りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６
愛称：みつぼしフライト２０１９－０６

運用報告書（全体版）

第１期（決算日　2020年５月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６」は、2020年５月15日に第１期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	単位型投信／内外／資産複合	
信託期間	2019年６月10日から2029年５月15日まで	
運用方針	主として以下の各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等への分散投資を行い、安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	りそな・リスクコントロールファンド2019－06	以下の各マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	・東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている株式
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている先進国株式等（日本の株式を除きます。以下同じ。） ・先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている新興国株式等 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	・ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
	ＲＡＭマネーマザーファンド	・国内の公社債
主な投資制限	りそな・リスクコントロールファンド2019－06	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	ＲＡＭマネーマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、元本超過額または経費控除後の配当等収益のうちいずれか多い額を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

＜照会先＞
りそなアセットマネジメント株式会社
東京都江東区木場１丁目５番65号
電話番号：0120-223351
（委託会社の営業日の午前９時～午後５時）
ホームページ：https://www.resona-am.co.jp/

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額				受益者利回り	株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	元本残存率
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落額	期中騰落率						
(設定日)	円	円	円	%	%	%	%	%	%	%
2019年６月10日	10,000	－	－	－	－	－	－	－	－	100.0
1期(2020年５月15日)	9,690	0	△310	△3.1	△3.3	2.1	0.9	57.4	0.8	82.5

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。また、株式先物比率には不動産投信指数先物比率を含めて表示しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

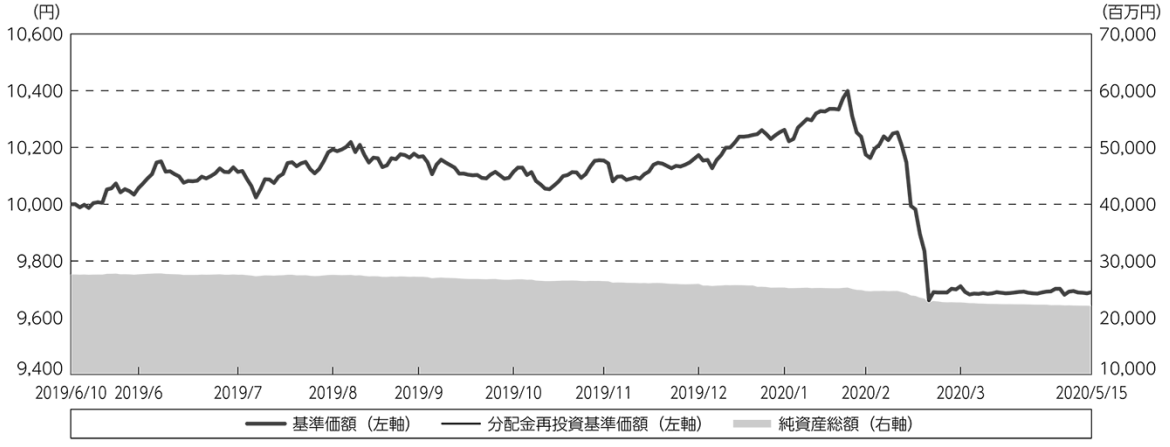
年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率				
(設定日)	円	%	%	%	%	%
2019年６月10日	10,000	－	－	－	－	－
６月末	10,057	0.6	13.9	1.5	79.4	4.2
７月末	10,114	1.1	17.8	3.0	72.6	5.6
８月末	10,193	1.9	12.1	1.9	79.8	3.8
９月末	10,167	1.7	16.2	3.1	75.1	5.3
10月末	10,114	1.1	15.4	5.1	76.4	5.1
11月末	10,154	1.5	18.0	3.4	72.3	5.7
12月末	10,173	1.7	17.2	4.9	71.4	5.9
2020年１月末	10,262	2.6	17.4	5.1	70.2	6.1
２月末	10,175	1.8	11.0	2.3	82.4	3.6
３月末	9,711	△2.9	2.4	0.8	62.6	0.8
４月末	9,702	△3.0	1.5	0.6	53.2	0.5
(期　末)						
2020年５月15日	9,690	△3.1	2.1	0.9	57.4	0.8

(注) 騰落率は設定日比です。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。また、株式先物比率には不動産投信指数先物比率を含めて表示しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2019年６月10日～2020年５月15日）

期中の基準価額等の推移



設定時：10,000円
期　末：9,690円（既払分配金(税引前)：0円）
騰落率：△ 3.1%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。なお、当ファンドは単位型投信であり、実際には分配金は再投資されませんのでご留意ください。
（注）上記騰落率は、小数点以下第２位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

各マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は設定時10,000円から当期末9,690円となり、310円の値下がりとなりました。先進国債券（為替ヘッジあり）が基準価額の主な値上がり要因となった一方、先進国株式が基準価額の主な値下がり要因となりました。

投資対象とする資産の設定来の値動きは、国内債券および先進国債券（為替ヘッジあり）が上昇した一方、そのほかのすべての資産は下落しました。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、設定時と比較して小幅上昇（価格は下落）しました。設定以降、2019年８月頃までの期間中は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念から、長期金利は低下（債券価格は上昇）基調となりました。ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による利下げ等を受け、国内長期金利にも一層の低下圧力がかかりましたが、９月頃からは世界的な製造業の調整一巡を反映し、上昇に転じました。2020年２月頃からは新型肺炎問題による世界経済への影響が懸念され、投資家のリスク回避の動きに伴う債券買いや各国中央銀行の緊急利下げが見られた一方、各国政府による経済対策期待や投資家の現金化需要等による債券売りも交錯し、国内長期金利は変動率の高い展開となりました。その後、金融市場が落ち着きを取り戻すなか、日銀による資金繰り支援策を中心に金融緩和策の強化決定などを受けて、国内長期金利は０％前後で推移しました。

先進国債券市況

先進国金利は、設定時と比較して米欧ともに長期金利は低下しました。米長期金利は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念から低下基調となり、その後ＦＲＢが約10年半ぶりに利下げを行ったことも加わり長期金利には一層の低下圧力がかかりました。欧州の長期金利も、ＥＣＢ（欧州中央銀行）による緩和観測からドイツをはじめ各国で大幅に低下しました。2020年２月以降は新型肺炎問題の世界的拡大に伴い、投資家のリスク回避の動きに伴う債券買いと現金化需要等による債券売りが交錯し、変動率の高い展開となる中、各国中央銀行による緊急利下げの決定等を受けて、先進国金利の水準は大きく低下しました。その後、ＦＲＢやＥＣＢが金融緩和政策の一環で国債購入を進めたことや、実体経済の回復ペースが鈍化するとの見方が強まり、先進国金利の上昇は抑制されました。

国内株式市況

国内株式市場は、設定時と比較して下落しました。設定当初は米中貿易摩擦問題を巡る両国間の交渉進展やＦＲＢの利下げ観測の高まりから緩やかに上昇しましたが、世界的な景気の先行きの不透明感が再燃すると不安定な動きとなりました。また2020年２月以降は、新型肺炎問題による景気・経済活動への影響が懸念され、国内株式市場は急速に下落しました。３月下旬以降、各国の大規模な経済政策や金融政策期待等で反発の動きも見られましたが、４月上旬に政府より緊急事態宣言が発令されるなど、経済活動の停滞や国内景気の冷え込みも懸念され、その動きは限定的なものに止まりました。

先進国株式市況

先進国株式市場は、設定時と比較して下落しました。設定当初は米中貿易摩擦問題を巡る両国間の交渉進展やＦＲＢの利下げ観測の高まりから上昇しましたが、その後は米中貿易摩擦の激化懸念などから不安定な動きとなりました。2019年９月から10月頃より世界景気の底入れ期待と主要国の金融緩和策を背景に上昇基調となる場面も見られましたが、2020年２月以降は新型肺炎の世界的な拡大に伴う世界経済・金融市場への悪影響が懸念され、急速に下落しました。３月下旬以降、各国の大規模な経済政策や金融政策期待等で反発の動きも見られ、また厳しい移動制限や営業停止などに代表される感染拡大防止施策の段階的解除計画も発表当初は好感されましたが、反発の動きは限定的なものに止まりました。

新興国株式市況

新興国株式市場は、設定時と比較して下落しました。設定当初は米中貿易摩擦問題を巡る両国間の交渉進展やＦＲＢの利下げ観測の高まりから上昇しましたが、その後は米中貿易摩擦の激化懸念などから不安定な動きとなりました。2019年９月から10月頃より世界景気の底入れ期待と主要国の金融緩和策を背景に上昇基調となる場面も見られましたが、2020年２月以降は新型肺炎の世界的な拡大に伴う世界経済・金融市場への悪影響が懸念され、急速に下落しました。３月下旬以降、先進国の政府・中央銀行の政策に対する期待や中国の新型肺炎新規感染者数の鈍化を受けて反発する動きも見られましたが、新型肺炎問題による世界的な先行きの不透明感や、景気悪化による一部商品市況の値崩れが資源輸出国の経済にとってさらなる逆風となる可能性が意識され、その動きは限定的なものに止まりました。

新興国債券市況

新興国金利は、設定時と比較して、多くの国で長期金利は低下しました。米国の金融政策が緩和姿勢に転じたことから多くの国で利下げが実施され、新興国金利は低下基調で推移しました。他方、2020年２月以降は新型肺炎問題の世界的拡大を受けて各国中央銀行が緊急利下げなどを行ったものの、経済基盤が脆弱な国からの資金流出が相次いだことから、新興国金利は急速に上昇に転じ、それまでに発生した金利の下げ幅が縮小する動きも見られました。その後、米ドルに対して急速に進んだ通貨安の一服を受けて、一部では新興国債券の買い戻しの動きも見られましたが、新型肺炎問題による世界的な先行きの不透明感に加え、南アフリカやメキシコなど一部新興国の国債格付が引き下げられたことが悪材料となり、その動きは限定的なものに止まりました。

国内リート市況

国内リート市場は、設定時と比較して下落しました。国内外の長期金利がマイナス圏まで低下するなか、国内長期金利や株式の配当利回りに比べて相対的に高い分配金利回りを求める投資資金の流入が続き、上昇基調で推移しました。しかし、2019年10月から11月頃より国内長期金利の上下に伴い一進一退の動きが見られたほか、2020年２月以降は、新型肺炎問題の拡大を受け、リートの収益に対する先行きの不透明感が高まり、リートを売却し現金化する動きが強まったことから大幅に下落しました。その後、日銀による国内リートの資産買入目標が倍増されるなど市場の下支え要因もありましたが、新型肺炎問題による収益への影響については依然として先行きの不透明感が強く、反発の動きは限定的なものに止まりました。

先進国リート市況

先進国リート市場は、設定時と比較して下落しました。設定当初、ＦＲＢによる利下げ観測の高まりなどを受け上昇基調で推移しましたが、米中貿易摩擦問題が再燃すると不安定な動きとなりました。2020年２月以降は新型肺炎問題の世界的拡大を受け、リートの収益に対する先行きの不透明感が急速に高まり売り圧力が強まったことから大幅に下落しました。その後も、新型肺炎問題やリートの収益に対する見通しに大きな変化が見られなかったことから、先進国リート市場は上値を抑えられた推移となりました。

為替市況

設定時と比較して、円は米ドル・ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、設定当初よりＦＲＢの金融緩和観測が広がるにつれ米ドルが売られ、円高が進行しました。その後米国の緩和的な金融政策が当面据え置かれるとの見方を背景に、緩やかに円安が進行する場面も見られましたが、2020年２月以降は新型肺炎問題を受けて、ＦＲＢによる緊急利下げや投資家のリスク回避の動きが円高圧力となる一方、企業や金融機関が米ドルを確保する動きが円安圧力となり、円は対米ドルで乱高下しました。その後、金融市場が徐々に落ち着きを取り戻すなかで、ＦＲＢのさらなる金融緩和策の一つとしてマイナス金利導入に対する市場の期待が一時的に高まる場面もみられ、円高基調で推移しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標、イギリスのＥＵ（欧州連合）離脱問題、および新型肺炎問題等を背景に、運用期間中を通じて円高基調で推移しました。

新興国通貨は、設定時と比較して多くの通貨が米ドル・円に対して下落しました。米国の利下げ観測の高まりを背景に多くの新興国で利下げが実施されたことに加え、2020年２月以降、新型肺炎問題を受け緊急利下げを行った国が相次いだことや、リスク回避のために米ドルを確保する投資家等の動きが強まったことから、新興国通貨安が急速に進みました。その後、金融市場が落ち着きを取り戻すなか新興国通貨が買い戻される動きも部分的にはみられましたが、ブラジルレアルなどの一部通貨安は止まらず、新興国への資金流入は限定的なものにとどまりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは、主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）などへの分散投資を行い、中長期的に信託財産の着実な成長を目指して運用を行いました。

各マザーファンド受益証券への投資は、投資環境を定量的に分析し、安定性重視資産（国内債券・先進国債券（為替ヘッジあり））および成長性重視資産（国内株式・先進国株式・新興国株式・新興国債券・国内リート・先進国リート）の配分比率を機動的に変更し、運用リスクのコントロールを行いました。安定性重視資産と成長性重視資産の配分比率の割合は、70%：30%程度から90%：10%程度の範囲内で変更しました。

設定以降、世界的に株式市場のボラティリティ（価格変動性）が低位に落ち着くなか、2019年７月にかけて成長性重視資産の配分比率を高位とするポートフォリオを構築しました。

８月には米中貿易摩擦問題の再燃が懸念されるなか、投資環境分析における米欧小型株指標が軟調な推移を示したことから成長性重視資産の配分比率を中位まで引き下げたものの、９月以降は世界的に株式市場のボラティリティが低位に推移し、米欧小型株指標も堅調に推移するなか、定量分析の結果、成長性重視資産の配分比率引き上げの示唆が得られたことから、11月にかけて高位に引き上げました。12月末から翌2020年２月においても、先進国株式市場が底堅く推移したことや先進国債券市場が堅調に推移するなか、成長性重視資産の配分比率を高位に維持した運用を行いました。

しかし２月中旬以降、新型肺炎の世界的な感染拡大が観測されるようになり、世界景気の後退懸念を背景に国内外の株式市場が大幅下落を続けたことから、成長性重視資産の配分比率を引き下げました。

３月以降も新型肺炎の感染拡大が続き、平常時は安定的な価格推移が見込まれる先進国の国債においても大きく売り越される環境下、基準価額が『確保ライン』に近づいたことから、安定性重視資産および成長性重視資産双方への投資割合を引き下げ、実質的にキャッシュ等（残存期間の短い国内の公社債等）への投資を行い価格変動性の低い資産への投資割合を増やしました。

３月下旬以降、先進国各国における緩和的な金融政策および財政政策が相次いで発表され、４月には一部先

進国にて新型肺炎感染者数の拡大ペースが鈍化したことなどから、経済活動の正常化期待が高まり、内外株式市場は２月以降の下落を一部取り戻す動きが観測されました。このように金融市場の価格形成機能が正常状態に回帰していくなか、基準価額の推移にあわせキャッシュ等への投資割合の引き下げを順次行ったほか、５月にはキャッシュ等への投資割合引き下げと同時に、小幅ながら成長性重視資産の配分比率の引き上げを行いました。

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

国内の債券を主要投資対象とし、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

日本を除く先進国の債券を主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。また、ベンチマークとの連動性を高めるため、投資対象資産の通貨は対円で為替ヘッジ（為替の売り予約）を行いました。

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

日本を除く先進国の株式を主要投資対象とし、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

新興国の株式を主要投資対象とし、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、ＥＴＦ（上場投資信託証券）を活用して運用を行いました。ＥＴＦ（上場投資信託証券）への投資を通じて実質債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

日本を除く先進国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

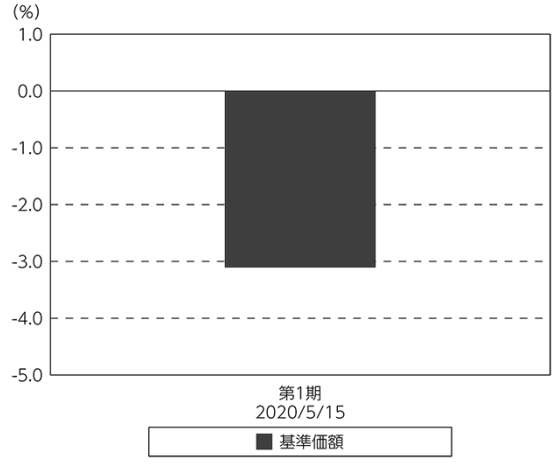
ＲＡＭマネーマザーファンド

国内の公社債を主要投資対象とし、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して残存期間の短い国内の公社債へ投資することによりポートフォリオを構築しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

基準価額（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して、見送りとさせていただきました。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

○今後の運用方針

引き続き、投資環境を定量的に分析し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して、安定性重視資産および成長性重視資産の配分比率を機動的に変更する運用を行います。また、基準価額が『確保ライン』に近づいた場合は、安定性重視資産および成長性重視資産双方への投資割合を引き下げ、実質的にキャッシュ等への投資を行い価格変動性の低い資産への投資割合を増やすことで、ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した『確保ライン』を上回る水準で運用を継続することを目指します。

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

引き続き、主としてＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

引き続き、主としてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）を行います。

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

引き続き、主として東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

引き続き、主としてＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている日本を除く先進国の株式に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

引き続き、主としてＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

引き続き、主としてＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）との連動性を高めるため、新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）を活用しながら運用を行う方針です。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

引き続き、主として東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

引き続き、主としてＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券および不動産関連株式に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

ＲＡＭマネーマザーファンド

引き続き、残存期間の短い国内の公社債へ投資し、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年６月10日～2020年５月15日）

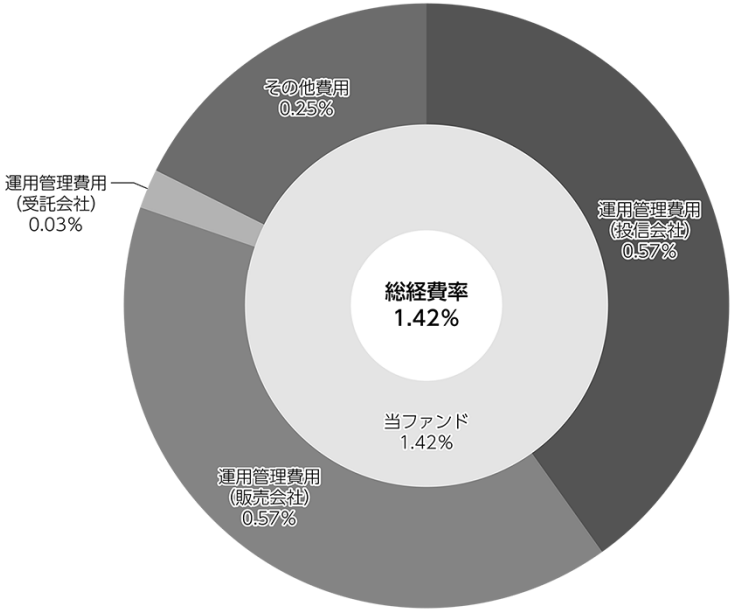
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	109	1.085	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(53)	(0.527)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(53)	(0.527)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(3)	(0.031)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	1	0.008	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.003)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.002)	
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
(c) 有価証券取引税	0	0.005	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.004)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	23	0.232	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.019)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(1)	(0.009)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（保証料）	(20)	(0.201)	保証料は、保証契約に係る費用
（その他）	(0)	(0.004)	その他は、権利・配当にかかる税金及びその払戻し、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	133	1.330	
期中の平均基準価額は、10,074円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

◯総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（１口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.42％です。



（注）当ファンドの費用は１万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
（注）各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
（注）各比率は、年率換算した値です。
（注）当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。
（注）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

（2019年６月10日～2020年５月15日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ＲＡＭ国内株式マザーファンド	1,513,176	1,642,550	1,431,340	1,496,244
ＲＡＭ国内リートマザーファンド	637,143	842,944	598,745	763,511
ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	7,914,781	9,866,787	7,486,975	9,034,963
ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	1,344,285	1,652,973	1,266,876	1,499,602
ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	1,554,098	1,707,274	1,454,095	1,522,886
ＲＡＭ国内債券マザーファンド	8,750,104	9,319,052	7,655,701	8,105,411
ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	745,372	798,888	701,209	733,791
ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	36,116,719	37,131,561	31,732,209	32,831,690
ＲＡＭマネーマザーファンド	12,820,254	12,810,000	－	－

○株式売買比率

（2019年６月10日～2020年５月15日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期			
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	62,997,506千円	25,971,722千円	5,339,966千円	950千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	30,824,849千円	31,910,280千円	5,806,995千円	61千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	2.04	0.81	0.91	15.44

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

（2019年６月10日～2020年５月15日）

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

＜ＲＡＭ国内株式マザーファンド＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	60	59	33

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社りそなホールディングス、株式会社関西みらいフィナンシャルグループです。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年６月10日～2020年５月15日）

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況（2019年６月10日～2020年５月15日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細（2020年５月15日現在）

親投資信託残高

銘柄	当期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ＲＡＭ国内株式マザーファンド	81,836	84,274
ＲＡＭ国内リートマザーファンド	38,398	40,782
ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	427,805	501,516
ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	77,409	85,003
ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	100,003	81,292
ＲＡＭ国内債券マザーファンド	1,094,403	1,155,580
ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	44,163	42,639
ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	4,384,509	4,651,088
ＲＡＭマネーマザーファンド	12,820,254	12,802,305

○投資信託財産の構成

（2020年５月15日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ＲＡＭ国内株式マザーファンド	84,274	0.4
ＲＡＭ国内リートマザーファンド	40,782	0.2
ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	501,516	2.3
ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	85,003	0.4
ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	81,292	0.4
ＲＡＭ国内債券マザーファンド	1,155,580	5.2
ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	42,639	0.2
ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	4,651,088	20.9
ＲＡＭマネーマザーファンド	12,802,305	57.5
コール・ローン等、その他	2,819,684	12.5
投資信託財産総額	22,264,163	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

（注）ＲＡＭ先進国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（40,898,835千円）の投資信託財産総額（40,987,966千円）に対する比率は99.8％です。

（注）ＲＡＭ新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（6,251,270千円）の投資信託財産総額（6,391,160千円）に対する比率は97.8％です。

（注）ＲＡＭ先進国リートマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（11,457,797千円）の投資信託財産総額（11,527,827千円）に対する比率は99.4％です。

（注）ＲＡＭ新興国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（3,965,581千円）の投資信託財産総額（4,056,996千円）に対する比率は97.7％です。

（注）ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）において、当期末における外貨建純資産（135,609,570千円）の投資信託財産総額（141,611,631千円）に対する比率は95.8％です。

（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=107.43円、1カナダドル=76.50円、1メキシコペソ=4.49円、1ブラジルレアル=18.47円、1チリペソ=0.1308円、1コロンビアペソ=0.0272円、1ユーロ=116.08円、1英ポンド=131.33円、1スイスフラン=110.35円、1スウェーデンクローナ=10.97円、1ノルウェークローネ=10.59円、1デンマーククローネ=15.57円、1トルコリラ=15.51円、1チェココルナ=4.20円、1ハンガリーフォリント=0.3277円、1ポーランドズロチ=25.46円、1オーストラリアドル=69.45円、1ニュージーランドドル=64.55円、1香港ドル=13.86円、1シンガポールドル=75.47円、1マレーシアリンギット=24.72円、1タイバーツ=3.35円、1フィリピンペソ=2.13円、1インドネシアルピア=0.0073円、1韓国ウォン=0.0876円、1新台湾ドル=3.59円、1オフショア人民元=15.10円、1インドルピー=1.43円、1イスラエルシュケル=30.32円、1カタールリアル=29.38円、1南アフリカランド=5.82円、1アラブディルハム=29.30円、1サウジアラビアリアル=28.64円。

○特定資産の価格等の調査

（2019年６月10日～2020年５月15日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年５月15日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	22,264,163,214
コール・ローン等	2,819,678,418
ＲＡＭ国内株式マザーファンド(評価額)	84,274,768
ＲＡＭ国内リートマザーファンド(評価額)	40,782,525
ＲＡＭ先進国株式マザーファンド(評価額)	501,516,789
ＲＡＭ新興国株式マザーファンド(評価額)	85,003,584
ＲＡＭ先進国リートマザーファンド(評価額)	81,292,583
ＲＡＭ国内債券マザーファンド(評価額)	1,155,580,875
ＲＡＭ新興国債券マザーファンド(評価額)	42,639,668
ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）(評価額)	4,651,088,157
ＲＡＭマネーマザーファンド(評価額)	12,802,305,847
(B) 負債	178,486,915
未払解約金	47,946,000
未払信託報酬	106,874,286
未払利息	7,647
その他未払費用	23,658,982
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	22,085,676,299
元本	22,793,111,107
次期繰越損益金	△ 707,434,808
(D) 受益権総口数	22,793,111,107口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,690円

(注) 当ファンドの設定元本額は27,612,309,231円、期末における元本残存率は82.5％です。
(注) 当期末の１口当たり純資産額は0.9690円です。
(注) 2020年５月15日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は707,434,808円です。

○損益の状況 (2019年６月10日～2020年５月15日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 572,855
支払利息	△ 572,855
(B) 有価証券売買損益	△364,007,099
売買益	614,116,553
売買損	△978,123,652
(C) 有価証券評価差損益	24,564,886
(D) 信託報酬等	△334,767,936
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△674,783,004
(F) 解約差損益金	△ 32,651,804
(G) 計(Ｅ＋Ｆ)	△707,434,808
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	△707,434,808

(注) 損益の状況の中で(D)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注) 損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注) 計算期間末における当ファンドの配当等収益額（△572,855円）に親ファンドの配当等収益額（390,083,023円）を加えた配当等収益合計額（389,510,168円）から経費（334,767,936円）を控除した額（54,742,232円）に、期末の受益権口数（22,793,111,107口）を乗じて期中の平均受益権口数（25,309,743,779口）で除することにより分配可能額は(49,299,028円)（１万口当たり21円）ですが、当期に分配した金額はありません。
(注) なお、親ファンドの配当等収益額の内訳は、ＲＡＭ国内株式マザーファンド9,833,420円、ＲＡＭ国内リートマザーファンド9,155,046円、ＲＡＭ先進国株式マザーファンド44,130,427円、ＲＡＭ新興国株式マザーファンド9,525,772円、ＲＡＭ先進国リートマザーファンド16,938,343円、ＲＡＭ国内債券マザーファンド25,035,529円、ＲＡＭ新興国債券マザーファンド16,107,802円、ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）259,835,264円、ＲＡＭマネーマザーファンド△478,580円です。

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	0円

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
主 要 投 資 対 象	・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券
主 な 投 資 制 限	・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は、行いません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
(設定日)	円	%		%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	367.259	－	－	195
１期(2017年１月25日)	10,300	3.0	378.473	3.1	99.5	15,275
２期(2018年１月25日)	10,328	0.3	379.684	0.3	99.3	46,026
３期(2019年１月25日)	10,483	1.5	385.440	1.5	99.7	64,555
４期(2020年１月27日)	10,645	1.5	391.374	1.5	99.3	80,324

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
(注) 「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合」は、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。野村證券株式会社は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合		債券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2019年１月25日	10,483	－	385.440	－	99.7
１月末	10,488	0.0	385.580	0.0	99.6
２月末	10,509	0.2	386.427	0.3	99.6
３月末	10,583	1.0	389.143	1.0	99.6
４月末	10,549	0.6	387.945	0.6	99.5
５月末	10,615	1.3	390.322	1.3	99.6
６月末	10,679	1.9	392.695	1.9	99.7
７月末	10,691	2.0	393.155	2.0	99.6
８月末	10,834	3.3	398.496	3.4	99.5
９月末	10,719	2.3	394.271	2.3	99.4
10月末	10,677	1.9	392.608	1.9	99.8
11月末	10,640	1.5	391.325	1.5	99.1
12月末	10,609	1.2	390.136	1.2	99.4
(期末)					
2020年１月27日	10,645	1.5	391.374	1.5	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

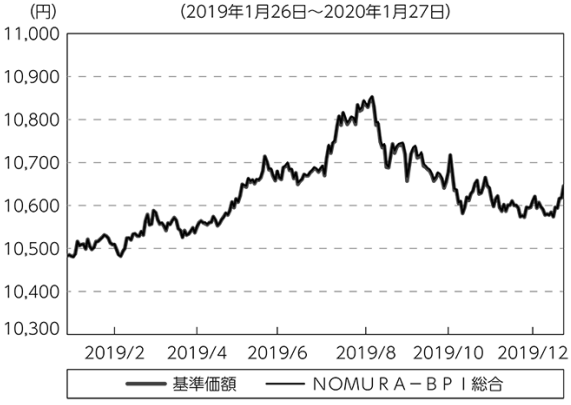
期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,483円から当期末10,645円となり、162円の値上がりとなりました。

国内債券の市況（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合）の上昇により、基準価額は上昇しました。

基準価額等の推移



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、前期末と比較して横ばいでした。期の前半は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念からリスク回避の姿勢が強まり、長期金利は低下（債券価格は上昇）基調となりました。期の後半はＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による利下げ等を受け世界的に金利が低下し、国内長期金利にも一層の低下圧力がかかりました。期末にかけては、世界的な製造業の調整一巡を反映し、国内長期金利は上昇基調に転じました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の債券を主要投資対象とし、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

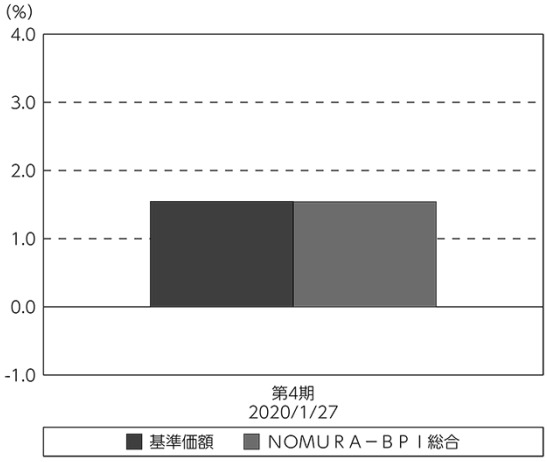
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋1.5%となり、ベンチマークの＋1.5%とほぼ同水準となりました。

（マイナス要因）
・コスト負担（債券等に係る取引費用）が生じたこと

（その他の要因）
・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	0	0.000	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,632円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	49,598,015	36,119,092
	地方債証券	842,833	201,623
	特殊債券	779,021	501,953 （ 77,221）
	社債券（投資法人債券を含む）	799,610	301,806

（注）金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
（注）（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
（注）社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	61,478,000	67,879,350	84.5	－	55.6	19.4	9.5
	(　580,000)	(　629,939)	(0.8)	(－)	(0.8)	(　－)	(　－)
地方債証券	4,130,000	4,251,702	5.3	－	3.4	1.9	－
	(4,130,000)	(4,251,702)	(5.3)	(－)	(3.4)	(1.9)	(　－)
特殊債券（除く金融債）	4,145,866	4,312,593	5.4	－	3.9	1.1	0.4
	(4,145,866)	(4,312,593)	(5.4)	(－)	(3.9)	(1.1)	(0.4)
金融債券	200,000	200,502	0.2	－	－	0.2	－
	(　200,000)	(　200,502)	(0.2)	(－)	(　－)	(0.2)	(　－)
普通社債券（含む投資法人債券）	3,100,000	3,135,485	3.9	－	1.6	1.8	0.5
	(3,100,000)	(3,135,485)	(3.9)	(－)	(1.6)	(1.8)	(0.5)
合計	73,053,866	79,779,633	99.3	－	64.4	24.5	10.4
	(12,155,866)	(12,530,222)	(15.6)	(－)	(9.7)	(5.0)	(0.9)

（注）（　）内は非上場債で内書きです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）格付のない債券については、ＢＢ格以下組入比率に含まれておりません。

(Ｂ)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第397回利付国債（２年）	0.1	200,000	200,496	2021/２/１
第398回利付国債（２年）	0.1	200,000	200,532	2021/３/１
第399回利付国債（２年）	0.1	240,000	240,688	2021/４/１
第400回利付国債（２年）	0.1	160,000	160,491	2021/５/１
第401回利付国債（２年）	0.1	200,000	200,656	2021/６/１
第402回利付国債（２年）	0.1	500,000	501,745	2021/７/１
第403回利付国債（２年）	0.1	130,000	130,479	2021/８/１
第404回利付国債（２年）	0.1	170,000	170,663	2021/９/１
第405回利付国債（２年）	0.1	380,000	381,561	2021/10/１
第406回利付国債（２年）	0.1	330,000	331,425	2021/11/１
第407回利付国債（２年）	0.1	200,000	200,904	2021/12/１
第136回利付国債（５年）	0.1	550,000	554,873	2023/６/20
第137回利付国債（５年）	0.1	740,000	747,044	2023/９/20
第138回利付国債（５年）	0.1	880,000	888,958	2023/12/20
第139回利付国債（５年）	0.1	700,000	707,434	2024/３/20
第140回利付国債（５年）	0.1	740,000	748,177	2024/６/20
第141回利付国債（５年）	0.1	730,000	738,358	2024/９/20
第127回利付国債（５年）	0.1	350,000	350,976	2021/３/20
第128回利付国債（５年）	0.1	470,000	471,602	2021/６/20
第129回利付国債（５年）	0.1	450,000	451,813	2021/９/20
第130回利付国債（５年）	0.1	560,000	562,604	2021/12/20
第131回利付国債（５年）	0.1	510,000	512,733	2022/３/20
第132回利付国債（５年）	0.1	630,000	633,855	2022/６/20
第133回利付国債（５年）	0.1	890,000	896,141	2022/９/20
第134回利付国債（５年）	0.1	970,000	977,323	2022/12/20
第135回利付国債（５年）	0.1	620,000	625,084	2023/３/20
第１回利付国債（40年）	2.4	40,000	61,958	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	70,000	105,639	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	110,000	167,305	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	130,000	199,773	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	170,000	253,599	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	170,000	250,478	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	160,000	227,256	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	180,000	239,889	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	300,000	300,948	2056/３/20
第10回利付国債（40年）	0.9	280,000	328,991	2057/３/20
第11回利付国債（40年）	0.8	210,000	239,780	2058/３/20
第12回利付国債（40年）	0.5	140,000	144,982	2059/３/20
第313回利付国債（10年）	1.3	320,000	325,257	2021/３/20
第314回利付国債（10年）	1.1	130,000	131,839	2021/３/20
第315回利付国債（10年）	1.2	295,000	300,510	2021/６/20
第316回利付国債（10年）	1.1	300,000	305,187	2021/６/20
第317回利付国債（10年）	1.1	460,000	469,397	2021/９/20
第318回利付国債（10年）	1.0	366,000	372,873	2021/９/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第319回利付国債（10年）	1.1	140,000	143,294	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	352,000	359,613	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	391,000	400,606	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	220,000	224,932	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	340,000	348,568	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	183,000	187,172	2022/6/20
第325回利付国債（10年）	0.8	470,000	481,848	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	280,000	286,955	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	387,000	397,739	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	461,000	471,981	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	477,000	492,531	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	257,000	265,992	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	90,000	92,489	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	312,000	321,225	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	445,000	458,995	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	421,000	435,052	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	175,000	180,360	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	180,000	185,812	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	340,000	347,626	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	741,000	762,303	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	335,000	345,106	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	674,000	695,291	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	370,000	380,012	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	220,000	223,476	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	610,000	619,839	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	750,000	762,577	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	660,000	671,490	2026/12/20
第346回利付国債（10年）	0.1	470,000	478,304	2027/3/20
第347回利付国債（10年）	0.1	220,000	223,942	2027/6/20
第348回利付国債（10年）	0.1	440,000	447,986	2027/9/20
第349回利付国債（10年）	0.1	420,000	427,530	2027/12/20
第350回利付国債（10年）	0.1	560,000	569,889	2028/3/20
第351回利付国債（10年）	0.1	400,000	406,940	2028/6/20
第352回利付国債（10年）	0.1	380,000	386,456	2028/9/20
第353回利付国債（10年）	0.1	500,000	508,285	2028/12/20
第354回利付国債（10年）	0.1	470,000	477,567	2029/3/20
第355回利付国債（10年）	0.1	360,000	365,612	2029/6/20
第356回利付国債（10年）	0.1	720,000	730,814	2029/9/20
第１回利付国債（30年）	2.8	60,000	76,533	2029/9/20
第11回利付国債（30年）	1.7	10,000	12,186	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	40,000	51,042	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	90,000	113,899	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	20,000	26,524	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	100,000	134,527	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	70,000	94,451	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	110,000	147,342	2034/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第18回利付国債（30年）	2.3	120,000	159,372	2035/３/20
第19回利付国債（30年）	2.3	100,000	133,247	2035/６/20
第20回利付国債（30年）	2.5	60,000	82,053	2035/９/20
第21回利付国債（30年）	2.3	90,000	120,692	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	50,000	68,786	2036/３/20
第23回利付国債（30年）	2.5	160,000	220,859	2036/６/20
第24回利付国債（30年）	2.5	100,000	138,497	2036/９/20
第25回利付国債（30年）	2.3	100,000	135,646	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	225,000	309,852	2037/３/20
第27回利付国債（30年）	2.5	215,000	301,586	2037/９/20
第28回利付国債（30年）	2.5	150,000	211,687	2038/３/20
第29回利付国債（30年）	2.4	140,000	196,063	2038/９/20
第30回利付国債（30年）	2.3	190,000	264,037	2039/３/20
第31回利付国債（30年）	2.2	130,000	179,142	2039/９/20
第32回利付国債（30年）	2.3	215,000	302,115	2040/３/20
第33回利付国債（30年）	2.0	250,000	338,207	2040/９/20
第34回利付国債（30年）	2.2	275,000	384,989	2041/３/20
第35回利付国債（30年）	2.0	276,000	376,717	2041/９/20
第36回利付国債（30年）	2.0	255,000	349,717	2042/３/20
第37回利付国債（30年）	1.9	310,000	420,518	2042/９/20
第38回利付国債（30年）	1.8	170,000	227,886	2043/３/20
第39回利付国債（30年）	1.9	180,000	245,905	2043/６/20
第40回利付国債（30年）	1.8	165,000	222,093	2043/９/20
第41回利付国債（30年）	1.7	185,000	245,202	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	160,000	212,574	2044/３/20
第43回利付国債（30年）	1.7	190,000	252,755	2044/６/20
第44回利付国債（30年）	1.7	150,000	200,025	2044/９/20
第45回利付国債（30年）	1.5	210,000	270,249	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	210,000	270,488	2045/３/20
第47回利付国債（30年）	1.6	220,000	289,185	2045/６/20
第48回利付国債（30年）	1.4	203,000	257,089	2045/９/20
第49回利付国債（30年）	1.4	220,000	279,149	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	190,000	212,767	2046/３/20
第51回利付国債（30年）	0.3	240,000	238,250	2046/６/20
第52回利付国債（30年）	0.5	210,000	219,011	2046/９/20
第53回利付国債（30年）	0.6	240,000	256,322	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	230,000	257,567	2047/３/20
第55回利付国債（30年）	0.8	80,000	89,557	2047/６/20
第56回利付国債（30年）	0.8	180,000	201,430	2047/９/20
第57回利付国債（30年）	0.8	240,000	268,809	2047/12/20
第58回利付国債（30年）	0.8	380,000	425,436	2048/３/20
第59回利付国債（30年）	0.7	180,000	196,777	2048/６/20
第60回利付国債（30年）	0.9	210,000	241,008	2048/９/20
第61回利付国債（30年）	0.7	170,000	185,855	2048/12/20
第62回利付国債（30年）	0.5	200,000	207,658	2049/３/20
第63回利付国債（30年）	0.4	200,000	202,126	2049/６/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第64回利付国債（30年）	0.4	250,000	252,340	2049/9/20
第49回利付国債（20年）	2.1	30,000	30,772	2021/3/22
第50回利付国債（20年）	1.9	150,000	153,517	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	90,000	92,697	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	190,000	197,039	2021/9/21
第53回利付国債（20年）	2.1	20,000	20,852	2021/12/20
第54回利付国債（20年）	2.2	180,000	188,011	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	100,000	104,609	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	10,000	10,516	2022/6/20
第57回利付国債（20年）	1.9	110,000	115,412	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	100,000	105,455	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	40,000	42,162	2022/12/20
第60回利付国債（20年）	1.4	30,000	31,360	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	50,000	51,830	2023/3/20
第62回利付国債（20年）	0.8	80,000	82,618	2023/6/20
第63回利付国債（20年）	1.8	60,000	64,010	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	120,000	129,060	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	380,000	410,582	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	20,000	21,712	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	90,000	98,830	2024/3/20
第69回利付国債（20年）	2.1	60,000	65,637	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	110,000	122,400	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	100,000	110,389	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	210,000	232,094	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	180,000	199,076	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	100,000	111,654	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	100,000	110,618	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	20,000	22,227	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	50,000	55,571	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	20,000	22,337	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	180,000	202,014	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	30,000	33,671	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	170,000	191,771	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	10,000	11,337	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	120,000	135,339	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	150,000	170,913	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	100,000	115,182	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	90,000	103,105	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	185,000	214,250	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	120,000	138,199	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	90,000	104,193	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	10,000	11,644	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	215,000	248,692	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	90,000	103,926	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	90,000	104,576	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	185,000	218,714	2027/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第96回利付国債（20年）	2.1	70,000	81,711	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	130,000	153,384	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	70,000	82,051	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	205,000	241,264	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	151,000	179,647	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	20,000	24,123	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	145,000	175,676	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	20,000	24,062	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	10,000	11,861	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	132,000	157,182	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	40,000	47,979	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	280,000	334,670	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	130,000	153,054	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	180,000	212,617	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	115,000	137,954	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	200,000	242,690	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	205,000	246,822	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	155,000	187,384	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	260,000	315,419	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	100,000	122,309	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	140,000	171,927	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	215,000	261,842	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	231,000	280,027	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	60,000	71,482	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	140,000	163,872	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	165,000	198,897	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	150,000	179,214	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	285,000	350,957	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	150,000	183,078	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	120,000	149,575	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	100,000	122,415	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	50,000	60,650	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	285,000	346,685	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	70,000	84,353	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	230,000	278,042	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	120,000	143,668	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	160,000	192,120	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	245,000	297,094	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	155,000	188,411	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	40,000	48,138	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	80,000	95,307	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	110,000	132,678	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	160,000	189,036	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	160,000	191,012	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	340,000	411,260	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	195,000	236,519	2032/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第142回利付国債（20年）	1.8	170,000	208,377	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	315,000	378,733	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	140,000	166,499	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	395,000	481,378	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	320,000	391,020	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	355,000	429,731	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	385,000	461,757	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	370,000	444,751	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	440,000	523,305	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	345,000	400,983	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	330,000	383,849	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	320,000	377,635	2035/6/20
第154回利付国債（20年）	1.2	348,000	406,022	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	370,000	420,449	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	340,000	353,950	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	270,000	272,157	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	280,000	295,912	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	300,000	321,975	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	210,000	228,916	2037/3/20
第161回利付国債（20年）	0.6	340,000	364,694	2037/6/20
第162回利付国債（20年）	0.6	220,000	236,002	2037/9/20
第163回利付国債（20年）	0.6	270,000	289,656	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	390,000	411,196	2038/3/20
第165回利付国債（20年）	0.5	280,000	295,162	2038/6/20
第166回利付国債（20年）	0.7	370,000	403,248	2038/9/20
第167回利付国債（20年）	0.5	320,000	336,860	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	270,000	278,923	2039/3/20
第169回利付国債（20年）	0.3	260,000	263,621	2039/6/20
第170回利付国債（20年）	0.3	420,000	425,523	2039/9/20
小計		61,478,000	67,879,350	
地方債証券				
第14回東京都公募公債	2.31	100,000	118,679	2028/3/17
第705回東京都公募公債	1.06	100,000	102,285	2022/3/18
第723回東京都公募公債	0.76	100,000	102,843	2023/9/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	102,936	2024/3/19
第746回東京都公募公債	0.499	100,000	102,717	2025/6/20
第761回東京都公募公債	0.075	100,000	100,471	2026/9/18
平成28年度第８回北海道公募公債	0.06	100,000	100,310	2026/10/28
平成29年度第６回北海道公募公債	0.01	100,000	100,049	2022/7/28
第211回神奈川県公募公債	0.438	100,000	102,240	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債	0.08	100,000	100,466	2026/3/19
第164回大阪府公募公債	0.001	100,000	100,092	2024/7/30
第376回大阪府公募公債	0.82	110,000	113,385	2023/9/27
第435回大阪府公募公債	0.2	100,000	101,412	2028/8/30
第451回大阪府公募公債	0.063	100,000	99,881	2029/12/26
平成27年度第13回京都府公募公債	0.11	100,000	100,649	2026/3/17

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
平成29年度第４回京都府公募公債	0.19	100,000	101,411	2027/６/21
平成29年度第１回兵庫県公募公債	0.187	100,000	101,299	2027/５/21
平成30年度第14回静岡県公募公債	0.15	100,000	100,974	2028/12/20
平成24年度第５回愛知県公募公債	0.886	100,000	102,175	2022/６/28
平成28年度第８回愛知県公募公債	0.065	100,000	100,401	2026/８/26
平成29年度第11回愛知県公募公債	0.225	100,000	101,731	2027/10/27
平成29年度第３回広島県公募公債	0.15	100,000	101,151	2027/９/27
平成30年度第１回広島県公募公債	0.2	100,000	101,494	2028/５/25
第８回埼玉県公募公債	2.19	100,000	120,353	2029/９/20
平成26年度第６回埼玉県公募公債	0.554	100,000	102,673	2024/９/26
平成27年度第１回福岡県公募公債	0.578	100,000	103,154	2025/６/26
平成29年度第６回千葉県公募公債	0.245	100,000	101,876	2028/１/25
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,204	2023/３/24
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	100,000	103,029	2023/６/23
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	103,005	2024/４/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,590	2026/３/25
第169回共同発行市場公募地方債	0.205	100,000	101,488	2027/４/23
平成27年度第１回静岡市公募公債	0.476	100,000	102,803	2025/11/25
第26回横浜市公募公債	1.776	100,000	120,664	2033/１/28
平成26年度第５回福岡市公募公債	0.539	100,000	102,652	2024/10/28
平成29年度第２回福岡市公募公債	0.01	100,000	100,057	2022/６/27
平成27年度第２回広島市公募公債	0.464	100,000	102,770	2025/12/25
平成29年度第３回千葉市公募公債	0.215	120,000	121,993	2027/12/28
平成29年度第１回鹿児島県公募公債	0.02	100,000	100,100	2022/10/31
平成29年度第５回福井県公募公債	0.19	100,000	101,440	2028/４/27
平成29年度第２回岡山県公募公債	0.235	100,000	101,799	2028/１/31
小計		4,130,000	4,251,702	
特殊債券(除く金融債)				
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.699	127,000	130,535	2023/10/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	100,000	102,451	2025/11/18
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	145,000	146,886	2027/６/14
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	113,000	115,163	2028/８/15
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	101,000	102,756	2021/４/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	114,000	117,504	2024/６/28
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	127,000	130,531	2024/９/30
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	102,543	2024/12/27
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.484	100,000	102,846	2025/６/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	133,000	135,884	2026/１/30
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	100,000	101,110	2027/１/29
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.16	100,000	101,582	2027/11/30
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	100,000	101,905	2028/２/29
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.12	100,000	101,281	2028/４/28
第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.45	100,000	102,514	2025/３/13
第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.209	100,000	101,937	2028/９/19
第31回国際協力機構債券	0.53	100,000	102,879	2025/９/19
第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	100,000	114,724	2026/３/19

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券（除く金融債）	%	千円	千円	
第27回道路債券	2.42	100,000	110,088	2024/３/20
第13回公営企業債券	2.16	100,000	111,496	2025/６/20
Ｆ82回地方公共団体金融機構債券	1.381	100,000	106,723	2024/11/20
Ｆ132回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	105,882	2025/７/30
Ｆ228回地方公共団体金融機構債券	1.269	100,000	112,325	2031/３/20
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	0.03	100,000	100,085	2022/３/11
第２回一般担保住宅金融公庫債券	2.54	100,000	115,900	2026/６/19
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	2.15	100,000	107,897	2023/９/20
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	120,444	2032/３/12
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	110,267	2027/９/17
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	90,172	91,793	2052/８/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	90,460	91,835	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	91,540	92,798	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	91,224	92,608	2053/１/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	94,350	95,585	2053/８/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	95,151	96,958	2053/10/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	99,371	99,207	2054/11/10
第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.16	74,423	74,433	2032/５/10
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.18	77,542	77,607	2032/５/10
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.16	81,633	82,002	2033/１/10
第36回東日本高速道路株式会社社債	0.06	100,000	100,076	2021/６/18
第39回東日本高速道路株式会社社債	0.03	100,000	100,066	2021/12/20
第29回西日本高速道路株式会社社債	0.31	100,000	101,478	2026/２/12
小計		4,145,866	4,312,593	
金融債券				
第327回信金中金債	0.06	100,000	100,123	2022/２/25
第340回信金中金債	0.11	100,000	100,379	2023/３/27
小計		200,000	200,502	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第521回関西電力株式会社社債	0.18	100,000	100,110	2023/９/20
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,242	2026/11/25
第１回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	0.2	100,000	99,518	2029/７/13
第1回コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス社債	0.1	100,000	99,958	2024/９/19
第12回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	100,000	100,020	2023/９/８
第３回株式会社電通無担保社債	0.424	100,000	101,545	2028/10/25
第12回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,448	2026/７/31
第12回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.02	100,000	99,834	2022/７/26
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	101,011	2029/４/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,875	2027/５/28
第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.361	100,000	100,467	2021/９/17
第12回株式会社小松製作所無担保社債	0.11	100,000	99,982	2024/６/６
第１回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	100,000	100,086	2021/８/２
第17回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債	0.535	100,000	100,774	2028/５/31
第124回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	1.51	100,000	101,793	2021/４/16
第147回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	0.89	100,000	102,962	2023/７/24
第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.1	100,000	99,689	2021/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.25	100,000	100,279	2024/9/13
第75回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,158	2025/1/23
第58回三井不動産株式会社無担保社債	0.1	100,000	99,988	2023/2/24
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,290	2027/6/18
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.757	100,000	102,724	2024/1/30
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.41	100,000	101,730	2026/1/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	115,029	2047/7/26
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	100,000	101,959	2023/3/20
第22回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,549	2028/7/12
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.43	100,000	100,630	2023/7/24
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.01	100,000	102,052	2029/7/10
第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	101,277	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	0.384	100,000	100,382	2024/10/11
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	100,000	100,124	2023/7/6
小計		3,100,000	3,135,485	
合計		73,053,866	79,779,633	

○投資信託財産の構成

(2020年１月27日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	79,779,633	98.8
コール・ローン等、その他	951,748	1.2
投資信託財産総額	80,731,381	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2019年１月26日～2020年１月27日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	80,731,381,445
コール・ローン等	403,345,874
公社債(評価額)	79,779,633,401
未収入金	392,459,500
未収利息	142,956,853
前払費用	12,985,817
(B) 負債	407,195,893
未払金	96,864,800
未払解約金	310,330,000
未払利息	1,093
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	80,324,185,552
元本	75,458,660,146
次期繰越損益金	4,865,525,406
(D) 受益権総口数	75,458,660,146口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,645円

(注) 当ファンドの期首元本額は61,581,519,887円、期中追加設定元本額は47,499,596,095円、期中一部解約元本額は33,622,455,836円です。

(注) 2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	40,338,229,354円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	6,168,912,518円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	5,763,205,997円
・りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	5,525,589,370円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	3,516,772,895円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	3,386,960,747円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,783,463,760円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	2,572,261,983円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	1,110,535,002円
・つみたてバランスファンド	1,065,663,362円
・ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	956,561,505円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	715,977,238円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	568,017,780円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	314,264,624円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	215,813,232円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	150,529,612円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	141,846,285円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	60,167,896円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	55,970,164円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	30,388,907円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	8,894,412円
・グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	5,637,595円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,491,674円
・りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	305,467円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	190,120円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	8,647円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.0645円です。

○損益の状況 (2019年１月26日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	585,596,831
受取利息	586,160,833
支払利息	△　564,002
(B) 有価証券売買損益	599,654,234
売買益	1,037,971,425
売買損	△　438,317,191
(C) 保管費用等	△　13,915
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	1,185,237,150
(E) 前期繰越損益金	2,973,881,315
(F) 追加信託差損益金	3,119,538,105
(G) 解約差損益金	△2,413,131,164
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	4,865,525,406
次期繰越損益金(Ｈ)	4,865,525,406

(注) 損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(F)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

運 用 報 告 書

第３期（決算日　2019年12月10日）
（2018年12月11日～2019年12月10日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2016年10月６日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主 要 投 資 対 象	・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券
主 な 投 資 制 限	・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率		
（設定日）	円	%		%	%	百万円
2016年10月６日	10,000	－	396.83	－	－	199
１期(2017年12月11日)	9,784	△2.2	387.33	△2.4	100.2	39,151
２期(2018年12月10日)	9,636	△1.5	381.92	△1.4	98.4	58,353
３期(2019年12月10日)	10,237	6.2	406.21	6.4	98.9	151,156

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
（注）FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）		債券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	
（期　首）	円	%		%	%
2018年12月10日	9,636	－	381.92	－	98.4
12月末	9,693	0.6	384.13	0.6	97.1
2019年１月末	9,734	1.0	385.88	1.0	98.0
２月末	9,723	0.9	385.50	0.9	100.4
３月末	9,903	2.8	392.62	2.8	98.2
４月末	9,836	2.1	389.98	2.1	98.5
５月末	9,976	3.5	395.72	3.6	96.4
６月末	10,144	5.3	401.98	5.3	98.8
７月末	10,184	5.7	403.79	5.7	98.7
８月末	10,495	8.9	416.34	9.0	96.9
９月末	10,419	8.1	413.28	8.2	99.9
10月末	10,288	6.8	408.17	6.9	101.4
11月末	10,277	6.7	407.93	6.8	99.4
（期　末） 2019年12月10日	10,237	6.2	406.21	6.4	98.9

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2018年12月11日～2019年12月10日）

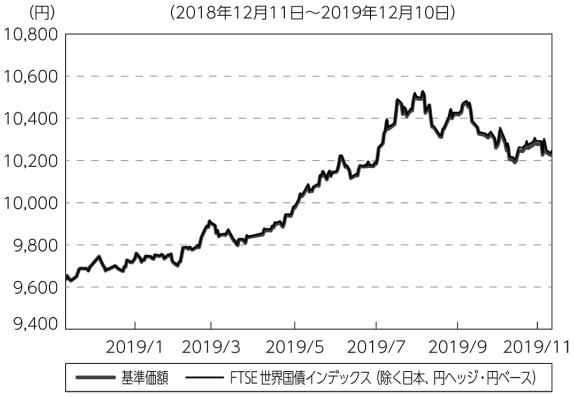
期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、前期末9,636円から当期末10,237円となり、601円の値上がりとなりました。

先進国債券の市況(FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース))の上昇により、基準価額は上昇しました。

基準価額等の推移
（2018年12月11日～2019年12月10日）



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

先進国債券市況

先進国金利は、前期末と比較して、米欧ともに長期金利は低下（債券価格は上昇）しました。米長期金利は、期の前半は米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念からリスク回避の姿勢が強まり、低下基調となりました。その後ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）の利下げ観測が高まり、期の後半に約10年半ぶりの利下げが決定すると、米長期金利は約３年ぶりの水準まで低下しました。欧州各国の長期金利は、欧州景気の先行き懸念からＥＣＢ（欧州中央銀行）の緩和観測が高まり、ドイツ長期金利がマイナス圏に転じるなど、期を通じて大幅に低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、ファンドの特性値（通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。また、ベンチマークとの連動性を高めるため、投資対象資産の通貨は対円で為替ヘッジ（為替の売り予約）を行いました。

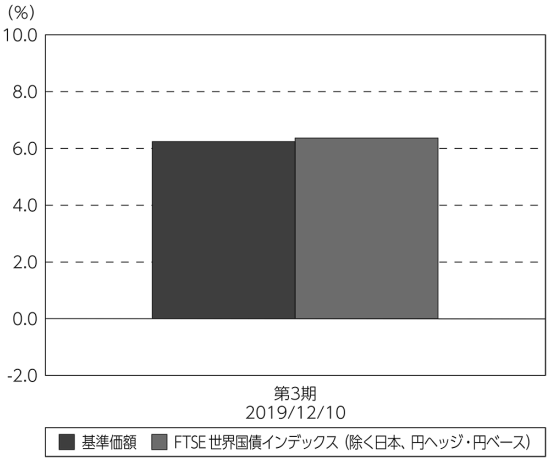
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋6.2%となり、ベンチマークの＋6.4%を0.1%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（債券等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと

（その他の要因）
・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ってまいります。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2018年12月11日～2019年12月10日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	2	0.018	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.017)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.001)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	2	0.018	
期中の平均基準価額は、10,056円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2018年12月11日～2019年12月10日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 598,724	千米ドル 186,197
	カナダ	国債証券	千カナダドル 31,908	千カナダドル 11,300
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 195,894	千メキシコペソ 55,195
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	71,620	24,382
	イタリア	国債証券	94,859	28,799
	フランス	国債証券	108,293	32,568
	オランダ	国債証券	18,643	5,025
	スペイン	国債証券	59,798	17,770
	ベルギー	国債証券	24,537	6,764
	オーストリア	国債証券	13,150	2,609
	フィンランド	国債証券	5,250	1,030
	アイルランド	国債証券	6,919	1,787
	イギリス	国債証券	千英ポンド 58,395	千英ポンド 18,427
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 32,954	千スウェーデンクローナ 3,042
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 21,061	千ノルウェークローネ 2,292
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 38,025	千デンマーククローネ 9,051
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 21,560	千ポーランドズロチ 3,979
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 33,588	千オーストラリアドル 10,248
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 6,424	千シンガポールドル 1,351
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 20,045	千マレーシアリンギット 3,863
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 88,753	千南アフリカランド 13,036

（注）金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2018年12月11日～2019年12月10日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2018年12月11日～2019年12月10日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2019年12月10日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	634,180	662,284	71,970,422	47.6	－	20.3	17.7	9.6
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	31,910	34,406	2,823,436	1.9	－	0.9	0.6	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	219,400	231,623	1,308,672	0.9	－	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	65,900	78,696	9,461,637	6.3	－	3.6	1.8	0.9
イタリア	96,210	110,069	13,233,611	8.8	－	5.2	2.6	1.0
フランス	101,350	122,309	14,705,275	9.7	－	6.5	2.4	0.8
オランダ	19,130	23,099	2,777,284	1.8	－	1.2	0.6	0.1
スペイン	57,020	69,246	8,325,524	5.5	－	3.7	1.3	0.5
ベルギー	23,630	29,396	3,534,374	2.3	－	1.7	0.5	0.1
オーストリア	14,190	17,326	2,083,190	1.4	－	0.9	0.4	0.1
フィンランド	6,380	7,135	857,898	0.6	－	0.3	0.2	0.0
アイルランド	7,590	8,790	1,056,854	0.7	－	0.5	0.2	－
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	52,240	67,835	9,692,313	6.4	－	5.0	1.0	0.4
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	40,770	45,914	523,427	0.3	－	0.2	0.1	0.1
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	28,430	29,395	349,515	0.2	－	0.1	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	36,140	47,501	764,291	0.5	－	0.4	0.1	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	28,330	29,815	835,720	0.6	－	0.2	0.2	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	34,180	39,443	2,926,710	1.9	－	1.4	0.4	0.1
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	7,490	7,983	637,860	0.4	－	0.2	0.1	0.1
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	25,560	26,754	698,554	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	127,720	115,155	853,300	0.6	0.6	0.5	0.0	0.0
合計	－	－	149,419,877	98.9	0.6	53.6	30.8	14.5

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）格付のない債券については、ＢＢ格以下組入比率に含まれておりません。

（Ｂ）外国（外貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.0	4,380	4,394	477,564	2020/11/30
		US TREASURY N/B	1.625	3,750	3,749	407,416	2020/11/30
		US TREASURY N/B	2.75	4,970	5,022	545,817	2020/11/30
		US TREASURY N/B	1.875	2,920	2,926	318,029	2020/12/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,340	2,342	254,551	2020/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,300	2,320	252,127	2020/12/31
		US TREASURY N/B	2.0	1,230	1,234	134,160	2021/1/15
		US TREASURY N/B	1.375	3,160	3,149	342,283	2021/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	1,610	1,646	178,922	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.25	2,650	2,668	289,944	2021/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	5,910	5,870	637,974	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.5	3,220	3,251	353,389	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.375	2,300	2,319	252,088	2021/3/15
		US TREASURY N/B	1.25	3,270	3,252	353,400	2021/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	2,470	2,488	270,375	2021/3/31
		US TREASURY N/B	2.375	5,960	6,014	653,605	2021/4/15
		US TREASURY N/B	1.375	1,220	1,214	132,025	2021/4/30
		US TREASURY N/B	2.25	4,220	4,252	462,152	2021/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	1,860	1,897	206,204	2021/5/15
		US TREASURY N/B	2.625	4,240	4,296	466,871	2021/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,510	1,517	164,864	2021/5/31
		US TREASURY N/B	1.375	2,800	2,787	302,926	2021/5/31
		US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,535	275,500	2021/6/15
		US TREASURY N/B	1.125	6,610	6,554	712,275	2021/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	4,000	3,996	434,348	2021/6/30
		US TREASURY N/B	2.625	1,940	1,968	213,957	2021/7/15
		US TREASURY N/B	1.125	6,730	6,669	724,806	2021/7/31
		US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,003	326,417	2021/7/31
		US TREASURY N/B	2.125	7,650	7,706	837,495	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,526	165,879	2021/8/15
		US TREASURY N/B	1.125	2,010	1,991	216,404	2021/8/31
		US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,988	433,440	2021/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,000	2,037	221,398	2021/9/15
		US TREASURY N/B	1.125	3,660	3,624	393,848	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.125	1,780	1,794	194,981	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.875	1,300	1,328	144,366	2021/10/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,880	2,858	310,597	2021/10/31
		US TREASURY N/B	1.5	3,000	2,991	325,124	2021/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	4,440	4,470	485,793	2021/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,300	1,329	144,515	2021/11/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,060	2,063	224,293	2021/11/30
		US TREASURY N/B	1.875	2,230	2,239	243,384	2021/11/30
		US TREASURY N/B	2.625	2,100	2,141	232,673	2021/12/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.0	3,730	3,755	408,133	2021/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	1,600	1,627	176,901	2022/1/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,350	2,343	254,636	2022/1/31
		US TREASURY N/B	1.875	5,510	5,535	601,578	2022/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	3,260	3,284	356,914	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,180	2,185	237,465	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.875	1,120	1,125	122,311	2022/2/28
		US TREASURY N/B	2.375	1,600	1,626	176,755	2022/3/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,300	2,306	250,604	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.875	5,270	5,297	575,666	2022/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,041	330,518	2022/4/15
		US TREASURY N/B	1.75	1,400	1,403	152,545	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.875	1,150	1,156	125,649	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,750	2,758	299,712	2022/5/15
		US TREASURY N/B	1.875	2,990	3,007	326,827	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.75	1,800	1,804	196,140	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,604	174,408	2022/6/15
		US TREASURY N/B	2.125	3,870	3,917	425,727	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,900	2,908	316,090	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,700	1,704	185,236	2022/7/15
		US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,056	658,119	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.875	1,150	1,156	125,724	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,750	2,749	298,760	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	2,340	2,354	255,862	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	4,210	4,208	457,375	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.5	2,100	2,092	227,382	2022/9/15
		US TREASURY N/B	1.75	3,280	3,289	357,516	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	2,200	2,214	240,652	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.375	1,480	1,468	159,619	2022/10/15
		US TREASURY N/B	1.875	2,940	2,958	321,536	2022/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	6,310	6,373	692,604	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	1,980	1,978	215,048	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	4,780	4,828	524,718	2022/11/30
		US TREASURY N/B	2.125	2,440	2,475	268,961	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	2,360	2,367	257,282	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.375	1,850	1,890	205,476	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	2,130	2,153	234,003	2023/2/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,300	2,289	248,779	2023/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	2,000	2,060	223,949	2023/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	1,940	1,930	209,839	2023/3/31
		US TREASURY N/B	2.5	5,350	5,496	597,315	2023/3/31
		US TREASURY N/B	1.625	3,020	3,017	327,933	2023/4/30
		US TREASURY N/B	2.75	4,140	4,288	466,079	2023/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,200	2,207	239,835	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,060	2,058	223,659	2023/5/31

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.75	1,800	1,866	202,780	2023/5/31
		US TREASURY N/B	1.375	5,460	5,408	587,706	2023/6/30
		US TREASURY N/B	2.625	2,220	2,294	249,309	2023/6/30
		US TREASURY N/B	1.25	1,850	1,823	198,173	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,590	2,688	292,191	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,160	2,224	241,741	2023/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,320	2,296	249,514	2023/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,050	2,129	231,458	2023/8/31
		US TREASURY N/B	1.375	2,160	2,137	232,251	2023/9/30
		US TREASURY N/B	2.875	3,000	3,133	340,514	2023/9/30
		US TREASURY N/B	1.625	3,090	3,085	335,324	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.875	4,500	4,703	511,097	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,580	2,685	291,835	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	2,420	2,462	267,593	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.875	2,100	2,196	238,725	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	4,720	4,826	524,493	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	2,450	2,541	276,163	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.25	3,410	3,488	379,105	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,780	2,899	315,142	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,395	586,378	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.375	3,160	3,249	353,149	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.125	5,350	5,449	592,217	2024/3/31
		US TREASURY N/B	2.0	2,520	2,554	277,608	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.5	4,340	4,491	488,079	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	2,810	2,849	309,662	2024/5/31
		US TREASURY N/B	2.0	3,880	3,934	427,585	2024/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,500	2,507	272,529	2024/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	4,480	4,568	496,483	2024/7/31
		US TREASURY N/B	1.75	2,500	2,507	272,534	2024/7/31
		US TREASURY N/B	2.375	3,350	3,453	375,328	2024/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	1,290	1,301	141,402	2024/8/31
		US TREASURY N/B	1.25	2,980	2,923	317,644	2024/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	2,520	2,570	279,384	2024/9/30
		US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,966	431,029	2024/9/30
		US TREASURY N/B	2.25	2,420	2,484	269,987	2024/10/31
		US TREASURY N/B	1.5	3,200	3,173	344,871	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	3,960	4,064	441,738	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	1,300	1,327	144,217	2024/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	3,100	3,184	346,048	2024/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,120	2,204	239,555	2025/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	2,480	2,517	273,565	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,300	2,421	263,126	2025/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	1,530	1,601	174,062	2025/3/31
		US TREASURY N/B	2.875	1,740	1,844	200,456	2025/4/30
		US TREASURY N/B	2.125	1,550	1,583	172,080	2025/5/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,288	357,372	2025/5/31
		US TREASURY N/B	2.75	1,970	2,078	225,850	2025/6/30
		US TREASURY N/B	2.875	4,750	5,045	548,332	2025/7/31
		US TREASURY N/B	2.0	3,640	3,694	401,492	2025/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,350	4,593	499,147	2025/8/31
		US TREASURY N/B	3.0	2,100	2,247	244,221	2025/9/30
		US TREASURY N/B	3.0	2,200	2,356	256,028	2025/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	5,130	5,278	573,667	2025/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,500	3,726	404,955	2025/11/30
		US TREASURY N/B	2.625	1,500	1,576	171,311	2025/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	1,820	1,913	207,919	2026/1/31
		US TREASURY N/B	1.625	3,490	3,465	376,591	2026/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,700	3,864	419,960	2026/2/28
		US TREASURY N/B	2.25	4,080	4,202	456,666	2026/3/31
		US TREASURY N/B	2.375	2,350	2,438	265,035	2026/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	2,450	2,431	264,203	2026/5/15
		US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,534	166,733	2026/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	4,700	4,735	514,609	2026/6/30
		US TREASURY N/B	1.875	1,700	1,712	186,110	2026/7/31
		US TREASURY N/B	1.5	4,130	4,061	441,408	2026/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	1,800	1,756	190,861	2026/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	3,700	3,667	398,552	2026/9/30
		US TREASURY N/B	1.625	3,000	2,972	323,036	2026/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	4,360	4,427	481,176	2026/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	4,730	4,885	530,864	2027/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	4,920	5,128	557,264	2027/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	4,020	4,155	451,631	2027/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	5,000	5,171	561,963	2027/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	5,450	5,846	635,305	2028/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	6,120	6,633	720,824	2028/5/15
		US TREASURY N/B	5.5	220	285	30,992	2028/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	5,120	5,557	603,933	2028/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	5,280	5,848	635,537	2028/11/15
		US TREASURY N/B	5.25	530	684	74,332	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.625	5,760	6,149	668,287	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	5,550	5,812	631,637	2029/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	5,300	5,201	565,286	2029/8/15
		US TREASURY N/B	1.75	1,900	1,886	204,988	2029/11/15
		US TREASURY N/B	6.25	780	1,106	120,288	2030/5/15
		US TREASURY N/B	5.375	950	1,287	139,935	2031/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,140	1,534	166,788	2036/2/15
		US TREASURY N/B	5.0	630	906	98,495	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.375	690	933	101,425	2038/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	520	714	77,658	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	560	683	74,268	2039/2/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	4.25	840	1,125	122,317	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,340	1,852	201,319	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	600	818	88,909	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	1,080	1,520	165,283	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	1,950	2,669	290,051	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	1,180	1,515	164,708	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,070	1,443	156,839	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	1,250	1,796	195,274	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	2,080	2,857	310,482	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.75	1,080	1,367	148,613	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,040	1,204	130,856	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	590	683	74,253	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,000	2,272	246,935	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,240	1,353	147,102	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,660	2,902	315,422	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,540	1,785	194,033	2043/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	4,340	4,836	525,542	2043/5/15
		US TREASURY N/B	3.625	2,510	3,145	341,841	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.75	2,560	3,271	355,541	2043/11/15
		US TREASURY N/B	3.625	2,640	3,317	360,499	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	3,160	3,825	415,752	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,650	4,249	461,813	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,100	2,396	260,441	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,760	3,929	427,049	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,950	4,515	490,724	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,090	3,458	375,809	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,070	2,371	257,678	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,320	2,426	263,656	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,390	3,546	385,364	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,850	1,842	200,230	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,620	4,066	441,951	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,740	3,152	342,628	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,010	2,312	251,267	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,140	2,352	255,627	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,090	4,498	488,836	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,370	2,731	296,823	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,740	4,413	479,622	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,200	3,693	401,413	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	4,350	5,377	584,411	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,430	3,967	431,138	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,250	3,674	399,345	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	4,010	3,996	434,328	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	1,400	1,433	155,810	2049/11/15
小計						71,970,422	

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	GOV OF CANADA	2.25	1,070	1,076	88,321	2021/2/1
		GOV OF CANADA	0.75	1,220	1,205	98,940	2021/3/1
		GOV OF CANADA	1.75	1,190	1,191	97,741	2021/5/1
		GOV OF CANADA	3.25	870	889	72,997	2021/6/1
		GOV OF CANADA	1.5	990	987	81,015	2021/8/1
		GOV OF CANADA	0.75	1,260	1,240	101,792	2021/9/1
		GOV OF CANADA	1.25	830	823	67,592	2021/11/1
		GOV OF CANADA	1.5	770	767	62,983	2022/2/1
		GOV OF CANADA	0.5	1,300	1,267	104,008	2022/3/1
		GOV OF CANADA	2.75	1,060	1,088	89,310	2022/6/1
		GOV OF CANADA	1.0	1,600	1,572	129,057	2022/9/1
		GOV OF CANADA	1.75	1,280	1,284	105,413	2023/3/1
		GOV OF CANADA	1.5	1,110	1,105	90,729	2023/6/1
		GOV OF CANADA	2.0	870	882	72,377	2023/9/1
		GOV OF CANADA	2.25	1,290	1,324	108,676	2024/3/1
		GOV OF CANADA	2.5	900	934	76,715	2024/6/1
		GOV OF CANADA	1.5	830	826	67,810	2024/9/1
		GOV OF CANADA	1.25	810	796	65,326	2025/3/1
		GOV OF CANADA	2.25	840	868	71,303	2025/6/1
		GOV OF CANADA	1.5	940	934	76,705	2026/6/1
		GOV OF CANADA	1.0	1,510	1,446	118,680	2027/6/1
		GOV OF CANADA	2.0	990	1,021	83,796	2028/6/1
		GOV OF CANADA	5.75	850	1,156	94,902	2029/6/1
		GOV OF CANADA	2.25	890	942	77,305	2029/6/1
		GOV OF CANADA	1.25	550	531	43,629	2030/6/1
		GOV OF CANADA	5.75	810	1,210	99,298	2033/6/1
		GOV OF CANADA	5.0	880	1,317	108,153	2037/6/1
		GOV OF CANADA	4.0	1,050	1,480	121,461	2041/6/1
		GOV OF CANADA	3.5	1,180	1,622	133,173	2045/12/1
		GOV OF CANADA	2.75	1,090	1,352	110,992	2048/12/1
		GOV OF CANADA	2.0	720	776	63,694	2051/12/1
		GOV OF CANADA	2.75	360	481	39,527	2064/12/1
小計						2,823,436	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	UNITED MEXICAN STATE	6.5	17,990	17,928	101,293	2021/6/10
		UNITED MEXICAN STATE	7.25	15,600	15,736	88,908	2021/12/9
		UNITED MEXICAN STATE	6.5	22,070	21,943	123,982	2022/6/9
		UNITED MEXICAN STATE	6.75	3,300	3,297	18,633	2023/3/9
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	25,340	26,400	149,164	2023/12/7
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	4,000	4,192	23,688	2024/9/5
		UNITED MEXICAN STATE	10.0	19,370	21,969	124,125	2024/12/5
		UNITED MEXICAN STATE	5.75	12,260	11,635	65,742	2026/3/5
		UNITED MEXICAN STATE	7.5	22,480	23,263	131,439	2027/6/3
		UNITED MEXICAN STATE	8.5	17,010	18,868	106,605	2029/5/31
		UNITED MEXICAN STATE	7.75	10,180	10,801	61,028	2031/5/29

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
メキシコ			%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
	国債証券	UNITED MEXICAN STATE	7.75	7,360	7,848	44,342	2034/11/23
		UNITED MEXICAN STATE	10.0	6,750	8,684	49,069	2036/11/20
		UNITED MEXICAN STATE	8.5	10,870	12,375	69,921	2038/11/18
		UNITED MEXICAN STATE	7.75	14,910	15,823	89,400	2042/11/13
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	9,910	10,854	61,327	2047/11/7
小計						1,308,672	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	—	1,330	1,338	160,963	2020/12/11
		GOV OF GERMANY	2.5	860	890	107,023	2021/1/4
		GOV OF GERMANY	—	1,120	1,129	135,788	2021/3/12
		GOV OF GERMANY	—	1,170	1,180	141,895	2021/4/9
		GOV OF GERMANY	—	1,400	1,413	169,992	2021/6/11
		GOV OF GERMANY	3.25	1,950	2,069	248,875	2021/7/4
		GOV OF GERMANY	2.25	1,200	1,260	151,584	2021/9/4
		GOV OF GERMANY	—	460	465	55,938	2021/9/10
		GOV OF GERMANY	—	1,280	1,295	155,751	2021/10/8
		GOV OF GERMANY	—	400	405	48,715	2021/12/10
		GOV OF GERMANY	2.0	1,400	1,478	177,771	2022/1/4
		GOV OF GERMANY	—	1,370	1,391	167,274	2022/4/8
		GOV OF GERMANY	1.75	1,660	1,763	211,976	2022/7/4
		GOV OF GERMANY	1.5	1,510	1,600	192,393	2022/9/4
		GOV OF GERMANY	—	1,210	1,232	148,211	2022/10/7
		GOV OF GERMANY	1.5	1,070	1,144	137,571	2023/2/15
		GOV OF GERMANY	—	1,170	1,195	143,741	2023/4/14
		GOV OF GERMANY	1.5	1,340	1,439	173,091	2023/5/15
		GOV OF GERMANY	2.0	1,480	1,625	195,441	2023/8/15
		GOV OF GERMANY	—	1,130	1,157	139,193	2023/10/13
		GOV OF GERMANY	1.75	1,970	2,167	260,544	2024/2/15
		GOV OF GERMANY	—	1,600	1,641	197,379	2024/4/5
		GOV OF GERMANY	1.5	1,300	1,422	171,058	2024/5/15
		GOV OF GERMANY	1.0	1,560	1,677	201,695	2024/8/15
		GOV OF GERMANY	—	1,300	1,336	160,662	2024/10/18
		GOV OF GERMANY	0.5	1,670	1,763	212,042	2025/2/15
		GOV OF GERMANY	1.0	1,540	1,677	201,659	2025/8/15
		GOV OF GERMANY	0.5	1,790	1,905	229,058	2026/2/15
		GOV OF GERMANY	—	1,910	1,974	237,393	2026/8/15
		GOV OF GERMANY	0.25	1,890	1,989	239,255	2027/2/15
		GOV OF GERMANY	6.5	1,010	1,551	186,496	2027/7/4
		GOV OF GERMANY	0.5	1,730	1,858	223,442	2027/8/15
		GOV OF GERMANY	5.625	930	1,392	167,403	2028/1/4
		GOV OF GERMANY	0.5	1,700	1,830	220,040	2028/2/15
		GOV OF GERMANY	4.75	710	1,028	123,665	2028/7/4
		GOV OF GERMANY	0.25	1,700	1,795	215,878	2028/8/15
		GOV OF GERMANY	0.25	1,610	1,699	204,352	2029/2/15
		GOV OF GERMANY	—	1,430	1,473	177,120	2029/8/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	6.25	740	1,238	148,941	2030/1/4
			GOV OF GERMANY	5.5	1,150	1,898	228,252	2031/1/4
			GOV OF GERMANY	4.75	1,490	2,566	308,575	2034/7/4
			GOV OF GERMANY	4.0	1,630	2,765	332,545	2037/1/4
			GOV OF GERMANY	4.25	1,090	1,998	240,291	2039/7/4
			GOV OF GERMANY	4.75	1,110	2,191	263,459	2040/7/4
			GOV OF GERMANY	3.25	1,010	1,729	207,963	2042/7/4
			GOV OF GERMANY	2.5	2,080	3,280	394,366	2044/7/4
			GOV OF GERMANY	2.5	2,070	3,336	401,204	2046/8/15
			GOV OF GERMANY	1.25	1,290	1,671	200,967	2048/8/15
			GOV OF GERMANY	－	380	355	42,723	2050/8/15
	イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	3.75	1,730	1,813	218,069	2021/3/1
			GOV OF ITALY	0.05	990	992	119,315	2021/4/15
			GOV OF ITALY	3.75	1,110	1,169	140,642	2021/5/1
			GOV OF ITALY	0.45	1,820	1,834	220,544	2021/6/1
			GOV OF ITALY	3.75	2,240	2,379	286,062	2021/8/1
			GOV OF ITALY	4.75	1,670	1,807	217,312	2021/9/1
			GOV OF ITALY	2.3	1,270	1,323	159,144	2021/10/15
			GOV OF ITALY	0.35	910	916	110,147	2021/11/1
			GOV OF ITALY	2.15	1,090	1,136	136,655	2021/12/15
			GOV OF ITALY	5.0	1,190	1,321	158,826	2022/3/1
			GOV OF ITALY	1.2	1,290	1,323	159,096	2022/4/1
			GOV OF ITALY	1.35	1,350	1,389	167,031	2022/4/15
			GOV OF ITALY	1.0	1,730	1,769	212,696	2022/7/15
			GOV OF ITALY	0.9	1,580	1,612	193,835	2022/8/1
			GOV OF ITALY	5.5	810	928	111,605	2022/9/1
			GOV OF ITALY	1.45	1,680	1,740	209,237	2022/9/15
			GOV OF ITALY	5.5	1,360	1,567	188,510	2022/11/1
			GOV OF ITALY	0.05	1,500	1,491	179,304	2023/1/15
			GOV OF ITALY	0.95	1,850	1,890	227,301	2023/3/1
			GOV OF ITALY	0.95	1,480	1,512	181,871	2023/3/15
			GOV OF ITALY	4.5	1,900	2,167	260,591	2023/5/1
			GOV OF ITALY	4.75	1,500	1,738	208,968	2023/8/1
			GOV OF ITALY	2.45	1,260	1,356	163,142	2023/10/1
			GOV OF ITALY	0.65	750	758	91,253	2023/10/15
			GOV OF ITALY	4.5	1,760	2,052	246,806	2024/3/1
			GOV OF ITALY	1.85	1,420	1,502	180,637	2024/5/15
			GOV OF ITALY	1.75	800	842	101,261	2024/7/1
			GOV OF ITALY	3.75	1,710	1,959	235,576	2024/9/1
			GOV OF ITALY	1.45	840	873	105,057	2024/11/15
			GOV OF ITALY	2.5	1,150	1,252	150,636	2024/12/1
			GOV OF ITALY	0.35	970	952	114,481	2025/2/1
			GOV OF ITALY	5.0	1,680	2,049	246,428	2025/3/1
			GOV OF ITALY	1.45	1,230	1,275	153,359	2025/5/15
			GOV OF ITALY	1.5	1,340	1,392	167,469	2025/6/1

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	2.5	970	1,062	127,723	2025/11/15
		GOV OF ITALY	2.0	1,630	1,741	209,426	2025/12/1
		GOV OF ITALY	4.5	1,720	2,098	252,321	2026/3/1
		GOV OF ITALY	1.6	1,350	1,410	169,614	2026/6/1
		GOV OF ITALY	2.1	1,990	2,136	256,857	2026/7/15
		GOV OF ITALY	1.25	1,490	1,520	182,841	2026/12/1
		GOV OF ITALY	0.85	400	395	47,553	2027/1/15
		GOV OF ITALY	2.2	1,290	1,397	168,055	2027/6/1
		GOV OF ITALY	2.05	1,890	2,026	243,671	2027/8/1
		GOV OF ITALY	6.5	1,610	2,264	272,284	2027/11/1
		GOV OF ITALY	2.0	1,230	1,316	158,311	2028/2/1
		GOV OF ITALY	4.75	1,970	2,553	307,020	2028/9/1
		GOV OF ITALY	2.8	1,410	1,601	192,574	2028/12/1
		GOV OF ITALY	3.0	1,540	1,780	214,043	2029/8/1
		GOV OF ITALY	5.25	2,090	2,848	342,488	2029/11/1
		GOV OF ITALY	3.5	1,720	2,068	248,714	2030/3/1
		GOV OF ITALY	1.35	700	698	83,981	2030/4/1
		GOV OF ITALY	6.0	2,090	3,080	370,314	2031/5/1
		GOV OF ITALY	1.65	1,580	1,602	192,672	2032/3/1
		GOV OF ITALY	5.75	1,360	2,011	241,869	2033/2/1
		GOV OF ITALY	2.45	1,180	1,287	154,851	2033/9/1
		GOV OF ITALY	5.0	2,360	3,328	400,176	2034/8/1
		GOV OF ITALY	3.35	970	1,162	139,815	2035/3/1
		GOV OF ITALY	2.25	1,010	1,062	127,800	2036/9/1
		GOV OF ITALY	4.0	1,830	2,363	284,210	2037/2/1
		GOV OF ITALY	2.95	1,490	1,695	203,801	2038/9/1
		GOV OF ITALY	5.0	1,620	2,367	284,676	2039/8/1
		GOV OF ITALY	3.1	590	679	81,663	2040/3/1
		GOV OF ITALY	5.0	1,570	2,297	276,237	2040/9/1
		GOV OF ITALY	4.75	1,250	1,822	219,099	2044/9/1
		GOV OF ITALY	3.25	1,220	1,450	174,396	2046/9/1
		GOV OF ITALY	2.7	1,280	1,389	167,012	2047/3/1
		GOV OF ITALY	3.45	1,230	1,508	181,357	2048/3/1
		GOV OF ITALY	3.85	940	1,225	147,354	2049/9/1
		GOV OF ITALY	2.8	680	714	85,929	2067/3/1
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	－	1,970	1,984	238,627	2021/2/25
		GOV OF FRANCE	3.75	2,900	3,075	369,756	2021/4/25
		GOV OF FRANCE	－	1,770	1,785	214,727	2021/5/25
		GOV OF FRANCE	3.25	3,050	3,274	393,640	2021/10/25
		GOV OF FRANCE	－	2,240	2,269	272,835	2022/2/25
		GOV OF FRANCE	3.0	3,080	3,347	402,418	2022/4/25
		GOV OF FRANCE	－	2,480	2,518	302,747	2022/5/25
		GOV OF FRANCE	2.25	2,880	3,118	374,914	2022/10/25
		GOV OF FRANCE	－	3,020	3,078	370,128	2023/3/25
		GOV OF FRANCE	1.75	3,250	3,513	422,414	2023/5/25

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4.25	3,570	4,240	509,865	2023/10/25
		GOV OF FRANCE	－	2,350	2,400	288,578	2024/3/25
		GOV OF FRANCE	2.25	2,510	2,819	338,981	2024/5/25
		GOV OF FRANCE	1.75	3,080	3,416	410,733	2024/11/25
		GOV OF FRANCE	－	2,060	2,100	252,579	2025/3/25
		GOV OF FRANCE	0.5	2,480	2,601	312,747	2025/5/25
		GOV OF FRANCE	6.0	2,270	3,123	375,523	2025/10/25
		GOV OF FRANCE	1.0	2,500	2,699	324,595	2025/11/25
		GOV OF FRANCE	3.5	2,580	3,212	386,276	2026/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	2,770	2,911	350,031	2026/5/25
		GOV OF FRANCE	0.25	2,560	2,647	318,361	2026/11/25
		GOV OF FRANCE	1.0	2,310	2,517	302,685	2027/5/25
		GOV OF FRANCE	2.75	3,060	3,775	453,869	2027/10/25
		GOV OF FRANCE	0.75	2,520	2,707	325,486	2028/5/25
		GOV OF FRANCE	0.75	2,130	2,287	275,068	2028/11/25
		GOV OF FRANCE	5.5	2,780	4,239	509,750	2029/4/25
		GOV OF FRANCE	0.5	2,400	2,520	303,081	2029/5/25
		GOV OF FRANCE	－	840	839	100,882	2029/11/25
		GOV OF FRANCE	2.5	3,080	3,874	465,889	2030/5/25
		GOV OF FRANCE	1.5	3,420	3,965	476,740	2031/5/25
		GOV OF FRANCE	5.75	2,450	4,203	505,417	2032/10/25
		GOV OF FRANCE	1.25	1,820	2,069	248,829	2034/5/25
		GOV OF FRANCE	4.75	2,190	3,656	439,567	2035/4/25
		GOV OF FRANCE	1.25	2,280	2,591	311,601	2036/5/25
		GOV OF FRANCE	4.0	1,910	3,142	377,871	2038/10/25
		GOV OF FRANCE	1.75	1,490	1,839	221,118	2039/6/25
		GOV OF FRANCE	4.5	2,660	4,796	576,702	2041/4/25
		GOV OF FRANCE	3.25	1,860	2,985	358,907	2045/5/25
		GOV OF FRANCE	2.0	1,940	2,563	308,188	2048/5/25
		GOV OF FRANCE	1.5	1,840	2,187	263,043	2050/5/25
		GOV OF FRANCE	4.0	1,230	2,414	290,325	2055/4/25
		GOV OF FRANCE	4.0	920	1,889	227,138	2060/4/25
		GOV OF FRANCE	1.75	850	1,103	132,624	2066/5/25
オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	3.25	1,140	1,211	145,629	2021/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	－	1,340	1,357	163,171	2022/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.25	970	1,043	125,436	2022/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	3.75	970	1,102	132,597	2023/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	1.75	1,300	1,411	169,658	2023/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	－	1,260	1,288	154,920	2024/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.0	1,000	1,117	134,337	2024/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.25	1,170	1,216	146,217	2025/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.5	1,070	1,133	136,329	2026/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	1,120	1,211	145,610	2027/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	5.5	790	1,163	139,915	2028/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	1,200	1,304	156,814	2028/7/15

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	0.25	960	999	120,129	2029/7/15
			GOV OF NETHERLANDS	2.5	930	1,238	148,937	2033/1/15
			GOV OF NETHERLANDS	4.0	1,180	1,965	236,366	2037/1/15
			GOV OF NETHERLANDS	0.5	550	583	70,195	2040/1/15
			GOV OF NETHERLANDS	3.75	1,070	1,906	229,185	2042/1/15
			GOV OF NETHERLANDS	2.75	1,110	1,845	221,830	2047/1/15
	スペイン	国債証券	GOV OF SPAIN	0.05	1,500	1,508	181,336	2021/1/31
			GOV OF SPAIN	5.5	1,770	1,916	230,389	2021/4/30
			GOV OF SPAIN	0.75	1,590	1,620	194,881	2021/7/30
			GOV OF SPAIN	0.05	1,530	1,542	185,484	2021/10/31
			GOV OF SPAIN	5.85	1,250	1,417	170,444	2022/1/31
			GOV OF SPAIN	0.4	1,910	1,944	233,789	2022/4/30
			GOV OF SPAIN	0.45	1,290	1,318	158,489	2022/10/31
			GOV OF SPAIN	5.4	1,720	2,026	243,689	2023/1/31
			GOV OF SPAIN	0.35	1,430	1,458	175,305	2023/7/30
			GOV OF SPAIN	4.4	1,390	1,637	196,839	2023/10/31
			GOV OF SPAIN	4.8	1,200	1,445	173,802	2024/1/31
			GOV OF SPAIN	3.8	1,270	1,487	178,808	2024/4/30
			GOV OF SPAIN	0.25	1,270	1,289	154,996	2024/7/30
			GOV OF SPAIN	2.75	1,830	2,082	250,354	2024/10/31
			GOV OF SPAIN	1.6	1,750	1,899	228,399	2025/4/30
			GOV OF SPAIN	4.65	1,560	1,963	236,018	2025/7/30
			GOV OF SPAIN	2.15	1,570	1,761	211,738	2025/10/31
			GOV OF SPAIN	1.95	1,450	1,618	194,561	2026/4/30
			GOV OF SPAIN	5.9	1,630	2,247	270,190	2026/7/30
			GOV OF SPAIN	1.3	1,640	1,766	212,341	2026/10/31
			GOV OF SPAIN	1.5	1,340	1,463	176,005	2027/4/30
			GOV OF SPAIN	1.45	1,820	1,985	238,719	2027/10/31
			GOV OF SPAIN	1.4	1,570	1,708	205,391	2028/4/30
			GOV OF SPAIN	1.4	1,570	1,708	205,433	2028/7/30
			GOV OF SPAIN	5.15	1,330	1,883	226,483	2028/10/31
			GOV OF SPAIN	6.0	1,830	2,751	330,814	2029/1/31
			GOV OF SPAIN	1.45	1,720	1,882	226,336	2029/4/30
			GOV OF SPAIN	0.6	1,310	1,328	159,754	2029/10/31
			GOV OF SPAIN	1.95	1,750	2,009	241,606	2030/7/30
			GOV OF SPAIN	5.75	1,530	2,488	299,209	2032/7/30
			GOV OF SPAIN	2.35	1,390	1,684	202,529	2033/7/30
			GOV OF SPAIN	1.85	850	974	117,139	2035/7/30
			GOV OF SPAIN	4.2	1,490	2,280	274,184	2037/1/31
			GOV OF SPAIN	4.9	1,330	2,284	274,615	2040/7/30
			GOV OF SPAIN	4.7	1,540	2,611	313,984	2041/7/30
			GOV OF SPAIN	5.15	1,000	1,850	222,487	2044/10/31
			GOV OF SPAIN	2.9	1,400	1,913	230,098	2046/10/31
			GOV OF SPAIN	2.7	810	1,076	129,397	2048/10/31
			GOV OF SPAIN	3.45	890	1,409	169,472	2066/7/30

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	ベルギー	国債証券	GOV OF BELGIUM	4.25	1,220	1,328	159,696	2021/9/28
			GOV OF BELGIUM	4.0	970	1,073	129,095	2022/3/28
			GOV OF BELGIUM	4.25	1,180	1,341	161,315	2022/9/28
			GOV OF BELGIUM	2.25	980	1,077	129,599	2023/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.2	730	749	90,113	2023/10/22
			GOV OF BELGIUM	2.6	1,010	1,150	138,304	2024/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.5	830	866	104,168	2024/10/22
			GOV OF BELGIUM	0.8	1,260	1,340	161,131	2025/6/22
			GOV OF BELGIUM	4.5	640	834	100,329	2026/3/28
			GOV OF BELGIUM	1.0	1,290	1,397	168,007	2026/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.8	990	1,062	127,764	2027/6/22
			GOV OF BELGIUM	5.5	1,190	1,751	210,625	2028/3/28
			GOV OF BELGIUM	0.8	1,430	1,539	185,074	2028/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.9	1,020	1,109	133,376	2029/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.0	870	958	115,180	2031/6/22
			GOV OF BELGIUM	4.0	620	912	109,686	2032/3/28
			GOV OF BELGIUM	1.25	460	522	62,778	2033/4/22
			GOV OF BELGIUM	3.0	560	777	93,478	2034/6/22
			GOV OF BELGIUM	5.0	1,410	2,391	287,522	2035/3/28
			GOV OF BELGIUM	1.45	370	431	51,854	2037/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.9	640	799	96,068	2038/6/22
			GOV OF BELGIUM	4.25	1,240	2,148	258,340	2041/3/28
			GOV OF BELGIUM	3.75	710	1,221	146,863	2045/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.6	820	997	119,892	2047/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.7	410	507	60,960	2050/6/22
			GOV OF BELGIUM	2.25	390	552	66,435	2057/6/22
			GOV OF BELGIUM	2.15	390	554	66,709	2066/6/22
	オーストリア	国債証券	GOV OF AUSTRIA	3.5	1,020	1,094	131,575	2021/9/15
			GOV OF AUSTRIA	3.65	430	473	56,928	2022/4/20
			GOV OF AUSTRIA	—	710	721	86,746	2022/9/20
			GOV OF AUSTRIA	3.4	730	816	98,145	2022/11/22
			GOV OF AUSTRIA	—	620	632	75,994	2023/7/15
			GOV OF AUSTRIA	1.75	940	1,023	123,055	2023/10/20
			GOV OF AUSTRIA	—	400	408	49,136	2024/7/15
			GOV OF AUSTRIA	1.65	700	772	92,825	2024/10/21
			GOV OF AUSTRIA	1.2	1,020	1,114	133,997	2025/10/20
			GOV OF AUSTRIA	4.85	620	823	99,025	2026/3/15
			GOV OF AUSTRIA	0.75	890	953	114,671	2026/10/20
			GOV OF AUSTRIA	0.5	600	632	76,049	2027/4/20
			GOV OF AUSTRIA	6.25	620	927	111,543	2027/7/15
			GOV OF AUSTRIA	0.75	820	881	105,971	2028/2/20
			GOV OF AUSTRIA	0.5	630	663	79,817	2029/2/20
			GOV OF AUSTRIA	2.4	490	645	77,620	2034/5/23
			GOV OF AUSTRIA	4.15	1,040	1,724	207,352	2037/3/15
			GOV OF AUSTRIA	3.15	490	802	96,514	2044/6/20

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	オーストリア	国債証券	GOV OF AUSTRIA	1.5	540	677	81,398	2047/2/20
			GOV OF AUSTRIA	3.8	260	561	67,539	2062/1/26
			GOV OF AUSTRIA	1.5	200	264	31,798	2086/11/2
			GOV OF AUSTRIA	2.1	420	710	85,483	2117/9/20
	フィンランド	国債証券	GOV OF FINLAND	3.5	510	538	64,758	2021/4/15
			GOV OF FINLAND	—	330	334	40,247	2022/4/15
			GOV OF FINLAND	1.625	380	403	48,515	2022/9/15
			GOV OF FINLAND	1.5	350	374	45,018	2023/4/15
			GOV OF FINLAND	—	400	408	49,075	2023/9/15
			GOV OF FINLAND	2.0	360	399	48,014	2024/4/15
			GOV OF FINLAND	—	300	306	36,823	2024/9/15
			GOV OF FINLAND	4.0	500	624	75,079	2025/7/4
			GOV OF FINLAND	0.875	250	267	32,210	2025/9/15
			GOV OF FINLAND	0.5	340	357	42,985	2026/4/15
			GOV OF FINLAND	0.5	390	411	49,427	2027/9/15
			GOV OF FINLAND	2.75	390	487	58,588	2028/7/4
			GOV OF FINLAND	0.5	310	327	39,319	2028/9/15
			GOV OF FINLAND	0.5	280	295	35,502	2029/9/15
			GOV OF FINLAND	0.75	320	345	41,524	2031/4/15
			GOV OF FINLAND	1.125	360	408	49,074	2034/4/15
			GOV OF FINLAND	2.625	340	510	61,404	2042/7/4
			GOV OF FINLAND	1.375	270	335	40,327	2047/4/15
	アイルランド	国債証券	GOV OF IRELAND	0.8	490	504	60,667	2022/3/15
			GOV OF IRELAND	—	350	354	42,674	2022/10/18
			GOV OF IRELAND	3.9	560	641	77,160	2023/3/20
			GOV OF IRELAND	3.4	540	628	75,569	2024/3/18
			GOV OF IRELAND	5.4	890	1,158	139,231	2025/3/13
			GOV OF IRELAND	1.0	850	916	110,137	2026/5/15
			GOV OF IRELAND	0.9	590	637	76,685	2028/5/15
			GOV OF IRELAND	1.1	560	616	74,152	2029/5/15
			GOV OF IRELAND	2.4	620	768	92,342	2030/5/15
			GOV OF IRELAND	1.35	510	576	69,334	2031/3/18
			GOV OF IRELAND	1.3	290	327	39,324	2033/5/15
			GOV OF IRELAND	1.7	410	490	59,010	2037/5/15
			GOV OF IRELAND	2.0	650	842	101,259	2045/2/18
			GOV OF IRELAND	1.5	280	326	39,304	2050/5/15
小計							56,035,650	
イギリス					千英ポンド	千英ポンド		
		国債証券	UK TREASURY	1.5	1,760	1,776	253,793	2021/1/22
			UK TREASURY	3.75	2,100	2,215	316,572	2021/9/7
			UK TREASURY	4.0	650	700	100,034	2022/3/7
			UK TREASURY	0.5	1,840	1,838	262,672	2022/7/22
			UK TREASURY	1.75	2,190	2,262	323,205	2022/9/7
			UK TREASURY	0.75	1,920	1,933	276,206	2023/7/22
			UK TREASURY	2.25	1,180	1,254	179,186	2023/9/7

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	1.0	1,950	1,986	283,792	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	970	1,068	152,737	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	1,330	1,634	233,514	2025/3/7
		UK TREASURY	0.625	830	831	118,786	2025/6/7
		UK TREASURY	2.0	470	508	72,711	2025/9/7
		UK TREASURY	1.5	950	1,007	143,949	2026/7/22
		UK TREASURY	1.25	1,190	1,246	178,077	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	980	1,258	179,796	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	1,970	2,130	304,454	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	700	1,025	146,561	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	970	980	140,050	2029/10/22
		UK TREASURY	4.75	1,060	1,501	214,591	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	1,140	1,589	227,085	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	1,070	1,580	225,774	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,850	2,720	388,773	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	1,540	1,683	240,546	2037/9/7
		UK TREASURY	4.75	1,090	1,762	251,787	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	1,010	1,556	222,392	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,230	1,921	274,570	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	1,440	2,380	340,054	2042/12/7
		UK TREASURY	3.25	1,730	2,443	349,194	2044/1/22
		UK TREASURY	3.5	1,600	2,368	338,445	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,520	2,558	365,526	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,510	1,592	227,480	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	640	715	102,187	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,070	1,869	267,116	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	1,230	2,068	295,572	2052/7/22
		UK TREASURY	1.625	650	726	103,751	2054/10/22
		UK TREASURY	4.25	1,220	2,316	330,985	2055/12/7
		UK TREASURY	1.75	1,220	1,436	205,317	2057/7/22
		UK TREASURY	4.0	1,000	1,913	273,442	2060/1/22
		UK TREASURY	2.5	1,480	2,192	313,249	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	1,320	2,474	353,530	2068/7/22
		UK TREASURY	1.625	670	803	114,829	2071/10/22
小計						9,692,313	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	GOV OF SWEDEN	5.0	7,410	7,796	88,879	2020/12/1
		GOV OF SWEDEN	3.5	7,710	8,451	96,350	2022/6/1
		GOV OF SWEDEN	1.5	5,850	6,271	71,497	2023/11/13
		GOV OF SWEDEN	2.5	5,170	5,949	67,825	2025/5/12
		GOV OF SWEDEN	1.0	4,240	4,582	52,241	2026/11/12
		GOV OF SWEDEN	0.75	3,580	3,828	43,648	2028/5/12
		GOV OF SWEDEN	0.75	3,340	3,577	40,786	2029/11/12
		GOV OF SWEDEN	3.5	3,470	5,456	62,198	2039/3/30
小計						523,427	

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ノルウェー			%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
	国債証券	GOV OF NORWAY	3.75	6,410	6,636	78,912	2021/5/25
		GOV OF NORWAY	2.0	5,300	5,421	64,463	2023/5/24
		GOV OF NORWAY	3.0	3,800	4,069	48,383	2024/3/14
		GOV OF NORWAY	1.75	2,540	2,599	30,904	2025/3/13
		GOV OF NORWAY	1.5	2,690	2,720	32,351	2026/2/19
		GOV OF NORWAY	1.75	2,850	2,924	34,770	2027/2/17
		GOV OF NORWAY	2.0	2,680	2,804	33,346	2028/4/26
		GOV OF NORWAY	1.75	2,160	2,218	26,381	2029/9/6
小計						349,515	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	GOV OF DENMARK	3.0	5,350	5,739	92,343	2021/11/15
		GOV OF DENMARK	0.25	1,430	1,469	23,643	2022/11/15
		GOV OF DENMARK	1.5	4,780	5,185	83,438	2023/11/15
		GOV OF DENMARK	1.75	4,850	5,512	88,703	2025/11/15
		GOV OF DENMARK	0.5	6,440	6,915	111,276	2027/11/15
		GOV OF DENMARK	0.5	3,300	3,559	57,279	2029/11/15
		GOV OF DENMARK	4.5	9,990	19,117	307,605	2039/11/15
小計						764,291	
ポーランド				千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
	国債証券	GOV OF POLAND	2.0	1,400	1,413	39,608	2021/4/25
		GOV OF POLAND	－	650	637	17,882	2021/5/25
		GOV OF POLAND	1.75	2,580	2,594	72,732	2021/7/25
		GOV OF POLAND	5.75	1,710	1,847	51,783	2021/10/25
		GOV OF POLAND	2.25	2,230	2,270	63,641	2022/4/25
		GOV OF POLAND	5.75	1,440	1,604	44,961	2022/9/23
		GOV OF POLAND	2.5	1,840	1,890	52,997	2023/1/25
		GOV OF POLAND	4.0	2,240	2,436	68,288	2023/10/25
		GOV OF POLAND	2.5	1,700	1,755	49,206	2024/4/25
		GOV OF POLAND	2.25	1,630	1,668	46,761	2024/10/25
		GOV OF POLAND	3.25	2,210	2,380	66,723	2025/7/25
		GOV OF POLAND	2.5	2,540	2,638	73,944	2026/7/25
		GOV OF POLAND	2.5	2,060	2,143	60,074	2027/7/25
		GOV OF POLAND	2.75	2,210	2,342	65,667	2028/4/25
		GOV OF POLAND	5.75	640	856	24,014	2029/4/25
		GOV OF POLAND	2.75	1,250	1,335	37,430	2029/10/25
小計						835,720	
オーストラリア				千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
	国債証券	GOV OF AUSTRALIA	5.75	1,920	2,056	152,558	2021/5/15
		GOV OF AUSTRALIA	2.0	1,360	1,394	103,454	2021/12/21
		GOV OF AUSTRALIA	5.75	1,690	1,908	141,620	2022/7/15
		GOV OF AUSTRALIA	2.25	1,350	1,410	104,665	2022/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	5.5	1,750	2,027	150,433	2023/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	2,150	2,333	173,118	2024/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	2,070	2,330	172,954	2025/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.25	2,480	2,987	221,641	2026/4/21

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア			%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
	国債証券	GOV OF AUSTRALIA	4.75	2,110	2,668	197,998	2027/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,980	2,233	165,727	2027/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.25	2,070	2,261	167,777	2028/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,900	2,161	160,360	2028/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	1,970	2,337	173,437	2029/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	2,000	2,299	170,652	2029/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.5	1,850	2,092	155,285	2030/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	1.5	1,000	1,033	76,656	2031/6/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.5	1,090	1,522	112,982	2033/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	510	606	44,979	2035/6/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.75	990	1,333	98,954	2037/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	620	795	59,022	2039/6/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	360	431	31,983	2041/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.0	960	1,218	90,444	2047/3/21
小計						2,926,710	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	GOV OF SINGAPORE	2.25	550	555	44,410	2021/6/1
		GOV OF SINGAPORE	1.25	690	686	54,849	2021/10/1
		GOV OF SINGAPORE	1.75	220	221	17,665	2022/4/1
		GOV OF SINGAPORE	3.125	370	385	30,813	2022/9/1
		GOV OF SINGAPORE	1.75	500	503	40,197	2023/2/1
		GOV OF SINGAPORE	2.75	470	489	39,092	2023/7/1
		GOV OF SINGAPORE	2.0	290	294	23,558	2024/2/1
		GOV OF SINGAPORE	3.0	540	573	45,853	2024/9/1
		GOV OF SINGAPORE	2.375	240	249	19,918	2025/6/1
		GOV OF SINGAPORE	2.125	230	236	18,900	2026/6/1
		GOV OF SINGAPORE	3.5	630	707	56,513	2027/3/1
		GOV OF SINGAPORE	2.625	360	385	30,794	2028/5/1
		GOV OF SINGAPORE	2.875	290	318	25,467	2029/7/1
		GOV OF SINGAPORE	2.875	290	321	25,680	2030/9/1
		GOV OF SINGAPORE	3.375	490	581	46,449	2033/9/1
		GOV OF SINGAPORE	2.25	270	283	22,645	2036/8/1
		GOV OF SINGAPORE	2.375	220	236	18,876	2039/7/1
		GOV OF SINGAPORE	2.75	350	396	31,698	2042/4/1
		GOV OF SINGAPORE	2.75	490	556	44,474	2046/3/1
小計						637,860	
マレーシア				千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
	国債証券	GOV OF MALAYSIA	4.16	1,080	1,099	28,695	2021/7/15
		GOV OF MALAYSIA	4.048	860	875	22,851	2021/9/30
		GOV OF MALAYSIA	3.62	1,180	1,193	31,159	2021/11/30
		GOV OF MALAYSIA	3.882	680	691	18,065	2022/3/10
		GOV OF MALAYSIA	3.418	560	564	14,748	2022/8/15
		GOV OF MALAYSIA	3.795	950	967	25,271	2022/9/30
		GOV OF MALAYSIA	3.48	940	950	24,813	2023/3/15
		GOV OF MALAYSIA	3.757	610	621	16,222	2023/4/20

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
	国債証券	GOV OF MALAYSIA	3.8	900	918	23,986	2023/8/17
		GOV OF MALAYSIA	3.478	760	767	20,031	2024/6/14
		GOV OF MALAYSIA	4.181	550	571	14,928	2024/7/15
		GOV OF MALAYSIA	4.059	670	693	18,108	2024/9/30
		GOV OF MALAYSIA	3.882	800	822	21,478	2025/3/14
		GOV OF MALAYSIA	3.955	680	702	18,337	2025/9/15
		GOV OF MALAYSIA	4.392	310	328	8,565	2026/4/15
		GOV OF MALAYSIA	3.906	1,190	1,229	32,094	2026/7/15
		GOV OF MALAYSIA	3.9	1,010	1,040	27,165	2026/11/30
		GOV OF MALAYSIA	3.502	90	90	2,362	2027/5/31
		GOV OF MALAYSIA	3.899	1,350	1,393	36,379	2027/11/16
		GOV OF MALAYSIA	3.733	1,380	1,407	36,744	2028/6/15
		GOV OF MALAYSIA	3.885	950	983	25,685	2029/8/15
		GOV OF MALAYSIA	4.498	460	497	12,979	2030/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.232	810	856	22,374	2031/6/30
		GOV OF MALAYSIA	3.844	1,510	1,533	40,036	2033/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.642	1,100	1,207	31,532	2033/11/7
		GOV OF MALAYSIA	4.254	270	286	7,487	2035/5/31
		GOV OF MALAYSIA	4.762	650	736	19,218	2037/4/7
		GOV OF MALAYSIA	4.893	1,340	1,531	39,984	2038/6/8
		GOV OF MALAYSIA	4.935	290	330	8,641	2043/9/30
		GOV OF MALAYSIA	4.736	490	548	14,309	2046/3/15
		GOV OF MALAYSIA	4.921	1,140	1,313	34,296	2048/7/6
小計						698,554	
南アフリカ				千南アフリカランド	千南アフリカランド		
	国債証券	GOV OF SOUTH AFRICA	6.75	3,660	3,663	27,147	2021/3/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	7.75	9,130	9,249	68,538	2023/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	10.5	17,040	18,934	140,307	2026/12/21
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.0	10,530	9,711	71,961	2030/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	7.0	8,420	7,039	52,159	2031/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.25	10,300	9,343	69,236	2032/3/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.875	6,110	5,636	41,765	2035/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	6.25	9,140	6,477	47,999	2036/3/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.5	9,270	8,119	60,165	2037/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	9.0	8,050	7,244	53,678	2040/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	6.5	8,010	5,497	40,734	2041/2/28
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.75	10,170	8,797	65,188	2044/1/31
		GOV OF SOUTH AFRICA	8.75	17,890	15,440	114,416	2048/2/28
小計						853,300	
合計						149,419,877	

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

（2019年12月10日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	149,419,877	97.4
コール・ローン等、その他	3,973,885	2.6
投資信託財産総額	153,393,762	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。
（注）当期末における外貨建純資産（150,461,790千円）の投資信託財産総額（153,393,762千円）に対する比率は98.1%です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.67円、1カナダドル=82.06円、1メキシコペソ=5.65円、1ユーロ=120.23円、1英ポンド=142.88円、1スウェーデンクローナ=11.40円、1ノルウェークローネ=11.89円、1デンマーククローネ=16.09円、1ポーランドズロチ=28.03円、1オーストラリアドル=74.20円、1シンガポールドル=79.90円、1マレーシアリンギット=26.11円、1南アフリカランド=7.41円。

○特定資産の価格等の調査

（2018年12月11日～2019年12月10日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年12月10日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	304,259,847,429
コール・ローン等	519,741,684
公社債(評価額)	149,419,877,324
未収入金	153,355,520,029
未収利息	737,418,417
前払費用	227,289,975
(B) 負債	153,103,491,046
未払金	150,989,705,399
未払解約金	2,113,779,000
未払利息	5,900
その他未払費用	747
(C) 純資産総額(A－B)	151,156,356,383
元本	147,652,755,545
次期繰越損益金	3,503,600,838
(D) 受益権総口数	147,652,755,545口
１万口当たり基準価額(C／D)	10,237円

(注) 当ファンドの期首元本額は60,557,036,701円、期中追加設定元本額は121,787,503,426円、期中一部解約元本額は34,691,784,582円です。

(注) 2019年12月10日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	59,076,650,602円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	26,684,453,123円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	14,980,054,135円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	14,898,799,812円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	11,991,173,808円
・りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,297,036,779円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	5,369,239,943円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	4,745,711,671円
・ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	930,646,700円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	614,922,923円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	458,897,320円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ ８資産バランス 安定型	153,582,467円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	135,170,659円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ ８資産バランス 安定成長型	118,018,190円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	116,219,710円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ ８資産バランス 成長型	48,025,341円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	25,581,793円
・グローバル９資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	4,715,942円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	2,704,568円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,016,824円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	128,106円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	5,129円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.0237円です。

○損益の状況 (2018年12月11日～2019年12月10日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	2,009,126,837
受取利息	2,009,990,703
支払利息	△ 863,866
(B) 有価証券売買損益	1,575,140,286
売買益	13,780,777,013
売買損	△12,205,636,727
(C) 保管費用等	△ 16,385,799
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	3,567,881,324
(E) 前期繰越損益金	△ 2,203,952,942
(F) 追加信託差損益金	2,945,964,874
(G) 解約差損益金	△ 806,292,418
(H) 計(D＋E＋F＋G)	3,503,600,838
次期繰越損益金(H)	3,503,600,838

(注) 損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(F)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている株式に投資し、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 ②株式（指数先物取引、ＥＴＦ（上場投資信託証券）を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
主 要 投 資 対 象	・東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている株式
主 な 投 資 制 限	・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は、行いません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
（設定日）	円	%		%	%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	2,145.49	－	－	－	33
1期(2017年1月25日)	9,959	△ 0.4	2,168.95	1.1	94.3	5.6	5,625
2期(2018年1月25日)	12,597	26.5	2,743.29	26.5	98.2	2.0	16,168
3期(2019年1月25日)	10,694	△15.1	2,330.25	△15.1	95.9	4.0	25,096
4期(2020年1月27日)	11,913	11.4	2,597.26	11.5	98.3	1.9	41,046

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
（注）「東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2019年1月25日	10,694	－	2,330.25	－	95.9	4.0
1月末	10,704	0.1	2,332.52	0.1	95.9	4.2
2月末	10,980	2.7	2,393.08	2.7	95.6	4.3
3月末	10,990	2.8	2,395.21	2.8	94.8	5.2
4月末	11,172	4.5	2,434.82	4.5	97.3	2.7
5月末	10,446	△ 2.3	2,275.96	△ 2.3	96.9	3.0
6月末	10,732	0.4	2,338.89	0.4	96.7	3.2
7月末	10,829	1.3	2,360.18	1.3	97.1	2.9
8月末	10,462	△ 2.2	2,280.58	△ 2.1	98.3	1.6
9月末	11,093	3.7	2,418.29	3.8	97.9	2.1
10月末	11,647	8.9	2,539.02	9.0	98.1	1.9
11月末	11,873	11.0	2,588.40	11.1	98.0	1.9
12月末	12,044	12.6	2,625.91	12.7	98.8	1.8
（期末）						
2020年1月27日	11,913	11.4	2,597.26	11.5	98.3	1.9

（注）騰落率は期首比です。
（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

期中の基準価額等の推移

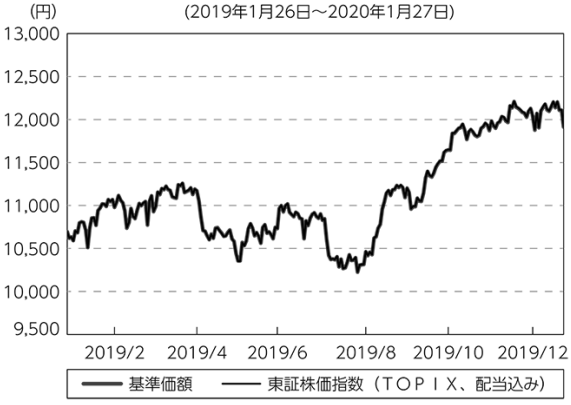
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,694円から当期末11,913円となり、1,219円の値上がりとなりました。

国内株式の市況（東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み））の上昇により、基準価額は上昇しました。

基準価額等の推移

（2019年1月26日～2020年1月27日）



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内株式市況

国内株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期の前半は、米中通商協議の交渉進展やＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）の利下げ観測の高まりから緩やかに上昇しましたが、世界景気の先行き不透明感が高まると不安定な動きとなりました。期の後半は、世界景気の底入れ期待と主要国の金融緩和策で投資家のリスク回避姿勢が和らぎ、国内株式市場は上昇基調となりました。

当ファンドのポートフォリオ

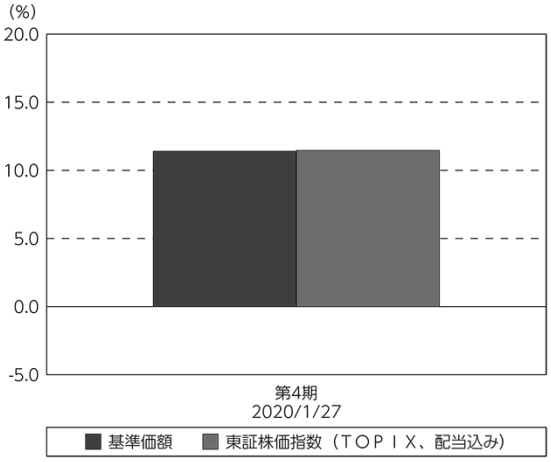
国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋11.4%となり、ベンチマークの＋11.5%を0.1%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（株式等に係る取引費用）が生じたこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主として東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている国内の株式に投資し、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.002)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	0	0.003	
期中の平均基準価額は、11,081円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	13,216 (356)	25,969,679 (－)	6,184	12,401,817

（注）金額は受け渡し代金。
（注）（ ）内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	4,646	4,968	－	－

○株式売買比率

（2019年１月26日～2020年１月27日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	38,371,497千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	29,407,275千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.30

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月26日～2020年１月27日）

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

利害関係人の発行する有価証券等

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	57	23	89

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社りそなホールディングス、株式会社関西みらいフィナンシャルグループです。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年１月27日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	0.5	0.8	2,296
日本水産	14.8	22.8	13,588
マルハニチロ	2.1	3.3	8,735
カネコ種苗	0.4	0.7	917
サカタのタネ	1.8	2.7	9,490
ホクト	1.3	1.7	3,294
ホクリヨウ	0.3	0.4	282
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	3.2	4.9	695
日鉄鉱業	0.3	0.5	2,310
三井松島ホールディングス	0.6	0.9	1,066
国際石油開発帝石	59.2	91.6	96,454
石油資源開発	2.1	3	8,649
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	0.7	1.1	1,852
建設業（2.8%）			
ヒノキヤグループ	0.3	0.6	1,219
ショーボンドホールディングス	1.1	3.3	15,097
ミライト・ホールディングス	4.2	6.8	11,424
タマホーム	1	1.1	1,471
サンヨーホームズ	0.2	0.2	141
日本アクア	0.6	1	593
ファーストコーポレーション	0.5	0.7	413
ベステラ	0.3	0.4	496
ＴＡＴＥＲＵ	1.6	4.7	1,005
スペースバリューホールディングス	1.9	2.8	1,570
ダイセキ環境ソリューション	0.3	0.4	463
第一カッター興業	0.2	0.3	534
明豊ファシリティワークス	－	0.6	472
安藤・間	9.4	13.6	12,743
東急建設	4.4	6.7	5,152
コムシスホールディングス	5.2	8.1	25,636
ミサワホーム	1.2	－	－
ビーアールホールディングス	1.4	2.6	1,250
高松コンストラクショングループ	0.9	1.4	3,840
東建コーポレーション	0.5	0.7	5,271
ソネック	0.1	0.2	162
ヤマウラ	0.6	1	917
大成建設	12.1	17.6	79,024
大林組	36.5	52.7	63,977
清水建設	37.3	53.5	61,204
飛島建設	1.1	1.5	2,137
長谷工コーポレーション	15.2	20.4	30,232
松井建設	1.4	2.1	1,591
錢高組	0.1	0.2	810
鹿島建設	28.5	41.4	58,870
不動テトラ	0.8	1.4	2,412
大末建設	0.5	0.6	592
鉄建建設	0.8	1.1	3,078
西松建設	2.6	4.1	10,098
三井住友建設	8.8	12.7	7,988
大豊建設	0.8	1.2	3,321
前田建設工業	8.7	13.2	14,968
佐田建設	0.9	1.2	560
ナカノフドー建設	1.1	1.5	708
奥村組	2	2.9	8,581
東鉄工業	1.5	2.3	7,337
イチケン	0.2	0.4	708
富士ピー・エス	0.5	0.8	452
淺沼組	0.4	0.6	2,883
戸田建設	14.2	21.9	15,811
熊谷組	1.7	2.4	7,632
青木あすなろ建設	0.7	－	－
北野建設	0.3	0.3	755
植木組	0.1	0.2	500
矢作建設工業	1.7	2.3	1,899
ピーエス三菱	1.4	1.7	1,212
日本ハウスホールディングス	2.4	3.6	1,746

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大東建託	4.3	6.3	80,860
新日本建設	1.5	2.2	2,006
ＮＩＰＰＯ	3.3	4.4	11,990
東亜道路工業	0.2	0.3	1,045
前田道路	3.8	5.6	20,328
日本道路	0.3	0.5	3,675
東亜建設工業	1.1	1.6	2,617
日本国土開発	－	3.1	1,903
若築建設	0.6	0.9	1,532
東洋建設	4.5	5.9	3,292
五洋建設	14.5	20.9	13,898
世紀東急工業	1.8	2.5	2,410
福田組	0.4	0.6	2,913
住友林業	8.6	13.4	20,649
日本基礎技術	1.3	1.8	711
巴コーポレーション	1.6	2.3	998
大和ハウス工業	33.7	52.2	182,439
ライト工業	2.4	3	4,743
積水ハウス	37.3	57.7	140,268
日特建設	1.1	1.4	1,208
北陸電気工事	0.7	0.9	1,010
ユアテック	2	3	2,010
四電工	0.2	0.3	858
中電工	1.6	2.1	5,241
関電工	5.5	7.5	7,657
きんでん	8.1	12.5	20,812
東京エネシス	1.3	1.7	1,504
トーエネック	0.3	0.5	1,895
住友電設	0.8	1.5	4,107
日本電設工業	2.1	2.9	6,452
協和エクシオ	4.8	8	22,088
新日本空調	1	1.4	2,899
九電工	2.4	3.7	12,062
三機工業	2.8	3.8	5,776
日揮ホールディングス	10.5	16.2	26,535
中外炉工業	0.3	0.6	1,051
ヤマト	1.2	1.7	1,511
太平電業	0.8	1.3	3,030
高砂熱学工業	3.1	4.6	8,822
三晃金属工業	0.1	0.2	523
朝日工業社	0.2	0.4	1,368
明星工業	2.3	3.4	3,049
大氣社	1.7	2.6	9,828
ダイダン	0.8	1.3	3,354
日比谷総合設備	1.2	1.7	3,233
東芝プラントシステム	2.6	－	－
ＯＳＪＢホールディングス	5.4	8.3	2,282
東洋エンジニアリング	1.4	2.2	1,339
千代田化工建設	8.8	－	－
レイズネクスト	2.2	2.8	3,794
食料品（3.8%）			
日本製粉	3.6	4.9	8,143
日清製粉グループ本社	12.2	19.1	34,284
日東富士製粉	0.1	0.1	622
昭和産業	1	1.5	4,530
鳥越製粉	1	1.5	1,252
中部飼料	1.4	2.1	3,437
フィード・ワン	7.3	11.3	2,034
東洋精糖	0.2	0.3	361
日本甜菜製糖	0.6	0.9	1,710
三井製糖	0.9	1.5	3,216
塩水港精糖	1.3	1.8	394
日新製糖	0.5	0.8	1,602
森永製菓	2.7	4	21,040
中村屋	0.3	0.4	1,652
江崎グリコ	3.2	5	23,600
名糖産業	0.5	0.8	1,108
井村屋グループ	0.5	0.7	1,323
不二家	0.6	0.9	1,922
山崎製パン	8.8	12.6	26,069
第一屋製パン	0.2	0.3	274
モロゾフ	0.2	0.2	1,020
亀田製菓	0.7	1	4,925
寿スピリッツ	1.1	1.6	12,400
カルビー	4.9	7.7	28,182
森永乳業	2.2	3.1	13,206

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
六甲バター	0.8	1.1	1,797
ヤクルト本社	8	11.6	68,092
明治ホールディングス	7.7	11.2	87,584
雪印メグミルク	2.6	4.1	10,245
プリマハム	1.5	2.6	6,307
日本ハム	4.7	6.4	30,528
林兼産業	0.4	0.6	412
丸大食品	1.2	1.8	3,832
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1	1.3	3,482
柿安本店	－	0.6	1,950
伊藤ハム米久ホールディングス	7	10.8	7,538
サッポロホールディングス	4	5.8	15,532
アサヒグループホールディングス	22.9	35.3	180,065
キリンホールディングス	49.4	71.6	176,171
宝ホールディングス	8.1	12.6	12,348
オエノンホールディングス	3.1	4.4	1,676
養命酒製造	0.3	0.5	994
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	8.4	11.8	33,134
サントリー食品インターナショナル	7.3	11.3	51,923
ダイドーグループホールディングス	0.6	0.9	3,834
伊藤園	3.7	5.1	27,234
キーコーヒー	1.1	1.7	3,865
ユニカフェ	0.3	0.5	483
ジャパンフーズ	0.1	0.2	257
日清オイリオグループ	1.4	2.2	8,140
不二製油グループ本社	2.7	4.1	11,689
かどや製油	0.1	0.1	384
Ｊ－オイルミルズ	0.6	0.9	3,712
キッコーマン	7.2	12.1	63,888
味の素	24.1	37.3	66,990
キユーピー	6.1	9.4	21,808
ハウス食品グループ本社	4.2	6.3	23,436
カゴメ	4.4	6.4	17,203
焼津水産化学工業	0.5	0.8	820
アリアケジャパン	1	1.5	11,205
ピエトロ	0.1	0.2	327
エバラ食品工業	0.2	0.4	882
やまみ	－	0.1	228

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニチレイ	5.7	8	20,840
東洋水産	5.6	8.7	39,019
イートアンド	0.4	0.6	1,123
大冷	0.1	0.2	389
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.3	0.9	919
日清食品ホールディングス	4.7	7.2	59,760
永谷園ホールディングス	0.6	0.8	1,716
一正蒲鉾	0.4	0.7	686
フジッコ	1.2	1.8	3,461
ロック・フィールド	1.2	1.8	2,615
日本たばこ産業	63	97.4	225,675
ケンコーマヨネーズ	0.6	0.9	2,189
わらべや日洋ホールディングス	0.7	1.1	2,061
なとり	0.6	0.9	1,531
イフジ産業	0.2	0.2	148
ピックルスコーポレーション	0.3	0.4	1,043
北の達人コーポレーション	4.3	5.9	3,575
ユーグレナ	4.6	7.2	5,306
ミヨシ油脂	0.4	0.6	705
理研ビタミン	0.5	0.8	3,160
繊維製品（0.6%）			
片倉工業	1.3	2.4	2,988
グンゼ	0.7	1.2	5,472
東洋紡	4.5	6.5	9,873
ユニチカ	3.1	4.8	1,598
富士紡ホールディングス	0.6	0.8	3,216
倉敷紡績	1	1.7	3,967
シキボウ	0.6	0.9	1,266
日本毛織	3.5	5.4	5,772
ダイトウボウ	1.7	2.3	197
トーア紡コーポレーション	0.5	0.7	357
ダイドーリミテッド	1.3	2.2	607
帝国繊維	1.2	1.8	4,260
帝人	8.7	13.4	26,585
東レ	82.6	119.2	86,491
サカイオーベックス	0.3	0.4	741
住江織物	0.3	0.5	1,205
日本フエルト	0.6	1	494

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イチカワ	0.1	0.2	290
日東製網	0.1	0.2	342
アツギ	0.9	1.4	1,180
ダイニック	0.4	0.6	483
セーレン	2.6	4	5,620
ソトー	0.4	0.7	679
東海染工	0.1	0.2	226
小松マテーレ	1.7	2.7	2,025
ワコールホールディングス	3.1	4.3	12,663
ホギメディカル	1.3	1.9	7,372
レナウン	3.1	4.3	473
クラウディアホールディングス	0.2	0.4	192
ＴＳＩホールディングス	3.9	5.5	2,997
マツオカコーポレーション	0.3	0.5	1,015
ワールド	1	2.3	5,632
三陽商会	0.6	0.9	1,149
ナイガイ	0.4	0.6	267
オンワードホールディングス	6.4	9.9	6,237
ルックホールディングス	0.4	0.6	645
キムラタン	5.2	8.6	249
ゴールドウイン	0.9	3	19,980
デサント	2.6	3.2	5,721
キング	0.6	0.8	451
ヤマトインターナショナル	0.7	1	403
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	0.7	1	3,960
王子ホールディングス	47.9	68.8	39,560
日本製紙	5.1	7.3	13,271
三菱製紙	1.7	2	924
北越コーポレーション	7.1	10.9	5,711
中越パルプ工業	0.5	0.7	1,117
巴川製紙所	0.3	0.5	430
大王製紙	5.2	7.2	10,425
阿波製紙	0.3	0.4	228
レンゴー	11	15.6	12,417
トーモク	0.7	1	1,780
ザ・パック	0.8	1.2	4,584

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
化学（7.1%）			
クラレ	18	25.9	34,213
旭化成	75.7	109.1	123,173
共和レザー	0.7	0.9	717
昭和電工	7.1	11.7	31,402
住友化学	83.8	121	57,717
住友精化	0.5	0.7	2,233
日産化学	6.5	9.2	41,630
ラサ工業	0.5	0.6	877
クレハ	1	1.4	9,128
多木化学	0.3	0.5	2,170
テイカ	0.9	1.2	2,306
石原産業	2	3	2,817
片倉コープアグリ	0.3	0.5	612
日東エフシー	0.7	—	—
日本曹達	1.7	2.4	7,248
東ソー	16.5	25.5	40,851
トクヤマ	3.1	4.7	12,492
セントラル硝子	2.3	3.4	8,299
東亞合成	6.7	10.3	12,545
大阪ソーダ	1.1	1.7	5,098
関東電化工業	2.5	3.9	3,962
デンカ	4.2	6	18,060
信越化学工業	18.8	28.3	350,778
日本カーバイド工業	0.4	0.6	827
堺化学工業	0.8	1.1	2,448
第一稀元素化学工業	1	1.8	1,672
エア・ウォーター	8.7	15.3	23,301
大陽日酸	8.8	15.8	37,935
日本化学工業	0.4	0.5	1,627
東邦アセチレン	0.1	0.3	409
日本パーカライジング	5.8	8.3	9,578
高圧ガス工業	1.7	2.6	2,087
チタン工業	0.1	0.2	503
四国化成工業	1.9	2.5	3,152
戸田工業	0.2	0.4	836
ステラ　ケミファ	0.6	0.9	2,812
保土谷化学工業	0.5	0.6	2,388

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本触媒	1.8	2.6	16,822
大日精化工業	0.9	1.5	4,440
カネカ	2.8	4.3	14,534
三菱瓦斯化学	11	15.5	25,869
三井化学	9.7	15	36,810
ＪＳＲ	10.7	15.3	30,645
東京応化工業	1.8	2.8	13,398
大阪有機化学工業	1.1	1.5	2,802
三菱ケミカルホールディングス	71.2	110.1	87,760
ＫＨネオケム	1.6	2.9	6,643
ダイセル	16.5	22.5	23,242
住友ベークライト	1.8	2.6	10,790
積水化学工業	23.3	35.4	66,622
日本ゼオン	9.6	14.9	18,759
アイカ工業	3.2	4.9	17,027
宇部興産	5.4	8.3	18,625
積水樹脂	1.8	3	6,777
タキロンシーアイ	2.3	3.5	2,488
旭有機材	0.7	0.9	1,522
日立化成	4.9	7.6	34,922
ニチバン	0.6	0.9	1,557
リケンテクノス	2.9	4.1	2,021
大倉工業	0.5	0.8	1,423
積水化成品工業	1.6	2.2	1,700
群栄化学工業	0.3	0.4	1,001
タイガースポリマー	0.6	0.9	525
ミライアル	0.3	0.6	779
ダイキアクシス	0.4	0.6	523
ダイキョーニシカワ	2.2	3.5	2,674
竹本容器	0.4	0.6	541
森六ホールディングス	0.6	0.9	2,016
日本化薬	6.8	10.2	13,168
カーリットホールディングス	1.1	1.7	994
日本精化	0.9	1.3	1,852
扶桑化学工業	1.1	1.7	5,414
トリケミカル研究所	0.3	0.4	4,268
ＡＤＥＫＡ	5.2	7.6	12,342
日油	4.1	6.2	21,638

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
新日本理化	1.9	2.7	531
ハリマ化成グループ	0.9	1.4	1,586
花王	26.4	40.3	366,730
第一工業製薬	0.4	0.6	2,598
石原ケミカル	0.2	0.4	782
日華化学	0.4	0.6	516
ニイタカ	0.2	0.3	838
三洋化成工業	0.7	1	5,210
有機合成薬品工業	0.8	1.2	345
大日本塗料	1.2	1.9	2,183
日本ペイントホールディングス	8.8	13.6	70,040
関西ペイント	12	18.5	48,266
神東塗料	0.8	1.3	274
中国塗料	3.5	4.7	4,949
日本特殊塗料	0.8	1.2	1,598
藤倉化成	1.4	2.2	1,234
太陽ホールディングス	0.9	1.2	5,556
ＤＩＣ	4.8	7	20,496
サカタインクス	2.3	3.6	4,053
東洋インキＳＣホールディングス	2.3	3.5	8,757
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	0.8	1.3	1,287
富士フイルムホールディングス	22.6	32.2	182,123
資生堂	21.6	33.4	235,804
ライオン	15.1	21.9	45,792
高砂香料工業	0.7	1.1	2,633
マンダム	2.4	3.8	10,959
ミルボン	1.3	2.2	13,596
ファンケル	4.8	6.8	19,019
コーセー	1.8	3.2	48,192
コタ	0.5	0.9	1,436
シーズ・ホールディングス	1.3	－	－
シーボン	0.1	0.1	248
ポーラ・オルビスホールディングス	4.6	7.2	16,999
ノエビアホールディングス	0.7	1.6	8,736
アジュバンコスメジャパン	0.2	0.4	396
エステー	0.8	1.1	1,806
アグロ　カネショウ	0.4	0.5	732
コニシ	1.9	2.8	4,424

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
長谷川香料	1.3	2.2	4,952
星光ＰＭＣ	0.7	1	958
小林製薬	3	4.7	41,642
荒川化学工業	1	1.5	2,304
メック	0.7	1.2	1,795
日本高純度化学	0.3	0.5	1,314
タカラバイオ	2.8	4.4	9,218
ＪＣＵ	1.4	2	6,580
新田ゼラチン	0.7	1.1	732
ＯＡＴアグリオ	0.1	0.3	420
デクセリアルズ	2.8	4.3	4,278
アース製薬	0.8	1.3	7,488
北興化学工業	1.1	1.8	1,144
大成ラミック	0.3	0.6	1,708
クミアイ化学工業	4.5	6.9	6,196
日本農薬	2.6	3	1,737
アキレス	0.8	1.2	2,102
有沢製作所	1.7	2.7	2,767
日東電工	8.2	11.6	70,992
レック	1.2	1.8	2,181
三光合成	0.8	2	734
きもと	1.8	2.9	510
藤森工業	1	1.5	5,077
前澤化成工業	0.7	1.1	1,276
未来工業	－	0.9	1,975
ウェーブロックホールディングス	0.2	0.6	475
ＪＳＰ	0.6	1	1,965
エフピコ	0.9	1.8	11,448
天馬	0.8	1.1	2,184
信越ポリマー	2	3	3,102
東リ	2.7	4.2	1,226
ニフコ	4.4	6.2	17,719
バルカー	0.9	1.4	3,572
ユニ・チャーム	23	32.4	120,204
ショーエイコーポレーション	－	0.2	164
医薬品（6.1%）			
協和キリン	13.6	16.9	44,835
武田薬品工業	43	139.9	601,150
アステラス製薬	100.4	147.9	279,604
大日本住友製薬	8.1	12.5	25,287
塩野義製薬	14.3	21.5	143,856
田辺三菱製薬	11.4	－	－
わかもと製薬	1.3	2	554
あすか製薬	1.3	1.9	2,299
日本新薬	2.8	4.4	43,560
ビオフェルミン製薬	0.2	0.3	698
中外製薬	11.3	17.5	185,587
科研製薬	2	2.9	16,965
エーザイ	13	20.1	165,724
ロート製薬	5.6	8.6	27,305
小野薬品工業	25.7	38.6	99,414
久光製薬	3.2	4.4	25,652
持田製薬	0.8	2.3	9,706
参天製薬	20.6	31.3	65,510
扶桑薬品工業	0.4	0.6	1,152
日本ケミファ	0.1	0.2	599
ツムラ	3.4	5.2	15,964
日医工	2.8	4.8	6,446
キッセイ薬品工業	1.9	3	9,150
生化学工業	2.1	3.3	3,900
栄研化学	1.9	3	6,981
日水製薬	0.5	0.7	937
鳥居薬品	0.6	1.1	4,152
ＪＣＲファーマ	0.8	1.2	11,460
東和薬品	0.5	2.2	5,702
富士製薬工業	0.7	1.1	1,727
沢井製薬	2.2	3.5	25,375
ゼリア新薬工業	2.2	3.1	6,190
第一三共	31.1	48.1	359,258
キョーリン製薬ホールディングス	2.4	3.7	7,414
大幸薬品	0.5	0.7	3,094
ダイト	0.6	1	3,610
大塚ホールディングス	20.7	32	156,224
大正製薬ホールディングス	2.4	3.6	28,440
ペプチドリーム	5	8.5	45,815

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	10.2	14.1	1,085
昭和シェル石油	10.1	－	－
ニチレキ	1.4	2	2,688
ユシロ化学工業	0.6	0.9	1,215
ビーピー・カストロール	0.4	0.6	864
富士石油	2.9	4.7	1,085
ＭＯＲＥＳＣＯ	0.4	0.6	849
出光興産	8.4	18.9	53,902
ＪＸＴＧホールディングス	182.9	252.9	121,341
コスモエネルギーホールディングス	3.1	4.9	10,878
ゴム製品（0.7%）			
横浜ゴム	6.3	9.7	18,565
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	5.6	9.7	13,453
ブリヂストン	33.4	51.7	201,371
住友ゴム工業	9.8	15.1	18,150
藤倉コンポジット	0.9	1.5	667
オカモト	0.8	1	3,850
フコク	0.5	0.8	576
ニッタ	1.2	1.9	5,757
住友理工	2.1	3.3	2,887
三ツ星ベルト	1.4	2.2	4,226
バンドー化学	2.1	2.9	2,438
ガラス・土石製品（0.8%）			
日東紡績	1.6	2.5	12,437
ＡＧＣ	10.7	16.6	64,491
日本板硝子	5.2	8	5,176
石塚硝子	0.1	0.3	773
日本山村硝子	0.5	0.7	864
日本電気硝子	4.7	6.8	15,102
オハラ	0.4	0.7	912
住友大阪セメント	2.2	3.2	14,560
太平洋セメント	6.9	10.6	31,959
日本ヒューム	1.1	1.7	1,375
日本コンクリート工業	2.3	3.8	1,067
三谷セキサン	0.5	0.8	3,044
アジアパイルホールディングス	1.5	2.4	1,360
東海カーボン	9.9	17.6	17,494
日本カーボン	0.5	0.9	3,433
東洋炭素	0.6	1	2,096
ノリタケカンパニーリミテド	0.7	0.9	3,978
ＴＯＴＯ	8.4	12	55,560
日本碍子	13.3	20.5	38,991
日本特殊陶業	9.2	13.1	26,396
ダントーホールディングス	0.9	1.4	158
ＭＡＲＵＷＡ	0.4	0.6	5,118
品川リフラクトリーズ	0.3	0.4	1,252
黒崎播磨	0.2	0.3	1,956
ヨータイ	0.9	1.4	994
イソライト工業	0.6	0.9	575
東京窯業	1.4	2.2	719
ニッカトー	0.5	0.8	568
フジミインコーポレーテッド	1	1.5	4,620
クニミネ工業	0.4	0.7	920
エーアンドエーマテリアル	0.2	0.3	477
ニチアス	3	4.6	12,479
ニチハ	1.5	2.3	5,773
鉄鋼（0.8%）			
日本製鉄	49.9	74.4	117,886
神戸製鋼所	20.1	30.4	15,990
中山製鋼所	1.5	2.4	1,207
合同製鐵	0.5	0.9	2,364
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	29.2	44.9	61,962
東京製鐵	5.7	8.1	6,698
共英製鋼	1.2	1.9	3,914
大和工業	2.3	3.5	9,135
東京鐵鋼	0.4	0.7	1,051
大阪製鐵	0.7	0.9	1,399
淀川製鋼所	1.4	2.2	4,323
丸一鋼管	3.9	5.4	16,443
モリ工業	0.3	0.5	1,235
大同特殊鋼	1.8	2.7	11,758
日本高周波鋼業	0.4	0.6	261
日本冶金工業	8.8	1.4	3,038
山陽特殊製鋼	1.4	1.2	1,866
愛知製鋼	0.6	0.9	3,199

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日立金属	11.6	17.9	31,163
日本金属	0.2	0.4	346
大平洋金属	0.7	1.1	2,307
新日本電工	6.3	10.6	1,685
栗本鐵工所	0.5	0.8	1,692
虹技	0.1	0.3	423
日本鋳鉄管	0.1	0.2	364
三菱製鋼	0.8	1.2	1,212
日亜鋼業	1.5	2.6	956
日本精線	0.2	0.3	1,116
エンビプロ・ホールディングス	0.2	0.7	548
シンニッタン	1.6	2.7	1,260
新家工業	0.2	0.4	576
非鉄金属（0.7%）			
大紀アルミニウム工業所	1.8	2.7	1,971
日本軽金属ホールディングス	29.3	42.1	8,798
三井金属鉱業	2.9	4.5	11,839
東邦亜鉛	0.6	0.9	1,669
三菱マテリアル	7.1	11	30,932
住友金属鉱山	14.7	21.3	68,032
ＤＯＷＡホールディングス	2.5	4.2	16,842
古河機械金属	1.8	3	4,062
エス・サイエンス	4.8	7.9	363
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.2	1.7	2,436
東邦チタニウム	1.9	3	2,640
ＵＡＣＪ	1.6	2.5	5,517
ＣＫサンエツ	0.2	0.3	990
古河電気工業	3.1	5.2	13,868
住友電気工業	40.2	62.2	96,316
フジクラ	13	20	8,040
昭和電線ホールディングス	1.2	1.9	2,661
東京特殊電線	0.1	0.2	495
タツタ電線	2.1	3.3	1,983
カナレ電気	0.2	0.3	543
平河ヒューテック	0.4	0.6	901
リョービ	1.3	2	3,626
アーレスティ	1.3	2.2	1,159
アサヒホールディングス	2	2.9	8,302

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	0.6	0.9	1,249
宮地エンジニアリンググループ	0.3	0.5	992
トーカロ	2.8	4.6	5,432
アルファＣｏ	0.4	0.6	790
ＳＵＭＣＯ	11.9	19.9	36,377
川田テクノロジーズ	0.2	0.3	1,908
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	0.2	0.5	1,557
信和	－	0.7	773
東洋製罐グループホールディングス	6.8	10.6	19,991
ホッカンホールディングス	0.5	0.9	1,710
コロナ	0.6	0.9	926
横河ブリッジホールディングス	2	3.1	5,868
駒井ハルテック	0.2	0.3	564
高田機工	0.1	0.2	540
三和ホールディングス	11.1	15.9	19,111
文化シヤッター	3.2	4.9	4,326
三協立山	1.5	2.3	3,217
アルインコ	0.9	1.2	1,459
東洋シヤッター	0.2	0.4	312
ＬＩＸＩＬグループ	15.9	24.5	45,864
日本フイルコン	0.8	1.3	716
ノーリツ	2.4	3.4	4,613
長府製作所	1.1	1.7	3,927
リンナイ	1.9	3.2	25,632
ダイニチ工業	0.6	0.9	611
日東精工	1.5	2.3	1,375
三洋工業	0.1	0.2	393
岡部	2.2	3.4	2,920
ジーテクト	1.2	2.1	3,465
中国工業	0.2	－	－
東プレ	2	3.1	5,223
高周波熱錬	2.1	3.2	2,752
東京製綱	0.7	1.2	1,335
サンコール	0.6	1	534
モリテック　スチール	0.8	1.3	478
パイオラックス	1.7	2.5	4,977
エイチワン	1.1	1.7	1,278

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本発條	10.7	17.8	16,340
中央発條	0.1	0.2	596
アドバネクス	0.1	0.3	508
立川ブラインド工業	0.5	0.7	861
三益半導体工業	0.8	1.5	3,744
機械（5.1%）			
日本ドライケミカル	0.3	0.4	725
日本製鋼所	3.2	5	10,460
三浦工業	4.6	7.2	28,116
タクマ	3.9	5.6	6,815
ツガミ	2.4	3.4	3,624
オークマ	1.4	1.9	9,899
東芝機械	1.2	1.9	6,393
アマダホールディングス	16.6	21.1	25,298
アイダエンジニアリング	3	4.3	3,904
滝澤鉄工所	0.3	0.5	677
ＦＵＪＩ	3.2	7.1	12,843
牧野フライス製作所	1.3	1.9	8,455
オーエスジー	5.2	7.7	14,930
ダイジェット工業	0.1	0.2	290
旭ダイヤモンド工業	2.8	4.3	2,627
ＤＭＧ森精機	6.7	10.5	16,800
ソディック	2.3	3.9	3,607
ディスコ	1.4	2.3	61,456
日東工器	0.6	0.9	2,085
日進工具	0.3	0.5	1,429
パンチ工業	0.7	1.6	774
冨士ダイス	0.5	0.8	603
豊和工業	0.6	0.9	799
ＯＫＫ	0.4	0.7	434
石川製作所	0.3	0.4	676
東洋機械金属	0.8	1.2	649
津田駒工業	0.2	0.3	337
エンシュウ	0.3	0.4	506
島精機製作所	1.5	2.7	5,948
オプトラン	1	1.9	6,051
ＮＣホールディングス	0.3	0.5	321
イワキポンプ	－	0.8	959

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フリュー	0.9	1.6	1,889
ヤマシンフィルタ	1.9	3.6	2,750
日阪製作所	1.3	2	1,836
やまびこ	2.1	3.2	3,539
平田機工	0.5	0.8	5,256
ベガサスミシン製造	1	1.8	896
マルマエ	0.3	0.7	689
タツモ	0.3	0.8	1,088
ナブテスコ	5.9	9.8	32,536
三井海洋開発	1.1	1.8	4,581
レオン自動機	1.1	1.6	2,451
ＳＭＣ	3.2	5.3	262,827
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	0.8	1.5	781
ホソカワミクロン	0.4	0.6	3,018
ユニオンツール	0.5	0.6	1,908
オイレス工業	1.5	2.1	3,280
日精エー・エス・ビー機械	0.3	0.6	2,406
サトーホールディングス	1.3	2.4	7,644
技研製作所	0.7	1.5	7,155
日本エアーテック	0.3	0.5	514
カワタ	0.2	0.5	488
日精樹脂工業	0.9	1.4	1,362
オカダアイヨン	0.4	0.5	617
ワイエイシイホールディングス	0.4	0.8	535
小松製作所	49.2	76.2	195,605
住友重機械工業	6.2	9.6	28,416
日立建機	4.4	6.7	21,239
日工	0.3	2.3	1,876
巴工業	0.5	0.7	1,551
井関農機	1.1	1.7	2,509
ＴＯＷＡ	0.9	1.7	1,817
丸山製作所	0.2	0.4	490
北川鉄工所	0.5	0.8	1,826
ローツェ	0.5	0.7	3,160
タカキタ	0.4	0.6	364
クボタ	58.3	89.2	155,252
荏原実業	0.3	0.4	876
三菱化工機	0.4	0.6	1,086

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
月島機械	2.2	3.1	4,730
帝国電機製作所	0.8	1.4	1,925
東京機械製作所	0.4	0.7	255
新東工業	2.6	4	3,780
澁谷工業	1	1.5	4,665
アイチ　コーポレーション	1.9	2.9	2,314
小森コーポレーション	2.9	4.3	4,588
鶴見製作所	0.8	1.3	2,327
住友精密工業	0.2	0.2	633
日本ギア工業	－	0.5	199
酒井重工業	0.2	0.3	806
荏原製作所	4.8	7	21,980
石井鐵工所	0.2	0.2	555
西島製作所	1.1	1.7	1,496
北越工業	1.1	1.7	2,218
ダイキン工業	14.8	21.4	337,692
オルガノ	0.4	0.6	4,440
トーヨーカネツ	0.4	0.7	1,564
栗田工業	5.9	9.1	29,438
椿本チエイン	1.4	2.4	8,532
大同工業	0.5	0.8	636
木村化工機	0.9	1.4	877
アネスト岩田	1.7	2.6	2,600
ダイフク	6	8.6	61,060
サムコ	0.3	0.5	1,060
加藤製作所	0.6	0.9	1,420
油研工業	0.2	0.3	514
タダノ	5.2	8.1	7,784
フジテック	4	6.1	11,083
ＣＫＤ	3	4.7	8,760
キトー	0.8	1.3	2,210
平和	3	4.7	10,706
理想科学工業	1	1.5	2,821
ＳＡＮＫＹＯ	2.7	3.7	13,653
日本金銭機械	1.2	1.9	1,613
マースグループホールディングス	0.7	1.1	2,187
フクシマガリレイ	0.7	1	4,025
オーイズミ	0.5	0.7	427
ダイコク電機	0.5	0.8	1,282
竹内製作所	1.8	2.8	5,392
アマノ	3.1	4.4	14,366
ＪＵＫＩ	1.5	2.3	1,826
サンデンホールディングス	1.3	2.2	1,513
蛇の目ミシン工業	1	1.6	649
マックス	1.7	2.6	5,392
グローリー	3	4.3	13,910
新晃工業	1	1.6	2,776
大和冷機工業	1.6	2.4	2,776
セガサミーホールディングス	10.8	16.7	25,784
日本ピストンリング	0.4	0.6	898
リケン	0.5	0.8	2,980
ＴＰＲ	1.5	2.3	4,326
ツバキ・ナカシマ	1.6	3.4	4,484
ホシザキ	3.2	4.9	49,245
大豊工業	0.9	1.4	1,072
日本精工	22.3	31.7	29,544
ＮＴＮ	23.4	38.8	12,222
ジェイテクト	10.4	16.1	19,336
不二越	1	1.6	6,720
日本トムソン	3.2	5	2,310
ＴＨＫ	6.8	9.8	28,870
ユーシン精機	0.8	1.3	1,261
前澤給装工業	0.4	0.6	1,387
イーグル工業	1.3	2.1	2,100
前澤工業	0.8	1.1	434
日本ピラー工業	1.1	1.7	2,567
キッツ	4.4	6.8	4,732
マキタ	13.2	21.9	87,271
日立造船	8.6	13.3	5,439
三菱重工業	18.2	28.2	115,845
ＩＨＩ	8.4	12.1	33,081
スター精密	1.9	2.6	3,796
電気機器（14.8%）			
日清紡ホールディングス	6	11.2	11,065
イビデン	6.7	10.3	26,986
コニカミノルタ	23.8	36.7	25,873

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ブラザー工業	14.2	20.5	46,084
ミネベアミツミ	20.2	31.2	71,292
日立製作所	48.9	80.8	358,994
三菱電機	108.7	168.1	262,488
富士電機	7.1	10.1	33,936
東洋電機製造	0.4	0.7	1,050
安川電機	12.6	18.1	70,499
シンフォニアテクノロジー	1.5	2.2	2,767
明電舎	2.1	3.1	7,201
オリジン	0.3	0.5	803
山洋電気	0.5	0.8	4,192
デンヨー	1	1.4	3,054
東芝テック	1.3	2.1	9,418
芝浦メカトロニクス	0.2	0.3	1,254
マブチモーター	3	4.7	19,481
日本電産	13.1	20.2	296,435
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.6	1	440
トレックス・セミコンダクター	0.4	1	1,548
東光高岳	0.5	0.9	1,056
ダブル・スコープ	1.6	2.7	2,249
宮越ホールディングス	0.4	0.6	563
ダイヘン	1.2	1.8	6,282
田淵電機	1.5	—	—
ヤーマン	1.6	2.4	1,660
ＪＶＣケンウッド	8.2	13.6	3,508
ミマキエンジニアリング	1	1.6	812
第一精工	0.5	0.7	1,672
日新電機	2.5	3.9	5,218
大崎電気工業	2.1	3.3	2,164
オムロン	11.6	15.1	94,375
日東工業	1.7	2.5	5,995
ＩＤＥＣ	1.5	2.4	4,953
正興電機製作所	—	0.4	358
不二電機工業	0.1	0.2	256
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	3.9	5.6	12,824
サクサホールディングス	0.3	0.4	862
メルコホールディングス	0.5	0.6	1,666
テクノメディカ	0.2	0.4	822

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	—	0.3	298
日本電気	14.1	20.4	103,428
富士通	10.5	16.2	174,798
沖電気工業	4.7	6.8	9,499
岩崎通信機	0.5	0.8	657
電気興業	0.6	0.8	2,956
サンケン電気	1.3	1.8	5,380
ナカヨ	0.2	0.3	501
アイホン	0.6	1	1,710
ルネサスエレクトロニクス	11.3	80.3	60,465
セイコーエプソン	13.5	20.9	34,025
ワコム	7.9	11.2	4,636
アルバック	2.5	3.3	14,272
アクセル	0.5	0.7	623
ＥＩＺＯ	1	1.3	4,719
ジャパンディスプレイ	25.7	48.3	3,429
日本信号	2.8	4.3	6,106
京三製作所	2.3	3.9	2,293
能美防災	1.4	2.2	5,458
ホーチキ	0.7	1.2	1,878
星和電機	0.4	0.9	494
エレコム	1	1.8	8,217
パナソニック	124.2	192.1	213,327
シャープ	10.8	19.5	31,102
アンリツ	7	10.8	23,446
富士通ゼネラル	3.3	4.6	11,624
ソニー	72.9	106.3	836,049
ＴＤＫ	5.7	8.1	100,683
帝国通信工業	0.5	0.7	867
タムラ製作所	4.2	5.6	3,864
アルプスアルパイン	11.3	14.9	34,910
池上通信機	0.3	0.5	613
パイオニア	16.5	—	—
日本電波工業	1	1.6	846
鈴木	0.5	0.9	687
日本トリム	0.2	0.2	937
ローランド　ディー．ジー．	0.6	0.9	1,825
フォスター電機	1.3	1.8	3,249

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クラリオン	0.8	－	－
ＳＭＫ	0.3	0.4	1,202
ヨコオ	0.8	1.1	3,476
ティアック	0.8	1.1	228
ホシデン	3.2	4.6	6,085
ヒロセ電機	1.6	2.6	36,764
日本航空電子工業	2.5	3.9	8,435
ＴＯＡ	1.2	1.8	2,055
マクセルホールディングス	2.3	3.6	5,508
古野電気	1.4	2.2	2,492
ユニデンホールディングス	0.3	0.5	1,052
スミダコーポレーション	0.9	1.3	1,480
アイコム	0.6	0.9	2,293
リオン	0.5	0.7	2,607
本多通信工業	0.9	1.5	832
船井電機	1.1	1.7	1,122
横河電機	10.9	15.4	30,800
新電元工業	0.4	0.6	2,112
アズビル	7	10.6	32,118
東亜ディーケーケー	0.5	0.8	796
日本光電工業	4.8	6.9	21,631
チノー	0.4	0.6	858
共和電業	1.1	1.8	779
日本電子材料	0.4	0.7	718
堀場製作所	2.2	3.3	23,496
アドバンテスト	7.4	12.5	75,750
小野測器	0.5	0.7	389
エスペック	1	1.5	3,360
キーエンス	5.3	15.2	594,624
日置電機	0.6	0.9	3,559
シスメックス	8.5	12	95,700
日本マイクロニクス	1.8	2.9	4,013
メガチップス	0.9	1.6	2,867
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	0.6	0.9	3,168
澤藤電機	0.1	0.2	444
原田工業	0.3	0.8	792
コーセル	1.5	2.1	2,578
イリソ電子工業	1	1.4	6,090
オプテックスグループ	1.9	2.8	4,538
千代田インテグレ	0.5	0.8	1,653
アイ・オー・データ機器	0.5	0.6	624
レーザーテック	2.2	6.9	40,917
スタンレー電気	7.7	11.8	35,022
岩崎電気	0.4	0.7	1,003
ウシオ電機	6.6	9.8	16,444
岡谷電機産業	0.8	1.3	488
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1	1.6	708
エノモト	0.2	0.5	624
日本セラミック	1.1	1.7	4,324
遠藤照明	0.5	0.9	642
古河電池	0.8	1.2	925
双信電機	0.5	0.8	360
山一電機	0.8	1.2	2,124
図研	0.7	1.1	2,904
日本電子	2.1	3.3	12,358
カシオ計算機	9.6	14.9	33,614
ファナック	10.3	16	320,000
日本シイエムケイ	2.8	3.9	2,148
エンプラス	0.5	0.9	2,821
大真空	0.4	0.6	1,234
ローム	5.3	7.5	66,000
浜松ホトニクス	7.8	12.1	57,293
三井ハイテック	1.2	1.9	3,243
新光電気工業	3.6	5.6	7,420
京セラ	16.6	23.7	180,404
太陽誘電	4.8	7.5	25,875
村田製作所	11.4	49.4	325,595
ユーシン	1.5	－	－
双葉電子工業	1.8	2.7	3,531
北陸電気工業	0.4	0.7	887
ニチコン	3.4	5.7	5,933
日本ケミコン	0.8	1.3	2,334
ＫＯＡ	1.6	2.5	3,362
市光工業	1.6	2.5	1,815
小糸製作所	6.5	10.1	48,631
ミツバ	2	3.1	2,098

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	1.9	2.9	22,330
キヤノン電子	1	1.8	3,871
キヤノン	58.5	90.5	274,034
リコー	32.7	42.8	54,313
象印マホービン	2	4.9	10,784
ＭＵＴＯＨホールディングス	0.1	0.2	345
東京エレクトロン	7.2	11.2	274,288
輸送用機器（7.6%）			
トヨタ紡織	3.8	4.9	8,045
芦森工業	0.2	0.3	421
ユニプレス	2.1	3.3	4,689
豊田自動織機	8.8	13.6	85,408
モリタホールディングス	1.9	2.9	5,040
三櫻工業	1.4	2.1	2,228
デンソー	23.9	37	172,087
東海理化電機製作所	2.9	4.4	8,712
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	3.9	6.1	6,051
川崎重工業	8.5	13.1	29,540
名村造船所	3.3	5.4	1,344
サノヤスホールディングス	1.4	2.2	398
日本車輌製造	0.4	0.6	1,869
三菱ロジスネクスト	1.3	2.2	3,746
近畿車輛	0.2	0.3	501
日産自動車	128.2	198.3	118,523
いすゞ自動車	34.4	48.7	55,055
トヨタ自動車	121.1	187.6	1,454,275
日野自動車	13.6	21	22,512
三菱自動車工業	40.2	62.2	26,061
エフテック	0.8	1.2	927
レシップホールディングス	0.4	0.7	464
ＧＭＢ	0.2	0.3	245
ファルテック	0.2	0.3	321
武蔵精密工業	2.6	3.7	4,946
日産車体	2.1	3.3	3,379
新明和工業	5.1	4.5	6,606
極東開発工業	2.2	3.1	4,699
日信工業	2	3.2	7,142
トピー工業	0.9	1.4	2,536
ティラド	0.4	0.6	1,128
曙ブレーキ工業	6	9.2	2,116
タチエス	1.8	2.8	3,718
ＮＯＫ	5.8	9	13,680
フタバ産業	3	4.7	3,247
ＫＹＢ	1.1	1.9	5,696
大同メタル工業	1.8	3.2	2,198
プレス工業	5.4	8.3	3,137
ミクニ	1.4	2.2	750
太平洋工業	2.3	3.5	4,942
ケーヒン	2.5	3.8	9,800
河西工業	1.3	2.3	1,909
アイシン精機	9	13.8	51,267
マツダ	34.1	49.5	46,035
今仙電機製作所	1	1.6	1,452
本田技研工業	91.7	132.4	385,350
スズキ	19.9	33.3	159,840
ＳＵＢＡＲＵ	33.7	52.2	144,333
安永	0.5	0.8	959
ヤマハ発動機	15.4	21.9	45,771
ショーワ	2.6	3.8	8,667
ＴＢＫ	1.3	2.1	968
エクセディ	1.5	2.3	5,152
豊田合成	3.5	5.4	13,883
愛三工業	1.7	2.6	1,885
盟和産業	0.1	0.2	224
日本プラスト	0.9	1.4	949
ヨロズ	1	1.6	2,299
エフ・シー・シー	2	2.7	6,142
シマノ	4.4	6.3	106,596
テイ・エス　テック	2.5	3.9	12,148
ジャムコ	0.5	0.8	1,104
精密機器（2.5%）			
テルモ	15.4	47.6	187,496
クリエートメディック	0.4	0.6	642
日機装	3.6	5	6,665
日本エム・ディ・エム	－	1	2,522
島津製作所	14	20.1	64,320

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＪＭＳ	1	1.5	1,132
クボテック	0.2	0.4	161
長野計器	0.9	1.2	1,213
ブイ・テクノロジー	0.2	0.8	4,032
東京計器	0.8	1.1	1,178
愛知時計電機	0.1	0.2	868
インターアクション	0.6	0.9	2,321
オーバル	1.1	1.5	370
東京精密	2	3	12,780
マニー	1.3	6.7	19,765
ニコン	18.9	27.2	37,046
トプコン	5.8	8.5	13,736
オリンパス	16.2	93	166,005
理研計器	1	1.5	3,241
タムロン	1	1.4	3,389
ＨＯＹＡ	21.9	33.6	369,936
シード	0.5	0.7	709
ノーリツ鋼機	0.9	1.1	1,647
エー・アンド・デイ	1.1	1.5	1,470
朝日インテック	3.9	14.3	44,115
シチズン時計	11.9	19.7	10,775
リズム時計工業	0.3	0.5	454
大研医器	0.9	1.2	843
メニコン	1.5	2.3	11,730
シンシア	0.2	0.2	140
松風	0.5	0.8	1,525
セイコーホールディングス	1.7	2.4	6,847
ニプロ	7.5	11.6	14,616
その他製品（2.3%）			
中本パックス	0.3	0.4	644
スノーピーク	0.4	0.8	824
パラマウントベッドホールディングス	1.3	1.8	8,235
トランザクション	0.6	1.1	1,233
粧美堂	0.3	0.5	196
ニホンフラッシュ	0.5	0.8	2,114
前田工繊	1.2	1.9	4,104
永大産業	1.4	2.3	795
アートネイチャー	1.2	1.8	1,443
バンダイナムコホールディングス	11.2	17.4	111,516
アイフィスジャパン	0.2	0.4	286
共立印刷	1.8	2.8	470
ＳＨＯＥＩ	0.5	0.8	3,880
フランスベッドホールディングス	1.5	2.4	2,282
パイロットコーポレーション	1.9	2.7	11,542
萩原工業	0.6	0.9	1,470
トッパン・フォームズ	2.4	3.6	4,521
フジシールインターナショナル	2.5	3.8	8,854
タカラトミー	4.6	7.5	9,202
廣済堂	0.3	1.2	1,104
エステールホールディングス	0.3	0.5	349
アーク	4.1	6.5	611
タカノ	0.4	0.7	556
プロネクサス	0.9	1.4	1,716
ホクシン	0.7	1.1	182
ウッドワン	0.3	0.6	708
大建工業	0.8	1.1	2,049
凸版印刷	15.3	23.7	53,159
大日本印刷	15.3	22	66,440
図書印刷	1	－	－
共同印刷	0.3	0.5	1,498
ＮＩＳＳＨＡ	2.3	3.5	3,626
光村印刷	0.1	0.1	167
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	0.6	0.8	1,348
アシックス	10.8	13.9	22,976
ツツミ	0.3	0.5	1,098
小松ウオール工業	0.3	0.5	1,089
ヤマハ	6.5	10	60,200
河合楽器製作所	0.3	0.5	1,835
クリナップ	1	1.6	1,094
ピジョン	6.6	10.2	37,893
オリバー	－	0.4	1,266
兼松サステック	0.1	0.1	189
キングジム	0.9	1.4	1,197
リンテック	2.6	4	9,636
イトーキ	2	3.6	1,728
任天堂	6.7	10.3	436,720

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱鉛筆	1.9	2.8	4,485
タカラスタンダード	2.2	3.5	6,678
コクヨ	5.2	8.1	13,203
ナカバヤシ	1.1	1.6	993
グローブライド	0.5	0.8	1,952
オカムラ	3.8	5.9	6,366
美津濃	1.2	1.5	3,945
電気・ガス業（1.5%）			
東京電力ホールディングス	86.8	134.2	57,571
中部電力	33.3	51.4	74,992
関西電力	44.4	63.7	77,363
中国電力	15	23.2	32,572
北陸電力	10.6	15.4	12,520
東北電力	25.5	42	42,000
四国電力	9.8	15.1	14,254
九州電力	22.4	34.6	30,482
北海道電力	10.2	15.7	7,818
沖縄電力	2	3.1	6,243
電源開発	8.6	13.4	33,553
エフオン	0.7	0.8	601
イーレックス	1.9	2.4	3,979
レノバ	1.1	2.8	3,357
東京瓦斯	21.3	32.3	79,458
大阪瓦斯	21.1	32.6	62,494
東邦瓦斯	5.4	8.3	35,399
北海道瓦斯	0.6	0.9	1,454
広島ガス	2.2	3.6	1,260
西部瓦斯	1.2	1.9	4,493
静岡ガス	3.3	4.8	4,286
メタウォーター	0.5	0.8	3,440
陸運業（4.3%）			
ＳＢＳホールディングス	1.2	1.5	2,818
東武鉄道	11.5	17.7	68,587
相鉄ホールディングス	3.7	5.4	15,930
東急	29.5	42.4	82,213
京浜急行電鉄	14.9	21.6	43,480
小田急電鉄	17.4	25	60,050
京王電鉄	6.1	8.7	54,723

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
京成電鉄	8.1	11.7	47,619
富士急行	1.5	2.3	9,039
新京成電鉄	0.3	0.4	992
東日本旅客鉄道	19.4	29.6	293,336
西日本旅客鉄道	9.8	15	139,740
東海旅客鉄道	9.7	14	306,530
西武ホールディングス	13.9	22.6	38,284
鴻池運輸	1.8	2.7	4,239
西日本鉄道	3	4.7	11,839
ハマキョウレックス	0.8	1.3	4,394
サカイ引越センター	0.6	0.9	5,940
近鉄グループホールディングス	10.3	15.9	93,015
阪急阪神ホールディングス	13.7	21.2	95,400
南海電気鉄道	4.6	7.5	21,690
京阪ホールディングス	4.6	7.1	36,139
神戸電鉄	0.2	0.4	1,588
名古屋鉄道	8.2	13.1	42,837
山陽電気鉄道	0.8	1.1	2,316
日本通運	4	5.6	35,728
ヤマトホールディングス	18.1	27.9	48,908
山九	2.9	4.4	24,112
丸運	0.6	1	353
丸全昭和運輸	0.8	1.3	3,841
センコーグループホールディングス	5.7	8.8	7,955
トナミホールディングス	0.2	0.4	2,000
ニッコンホールディングス	3.9	5.7	14,791
日本石油輸送	0.1	0.2	579
福山通運	1.3	2	7,460
セイノーホールディングス	7.7	11.9	17,207
エスライン	0.3	0.5	505
神奈川中央交通	0.2	0.4	1,602
日立物流	2.3	2.9	9,120
丸和運輸機関	0.5	1.7	3,974
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1.1	1.6	2,161
九州旅客鉄道	8.6	14.2	51,049
ＳＧホールディングス	9.7	16.7	39,595
海運業（0.2%）			
日本郵船	8.6	13.3	23,993

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
商船三井	6.1	10.1	27,674
川崎汽船	3.2	4.9	7,526
ＮＳユナイテッド海運	0.6	0.9	1,850
明治海運	1.1	1.7	608
飯野海運	4.9	7.5	2,602
共栄タンカー	0.1	0.3	294
乾汽船	0.9	0.9	1,035
空運業（0.5%）			
日本航空	18.8	28.7	89,945
ＡＮＡホールディングス	18.8	29.1	100,133
パスコ	0.2	0.3	636
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	0.3	0.4	3,220
日新	0.9	1.4	2,450
三菱倉庫	3.6	5.1	14,178
三井倉庫ホールディングス	1.3	1.8	3,421
住友倉庫	3.9	5.9	8,625
澁澤倉庫	0.6	0.9	1,996
東陽倉庫	1.9	2.9	930
日本トランスシティ	2.3	3.5	1,711
ケイヒン	0.2	0.3	390
中央倉庫	0.6	1	1,120
川西倉庫	0.2	0.3	312
安田倉庫	0.8	1.3	1,357
ファイズホールディングス	－	0.3	154
東洋埠頭	0.3	0.5	707
宇徳	0.9	1.4	824
上組	6.4	9.1	21,485
サンリツ	0.2	0.4	296
キムラユニティー	0.3	0.4	450
キユーソー流通システム	0.3	0.4	770
近鉄エクスプレス	1.9	3.4	6,483
東海運	0.6	1	286
エーアイテイー	0.7	1.1	1,101
内外トランスライン	0.3	0.6	760
日本コンセプト	0.3	0.5	767
情報・通信業（8.8%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	1.2	1.6	6,872

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
クロスキャット	－	0.4	502
システナ	3.8	5.9	11,310
デジタルアーツ	0.6	0.8	4,376
日鉄ソリューションズ	1.6	2.5	8,362
キューブシステム	0.7	0.9	722
エイジア	0.3	0.3	400
コア	0.5	0.7	1,043
ソリトンシステムズ	0.6	0.7	857
ソフトクリエイトホールディングス	0.5	0.7	1,215
ＴＩＳ	3.5	5.5	36,520
ネオス	0.4	0.7	540
電算システム	0.4	0.6	1,778
グリー	5.7	11.3	5,231
コーエーテクモホールディングス	2.2	3.4	9,452
三菱総合研究所	0.4	0.7	3,195
ボルテージ	0.2	0.3	158
電算	0.1	0.1	227
ＡＧＳ	0.6	1	815
ファインデックス	0.9	1.4	1,675
ヒト・コミュニケーションズ	0.2	－	－
ブレインパッド	0.2	0.3	1,905
ＫＬａｂ	1.9	3.2	2,601
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1.4	2	1,852
イーブックイニシアティブジャパン	0.2	0.2	406
ネクソン	27	47	69,842
アイスタイル	2.7	4.2	2,045
エムアップ	0.4	0.5	1,400
エイチーム	0.7	1.1	1,112
エニグモ	－	1.2	1,045
テクノスジャパン	0.9	1.3	639
ｅｎｉｓｈ	0.4	0.8	464
コロプラ	3	5.4	6,118
オルトプラス	0.7	1.2	1,069
ブロードリーフ	5.3	8.1	5,103
クロス・マーケティンググループ	0.3	0.7	245
デジタルハーツホールディングス	0.5	0.9	868
システム情報	－	0.8	823
メディアドゥホールディングス	0.3	0.5	1,645

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
じげん	1.1	4.1	2,041
ブイキューブ	0.6	1.1	694
エンカレッジ・テクノロジ	－	0.3	265
サイバーリンクス	0.2	0.3	361
ディー・エル・イー	0.7	1.2	220
フィックスターズ	1	1.8	2,910
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.6	0.8	836
オプティム	0.2	0.4	1,586
セレス	0.3	0.5	610
ＳＨＩＦＴ	－	0.4	3,204
ベリサーブ	0.1	－	－
ティーガイア	1.1	1.5	4,080
セック	0.2	0.2	773
日本アジアグループ	1.1	1.8	684
豆蔵ホールディングス	0.7	1.1	1,640
テクマトリックス	0.8	1.2	3,139
プロシップ	0.1	0.5	749
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	25.6	4	8,456
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	1.7	2.7	19,737
ザッパラス	0.5	0.9	363
システムリサーチ	0.1	0.4	730
インターネットイニシアティブ	1.7	2.4	7,392
さくらインターネット	1.3	1.8	1,263
ヴィンクス	0.4	0.5	554
ＧＭＯクラウド	0.2	0.3	735
ＳＲＡホールディングス	0.6	0.9	2,296
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	0.2	－	－
システムインテグレータ	0.3	0.5	461
朝日ネット	0.9	1.2	844
ｅＢＡＳＥ	0.3	1	1,526
アバント	0.3	1.2	1,405
アドソル日進	0.4	0.6	1,437
フリービット	0.7	1	901
コムチュア	0.6	1.9	4,712
サイバーコム	0.2	0.3	651
アステリア	0.5	1.1	616
アイル	－	0.6	1,166
マークラインズ	0.4	0.8	1,562

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メディカル・データ・ビジョン	0.9	1.3	1,076
ｇｕｍｉ	1.2	2.1	1,717
ショーケース	0.2	0.4	278
モバイルファクトリー	0.3	0.4	544
テラスカイ	0.1	0.6	1,920
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.5	0.7	1,223
ＰＣＩホールディングス	0.2	0.3	652
パイプドHD	0.2	0.2	368
アイビーシー	0.2	0.3	462
ネオジャパン	0.2	0.3	364
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	0.1	0.1	246
ランドコンピュータ	0.1	0.3	347
ダブルスタンダード	0.1	0.2	870
オープンドア	0.5	0.8	1,078
マイネット	0.3	0.6	423
アカツキ	0.4	0.6	3,162
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	187
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	0.2	0.4	532
ＬＩＮＥ	3.2	3.8	20,368
カナミックネットワーク	0.2	1	808
ノムラシステムコーポレーション	0.1	0.4	206
チェンジ	0.1	0.3	960
シンクロ・フード	0.5	0.7	386
オークネット	0.6	1	1,168
セグエグループ	－	0.3	252
エイトレッド	－	0.2	291
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1.2	1.7	1,196
マクロミル	1.3	2.9	3,088
ビーグリー	0.2	0.3	356
オロ	0.1	0.4	1,468
ユーザーローカル	－	0.1	315
テモナ	－	0.2	104
ニーズウェル	－	0.2	156
サインポスト	－	0.3	587
ソルクシーズ	0.5	0.7	705
フェイス	0.4	0.6	465
プロトコーポレーション	－	1.5	2,073
ハイマックス	0.1	0.2	394

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
野村総合研究所	6.7	27.6	65,688
サイバネットシステム	0.9	1.2	1,104
ＣＥホールディングス	0.3	1	499
日本システム技術	0.2	0.3	419
インテージホールディングス	1.4	2.1	1,837
東邦システムサイエンス	0.3	0.5	454
ソースネクスト	4.1	7.8	4,118
インフォコム	0.4	1.8	5,288
ラクスル	－	0.9	3,240
ＦＩＧ	0.9	1.8	540
システムサポート	－	0.1	241
イーソル	－	0.6	1,560
アルテリア・ネットワークス	－	1.8	3,524
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	－	0.4	676
フォーカスシステムズ	0.7	1	998
クレスコ	0.3	0.5	1,960
フジ・メディア・ホールディングス	11.1	15.9	24,454
オービック	3.7	5.7	88,350
ジャストシステム	1.5	2.7	16,848
ＴＤＣソフト	0.9	1.4	1,510
Ｚホールディングス	69.5	226.6	100,383
トレンドマイクロ	5.7	7.3	42,194
ＩＤホールディングス	0.3	0.6	934
日本オラクル	1.7	3.3	31,977
アルファシステムズ	0.3	0.5	1,446
フューチャー	1.4	2	3,966
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	0.8	1.1	1,637
ＳＢテクノロジー	0.5	0.6	1,314
トーセ	0.3	0.5	450
オービックビジネスコンサルタント	1.1	1.7	8,364
伊藤忠テクノソリューションズ	4.9	7.5	24,825
アイティフォー	1.3	2	1,762
東計電算	0.2	0.2	711
エックスネット	0.2	0.3	309
大塚商会	5.8	8.9	40,450
サイボウズ	1.2	1.9	3,591
ソフトブレーン	0.8	1	646
電通国際情報サービス	0.7	1	4,720

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デジタルガレージ	2.1	3	12,645
ＥＭシステムズ	0.9	2.3	2,187
ウェザーニューズ	0.4	0.6	2,313
ＣＩＪ	0.8	1.2	1,084
ビジネスエンジニアリング	0.1	0.2	655
日本エンタープライズ	1.1	1.7	397
ＷＯＷＯＷ	0.5	0.8	2,116
スカラ	0.9	1.2	914
インテリジェント　ウェイブ	－	0.6	483
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	0.9	1.5	814
ネットワンシステムズ	3.8	6.3	10,533
システムソフト	2.5	3.9	409
アルゴグラフィックス	0.5	1.4	4,760
マーベラス	1.6	2.5	1,752
エイベックス	1.8	2.8	3,418
日本ユニシス	3.3	5.2	17,446
兼松エレクトロニクス	0.6	0.9	3,199
東京放送ホールディングス	7.1	10	18,680
日本テレビホールディングス	9.8	13.8	20,341
朝日放送グループホールディングス	1.1	1.6	1,192
テレビ朝日ホールディングス	2.9	4.5	9,432
スカパーＪＳＡＴホールディングス	8.1	10.8	5,140
テレビ東京ホールディングス	0.9	1.4	3,301
日本ＢＳ放送	0.4	0.6	718
ビジョン	0.3	1.5	2,290
スマートバリュー	－	0.5	400
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.4	0.6	1,059
ワイヤレスゲート	0.5	0.8	588
コネクシオ	0.8	0.9	1,607
日本通信	9.1	12.7	2,984
クロップス	0.2	0.3	226
日本電信電話	73	220.5	616,628
ＫＤＤＩ	94	122.9	401,391
ソフトバンク	－	149.9	221,627
光通信	1.3	1.7	46,138
ＮＴＴドコモ	76.6	121.9	379,840
エムティーアイ	1.2	1.6	1,118
ＧＭＯインターネット	3.9	6.5	14,118

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファイバーゲート	－	0.3	395
アイドママーケティングコミュニケーション	0.2	0.5	322
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	3.1	4.4	8,540
学研ホールディングス	0.4	0.6	4,452
ゼンリン	2.1	3.3	5,468
昭文社	0.5	0.8	304
インプレスホールディングス	0.9	1.5	256
アイネット	0.6	0.8	1,242
松竹	0.7	1.1	16,478
東宝	7	9.9	41,035
東映	0.4	0.6	9,138
エヌ・ティ・ティ・データ	28.4	43.9	67,913
ピー・シー・エー	0.1	0.2	1,048
ビジネスブレイン太田昭和	0.2	0.3	751
ＤＴＳ	1.2	3.7	9,575
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5	7	38,640
シーイーシー	1.1	1.8	3,828
カプコン	4.6	7.8	23,478
アイ・エス・ビー	0.2	0.3	588
ジャステック	0.6	1.1	1,213
ＳＣＳＫ	2.8	3.8	22,686
日本システムウエア	0.4	0.5	1,325
アイネス	1.4	1.6	2,348
ＴＫＣ	0.9	1.4	7,518
富士ソフト	1.6	2.1	9,135
ＮＳＤ	1.8	5.4	9,671
コナミホールディングス	4.4	6	27,030
福井コンピュータホールディングス	0.3	0.6	2,049
ＪＢＣＣホールディングス	0.8	1.1	2,304
ミロク情報サービス	1.1	1.5	4,800
ソフトバンクグループ	44.6	130.9	598,867
卸売業（5.0%）			
ホウスイ	0.1	0.1	88
高千穂交易	0.4	0.6	706
伊藤忠食品	0.2	0.4	2,044
エレマテック	0.5	1.5	1,762
ＪＡＬＵＸ	0.3	0.5	1,182
あらた	0.6	1.3	5,941
トーメンデバイス	0.1	0.2	730
東京エレクトロン　デバイス	0.4	0.6	1,704
フィールズ	1	1.3	765
双日	59.1	91.5	32,025
アルフレッサ　ホールディングス	11.9	18.4	41,032
横浜冷凍	2.8	4.6	4,411
神栄	0.1	0.2	166
ラサ商事	0.6	0.9	907
ラクーンホールディングス	0.7	0.8	629
アルコニックス	1.2	1.8	2,485
神戸物産	1.6	5.7	24,481
あい　ホールディングス	1.7	2.4	4,572
ディーブイエックス	0.4	0.6	534
ダイワボウホールディングス	1	1.4	9,366
マクニカ・富士エレホールディングス	3	3.9	6,825
ラクト・ジャパン	0.2	0.6	2,337
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2	3.1	3,214
八洲電機	0.8	1.3	1,185
メディアスホールディングス	0.6	1	838
レスターホールディングス	0.7	1.7	3,216
ジューテックホールディングス	0.2	0.4	504
大光	0.3	0.7	464
ＯＣＨＩホールディングス	0.3	0.4	588
ＴＯＫＡＩホールディングス	5.7	8.7	9,265
黒谷	0.2	0.4	194
Ｃｏｍｉｎｉｘ	0.2	0.3	246
三洋貿易	0.5	0.8	2,190
ビューティガレージ	0.2	0.3	711
ウイン・パートナーズ	0.7	1.2	1,472
ミタチ産業	0.3	0.5	367
シップヘルスケアホールディングス	2.2	2.7	13,581
明治電機工業	0.3	0.5	778
デリカフーズホールディングス	0.2	0.6	417
スターティアホールディングス	0.2	0.4	307
コメダホールディングス	2.5	3.6	7,923
アセンテック	－	0.1	241
富士興産	0.4	0.5	330
協栄産業	0.1	0.2	289

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
小野建	0.9	1.5	2,022
南陽	－	0.4	726
佐鳥電機	0.8	1.2	1,040
エコートレーディング	0.2	0.4	228
伯東	0.7	1	1,295
コンドーテック	0.8	1.3	1,459
中山福	0.6	1	547
ナガイレーベン	1.5	2.4	5,680
三菱食品	1.2	1.8	5,643
松田産業	0.8	1.2	1,893
第一興商	1.6	2.5	13,675
メディパルホールディングス	11.6	17.9	42,530
ＳＰＫ	0.2	0.4	1,105
萩原電気ホールディングス	0.4	0.6	1,594
アズワン	0.8	1.1	11,176
スズデン	0.3	0.6	862
尾家産業	0.3	0.5	685
シモジマ	0.7	1	1,161
ドウシシャ	1	1.6	2,672
小津産業	0.2	0.4	760
高速	0.6	1	1,245
たけびし	0.4	0.6	883
リックス	0.2	0.4	685
丸文	0.9	1.5	909
ハピネット	0.9	1.4	1,876
橋本総業ホールディングス	0.2	0.3	542
日本ライフライン	3.4	4.9	6,639
タカショー	0.5	0.8	379
エクセル	0.4	0.5	798
マルカ	0.3	0.6	1,249
ＩＤＯＭ	3.6	4.4	2,670
日本エム・ディ・エム	0.6	－	－
進和	0.6	1	2,236
エスケイジャパン	0.3	0.3	139
ダイトロン	0.5	0.7	1,286
シークス	1.4	2.1	2,860
田中商事	0.4	0.5	360
オーハシテクニカ	0.6	0.9	1,390

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
白銅	0.3	0.6	861
伊藤忠商事	74.9	115.8	302,238
丸紅	105.6	172.4	138,247
高島	0.2	0.3	588
長瀬産業	6	9.3	14,545
蝶理	0.7	1.1	2,311
豊田通商	11.9	18.5	71,132
三共生興	1.8	2.5	1,465
兼松	4.3	6.2	8,847
ツカモトコーポレーション	0.2	0.3	335
三井物産	88.2	145.5	284,743
日本紙パルプ商事	0.6	0.9	3,586
日立ハイテクノロジーズ	3.3	5.8	45,472
カメイ	1.4	2.2	2,545
東都水産	0.1	0.2	550
ＯＵＧホールディングス	0.2	0.2	527
スターゼン	0.4	0.6	2,649
山善	4.2	6.5	6,799
椿本興業	0.2	0.3	1,224
住友商事	63.3	104.5	172,007
内田洋行	0.5	0.7	5,026
三菱商事	75.1	116.2	330,879
第一実業	0.5	0.8	2,912
キヤノンマーケティングジャパン	3.1	4.7	12,060
西華産業	0.6	0.9	1,164
佐藤商事	1	1.4	1,359
菱洋エレクトロ	1.1	1.7	3,479
東京産業	1.1	1.5	964
ユアサ商事	1.1	1.6	5,664
神鋼商事	0.2	0.4	1,069
小林産業	0.6	1	282
阪和興業	1.9	3.1	8,370
正栄食品工業	0.6	1.1	4,152
カナデン	1	1.3	1,730
菱電商事	0.8	1.2	1,918
フルサト工業	0.6	0.9	1,538
岩谷産業	2.4	3.7	13,597
すてきナイスグループ	0.5	0.7	893

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
昭光通商	0.4	0.6	427
ニチモウ	0.2	0.3	593
極東貿易	0.3	0.5	1,083
イワキ	1.3	2.3	1,230
三愛石油	2.9	4.1	4,514
稲畑産業	2.6	3.6	5,569
ＧＳＩクレオス	0.3	0.4	528
明和産業	1	1.6	974
クワザワ	－	0.6	396
ワキタ	2.3	3.5	3,643
東邦ホールディングス	3.2	5.3	12,264
サンゲツ	3.2	4.5	8,896
ミツウロコグループホールディングス	1.6	2.4	2,680
シナネンホールディングス	0.4	0.7	1,381
伊藤忠エネクス	2.4	3.7	3,385
サンリオ	3.3	4.6	9,899
サンワテクノス	0.6	1.2	1,248
リョーサン	1.2	1.8	4,728
新光商事	1	2.6	2,254
トーホー	0.5	0.7	1,288
三信電気	0.9	0.9	1,572
東陽テクニカ	1.2	1.9	2,437
モスフードサービス	1.4	2.2	6,512
加賀電子	1.1	1.6	3,827
ソーダニッカ	1.1	1.8	1,108
立花エレテック	0.8	1.2	2,164
フォーバル	0.5	0.7	763
ＰＡＬＴＡＣ	1.9	2.7	13,662
三谷産業	1.3	2.3	786
太平洋興発	0.4	0.7	546
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	0.2	0.3	1,095
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.1	0.1	228
国際紙パルプ商事	1.9	4.1	1,180
ヤマタネ	0.5	0.8	1,240
丸紅建材リース	0.1	0.2	374
日鉄物産	0.8	1.2	6,024
泉州電業	0.4	0.5	1,582
トラスコ中山	2.2	3.4	8,823
オートバックスセブン	4.3	6.1	9,833
モリト	0.8	1.2	939
加藤産業	1.7	2.6	8,788
北恵	0.2	0.3	266
イノテック	0.7	1	1,207
イエローハット	1	3.1	5,533
ＪＫホールディングス	1	1.5	1,087
日伝	0.9	1.5	3,043
北沢産業	0.8	1.3	357
杉本商事	0.6	0.9	1,786
因幡電機産業	1.5	4.7	12,990
バイテックホールディングス	0.5	－	－
東テク	0.4	0.5	1,364
ミスミグループ本社	13.4	20.7	60,402
アルテック	0.8	1.3	326
タキヒヨー	0.3	0.5	944
蔵王産業	0.2	0.3	440
スズケン	4.9	7	29,925
ジェコス	0.7	1.1	1,192
グローセル	1	1.7	785
小売業（4.5%）			
ローソン	2.7	4.2	27,174
サンエー	0.8	1.4	6,370
カワチ薬品	0.8	1.3	2,863
エービーシー・マート	1.7	2.6	18,070
ハードオフコーポレーション	0.4	0.7	578
アスクル	0.9	1.7	6,026
ゲオホールディングス	1.6	3	3,765
アダストリア	1.5	2.3	5,043
ジーフット	0.7	1	620
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.1	0.2	138
くら寿司	0.6	0.9	5,103
キャンドゥ	0.5	0.8	1,285
パルグループホールディングス	0.5	0.8	2,664
エディオン	4.5	7.6	8,717
サーラコーポレーション	2.3	3.3	2,046
ワッツ	0.4	0.8	501
ハローズ	0.4	0.6	1,631

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フジオフードシステム	－	1.4	2,490
あみやき亭	0.2	0.4	1,456
ひらまつ	2.3	3	810
大黒天物産	0.2	0.4	1,442
ハニーズホールディングス	1.2	1.5	2,071
ファーマライズホールディングス	0.2	0.4	267
アルペン	0.8	1.3	2,124
ハブ	0.3	0.5	511
クオールホールディングス	1.6	2.4	3,386
ジンズホールディングス	0.7	0.9	6,867
ビックカメラ	5.7	9.8	11,818
ＤＣＭホールディングス	5.8	8.9	9,175
ペッパーフードサービス	0.8	1.3	1,267
ＭｏｎｏｔａＲＯ	6.8	11.8	31,270
東京一番フーズ	0.2	0.4	250
ＤＤホールディングス	0.2	0.7	1,199
きちりホールディングス	0.4	0.5	382
アークランドサービスホールディングス	0.8	1.2	2,416
Ｊ．フロント　リテイリング	13.7	19.8	27,007
ドトール・日レスホールディングス	1.9	2.6	5,418
マツモトキヨシホールディングス	4.5	6.8	29,070
ブロンコビリー	0.6	0.9	2,364
ＺＯＺＯ	11.6	11.4	20,497
トレジャー・ファクトリー	0.3	0.5	445
物語コーポレーション	0.3	0.4	3,648
ココカラファイン	1.2	1.7	11,067
三越伊勢丹ホールディングス	20	28.9	26,356
Ｈａｍｅｅ	0.4	0.5	760
ウエルシアホールディングス	2.8	4.9	31,066
クリエイトＳＤホールディングス	1.6	2.4	6,808
丸善ＣＨＩホールディングス	1.3	2	728
ミサワ	0.4	0.3	209
ティーライフ	0.1	0.2	178
エー・ピーカンパニー	0.2	0.3	187
チムニー	0.3	0.5	1,155
シュッピン	0.9	1.1	1,262
ネクステージ	1.8	2.4	2,640
ジョイフル本田	3.1	4.8	6,014

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
鳥貴族	0.5	0.5	1,280
キリン堂ホールディングス	0.5	0.7	1,267
ホットランド	0.7	1.1	1,410
すかいらーくホールディングス	10	18.6	37,851
ＳＦＰホールディングス	－	0.7	1,689
綿半ホールディングス	0.4	0.6	1,073
ヨシックス	0.2	0.3	886
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3.1	4.8	4,636
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.6	0.8	519
ＢＥＥＮＯＳ	0.3	0.629	754
あさひ	1	1.2	1,584
日本調剤	0.4	0.5	1,892
コスモス薬品	0.5	0.7	16,723
トーエル	0.5	0.8	631
一六堂	0.2	－	－
オンリー	0.2	0.3	239
セブン&アイ・ホールディングス	44.9	64.8	272,548
薬王堂	0.5	－	－
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	2.9	4.4	10,348
ツルハホールディングス	2.3	3.6	48,060
サンマルクホールディングス	0.8	1.3	3,017
フェリシモ	0.2	0.4	400
トリドールホールディングス	1.3	2	5,266
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1	1.6	808
ウイルプラスホールディングス	0.1	0.3	258
ジャパンミート	0.5	0.8	1,764
サツドラホールディングス	0.2	0.2	371
デファクトスタンダード	0.1	－	－
アレンザホールディングス	0.6	0.8	782
串カツ田中ホールディングス	－	0.3	710
バロックジャパンリミテッド	1	1.2	1,281
クスリのアオキホールディングス	0.8	1.6	10,224
力の源ホールディングス	0.4	0.8	840
スシローグローバルホールディングス	1.2	1.8	17,658
ＬＩＸＩＬビバ	0.9	1.6	3,264
メディカルシステムネットワーク	1.2	1.7	877
はるやまホールディングス	0.5	0.8	694
ノジマ	1.9	2.9	6,420

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
カッパ・クリエイト	1.6	2.3	3,443
ライトオン	1	1.3	767
ジーンズメイト	0.4	0.4	122
良品計画	1.5	22	41,646
三城ホールディングス	1.4	1.9	581
アドヴァン	1.7	2.5	3,245
アルビス	0.4	0.6	1,336
コナカ	1.5	2	814
ハウス　オブ　ローゼ	0.1	0.1	168
Ｇ－７ホールディングス	0.3	1	2,694
イオン北海道	1.1	1.7	1,344
コジマ	1.7	2.8	1,489
ヒマラヤ	0.3	0.6	504
コーナン商事	1.4	2.4	5,728
エコス	0.5	0.6	1,018
ワタミ	1.4	2	2,580
マルシェ	0.3	0.5	390
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	6.9	39.7	68,879
西松屋チェーン	2.3	3.6	3,384
ゼンショーホールディングス	5.1	7.9	19,141
幸楽苑ホールディングス	0.8	1.1	2,118
ハークスレイ	0.2	0.3	389
サイゼリヤ	1.8	2.7	6,625
ＶＴホールディングス	3.6	6.8	3,060
魚力	0.3	0.5	790
ポプラ	0.3	0.4	202
フジ・コーポレーション	0.2	0.4	872
ユナイテッドアローズ	1.2	1.7	4,972
ハイデイ日高	1.4	2.4	4,809
京都きもの友禅	0.8	1.1	375
コロワイド	3.6	5.5	12,732
ピーシーデポコーポレーション	1.5	2.3	1,345
壱番屋	0.8	1.2	7,116
トップカルチャー	0.4	0.5	166
ＰＬＡＮＴ	0.2	0.4	229
スギホールディングス	2.4	3.3	18,216
薬王堂ホールディングス	－	0.7	1,518
ヴィア・ホールディングス	1.4	2	1,320

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スクロール	1.7	2.7	966
ヨンドシーホールディングス	1.2	1.7	4,146
ファミリーマート	3	13.2	32,181
木曽路	1.4	2.2	6,633
ＳＲＳホールディングス	1.3	2	2,104
千趣会	2	3	1,344
タカキュー	0.9	1.4	260
ケーヨー	2.1	3.4	1,853
上新電機	1.3	2	4,780
日本瓦斯	1.7	2.6	8,866
ロイヤルホールディングス	1.9	2.9	6,945
東天紅	0.1	0.1	127
いなげや	1.2	2.1	3,021
島忠	2.4	3.1	9,501
チヨダ	1.1	1.7	2,483
ライフコーポレーション	0.8	1.3	3,149
リンガーハット	1.3	2	4,982
ＭｒＭａｘＨＤ	1.6	2.4	1,130
テンアライド	1	1.6	702
ＡＯＫＩホールディングス	2.1	3.3	3,534
オークワ	1.5	2.6	3,868
コメリ	1.7	2.6	5,548
青山商事	1.9	3.4	4,794
しまむら	1.2	1.9	15,162
はせがわ	0.5	0.9	360
高島屋	8.4	12.1	14,653
松屋	2.2	3.3	2,455
エイチ・ツー・オー　リテイリング	5.5	7.8	8,619
近鉄百貨店	0.4	0.6	2,148
パルコ	1	1.6	2,956
丸井グループ	9.1	15.2	39,200
アクシアル　リテイリング	0.9	1.4	5,110
井筒屋	0.5	0.9	216
イオン	41.2	63.7	143,452
イズミ	2.2	3.4	11,917
平和堂	2.2	3.4	6,636
フジ	1.3	2	3,642
ヤオコー	1.2	1.9	10,678

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ゼビオホールディングス	1.3	2	2,360
ケーズホールディングス	11.1	16	21,392
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	0.6	0.9	549
日産東京販売ホールディングス	1.6	2.5	695
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	0.4	0.8	1,604
ナルミヤ・インターナショナル	－	0.3	380
総合メディカルホールディングス	0.9	1.4	2,846
ブックオフグループホールディングス	0.6	1	1,014
アインホールディングス	1.4	2.2	13,838
元気寿司	0.3	0.4	1,200
ヤマダ電機	32.6	50.4	27,820
アークランドサカモト	1.8	2.6	3,101
ニトリホールディングス	4.6	7.2	122,508
グルメ杵屋	0.8	1.2	1,450
愛眼	0.9	1.3	319
ケーユーホールディングス	0.6	0.9	808
吉野家ホールディングス	3.7	5.4	14,034
松屋フーズホールディングス	0.5	0.8	3,800
サガミホールディングス	1.4	2.2	2,972
関西スーパーマーケット	0.8	1.4	1,421
王将フードサービス	0.8	1.2	7,836
プレナス	1.2	1.9	3,779
ミニストップ	0.8	1.2	1,886
アークス	2	3.4	6,694
バローホールディングス	2.3	3.7	7,141
藤久	0.1	0.1	72
ベルク	0.5	0.8	4,760
大庄	0.6	0.9	1,481
ファーストリテイリング	1.4	2.2	128,612
サンドラッグ	4	6.2	23,157
サックスバー　ホールディングス	0.9	1.4	1,212
ヤマザワ	0.2	0.4	676
やまや	0.2	0.3	663
ベルーナ	2.6	3.5	2,282
銀行業（5.6%）			
島根銀行	0.2	0.3	191
じもとホールディングス	7.2	11.1	1,187
めぶきフィナンシャルグループ	55.7	86	20,984

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1.4	2.2	2,857
九州フィナンシャルグループ	17.6	27.2	12,403
ゆうちょ銀行	30.4	47	47,517
富山第一銀行	2.6	3.9	1,216
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68.3	97.5	40,950
西日本フィナンシャルホールディングス	6.9	11.3	8,305
関西みらいフィナンシャルグループ	5	9.8	6,281
三十三フィナンシャルグループ	0.9	1.5	2,409
第四北越フィナンシャルグループ	1.9	2.9	7,728
新生銀行	7.9	12.2	20,069
あおぞら銀行	6	9.9	28,353
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	746.7	1,141.5	646,659
りそなホールディングス	117.5	180.7	83,067
三井住友トラスト・ホールディングス	21.1	31.3	127,954
三井住友フィナンシャルグループ	75.6	114.7	444,003
千葉銀行	38	57	34,542
群馬銀行	21.4	32.6	11,410
武蔵野銀行	1.6	2.5	4,292
千葉興業銀行	2.9	4.5	1,588
筑波銀行	4.5	6.8	1,448
七十七銀行	3.4	5.6	9,212
青森銀行	0.8	1.3	3,500
秋田銀行	0.7	1.1	2,227
山形銀行	1.2	1.9	2,665
岩手銀行	0.7	1.1	2,851
東邦銀行	9.7	14.7	3,689
東北銀行	0.5	0.8	810
みちのく銀行	0.7	1.1	1,559
ふくおかフィナンシャルグループ	8.7	14	27,104
静岡銀行	27	41	31,406
十六銀行	1.4	2.1	4,762
スルガ銀行	10.8	16.9	7,216
八十二銀行	19.4	40	16,640
山梨中央銀行	1.3	1.9	1,930
大垣共立銀行	1.7	3.3	7,421
福井銀行	0.9	1.4	2,308
北國銀行	1.1	1.7	5,380
清水銀行	0.4	0.7	1,443

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
富山銀行	0.2	0.3	661
滋賀銀行	2.2	3.3	8,560
南都銀行	1.3	2.8	7,428
百五銀行	9.6	14.8	4,869
京都銀行	3.8	5.9	26,638
紀陽銀行	3.8	5.9	9,251
ほくほくフィナンシャルグループ	7.1	11	11,616
広島銀行	15.8	24.4	11,931
山陰合同銀行	6.4	9.8	5,968
中国銀行	6.9	14.3	14,586
鳥取銀行	0.3	0.6	801
伊予銀行	14.2	23.6	13,263
百十四銀行	1.1	1.8	3,535
四国銀行	1.5	2.5	2,367
阿波銀行	1.7	2.7	6,161
大分銀行	0.7	1	2,557
宮崎銀行	0.7	1.1	2,665
佐賀銀行	0.7	1	1,562
十八銀行	0.7	－	－
沖縄銀行	1	1.5	5,205
琉球銀行	2.5	3.8	4,054
セブン銀行	36.2	55.3	18,138
みずほフィナンシャルグループ	1,457	2,253.3	365,259
高知銀行	0.4	0.6	496
山口フィナンシャルグループ	13.4	20.7	13,620
長野銀行	0.4	0.5	796
名古屋銀行	0.9	1.3	4,283
北洋銀行	16.2	24.8	5,456
愛知銀行	0.4	0.6	2,058
中京銀行	0.4	0.7	1,547
大光銀行	0.3	0.6	986
愛媛銀行	1.5	2.3	2,569
トマト銀行	0.4	0.7	726
京葉銀行	4.7	7	4,081
栃木銀行	5.5	8	1,656
北日本銀行	0.3	0.5	1,069
東和銀行	1.9	2.9	2,331
福島銀行	0.9	1.6	379
大東銀行	0.5	0.9	568
トモニホールディングス	8.3	12.7	4,724
フィデアホールディングス	10.4	16	2,032
池田泉州ホールディングス	11.4	18.9	3,761
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	3.4	5.1	5,232
マーキュリアインベストメント	0.4	0.8	570
ＳＢＩホールディングス	12.8	18.5	44,307
日本アジア投資	0.9	1.4	379
ジャフコ	1.8	2.5	11,387
大和証券グループ本社	86	133.1	74,003
野村ホールディングス	196.8	291.8	163,408
岡三証券グループ	9.1	14	5,320
丸三証券	3.2	4.9	2,464
東洋証券	3.8	5.9	855
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12.8	18.9	6,407
光世証券	0.3	0.4	244
水戸証券	3.1	4.8	1,070
いちよし証券	2.2	3.1	1,906
松井証券	5.3	9.5	8,331
だいこう証券ビジネス	0.4	0.8	558
マネックスグループ	10	12.4	3,348
カブドットコム証券	8	－	－
極東証券	1.4	2.2	1,623
岩井コスモホールディングス	1.1	1.6	2,054
藍澤證券	2	3	2,199
マネーパートナーズグループ	1.3	1.7	408
スパークス・グループ	－	5.7	1,504
小林洋行	0.3	0.4	108
保険業（2.3%）			
かんぽ生命保険	4.1	5.9	11,221
ＳＯＭＰＯホールディングス	18.9	31.2	130,946
アニコム　ホールディングス	0.9	1.4	5,565
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	28	43.4	157,932
ソニーフィナンシャルホールディングス	8.8	13.6	34,938
第一生命ホールディングス	60.7	93.8	155,145
東京海上ホールディングス	38.9	59.3	355,740
Ｔ＆Ｄホールディングス	33.2	49.6	59,520

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アドバンスクリエイト	0.2	0.4	742
その他金融業（1.2%）			
全国保証	3	4.7	22,090
ジェイリース	0.2	0.5	195
イントラスト	0.3	0.6	504
日本モーゲージサービス	0.1	0.3	621
Ｃａｓａ	0.4	0.6	946
アルヒ	1	2.6	5,252
プレミアグループ	－	0.9	1,874
クレディセゾン	7.5	11.6	21,471
芙蓉総合リース	1.2	1.7	11,866
みずほリース	2	2.6	8,567
東京センチュリー	2.2	3.3	18,579
日本証券金融	4.7	7.3	3,723
アイフル	16.4	25.3	7,741
リコーリース	0.8	1.3	5,694
イオンフィナンシャルサービス	6.9	10.1	16,968
アコム	21.6	33.3	17,549
ジャックス	1.2	1.8	4,723
オリエントコーポレーション	29	44.9	7,677
日立キャピタル	2.5	3.9	11,661
アプラスフィナンシャル	5.1	8.6	851
オリックス	71.5	103.7	193,711
三菱ＵＦＪリース	24.2	42.1	29,385
九州リースサービス	0.5	0.8	477
日本取引所グループ	29	47.6	95,295
イー・ギャランティ	1	1.8	2,388
アサックス	0.4	0.9	639
ＮＥＣキャピタルソリューション	0.4	0.7	1,952
不動産業（2.5%）			
いちご	13.6	21	8,967
日本駐車場開発	12.9	18.1	2,624
スター・マイカ・ホールディングス	－	0.9	1,487
ヒューリック	22.4	35.4	47,152
三栄建築設計	0.4	0.7	1,038
スター・マイカ	0.5	－	－
野村不動産ホールディングス	7.1	10.1	28,209
三重交通グループホールディングス	2.2	3.3	1,999

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サムティ	1.5	2.4	4,538
ディア・ライフ	1.4	2.1	1,222
コーセーアールイー	0.3	0.5	351
エー・ディー・ワークス	16.5	32.7	948
日本商業開発	0.7	1	1,698
プレサンスコーポレーション	1.7	2.7	3,410
ユニゾホールディングス	1.6	2.5	12,900
ＴＨＥグローバル社	0.5	0.9	404
ハウスコム	－	0.2	308
日本管理センター	0.7	1.1	1,481
サンセイランディック	0.3	0.5	441
エストラスト	0.1	0.2	172
フージャースホールディングス	2.4	3.3	2,336
オープンハウス	1.7	4.8	14,011
東急不動産ホールディングス	28.8	45.1	34,681
飯田グループホールディングス	8.9	13.8	26,689
イーグランド	0.2	0.3	251
ムゲンエステート	0.7	1.2	853
ビーロット	0.2	0.4	687
ファーストブラザーズ	0.3	0.4	499
ハウスドゥ	0.4	0.9	1,214
シーアールイー	0.4	0.4	472
プロパティエージェント	0.1	0.3	350
ケイアイスター不動産	0.3	0.5	966
アグレ都市デザイン	0.1	0.3	171
グッドコムアセット	0.2	0.4	982
ジェイ・エス・ビー	0.1	0.2	1,058
テンポイノベーション	0.1	0.4	352
グローバル・リンク・マネジメント	－	0.3	187
パーク２４	6.3	8.9	24,190
パラカ	0.3	0.4	797
三井不動産	56.9	81.8	233,825
三菱地所	75.1	116.2	262,902
平和不動産	2	3	9,600
東京建物	11.7	18.1	31,747
ダイビル	3.2	4.3	5,899
京阪神ビルディング	1.9	2.7	4,017
住友不動産	24.1	37.3	147,819

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
テーオーシー	2.5	3.2	2,921
東京楽天地	0.1	0.3	1,788
レオパレス２１	13.2	21.7	8,115
スターツコーポレーション	1.5	2.3	6,315
フジ住宅	1.4	1.9	1,286
空港施設	1.3	1.7	926
明和地所	0.6	1	616
ゴールドクレスト	0.8	1.3	2,626
エスリード	0.4	0.6	1,229
日神グループホールディングス	1.6	2.4	1,300
日本エスコン	1.9	3	2,901
タカラレーベン	5	7.5	3,585
ＡＶＡＮＴＩＡ	0.6	0.9	898
イオンモール	5.4	8.3	15,479
毎日コムネット	0.2	0.4	373
ファースト住建	0.4	0.7	857
ランド	43.8	95.2	1,142
カチタス	1.2	2.1	9,565
トーセイ	1.5	2.3	3,369
穴吹興産	0.1	0.4	682
サンフロンティア不動産	1.5	2.3	2,898
エフ・ジェー・ネクスト	0.9	1.4	1,724
インテリックス	0.3	0.5	367
ランドビジネス	0.5	0.7	506
日本社宅サービス	－	0.4	431
グランディハウス	0.9	1.3	642
日本空港ビルデング	3.4	5.3	26,341
サービス業（5.2%）			
日本工営	0.7	1.1	3,899
ＬＩＦＵＬＬ	3.6	5.6	3,080
ジェイエイシーリクルートメント	0.8	1.1	1,930
日本M&Aセンター	7.7	12.1	47,855
メンバーズ	0.4	0.5	961
中広	0.1	0.1	54
ＵＴグループ	－	1.9	5,500
アイティメディア	－	0.5	452
タケエイ	1.2	1.5	1,800
Ｅ・Ｊホールディングス	0.1	0.2	363

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビーネックスグループ	0.5	1.8	2,244
コシダカホールディングス	2.8	3.9	6,957
アルトナー	0.3	0.4	344
パソナグループ	1	2	3,086
ＣＤＳ	0.3	0.4	612
リンクアンドモチベーション	1.9	3.5	1,928
ＧＣＡ	1.1	1.9	1,778
エス・エム・エス	3.8	5	14,095
サニーサイドアップグループ	－	0.4	472
パーソルホールディングス	10.4	16.1	32,183
リニカル	0.6	0.8	828
クックパッド	3.2	5.6	1,898
エスクリ	0.4	0.5	394
アイ・ケイ・ケイ	0.6	0.8	585
学情	0.5	0.6	1,347
スタジオアリス	0.5	0.8	1,532
シミックホールディングス	0.6	0.9	1,567
エプコ	－	0.3	395
ＮＪＳ	0.2	0.4	718
綜合警備保障	4.2	6.4	37,888
カカクコム	7.8	12	35,040
アイロムグループ	0.4	0.6	811
セントケア・ホールディング	0.6	1.1	526
サイネックス	0.2	0.3	208
ルネサンス	0.6	0.9	1,546
ディップ	1.7	2.3	8,165
オプトホールディング	0.6	0.9	1,360
新日本科学	1.4	1.8	1,164
ツクイ	2.4	3.8	2,230
キャリアデザインセンター	0.3	0.4	524
ベネフィット・ワン	1.4	4.4	9,592
エムスリー	21.9	35.4	112,218
ツカダ・グローバルホールディング	0.7	1.1	636
プラス	0.1	0.2	155
アウトソーシング	5.4	9.2	9,540
ウェルネット	1.1	1.6	1,102
ワールドホールディングス	0.3	0.5	845
ディー・エヌ・エー	5.6	7.9	14,259

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
博報堂ＤＹホールディングス	14.4	22.3	35,858
ぐるなび	1.5	2.8	2,626
タカミヤ	1.1	1.7	1,111
ジャパンベストレスキューシステム	0.8	1.1	1,163
ファンコミュニケーションズ	2.8	4.4	1,971
ライク	0.4	0.6	970
ビジネス・ブレークスルー	0.4	0.7	282
エスプール	－	3.1	2,557
ＷＤＢホールディングス	0.5	0.7	1,901
ティア	0.5	1	591
ＣＤＧ	0.1	0.2	286
バリューコマース	0.7	0.9	2,142
インフォマート	5.7	17.6	15,980
ＪＰホールディングス	3	5	1,595
エコナックホールディングス	1.9	3.1	434
ＥＰＳホールディングス	1.6	2.4	3,331
レッグス	0.3	0.4	646
プレステージ・インターナショナル	1.9	6	5,730
アミューズ	0.6	0.9	2,638
ドリームインキュベータ	0.3	0.5	772
クイック	0.6	1	1,592
ＴＡＣ	0.6	0.9	199
ケネディクス	9.7	15.2	8,420
電通グループ	12.7	16.6	60,756
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.4	0.6	643
ぴあ	0.3	0.5	2,252
イオンファンタジー	0.3	0.6	1,416
シーティーエス	1.2	1.8	1,281
ネクシィーズグループ	0.3	0.6	1,041
みらかホールディングス	2.9	4.5	12,973
アルプス技研	0.9	1.4	2,648
サニックス	1.8	2.8	949
ダイオーズ	0.2	0.3	403
日本空調サービス	1.2	1.7	1,343
オリエンタルランド	12.3	17.1	247,950
ダスキン	2.8	4.1	12,546
明光ネットワークジャパン	1.3	1.9	1,863
ファルコホールディングス	0.6	0.9	1,842

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
秀英予備校	0.2	0.3	133
田谷	0.2	0.3	187
ラウンドワン	3.2	4.5	4,698
リゾートトラスト	4.4	7.4	12,802
ビー・エム・エル	1.3	2.1	6,415
ワタベウェディング	0.2	0.2	108
りらいあコミュニケーションズ	1.9	2.9	4,286
リソー教育	5.2	7.3	2,540
早稲田アカデミー	0.1	0.5	579
ユー・エス・エス	12.7	18	35,280
東京個別指導学院	0.4	0.6	430
サイバーエージェント	6.4	9.2	35,144
楽天	48.4	74.9	65,537
クリーク・アンド・リバー社	0.6	0.8	832
テー・オー・ダブリュー	1	1.4	1,395
山田コンサルティンググループ	－	0.8	1,231
セントラルスポーツ	0.4	0.6	1,854
フルキャストホールディングス	1	1.6	3,996
エン・ジャパン	1.1	2.9	12,687
リソルホールディングス	0.1	0.1	414
テクノプロ・ホールディングス	2	3.2	23,840
アトラ	0.2	0.3	98
インターワークス	0.2	0.3	162
アイ・アールジャパンホールディングス	0.3	0.7	4,025
ＫｅｅＰｅｒ技研	0.3	0.6	764
ファーストロジック	0.2	0.4	236
三機サービス	0.2	0.4	418
Ｇｕｎｏｓｙ	0.6	1.1	1,314
デザインワン・ジャパン	0.2	0.2	64
イー・ガーディアン	0.5	0.8	1,520
リブセンス	0.6	1	285
ジャパンマテリアル	2.8	4.9	8,344
ベクトル	1.3	2	2,278
ウチヤマホールディングス	0.5	0.8	431
チャーム・ケア・コーポレーション	－	1.2	1,098
ライクキッズ	0.2	0.4	319
キャリアリンク	0.4	0.5	309
ＩＢＪ	0.7	1.1	1,438

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アサンテ	0.4	0.6	1,203
Ｎ・フィールド	0.7	1.2	732
バリューＨＲ	0.2	0.3	939
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.3	1.1	4,719
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.4	0.6	1,215
ＥＲＩホールディングス	0.3	0.5	385
アビスト	0.2	0.2	531
シグマクシス	0.5	1.1	2,388
ウィルグループ	0.7	1	1,169
エスクロー・エージェント・ジャパン	1.4	2.2	473
日本ビューホテル	0.3	－	－
リクルートホールディングス	74.4	115.1	505,749
エラン	0.7	0.9	1,524
土木管理総合試験所	0.4	0.7	308
ネットマーケティング	－	0.6	610
日本郵政	85.1	131.7	132,490
ベルシステム２４ホールディングス	1.7	2.7	4,171
鎌倉新書	0.7	1.2	2,001
ＳＭＮ	－	0.3	241
一蔵	0.1	0.2	156
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	0.2	0.6	1,601
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	0.1	0.2	151
エアトリ	0.3	0.7	1,210
アトラエ	0.2	0.4	1,506
ストライク	0.3	0.6	3,228
ソラスト	2.5	4.4	5,161
セラク	0.2	0.5	660
インソース	0.3	0.8	2,836
ベイカレント・コンサルティング	－	1	8,100
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	－	0.3	383
アイモバイル	0.2	0.5	349
キャリアインデックス	0.3	0.6	232
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	0.4	0.5	725
船場	0.2	0.3	320
グレイステクノロジー	0.3	0.7	2,038
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	0.6	1.7	4,357
フルテック	0.1	0.2	264
グリーンズ	0.2	0.6	587

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツナググループ・ホールディングス	0.1	0.2	149
ＧａｍｅＷｉｔｈ	－	0.4	302
ソウルドアウト	－	0.2	405
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	－	0.2	211
日総工産	0.3	1.1	1,151
キュービーネットホールディングス	0.5	1	2,396
ＲＰＡホールディングス	－	0.9	890
スプリックス	0.3	0.5	534
マネジメントソリューションズ	－	0.2	653
アドバンテッジリスクマネジメント	0.4	0.8	741
リログループ	5.7	8.8	26,884
東祥	0.6	1	2,202
エイチ・アイ・エス	1.9	2.5	6,370
ラックランド	0.2	0.4	873
共立メンテナンス	1.6	2.7	11,731
イチネンホールディングス	1.1	1.8	2,806
建設技術研究所	0.7	1.1	2,704
スペース	0.7	1	1,233
長大	0.4	0.6	763
燦ホールディングス	0.2	0.7	1,001
スバル興業	0.1	0.1	1,011
東京テアトル	0.4	0.6	822
タナベ経営	0.2	0.3	389
ナガワ	0.3	0.5	3,695
よみうりランド	0.2	0.3	1,308
東京都競馬	0.7	1.1	3,503
常磐興産	0.4	0.6	989
カナモト	1.6	2.6	7,113
東京ドーム	3.9	6.5	6,844
西尾レントオール	1.1	1.6	4,795
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	5.7	10.9	337
トランス・コスモス	1.2	1.5	4,221
乃村工藝社	2.4	6.9	8,866
藤田観光	0.4	0.7	1,874
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	0.5	1	1,378
日本管財	1.1	1.7	3,313
トーカイ	1	1.6	4,080
白洋舎	0.1	0.2	563

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セコム	11	17	165,835
セントラル警備保障	0.5	0.8	4,800
丹青社	2	3	3,867
メイテック	1.3	2	12,720
応用地質	1.1	1.7	2,398
船井総研ホールディングス	2.2	3.3	9,002
進学会ホールディングス	0.5	0.6	310
オオバ	0.8	1.3	1,081
いであ	0.2	0.3	850
学究社	0.3	0.5	712
ベネッセホールディングス	3.8	5.4	16,443
イオンディライト	1.3	2	7,440
ナック	0.6	0.9	928
ニチイ学館	1.5	2.3	3,498
ダイセキ	1.7	2.7	8,032
ステップ	0.4	0.6	943
合計 株数・金額	12,530	19,919	40,348,833
合計 銘柄数＜比率＞	2,111	2,151	＜98.3%＞

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	766	－

○投資信託財産の構成

(2020年１月27日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	40,348,833	97.5
コール・ローン等、その他	1,038,502	2.5
投資信託財産総額	41,387,335	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2019年１月26日～2020年１月27日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	41,387,335,745
コール・ローン等	793,282,477
株式(評価額)	40,348,833,940
未収入金	161,770,000
未収配当金	67,679,328
差入委託証拠金	15,770,000
(B) 負債	340,397,657
未払金	282,284,506
未払解約金	58,111,000
未払利息	2,151
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	41,046,938,088
元本	34,456,230,681
次期繰越損益金	6,590,707,407
(D) 受益権総口数	34,456,230,681口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,913円

(注) 当ファンドの期首元本額は23,469,138,912円、期中追加設定元本額は25,634,689,921円、期中一部解約元本額は14,647,598,152円です。

(注) 2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	19,411,557,058円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,983,412,431円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	1,742,935,848円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,543,042,033円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	1,420,203,859円
・つみたてバランスファンド	1,396,541,529円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,111,581,950円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	633,692,229円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	610,296,074円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	560,405,708円
・ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	532,375,773円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	468,365,313円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	463,501,764円
・ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	409,404,641円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	223,685,683円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	200,111,438円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	182,055,214円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	161,870,070円
・りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	156,447,954円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	126,458,353円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	52,712,966円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	42,318,018円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	9,314,643円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	6,187,321円
・グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	4,058,158円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,785,408円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,726,721円
・りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	182,524円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.1913円です。

○損益の状況 (2019年１月26日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	724,620,211
受取配当金	725,003,594
その他収益金	373,028
支払利息	△　756,411
(B) 有価証券売買損益	2,701,107,670
売買益	4,330,040,444
売買損	△1,628,932,774
(C) 先物取引等取引損益	82,032,000
取引益	132,289,780
取引損	△　50,257,780
(D) 保管費用等	△　27,442
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	3,507,732,439
(F) 前期繰越損益金	1,627,768,837
(G) 追加信託差損益金	3,151,450,979
(H) 解約差損益金	△1,696,244,848
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	6,590,707,407
次期繰越損益金(Ｉ)	6,590,707,407

(注) 損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**および(C)**先物取引等取引損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(G)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(H)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
主 要 投 資 対 象	・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式(*)（日本の株式を除きます。以下同じ。） (*) ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
主 な 投 資 制 限	・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
（設定日）	円	%		%	%	%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	908,592.43	－	－	－	－	30
1期(2017年1月25日)	10,306	3.1	945,403.24	4.1	95.5	1.6	2.6	1,943
2期(2018年1月25日)	12,539	21.7	1,158,586.43	22.5	93.8	4.2	2.2	11,661
3期(2019年1月25日)	11,465	△ 8.6	1,066,031.25	△ 8.0	93.9	3.5	2.5	18,347
4期(2020年1月27日)	14,161	23.5	1,320,229.10	23.8	74.0	24.0	2.1	57,303

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
（注）「ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）」は、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（米ドルベース）は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2019年1月25日	11,465	－	1,066,031.25	－	93.9	3.5	2.5
1月末	11,579	1.0	1,074,489.97	0.8	93.7	3.9	2.5
2月末	12,271	7.0	1,141,179.37	7.0	93.1	4.4	2.4
3月末	12,358	7.8	1,149,447.96	7.8	89.3	8.5	2.4
4月末	12,911	12.6	1,201,500.53	12.7	89.4	8.2	2.3
5月末	12,095	5.5	1,125,763.87	5.6	91.6	5.8	2.5
6月末	12,529	9.3	1,166,661.83	9.4	88.4	9.3	2.4
7月末	12,867	12.2	1,198,357.87	12.4	83.1	14.6	2.3
8月末	12,238	6.7	1,139,762.89	6.9	84.9	12.5	2.5
9月末	12,624	10.1	1,176,490.96	10.4	82.5	15.3	2.4
10月末	13,130	14.5	1,221,956.97	14.6	78.4	27.1	2.2
11月末	13,616	18.8	1,268,769.44	19.0	81.7	15.9	2.3
12月末	14,029	22.4	1,307,004.78	22.6	74.3	23.7	2.0
（期末）							
2020年1月27日	14,161	23.5	1,320,229.10	23.8	74.0	24.0	2.1

（注）騰落率は期首比です。
（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

期中の基準価額等の推移

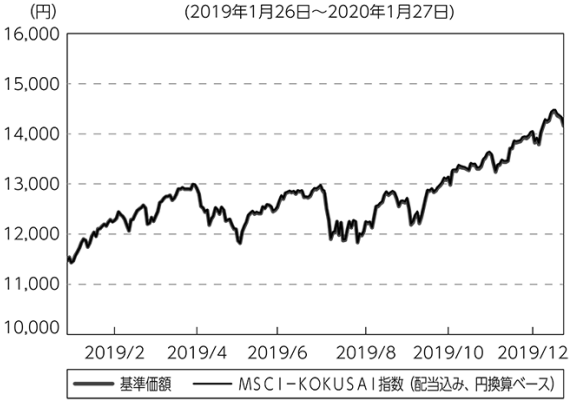
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末11,465円から当期末14,161円となり、2,696円の値上がりとなりました。

先進国株式の市況（ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国の株価が上昇したことが寄与しました。

基準価額等の推移



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

先進国株式市況

先進国株式市場は、前期末と比較して大幅に上昇しました。期の前半は、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）が利上げの一時停止の可能性を示唆したことなどを背景に上昇しましたが、米中貿易摩擦問題が再燃すると不安定な動きとなりました。期の後半は、世界景気の底入れ期待と主要国の金融緩和策で投資家のリスク回避姿勢が和らぎ、上昇基調となりました。期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待が高まり、米中通商協議が部分合意に達すると、先進国株式市場は一層上昇しました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して横ばいで推移し、ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、期の前半は世界景気の減速懸念や米中対立に対する過度な警戒感が緩和され円安基調となりましたが、ＦＲＢの金融緩和観測が広がるにつれ米ドルは売られ円高が進行しました。期の後半は、米国の緩和的な金融政策が当面据え置かれるとの見方を背景に過度な円高圧力は緩和され、期末にかけては緩やかに円安が進行しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標やイギリスのＥＵ（欧州連合）離脱問題等を背景に、期を通じて円高傾向で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

日本を除く先進国の株式を主要投資対象とし、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

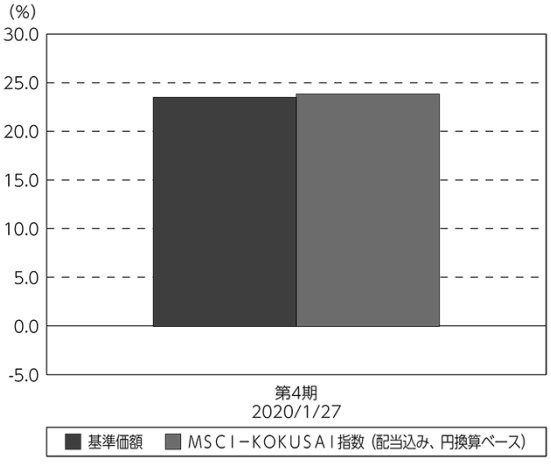
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋23.5%となり、ベンチマークの＋23.8%を0.3%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）
・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている日本を除く先進国の株式に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	4	0.030	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(2)	(0.014)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(2)	(0.015)	
(b) 有価証券取引税	4	0.029	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(4)	(0.029)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
(c) その他費用	6	0.047	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(6)	(0.044)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.003)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	14	0.106	
期中の平均基準価額は、12,687円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 14,799 (260)	千米ドル 125,792 (1,271)	百株 353 (193)	千米ドル 1,396 (1,794)
	カナダ	 1,899 (35)	千カナダドル 9,553 (－)	 98 (19)	千カナダドル 161 (41)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,127 (1)	5,285 (△ 23)	21 (－)	74 (0)
	イタリア	2,378	1,225	－	－
	フランス	1,203 (5)	6,320 (6)	8 (0.01)	10 (7)
	オランダ	1,029	3,080	－ (－)	－ (0)
	スペイン	2,547 (1,239)	1,812 (30)	1,256 (－)	44 (30)
	ベルギー	94	678	－	－
	オーストリア	33 (－)	127 (△ 1)	6	29
	ルクセンブルク	164	217	3	14
	フィンランド	473 (16)	607 (1)	2 (－)	1 (1)
	アイルランド	129	321	－	－
	ポルトガル	115	81	－	－
	イギリス	 14,639 (12,453)	千英ポンド 8,840 (66)	 12,340 (19)	千英ポンド 54 (84)
	スイス	 834 (20)	千スイスフラン 6,257 (81)	 2 (－)	千スイスフラン 22 (109)
	スウェーデン	 1,254 (39)	千スウェーデンクローナ 17,152 (121)	 39 (－)	千スウェーデンクローナ 140 (121)
	ノルウェー	 243 (5)	千ノルウェークローネ 3,833 (43)	 5 (－)	千ノルウェークローネ 47 (43)
	デンマーク	 187 (0.94)	千デンマーククローネ 7,991 (47)	 0.94 (－)	千デンマーククローネ 52 (47)

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	オーストラリア	百株 3,562 (115)	千オーストラリアドル 6,614 (151)	百株 57 (118)	千オーストラリアドル 88 (158)
	ニュージーランド	492	千ニュージーランドドル 353	－	千ニュージーランドドル －
	香港	4,113 (59)	千香港ドル 16,984 (－)	163	千香港ドル 309
	シンガポール	1,953	千シンガポールドル 1,072	57	千シンガポールドル 1
	イスラエル	245	千イスラエルシュケル 1,004	17	千イスラエルシュケル 4

（注）金額は受け渡し代金。
（注）( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

投資信託証券

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	AGNC INVESTMENT CORP	3,045	49	－	－
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	504	75	－	－
	AMERICAN TOWER CORP	2,100	457	－	－
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	9,814	89	－	－
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	688	144	－	－
	BOSTON PROPERTIES INC	713	94	－	－
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	－	－	544	10
	CAMDEN PROPERTY TRUST	300	32	－	－
	CROWN CASTLE INTL CORP	1,993	276	－	－
	DIGITAL REALTY TRUST INC	1,044	128	－	－
	DUKE REALTY CORP	2,239	75	－	－
	EQUINIX INC	422	232	－	－
外	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	774 (774)	96 (－)	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL	1,813	151	－	－
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	298	94	－	－
	EXTRA SPACE STORAGE INC	609	69	－	－
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	300	39	－	－
	HCP INC	2,013	66	－	－
	HOST HOTELS & RESORTS INC	2,500	43	－	－
	INVITATION HOMES INC	4,944	140	－	－
	IRON MOUNTAIN INC	870	28	－	－
	KIMCO REALTY CORP	2,727	51	－	－
	LIBERTY PROPERTY TRUST	617	31	－	－
	MACERICH CO/THE	－	－	178	4
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,450	113	－	－
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	542	67	－	－
国	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	626	34	－	－
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	98	－	－
	PROLOGIS INC	3,005	257	－	－
	PUBLIC STORAGE	775	182	－	－
	REALTY INCOME CORP	1,547	114	－	－
	REGENCY CENTERS CORP	856	58	－	－
	SBA COMMUNICATIONS CORP	688	166	－	－
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,512	230	－	－
	SUN COMMUNITIES INC	788	105	－	－
	UDR INC	1,397	65	－	－
	VENTAS INC	1,837	119	－	－
	VEREIT INC	7,288	70	－	－
	VICI PROPERTIES INC	4,920	121	－	－
	VORNADO REALTY TRUST	520	31	－	－
	WP CAREY INC	763	65	－	－

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	WELLTOWER INC	2,130	183	－	－
	WEYERHAEUSER CO	4,384	118	－	－
	小計	81,685 (774)	4,676 (－)	722	15
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	52	－	－
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	－ (1,901)	－ (41)	－	－
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,400	37	－	－
	小計	2,350 (1,901)	89 (41)	－	－
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	1,080	35	－	－
	GECINA SA	251	35	－	－
	COVIVIO	300	30	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	481	63	－	－
	小計	2,112	165	－	－
	ユーロ計	2,112	165	－	－
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	5,590	31	－	－
	HAMMERSON PLC	－	－	1,987	5
	SEGRO PLC	6,520	55	－	－
	LAND SECURITIES GROUP PLC	3,183	26	－	－
	小計	15,293	112	1,987	5
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	MIRVAC GROUP	13,000	41	－	－
	GPT GROUP	6,200	39	－	－
	STOCKLAND	13,427	66	－	－
	DEXUS	4,800	58	－	－
	GOODMAN GROUP	7,848	111	－	－
	SCENTRE GROUP	26,368	103	－	－
	VICINITY CENTRES	25,000	66	－	－
	小計	96,643	486	－	－
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	13,500	1,185	－	－
	小計	13,500	1,185	－	－
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	13,900	35	－	－
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	20,100 (－)	58 (△0.394)	－ (－)	－ (0.689)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	17,900	38	－	－
	SUNTEC REIT	－ (－)	－ (△0.099)	－	－

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	55	－	－
	(Right)ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	－ (2,992)	－ (0.689)	2,992	0.701
	小計	74,900 (2,992)	188 (0.195)	2,992 (－)	0.701 (0.689)

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) ( )内は分割・合併・増資等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

	種類別	買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 47,632	百万円 35,534	百万円 －	百万円 －

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2019年１月26日～2020年１月27日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	20,126,318千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	25,929,311千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.77

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2019年１月26日～2020年１月27日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

(2019年１月26日～2020年１月27日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
AES CORP	28	49	100	10,944	公益事業
AT&T INC	343	706	2,719	296,570	電気通信サービス
ABBVIE INC	71	140	1,175	128,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACUITY BRANDS INC	1	4	54	5,896	資本財
ADVANCE AUTO PARTS INC	3	5	83	9,070	小売
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12	27	239	26,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	22	35	114	12,517	各種金融
ALTICE USA INC- A	－	8	24	2,665	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	89	177	892	97,291	食品・飲料・タバコ
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3	7	85	9,350	保険
AMERISOURCEBERGEN CORP	6	15	142	15,506	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	5	11	186	20,340	各種金融
ANTERO RESOURCES CORP	1	－	－	－	エネルギー
AQUA AMERICA INC	－	23	119	13,008	公益事業
ARAMARK	13	22	102	11,138	消費者サービス
ARCONIC INC	18	31	91	9,949	資本財
ARISTA NETWORKS INC	2	4	113	12,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	2	5	65	7,128	保険
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	7	－	－	－	各種金融
BAKER HUGHES COMPANY	26	66	152	16,673	エネルギー
BIO-RAD LABORATORIES-A	－	2	85	9,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	－	16	105	11,501	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	5	11	611	66,685	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	－	68	423	46,135	各種金融
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	－	15	116	12,753	ソフトウェア・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	66	133	575	62,751	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	37	72	382	41,703	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77	222	1,424	155,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	4	10	133	14,590	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	－	25	106	11,660	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11	30	218	23,864	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	3	5	128	13,962	小売
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	14	－	－	－	メディア・娯楽
CBRE GROUP INC - A	13	27	164	17,907	不動産
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9	15	63	6,941	素材
CIGNA CORP	18	36	744	81,242	ヘルスケア機器・サービス
CIT GROUP INC	2	－	－	－	銀行
CMS ENERGY CORP	12	28	194	21,205	公益事業
CSX CORP	39	75	580	63,272	運輸
ALBEMARLE CORP	3	6	54	5,922	素材
CVS HEALTH CORP	61	123	881	96,083	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	15	44	65	7,124	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	9	17	84	9,253	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	23	46	483	52,688	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	12	30	162	17,685	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	7	17	167	18,292	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CARNIVAL CORP	21	37	176	19,196	消費者サービス
CATERPILLAR INC	28	54	768	83,806	資本財
CELANESE CORP	5	11	129	14,149	素材
CENTENE CORP	10	58	392	42,780	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	20	39	104	11,404	公益事業
CENTURYLINK INC	41	102	151	16,520	電気通信サービス
CHEMOURS CO/THE	4	—	—	—	素材
CHEVRON CORP	90	180	2,017	219,985	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1	2	200	21,910	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	12	24	172	18,820	家庭用品・パーソナル用品
ALLEGHANY CORP	0.63	1	123	13,429	保険
CIMAREX ENERGY CO	2	—	—	—	エネルギー
CITIGROUP INC	118	218	1,711	186,606	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19	36	141	15,448	銀行
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2	2	27	3,033	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	9	24	142	15,553	公益事業
CLOROX COMPANY	5	13	209	22,889	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO/THE	190	392	2,262	246,748	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	39	77	546	59,556	家庭用品・パーソナル用品
ALLSTATE CORP	17	32	382	41,756	保険
COMERICA INC	6	13	85	9,353	銀行
CONAGRA BRANDS INC	25	37	120	13,184	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	9	17	148	16,178	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	55	109	686	74,870	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	15	34	323	35,333	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8	16	325	35,452	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3	3	11	1,224	エネルギー
COOPER COS INC/THE	2	4	152	16,639	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	41	68	199	21,783	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	65	183	20,011	素材
COTY INC-CL A	7	25	26	2,880	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	5	14	110	12,015	素材
CUMMINS INC	7	15	266	29,054	資本財
DR HORTON INC	15	32	187	20,451	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	7	18	246	26,858	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	11	27	93	10,247	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	30	61	993	108,328	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	10	25	205	22,418	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	5	11	129	14,085	消費者サービス
DAVITA INC	4	9	75	8,238	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	14	29	496	54,119	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	3	13	69	7,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	7	13	77	8,440	運輸
DEVON ENERGY CORP	21	32	78	8,577	エネルギー
WALT DISNEY CO/THE	70	173	2,437	265,806	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	17	28	213	23,296	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	24	47	487	53,178	公益事業
EVEREST RE GROUP LTD	1	3	86	9,467	保険
DOLLAR GENERAL CORP	13	25	390	42,585	小売
DOMINION ENERGY INC	36	76	645	70,384	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	1	2	82	9,016	消費者サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AMERICAN EXPRESS CO	35	68	924	100,788	各種金融
DOVER CORP	6	12	151	16,565	資本財
DOW INC	－	73	356	38,863	素材
DOWDUPONT INC	109	－	－	－	素材
DUKE ENERGY CORP	34	69	671	73,281	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	－	73	434	47,353	素材
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	43	83	428	46,726	保険
EOG RESOURCES INC	27	56	454	49,620	エネルギー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1	3	67	7,401	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7	15	198	21,633	消費者サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	7	12	90	9,919	素材
EATON VANCE CORP	3	11	55	6,072	各種金融
ECOLAB INC	12	25	499	54,527	素材
BUNGE LTD	7	14	77	8,430	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	13	36	277	30,216	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10	20	461	50,341	ヘルスケア機器・サービス
ABBOTT LABORATORIES	83	167	1,517	165,493	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	－	24	76	8,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	30	59	458	50,047	資本財
ENTERGY CORP	7	20	273	29,783	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	－	4	109	11,913	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	5	9	148	16,225	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	－	44	110	12,104	各種金融
EVERGY INC	11	21	155	16,968	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	13	32	300	32,761	公益事業
EXELON CORP	46	93	448	48,925	公益事業
EXXON MOBIL CORP	199	408	2,709	295,455	エネルギー
FMC CORP	5	13	132	14,400	素材
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	－	3	95	10,375	各種金融
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7	15	213	23,322	公益事業
AMETEK INC	9	19	198	21,620	資本財
FEDEX CORP	12	24	373	40,780	運輸
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	16	59	873	95,260	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	11	27	135	14,744	保険
FIRST DATA CORP- CLASS A	22	－	－	－	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORP-CL A	15	29	309	33,770	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	25	－	－	－	エネルギー
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6	16	190	20,766	銀行
FIRSTENERGY CORP	20	54	275	30,064	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3	9	294	32,065	ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	3	－	－	－	資本財
FLOWSERVE CORP	4	11	56	6,163	資本財
FORD MOTOR CO	184	389	350	38,240	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	15	26	202	22,085	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	5	11	76	8,369	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	16	27	69	7,542	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	57	130	154	16,803	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7	18	181	19,785	保険
GAP INC/THE	6	23	42	4,614	小売
GARTNER INC	3	7	127	13,869	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	12	24	728	79,464	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GENERAL DYNAMICS CORP	12	23	442	48,218	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	417	831	973	106,178	資本財
GENERAL MILLS INC	29	61	328	35,854	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	61	125	429	46,832	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	6	12	123	13,422	小売
APACHE CORP	16	29	89	9,723	エネルギー
GLOBAL PAYMENTS INC	6	29	578	63,082	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	－	9	96	10,525	保険
GODADDY INC - CLASS A	6	15	110	11,996	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17	31	773	84,375	各種金融
WW GRAINGER INC	2	4	161	17,581	資本財
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	27	48	214	23,412	食品・飲料・タバコ
GRUBHUB INC	2	9	57	6,310	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	－	8	98	10,730	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	13	26	380	41,505	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	78	149	328	35,865	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	43	76	177	19,355	エネルギー
HANESBRANDS INC	15	40	57	6,249	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	3	12	44	4,879	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	4	－	－	－	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15	31	184	20,081	保険
HEICO CORP	－	2	29	3,230	資本財
HEICO CORP-CLASS A	－	8	78	8,612	資本財
HELMERICH & PAYNE	4	－	－	－	エネルギー
ARROW ELECTRONICS INC	2	9	73	8,019	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERSHEY CO/THE	5	12	199	21,710	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	11	28	182	19,949	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	76	117	172	18,848	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	14	27	303	33,093	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	8	17	79	8,662	エネルギー
HOME DEPOT INC	54	103	2,410	262,836	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	35	69	1,223	133,485	資本財
HORMEL FOODS CORP	12	29	139	15,262	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	6	13	464	50,639	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	2	4	119	13,025	資本財
IDEX CORP	3	7	135	14,793	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	14	31	554	60,508	資本財
INGREDION INC	2	7	68	7,486	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	27	55	536	58,461	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	43	84	1,186	129,426	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3	9	123	13,461	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	16	33	146	16,008	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	16	36	86	9,418	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	6	14	227	24,777	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	157	304	4,058	442,610	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	6	10	104	11,414	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	7	27	59	6,483	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	125	254	3,773	411,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	1	4	79	8,649	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	14	32	80	8,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KKR & CO INC -A	－	43	131	14,392	各種金融

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KANSAS CITY SOUTHERN	4	10	182	19,874	運輸
KELLOGG CO	10	22	156	17,083	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	42	85	165	18,086	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	8	20	206	22,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	16	32	470	51,366	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	97	200	432	47,217	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	5	9	108	11,790	公益事業
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2	10	38	4,219	運輸
KOHLS CORP	7	15	71	7,759	小売
KROGER CO	33	72	203	22,141	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	6	—	—	—	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	3	—	—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	21	480	52,357	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	4	9	176	19,207	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	7	13	117	12,857	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	20	29	199	21,710	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10	20	430	46,983	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	3	3	47	5,134	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	3	14	74	8,134	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	7	12	124	13,620	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-A	12	26	174	18,997	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	1	3	88	9,644	資本財
AUTOLIV INC	3	7	57	6,267	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	45	82	1,153	125,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOZONE INC	1	2	244	26,611	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	9	20	116	12,704	保険
AVERY DENNISON CORP	4	7	98	10,706	素材
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6	15	112	12,284	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	12	24	1,049	114,430	資本財
LOEWS CORP	11	24	124	13,546	保険
LOWE'S COS INC	38	75	913	99,627	小売
BB&T CORP	37	—	—	—	銀行
M & T BANK CORP	5	12	220	24,051	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	21	45	144	15,796	消費者サービス
MSCI INC	3	7	195	21,349	各種金融
MACY'S INC	16	—	—	—	小売
MANPOWERGROUP INC	2	2	27	2,991	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	35	64	77	8,418	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	33	65	357	38,972	エネルギー
MARKEL CORP	0.72	1	167	18,274	保険
MARSH & MCLENNAN COS	24	49	568	61,981	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2	5	146	16,030	素材
MASCO CORP	13	30	148	16,175	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	43	87	2,828	308,481	ソフトウェア・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5	12	209	22,823	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	36	72	1,539	167,876	消費者サービス
MCKESSON CORP	9	19	295	32,240	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	13	27	199	21,745	素材
MERCK & CO. INC.	125	248	2,133	232,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	41	79	406	44,323	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	1	2	204	22,266	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
BANK OF AMERICA CORP	446	849	2,850	310,824	銀行
MOHAWK INDUSTRIES INC	2	5	80	8,725	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7	14	82	8,954	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	8	17	436	47,643	各種金融
MORGAN STANLEY	63	123	672	73,330	各種金融
MOSAIC CO/THE	15	32	62	6,863	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6	16	292	31,937	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	15	27	103	11,322	公益事業
NVR INC	0.15	0.36	143	15,640	耐久消費財・アパレル
NATIONAL OILWELL VARCO INC	16	30	66	7,285	エネルギー
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	48	85	391	42,751	各種金融
NEWELL RUBBERMAID INC	25	41	83	9,095	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	22	81	360	39,294	素材
NEXTERA ENERGY INC	22	45	1,198	130,720	公益事業
NIKE INC -CL B	61	119	1,222	133,361	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	15	27	79	8,718	公益事業
NOBLE ENERGY INC	20	50	108	11,885	エネルギー
NORDSTROM INC	2	12	49	5,402	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	13	26	547	59,710	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	8	15	594	64,846	資本財
NUCOR CORP	13	31	160	17,454	素材
OGE ENERGY CORP	6	21	97	10,584	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	36	88	375	40,906	エネルギー
OMNICOM GROUP	9	19	152	16,642	メディア・娯楽
ONEOK INC	20	41	309	33,774	エネルギー
ORACLE CORP	141	226	1,223	133,475	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	2	8	56	6,127	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	22	43	647	70,587	銀行
PPG INDUSTRIES INC	12	23	295	32,257	素材
PPL CORP	29	73	268	29,282	公益事業
PVH CORP	3	7	75	8,201	耐久消費財・アパレル
PACKAGING CORP OF AMERICA	5	8	89	9,770	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	3	8	201	21,960	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	6	11	220	24,089	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	6	－	－	－	エネルギー
PAYCOM SOFTWARE INC	－	4	137	15,003	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	66	132	1,888	205,973	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	－	11	112	12,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	275	536	2,136	232,959	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	24	46	425	46,433	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	73	147	1,266	138,170	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	21	44	445	48,544	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	4	8	80	8,770	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	－	15	35	3,842	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	8	17	248	27,122	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	2	－	－	－	エネルギー
POLARIS INC	1	6	58	6,419	耐久消費財・アパレル
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12	24	133	14,518	保険
PROCTER & GAMBLE CO/THE	117	241	3,023	329,743	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	28	57	442	48,305	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	20	39	372	40,664	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	25	51	316	34,497	公益事業
PULTEGROUP INC	10	22	97	10,663	耐久消費財・アパレル
QUEST DIAGNOSTICS INC	5	11	126	13,824	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	—	13	101	11,070	素材
RALPH LAUREN CORP	1	4	55	6,059	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5	10	95	10,383	各種金融
RAYTHEON COMPANY	13	26	623	68,015	資本財
RED HAT INC	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BECTON DICKINSON AND CO	12	25	717	78,201	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	44	86	136	14,872	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2	4	72	7,955	保険
REPUBLIC SERVICES INC	9	23	217	23,749	商業・専門サービス
RESMED INC	5	14	231	25,237	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	7	151	16,571	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	6	6	41	4,546	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	5	10	207	22,609	資本財
ROLLINS INC	3	11	43	4,751	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	5	10	383	41,879	資本財
S&P GLOBAL INC	12	23	707	77,137	各種金融
SALESFORCE.COM INC	34	78	1,432	156,225	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	66	135	485	52,914	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	58	118	558	60,878	各種金融
SEALED AIR CORP	5	13	51	5,641	素材
SEMPRA ENERGY	13	26	425	46,416	公益事業
SERVICENOW INC	8	17	548	59,858	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4	8	481	52,482	素材
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2	—	—	—	各種金融
SMITH (A.O.) CORP	4	7	34	3,775	資本財
JM SMUCKER CO/THE	4	10	108	11,871	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	2	4	72	7,910	資本財
SNAP INC - A	—	62	118	12,972	メディア・娯楽
SOUTHERN CO/THE	49	99	691	75,466	公益事業
WR BERKLEY CORP	2	12	93	10,147	保険
SOUTHWEST AIRLINES CO	3	14	82	8,998	運輸
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	61	127	2,883	314,462	各種金融
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	5	10	75	8,274	資本財
SPRINT CORP	43	43	21	2,306	電気通信サービス
SQUARE INC - A	15	35	255	27,899	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	7	13	219	23,966	資本財
STATE STREET CORP	18	32	255	27,861	各種金融
STRYKER CORP	16	32	688	75,044	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	10	21	193	21,137	小売
SUNTRUST BANKS INC	22	—	—	—	銀行
SYNCHRONY FINANCIAL	29	54	177	19,376	各種金融
SYSCO CORP	24	48	401	43,742	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	60	116	713	77,804	小売
TAPESTRY INC	12	29	81	8,857	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	24	49	564	61,578	小売
TARGA RESOURCES CORP	9	18	71	7,757	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	3	141	15,391	資本財
TELEFLEX INC	1	4	153	16,743	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	52	95	96	10,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	10	24	109	11,943	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	19	37	1,263	137,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	27	55	988	107,792	資本財
TIFFANY & CO	4	11	153	16,783	小売
TORCHMARK CORP	5	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	6	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRANSDIGM GROUP INC	2	4	313	34,164	資本財
TRANSUNION	8	16	156	17,068	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	13	26	352	38,423	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	—	129	719	78,519	銀行
TWILIO INC - A	—	11	137	14,985	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	28	77	258	28,175	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	4	127	13,857	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	12	25	218	23,813	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	9	15	68	7,442	公益事業
US BANCORP	73	143	773	84,330	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	10	39	4,342	運輸
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4	4	8	936	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1	10	19	2,141	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	35	67	1,255	136,871	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	3	—	—	—	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	33	67	787	85,841	運輸
UNITED RENTALS INC	3	6	94	10,270	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	39	77	1,192	130,079	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	45	91	2,687	293,088	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4	6	96	10,487	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	11	11	32	3,496	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	10	21	521	56,828	素材
VF CORP	17	34	295	32,219	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	1	2	71	7,793	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	20	41	367	40,048	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4	7	106	11,579	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5	12	185	20,220	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	195	400	2,412	263,064	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	83	166	3,415	372,494	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	17	28	63	6,888	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	3	7	109	11,992	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	8	8	51	5,664	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	7	11	163	17,838	素材
WABCO HOLDINGS INC	1	5	72	7,942	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	15	32	321	35,043	公益事業
WABTEC CORP	2	19	153	16,697	資本財
WALMART INC	69	136	1,561	170,284	食品・生活必需品小売り
H&R BLOCK INC	5	—	—	—	消費者サービス
WASTE CONNECTIONS INC	13	27	266	29,066	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	21	41	506	55,213	商業・専門サービス
WATERS CORP	3	5	127	13,859	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	1	3	36	3,969	小売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	215	402	1,912	208,624	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	7	121	13,249	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN UNION CO	23	37	102	11,186	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1	1	10	1,179	素材
WESTROCK CO	10	22	93	10,153	素材
WHIRLPOOL CORP	2	6	102	11,178	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	59	122	271	29,660	エネルギー
BOEING CO/THE	25	52	1,680	183,275	資本財
WORKDAY INC-CLASS A	7	16	312	34,112	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
XPO LOGISTICS INC	5	9	89	9,785	運輸
XCEL ENERGY INC	25	52	352	38,495	公益事業
XEROX CORP	5	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XYLEM INC	7	16	130	14,271	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	—	21	75	8,185	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	15	31	331	36,179	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	8	18	63	6,926	電気通信サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	10	20	296	32,302	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	23	45	625	68,175	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BORGWARNER INC	11	21	86	9,410	自動車・自動車部品
AERCAP HOLDINGS NV	3	8	51	5,590	資本財
INVESCO LTD	11	26	47	5,175	各種金融
CHUBB LTD	22	44	671	73,242	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	16	27	229	25,033	素材
ACCENTURE PLC-CL A	30	60	1,270	138,595	ソフトウェア・サービス
AON PLC	11	23	502	54,767	保険
TE CONNECTIVITY LTD	17	33	325	35,542	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND PLC	12	23	311	33,970	資本財
APTIV PLC	13	27	251	27,414	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	21	41	401	43,787	資本財
TECHNIPFMC PLC	18	32	57	6,296	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9	16	84	9,226	資本財
ALLEGION PLC	5	8	107	11,712	資本財
STERIS PLC	—	7	111	12,209	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC	3	9	58	6,395	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	—	173	181	19,814	素材
CAPRI HOLDINGS LTD	8	16	57	6,246	耐久消費財・アパレル
PENTAIR PLC	5	12	59	6,494	資本財
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	4	16	48	5,304	素材
MEDTRONIC PLC	64	130	1,561	170,255	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	12	27	57	6,306	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	46	78	324	35,369	資本財
ALLERGAN PLC	16	31	590	64,383	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7	21	113	12,351	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC	26	51	1,085	118,400	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	5	12	56	6,181	保険
CHENIERE ENERGY INC	8	24	147	16,092	エネルギー
ABIOMED INC	1	5	96	10,496	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	35	76	452	49,305	メディア・娯楽
ADOBE INC	23	46	1,629	177,730	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	37	101	509	55,570	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	7	16	161	17,615	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ALIGN TECHNOLOGY INC	3	7	204	22,318	ヘルスケア機器・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3	11	134	14,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	14	30	4,427	482,917	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	14	28	4,243	462,752	メディア・娯楽
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1	1	5	596	運輸
ANSYS INC	3	7	202	22,110	ソフトウェア・サービス
BEIGENE LTD-ADR	1	5	81	8,918	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7	19	163	17,879	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	9	18	517	56,390	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	2	4	814	88,843	小売
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1	—	—	—	保険
BROADCOM INC	20	38	1,260	137,419	半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4	12	146	15,941	各種金融
CDK GLOBAL INC	5	12	67	7,347	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	6	12	178	19,463	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6	9	77	8,448	運輸
CME GROUP INC	17	34	725	79,115	各種金融
CADENCE DESIGN SYS INC	11	24	182	19,862	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10	22	232	25,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	12	27	208	22,688	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	7	15	773	84,320	メディア・娯楽
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6	15	166	18,163	保険
CISCO SYSTEMS INC	222	405	1,981	216,129	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	3	9	265	28,964	商業・専門サービス
CITRIX SYSTEMS INC	5	13	171	18,702	ソフトウェア・サービス
COGNEX CORP	9	17	101	11,099	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	28	56	352	38,394	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	216	430	1,920	209,400	メディア・娯楽
COMMSCOPE HOLDING CO INC	7	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COPART INC	9	18	184	20,114	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	7	10	120	13,098	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	20	42	1,305	142,365	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	1	3	208	22,778	商業・専門サービス
AMAZON.COM INC	19	40	7,522	820,446	小売
FLEX LTD	15	45	61	6,731	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	0.06	1	39	4,292	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	9	20	122	13,325	ヘルスケア機器・サービス
DEXCOM INC	4	9	212	23,166	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	6	16	137	14,970	エネルギー
DISCOVERY INC - A	6	17	52	5,694	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	16	33	95	10,421	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	5	21	80	8,746	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	—	10	80	8,737	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	12	23	209	22,861	小売
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	25	53	146	15,973	半導体・半導体製造装置
DROPBOX INC-CLASS A	—	10	18	1,979	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	10	19	88	9,669	各種金融
ARCH CAPITAL GROUP LTD	17	35	159	17,384	保険
EAST WEST BANCORP INC	3	15	75	8,268	銀行
EBAY INC	46	82	292	31,868	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ELECTRONIC ARTS INC	15	30	339	36,997	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	－	1	24	2,664	保険
EXACT SCIENCES CORP	－	11	101	11,116	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXPEDIA GROUP INC	5	14	164	17,978	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	7	17	133	14,512	運輸
FLIR SYSTEMS INC	3	10	56	6,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	113	231	5,055	551,311	メディア・娯楽
AMGEN INC	30	57	1,301	141,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FASTENAL CO	12	50	178	19,465	資本財
F5 NETWORKS INC	3	6	83	9,080	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIFTH THIRD BANCORP	27	72	209	22,837	銀行
ANALOG DEVICES INC	18	35	417	45,518	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	19	55	665	72,562	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC	5	14	173	18,967	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	－	37	137	15,012	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	－	18	66	7,216	メディア・娯楽
GILEAD SCIENCES INC	61	121	764	83,341	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	226	434	13,818	1,507,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	47	89	553	60,361	半導体・半導体製造装置
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	5	－	－	－	自動車・自動車部品
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7	15	61	6,666	資本財
HASBRO INC	5	10	114	12,500	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3	7	118	12,932	ソフトウェア・サービス
HOLOGIC INC	11	28	152	16,580	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3	7	84	9,262	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	44	89	123	13,454	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	3	8	217	23,753	メディア・娯楽
IPG PHOTONICS CORP	0.85	4	58	6,374	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEXX LABORATORIES INC	3	9	257	28,079	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	7	14	452	49,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	7	19	149	16,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	－	6	125	13,650	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	216	421	2,882	314,419	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	11	24	712	77,728	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	5	11	649	70,876	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	－	14	88	9,610	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP	6	16	293	31,989	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	30	66	201	22,001	食品・飲料・タバコ
LKQ CORP	16	28	95	10,428	小売
LAM RESEARCH CORP	7	14	441	48,107	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	10	21	434	47,335	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21	42	746	81,364	ソフトウェア・サービス
LIBERTY BROADBAND-C	4	11	147	16,098	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	2	9	46	5,044	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	9	17	86	9,484	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	10	21	101	11,089	メディア・娯楽
LULULEMON ATHLETICA INC	4	9	236	25,793	耐久消費財・アパレル
MARKETAXESS HOLDINGS INC	－	3	121	13,282	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	14	28	399	43,601	消費者サービス
MATCH GROUP INC	－	6	52	5,692	メディア・娯楽
MATTEL INC	13	－	－	－	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	11	23	145	15,910	半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	11	11	23	2,548	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	1	4	309	33,716	小売
MICROSOFT CORP	341	696	11,500	1,254,278	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9	25	269	29,385	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	55	105	610	66,602	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	2	2	34	3,722	資本財
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	70	137	754	82,329	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	—	4	67	7,365	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	20	40	268	29,322	食品・飲料・タバコ
NASDAQ INC	6	10	116	12,692	各種金融
NEKTAR THERAPEUTICS	8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	10	22	131	14,369	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	20	41	1,476	161,072	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	9	92	10,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	9	28	39	4,272	メディア・娯楽
NORTHERN TRUST CORP	8	21	218	23,883	各種金融
NORTONLIFELOCK INC	—	62	176	19,221	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	27	54	1,368	149,289	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	4	7	333	36,362	小売
OKTA INC	—	9	123	13,518	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3	5	106	11,618	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	16	31	79	8,718	半導体・半導体製造装置
PTC INC	5	11	95	10,416	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	17	34	265	28,917	資本財
PAYCHEX INC	16	31	282	30,796	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	53	105	1,237	134,939	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	13	34	54	5,917	銀行
T ROWE PRICE GROUP INC	12	24	320	34,907	各種金融
QORVO INC	4	11	134	14,678	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	66	114	1,030	112,428	半導体・半導体製造装置
QURATE RETAIL INC	18	—	—	—	小売
REGENERON PHARMACEUTICALS	3	8	295	32,196	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROKU INC	—	7	97	10,654	メディア・娯楽
ROSS STORES INC	18	36	416	45,474	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	5	13	83	9,129	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8	20	130	14,283	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	2	4	105	11,462	銀行
SABRE CORP	9	27	63	6,874	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	7	88	9,695	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENRY SCHEIN INC	7	13	92	10,133	ヘルスケア機器・サービス
SEATTLE GENETICS INC	5	11	130	14,181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	1	5	86	9,381	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	84	154	109	11,946	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7	17	209	22,876	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	5	13	205	22,430	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	64	116	1,070	116,717	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	12	23	72	7,887	素材
SYMANTEC CORP	25	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	6	12	199	21,790	ソフトウェア・サービス
TD AMERITRADE HOLDING CORP	11	24	122	13,377	各種金融

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
T-MOBILE US INC	17	34	279	30,517	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	5	11	149	16,313	メディア・娯楽
TERADYNE INC	－	18	131	14,311	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	6	12	724	79,031	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	46	88	1,157	126,260	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5	10	102	11,153	小売
TRIMBLE INC	13	22	98	10,787	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	4	4	13	1,514	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX-A	51	－	－	－	メディア・娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	18	－	－	－	メディア・娯楽
ULTA BEAUTY INC	2	4	135	14,826	小売
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	－	3	29	3,251	運輸
UNITED THERAPEUTICS CORP	1	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	4	9	197	21,508	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	8	13	223	24,391	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12	24	562	61,354	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CLASS B	15	－	－	－	メディア・娯楽
VIACOMCBS INC - CLASS B	－	45	164	17,951	メディア・娯楽
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	40	76	398	43,434	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	12	31	221	24,208	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WYNN RESORTS LTD	4	10	137	14,945	消費者サービス
XILINX INC	12	24	250	27,285	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	－	4	121	13,256	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - C	4	14	68	7,438	メディア・娯楽
ZIONS BANCORPORATION	9	18	85	9,367	銀行
ALKERMES PLC	6	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARMIN LTD	5	12	121	13,218	耐久消費財・アパレル
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3	5	83	9,139	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	16	28	378	41,324	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY	11	25	161	17,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY GLOBAL PLC-A	3	13	26	2,921	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23	35	67	7,415	メディア・娯楽
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	9	15	88	9,689	消費者サービス
IHS MARKIT LTD	20	32	263	28,699	商業・専門サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5	13	273	29,792	保険
WIX.COM LTD	1	4	61	6,721	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	－	5	76	8,376	ソフトウェア・サービス
MYLAN NV	21	45	99	10,823	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	1	1	0.54	58	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	74	130	72	7,897	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	10	22	124	13,594	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	11	23	73	8,026	資本財
小計 株数・金額	14,055	28,568	269,479	29,389,433	
小計 銘柄数＜比率＞	593	608	－	＜51.3%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	5	－	－	－	エネルギー
AIR CANADA	－	8	39	3,287	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	－	62	123	10,202	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	22	87	386	32,066	食品・生活必需品小売り
AURORA CANNABIS INC	13	43	11	945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	10	16	106	8,793	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
BAUSCH HEALTH COS INC	14	32	122	10,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKBERRY LTD	14	14	12	1,012	ソフトウェア・サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	42	86	712	59,073	各種金融
CAE INC	8	31	124	10,345	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	7	16	95	7,928	素材
CGI INC	—	20	235	19,563	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	7	7	17	1,489	各種金融
CAMECO CORP	24	24	27	2,258	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21	43	474	39,326	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	35	69	868	72,027	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	60	120	478	39,711	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	7	13	479	39,798	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2	5	72	6,009	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1	9	39	3,294	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	11	11	33	2,806	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	61	103	119	9,885	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.87	1	253	21,056	ソフトウェア・サービス
ALTAGAS LTD	5	29	59	4,950	公益事業
CRONOS GROUP INC	—	10	9	828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	14	34	159	13,236	小売
EMERA INC	0.5	23	144	11,975	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	8	8	26	2,230	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	46	85	42	3,499	エネルギー
ENBRIDGE INC	97	195	1,055	87,566	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1	2	151	12,558	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	7	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	1	—	—	—	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	24	42	51	4,280	素材
FORTIS INC	18	36	214	17,784	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	8	16	238	19,796	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11	18	70	5,858	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	40	—	—	—	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	18	18	63	5,266	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	10	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	13	13	12	1,055	エネルギー
HYDRO ONE LTD	16	34	92	7,665	公益事業
IGM FINANCIAL INC	0.81	0.81	3	262	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	3	12	91	7,618	保険
IMPERIAL OIL LTD	16	28	96	8,012	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	6	13	186	15,460	保険
INTER PIPELINE LTD	18	34	77	6,419	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	0.63	8	44	3,711	公益事業
KEYERA CORP	8	22	79	6,557	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	32	102	66	5,508	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	23	131	10,917	素材
LOBLAW COMPANIES LTD	8	14	99	8,226	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	18	73	53	4,431	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	17	33	231	19,163	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	99	193	524	43,540	保険
METHANEX CORP	1	1	6	539	素材
METRO INC	14	26	142	11,823	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	14	35	264	21,916	銀行
BANK OF MONTREAL	31	61	644	53,446	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	59	117	860	71,351	銀行
NUTRIEN LTD	31	59	346	28,730	素材
BARRICK GOLD CORP	91	179	441	36,631	素材
ONEX CORPORATION	2	9	78	6,545	各種金融
OPEN TEXT CORP	15	26	158	13,160	ソフトウェア・サービス
PARKLAND FUEL CORP	—	17	82	6,876	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	21	46	238	19,771	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	17	34	119	9,873	保険
POWER FINANCIAL CORP	10	27	97	8,068	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5	5	7	638	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	—	12	42	3,519	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	10	28	241	20,001	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	15	34	225	18,678	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	68	136	1,442	119,648	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	8	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	11	24	98	8,176	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	4	—	—	—	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22	38	99	8,291	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	4	9	602	49,984	ソフトウェア・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	10	25	209	17,334	素材
STARS GROUP INC/THE	6	28	90	7,539	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	26	59	377	31,284	保険
SUNCOR ENERGY INC	79	154	656	54,427	エネルギー
TC ENERGY CORP	—	91	660	54,781	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CLS B	22	60	115	9,604	素材
TELUS CORP	3	3	16	1,388	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	9	19	201	16,674	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	87	174	1,291	107,137	銀行
TOURMALINE OIL CORP	4	—	—	—	エネルギー
TRANSCANADA CORP	45	—	—	—	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	8	—	—	—	素材
VERMILION ENERGY INC	5	—	—	—	エネルギー
WSP GLOBAL INC	6	12	119	9,873	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3	3	19	1,602	素材
WESTON (GEORGE) LTD	2	8	87	7,255	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	27	43	170	14,121	素材
BOMBARDIER INC-B	80	80	9	816	資本財
小計 株数・金額	1,846	3,664	19,181	1,590,927	
小計 銘柄数<比率>	88	85	—	<2.8%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	9	17	558	67,147	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	17	37	183	22,042	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	2	14	44	5,300	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	0.56	0.56	2	282	素材
HANNOVER RUECK SE	2	4	86	10,443	保険
GEA GROUP AG	4	16	47	5,724	資本財
CONTINENTAL AG	4	10	107	12,874	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	50	99	331	39,845	運輸
AXEL SPRINGER SE	0.35	—	—	—	メディア・娯楽

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MERCK KGAA	5	12	144	17,424	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	29	58	185	22,308	公益事業
SAP SE	47	93	1,189	143,115	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	114	235	244	29,471	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	4	9	84	10,168	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	0.2	7	58	7,055	耐久消費財・アパレル
BAYER AG-REG	44	90	683	82,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	7	18	176	21,237	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	44	89	569	68,554	素材
BEIERSDORF AG	4	10	114	13,715	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	0.17	0.17	1	224	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	8	13	89	10,819	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	9	19	143	17,221	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	20	40	898	108,118	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14	14	20	2,459	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7	14	391	47,074	保険
VOLKSWAGEN AG	1	1	33	4,083	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PREF	9	18	329	39,579	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	44	89	393	47,313	自動車・自動車部品
THYSSENKRUPP AG	20	20	22	2,762	素材
SIEMENS AG-REG	37	73	867	104,329	資本財
1&1 DRILLISCH AG	1	—	—	—	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	86	208	161	19,451	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17	29	205	24,671	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	1	6	33	4,002	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	164	326	483	58,189	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	1	3	74	8,931	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	57	128	281	33,922	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	2	29	3,542	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	9	19	290	34,976	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	6	17	114	13,779	自動車・自動車部品
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	0.35	3	26	3,228	運輸
WIRECARD AG	5	11	156	18,799	ソフトウェア・サービス
LANXESS AG	1	7	41	4,952	素材
MTU AERO ENGINES AG	2	5	149	17,959	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	16	35	133	16,035	不動産
SYMRISE AG	5	12	115	13,939	素材
BRENNTAG AG	7	15	73	8,836	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	3	17	46	5,608	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6	6	1	207	電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	56	56	28	3,479	銀行
OSRAM LICHT AG	1	—	—	—	資本財
KION GROUP AG	1	7	43	5,189	資本財
VONOVIA SE	25	52	266	32,027	不動産
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	5	—	—	—	メディア・娯楽
KNORR-BREMSE AG	—	2	29	3,550	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4	15	70	8,450	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	1	19	25	3,045	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	5	—	—	—	公益事業
ZALANDO SE	2	8	36	4,421	小売

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
COVESTRO AG		11	19	78	9,391	素材
UNIPER SE		11	21	64	7,775	公益事業
DELIVERY HERO SE		4	11	77	9,308	小売
小計	株数・金額	1,100	2,207	11,143	1,340,596	
	銘柄数<比率>	61	57	—	<2.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		51	98	178	21,495	保険
INTESA SANPAOLO		729	1,445	329	39,604	銀行
MEDIOBANCA SPA		35	68	65	7,887	銀行
ENEL SPA		396	782	611	73,621	公益事業
ENI SPA		124	251	338	40,715	エネルギー
SNAM SPA		124	203	99	11,957	公益事業
TELECOM ITALIA SPA		720	720	36	4,369	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP		97	714	35	4,241	電気通信サービス
ATLANTIA SPA		24	51	110	13,246	運輸
TERNA SPA		81	144	91	10,992	公益事業
RECORDATI SPA		1	8	33	4,022	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA		8	31	35	4,232	資本財
PRYSMIAN SPA		12	12	27	3,272	資本財
MONCLER SPA		6	21	87	10,551	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA		—	67	73	8,884	銀行
UNICREDIT SPA		85	205	255	30,702	銀行
POSTE ITALIANE SPA		21	53	56	6,843	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		14	35	30	3,671	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA		17	17	8	998	自動車・自動車部品
小計	株数・金額	2,554	4,933	2,504	301,310	
	銘柄数<比率>	18	19	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES SA		10	17	67	8,149	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT		23	50	135	16,309	公益事業
L'OREAL		12	24	662	79,693	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI		13	26	1,102	132,614	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA		0.11	0.11	12	1,478	資本財
THALES SA		4	12	119	14,343	資本財
CAPGEMINI SA		6	16	196	23,645	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		0.45	6	22	2,747	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP		1	4	41	5,022	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE		11	19	81	9,747	メディア・娯楽
FAURECIA		2	8	34	4,155	自動車・自動車部品
BOLLORE		32	32	12	1,446	運輸
MICHELIN (CGDE)		7	15	163	19,703	自動車・自動車部品
PERNOD RICARD SA		10	21	346	41,718	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		8	18	65	7,928	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU		0.18	0.18	1	214	食品・飲料・タバコ
SEB SA		0.21	1	19	2,343	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE		27	53	506	60,957	資本財
VIVENDI		53	80	201	24,189	メディア・娯楽
ORANGE		100	199	261	31,442	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		1	3	231	27,798	耐久消費財・アパレル
SOCIETE BIC SA		0.23	—	—	—	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA		5	13	222	26,764	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
KERING	3	7	425	51,243	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	10	10	17	2,081	保険
CARREFOUR SA	26	65	100	12,038	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	4	10	78	9,442	ソフトウェア・サービス
SANOFI	53	107	960	115,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	11	18	71	8,575	消費者サービス
SOCIETE GENERALE SA	37	86	260	31,342	銀行
TELEPERFORMANCE	2	6	149	17,973	商業・専門サービス
EURAZEO	0.34	4	25	3,027	各種金融
SODEXO	4	10	101	12,180	消費者サービス
AXA SA	94	189	460	55,369	保険
PEUGEOT SA	24	51	98	11,892	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	0.6	0.6	1	182	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	14	28	390	46,954	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	47	101	127	15,363	銀行
BNP PARIBAS	54	109	545	65,595	銀行
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	21	52	185	22,322	資本財
WENDEL	0.24	2	36	4,353	各種金融
ILIAD SA	0.98	0.98	11	1,356	電気通信サービス
IMERYS SA	0.29	－	－	－	素材
SAFRAN SA	16	32	470	56,606	資本財
ENGIE	91	184	289	34,783	公益事業
ALSTOM	9	19	90	10,832	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4	4	5	710	メディア・娯楽
EDF	27	61	70	8,423	公益事業
IPSEN	1	1	10	1,217	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	4	8	69	8,376	素材
LEGRAND SA	11	23	175	21,086	資本財
EIFFAGE	2	7	81	9,863	資本財
TOTAL SA	113	228	1,081	130,060	エネルギー
ADP	1	3	53	6,463	運輸
NATIXIS	31	31	12	1,466	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT	3	8	56	6,828	メディア・娯楽
SCOR SE	7	15	60	7,229	保険
REXEL SA	7	－	－	－	資本財
VINCI SA	25	49	509	61,273	資本財
DANONE	30	60	448	53,913	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE SA	20	46	603	72,569	素材
BUREAU VERITAS SA	8	34	89	10,732	商業・専門サービス
GETLINK	23	46	73	8,859	運輸
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	22	22	33	4,030	公益事業
EDENRED	14	23	111	13,413	商業・専門サービス
VALEO SA	10	24	69	8,307	自動車・自動車部品
BIOMERIEUX	1	1	9	1,177	ヘルスケア機器・サービス
WORLDLINE SA	－	5	38	4,602	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	0.88	2	48	5,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	1	6	45	5,501	各種金融
小計 株数・金額	1,240	2,440	13,162	1,583,494	
小計 銘柄数＜比率＞	69	67	－	＜2.8%＞	
(ユーロ…オランダ)					
AIRBUS SE	28	56	782	94,143	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
RANDSTAD NV	5	13	70	8,518	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER	12	28	200	24,173	商業・専門サービス
VOPAK	0.56	7	37	4,460	エネルギー
AEGON NV	80	165	63	7,668	保険
KONINKLIJKE KPN NV	186	378	103	12,459	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	36	60	168	20,236	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	46	89	407	48,981	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV	10	25	253	30,539	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	5	11	107	12,941	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	7	16	182	21,921	素材
UNILEVER NV-CVA	73	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
UNILEVER NV	—	137	714	86,007	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV	19	40	1,087	130,855	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	60	115	259	31,256	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV	5	12	200	24,062	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	58	95	92	11,075	資本財
AKZO NOBEL	9	20	179	21,563	素材
PROSUS NV	—	48	327	39,370	小売
NN GROUP NV	15	28	90	10,939	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	47	96	117	14,117	自動車・自動車部品
ABN AMRO BANK NV-CVA	21	38	60	7,229	銀行
EXOR NV	5	11	85	10,292	各種金融
ALTICE EUROPE NV	—	73	44	5,399	メディア・娯楽
QIAGEN N.V.	12	21	68	8,234	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV	—	1	89	10,750	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA	186	374	382	45,999	銀行
小計 株数・金額	938	1,968	6,177	743,198	
小計 銘柄数＜比率＞	23	26	—	＜1.3%＞	
(ユーロ…スペイン)					
ENDESA SA	15	31	78	9,421	公益事業
BANKINTER SA	28	28	16	2,022	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	320	667	307	36,975	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	19	34	80	9,644	公益事業
REPSOL SA	59	129	170	20,483	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	771	1,636	579	69,703	銀行
TELEFONICA SA	228	471	288	34,737	電気通信サービス
ENAGAS SA	6	12	31	3,750	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A.	4	4	6	751	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11	28	91	11,043	資本財
FERROVIAL SA	23	51	152	18,370	資本財
MAPFRE SA	9	9	2	270	保険
BANCO DE SABADELL SA	205	551	53	6,396	銀行
CAIXABANK S.A	181	351	93	11,209	銀行
IBERDROLA SA	300	584	577	69,503	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA	21	39	307	36,987	ソフトウェア・サービス
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	13	—	—	—	運輸
RED ELECTRICA CORPORACION SA	15	43	80	9,685	公益事業
(Right)ACS ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	11	—	—	—	資本財
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	54	108	336	40,458	小売
AENA SME SA	3	7	120	14,554	運輸
CELLNEX TELECOM SA	—	27	121	14,596	電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
GRIFOLS SA		13	28	89	10,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA		16	16	2	325	銀行
小計	株数・金額	2,334	4,865	3,588	431,695	
	銘柄数＜比率＞	23	22	－	＜0.8%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV		10	21	149	17,982	銀行
SOLVAY SA		4	8	81	9,828	素材
UCB SA		5	10	85	10,343	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		2	2	13	1,579	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		3	8	78	9,462	各種金融
PROXIMUS		2	9	23	2,840	電気通信サービス
GALAPAGOS NV		－	5	108	13,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELENET GROUP HOLDING NV		1	1	7	945	メディア・娯楽
AGEAS		6	16	87	10,513	保険
UMICORE		12	22	97	11,679	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		37	74	526	63,389	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	87	182	1,260	151,634	
	銘柄数＜比率＞	10	11	－	＜0.3%＞	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		10	14	69	8,369	エネルギー
VERBUND AG		2	7	37	4,506	公益事業
VOESTALPINE AG		7	7	16	2,000	素材
ERSTE GROUP BANK AG		13	33	114	13,719	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		12	12	25	3,086	銀行
ANDRITZ AG		7	3	13	1,591	資本財
小計	株数・金額	52	79	276	33,274	
	銘柄数＜比率＞	6	6	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		0.48	1	60	7,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		12	50	51	6,232	エネルギー
SES		22	22	28	3,423	メディア・娯楽
RTL GROUP		0.32	－	－	－	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		27	104	86	10,396	不動産
ARCELORMITTAL		28	74	105	12,665	素材
小計	株数・金額	92	253	332	40,042	
	銘柄数＜比率＞	6	5	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ ABP		27	27	29	3,590	資本財
UPM-KYMMENE OYJ		23	48	140	16,911	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS		27	56	67	8,070	素材
SAMPO OYJ-A SHS		19	46	192	23,116	保険
FORTUM OYJ		24	39	90	10,861	公益事業
ELISA OYJ		7	12	66	7,945	電気通信サービス
METSO OYJ		0.9	7	26	3,159	資本財
NOKIA OYJ		280	597	219	26,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ		6	38	132	15,987	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ		4	4	9	1,182	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B		15	35	213	25,703	資本財
ORION OYJ-CLASS B		1	12	54	6,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	439	926	1,242	149,522	
	銘柄数＜比率＞	12	12	－	＜0.3%＞	

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC		43	72	255	30,685	素材
KINGSPAN GROUP PLC		4	17	99	11,966	資本財
KERRY GROUP PLC-A		7	13	157	18,932	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		10	22	74	8,965	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC		38	104	47	5,707	銀行
AIB GROUP PLC		20	20	5	647	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		5	9	94	11,413	消費者サービス
小計	株数・金額	129	259	734	88,319	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		108	183	78	9,488	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		20	46	65	7,841	エネルギー
JERONIMO MARTINS		7	22	35	4,295	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	136	252	179	21,625	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	9,106	18,369	40,604	4,884,712	
	銘柄数<比率>	238	235	—	<8.5%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC		11	43	37	5,390	素材
ASHTEAD GROUP PLC		22	49	127	18,143	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		48	103	84	11,989	耐久消費財・アパレル
AVIVA PLC		168	342	141	20,095	保険
DIAGEO PLC		117	225	731	104,213	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC		3	11	37	5,402	各種金融
DCC PLC		4	8	52	7,459	資本財
BAE SYSTEMS PLC		137	335	216	30,797	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		109	218	744	106,162	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC		—	40	87	12,539	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC		116	287	197	28,202	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		47	82	162	23,121	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		939	1,913	1,108	157,994	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC		257	629	196	27,985	保険
MEGGITT PLC		23	70	48	6,939	資本財
WM MORRISON SUPERMARKETS		91	230	43	6,152	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		19	32	87	12,484	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC		37	73	42	6,100	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC		18	30	92	13,239	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC		125	248	352	50,198	保険
RIO TINTO PLC		56	109	488	69,553	素材
ST JAMES'S PLACE PLC		29	57	64	9,202	各種金融
SSE PLC		44	93	142	20,299	公益事業
BP PLC		947	1,937	941	134,192	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC		3,420	6,816	395	56,433	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		190	363	81	11,564	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		486	969	241	34,372	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		37	88	170	24,333	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC		235	473	863	123,030	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE		5	25	35	5,083	資本財
BABCOCK INTL GROUP PLC		2	—	—	—	商業・専門サービス
ASTRAZENECA PLC		60	124	952	135,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC		429	765	130	18,657	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
CARNIVAL PLC	8	17	59	8,412	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	91	91	16	2,404	小売
BARCLAYS PLC	832	1,674	290	41,396	銀行
INTERTEK GROUP PLC	7	17	106	15,150	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	19	32	69	9,865	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	7	12	91	13,102	小売
KINGFISHER PLC	60	127	26	3,754	小売
ITV PLC	109	429	60	8,632	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	95	95	20	2,860	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	27	175	36	5,171	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	4	11	25	3,621	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS	7	13	73	10,477	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	259	609	55	7,933	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	217	414	906	129,221	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	177	357	787	112,162	エネルギー
BUNZL PLC	15	33	68	9,716	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	—	172	83	11,861	商業・専門サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	13	32	258	36,843	各種金融
UNILEVER PLC	54	105	472	67,405	家庭用品・パーソナル用品
TUI AG-DI	12	41	34	4,920	消費者サービス
INVESTEC PLC	23	—	—	—	各種金融
EXPERIAN PLC	47	93	251	35,806	商業・専門サービス
MONDI PLC	20	53	86	12,376	素材
SEVERN TRENT PLC	10	25	66	9,450	公益事業
WHITBREAD PLC	8	9	42	6,026	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	15	28	4,105	各種金融
SMITHS GROUP PLC	18	38	66	9,495	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	53	106	226	32,212	素材
3I GROUP PLC	53	88	98	14,106	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	32	67	416	59,308	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	98	189	388	55,294	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	1	—	—	—	素材
UNITED UTILITIES GROUP PLC	20	47	47	6,780	公益事業
OCADO GROUP PLC	—	28	37	5,302	小売
GLENCORE PLC	559	1,090	251	35,815	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	14	—	—	—	エネルギー
GVC HOLDINGS PLC	15	69	61	8,785	消費者サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	72	180	118	16,878	資本財
EVRAZ PLC	—	30	11	1,660	素材
NMC HEALTH PLC	4	4	5	841	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	1	1	1	274	運輸
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	247	423	94	13,496	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	41	123	94	13,430	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	57	114	114	16,327	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-DI	7	18	51	7,294	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	—	7	35	5,112	ソフトウェア・サービス
CONVATEC GROUP PLC	20	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
COMPASS GROUP PLC	78	156	300	42,875	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NATIONAL GRID PLC	167	333	337	48,140	公益事業
ROYAL MAIL PLC	29	—	—	—	運輸

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
MERLIN ENTERTAINMENT	23	－	－	－	消費者サービス
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	105	187	58	8,381	各種金融
FERGUSON PLC	10	－	－	－	資本財
BHP GROUP PLC	103	206	367	52,398	素材
VODAFONE GROUP PLC	1,304	2,602	407	58,041	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	9	16	80	11,437	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	－	16	17	2,544	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	－	12	66	9,518	素材
FERGUSON PLC	－	23	168	23,951	資本財
M&G PLC	－	215	52	7,546	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	46	93	51	7,396	保険
INFORMA PLC	70	115	94	13,497	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC	38	103	61	8,807	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	－	8	73	10,463	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	30	74	25	3,610	保険
JD SPORTS FASHION PLC	－	49	42	6,002	小売
CRODA INTERNATIONAL PLC	5	－	－	－	素材
MELROSE INDUSTRIES PLC	274	445	109	15,622	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	8	18	50	7,173	素材
小計 株数・金額	14,042	28,776	17,609	2,509,596	
小計 銘柄数＜比率＞	92	93	－	＜4.4%＞	
(スイス)			千スイスフラン		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.02	0.33	72	8,100	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.03	0.11	90	10,143	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	－	0.01	92	10,351	食品・飲料・タバコ
CLARIANT AG-REG	5	5	12	1,448	素材
TEMENOS GROUP AG-REG	3	6	97	11,013	ソフトウェア・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.58	1	107	12,109	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2	2	12	1,407	耐久消費財・アパレル
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.23	0.78	51	5,733	素材
SWISS PRIME SITE-REG	4	8	97	10,988	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	0.29	0.29	2	265	各種金融
DUFRY AG-REG	0.57	4	41	4,677	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.8	1	156	17,608	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG	0.52	2	52	5,939	資本財
SIKA AG-REG	5	10	196	22,028	素材
ALCON INC	－	42	253	28,506	ヘルスケア機器・サービス
VIFOR PHARMA AG	1	4	89	10,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	0.25	0.55	152	17,097	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	1	2	134	15,075	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	0.4	0.81	255	28,712	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7	14	610	68,558	保険
NOVARTIS AG-REG	102	207	1,900	213,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	92	180	423	47,548	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	33	66	2,149	241,636	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO SA-REG	9	15	91	10,277	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	21	42	223	25,072	素材
NESTLE SA-REG	144	288	3,145	353,531	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	1	5	91	10,325	保険
SONOVA HOLDING AG-REG	2	4	101	11,414	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	128	253	334	37,575	各種金融

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
SWATCH GROUP AG/THE-BR		1	3	79	8,883	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG		3	7	296	33,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		1	3	171	19,319	保険
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		1	3	98	11,092	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		3	5	86	9,751	運輸
GEBERIT AG-REG		1	3	175	19,698	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD		10	18	90	10,220	各種金融
SWISS RE AG		15	30	340	38,278	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG		26	51	388	43,623	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG		188	376	466	52,428	各種金融
小計	株数・金額	825	1,677	13,234	1,487,414	
	銘柄数<比率>	37	39	—	<2.6%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		0.9	0.9	39	445	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		69	144	1,336	15,238	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		46	99	1,346	15,353	銀行
SWEDISH MATCH AB		10	18	1,019	11,618	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS		9	38	602	6,871	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS		24	47	2,545	29,016	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		39	75	1,417	16,160	小売
ERICSSON LM-B SHS		161	312	2,494	28,435	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB		130	268	1,107	12,626	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		13	37	856	9,768	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB		10	10	350	3,996	エネルギー
ALFA LAVAL AB		17	36	897	10,229	資本財
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		1	1	65	741	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB		0.65	5	217	2,478	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		3	28	215	2,456	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B		7	15	365	4,165	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES		11	25	463	5,288	資本財
VOLVO AB-B SHS		83	157	2,460	28,055	資本財
SANDVIK AB		50	119	2,244	25,586	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		6	6	146	1,674	各種金融
HEXAGON AB-B SHS		11	24	1,363	15,543	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS		24	54	803	9,156	電気通信サービス
INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS		11	—	—	—	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS		29	71	2,775	31,644	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS		23	37	1,284	14,638	資本財
BOLIDEN AB		16	—	—	—	素材
EPIROC AB-A		26	57	700	7,981	資本財
EPIROC AB-B		12	12	155	1,768	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		26	53	1,667	19,011	家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB		—	31	768	8,764	素材
KINNEVIK AB - B		—	23	546	6,234	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		65	163	1,548	17,651	銀行
ASSA ABLOY AB-B		44	89	2,142	24,419	資本財
NORDEA BANK ABP		154	331	2,532	28,871	銀行
小計	株数・金額	1,144	2,399	36,481	415,892	
	銘柄数<比率>	32	32	—	<0.7%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		48	89	1,443	17,393	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
TELENOR ASA		34	85	1,425	17,173	電気通信サービス
EQUINOR ASA		50	94	1,693	20,409	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		9	17	578	6,966	素材
MOWI ASA		20	50	1,136	13,697	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA		81	81	246	2,975	素材
AKER BP ASA		2	2	67	816	エネルギー
ORKLA ASA		23	94	834	10,059	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		6	6	132	1,597	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		5	5	148	1,794	メディア・娯楽
小計	株数・金額	282	526	7,708	92,883	
	銘柄数<比率>	10	10	－	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B		5	11	1,162	18,709	食品・飲料・タバコ
AP MOELLER-MAERSK A/S-B		0.37	0.67	577	9,300	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-A		0.1	0.39	317	5,117	運輸
DANSKE BANK A/S		31	60	662	10,661	銀行
GENMAB A/S		2	6	954	15,366	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		8	16	1,107	17,830	資本財
H LUNDBECK A/S		1	1	33	535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A S		8	20	1,542	24,835	運輸
PANDORA A/S		4	10	406	6,539	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S		4	11	609	9,809	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES		12	20	723	11,650	素材
COLOPLAST-B		6	12	1,084	17,462	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B		86	170	7,159	115,273	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S		9	9	167	2,703	商業・専門サービス
TRYG A/S		0.94	6	145	2,339	保険
ORSTED A/S		8	20	1,538	24,776	公益事業
DEMANT A/S		5	5	123	1,983	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	198	386	18,316	294,896	
	銘柄数<比率>	17	17	－	<0.5%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		6	14	112	8,378	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP		138	279	724	53,830	銀行
AMCOR PLC-CDI		53	－	－	－	素材
WESTPAC BANKING CORP		164	334	843	62,707	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		3	－	－	－	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		95	162	202	15,048	素材
TELSTRA CORP LTD		207	327	127	9,451	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		3	32	33	2,501	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		4	51	61	4,585	食品・飲料・タバコ
ASX LTD		9	14	125	9,313	各種金融
BHP GROUP LTD		141	285	1,154	85,796	素材
CALTEX AUSTRALIA LTD		8	30	105	7,859	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		4	4	1	141	小売
COMPUTERSHARE LTD		27	27	48	3,631	ソフトウェア・サービス
CSL LTD		21	43	1,356	100,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD		0.43	5	63	4,739	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP		115	274	435	32,350	運輸
COCHLEAR LTD		2	5	139	10,330	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LTD		83	143	122	9,130	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	83	170	1,447	107,552	銀行
BORAL LTD	37	129	65	4,903	素材
RIO TINTO LTD	16	38	401	29,860	素材
APA GROUP	68	119	135	10,061	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	27	62	230	17,126	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	124	257	187	13,943	保険
TPG TELECOM LTD	2	2	2	150	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	0.44	0.44	1	135	消費者サービス
ORICA LTD	23	23	53	3,957	素材
LENDLEASE GROUP	35	67	127	9,441	不動産
BLUESCOPE STEEL LTD	21	62	95	7,107	素材
WORLEY LTD	10	10	16	1,258	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	69	115	150	11,150	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	131	275	711	52,834	銀行
NEWCREST MINING LTD	34	70	225	16,720	素材
OIL SEARCH LTD	67	147	113	8,422	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	53	53	18	1,349	素材
AMP LTD	116	366	68	5,065	各種金融
QANTAS AIRWAYS LTD	－	87	58	4,337	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	63	138	190	14,188	保険
CHALLENGER LTD	17	17	15	1,163	各種金融
SANTOS LTD	86	146	129	9,634	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	13	44	137	10,211	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3	3	7	581	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD	117	212	100	7,493	消費者サービス
WESFARMERS LTD	57	114	511	38,039	小売
ALUMINA LTD	77	257	57	4,304	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	40	84	298	22,211	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	65	125	513	38,148	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	－	8	53	3,953	各種金融
SEEK LTD	9	33	79	5,903	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	0.49	－	－	－	消費者サービス
BRAMBLES LTD	75	153	189	14,087	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	16	33	488	36,283	各種金融
CROWN RESORTS LTD	7	7	9	691	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	16	39	123	9,150	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	35	70	124	9,271	食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT	52	120	101	7,533	運輸
AURIZON HOLDINGS LTD	106	214	117	8,710	運輸
AUSNET SERVICES	14	14	2	187	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	161	161	51	3,799	保険
AGL ENERGY LTD	36	66	133	9,924	公益事業
SOUTH32 LTD	232	585	159	11,883	素材
CIMIC GROUP LTD	0.82	6	19	1,463	資本財
COLES GROUP LTD	62	113	185	13,751	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	－	16	39	2,941	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	3,388	6,890	13,613	1,011,458	
小計 銘柄数＜比率＞	62	62	－	＜1.8%＞	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	15	15	26	1,906	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	37	75	121	8,714	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	14	63	144	10,402	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	11	101	57	4,097	素材
SPARK NEW ZEALAND LTD	101	217	99	7,153	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	—	72	37	2,688	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	37	81	72	5,176	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	10	94	49	3,524	公益事業
小計 株数・金額	228	721	607	43,664	
小計 銘柄数<比率>	7	8	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	16	16	184	2,592	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	130	130	233	3,279	不動産
BANK OF EAST ASIA	36	36	63	891	銀行
CLP HOLDINGS LTD	75	180	1,486	20,859	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	59	121	3,283	46,073	各種金融
MTR CORP	80	195	899	12,625	運輸
HANG LUNG GROUP LTD	12	—	—	—	不動産
HANG SENG BANK LTD	33	70	1,158	16,253	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	90	199	737	10,352	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	80	145	834	11,707	公益事業
WHARF HOLDINGS LTD	20	—	—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	408	938	1,455	20,415	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	23	—	—	—	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	110	210	1,177	16,514	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	5	5	11	163	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	165	345	943	13,238	銀行
NWS HOLDINGS LTD	100	100	109	1,529	資本財
PCCW LTD	40	40	18	264	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5	5	11	163	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	310	800	844	11,852	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	20	—	—	—	消費者サービス
SINO LAND CO	180	180	201	2,833	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	72	172	1,990	27,920	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17	42	306	4,301	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	60	171	2,399	食品・飲料・タバコ
WHEELOCK & CO LTD	34	94	473	6,640	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	75	125	835	11,715	資本財
MINTH GROUP LTD	20	—	—	—	自動車・自動車部品
SJM HOLDINGS LTD	20	20	18	257	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	52	52	93	1,313	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	8	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD	578	1,158	9,611	134,847	保険
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	160	330	387	5,435	電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	142	226	933	13,095	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	50	50	132	1,851	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	80	140	625	8,770	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	5	5	3	55	公益事業
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	100	247	3,465	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	450	1,205	959	13,457	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	140	285	2,118	29,729	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	44	44	246	3,456	公益事業

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
CK ASSET HOLDINGS LTD		115	245	1,308	18,355	不動産
小計	株数・金額	4,059	8,068	34,118	478,680	
	銘柄数＜比率＞	40	36	－	＜0.8%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		120	120	49	3,984	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		57	－	－	－	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD		89	178	466	37,588	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		16	67	73	5,897	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		1	1	3	242	小売
SATS LTD		12	12	5	467	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		45	109	96	7,739	各種金融
CAPITALAND LTD		102	212	82	6,646	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		67	191	42	3,417	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD		27	74	65	5,260	運輸
UNITED OVERSEAS BANK LTD		67	110	289	23,361	銀行
UOL GROUP LTD		21	21	17	1,415	不動産
VENTURE CORP LTD		13	13	21	1,724	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		132	132	27	2,223	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		365	868	294	23,716	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		8	8	1	141	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		157	342	379	30,597	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		106	239	97	7,897	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD		75	159	107	8,650	資本財
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		15	15	1	125	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		288	808	73	5,926	消費者サービス
小計	株数・金額	1,783	3,679	2,196	177,026	
	銘柄数＜比率＞	21	20	－	＜0.3%＞	
(イスラエル)				千イスラエルシュケル		
BANK HAPOALIM BM		50	99	293	9,269	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		68	168	421	13,281	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		17	－	－	－	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		0.52	2	138	4,375	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		－	75	118	3,746	銀行
ISRAEL CHEMICALS LTD		41	41	59	1,869	素材
NICE SYSTEMS LTD		1	7	456	14,403	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		1	14	131	4,160	銀行
AZRIELI GROUP		2	2	60	1,915	不動産
小計	株数・金額	184	411	1,681	53,022	
	銘柄数＜比率＞	8	8	－	＜0.1%＞	
合計	株数・金額	51,146	104,139	－	42,429,608	
	銘柄数＜比率＞	1,245	1,253	－	＜74.0%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の＜ ＞内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	1,778	4,823	88	9,652	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	457	961	158	17,257	0.0
AMERICAN TOWER CORP	2,124	4,224	1,003	109,418	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	5,848	15,662	151	16,500	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	702	1,390	304	33,248	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	654	1,367	194	21,171	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	544	－	－	－	－
CAMDEN PROPERTY TRUST	401	701	77	8,489	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	2,034	4,027	603	65,833	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,057	2,101	269	29,388	0.1
DUKE REALTY CORP	1,542	3,781	136	14,886	0.0
EQUINIX INC	398	820	485	52,938	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	－	1,548	111	12,168	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	1,868	3,681	304	33,223	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	282	580	179	19,575	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	546	1,155	128	13,973	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	317	617	80	8,734	0.0
HCP INC	2,028	－	－	－	－
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	－	4,041	149	16,306	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	4,008	6,508	111	12,122	0.0
INVITATION HOMES INC	800	5,744	180	19,632	0.0
IRON MOUNTAIN INC	1,174	2,044	64	7,033	0.0
KIMCO REALTY CORP	1,097	3,824	77	8,486	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	799	1,416	91	10,016	0.0
MACERICH CO/THE	178	－	－	－	－
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	－	5,450	122	13,314	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	491	1,033	141	15,429	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	848	1,474	83	9,084	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	－	2,330	100	11,000	0.0
PROLOGIS INC	3,103	6,108	587	64,049	0.1
PUBLIC STORAGE	782	1,557	349	38,116	0.1
REALTY INCOME CORP	1,227	2,774	213	23,334	0.0
REGENCY CENTERS CORP	658	1,514	96	10,531	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	485	1,173	296	32,384	0.1
SL GREEN REALTY CORP	468	468	43	4,765	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	1,505	3,017	436	47,650	0.1
SUN COMMUNITIES INC	－	788	124	13,583	0.0
UDR INC	1,156	2,553	123	13,414	0.0
VENTAS INC	1,831	3,668	215	23,533	0.0
VEREIT INC	3,812	11,100	107	11,742	0.0
VICI PROPERTIES INC	－	4,920	131	14,299	0.0
VORNADO REALTY TRUST	739	1,259	84	9,242	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
WP CAREY INC		695	1,458	122	13,410	0.0
WELLTOWER INC		1,878	4,008	348	38,006	0.1
WEYERHAEUSER CO		3,208	7,592	231	25,278	0.0
小計	口数・金額	53,522	135,259	8,914	972,232	
	銘柄数<比率>	39	42	－	<1.7%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		－	950	54	4,481	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		－	1,901	41	3,437	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		114	114	2	206	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		130	1,530	41	3,483	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		53	53	1	141	0.0
小計	口数・金額	297	4,548	141	11,750	
	銘柄数<比率>	3	5	－	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		30	30	2	358	0.0
KLEPIERRE		1,285	2,365	77	9,283	0.0
GECINA SA		223	474	80	9,653	0.0
COVIVIO		222	522	56	6,782	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		715	1,196	157	18,992	0.0
ユーロ計	口数・金額	2,475	4,587	374	45,070	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		4,343	9,933	58	8,354	0.0
HAMMERSON PLC		1,987	－	－	－	－
SEGRO PLC		5,784	12,304	112	16,058	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		3,465	6,648	64	9,189	0.0
小計	口数・金額	15,579	28,885	235	33,602	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP		19,387	32,387	112	8,374	0.0
GPT GROUP		9,342	15,542	92	6,870	0.0
STOCKLAND		15,223	28,650	144	10,707	0.0
DEXUS		6,106	10,906	138	10,266	0.0
GOODMAN GROUP		7,561	15,409	231	17,196	0.0
SCENTRE GROUP		24,098	50,466	197	14,698	0.0
VICINITY CENTRES		17,168	42,168	107	8,020	0.0
小計	口数・金額	98,885	195,528	1,024	76,134	
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		9,500	23,000	1,876	26,331	0.0
小計	口数・金額	9,500	23,000	1,876	26,331	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		8,100	22,000	57	4,645	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		18,700	38,800	122	9,850	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		口	口	千シンガポールドル	千円	%
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		7,600	25,500	54	4,398	0.0
SUNTEC REIT		8,500	8,500	15	1,274	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	23,000	55	4,504	0.0
小計	口数・金額	42,900	117,800	306	24,674	
	銘柄数<比率>	4	5	—	<0.0%>	
合計	口数・金額	223,158	509,607	—	1,189,796	
	銘柄数<比率>	63	68	—	<2.1%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	SP500MIN2003	10,667	—
		STX E6002003	3,092	—

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2020年１月27日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	42,429,608	74.0
投資証券	1,189,796	2.1
コール・ローン等、その他	13,698,755	23.9
投資信託財産総額	57,318,159	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。
(注) 当期末における外貨建純資産（56,343,483千円）の投資信託財産総額（57,318,159千円）に対する比率は98.3%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.06円、1カナダドル=82.94円、1ユーロ=120.30円、1英ポンド=142.51円、1スイスフラン=112.39円、1スウェーデンクローナ=11.40円、1ノルウェークローネ=12.05円、1デンマーククローネ=16.10円、1オーストラリアドル=74.30円、1ニュージーランドドル=71.82円、1香港ドル=14.03円、1シンガポールドル=80.60円、1イスラエルシュケル=31.54円。

○特定資産の価格等の調査

(2019年１月26日～2020年１月27日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	58,361,559,012
コール・ローン等	10,209,376,824
株式(評価額)	42,429,608,621
投資証券(評価額)	1,189,796,101
未収入金	2,348,146,705
未収配当金	33,787,669
差入委託証拠金	2,150,843,092
(B) 負債	1,057,800,328
未払金	1,055,692,252
未払解約金	2,108,000
未払利息	76
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	57,303,758,684
元本	40,465,219,618
次期繰越損益金	16,838,539,066
(D) 受益権総口数	40,465,219,618口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,161円

(注) 当ファンドの期首元本額は16,003,677,154円、期中追加設定元本額は37,497,918,027円、期中一部解約元本額は13,036,375,563円です。

(注) 2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	12,236,655,573円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	5,630,824,860円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	3,454,544,460円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	3,209,987,244円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	3,091,536,010円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,676,244,973円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	2,347,876,242円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	1,736,593,921円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	1,458,591,769円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,370,998,463円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	1,013,659,711円
・つみたてバランスファンド	781,929,363円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	446,451,498円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	213,753,513円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	164,849,855円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	151,058,008円
・りそなＦＴ　先進国株式インデックス（適格機関投資家専用）	139,187,288円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	121,841,499円
・ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	64,935,591円
・ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	61,782,316円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	55,438,468円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	14,291,150円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	8,929,250円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	5,894,604円
・グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	3,819,977円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,698,440円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,659,972円
・りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	185,600円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.4161円です。

○損益の状況 (2019年１月26日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	580,118,958
受取配当金	558,031,354
受取利息	22,350,683
その他収益金	14,977
支払利息	△　278,056
(B) 有価証券売買損益	5,695,792,222
売買益	6,498,964,860
売買損	△　803,172,638
(C) 先物取引等取引損益	1,052,416,012
取引益	1,279,700,773
取引損	△　227,284,761
(D) 保管費用等	△　14,187,637
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	7,314,139,555
(F) 前期繰越損益金	2,344,199,975
(G) 追加信託差損益金	10,696,977,973
(H) 解約差損益金	△ 3,516,778,437
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	16,838,539,066
次期繰越損益金(Ｉ)	16,838,539,066

(注) 損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**および**(C)先物取引等取引損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で**(G)追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で**(H)解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
主 要 投 資 対 象	・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式(*) (*) ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
主 な 投 資 制 限	・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
（設定日）	円	%		%	%	%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	198,988.93	－	－	－	－	30
1期(2017年1月25日)	11,197	12.0	219,460.53	10.3	－	－	99.8	1,345
2期(2018年1月25日)	15,125	35.1	300,137.86	36.8	93.0	6.6	0.4	3,145
3期(2019年1月25日)	12,478	△17.5	250,692.51	△16.5	93.2	6.3	0.4	5,315
4期(2020年1月27日)	13,853	11.0	281,695.65	12.4	71.2	29.0	0.2	10,642

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
（注）「ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）」は、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（米ドルベース）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（米ドルベース）は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2019年1月25日	12,478	－	250,692.51	－	93.2	6.3	0.4
1月末	12,630	1.2	253,056.22	0.9	93.1	6.6	0.4
2月末	13,131	5.2	263,953.75	5.3	95.6	3.7	0.3
3月末	12,966	3.9	260,713.96	4.0	88.2	11.9	0.3
4月末	13,472	8.0	270,962.66	8.1	88.7	10.9	0.3
5月末	12,199	△ 2.2	245,572.58	△ 2.0	91.4	8.3	0.3
6月末	12,847	3.0	258,203.62	3.0	81.7	18.0	0.2
7月末	12,823	2.8	258,772.88	3.2	77.8	21.9	0.2
8月末	11,740	△ 5.9	236,418.70	△ 5.7	68.6	31.1	0.2
9月末	12,223	△ 2.0	248,035.67	△ 1.1	68.1	32.3	0.2
10月末	12,922	3.6	260,565.85	3.9	61.4	45.0	0.1
11月末	13,096	5.0	264,578.09	5.5	74.2	25.6	0.2
12月末	13,970	12.0	282,689.78	12.8	70.3	29.5	0.2
（期末）							
2020年1月27日	13,853	11.0	281,695.65	12.4	71.2	29.0	0.2

（注）騰落率は期首比です。
（注）株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

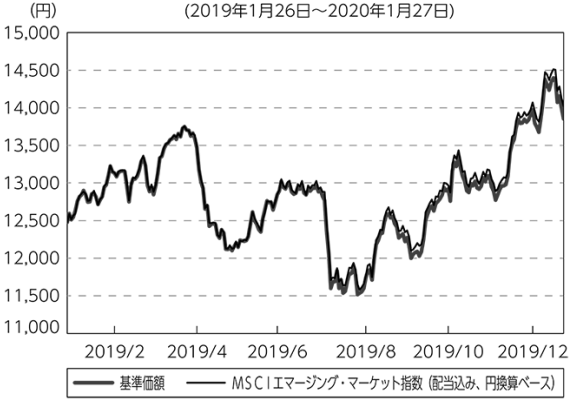
基準価額は前期末12,478円から当期末13,853円となり、1,375円の値上がりとなりました。

新興国株式の市況（ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも新興国の株価が上昇したことが寄与しました。

基準価額等の推移

（2019年1月26日～2020年1月27日）



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

新興国株式市況

新興国株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期の前半は、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）が利上げの一時停止の可能性を示唆したことなどを好感し上昇しましたが、その後米中貿易摩擦激化への懸念などから不安定な動きとなりました。期の後半は、世界景気の底入れ期待と主要国の金融緩和策で投資家のリスク回避姿勢が和らぎ、新興国市場は上昇基調となりました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して横ばいで推移し、ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、期の前半は世界景気の減速懸念や米中対立に対する過度な警戒感が緩和され円安基調となりましたが、ＦＲＢの金融緩和観測が広がるにつれ米ドルは売られ円高が進行しました。期の後半は、米国の緩和的な金融政策が当面据え置かれるとの見方を背景に過度な円高圧力は緩和され、期末にかけては緩やかに円安が進行しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標やイギリスのＥＵ（欧州連合）離脱問題等を背景に、期を通じて円高傾向で推移しました。

新興国通貨は、前期末と比較して、多くの通貨で米ドル・円に対して横ばいで推移しました。期の前半は、米国の利下げ観測の高まりを背景に多くの新興国でも利下げが実施され、米ドルに対しては横ばいで推移し、金融緩和余地の少ない日本円に対しては新興国通貨安が進行しました。期の後半は、米中貿易摩擦の緩和期待の高まりなどから投資家のリスク志向が強まり、米ドル・円に対して新興国通貨は買われました。

当ファンドのポートフォリオ

新興国の株式を主要投資対象とし、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。先物を含めた実質株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

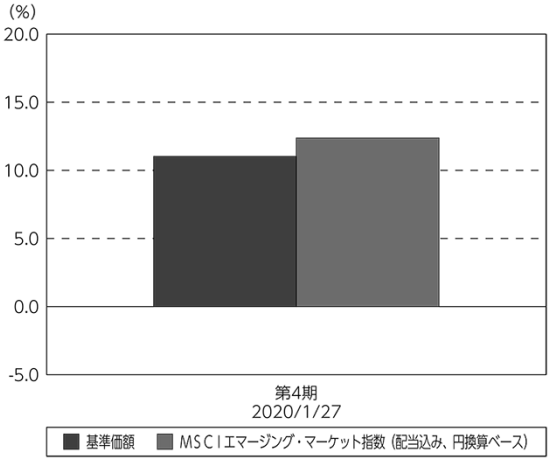
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋11.0%となり、ベンチマークの＋12.4%を1.3%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（株式等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）
・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている新興国の株式に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	9	0.072	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(6)	(0.046)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(3)	(0.026)	
(b) 有価証券取引税	4	0.032	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(4)	(0.032)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	27	0.208	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(26)	(0.199)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(1)	(0.009)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	40	0.312	
期中の平均基準価額は、12,834円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 1,339 (35)	千米ドル 3,700 (－)	百株 266	千米ドル 866
	メキシコ	 3,191 (－)	千メキシコペソ 9,541 (△ 34)	 1,574	千メキシコペソ 3,860
	ブラジル	 2,208 (319)	千ブラジルレアル 6,974 (△ 8)	 738 (－)	千ブラジルレアル 2,126 (2)
	チリ	 10,121 (909)	千チリペソ 138,544 (522)	 2,942 (－)	千チリペソ 32,623 (522)
	コロンビア	 379	千コロンビアペソ 283,751	 92	千コロンビアペソ 141,291
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	515	90	135	34
	トルコ	 487 (21)	千トルコリラ 588 (－)	 269	千トルコリラ 244
	チェコ	 25	千チェココルナ 507	 3	千チェココルナ 174
	ハンガリー	 40	千ハンガリーフォリント 23,820	 18	千ハンガリーフォリント 9,632
	ポーランド	 297	千ポーランドズロチ 824	 106	千ポーランドズロチ 358
	香港	 34,873 (73)	千香港ドル 38,121 (△ 32)	 13,563 (－)	千香港ドル 11,196 (9)
	マレーシア	 2,516	千マレーシアリンギット 1,770	 1,320	千マレーシアリンギット 695
	タイ	 7,836 (588)	千タイバーツ 27,982 (2)	 1,508 (－)	千タイバーツ 7,617 (7)
	フィリピン	 1,492 (18)	千フィリピンペソ 11,108 (－)	 1,117	千フィリピンペソ 4,546
	インドネシア	 12,242 (3,416)	千インドネシアルピア 6,438,471 (－)	 6,194	千インドネシアルピア 2,629,373

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	韓国	百株 629 (1)	千韓国ウォン 2,831,781 (6,135)	百株 264 (－)	千韓国ウォン 1,041,018 (6,483)
	台湾	11,380 (253)	千新台湾ドル 74,874 (△ 141)	5,050	千新台湾ドル 25,594
	中国オフショア	9,780 (36)	千オフショア人民元 13,265 (－)	151	千オフショア人民元 294
	インド	3,428 (584)	千インドルピー 169,534 (471)	1,939 (－)	千インドルピー 47,247 (471)
	カタール	342 (2,099)	千カタールリアル 632 (－)	78	千カタールリアル 55
	南アフリカ	1,604 (58)	千南アフリカランド 17,303 (450)	670 (－)	千南アフリカランド 10,848 (450)
	アラブ首長国連邦	664	千アラブディルハム 310	170	千アラブディルハム 39
	サウジアラビア	1,772	千ｻｳｼﾞｱﾗﾋﾞｱﾘｱﾙ 6,835	－	千ｻｳｼﾞｱﾗﾋﾞｱﾘｱﾙ －

（注）金額は受け渡し代金。
（注）( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

新株予約権証券

		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	タイ	証券 － (1,305)	千タイバーツ － (4)	証券 1,305	千タイバーツ 4

（注）金額は受け渡し代金。
（注）( )内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	11,200 (－)	347 (△ 27)	7,400 (－)	194 (0)
	小計	11,200 (－)	347 (△ 27)	7,400 (－)	194 (0)
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	18,499	424	7,643	174
	FORTRESS REIT LTD-B	－	－	8,600	89
	REDEFINE PROPERTIES LTD	11,213	89	－	－
	HYPROP INVESTMENTS LTD	－	－	2,850	192
	RESILIENT REIT LTD	－	－	2,600	148
	小計	29,712	514	21,693	605

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) ( )内は分割・合併・増資等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種類別		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 13,609	百万円 11,055	百万円 －	百万円 －

(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○株式売買比率

(2019年１月26日～2020年１月27日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	3,595,845千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,687,828千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.63

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	115	188	4,024	438,956	小売
AUTOHOME INC-ADR	5	7	58	6,394	メディア・娯楽
BANCO MACRO SA-ADR	－	4	13	1,486	銀行
BEST INC - ADR	－	15	9	994	運輸
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	11	26	35	3,881	素材
CREDICORP LTD	6	7	161	17,645	銀行
58.COM INC-ADR	8	10	66	7,235	メディア・娯楽
HUYA INC-ADR	－	9	16	1,781	メディア・娯楽
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	45	57	61	6,695	電気通信サービス
NIO INC - ADR	－	74	34	3,760	自動車・自動車部品
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	12	15	193	21,064	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	2	4	14	1,573	各種金融
QUDIAN INC-SPON ADR	－	30	9	1,050	各種金融
SOUTHERN COPPER CORP	8	8	35	3,846	素材
TAL EDUCATION GROUP- ADR	32	44	205	22,400	消費者サービス
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	－	8	9	1,079	電気通信サービス
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	－	10	12	1,398	メディア・娯楽
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	43	50	67	7,405	小売
YPF S.A.-SPONSORED ADR	－	19	18	2,001	エネルギー
YUM CHINA HOLDINGS INC	33	40	179	19,544	消費者サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	－	37	83	9,123	運輸
GLOBANT SA	－	4	54	5,958	ソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	24	30	396	43,242	メディア・娯楽
BAOZUN INC-SPN ADR	2	5	16	1,766	小売
CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	36	－	－	－	小売
SINA CORP	6	6	25	2,734	メディア・娯楽
51JOB INC-ADR	3	3	24	2,644	商業・専門サービス
GDS HOLDINGS LTD - ADR	4	7	36	3,994	ソフトウェア・サービス
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	－	12	16	1,846	銀行
HUAZHU GROUP LTD-ADR	12	15	48	5,285	消費者サービス
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	6	6	14	1,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQIYI INC-ADR	－	13	28	3,103	メディア・娯楽
JOYY INC	－	6	36	4,009	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	67	83	329	35,886	小売
MOMO INC-SPON ADR	13	17	52	5,735	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR	6	7	256	27,986	メディア・娯楽
PINDUODUO INC-ADR	－	22	82	8,959	小売
TRIP.COM GROUP LTD	－	53	170	18,612	小売
WEIBO CORP-SPON ADR	3	5	23	2,517	メディア・娯楽
YY INC-ADR	4	－	－	－	メディア・娯楽
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	72	132	10	1,138	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	84	100	9	1,039	不動産
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	73	172	92	10,033	銀行
GAZPROM PAO -SPON ADR	474	601	457	49,889	エネルギー
VTB BANK JSC -GDR-REG S	71	221	33	3,697	銀行
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	56	75	256	28,014	素材

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS		11	31	30	3,294	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		31	47	66	7,297	食品・生活必需品小売り
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		8	10	204	22,248	エネルギー
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR		11	19	45	4,983	素材
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR		102	147	112	12,278	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR		43	44	471	51,435	エネルギー
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S		6	16	21	2,313	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR		3	6	36	3,942	素材
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR		238	302	519	56,611	銀行
SEVERSTAL - GDR REG S		20	32	49	5,351	素材
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR		155	140	107	11,719	エネルギー
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR		24	30	238	25,962	エネルギー
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR		11	16	58	6,368	食品・生活必需品小売り
DP WORLD PLC		12	19	27	2,961	運輸
小計	株数・金額	2,023	3,131	9,771	1,065,724	
	銘柄数＜比率＞	45	58	－	＜10.0%＞	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A		289	289	438	2,541	資本財
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L		38	－	－	－	食品・飲料・タバコ
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		167	219	3,851	22,299	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		8	21	212	1,232	小売
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		223	273	1,237	7,166	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		156	156	522	3,027	食品・飲料・タバコ
GRUMA S.A.B.-B		14	24	508	2,942	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		17	27	569	3,295	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		20	56	401	2,326	資本財
CEMEX SAB-CPO		1,323	1,739	1,365	7,904	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		254	289	3,307	19,149	銀行
MEXICHEM SAB DE CV-*		100	－	－	－	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		13	13	274	1,590	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		149	181	712	4,126	家庭用品・パーソナル用品
ALSEA SAB DE CV		27	60	273	1,581	消費者サービス
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B		19	24	910	5,269	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		318	398	2,097	12,146	素材
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		3,001	3,788	5,935	34,368	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		192	273	661	3,829	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		43	43	455	2,635	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B		34	42	1,007	5,832	運輸
MEGACABLE HOLDINGS-CPO		36	36	266	1,542	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N		53	53	468	2,714	公益事業
BANCO SANTANDER MEXICO-B		193	－	－	－	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		－	100	470	2,721	素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		－	61	720	4,173	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO SAB DE CV		444	584	3,319	19,219	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	7,133	8,750	29,989	173,639	
	銘柄数＜比率＞	25	24	－	＜1.6%＞	
(ブラジル)				千ブラジルレアル		
BRF SA		51	65	219	5,732	食品・飲料・タバコ
VALE SA		281	357	1,920	50,071	素材
TIM PARTICIPACOES SA		96	96	157	4,101	電気通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B		39	55	233	6,076	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
BANCO DO BRASIL S.A.	78	94	477	12,448	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	389	487	650	16,949	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	73	86	248	6,490	小売
GERDAU SA-PREF	101	126	273	7,118	素材
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	35	81	239	6,248	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	642	824	2,414	62,941	エネルギー
KROTON EDUCACIONAL SA	129	—	—	—	消費者サービス
CCR SA	117	139	275	7,182	運輸
WEG SA	69	94	391	10,206	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	379	575	1,975	51,491	銀行
NATURA COSMETICOS SA	16	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	—	73	108	2,837	素材
SUZANO SA	54	62	272	7,098	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	430	536	1,835	47,845	銀行
PORTO SEGURO SA	7	12	78	2,033	保険
BRASKEM SA-PREF A	16	23	86	2,256	素材
LOCALIZA RENT A CAR	49	65	334	8,725	運輸
LOJAS RENNER S.A.	70	87	523	13,647	小売
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	34	71	195	5,095	エネルギー
COSAN SA	7	14	112	2,940	エネルギー
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	17	95	232	6,050	公益事業
EMBRAER SA	54	81	150	3,917	資本財
M DIAS BRANCO SA	5	—	—	—	食品・飲料・タバコ
B2W CIA DIGITAL	9	23	170	4,452	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA	93	93	174	4,543	不動産
JBS SA	94	124	363	9,471	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	74	106	163	4,266	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	22	39	243	6,351	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	35	35	122	3,205	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	28	27	180	4,700	保険
HYPERA SA	29	43	150	3,926	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	41	48	287	7,500	電気通信サービス
MAGAZINE LUIZA SA	7	79	443	11,564	小売
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39	44	193	5,033	銀行
ENERGISA SA-UNITS	—	21	118	3,083	公益事業
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	15	18	159	4,162	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	113	117	81	2,135	ソフトウェア・サービス
RAIA DROGASIL SA	23	26	322	8,404	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	64	79	283	7,393	保険
ENGIE BRASIL ENERGIA SA	8	23	127	3,335	公益事業
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	—	56	395	10,314	ヘルスケア機器・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	—	20	129	3,363	ヘルスケア機器・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	49	47	111	2,899	食品・生活必需品小売り
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	181	230	1,126	29,374	各種金融
AMBEV SA	434	529	1,004	26,189	食品・飲料・タバコ
COGNA EDUCACAO	—	169	197	5,141	消費者サービス
KLABIN SA - UNIT	69	79	171	4,481	素材
NATURA &CO HOLDING SA	—	72	354	9,231	家庭用品・パーソナル用品
RUMO SA	108	125	304	7,928	運輸
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	13	79	338	8,818	保険

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		－	26	203	5,310	各種金融
小計	株数・金額	4,787	6,576	21,330	556,093	
	銘柄数<比率>	48	52	－	<5.2%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE		6,124	7,524	31,287	4,386	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		3	5	19,492	2,732	銀行
BANCO DE CHILE		2,306	4,906	38,581	5,409	銀行
EMPRESAS CMPC SA		117	144	27,905	3,912	素材
EMPRESAS COPEC SA		36	46	33,682	4,722	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		14	14	10,399	1,457	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		10	10	5,385	755	電気通信サービス
ENEL AMERICAS SA		2,238	4,538	71,617	10,040	公益事業
COLBUN SA		839	839	10,090	1,414	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A		315	400	12,281	1,721	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		28	28	6,056	849	食品・飲料・タバコ
LATAM AIRLINES GROUP SA		29	29	19,868	2,785	運輸
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		11	11	25,280	3,544	素材
S.A.C.I. FALABELLA		67	95	30,478	4,273	小売
CENCOSUD SA		134	134	13,817	1,937	食品・生活必需品小売り
ENEL CHILE SA		1,885	3,521	26,976	3,782	公益事業
ITAU CORPBANCA		18,800	18,800	7,426	1,041	銀行
小計	株数・金額	32,963	41,051	390,627	54,765	
	銘柄数<比率>	17	17	－	<0.5%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		44	57	112,210	3,635	公益事業
ECOPETROL SA		361	511	168,171	5,448	エネルギー
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		4	－	－	－	各種金融
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		300	430	61,920	2,006	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		20	－	－	－	素材
GRUPO ARGOS SA		29	29	52,084	1,687	素材
BANCOLOMBIA SA		19	36	162,034	5,249	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		41	41	189,108	6,127	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		25	25	85,041	2,755	各種金融
小計	株数・金額	844	1,132	830,570	26,910	
	銘柄数<比率>	9	7	－	<0.3%>	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		24	27	37	4,528	電気通信サービス
MOTOR OIL (HELLAS) SA		6	7	15	1,914	エネルギー
OPAP SA		22	22	25	3,122	消費者サービス
JUMBO SA		11	11	23	2,788	小売
TITAN CEMENT CO. S.A.		2	－	－	－	素材
NATIONAL BANK OF GREECE		－	66	20	2,437	銀行
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		－	3	7	859	素材
EUROBANK ERGASIAS SA		－	307	27	3,354	銀行
ALPHA BANK AE		142	142	26	3,172	銀行
ユーロ計	株数・金額	208	588	184	22,178	
	銘柄数<比率>	6	8	－	<0.2%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		217	346	303	5,567	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		19	19	49	915	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS		10	10	21	402	耐久消費財・アパレル

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(トルコ)		百株	百株	千トルコリラ	千円	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		36	36	82	1,514	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		138	138	132	2,438	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		4	4	33	611	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS		77	94	196	3,601	資本財
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		34	—	—	—	素材
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		35	—	—	—	資本財
TURK HAVA YOLLARI AO		55	55	79	1,466	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		111	133	192	3,530	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI		225	278	333	6,116	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		120	177	129	2,379	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		12	14	169	3,108	エネルギー
HACI OMER SABANCI HOLDING		71	125	129	2,372	各種金融
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		15	48	242	4,456	食品・生活必需品小売り
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		15	15	42	786	運輸
TURKIYE HALK BANKASI		60	—	—	—	銀行
小計	株数・金額	1,256	1,496	2,141	39,267	
	銘柄数＜比率＞	18	15	—	＜0.4%＞	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		7	7	602	2,878	銀行
CEZ AS		15	19	987	4,721	公益事業
MONETA MONEY BANK AS		46	64	554	2,648	銀行
小計	株数・金額	69	91	2,144	10,249	
	銘柄数＜比率＞	3	3	—	＜0.1%＞	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
OTP BANK PLC		19	25	37,130	13,277	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		12	15	10,409	3,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL		32	45	12,273	4,389	エネルギー
小計	株数・金額	64	86	59,813	21,389	
	銘柄数＜比率＞	3	3	—	＜0.2%＞	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA		28	83	50	1,424	銀行
MBANK SA		0.65	1	62	1,767	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		2	—	—	—	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		10	16	157	4,439	素材
BANK PEKAO SA		16	19	198	5,602	銀行
ORANGE POLSKA SA		42	42	30	867	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		27	32	280	7,917	エネルギー
LPP SA		0.13	0.13	111	3,155	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA		3	3	100	2,847	銀行
CD PROJEKT SA		6	7	209	5,929	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA		81	99	356	10,074	銀行
CCC SA		3	3	33	956	耐久消費財・アパレル
GRUPA LOTOS SA		11	11	95	2,701	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		123	203	82	2,341	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA		32	29	79	2,257	メディア・娯楽
PGE SA		88	99	73	2,088	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		48	67	280	7,927	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S		4	—	—	—	素材
ALIOR BANK SA		6	—	—	—	銀行
DINO POLSKA SA		3	5	82	2,332	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)	百株	百株	千ポーランドズロチ	千円	
AMREST HOLDINGS SE	－	8	39	1,102	消費者サービス
小計 株数・金額	543	734	2,325	65,737	
小計 銘柄数＜比率＞	20	18	－	＜0.6%＞	
(香港)			千香港ドル		
JIANGXI COPPER CO LTD-H	150	150	148	2,077	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	120	120	124	1,750	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	240	220	102	1,438	運輸
ANGANG STEEL CO LTD-H	40	－	－	－	素材
CHINA MOBILE LTD	540	690	4,809	67,474	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	120	145	793	11,138	素材
DATANG INTL POWER GEN CO-H	320	320	47	659	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	50	50	182	2,553	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H	420	480	197	2,767	公益事業
YANZHOU COAL MINING CO-H	180	280	177	2,494	エネルギー
HENGAN INTL GROUP CO LTD	65	85	527	7,405	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	200	200	57	805	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	40	260	98	1,382	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	280	380	267	3,758	自動車・自動車部品
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	420	540	1,009	14,167	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	320	440	1,185	16,636	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD	260	320	1,094	15,354	不動産
CITIC LTD	530	680	656	9,216	資本財
CHINA TRAVEL INTL INV HK	120	－	－	－	消費者サービス
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	180	180	115	1,618	運輸
LENOVO GROUP LTD	700	860	484	6,793	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	1,820	2,360	880	12,350	エネルギー
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	560	720	489	6,869	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	148	188	340	4,779	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,220	2,920	1,308	18,353	エネルギー
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	40	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	90	90	162	2,280	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	160	260	237	3,334	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	70	91	874	12,275	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	300	400	269	3,776	公益事業
TOWNGAS CHINA CO LTD	110	110	58	814	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	180	180	109	1,537	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	240	740	125	1,754	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	140	140	185	2,608	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	480	480	115	1,616	素材
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	80	－	－	－	各種金融
WHARF HOLDINGS LTD	－	130	270	3,793	不動産
CHINA EVERBRIGHT LTD	100	100	131	1,843	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	162	212	685	9,622	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	70	80	187	2,632	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	450	580	779	10,936	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	100	400	116	1,633	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	80	100	449	6,299	公益事業
BYD CO LTD-H	60	80	369	5,185	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,260	1,620	511	7,182	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	180	220	268	3,765	エネルギー
SINOTRANS LIMITED-H	150	150	40	566	運輸

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	240	240	71	1,006	素材
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	330	440	258	3,629	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	190	190	115	1,626	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	620	780	711	9,980	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	260	260	89	1,258	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	180	240	271	3,804	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	205	360	204	2,863	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	640	840	1,730	24,277	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	580	580	219	3,075	素材
MMG LTD	320	－	－	－	素材
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	160	－	－	－	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	200	240	237	3,336	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	200	200	295	4,141	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	100	100	33	472	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	340	340	73	1,035	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	20	70	102	1,431	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	－	100	105	1,473	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	180	240	339	4,761	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	20	40	189	2,651	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD	280	340	563	7,908	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	240	240	94	1,319	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	140	160	612	8,586	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	180	180	124	1,745	運輸
CNOOC LTD	1,560	2,010	2,621	36,773	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	645	805	924	12,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	250	320	1,009	14,164	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	460	630	5,975	83,836	保険
LI NING CO LTD	－	230	592	8,309	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	560	560	217	3,048	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	430	1,180	92	1,291	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	590	590	96	1,357	公益事業
AIR CHINA LTD-H	180	180	120	1,697	運輸
ZTE CORP-H	46	90	252	3,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	140	380	95	1,338	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	310	400	589	8,272	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	345	345	105	1,485	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	810	960	506	7,111	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	140	260	183	2,568	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	8,510	10,710	6,886	96,618	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	70	87	970	13,622	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	260	340	217	3,052	自動車・自動車部品
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	180	180	200	2,813	不動産
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	170	170	140	1,977	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	380	460	392	5,511	素材
BANK OF CHINA LTD-H	6,980	8,900	2,848	39,957	銀行
SHUI ON LAND LTD	280	280	48	675	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	120	135	369	5,180	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	80	－	－	－	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	116	116	149	2,092	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	335	445	1,775	24,910	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	6,120	7,350	4,130	57,953	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	120	120	106	1,498	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	155	155	141	1,978	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	120	260	153	2,155	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	420	540	316	4,447	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	70	350	99	1,399	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	80	80	148	2,078	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	53	53	145	2,037	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	120	150	370	5,198	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	240	240	100	1,410	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	640	870	951	13,353	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	450	450	146	2,051	素材
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	830	1,060	464	6,513	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	40	145	156	2,193	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	58	78	1,099	15,430	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	100	120	876	12,298	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL LTD	245	310	357	5,010	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	520	620	353	4,958	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	130	405	125	1,755	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	—	420	118	1,655	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	120	120	37	520	不動産
KINGSOFT CORP LTD	50	90	225	3,163	ソフトウェア・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	95	95	149	2,092	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	360	480	224	3,151	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	50	170	143	2,020	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	35	75	131	1,845	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	195	195	158	2,229	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	470	590	406	5,703	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	236	300	858	12,037	保険
CRRC CORP LTD - H	400	540	297	4,174	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235	235	222	3,119	食品・生活必需品小売り
BBMG CORP-H	250	250	56	792	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	172	172	49	692	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	108	144	398	5,586	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	240	300	291	4,091	素材
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	320	320	53	749	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	280	360	312	4,379	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	275	130	55	784	素材
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	100	290	111	1,566	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	320	320	160	2,249	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	62	110	164	2,311	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	580	580	185	2,595	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	170	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	200	280	1,160	16,283	不動産
YUZHOU PROPERTIES CO	120	120	48	673	不動産
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	—	194	121	1,698	資本財
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	145	205	710	9,965	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	77	97	311	4,368	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	586	841	489	6,867	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	150	320	116	1,638	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	60	60	52	742	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	110	400	141	1,986	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	2,510	3,290	1,052	14,770	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	20	65	194	2,731	小売
FAR EAST HORIZON LTD	220	290	217	3,051	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	220	250	418	5,864	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	60	200	167	2,351	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	100	170	198	2,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	316	316	263	3,693	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	65	80	500	7,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	690	970	298	4,191	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55	55	125	1,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	260	260	152	2,133	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	175	175	80	1,131	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	370	370	158	2,221	各種金融
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	110	110	68	963	自動車・自動車部品
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	—	150	164	2,302	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	100	100	90	1,262	商業・専門サービス
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	100	—	—	—	不動産
CHINA EVERGRANDE GROUP	220	220	415	5,827	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	76	76	105	1,482	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	290	940	482	6,765	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	30	60	275	3,863	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	60	100	176	2,469	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	190	365	589	8,265	半導体・半導体製造装置
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	40	140	387	5,431	商業・専門サービス
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	—	210	106	1,493	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	—	43	300	4,213	ヘルスケア機器・サービス
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	260	260	6	91	自動車・自動車部品
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	—	80	86	1,209	消費者サービス
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	—	52	153	2,150	商業・専門サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	3,320	4,820	843	11,834	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	—	898	1,197	16,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTEC CO LTD-H	—	19	199	2,804	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN DIANPING-CLASS B	—	113	1,155	16,218	小売
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	—	40	118	1,666	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	100	360	218	3,065	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	—	95	297	4,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	980	980	169	2,378	各種金融
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	160	160	210	2,949	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	150	190	699	9,809	資本財
CHINA AOYUAN GROUP LTD	—	140	159	2,239	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	—	60	95	1,335	消費者サービス
SHENZHEN INTL HOLDINGS	95	95	163	2,295	運輸
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	—	60	168	2,365	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENCENT HOLDINGS LTD	507	639	24,652	345,876	メディア・娯楽
CHINA VANKE CO LTD-H	123	175	525	7,378	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	75	165	93	1,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,400	1,400	177	2,494	メディア・娯楽
CAR INC	90	—	—	—	運輸
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	30	30	63	894	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	320	420	451	6,340	ヘルスケア機器・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,050	1,310	268	3,767	公益事業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
FULLSHARE HOLDINGS LTD	675	—	—	—	資本財
BAIC MOTOR CORP LTD-H	120	235	101	1,421	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	106	192	182	2,556	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	52	52	128	1,798	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	164	210	280	3,942	各種金融
3SBIO INC	130	130	143	2,006	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGEND HOLDINGS CORP-H	34	34	55	779	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	175	175	135	1,900	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	1,030	1,030	119	1,676	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	18	34	116	1,631	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD	100	220	172	2,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DALI FOODS GROUP CO LTD	75	230	138	1,936	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	150	150	62	877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	550	550	67	949	保険
MEITU INC	70	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOC AVIATION LTD	22	22	159	2,239	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	17	39	109	1,537	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	108	172	256	3,600	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	45	65	679	9,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	1,800	—	—	—	小売
小計 株数・金額	81,577	102,960	115,154	1,615,614	
小計 銘柄数＜比率＞	202	207	—	＜15.2%＞	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	190	190	72	1,955	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	30	30	32	865	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	437	536	271	7,287	銀行
DIGI.COM BHD	302	361	161	4,345	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	53	135	92	2,477	運輸
RHB BANK BHD	55	197	115	3,096	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	28	68	66	1,799	資本財
GAMUDA BHD	133	233	94	2,529	資本財
YTL CORP BHD	193	193	18	510	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	15	32	52	1,410	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	65	65	104	2,818	銀行
IJM CORP BHD	236	236	54	1,452	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43	43	100	2,710	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	17	17	56	1,507	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	352	445	379	10,199	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	65	—	—	—	銀行
MISC BHD	90	140	113	3,054	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	6	8	116	3,140	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	58	58	108	2,911	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	9	29	67	1,803	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	49	71	116	3,128	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	18	18	20	538	食品・飲料・タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	50	141	56	1,515	電気通信サービス
SP SETIA BHD	70	—	—	—	不動産
TENAGA NASIONAL BHD	285	357	459	12,355	公益事業
QL RESOURCES BHD	24	82	66	1,800	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	370	430	141	3,801	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	250	353	677	18,192	銀行

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
AIRASIA GROUP BHD	75	226	35	947	運輸
TOP GLOVE CORP BHD	146	146	80	2,173	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	204	204	118	3,190	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	289	289	91	2,446	消費者サービス
IOI CORP BHD	197	197	90	2,424	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	170	360	81	2,176	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	136	136	82	2,203	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	302	320	135	3,637	電気通信サービス
MAXIS BHD	229	229	125	3,384	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	228	280	193	5,206	素材
IHH HEALTHCARE BHD	241	262	151	4,076	ヘルスケア機器・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	68	68	27	741	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	164	174	88	2,384	素材
SIME DARBY PROPERTY BHD	119	—	—	—	不動産
SIME DARBY PLANTATION BHD	236	244	128	3,461	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP BHD	110	—	—	—	不動産
小計 株数・金額	6,408	7,604	5,048	135,662	
小計 銘柄数＜比率＞	44	40	—	＜1.3%＞	
(タイ)			千タイバーツ		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	27	41	608	2,161	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	120	120	495	1,757	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	414	414	683	2,425	銀行
ROBINSON PCL-NVDR	33	33	226	802	小売
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	168	98	977	3,470	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	1,021	1,421	565	2,007	電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	158	198	2,791	9,910	銀行
TMB BANK PCL-NVDR	850	2,150	326	1,160	銀行
IRPC PCL - NVDR	516	1,377	415	1,476	エネルギー
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	130	530	583	2,069	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	9	34	1,122	3,983	公益事業
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	379	449	1,369	4,861	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	96	138	3,077	10,924	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	420	690	1,062	3,772	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	22	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	947	1,257	5,687	20,192	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	90	340	496	1,762	食品・飲料・タバコ
LAND & HOUSES PUB - NVDR	300	985	960	3,409	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR	29	90	3,267	11,597	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	348	490	3,503	12,437	運輸
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	91	257	1,612	5,724	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	372	1,079	2,805	9,959	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	28	43	621	2,205	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	261	325	1,088	3,865	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	112	132	699	2,483	エネルギー
GLOW ENERGY PCL - NVDR	22	—	—	—	公益事業
CP ALL PCL-NVDR	453	669	4,917	17,455	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	630	760	1,041	3,696	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	129	157	2,017	7,161	エネルギー
TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	—	92	437	1,551	電気通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	165	165	466	1,654	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	212	262	1,323	4,697	素材

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)		百株	百株	千タイバーツ	千円	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		67	198	881	3,127	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO		789	789	875	3,109	運輸
B GRIMM POWER PCL-NVDR		—	72	469	1,667	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR		52	62	1,230	4,368	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR		—	65	302	1,072	食品・飲料・タバコ
RATCH GROUP PCL-FOREIGN		—	70	514	1,826	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-F		—	184	1,113	3,951	電気通信サービス
SRISAWAD CORP PCL-NVDR		—	70	518	1,838	各種金融
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR		78	78	516	1,834	各種金融
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR		—	70	656	2,329	公益事業
小計	株数・金額	9,538	16,454	52,328	185,765	
	銘柄数<比率>	35	40	—	<1.7%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC		719	838	3,469	7,459	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		145	238	1,263	2,716	資本財
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		72	98	806	1,733	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		180	—	—	—	資本財
DMCI HOLDINGS INC		180	—	—	—	資本財
GLOBE TELECOM INC		4	4	861	1,852	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		25	94	1,253	2,694	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC		217	332	2,563	5,511	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP		45	45	976	2,099	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST		133	217	1,401	3,013	銀行
MEGAWORLD CORP		980	980	419	901	不動産
ROBINSONS LAND CO		220	245	693	1,490	不動産
SECURITY BANK CORP		14	14	266	571	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC		1,001	1,147	4,679	10,061	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP		95	103	1,668	3,587	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP		19	27	2,874	6,179	資本財
AYALA CORPORATION		24	32	2,427	5,218	資本財
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		1,450	1,450	485	1,044	各種金融
ABOITIZ POWER CORP		160	160	532	1,145	公益事業
MANILA ELECTRIC COMPANY		14	27	828	1,781	公益事業
BDO UNIBANK INC		196	227	3,549	7,630	銀行
GT CAPITAL HOLDINGS INC		7	11	941	2,023	資本財
PLDT INC		8	8	923	1,984	電気通信サービス
小計	株数・金額	5,910	6,303	32,884	70,701	
	銘柄数<比率>	23	21	—	<0.7%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
BARITO PACIFIC TBK PT		—	3,135	431,062	3,491	素材
UNITED TRACTORS TBK PT		161	201	406,020	3,288	エネルギー
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P		300	509	417,380	3,380	食品・飲料・タバコ
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT		719	846	607,005	4,916	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT		47	47	274,010	2,219	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		911	911	196,776	1,593	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA		139	215	404,737	3,278	素材
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		269	269	214,527	1,737	素材
BUKIT ASAM TBK PT		400	400	94,800	767	エネルギー
BANK DANAMON INDONESIA TBK		220	—	—	—	銀行
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		1,700	2,129	1,687,232	13,666	銀行
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT		150	150	160,125	1,297	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシアルピア	千円	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	143	885	723,487	5,860	家庭用品・パーソナル用品
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	4,784	6,287	2,980,038	24,138	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	810	1,315	247,220	2,002	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	713	869	669,130	5,419	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	307	347	450,232	3,646	素材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	856	1,114	3,793,170	30,724	銀行
XL AXIATA TBK PT	—	280	89,320	723	電気通信サービス
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	185	185	93,887	760	運輸
BUMI SERPONG DAMAI PT	660	660	78,210	633	不動産
ADARO ENERGY TBK PT	1,509	1,509	208,242	1,686	エネルギー
PAKUWON JATI TBK PT	970	970	55,290	447	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	155	273	319,410	2,587	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	130	—	—	—	電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	260	260	53,820	435	銀行
KALBE FARMA TBK PT	2,200	2,527	389,158	3,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACE HARDWARE INDONESIA	—	500	81,500	660	小売
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	1,828	2,310	1,611,225	13,050	自動車・自動車部品
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	360	—	—	—	メディア・娯楽
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	4,334	5,581	2,187,752	17,720	電気通信サービス
小計 株数・金額	25,220	34,684	18,924,768	153,290	
小計 銘柄数<比率>	28	28	—	<1.4%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
CHEIL WORLDWIDE INC	3	8	18,491	1,727	メディア・娯楽
HANMI SCIENCE CO LTD	0.77	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2	2	20,280	1,894	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	2	3	78,075	7,292	保険
DB INSURANCE CO LTD	4	4	21,449	2,003	保険
WOONGJIN COWAY CO LTD	4	5	51,064	4,769	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	10	12	119,867	11,195	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	2	2	19,260	1,798	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	2	2	7,863	734	公益事業
CJ CORP	1	1	16,290	1,521	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	5	5	13,312	1,243	資本財
SK TELECOM	1	2	54,510	5,091	電気通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	2	3	30,806	2,877	資本財
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	41	47	35,539	3,319	各種金融
NCSOFT CORP	1	1	122,740	11,463	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	8	13	18,303	1,709	電気通信サービス
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	5	30	14,215	1,327	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	5	5	8,850	826	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	0.94	1	161,880	15,119	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	4	5	196,554	18,358	素材
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	37	50	206,164	19,255	銀行
S-OIL CORP	4	4	35,434	3,309	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORP	8	12	23,937	2,235	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	—	41	14,734	1,376	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6	6	26,593	2,483	各種金融
LOTTE CHEMICAL CORP	1	1	40,964	3,826	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	2	3	34,920	3,261	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	3	4	60,875	5,685	資本財
HYUNDAI MOBIS CO LTD	6	7	188,373	17,594	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
SK HYNIX INC	51	61	602,662	56,288	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	7	9	40,243	3,758	資本財
HYUNDAI MOTOR CO	14	19	256,041	23,914	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	7	7	23,255	2,172	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	16	25	28,760	2,686	銀行
KCC CORP	0.65	0.54	12,069	1,127	資本財
KIA MOTORS CORP	24	29	129,766	12,120	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	0.85	0.95	38,665	3,611	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	21	29	78,064	7,291	公益事業
KOREAN AIR LINES CO LTD	5	5	15,087	1,409	運輸
OCI CO LTD	1	1	12,474	1,165	素材
CJ LOGISTICS	0.36	1	19,170	1,790	運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	1	2	16,589	1,549	素材
KT CORP	0.75	—	—	—	電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	8	11	81,420	7,604	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	2	2	9,413	879	資本財
LG CORP	7	11	84,157	7,860	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	6	15	18,403	1,718	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	5	8	24,270	2,266	資本財
NAVER CORP	12	15	288,408	26,937	メディア・娯楽
HYUNDAI DEPT STORE CO	1	1	16,012	1,495	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4	4	35,912	3,354	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.13	0.13	6,955	649	食品・飲料・タバコ
AMOREPACIFIC GROUP	2	3	31,699	2,960	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	10	13	39,039	3,646	消費者サービス
POSCO	6	8	212,361	19,834	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16	16	29,353	2,741	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	5	5	167,265	15,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5	5	77,203	7,210	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	450	564	3,433,376	320,677	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	44	53	38,449	3,591	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	52	52	261,560	24,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE INC	0.79	0.79	24,213	2,261	小売
YUHAN CORP	0.99	1	23,381	2,183	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	23	22	24,864	2,322	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	7	7	16,632	1,553	保険
GS HOLDINGS	5	4	23,691	2,212	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	22	22	33,768	3,154	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANA FINANCIAL GROUP	27	31	111,126	10,379	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1	2	35,880	3,351	運輸
LOTTE SHOPPING CO	0.83	1	18,200	1,699	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	6	8	59,959	5,600	保険
AMOREPACIFIC CORP	3	3	82,025	7,661	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	1	3	14,573	1,361	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	5	5	76,440	7,139	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	0.85	0.85	21,207	1,980	食品・飲料・タバコ
PAN OCEAN CO LTD	9	32	14,009	1,308	運輸
LG INNOTEK CO LTD	1	1	16,775	1,566	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK HOLDINGS CO LTD	2	4	100,738	9,408	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	35	42	200,716	18,746	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	7	9	30,297	2,829	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
BNK FINANCIAL GROUP INC	19	25	18,425	1,720	銀行
HANMI PHARM CO LTD	0.66	0.67	19,731	1,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	41	41	9,132	852	保険
FILA HOLDINGS CORP	5	5	25,116	2,345	耐久消費財・アパレル
E-MART INC	2	2	23,600	2,204	食品・生活必需品小売り
DGB FINANCIAL GROUP INC	7	—	—	—	銀行
GS RETAIL CO., LTD.	1	4	19,216	1,794	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	6	8	25,779	2,407	自動車・自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2	2	6,570	613	資本財
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	0.97	1	38,481	3,594	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	0.99	0.57	9,918	926	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1	2	29,837	2,786	食品・飲料・タバコ
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	2	—	—	—	保険
NETMARBLE CORPORATION	1	2	25,353	2,367	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	—	49	53,060	4,955	銀行
SAMSUNG SDS CO LTD	3	4	82,205	7,677	ソフトウェア・サービス
WOORI BANK	41	—	—	—	銀行
SAMSUNG C&T CORP	6	10	117,234	10,949	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1	1	88,872	8,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOOSAN BOBCAT INC	5	5	18,299	1,709	資本財
KAKAO CORP	4	5	91,356	8,532	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	1	1	17,063	1,593	小売
KMW CO LTD	—	1	10,217	954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POSCO CHEMICAL CO LTD	2	2	17,663	1,649	素材
HLB INC	3	3	36,833	3,440	耐久消費財・アパレル
CELLTRION INC	7	10	185,328	17,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HELIXMITH CO LTD	1	2	17,826	1,665	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC	0.6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDY-TOX INC	0.46	0.47	15,594	1,456	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	0.4	0.7	13,531	1,263	メディア・娯楽
SILLAJEN INC	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5	5	30,856	2,882	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	1,329	1,695	9,745,058	910,188	
小計 銘柄数＜比率＞	109	105	—	＜8.6%＞	
(台湾)			千新台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	—	60	1,044	3,789	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	310	310	559	2,031	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	70	80	1,888	6,853	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50	50	1,302	4,728	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	220	220	1,071	3,889	素材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	30	30	696	2,526	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN BUSINESS BANK	221	605	771	2,802	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	100	100	793	2,878	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	40	70	656	2,383	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	90	70	620	2,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	260	300	1,950	7,078	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	100	100	471	1,709	不動産
EVA AIRWAYS CORP	97	260	353	1,284	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	60	70	1,781	6,466	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	413	625	1,404	5,097	銀行
CHINA AIRLINES LTD	170	170	152	554	運輸

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台湾ドル	千円	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	190	190	802	2,913	自動車・自動車部品
CHINA STEEL CORP	1,150	1,320	3,174	11,523	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	263	263	684	2,484	保険
ADVANTECH CO LTD	30	40	1,258	4,566	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	490	490	935	3,397	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	190	220	3,355	12,178	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	120	120	1,022	3,711	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	330	420	4,599	16,694	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	860	860	907	3,293	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	150	180	1,953	7,089	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP LTD	115	115	149	542	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	320	320	940	3,415	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	20	34	646	2,344	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	20	20	813	2,951	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	60	70	1,613	5,857	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	380	500	4,950	17,968	素材
FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	40	100	344	1,248	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	320	390	3,439	12,486	素材
GIANT MANUFACTURING	20	30	582	2,112	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	140	170	7,123	25,856	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	570	740	3,485	12,652	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	728	897	2,015	7,316	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	20	30	2,106	7,644	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	150	150	1,060	3,849	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	960	1,130	2,333	8,470	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	700	870	3,749	13,611	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,070	1,390	1,367	4,964	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	908	1,174	3,440	12,489	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,158	1,388	12,811	46,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,000	1,220	3,946	14,326	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	5	15	7,462	27,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	866	1,087	1,599	5,804	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	998	998	1,038	3,768	保険
INVENTEC CORP	270	270	618	2,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	220	220	1,100	3,993	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	839	1,209	1,633	5,929	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	1,590	2,080	4,763	17,290	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	924	1,125	2,763	10,030	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	80	80	892	3,237	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	470	580	4,222	15,327	素材
WISTRON CORP	219	339	998	3,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	230	230	892	3,239	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	440	540	4,071	14,779	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	50	60	1,848	6,708	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	120	140	1,356	4,924	エネルギー
PHISON ELECTRONICS CORP	10	20	708	2,570	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	43	63	287	1,042	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	24	24	173	628	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	100	100	659	2,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	31	31	221	802	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	110	170	659	2,394	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台湾ドル	千円	
TAIWAN CEMENT	431	551	2,477	8,994	素材
TATUNG CO LTD	210	210	454	1,650	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,190	2,750	91,575	332,417	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,140	1,300	2,086	7,573	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	370	340	652	2,369	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	21	31	1,328	4,823	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	210	220	856	3,110	運輸
INNOLUX CORP	910	910	849	3,085	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	119	159	622	2,259	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	20	21	697	2,532	資本財
TAIMED BIOLOGICS INC	10	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEGATRON CORP	190	210	1,428	5,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10	10	520	1,887	資本財
WIN SEMICONDUCTORS CORP	20	40	1,144	4,152	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	112	135	1,928	7,001	各種金融
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	60	60	807	2,929	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	837	1,026	2,206	8,009	銀行
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	—	380	2,017	7,324	銀行
WIWYNN CORP	—	10	721	2,617	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	320	390	3,081	11,184	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	20	20	840	3,049	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10	20	570	2,069	耐久消費財・アパレル
小計 株数・金額	29,560	36,144	245,961	892,841	
小計 銘柄数<比率>	86	88	—	<8.4%>	
(中国オフショア)			千オフショア人民元		
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	12	88	78	1,231	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	3	3	7	115	ソフトウェア・サービス
CSC FINANCIAL CO LTD-A	—	34	115	1,808	各種金融
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1	1	2	45	資本財
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	—	27	12	199	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	—	5	24	390	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3	36	61	969	素材
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	—	4	20	322	食品・飲料・タバコ
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	—	60	63	995	各種金融
JUEWEI FOOD CO LTD-A	—	10	38	599	食品・飲料・タバコ
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1	1	11	177	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2	2	12	192	素材
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	—	25	24	384	食品・飲料・タバコ
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	15	16	254	各種金融
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	—	15	13	204	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	—	15	12	190	素材
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	—	9	45	712	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	—	70	89	1,399	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	—	12	24	376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOTRANS LIMITED-A	—	120	49	773	運輸
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	—	4	113	1,776	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTEC CO LTD-A	—	14	134	2,104	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	—	32	20	325	自動車・自動車部品
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	—	5	92	1,455	半導体・半導体製造装置
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	1	1	1	22	メディア・娯楽
PETROCHINA CO LTD-A	21	51	28	451	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
IND & COMM BK OF CHINA-A	60	314	179	2,818	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	85	417	146	2,303	銀行
BANK OF CHINA LTD-A	54	234	84	1,325	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32	198	97	1,534	エネルギー
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	3	8	25	404	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5	15	25	406	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	25	139	511	8,027	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	13	77	642	10,086	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	25	137	254	3,995	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	35	168	190	2,991	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	39	246	149	2,346	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	9	50	113	1,777	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	2	8	842	13,214	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	44	262	143	2,248	銀行
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	6	6	3	54	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	11	63	150	2,362	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	7	35	125	1,974	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	10	10	5	81	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22	159	272	4,278	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	21	51	39	616	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	43	256	102	1,614	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	48	326	178	2,797	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	49	79	39	624	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8	28	40	639	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	14	44	32	510	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	7	37	113	1,778	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	25	75	40	637	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	34	185	104	1,639	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	20	80	43	681	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	5	32	153	2,409	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6	19	35	558	各種金融
HUANENG POWER INTL INC-A	8	8	4	67	公益事業
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	17	72	110	1,731	不動産
CRRC CORP LTD-A	22	154	104	1,633	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	5	25	219	3,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	5	5	5	79	素材
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	13	38	35	561	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	7	71	134	2,109	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	3	3	2	39	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	—	180	100	1,570	資本財
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	3	7	33	527	保険
HAIER SMART HOME CO LTD-A	7	20	37	582	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	8	25	40	628	資本財
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	28	28	6	97	公益事業
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	2	2	3	49	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	10	30	20	328	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	2	2	5	82	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	—	11	3	56	エネルギー
GEMDALE CORP-A	6	6	7	123	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	3	3	6	106	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	—	25	129	2,036	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	8	8	3	60	資本財
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	4	11	29	455	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	3	3	3	49	メディア・娯楽
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	1	1	1	22	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	18	18	7	121	素材
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	8	8	6	100	各種金融
KANGMEI PHARMACEUTICAL CO-A	7	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	11	11	8	140	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	5	14	26	410	資本財
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	5	5	3	56	エネルギー
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	3	16	131	2,058	消費者サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	2	2	2	34	自動車・自動車部品
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	39	179	22	351	素材
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1	1	4	75	食品・飲料・タバコ
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	—	55	20	315	運輸
AVIC CAPITAL CO LTD -A	9	9	4	64	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	—	21	6	108	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	—	13	25	403	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-A	8	8	6	103	運輸
TBEA CO LTD-A	4	4	2	39	資本財
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	5	5	3	55	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	18	18	4	75	資本財
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	—	7	11	185	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	10	40	16	255	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1	3	20	324	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	2	2	7	118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGXI COPPER CO LTD-A	3	3	4	71	素材
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	—	38	19	302	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3	10	26	418	自動車・自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	3	3	2	41	各種金融
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	4	4	5	83	素材
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	7	7	6	100	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2	2	3	59	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	2	2	2	38	メディア・娯楽
AECC AVIATION POWER CO-A	2	2	4	67	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	9	24	19	311	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	2	2	3	51	ヘルスケア機器・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12	12	5	89	運輸
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	8	68	28	439	素材
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4	4	3	50	素材
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	6	6	2	36	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	7	7	4	74	各種金融
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2	2	5	85	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3	4	13	213	素材
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	—	6	17	267	家庭用品・パーソナル用品
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2	2	5	83	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	4	4	2	45	素材
BBMG CORPORATION-A	9	9	3	48	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	11	31	23	368	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	9	9	150	エネルギー
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	2	2	3	49	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	7	7	3	60	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	13	13	6	104	運輸
CHINA SPACESAT CO LTD -A	1	1	2	46	資本財
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	2	2	3	51	小売
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	6	6	5	83	資本財
HUADIAN POWER INTL CORP-A	13	13	4	72	公益事業
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	12	12	4	66	不動産
AISINO CORP-A	2	2	4	71	ソフトウェア・サービス
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	3	3	2	31	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	5	5	3	49	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1	1	11	180	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2	2	8	132	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	15	15	3	57	運輸
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	—	12	15	235	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	11	11	7	110	運輸
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	—	56	18	296	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2	2	4	77	自動車・自動車部品
XIAMEN C & D INC-A	3	3	2	40	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A	5	—	—	—	不動産
AVICOPTER PLC-A	—	5	22	348	資本財
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	—	160	56	883	各種金融
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	10	10	2	45	運輸
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	3	3	2	43	各種金融
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	—	49	12	195	公益事業
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	8	—	—	—	不動産
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	—	35	10	160	素材
SINOCHEM INTL CORP-A	—	23	11	188	資本財
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	3	3	1	27	資本財
BEIJING CAPITAL CO LTD-A	8	—	—	—	公益事業
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	—	7	11	177	資本財
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	2	2	3	52	資本財
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	1	1	12	202	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	2	2	2	38	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	—	50	46	722	素材
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1	1	9	143	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	—	11	28	448	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	20	12	198	エネルギー
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	—	35	10	170	資本財
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	—	22	13	209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A	—	50	45	713	各種金融
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	—	50	37	595	小売
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	—	23	14	221	資本財
CHINA MEHECO CO LTD -A	—	9	11	188	資本財
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	—	9	13	204	不動産
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	—	22	16	256	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	8	57	907	ソフトウェア・サービス
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	—	9	12	194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG JUHUA CO-A	—	23	16	251	素材
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	—	19	56	882	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	—	100	22	351	素材
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	—	190	46	736	運輸

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	—	9	28	442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MAANSHAN IRON & STEEL-A	7	7	1	31	素材
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	—	22	16	257	公益事業
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	—	34	15	243	不動産
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	—	26	21	336	資本財
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	—	10	37	594	食品・飲料・タバコ
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	—	14	14	233	資本財
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	—	240	47	738	運輸
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	—	9	18	284	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	—	11	19	301	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	—	35	53	842	運輸
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	—	16	16	260	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	—	21	51	801	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	—	20	41	644	ソフトウェア・サービス
TONGWEI CO LTD-A	4	4	5	84	食品・飲料・タバコ
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	—	38	12	199	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	—	10	37	590	ソフトウェア・サービス
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	—	20	33	531	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	—	4	19	300	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	—	6	15	245	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	—	11	23	369	素材
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	—	19	19	308	資本財
ANXIN TRUST CO LTD-A	5	5	1	28	各種金融
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	—	14	25	400	素材
CHINA JUSHI CO LTD -A	—	29	29	455	素材
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	—	74	10	170	素材
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	—	60	30	475	小売
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	—	7	35	554	資本財
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2	2	3	52	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	2	—	—	—	自動車・自動車部品
TONGKUN GROUP CO LTD-A	—	15	21	333	素材
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	—	3	19	303	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	—	7	19	307	食品・飲料・タバコ
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	—	9	11	180	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	—	8	13	215	消費者サービス
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2	12	34	546	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	—	2	19	309	自動車・自動車部品
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A	14	—	—	—	公益事業
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	—	7	18	286	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HLA CORP LTD -A	2	2	1	23	小売
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	7	25	20	329	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	3	13	139	2,186	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	—	10	30	484	食品・飲料・タバコ
NANJING IRON & STEEL CO-A	—	37	11	187	素材
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	—	12	26	409	自動車・自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	—	12	41	647	資本財
DONGXING SECURITIES CO LT-A	2	2	2	38	各種金融
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	—	40	52	828	運輸
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	8	25	43	689	各種金融
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	18	43	20	327	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	—	5	25	400	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	4	4	2	43	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	12	32	22	348	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5	5	4	71	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	2	2	2	43	メディア・娯楽
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1	1	2	34	自動車・自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	－	5	56	890	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	2	2	5	84	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	2	2	2	38	銀行
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	－	2	84	1,326	半導体・半導体製造装置
SDIC CAPITAL CO LTD-A	－	6	8	131	各種金融
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	5	5	1	28	小売
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	－	25	17	269	不動産
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	－	5	51	804	ヘルスケア機器・サービス
TOLY BREAD CO LTD-A	－	5	19	300	食品・飲料・タバコ
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	－	3	24	390	食品・生活必需品小売り
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	－	1	37	584	メディア・娯楽
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	－	3	20	328	資本財
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	－	2	14	230	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	6	6	6	96	各種金融
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	－	12	11	187	素材
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1	1	3	61	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	4	4	4	77	各種金融
DAWNING INFORMATION INDUST-A	－	8	33	522	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	－	8	40	628	商業・専門サービス
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	12	12	7	122	不動産
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	3	8	27	426	不動産
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	－	14	22	355	商業・専門サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	－	8	48	756	資本財
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	－	12	11	181	素材
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	－	16	38	601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	－	6	17	278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	－	6	31	493	食品・飲料・タバコ
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	2	2	8	136	素材
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	－	18	11	175	素材
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1	1	4	72	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	－	17	13	219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	－	22	20	320	素材
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	－	9	39	621	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	－	3	21	344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	－	13	31	495	資本財
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	－	1	49	781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	－	23	47	750	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	－	10	17	280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN AIRPORT CO-A	－	19	17	269	運輸
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	－	5	23	368	メディア・娯楽
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	－	7	20	315	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YINTAI GOLD CO LTD-A	－	17	21	330	素材
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	6	6	3	61	保険
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	－	11	16	264	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	－	26	51	803	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	－	12	32	511	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
GEM CO LTD-A	－	35	20	316	素材
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	－	6	16	265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	－	8	24	389	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	－	28	17	267	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1	1	3	51	耐久消費財・アパレル
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	－	31	28	451	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	－	17	41	658	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUNNAN TIN CO LTD-A	－	14	14	231	素材
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	－	10	16	254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	－	9	33	527	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	－	9	18	295	食品・飲料・タバコ
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	－	11	54	853	ヘルスケア機器・サービス
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	－	6	22	347	資本財
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	－	20	37	585	ソフトウェア・サービス
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	－	14	36	565	資本財
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	－	20	45	712	ソフトウェア・サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	－	20	42	665	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	－	13	44	694	食品・飲料・タバコ
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	－	10	24	391	資本財
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	－	30	20	321	資本財
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	－	9	12	200	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	－	25	61	957	ヘルスケア機器・サービス
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	－	20	14	227	自動車・自動車部品
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	1	1	1	28	自動車・自動車部品
VENUSTECH GROUP INC-A	－	15	58	922	ソフトウェア・サービス
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	－	20	35	558	小売
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	－	25	11	174	公益事業
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2	12	98	1,537	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	－	5	29	467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLODON CO LTD-A	－	18	72	1,129	ソフトウェア・サービス
BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	－	20	12	194	素材
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	－	11	19	310	食品・飲料・タバコ
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	－	27	17	268	不動産
WESTONE INFORMATION INDUST-A	－	8	20	322	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	4	4	2	35	エネルギー
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	－	27	74	1,173	メディア・娯楽
TIANQI LITHIUM CORP-A	2	2	6	96	素材
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	－	26	36	578	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	－	24	15	237	食品・飲料・タバコ
TIANMA MICROELECTRONICS-A	3	3	4	77	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	8	8	2	38	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	－	13	9	144	素材
YANGO GROUP CO LTD-A	－	34	24	382	不動産
NAVINFO CO LTD-A	－	35	55	864	耐久消費財・アパレル
HAN'S LASER TECHNOLOGY IN-A	1	－	－	－	資本財
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	－	9	20	321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BY-HEALTH CO LTD-A	－	13	21	342	家庭用品・パーソナル用品
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	7	7	4	78	不動産
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	－	32	50	799	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2	2	5	78	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	－	12	43	679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	4	4	4	72	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1	1	3	56	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	—	5	27	438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	—	12	40	642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAHOE GROUP CO LTD-A	—	21	11	184	不動産
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	—	10	16	256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	—	22	22	349	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	4	4	7	112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	—	33	12	198	素材
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	—	48	18	289	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	—	11	46	734	ヘルスケア機器・サービス
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	—	12	10	170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	—	7	16	254	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	5	5	2	31	素材
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	2	2	1	27	商業・専門サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	1	1	1	29	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	—	7	22	350	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	11	11	5	89	資本財
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	—	6	22	360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	1	1	3	53	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	3	3	3	56	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	4	4	3	58	耐久消費財・アパレル
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2	2	5	78	ヘルスケア機器・サービス
CITIC GUOAN INFORMATION-A	5	5	1	26	メディア・娯楽
YANTAI JEREH OILFIELD-A	—	9	33	522	エネルギー
TONGLING NONFERROUS METALS-A	15	15	3	52	素材
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	6	7	2	38	ソフトウェア・サービス
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	4	4	3	47	不動産
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	2	2	6	101	メディア・娯楽
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	—	10	12	202	資本財
BOHAI LEASING CO LTD-A	—	100	34	542	各種金融
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	2	5	41	648	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	—	7	20	321	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	5	5	2	45	食品・飲料・タバコ
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	—	30	25	406	各種金融
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	—	23	36	565	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	—	6	16	253	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	1	1	3	58	ソフトウェア・サービス
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	—	100	46	729	各種金融
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	6	6	5	85	不動産
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	—	9	7	115	ソフトウェア・サービス
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	—	2	21	342	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	6	6	2	36	公益事業
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	5	5	2	46	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	—	54	57	895	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6	30	139	2,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	4	4	3	54	資本財
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	4	4	3	49	各種金融
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	17	17	9	156	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	5	26	47	740	食品・飲料・タバコ
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	4	4	2	37	自動車・自動車部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	4	4	8	126	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	4	4	5	87	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	3	3	10	165	ソフトウェア・サービス
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	—	13	19	308	資本財
HESTEEL CO LTD-A	15	15	3	56	素材
GOERTEK INC -A	5	5	11	185	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	5	5	4	68	各種金融
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	—	26	22	349	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5	34	91	1,436	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	—	13	26	421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL CORP-A	19	19	9	150	耐久消費財・アパレル
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	—	12	5	86	不動産
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	8	8	5	86	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	11	11	7	122	消費者サービス
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5	5	4	77	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	5	5	4	72	各種金融
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	4	4	11	183	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	2	11	95	1,494	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	4	4	6	104	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	27	40	638	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	2	7	75	1,176	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	5	28	353	5,542	食品・飲料・タバコ
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	—	38	65	1,030	メディア・娯楽
SUNING.COM CO LTD-A	13	33	33	517	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	47	205	96	1,518	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	9	65	117	1,848	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	4	14	89	1,404	耐久消費財・アパレル
MIDEA GROUP CO LTD-A	9	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	13	72	259	4,066	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	6	6	7	115	各種金融
PING AN BANK CO LTD-A	17	102	158	2,486	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	—	42	137	2,153	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	26	152	73	1,149	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	14	55	159	2,500	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	2	2	2	34	資本財
ZTE CORP-A	5	13	50	798	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9	9	5	88	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	8	8	10	169	資本財
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	—	5	18	297	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GF SECURITIES CO LTD-A	8	8	11	185	各種金融
ANGANG STEEL CO LTD-A	6	7	2	37	素材
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	4	4	4	73	資本財
BYD CO LTD -A	2	2	11	187	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	—	52	67	1,057	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	—	11	17	267	半導体・半導体製造装置
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	—	17	27	431	素材
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	—	52	53	837	メディア・娯楽
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	—	13	16	252	資本財
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	—	4	47	743	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	—	20	27	434	食品・飲料・タバコ
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	—	35	15	243	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1	1	4	74	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	—	3	42	674	食品・飲料・タバコ
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	—	23	17	272	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	—	15	20	322	素材
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	—	9	63	997	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	1	1	3	61	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	—	21	17	278	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	—	9	26	418	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	—	43	25	397	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2	2	3	56	メディア・娯楽
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	—	4	17	276	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	—	3	21	344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	—	10	9	156	食品・飲料・タバコ
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	—	2	30	477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	4	4	6	105	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	2	2	7	123	運輸
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	5	5	3	60	各種金融
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	—	8	19	308	素材
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	—	37	28	452	エネルギー
CHONGQING FULING ZHACAI-A	—	7	16	258	食品・飲料・タバコ
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	—	5	41	643	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	—	6	35	556	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	—	5	26	419	資本財
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	—	3	53	835	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	—	4	19	303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	—	7	56	887	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	—	3	23	374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	—	4	18	294	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	—	3	30	471	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	—	2	37	588	ヘルスケア機器・サービス
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	—	3	3	49	各種金融
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	—	5	77	1,208	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	—	9	46	736	ヘルスケア機器・サービス
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	—	18	235	3,687	資本財
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	—	72	18	295	素材
小計 株数・金額	2,013	11,679	16,600	260,462	
小計 銘柄数<比率>	234	461	—	<2.4%>	
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	251	317	48,233	74,279	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	73	73	3,423	5,272	エネルギー
EICHER MOTORS LTD	1	1	3,223	4,963	自動車・自動車部品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	67	85	4,842	7,458	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	0.58	0.99	2,290	3,527	素材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	71	71	1,754	2,701	エネルギー
LIC HOUSING FINANCE LTD	13	35	1,636	2,520	銀行
TATA STEEL LTD	34	34	1,646	2,536	素材
NESTLE INDIA LTD	2	2	4,112	6,332	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	74	149	1,936	2,981	公益事業
VEDANTA LTD	123	211	3,304	5,089	素材
TITAN CO LTD	29	35	4,367	6,725	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	106	276	3,272	5,039	エネルギー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	—	7	1,060	1,632	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	16	26	1,924	2,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	143	183	45,081	69,425	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	46	80	2,268	3,492	メディア・娯楽
INFOSYS LTD	306	377	29,528	45,473	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	103	130	3,222	4,961	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	162	207	2,484	3,825	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	56	73	15,202	23,411	家庭用品・パーソナル用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	50	122	7,450	11,473	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	50	61	3,073	4,732	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	3	11	2,801	4,314	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	10	13	3,989	6,143	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	127	273	14,335	22,076	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	76	96	4,307	6,633	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	7	7	1,337	2,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	9	11	8,547	13,162	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	25	25	1,292	1,990	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	67	113	1,639	2,525	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	14	20	2,176	3,351	各種金融
PETRONET LNG LTD	29	66	1,834	2,824	エネルギー
CIPLA LTD	33	33	1,537	2,367	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	43	53	7,338	11,301	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	8	11	5,315	8,186	素材
ASHOK LEYLAND LTD	82	139	1,207	1,859	資本財
BOSCH LTD	0.73	0.73	1,096	1,688	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	78	101	22,115	34,058	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	185	270	3,109	4,788	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	8	8	1,340	2,064	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMBUJA CEMENTS LTD	40	73	1,597	2,460	素材
BHARAT FORGE LTD	13	25	1,330	2,048	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	111	111	2,283	3,515	素材
ITC LTD	294	386	9,197	14,163	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	8	14	2,160	3,326	素材
UPL LTD	34	60	3,308	5,094	素材
SIEMENS LTD	—	7	1,244	1,916	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	—	6	1,798	2,769	メディア・娯楽
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	33	41	3,102	4,777	家庭用品・パーソナル用品
VODAFONE IDEA LTD	140	—	—	—	電気通信サービス
MARICO LTD	45	45	1,549	2,385	家庭用品・パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	0.54	0.54	1,415	2,179	耐久消費財・アパレル
DLF LTD	—	64	1,687	2,598	不動産
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	148	208	4,099	6,313	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	51	69	2,682	4,131	運輸
REC LTD	30	70	990	1,524	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	3	4	4,084	6,290	保険
BAJAJ AUTO LTD	8	9	2,981	4,592	自動車・自動車部品
COAL INDIA LTD	67	132	2,560	3,942	エネルギー
TATA MOTORS LTD	148	183	3,423	5,271	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	140	140	860	1,325	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	23	38	1,409	2,171	各種金融

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
BHARTI INFRATEL LTD		24	24	586	902	電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		26	—	—	—	銀行
ASIAN PAINTS LTD		26	32	5,819	8,962	素材
BAJAJ FINANCE LTD		16	19	8,300	12,783	各種金融
YES BANK LTD		157	—	—	—	銀行
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD		—	50	3,036	4,675	保険
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD		—	4	1,524	2,347	各種金融
CONTAINER CORP OF INDIA LTD		10	24	1,352	2,083	運輸
BANDHAN BANK LTD		—	44	2,165	3,334	銀行
BRITANNIA INDUSTRIES LTD		5	6	2,091	3,220	食品・飲料・タバコ
AXIS BANK LTD		160	235	17,345	26,711	銀行
HAVELLS INDIA LTD		25	29	1,808	2,785	資本財
STATE BANK OF INDIA		163	202	6,573	10,123	銀行
ICICI BANK LTD		214	530	28,296	43,576	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD		—	25	1,404	2,162	素材
TECH MAHINDRA LTD		43	52	4,132	6,364	ソフトウェア・サービス
CADILA HEALTHCARE LTD		8	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRASIM INDUSTRIES LTD		31	33	2,780	4,281	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD		11	11	2,320	3,574	食品・生活必需品小売り
UNITED SPIRITS LTD		21	33	1,909	2,940	食品・飲料・タバコ
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA		—	16	2,172	3,345	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA		—	37	1,960	3,018	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD		8	8	1,276	1,965	運輸
SBI LIFE INSURANCE CO LTD		—	38	3,851	5,930	保険
JSW STEEL LTD		79	79	2,159	3,325	素材
小計	株数・金額	4,984	7,058	437,298	673,439	
	銘柄数<比率>	78	84	—	<6.3%>	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR INSURANCE CO		11	113	36	1,078	保険
QATAR NATIONAL BANK		41	511	1,059	31,601	銀行
COMMERCIAL BANK PQSC		14	224	110	3,300	銀行
OOREDOO QPSC		5	94	66	1,972	電気通信サービス
QATAR FUEL QSC		—	54	122	3,642	エネルギー
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		5	64	104	3,117	公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC		—	84	79	2,366	銀行
INDUSTRIES QATAR		18	210	215	6,437	資本財
QATAR ISLAMIC BANK		12	120	199	5,939	銀行
MASRAF AL RAYAN		37	432	178	5,335	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		21	214	77	2,301	不動産
EZDAN HOLDING GROUP		78	—	—	—	不動産
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI		—	486	109	3,276	素材
小計	株数・金額	245	2,608	2,359	70,369	
	銘柄数<比率>	10	12	—	<0.7%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
BIDVEST GROUP LTD		31	33	737	5,573	資本財
CLICKS GROUP LTD		23	29	756	5,722	食品・生活必需品小売り
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		46	—	—	—	小売
DISCOVERY LTD		32	44	555	4,197	保険
GOLD FIELDS LTD		88	95	871	6,587	素材
REMGRO LTD		48	61	1,164	8,803	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD		23	23	350	2,649	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円	
NORTHAM PLATINUM LTD	—	38	475	3,596	素材
EXXARO RESOURCES LTD	24	24	316	2,391	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3	4	673	5,093	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	8	8	87	663	保険
MTN GROUP LTD	151	191	1,578	11,931	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	38	47	1,382	10,454	素材
TELKOM SA SOC LTD	25	25	80	609	電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	287	383	2,314	17,496	各種金融
PSG GROUP LTD	11	18	412	3,117	各種金融
NASPERS LTD-N SHS	39	48	11,999	90,719	小売
NEDBANK GROUP LTD	36	39	800	6,051	銀行
NETCARE LTD	74	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
PICK N PAY STORES LTD	21	41	277	2,095	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	67	91	705	5,334	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	3	6	740	5,597	素材
SAPPI LIMITED	50	—	—	—	素材
SASOL LTD	48	63	1,686	12,747	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	40	53	656	4,965	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	114	142	2,326	17,585	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	14	22	452	3,422	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	95	95	452	3,422	小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	36	45	534	4,042	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIGER BRANDS LTD	15	15	322	2,440	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD	148	212	1,636	12,368	保険
INVESTEC LTD	22	36	315	2,386	各種金融
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	—	87	1,190	9,002	素材
KUMBA IRON ORE LTD	7	7	293	2,221	素材
MONDI LTD	11	—	—	—	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	127	127	323	2,444	ヘルスケア機器・サービス
MMI HOLDINGS LTD	39	—	—	—	保険
VODACOM GROUP LTD	55	72	880	6,655	電気通信サービス
SIBANYE GOLD LTD	—	248	953	7,205	素材
NEPI ROCKCASTLE PLC	35	43	546	4,127	不動産
OLD MUTUAL LTD	444	547	986	7,455	保険
REINET INVESTMENTS SCA	14	17	541	4,095	各種金融
ABSA GROUP LTD	65	76	1,077	8,144	銀行
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	99	166	1,257	小売
MULTICHOICE GROUP LTD	—	49	564	4,267	メディア・娯楽
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	—	100	213	1,615	保険
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	53	85	246	1,862	保険
MR PRICE GROUP LTD	24	24	440	3,330	小売
BID CORP LTD	30	37	1,321	9,986	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	2,580	3,572	44,409	335,738	
小計 銘柄数＜比率＞	43	44	—	＜3.2%＞	
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK	137	199	115	3,427	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	344	403	165	4,926	不動産
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	90	—	—	—	不動産
EMAAR MALLS PJSC	90	306	56	1,669	不動産
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO	80	—	—	—	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	161	184	303	9,031	電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アラブ首長国連邦)		百株	百株	千アラブディルハム	千円	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		217	296	236	7,025	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		268	310	490	14,583	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC		267	450	99	2,972	不動産
小計	株数・金額	1,656	2,150	1,467	43,636	
	銘柄数<比率>	9	7	－	<0.4%>	
(サウジアラビア)				千ｻｳｼﾞｱﾗﾋﾞｱﾘｱﾙ		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL		－	22	116	3,387	素材
JARIR MARKETING CO		－	6	104	3,046	小売
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE		－	6	51	1,504	保険
ETIHAD ETISALAT CO		－	42	113	3,297	電気通信サービス
SAUDI BRITISH BANK		－	80	274	8,003	銀行
AL RAJHI BANK		－	138	904	26,325	銀行
ARAB NATIONAL BANK		－	67	183	5,349	銀行
BANK ALBILAD		－	42	115	3,360	銀行
BANK AL-JAZIRA		－	35	54	1,574	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI		－	62	236	6,895	銀行
RIYAD BANK		－	136	330	9,611	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP		－	111	334	9,733	銀行
SAUDI TELECOM CO		－	44	415	12,095	電気通信サービス
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO		－	18	146	4,257	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		－	84	757	22,057	素材
SAUDI CEMENT		－	8	59	1,737	素材
SAUDI ELECTRICITY CO		－	94	187	5,468	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP		－	25	61	1,796	素材
SAVOLA		－	29	102	2,991	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C		－	37	48	1,420	素材
ALMARAI CO		－	28	134	3,925	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY		－	42	44	1,285	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH		－	35	61	1,803	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO		－	12	60	1,756	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		－	80	81	2,366	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV		－	59	57	1,677	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE		－	30	61	1,804	エネルギー
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE		－	2	30	902	保険
ALINMA BANK		－	84	217	6,335	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO		－	48	212	6,178	素材
SAUDI AIRLINES CATERING CO		－	4	43	1,257	消費者サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO		－	114	391	11,382	エネルギー
NATIONAL COMMERCIAL BANK		－	135	632	18,420	銀行
小計	株数・金額	－	1,772	6,630	193,013	
	銘柄数<比率>	－	33	－	<1.8%>	
合計	株数・金額	220,917	298,329	－	7,576,678	
	銘柄数<比率>	1,095	1,375	－	<71.2%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		口	口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		31,700	35,500	1,143	6,620	0.1
小計	口数・金額	31,700	35,500	1,143	6,620	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		22,964	33,820	715	5,412	0.1
FORTRESS REIT LTD-A		12,100	12,100	223	1,687	0.0
FORTRESS REIT LTD-B		8,600	－	－	－	－
REDEFINE PROPERTIES LTD		51,557	62,770	458	3,464	0.0
HYPROP INVESTMENTS LTD		2,850	－	－	－	－
RESILIENT REIT LTD		2,600	－	－	－	－
小計	口数・金額	100,671	108,690	1,397	10,564	
	銘柄数<比率>	6	3	－	<0.1%>	
合計	口数・金額	132,371	144,190	－	17,185	
	銘柄数<比率>	7	4	－	<0.2%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	MSCIEMG 2003	百万円 3,088	百万円 －

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

（2020年１月27日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	7,576,678	71.2
投資証券	17,185	0.2
コール・ローン等、その他	3,051,591	28.6
投資信託財産総額	10,645,454	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。
（注）当期末における外貨建純資産（10,413,126千円）の投資信託財産総額（10,645,454千円）に対する比率は97.8％です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.06円、1メキシコペソ=5.79円、1ブラジルレアル=26.07円、1チリペソ=0.1402円、1コロンビアペソ=0.0324円、1ユーロ=120.30円、1トルコリラ=18.34円、1チェココルナ=4.78円、1ハンガリーフォリント=0.3576円、1ポーランドズロチ=28.27円、1香港ドル=14.03円、1マレーシアリンギット=26.87円、1タイバーツ=3.55円、1フィリピンペソ=2.15円、1インドネシアルピア=0.0081円、1韓国ウォン=0.0934円、1新台湾ドル=3.63円、1オフショア人民元=15.69円、1インドルピー=1.54円、1カタールリアル=29.83円、1南アフリカランド=7.56円、1アラブディルハム=29.74円、1サウジアラビアリアル=29.11円。

○特定資産の価格等の調査

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,910,000,136
コール・ローン等	2,298,159,326
株式(評価額)	7,576,678,079
投資証券(評価額)	17,185,215
未収入金	495,528,140
未収配当金	3,292,912
差入委託証拠金	519,156,464
(B) 負債	267,687,494
未払金	267,596,388
未払解約金	91,000
未払利息	106
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	10,642,312,642
元本	7,682,410,355
次期繰越損益金	2,959,902,287
(D) 受益権総口数	7,682,410,355口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	13,853円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,259,682,907円、期中追加設定元本額は7,250,403,925円、期中一部解約元本額は3,827,676,477円です。

(注) 2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	1,996,589,744円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	951,409,111円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	855,977,079円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	617,085,627円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	589,300,965円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	542,362,143円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	522,364,713円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	415,870,035円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	396,694,194円
・つみたてバランスファンド	194,455,309円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	171,271,732円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	157,705,015円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	76,149,551円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	58,991,402円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	50,858,472円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	43,707,129円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	16,566,042円
・ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	9,820,193円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	7,988,561円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	3,214,685円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,077,912円
・グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	744,723円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	613,829円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	592,189円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.3853円です。

○損益の状況 (2019年１月26日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	159,576,807
受取配当金	145,420,830
受取利息	14,240,224
その他収益金	2,760
支払利息	△　87,007
(B) 有価証券売買損益	539,370,837
売買益	1,085,722,273
売買損	△ 546,351,436
(C) 先物取引等取引損益	174,276,248
取引益	352,807,188
取引損	△ 178,530,940
(D) 保管費用等	△　15,100,130
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	858,123,762
(F) 前期繰越損益金	1,055,458,173
(G) 追加信託差損益金	1,975,983,875
(H) 解約差損益金	△　929,663,523
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	2,959,902,287
次期繰越損益金(Ｉ)	2,959,902,287

(注) 損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**および(C)**先物取引等取引損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(G)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(H)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
主 要 投 資 対 象	・ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
主 な 投 資 制 限	・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 ・株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率		
（設定日）	円	%		%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	28,863.78	－	－	30
1期(2017年1月25日)	10,573	5.7	29,667.71	2.8	99.7	734
2期(2018年1月25日)	11,848	12.1	33,711.33	13.6	99.9	1,678
3期(2019年1月25日)	10,717	△ 9.5	31,263.48	△ 7.3	99.9	2,398
4期(2020年1月27日)	11,280	5.3	34,193.00	9.4	98.4	6,100

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
(注) 「ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）」は、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（米ドルベース）をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（米ドルベース）は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（J.P.Morgan Securities LLC）が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）		投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	
（期首）	円	%		%	%
2019年1月25日	10,717	－	31,263.48	－	99.9
1月末	10,858	1.3	31,235.67	△0.1	99.9
2月末	11,040	3.0	32,082.90	2.6	99.5
3月末	10,814	0.9	31,500.96	0.8	99.9
4月末	10,907	1.8	31,730.84	1.5	99.4
5月末	10,570	△1.4	31,075.08	△0.6	99.9
6月末	11,044	3.1	32,298.63	3.3	100.0
7月末	11,210	4.6	32,890.33	5.2	99.9
8月末	10,458	△2.4	31,345.98	0.3	99.8
9月末	10,690	△0.3	32,274.56	3.2	99.8
10月末	11,101	3.6	33,390.89	6.8	99.9
11月末	10,912	1.8	32,946.41	5.4	99.2
12月末	11,324	5.7	34,229.09	9.5	99.8
（期末） 2020年1月27日	11,280	5.3	34,193.00	9.4	98.4

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

期中の基準価額等の推移

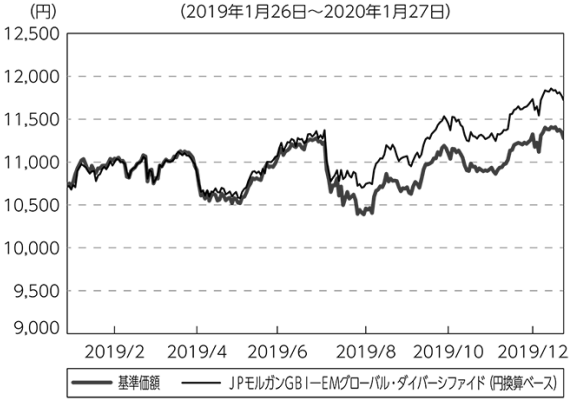
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,717円から当期末11,280円となり、563円の値上がりとなりました。

新興国債券の市況（ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも新興国の債券価格が上昇したことが作用しました。

基準価額等の推移
（2019年1月26日～2020年1月27日）



（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

新興国債券市況

新興国金利は、前期末と比較して、多くの国で長期金利が低下（債券価格は上昇）しました。期初は米国の金融政策が緩和姿勢に転じたことから多くの国で利下げが実施され、新興国金利は低下基調となりました。期の後半にはＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）、ＥＣＢ（欧州中央銀行）の緩和策強化を受け、新興国金利は一段と低下しました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して横ばいで推移し、ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、期の前半は世界景気の減速懸念や米中対立に対する過度な警戒感が緩和され円安基調となりましたが、ＦＲＢの金融緩和観測が広がるにつれ米ドルは売られ円高が進行しました。期の後半は、米国の緩和的な金融政策が当面据え置かれるとの見方を背景に過度な円高圧力は緩和され、期末にかけては緩やかに円安が進行しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標やイギリスのＥＵ（欧州連合）離脱問題等を背景に、期を通じて円高傾向で推移しました。

新興国通貨は、前期末と比較して、多くの通貨で米ドル・円に対して横ばいで推移しました。期の前半は、米国の利下げ観測の高まりを背景に多くの新興国でも利下げが実施され、米ドルに対しては横ばいで推移し、金融緩和余地の少ない日本円に対しては新興国通貨安が進行しました。期の後半は、米中貿易摩擦の緩和期待の高まりなどから投資家のリスク志向が強まり、米ドル・円に対して新興国通貨は買われました。

当ファンドのポートフォリオ

新興国の現地通貨建て債券を実質的な主要投資対象とし、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いました。ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、ＥＴＦ（上場投資信託証券）を活用して運用を行いました。ＥＴＦへの投資を通じて実質債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

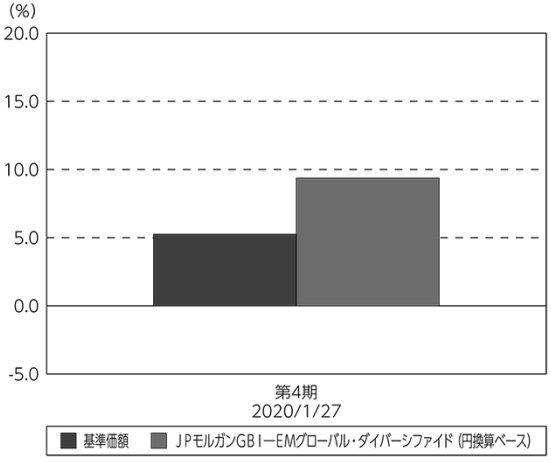
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋5.3%となり、ベンチマークの＋9.4%を4.1%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（ＥＴＦ等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと
・配当金の課税負担が生じたこと

（その他の要因）
・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと
・ベンチマークとファンドで保有するＥＴＦの値動きで乖離が生じたこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ―ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）との連動性を高めるため、新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦを活用しながら運用を行う方針です。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	7	0.064	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（投資信託証券）	(7)	(0.064)	
(b) 有価証券取引税	0	0.002	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（投資信託証券）	(0)	(0.002)	
(c) その他費用	2	0.016	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.016)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	9	0.082	
期中の平均基準価額は、10,910円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

投資信託証券

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	1,064,560	35,714	975,834	32,699
	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	498,965	30,486	－	－
	小計	1,563,525	66,200	975,834	32,699

（注）金額は受け渡し代金。
（注）銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

外国投資信託証券

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
VANECK VECTORS J.P. MORGAN E		645,108	733,834	24,928	2,718,684	44.6
ISHARES JPM EM LCL GOV BND		－	498,965	30,127	3,285,705	53.9
合計	口数・金額	645,108	1,232,799	55,055	6,004,390	
	銘柄数＜比率＞	1	2	－	＜98.4%＞	

（注）邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
（注）比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
（注）銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○投資信託財産の構成

（2020年１月27日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	6,004,390	97.1
コール・ローン等、その他	176,157	2.9
投資信託財産総額	6,180,547	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。
（注）当期末における外貨建純資産（6,055,798千円）の投資信託財産総額（6,180,547千円）に対する比率は98.0%です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.06円。

○特定資産の価格等の調査

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,222,462,650
コール・ローン等	18,172,448
投資信託受益証券(評価額)	6,004,390,747
未収入金	115,524,976
未収配当金	84,374,479
(B) 負債	121,741,720
未払金	81,741,689
未払解約金	40,000,000
未払利息	31
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	6,100,720,930
元本	5,408,384,361
次期繰越損益金	692,336,569
(D) 受益権総口数	5,408,384,361口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,280円

(注) 当ファンドの期首元本額は2,237,772,471円、期中追加設定元本額は4,178,147,843円、期中一部解約元本額は1,007,535,953円です。

(注) 2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	2,086,671,579円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	591,454,177円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	525,138,072円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	377,233,743円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	337,175,868円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	324,730,401円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	246,616,512円
・つみたてバランスファンド	245,175,001円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	194,658,577円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	106,477,440円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	102,193,909円
・ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	92,904,467円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	48,901,118円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	37,061,599円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	36,005,929円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	28,234,710円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	13,851,723円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	9,152,026円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	2,117,286円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,350,382円
・グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	490,967円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	396,853円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	392,022円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.1280円です。

○損益の状況 (2019年１月26日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	278,901,587
受取配当金	278,815,690
受取利息	110,596
支払利息	△　24,699
(B) 有価証券売買損益	△ 30,401,552
売買益	46,764,431
売買損	△ 77,165,983
(C) 保管費用等	△　591,683
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	247,908,352
(E) 前期繰越損益金	160,545,407
(F) 追加信託差損益金	372,160,857
(G) 解約差損益金	△ 88,278,047
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	692,336,569
次期繰越損益金(Ｈ)	692,336,569

(注) 損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(F)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(G)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ②不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。
主 要 投 資 対 象	・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）
主 な 投 資 制 限	・不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は、行いません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		不動産投信指数先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
（設定日）	円	%		%	%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	3,066.27	－	－	－	50
1期(2017年1月25日)	11,104	11.0	3,390.95	10.6	1.8	97.9	3,869
2期(2018年1月25日)	11,040	△ 0.6	3,378.86	△ 0.4	3.4	96.8	14,593
3期(2019年1月25日)	11,929	8.1	3,654.11	8.1	4.4	95.6	12,367
4期(2020年1月27日)	14,787	24.0	4,533.90	24.1	2.1	97.8	24,559

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
（注）不動産投信指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
（注）「東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）」は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託（ＲＥＩＴ）全銘柄を対象として算出した東証ＲＥＩＴ指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）		不動産投信指数先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2019年1月25日	11,929	－	3,654.11	－	4.4	95.6
1月末	12,108	1.5	3,709.11	1.5	4.4	95.6
2月末	12,170	2.0	3,728.00	2.0	4.5	95.4
3月末	12,572	5.4	3,851.10	5.4	3.6	96.5
4月末	12,479	4.6	3,822.76	4.6	2.2	98.0
5月末	12,697	6.4	3,889.57	6.4	2.1	95.2
6月末	12,886	8.0	3,947.76	8.0	2.1	97.7
7月末	13,449	12.7	4,120.33	12.8	1.6	98.3
8月末	13,955	17.0	4,275.94	17.0	2.1	97.8
9月末	14,613	22.5	4,477.77	22.5	2.9	97.1
10月末	15,094	26.5	4,625.77	26.6	2.8	98.4
11月末	14,956	25.4	4,584.30	25.5	2.4	97.6
12月末	14,516	21.7	4,450.34	21.8	2.0	98.1
（期末）						
2020年1月27日	14,787	24.0	4,533.90	24.1	2.1	97.8

（注）騰落率は期首比です。
（注）不動産投信指数先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末11,929円から当期末14,787円となり、2,858円の値上がりとなりました。

国内リートの市況（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の上昇により、基準価額は上昇しました。

基準価額等の推移

（2019年1月26日～2020年1月27日）

（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内リート市況

国内リート市場は、前期末と比較して大幅に上昇しました。期の前半は、国内外の長期金利がマイナス圏まで低下するなか、国内長期金利や株式配当利回りに比べ相対的に高い分配金利回りを求める投資資金の流入が続き、上昇基調となりました。期末にかけては、国内長期金利が急上昇し国内リート市場は一時下落する局面がありましたが、金利上昇が一服すると落ち着いた動きとなりました。

当ファンドのポートフォリオ

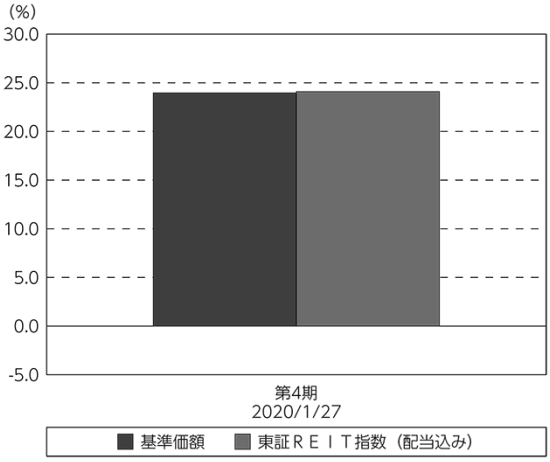
国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋24.0%となり、ベンチマークの＋24.1%を0.1%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（リート等に係る売買費用）が生じたこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主として東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	0	0.003	
期中の平均基準価額は、13,457円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

投資信託証券

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		口	千円	口	千円
国内	エスコンジャパンリート投資法人	325	36,551	104	12,032
	サンケイリアルエステート投資法人	425	50,013	113	13,618
	日本アコモデーションファンド投資法人	645	413,635	368	233,477
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2,509	284,598	1,235	136,165
	森ヒルズリート投資法人	2,228	365,972	1,266	205,673
	産業ファンド投資法人	2,605	385,799	1,371	200,372
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,884	633,198	1,130	377,091
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,233	245,079	677	133,433
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	990	513,466	605	306,640
	ＧＬＰ投資法人	4,818	638,499	2,729	352,550
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	855	277,153	462	149,428
	日本プロロジスリート投資法人	2,878	778,457	1,556	413,765
	星野リゾート・リート投資法人	296	166,643	170	95,304
	Ｏｎｅリート投資法人	300	92,945	157	48,385
	イオンリート投資法人	2,125	298,362	1,157	163,307
	ヒューリックリート投資法人	1,669	320,707	905	173,418
	日本リート投資法人	625	278,178	352	155,673
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12,426	244,382	6,423	125,421
	日本ヘルスケア投資法人	97	18,542	53	9,991
	積水ハウス・リート投資法人	6,031	532,430	3,144	274,339
	トーセイ・リート投資法人	445	57,712	231	28,995
	ケネディクス商業リート投資法人	761	208,866	413	111,725
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	513	65,009	229	29,531
	サムティ・レジデンシャル投資法人	390	43,719	223	25,156
	野村不動産マスターファンド投資法人	6,705	1,212,750	3,670	654,959
	いちごホテルリート投資法人	324	41,923	199	25,794
	ラサールロジポート投資法人	1,937	278,165	932	130,953
	スターアジア不動産投資法人	640	73,069	336	38,678
	マリモ地方創生リート投資法人	191	23,585	92	11,155
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	571	231,338	266	108,569
	大江戸温泉リート投資法人	325	29,294	172	15,338
	さくら総合リート投資法人	420	39,442	240	22,513
	投資法人みらい	1,949 (　1,224)	126,045 (　－)	1,082	66,652
	森トラスト・ホテルリート投資法人	459	65,218	263	37,412
	三菱地所物流リート投資法人	436	143,604	153	49,118
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	399	52,851	127	16,155
	ザイマックス・リート投資法人	315	41,309	125	16,438
	タカラレーベン不動産投資法人	631	73,736	217	24,730

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	298	32,736	169	18,266
	日本ビルファンド投資法人	1,874	1,465,692	1,068	825,766
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,938	1,342,796	1,106	758,870
	日本リテールファンド投資法人	3,661	828,109	2,088	470,271
	オリックス不動産投資法人	3,862	842,760	2,204	473,053
	日本プライムリアルティ投資法人	1,226	589,377	699	335,864
	プレミア投資法人	1,784	267,045	1,095	161,212
国	東急リアル・エステート投資法人	1,299	252,374	741	143,502
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,410	193,983	759	104,583
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,388	863,960	2,467	475,716
	森トラスト総合リート投資法人	1,385	257,458	790	145,402
	インヴィンシブル投資法人	8,956	548,884	4,136	251,136
	フロンティア不動産投資法人	690	320,715	375	174,216
	平和不動産リート投資法人	1,210	160,657	691	90,930
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,266	329,307	730	189,047
	福岡リート投資法人	1,001	179,565	570	102,110
内	ケネディクス・オフィス投資法人	602	482,786	345	274,659
	いちごオフィスリート投資法人	1,544	164,889	972	102,860
	大和証券オフィス投資法人	449	362,469	256	206,042
	阪急阪神リート投資法人	871	139,411	493	77,991
	スターツプロシード投資法人	303	57,929	176	33,322
	大和ハウスリート投資法人	2,721	753,319	1,473	404,635
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,243	533,061	3,559	306,177
	日本賃貸住宅投資法人	2,179	209,318	1,243	116,549
	ジャパンエクセレント投資法人	1,802	308,619	993	167,176
	合計	115,337 (1,224)	20,869,494 (－)	62,145	11,403,337

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) ( )内は分割・合併・増資等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

	種類別	買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	不動産投信指数先物取引	3,335	3,424	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020年１月27日現在）

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	－	221	31,138	0.1
サンケイリアルエステート投資法人	－	312	42,276	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	438	715	499,785	2.0
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	1,486	2,760	342,516	1.4
森ヒルズリート投資法人	1,513	2,475	455,400	1.9
産業ファンド投資法人	1,537	2,771	466,082	1.9
アドバンス・レジデンス投資法人	1,286	2,040	702,780	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	783	1,339	288,956	1.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人	693	1,078	611,226	2.5
ＧＬＰ投資法人	3,269	5,358	731,367	3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	503	896	321,216	1.3
日本プロロジスリート投資法人	1,769	3,091	923,590	3.8
星野リゾート・リート投資法人	201	327	182,139	0.7
Ｏｎｅリート投資法人	192	335	120,432	0.5
イオンリート投資法人	1,354	2,322	349,461	1.4
ヒューリックリート投資法人	1,066	1,830	360,327	1.5
日本リート投資法人	426	699	350,898	1.4
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	7,818	13,821	322,443	1.3
日本ヘルスケア投資法人	60	104	22,360	0.1
積水ハウス・リート投資法人	3,403	6,290	575,535	2.3
トーセイ・リート投資法人	254	468	63,414	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	483	831	225,117	0.9
ヘルスケア＆メディカル投資法人	175	459	65,178	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	264	431	51,461	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	3,910	6,945	1,293,853	5.3
いちごホテルリート投資法人	231	356	47,063	0.2
ラサールロジポート投資法人	995	2,000	335,400	1.4
スターアジア不動産投資法人	410	714	82,681	0.3
マリモ地方創生リート投資法人	113	212	26,966	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	225	530	283,020	1.2
大江戸温泉リート投資法人	213	366	33,672	0.1
さくら総合リート投資法人	285	465	44,640	0.2
投資法人みらい	355	2,446	147,738	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人	309	505	74,639	0.3
三菱地所物流リート投資法人	140	423	156,721	0.6
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	132	404	58,378	0.2
ザイマックス・リート投資法人	122	312	43,274	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	197	611	78,696	0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	204	333	42,657	0.2
日本ビルファンド投資法人	1,277	2,083	1,787,214	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,319	2,151	1,684,233	6.9
日本リテールファンド投資法人	2,493	4,066	934,366	3.8
オリックス不動産投資法人	2,628	4,286	995,209	4.1
日本プライムリアルティ投資法人	835	1,362	661,932	2.7
プレミア投資法人	1,254	1,943	303,496	1.2

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
東急リアル・エステート投資法人		884	1,442	307,434	1.3
グローバル・ワン不動産投資法人		843	1,494	214,389	0.9
ユナイテッド・アーバン投資法人		2,909	4,830	941,850	3.8
森トラスト総合リート投資法人		943	1,538	301,294	1.2
インヴィンシブル投資法人		4,616	9,436	512,374	2.1
フロンティア不動産投資法人		449	764	343,036	1.4
平和不動産リート投資法人		821	1,340	186,126	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人		870	1,406	409,146	1.7
福岡リート投資法人		682	1,113	206,906	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人		408	665	569,240	2.3
いちごオフィスリート投資法人		1,094	1,666	193,755	0.8
大和証券オフィス投資法人		304	497	426,426	1.7
阪急阪神リート投資法人		594	972	165,045	0.7
スターツプロシード投資法人		208	335	68,742	0.3
大和ハウスリート投資法人		1,652	2,900	820,410	3.3
ジャパン・ホテル・リート投資法人		4,246	6,930	501,039	2.0
日本賃貸住宅投資法人		1,484	2,420	256,036	1.0
ジャパンエクセレント投資法人		1,181	1,990	386,657	1.6
合計	口数・金額	70,808	125,224	24,030,863	
	銘柄数<比率>	61	63	<97.8%>	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。
(注) 当社または当社の利害関係人が資産運用会社または一般事務受託会社となっている投資法人はありません。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	百万円 526	百万円 －

○投資信託財産の構成

(2020年１月27日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	24,030,863	96.4
コール・ローン等、その他	893,501	3.6
投資信託財産総額	24,924,364	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2019年１月26日～2020年１月27日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月27日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	24,924,364,491
コール・ローン等	669,750,075
投資証券(評価額)	24,030,863,630
未収入金	65,679,250
未収配当金	158,795,636
差入委託証拠金	△ 724,100
(B) 負債	365,349,831
未払金	226,843,015
未払解約金	138,505,000
未払利息	1,816
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	24,559,014,660
元本	16,608,377,856
次期繰越損益金	7,950,636,804
(D) 受益権総口数	16,608,377,856口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	14,787円

(注) 当ファンドの期首元本額は10,367,134,330円、期中追加設定元本額は17,725,311,130円、期中一部解約元本額は11,484,067,604円です。

(注) 2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	4,522,556,621円
・Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,487,107,932円
・ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	2,464,261,785円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	1,934,565,748円
・りそなＤＡＡファンド(適格機関投資家専用)	1,223,038,157円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	455,061,505円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	409,235,380円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	389,622,834円
・つみたてバランスファンド	384,539,664円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	294,146,363円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	259,430,990円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	249,849,080円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	189,754,155円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	97,777,349円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	81,922,297円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	46,798,891円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	34,818,000円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	34,700,963円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	26,021,037円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	10,793,425円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	7,435,812円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	1,839,793円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,266,857円
・グローバル９資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,122,959円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	361,111円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	349,148円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.4787円です。

○損益の状況　(2019年１月26日～2020年１月27日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	621,219,600
受取配当金	621,770,294
その他収益金	29
支払利息	△ 550,723
(B) 有価証券売買損益	2,741,988,954
売買益	2,878,408,307
売買損	△ 136,419,353
(C) 先物取引等取引損益	74,592,952
取引益	93,896,044
取引損	△ 19,303,092
(D) 保管費用等	△ 18,628
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	3,437,782,878
(F) 前期繰越損益金	2,000,221,252
(G) 追加信託差損益金	6,788,021,070
(H) 解約差損益金	△4,275,388,396
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	7,950,636,804
次期繰越損益金(Ｉ)	7,950,636,804

(注) 損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**および**(C)先物取引等取引損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で**(G)追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で**(H)解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

運 用 報 告 書

第４期（決算日　2020年１月27日）
（2019年１月26日～2020年１月27日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2015年12月11日から無期限です。
運　用　方　針	①主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。
主 要 投 資 対 象	・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
主 な 投 資 制 限	・不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		S＆P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率			
（設定日）	円	%		%	%	%	百万円
2015年12月11日	10,000	－	112,558.82	－	－	－	100
1期(2017年1月25日)	10,065	0.7	115,671.31	2.8	－	99.3	917
2期(2018年1月25日)	10,205	1.4	118,414.40	2.4	－	99.7	7,034
3期(2019年1月25日)	10,313	1.1	121,176.83	2.3	－	99.8	11,593
4期(2020年1月27日)	12,154	17.9	144,187.15	19.0	－	99.7	24,980

（注）設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
（注）設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
（注）「Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み）をもとに委託会社が円換算して計算したものです。Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み）は、Ｓ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するＳ＆Ｐグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託（ＲＥＩＴ）および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はＳ＆Ｐダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		S＆P先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）		株式組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2019年1月25日	10,313	－	121,176.83	－	－	99.8
1月末	10,677	3.5	125,279.31	3.4	－	99.7
2月末	10,931	6.0	128,472.03	6.0	－	99.6
3月末	11,331	9.9	133,215.20	9.9	－	99.3
4月末	11,296	9.5	132,848.94	9.6	－	99.6
5月末	10,980	6.5	129,142.44	6.6	－	99.4
6月末	11,006	6.7	129,636.53	7.0	－	99.3
7月末	11,281	9.4	132,945.01	9.7	－	99.6
8月末	11,193	8.5	132,025.50	9.0	－	99.5
9月末	11,638	12.8	137,663.18	13.6	－	99.6
10月末	12,031	16.7	142,261.33	17.4	0.0	99.8
11月末	11,988	16.2	141,938.55	17.1	－	99.6
12月末	11,855	15.0	140,439.63	15.9	－	99.6
（期末）						
2020年1月27日	12,154	17.9	144,187.15	19.0	－	99.7

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2019年１月26日～2020年１月27日）

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,313円から当期末12,154円となり、1,841円の値上がりとなりました。

先進国リートの市況（Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））の上昇により、基準価額は上昇しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国のリート価格が上昇したことが寄与しました。

基準価額等の推移

（2019年1月26日～2020年1月27日）

（注）ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

先進国リート市況

先進国リート市場は、前期末と比較して上昇しました。期の前半は、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）が利上げの一時停止の可能性を示唆したことなどを受け上昇しましたが、米中貿易摩擦問題が再燃すると不安定な動きとなりました。期の後半は、世界的な金利低下を背景に投資資金の流入が続きましたが、金利が上昇に転じると、先進国リート市場は軟調な動きとなりました。期末にかけては、投資家のリスク回避姿勢が和らぎ上昇基調となりました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して横ばいで推移し、ユーロなど主要通貨に対して上昇しました。

米ドルに対しては、期の前半は世界景気の減速懸念や米中対立に対する過度な警戒感が緩和され円安基調となりましたが、ＦＲＢの金融緩和観測が広がるにつれ米ドルは売られ円高が進行しました。期の後半は、米国の緩和的な金融政策が当面据え置かれるとの見方を背景に過度な円高圧力は緩和され、期末にかけては緩やかに円安が進行しました。

ユーロに対しては、欧州の低調な経済指標やイギリスのＥＵ（欧州連合）離脱問題等を背景に、期を通じて円高傾向で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

日本を除く先進国の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（国別構成比、用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

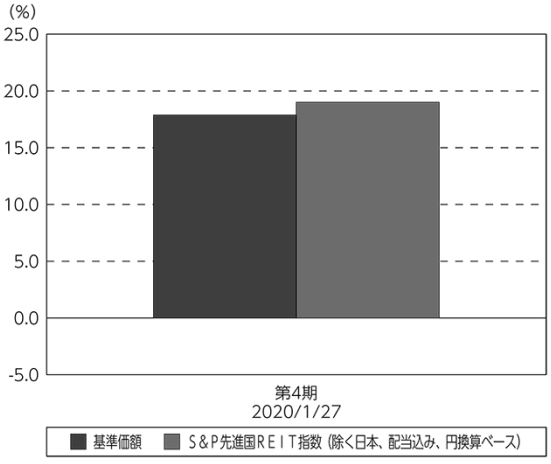
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋17.9%となり、ベンチマークの＋19.0%を1.1%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）
・コスト負担（リート等に係る保管費用や取引費用などのコスト）が生じたこと

（その他の要因）
・ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



○今後の運用方針

引き続き、主としてＳ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）に採用されている不動産投資信託証券および不動産関連株式に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、原則として、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いません。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	10	0.084	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(10)	(0.084)	
(b) 有価証券取引税	4	0.039	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(4)	(0.039)	
(c) その他費用	7	0.064	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(8)	(0.071)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(△ 1)	(△0.007)	その他は、権利・配当にかかる税金及びその払戻し、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	21	0.187	
期中の平均基準価額は、11,350円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注) 各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千米ドル	百株	千米ドル
外国	アメリカ	－ (25)	－ (13)	25	8

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) ( )内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分です。

投資信託証券

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ACADIA REALTY TRUST	7,505	208	1,200	34
	AGREE REALTY CORP	4,505	320	853	59
	ALEXANDER'S INC	232	82	257	89
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,210	2,023	2,985	435
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	4,695	219	－	－
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,634	602	3,230	152
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	12,100	165	－	－
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	24,625	625	7,067	172
	AMERICOLD REALTY TRUST	29,965	1,012	4,048	142
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	－ (△ 437)	－ (－)	310	15
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	14,667	763	4,221	215
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	17,647	283	3,398	55
外	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3,500	9	－ (－)	－ (0.466)
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,642	2,880	3,563	733
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,200	14	－	－
	BOSTON PROPERTIES INC	14,859	1,974	5,636	735
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	2,200	20	－ (－)	－ (0.283)
	BRANDYWINE REALTY TRUST	14,333	214	2,590	37
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,691	624	11,079	209
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	15,013	297	4,889	93
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,550	11	－	－
	CAMDEN PROPERTY TRUST	9,269	1,004	2,201	232
	CARETRUST REIT INC	8,824	205	1,512	35
	CEDAR REALTY TRUST INC	8,000	27	－	－
国	CHATHAM LODGING TRUST	3,239	59	－	－
	CHESAPEAKE LODGING TRUST	697	19	－ (6,568)	－ (177)
	CITY OFFICE REIT INC	6,831	89	－	－
	COLONY CAPITAL INC	38,046	200	7,121	39
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	9,971	210	1,300	27
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	1,740	78	－	－
	CORESITE REALTY CORP	3,285	378	519	59
	CORECIVIC INC	9,789	167	2,300	38
	COREPOINT LODGING INC	6,500	69	－	－
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	9,832	284	1,630	46
	COUSINS PROPERTIES INC	4,765 (△ 31,392)	44 (－)	2,824	27
	COUSINS PROPERTIES INC	12,713 (4,017)	481 (119)	2,410	86

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	CUBESMART	17,422	584	3,454	117
	CYRUSONE INC	12,359	837	3,425	230
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	16,315	166	4,336	45
	DIGITAL REALTY TRUST INC	20,128	2,485	5,295	642
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	— (37,686)	— (410)	—	—
	DOUGLAS EMMETT INC	15,463	652	3,925	161
	DUKE REALTY CORP	34,845	1,166	7,925	256
	EPR PROPERTIES	7,635	576	1,559	118
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	8,895	192	1,800	37
	EASTGROUP PROPERTIES INC	3,675	463	713	85
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	12,135	172	1,100	14
	EQUINIX INC	14,610	8,500	490	282
	EQUITY COMMONWEALTH	9,834	321	1,612	53
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,019 (11,910)	1,163 (—)	2,030	253
	EQUITY RESIDENTIAL	34,531	2,860	11,935	969
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	13,145	302	1,497	30
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,433	2,006	1,745	532
	EXTRA SPACE STORAGE INC	13,408	1,484	3,897	422
	FARMLAND PARTNERS INC	1,939	12	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,362	978	2,818	376
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	12,390	489	3,334	128
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	5,428	153	530	14
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	8,094	68	2,300	19
	FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	3,200	36	—	—
	GEO GROUP INC/THE	10,109	170	830	14
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	19,495	774	5,051	194
	GETTY REALTY CORP	2,877	92	—	—
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,222	50	750	17
	GLADSTONE LAND CORP	1,450	17	—	—
	GLOBAL NET LEASE INC	8,176	159	1,000	19
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,477	54	—	—
	HCP INC	35,583	1,227	11,980	398
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	12,535	415	2,158	70
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	19,548	572	5,380	153
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	13,690	466	—	—
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,600	21	—	—
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	10,168	461	2,609	117
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	6,395	162	1,900	50
	HOST HOTELS & RESORTS INC	71,549	1,251	23,741	418
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	15,525	537	5,104	172
	INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	5,973	83	—	—
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	3,930	82	—	—

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	INFRAREIT INC	－	－	3,911	82
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,090	101	－	－
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	580	42	－	－
	INVITATION HOMES INC	70,764	2,034	9,221	249
	IRON MOUNTAIN INC	28,745	937	7,864	263
	JBG SMITH PROPERTIES	12,431	497	2,761	109
	KILROY REALTY CORP	10,362	818	3,836	295
	KIMCO REALTY CORP	40,463	800	11,032	211
	KITE REALTY GROUP TRUST	6,743	117	750	14
	LTC PROPERTIES INC	2,793	133	－	－
	LEXINGTON REALTY TRUST	22,325	234	－	－
	LIBERTY PROPERTY TRUST	15,283	821	3,077	155
	LIFE STORAGE INC	4,242	441	1,056	107
	MACERICH CO/THE	9,673	296	1,254	51
	MACK-CALI REALTY CORP	6,636	145	900	19
	MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	－	－	－	－
				(3,150)	(34)
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	61,203	1,199	9,340	174
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,513	1,454	3,279	384
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	7,111	102	－	－
	NATL HEALTH INVESTORS INC	3,884	318	739	59
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,921	873	2,808	154
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5,316	175	880	27
	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5,877	35	－	－
	NEXPOINT RESIDENTIAL	1,889	83	－	－
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	900	14	5,745	97
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	3,711	110	620	18
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	21,827	891	5,234	205
		(740)	(28)		
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	800	21	－	－
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,979	344	438	74
	PARAMOUNT GROUP INC	18,045	245	3,661	48
	PARK HOTELS & RESORTS INC	21,362	539	5,161	138
		(4,124)	(104)		
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	12,017	331	2,960	83
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,500	14	－	－
	PHYSICIANS REALTY TRUST	16,209	290	3,484	61
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	11,265	236	2,337	47
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	40	－	－
	PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3,836	53	－	－
	PROLOGIS INC	60,632	5,147	15,686	1,239
	PUBLIC STORAGE	14,340	3,357	3,642	858
	QTS REALTY TRUST INC-CL A	5,610	283	730	35
	RLJ LODGING TRUST	14,902	255	3,229	55

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	RPT REALTY	6,344	88	－	－
	REALTY INCOME CORP	32,862	2,454	6,969	514
	REGENCY CENTERS CORP	16,474	1,091	5,014	333
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	9,620	170	400	7
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	17,027	214	2,000	23
	RETAIL VALUE INC	949	34	－	－
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	11,410	498	1,758	73
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,299	441	1,171	95
	SL GREEN REALTY CORP	8,057	683	2,439	203
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	20,634	447	4,690	99
	SAFEHOLD INC	1,050	35	－	－
	SAUL CENTERS INC	676	37	－	－
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	16,772	146	1,694 (37,686)	20 (422)
外	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,183	134	－	－
	SERVICE PROPERTIES TRUST	7,950	195	1,500	37
	SIMON PROPERTY GROUP INC	29,632	4,579	8,040	1,306
	SITE CENTERS CORP	11,926	174	1,600	23
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	9,778	469	1,175	51
	SPIRIT MTA REIT	1,400	11	4,253	36
	STAG INDUSTRIAL INC	16,874	519	2,265	67
	STORE CAPITAL CORP	21,396	786	4,161	146
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,427	113	1,400	16
	SUN COMMUNITIES INC	9,314	1,355	2,022	275
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	19,678	269	4,283	59
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	8,502	134	1,000	14
	TAUBMAN CENTERS INC	6,013	224	1,092	50
	TERRENO REALTY CORP	6,876	355	1,274	60
国	TIER REIT INC	257 (△ 5,392)	7 (△ 119)	－	－
	UDR INC	27,839	1,321	5,280	244
	UMH PROPERTIES INC	2,200	31	－	－
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	881	96	－	－
	URBAN EDGE PROPERTIES	9,780	188	2,300	45
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,250	54	－	－
	VENTAS INC	37,010	2,476	9,290	637
	VEREIT INC	108,085	1,023	24,436	223
	VICI PROPERTIES INC	49,038	1,135	6,853	149
	VORNADO REALTY TRUST	16,126	1,047	6,525	415
	WP CAREY INC	18,964	1,606	5,416	451
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	16,299	62	－	－
	WASHINGTON REIT	6,081	172	590	15
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	11,551	337	2,591	74
	WELLTOWER INC	41,335	3,534	9,587	811

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	WHITESTONE REIT	2,222	30	－	－
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	10,422	220	1,790	37
	EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	45	－	－
	PRIME US REIT	57,000	55	－	－
	ARA US HOSPITALITY TRUST	92,000	80	－	－
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	162,600 (－)	149 (△ 3)	47,500	42
	小計	2,532,783 (21,256)	101,146 (539)	501,359 (47,404)	22,181 (635)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	－	－	1,620	23
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,490	386	2,248	113
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	4,200	50	－	－
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,338	103	670	28
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,498	136	4,209	63
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,420	447	1,462	78
	CHOICE PROPERTIES REIT	16,900	239	3,856	55
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	5,600	75	－	－
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	2,945	45	－	－
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,576	72	－	－
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	7,681	98	－	－
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	7,743	114	15,968	262
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,100	374	－	－
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,845	119	－	－
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	14,987	335	5,376	123
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,490	101	1,243	18
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,700	53	－	－
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,626	58	700	15
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	1,100	21	476	8
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,491	101	750	21
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	6,237	74	－	－
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,200	430	4,938	129
	SLATE OFFICE REIT	2,600	15	－	－
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	9,089	295	3,550	117
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11,540	144	2,999	39
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,800	19	－	－
	小計	175,196	3,916	50,065	1,100
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	HAMBORNER REIT AG	5,971	56	2,000	18
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	15,276 (－)	237 (△ 7)	4,769	69
	小計	21,247 (－)	294 (△ 7)	6,769	88

銘柄			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ		口	千ユーロ	口	千ユーロ
	イタリア					
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,000 (－)	23 (△ 0.062)	－ (－)	－ (0)
		小計	4,000 (－)	23 (△ 0.062)	－ (－)	－ (0)
	フランス					
		ICADE	3,105	258	2,842	227
		ALTAREA	220 (－)	42 (△ 4)	－	－
		KLEPIERRE	20,103	624	5,787	172
		GECINA SA	5,498	800	1,701	232
		COVIVIO	5,486	534	3,958	374
		MERCIALYS	2,655	31	3,700	44
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13,702	1,857	3,901	533
		小計	50,769 (－)	4,150 (△ 4)	21,889	1,585
	オランダ					
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	4,000	100	966	23
		VASTNED RETAIL NV	1,500	40	－	－
		WERELDHAVE NV	4,038	79	650	12
		NSI NV	1,887	76	554	21
		小計	11,425	297	2,170	57
	スペイン					
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	24,268 (－)	261 (△ 3)	10,178	105
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	7,433 (－)	58 (△ 0.532)	4,078	31
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	31,700 (－)	398 (△ 3)	5,960 (－)	73 (0)
		小計	63,401 (－)	718 (△ 7)	20,216 (－)	209 (0)
	ベルギー					
		BEFIMMO	2,126	115	350	19
		COFINIMMO	2,636	333	472	57
		RETAIL ESTATES	1,353	115	257	20
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,570	41	530	13
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,778 (17,556)	283 (－)	520	79
		MONTEA	2,060	157	562 (－)	40 (0.558)
		AEDIFICA	2,923	291	587 (－)	57 (5)
		(Right)MONTEA-RTS	－ (476)	－ (0.558)	476	0.233

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	ベルギー				
	(Right)AEDIFICA SA-RTS	－ (1,782)	－ (5)	1,782	－
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,000	24	－	－
	小計	15,446 (19,814)	1,362 (6)	5,536 (－)	289 (6)
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	43,988	80	101,496	193
	HIBERNIA REIT PLC	70,000	99	17,021	23
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	33,490	59	－	－
	小計	147,478	240	118,517	217
	ユーロ計	313,766 (19,814)	7,087 (△ 13)	175,097 (－)	2,447 (6)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	93,696	540	30,941	172
	CAPITAL & REGIONAL PLC	－ (△ 41,580)	－ (－)	－	－
	DERWENT LONDON PLC	11,270	384	4,357	137
	BIG YELLOW GROUP PLC	13,132	143	2,700	27
	HAMMERSON PLC	81,831	235	27,161	79
	INTU PROPERTIES PLC	36,894	17	－	－
	UNITE GROUP PLC	39,525	450	5,223	52
	SHAFTESBURY PLC	21,895	195	5,736	49
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	47,440	26	－	－
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	87,000	79	－	－
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	19,000	18	－	－
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	85,000	73	－	－
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	22,604	157	7,804	48
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	86,391	186	16,400	34
	SEGRO PLC	117,144	926	31,073	224
	WORKSPACE GROUP PLC	12,000	124	2,193	20
	RDI REIT PLC	－ (△ 103,127)	－ (－)	－	－
	NEWRIVER REIT PLC	32,190	65	5,148	12
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	34,000	29	－	－
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	30,000	29	－	－
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	24,405	181	10,236	72
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	180,128	266	41,934	61
	RDI REIT PLC	15,000	19	－	－
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	53,720	51	－	－
	ASSURA PLC	220,505	160	42,800	31
	AEW UK REIT PLC	20,000	18	－	－
	LXI REIT PLC	58,000	76	－	－
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	161,617	227	23,996	32

外国

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	イギリス	口	千英ポンド	口	千英ポンド
	REGIONAL REIT LTD	42,160	44	－	－
	LAND SECURITIES GROUP PLC	72,170	638	19,885	168
	小計	1,718,717 (△ 144,707)	5,370 (－)	277,587	1,225
	オーストラリア		千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	BWP TRUST	35,173	142	－	－
	MIRVAC GROUP	416,731	1,294	118,046	352
	CROMWELL PROPERTY GROUP	158,820	194	15,000	18
	CHARTER HALL RETAIL REIT	30,010	131	8,200	36
	GPT GROUP	203,601	1,240	51,845	318
	ABACUS PROPERTY GROUP	32,000	124	－	－
	STOCKLAND	248,560	1,119	79,206	334
	DEXUS	115,617	1,432	31,156	388
	GOODMAN GROUP	156,528	2,202	41,197	563
	CHARTER HALL GROUP	48,576	558	14,824	158
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	16,719	72	－	－
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	24,500	107	－	－
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	71,900	190	9,671	24
	ARENA REIT	19,176	54	－	－
	PROPERTYLINK GROUP	－	－	37,600	43
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	58,215	319	4,400	25
	NATIONAL STORAGE REIT	98,921	179	21,207	37
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	8,500	27	－	－
	GDI PROPERTY GROUP	26,000	40	－	－
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	19,080	68	－	－
	APN INDUSTRIA REIT	6,129	18	－	－
	RURAL FUNDS GROUP	31,000	61	－	－
	SCENTRE GROUP	531,624	2,087	146,840	584
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	64,500	196	－	－
	VICINITY CENTRES	301,720	778	75,059	192
	VIVA ENERGY REIT	36,971	104	10,000	29
	小計	2,760,571	12,746	664,251	3,107
	ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	87,716	160	17,000	30
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	25,000	65	－	－
	GOODMAN PROPERTY TRUST	106,844	227	13,000	28
	ARGOSY PROPERTY LTD	57,134	80	19,490	24
	STRIDE STAPLED GROUP	17,000	34	39,111	87
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	172,000	274	39,241	61
	小計	465,694	841	127,842	232
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	195,300	16,843	50,500	4,487
	PROSPERITY REIT	84,000	266	－	－
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	155,000	819	10,000	51

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	CHAMPION REIT	141,000	762	24,000	160
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	72,000	381	－	－
	FORTUNE REIT	133,000	1,264	44,000	441
	小計	780,300	20,337	128,500	5,141
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	289,200	738	86,000	216
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	316,700 (－)	953 (△ 6)	71,700 (－)	216 (14)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	279,900	573	59,500	116
	SUNTEC REIT	221,000 (－)	417 (△ 2)	57,900 (－)	109 (0)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	276,000 (－)	457 (△ 5)	－ (－)	－ (0)
	STARHILL GLOBAL REIT	100,000 (－)	75 (△ 0.794)	26,000	19
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	95,000 (－)	127 (△ 3)	16,000 (200,800)	19 (244)
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	45,800 (－)	75 (△ 1)	－ (－)	－ (0)
	KEPPEL REIT	171,700	212	38,300	48
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	80,100	217	11,000	30
	ESR REIT	159,000	84	－	－
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	87,300 (－)	142 (△ 1)	24,800	39
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	69,700 (－)	106 (△ 3)	11,000	16
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	45,100 (－)	45 (△ 1)	－	－
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	21,100 (－)	68 (△ 0.954)	－	－
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	200,800 (－)	45 (△ 1)	－	－
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	159,800 (－)	387 (△ 0.302)	21,200	45
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	218,100	488	51,700	103
	CACHE LOGISTICS TRUST	99,000 (－)	72 (△ 0.151)	26,400	20
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	31,000 (－)	44 (△ 0.116)	13,000 (－)	18 (0)
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	99,000	44	－	－
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	219,400 (－)	279 (△ 7)	64,100 (－)	85 (0)
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	73,200 (－)	75 (△ 1)	－ (128,300)	－ (119)

外国

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	104,100	72	38,000	25
	SPH REIT	78,100	85	－	－
	OUE HOSPITALITY TRUST	35,000	25	－	－
				(121,700)	(85)
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	35,000	18	－	－
		(－)	(△ 0.072)	(－)	(0)
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	89,500	74	－	－
	ASCOTT TRUST	－	－	－	－
		(302,696)	(357)		
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	445,200	240	165,305	85
		(165,305)	(80)		
	(Right)ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	－	－	57,120	13
		(57,120)	(14)		
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	70,300	50	－	－
		(－)	(△ 2)	(－)	(0)
	KEPPEL DC REIT	136,000	263	19,700	30
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	152,000	188	34,500	42
		(－)	(△ 3)		
	小計	4,503,100	6,754	893,225	1,304
		(525,121)	(407)	(450,800)	(463)
	イスラエル		千イスラエルシュケル		千イスラエルシュケル
	REIT 1 LTD	15,000	309	－	－
	小計	15,000	309	－	－

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) ( )内は分割・合併・増資等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○株式売買比率

(2019年１月26日～2020年１月27日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	950千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	61千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	15.44

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。
(注) 外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年１月27日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	7,795	14,100	366	40,012	0.2
AGREE REALTY CORP	3,296	6,948	518	56,581	0.2
ALEXANDER'S INC	354	329	111	12,205	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,153	20,378	3,355	365,944	1.5
AMERICAN ASSETS TRUST INC	3,623	8,318	397	43,307	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	12,995	22,399	1,050	114,568	0.5
AMERICAN FINANCE TRUST INC	5,269	17,369	229	25,061	0.1
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	24,426	41,984	1,149	125,321	0.5
AMERICOLD REALTY TRUST	5,672	31,589	1,113	121,439	0.5
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	14,743	－	－	－	－
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	－	24,885	1,344	146,608	0.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	20,575	34,824	539	58,829	0.2
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,194	11,694	30	3,328	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,101	23,180	5,084	554,468	2.2
BRT APARTMENTS CORP	877	877	15	1,705	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,220	3,420	41	4,498	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	14,574	23,797	3,379	368,558	1.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	2,809	5,009	41	4,474	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	17,004	28,747	462	50,475	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	28,431	49,043	1,032	112,588	0.5
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	－	10,124	194	21,166	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	12,565	17,115	16	1,754	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,816	15,884	1,763	192,355	0.8
CARETRUST REIT INC	8,037	15,349	335	36,609	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	7,920	15,920	45	4,930	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	4,397	7,636	134	14,665	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	5,871	－	－	－	－
CITY OFFICE REIT INC	3,175	10,006	136	14,928	0.1
CLIPPER REALTY INC	1,350	1,350	14	1,626	0.0
COLONY CAPITAL INC	46,665	77,590	360	39,263	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	11,236	19,907	436	47,589	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	1,743	3,483	159	17,412	0.1
CORESITE REALTY CORP	3,499	6,265	737	80,433	0.3
CORECIVIC INC	11,380	18,869	306	33,398	0.1
COREPOINT LODGING INC	－	6,500	61	6,720	0.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	10,363	18,565	556	60,700	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	39,914	－	－	－	－
COUSINS PROPERTIES INC	－	24,783	1,014	110,626	0.4
CUBESMART	17,620	31,588	999	109,033	0.4
CYRUSONE INC	10,047	18,981	1,188	129,627	0.5

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	20,078	32,057	324	35,380	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	19,568	34,401	4,412	481,202	1.9
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	－	37,686	303	33,065	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	15,282	26,820	1,136	123,961	0.5
DUKE REALTY CORP	33,865	60,785	2,194	239,314	1.0
EPR PROPERTIES	7,060	13,136	949	103,563	0.4
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	5,800	12,895	311	33,920	0.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,425	6,387	876	95,547	0.4
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	13,378	24,413	344	37,540	0.2
EQUINIX INC	－	14,120	8,358	911,575	3.6
EQUITY COMMONWEALTH	11,528	19,750	645	70,433	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,493	30,392	2,190	238,912	1.0
EQUITY RESIDENTIAL	34,922	57,518	4,760	519,146	2.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	3,432	15,080	402	43,878	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,240	10,928	3,381	368,828	1.5
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,942	21,453	2,379	259,538	1.0
FARMLAND PARTNERS INC	1,320	3,259	22	2,409	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,984	11,528	1,496	163,202	0.7
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	11,992	21,048	912	99,532	0.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	6,530	11,428	339	37,016	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	10,254	16,048	125	13,651	0.1
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	3,875	7,075	80	8,734	0.0
GEO GROUP INC/THE	11,649	20,928	339	36,975	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	19,073	33,517	1,548	168,841	0.7
GETTY REALTY CORP	3,143	6,020	195	21,350	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,864	4,336	95	10,469	0.0
GLADSTONE LAND CORP	1,113	2,563	34	3,776	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	7,295	14,471	296	32,353	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	2,216	6,693	98	10,781	0.0
HCP INC	45,087	－	－	－	－
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	11,890	22,267	792	86,428	0.3
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	19,601	33,769	1,083	118,219	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	－	82,380	3,048	332,421	1.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	3,693	5,293	70	7,740	0.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	9,810	17,369	871	95,073	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	15,682	－	－	－	－
HOST HOTELS & RESORTS INC	70,209	118,017	2,015	219,835	0.9
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	14,848	25,269	930	101,469	0.4
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	8,733	14,706	218	23,849	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,230	10,160	233	25,496	0.1
INFRAREIT INC	3,911	－	－	－	－
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	972	2,062	166	18,161	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,145	1,725	127	13,861	0.1
INVITATION HOMES INC	28,129	89,672	2,810	306,493	1.2
IRON MOUNTAIN INC	27,024	47,905	1,511	164,833	0.7

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
JBG SMITH PROPERTIES	10,321	19,991	820	89,497	0.4
KILROY REALTY CORP	9,530	16,056	1,322	144,200	0.6
KIMCO REALTY CORP	39,885	69,316	1,410	153,837	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	8,070	14,063	260	28,434	0.1
LTC PROPERTIES INC	3,797	6,590	309	33,743	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	20,100	42,425	462	50,479	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	13,988	26,194	1,698	185,286	0.7
LIFE STORAGE INC	4,411	7,597	868	94,700	0.4
MACERICH CO/THE	10,032	18,451	461	50,306	0.2
MACK-CALI REALTY CORP	8,631	14,367	331	36,116	0.1
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,150	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	34,548	86,411	1,935	211,097	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,763	18,997	2,601	283,755	1.1
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	8,718	15,829	236	25,773	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,014	7,159	615	67,114	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,055	28,168	1,591	173,598	0.7
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5,400	9,836	343	37,491	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	6,318	12,195	95	10,413	0.0
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,025	3,914	189	20,634	0.1
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	4,845	—	—	—	—
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	4,608	7,699	262	28,665	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	18,983	36,316	1,572	171,455	0.7
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,420	2,220	63	6,948	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,900	3,441	587	64,082	0.3
PARAMOUNT GROUP INC	19,407	33,791	479	52,256	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	19,132	39,457	927	101,124	0.4
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	12,219	21,276	523	57,080	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	5,885	8,385	37	4,124	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	17,339	30,064	588	64,165	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12,231	21,159	490	53,513	0.2
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	—	2,100	39	4,271	0.0
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4,092	7,928	104	11,421	0.0
PROLOGIS INC	59,659	104,605	10,057	1,096,900	4.4
PUBLIC STORAGE	14,233	24,931	5,596	610,328	2.4
QTS REALTY TRUST INC-CL A	4,903	9,783	559	61,039	0.2
RLJ LODGING TRUST	16,776	28,449	462	50,387	0.2
RPT REALTY	7,485	13,829	205	22,396	0.1
REALTY INCOME CORP	27,856	53,749	4,145	452,125	1.8
REGENCY CENTERS CORP	16,015	27,475	1,752	191,126	0.8
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	10,912	20,132	353	38,499	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	20,546	35,573	466	50,822	0.2
RETAIL VALUE INC	1,405	2,471	86	9,388	0.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	8,831	18,483	897	97,844	0.4
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	4,901	9,029	778	84,940	0.3
SL GREEN REALTY CORP	8,063	13,681	1,277	139,297	0.6

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
SABRA HEALTH CARE REIT INC	16,940	32,884	729	79,580	0.3
SAFEHOLD INC	－	1,750	79	8,638	0.0
SAFETY INCOME & GROWTH INC	700	－	－	－	－
SAUL CENTERS INC	1,066	1,742	98	10,694	0.0
SENIOR HOUSING PROP TRUST	22,608	－	－	－	－
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	2,601	5,784	230	25,143	0.1
SERVICE PROPERTIES TRUST	－	26,627	614	66,964	0.3
SIMON PROPERTY GROUP INC	29,299	50,891	7,370	803,775	3.2
SITE CENTERS CORP	13,977	24,303	327	35,702	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	8,155	16,758	869	94,780	0.4
SPIRIT MTA REIT	2,853	－	－	－	－
STAG INDUSTRIAL INC	10,365	24,974	822	89,690	0.4
STORE CAPITAL CORP	17,936	35,171	1,352	147,484	0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	9,908	17,935	209	22,826	0.1
SUN COMMUNITIES INC	8,172	15,464	2,444	266,568	1.1
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	21,856	37,251	488	53,301	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	8,979	16,481	255	27,913	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	5,812	10,733	333	36,345	0.1
TERRENO REALTY CORP	5,646	11,248	643	70,155	0.3
TIER REIT INC	5,135	－	－	－	－
UDR INC	26,052	48,611	2,342	255,427	1.0
UMH PROPERTIES INC	3,342	5,542	91	9,930	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,232	2,113	261	28,475	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	10,919	18,399	359	39,248	0.2
URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,951	5,201	124	13,613	0.1
VENTAS INC	33,798	61,518	3,619	394,699	1.6
VEREIT INC	91,504	175,153	1,698	185,291	0.7
VICI PROPERTIES INC	34,126	76,311	2,033	221,794	0.9
VORNADO REALTY TRUST	16,355	25,956	1,747	190,538	0.8
WP CAREY INC	15,215	28,763	2,425	264,565	1.1
WASHINGTON PRIME GROUP INC	17,374	33,673	113	12,339	0.0
WASHINGTON REIT	7,630	13,121	403	43,959	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	11,352	20,312	623	68,029	0.3
WELLTOWER INC	35,611	67,359	5,856	638,749	2.6
WHITESTONE REIT	3,672	5,894	80	8,832	0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC	10,874	19,506	384	41,908	0.2
EAGLE HOSPITALITY TRUST	－	82,000	43	4,739	0.0
PRIME US REIT	－	57,000	56	6,154	0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST	－	92,000	79	8,678	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	120,800	235,900	240	26,241	0.1
小計 口数・金額	2,128,211	4,134,047	168,486	18,375,088	
小計 銘柄数＜比率＞	157	158	－	＜73.6%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	1,620	－	－	－	－
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	4,984	10,226	564	46,834	0.2

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		6,199	10,399	125	10,418	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		2,176	3,844	184	15,328	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		3,296	8,585	140	11,677	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		6,932	13,890	790	65,527	0.3
CHOICE PROPERTIES REIT		13,583	26,627	394	32,684	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		9,139	14,739	216	17,921	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		3,460	6,405	103	8,584	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		2,242	4,818	157	13,079	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		3,400	11,081	156	12,958	0.1
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV		8,225	—	—	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	18,100	394	32,726	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		2,269	4,114	293	24,325	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		13,593	23,204	507	42,051	0.2
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		5,648	10,895	183	15,244	0.1
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		4,549	7,249	146	12,162	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		759	2,685	66	5,545	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT		2,123	2,747	52	4,342	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST		2,392	5,133	160	13,287	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		4,988	11,225	137	11,395	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		14,543	25,805	708	58,750	0.2
SLATE OFFICE REIT		1,569	4,169	24	2,043	0.0
SLATE RETAIL REIT - U		2,120	2,120	28	2,375	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		6,480	12,019	386	32,068	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		3,300	11,841	150	12,462	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		2,000	4,800	36	3,021	0.0
小計	口数・金額	131,589	256,720	6,110	506,819	
	銘柄数<比率>	26	25	—	<2.0%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		7,124	11,095	112	13,534	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		15,266	25,773	455	54,754	0.2
小計	口数・金額	22,390	36,868	567	68,288	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		3,320	7,320	45	5,477	0.0
小計	口数・金額	3,320	7,320	45	5,477	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		4,307	4,570	454	54,674	0.2
ALTAREA		359	579	121	14,557	0.1
KLEPIERRE		19,709	34,025	1,110	133,561	0.5
GECINA SA		5,202	8,999	1,523	183,280	0.7
COVIVIO		5,934	7,462	805	96,949	0.4
MERCIALYS		4,526	3,481	40	4,907	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		口	口	千ユーロ	千円	%
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		13,000	22,801	3,009	362,070	1.4
小計	口数・金額	53,037	81,917	7,065	850,002	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<3.4%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		3,966	7,000	168	20,227	0.1
VASTNED RETAIL NV		1,677	3,177	78	9,421	0.0
WERELDHAVE NV		3,924	7,312	133	16,018	0.1
NSI NV		1,662	2,995	135	16,339	0.1
小計	口数・金額	11,229	20,484	515	62,005	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.2%>	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		26,436	40,526	487	58,649	0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		6,269	9,624	65	7,930	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		34,986	60,726	790	95,115	0.4
小計	口数・金額	67,691	110,876	1,344	161,695	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.6%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		1,968	3,744	203	24,501	0.1
COFINIMMO		2,037	4,201	589	70,955	0.3
RETAIL ESTATES		782	1,878	159	19,158	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		2,271	3,311	88	10,674	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		1,668	—	—	—	—
MONTEA		476	1,974	167	20,137	0.1
AEDIFICA		1,797	4,133	505	60,757	0.2
WAREHOUSES DE PAUW SCA		—	21,482	538	64,736	0.3
小計	口数・金額	10,999	40,723	2,252	270,922	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<1.1%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		57,508	—	—	—	—
HIBERNIA REIT PLC		70,710	123,689	175	21,069	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		33,867	67,357	112	13,532	0.1
小計	口数・金額	162,085	191,046	287	34,601	
	銘柄数<比率>	3	2	—	<0.1%>	
ユーロ計	口数・金額	330,751	489,234	12,078	1,452,994	
	銘柄数<比率>	27	26	—	<5.8%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		92,427	155,182	915	130,522	0.5
CAPITAL & REGIONAL PLC		46,200	—	—	—	—
DERWENT LONDON PLC		10,527	17,440	723	103,043	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC		14,982	25,414	299	42,736	0.2
HAMMERSON PLC		73,384	128,054	333	47,575	0.2
INTU PROPERTIES PLC		80,655	117,549	22	3,165	0.0
UNITE GROUP PLC		25,175	59,477	776	110,612	0.4
SHAFTESBURY PLC		22,057	38,216	356	50,839	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		39,200	86,640	47	6,803	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		口	口	千英ポンド	千円	%
PICTON PROPERTY INCOME LTD		—	87,000	87	12,522	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC		42,038	61,038	71	10,125	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		66,619	151,619	132	18,927	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		20,558	35,358	282	40,260	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		66,698	136,689	313	44,686	0.2
SEGRO PLC		95,554	181,625	1,663	237,039	0.9
WORKSPACE GROUP PLC		12,504	22,311	278	39,648	0.2
RDI REIT PLC		128,909	—	—	—	—
NEWRIVER REIT PLC		26,624	53,666	103	14,714	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		61,927	95,927	94	13,465	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		33,121	63,121	62	8,959	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		26,899	41,068	389	55,517	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC		140,851	279,045	399	56,866	0.2
RDI REIT PLC		—	40,782	54	7,752	0.0
CAPITAL & REGIONAL PLC		—	4,620	10	1,560	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		48,126	101,846	102	14,630	0.1
ASSURA PLC		228,810	406,515	319	45,476	0.2
AEW UK REIT PLC		—	20,000	19	2,815	0.0
LXI REIT PLC		35,342	93,342	127	18,117	0.1
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		73,192	210,813	334	47,708	0.2
REGIONAL REIT LTD		21,400	63,560	73	10,489	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		71,100	123,385	1,196	170,560	0.7
小計	口数・金額	1,604,879	2,901,302	9,593	1,367,145	
	銘柄数<比率>	27	29	—	<5.5%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST		47,352	82,525	337	25,078	0.1
MIRVAC GROUP		351,866	650,551	2,263	168,209	0.7
CROMWELL PROPERTY GROUP		161,093	304,913	373	27,752	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		32,401	54,211	253	18,810	0.1
GPT GROUP		170,251	322,007	1,915	142,354	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP		32,226	64,226	245	18,276	0.1
STOCKLAND		231,071	400,425	2,014	149,650	0.6
DEXUS		95,641	180,102	2,281	169,544	0.7
GOODMAN GROUP		151,582	266,913	4,009	297,871	1.2
CHARTER HALL GROUP		44,436	78,188	986	73,314	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		26,685	43,404	187	13,963	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP		19,077	43,577	205	15,282	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		85,748	147,977	421	31,334	0.1
ARENA REIT		23,166	42,342	129	9,595	0.0
PROPERTYLINK GROUP		37,600	—	—	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT		17,790	71,605	403	30,006	0.1
INDUSTRIA REIT		5,250	—	—	—	—
NATIONAL STORAGE REIT		55,757	133,471	288	21,420	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		14,520	23,020	76	5,695	0.0
GDI PROPERTY GROUP		52,244	78,244	120	8,923	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千オーストラリアドル	千円	%
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		17,600	36,680	129	9,647	0.0
APN INDUSTRIA REIT		—	11,379	34	2,544	0.0
RURAL FUNDS GROUP		29,734	60,734	116	8,641	0.0
SCENTRE GROUP		503,368	888,152	3,481	258,679	1.0
CENTURIA METROPOLITAN REIT		—	64,500	192	14,329	0.1
VICINITY CENTRES		305,333	531,994	1,361	101,189	0.4
VIVA ENERGY REIT		43,952	70,923	190	14,175	0.1
小計	口数・金額	2,555,743	4,652,063	22,022	1,636,291	
	銘柄数<比率>	25	25	—	<6.6%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		105,398	176,114	333	23,968	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		26,700	51,700	146	10,526	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		91,245	185,089	429	30,839	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		90,106	127,750	183	13,212	0.1
STRIDE STAPLED GROUP		22,111	—	—	—	—
KIWI PROPERTY GROUP LTD		145,255	278,014	439	31,547	0.1
小計	口数・金額	480,815	818,667	1,532	110,095	
	銘柄数<比率>	6	5	—	<0.4%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		200,900	345,700	28,209	395,773	1.6
PROSPERITY REIT		96,000	180,000	547	7,677	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		114,000	259,000	1,364	19,149	0.1
CHAMPION REIT		194,000	311,000	1,536	21,554	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		103,000	175,000	890	12,497	0.1
FORTUNE REIT		136,000	225,000	2,067	29,010	0.1
小計	口数・金額	843,900	1,495,700	34,616	485,663	
	銘柄数<比率>	6	6	—	<1.9%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		267,200	470,400	1,232	99,335	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		243,000	488,000	1,537	123,898	0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		265,100	485,500	1,038	83,740	0.3
SUNTEC REIT		215,300	378,400	703	56,728	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		225,500	501,500	917	73,970	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		138,500	212,500	155	12,503	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		121,800	—	—	—	—
FRASERS COMMERCIAL TRUST		63,300	109,100	181	14,597	0.1
KEPPEL REIT		176,100	309,500	393	31,681	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		57,700	126,800	361	29,127	0.1
ESR REIT		195,300	354,300	198	15,991	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		78,300	140,800	230	18,611	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		56,100	114,800	187	15,082	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		44,000	89,100	89	7,181	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		39,300	60,400	210	16,941	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		138,000	338,800	76	6,144	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		121,200	259,800	732	59,050	0.2

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		口	口	千シンガポールドル	千円	%
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		181,500	347,900	845	68,138	0.3
CACHE LOGISTICS TRUST		86,400	159,000	115	9,291	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT		52,800	70,800	102	8,274	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		38,400	137,400	63	5,149	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		206,100	361,400	448	36,119	0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		55,100	—	—	—	—
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		83,200	149,300	108	8,724	0.0
SPH REIT		68,600	146,700	159	12,888	0.1
OUE HOSPITALITY TRUST		86,700	—	—	—	—
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		65,900	100,900	51	4,188	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		—	89,500	78	6,311	0.0
ASCOTT TRUST		—	302,696	399	32,204	0.1
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		—	445,200	249	20,094	0.1
FRASERS HOSPITALITY TRUST		58,500	128,800	92	7,422	0.0
KEPPEL DC REIT		95,500	211,800	478	38,580	0.2
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		149,900	267,400	326	26,293	0.1
小計	口数・金額	3,674,300	7,358,496	11,765	948,267	
	銘柄数<比率>	30	30	—	<3.8%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		4,100	4,100	30,791	2,875	0.0
小計	口数・金額	4,100	4,100	30,791	2,875	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(イスラエル)				千イスラエルシュケル		
REIT 1 LTD		14,365	29,365	622	19,644	0.1
小計	口数・金額	14,365	29,365	622	19,644	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
合計	口数・金額	11,768,653	22,139,694	—	24,904,886	
	銘柄数<比率>	306	306	—	<99.7%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
(注) 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○投資信託財産の構成

(2020年１月27日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	24,904,886	98.7
コール・ローン等、その他	319,176	1.3
投資信託財産総額	25,224,062	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。
(注) 当期末における外貨建純資産（24,812,487千円）の投資信託財産総額（25,224,062千円）に対する比率は98.4%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.06円、1カナダドル=82.94円、1ユーロ=120.30円、1英ポンド=142.51円、1オーストラリアドル=74.30円、1ニュージーランドドル=71.82円、1香港ドル=14.03円、1シンガポールドル=80.60円、1韓国ウォン=0.0934円、1イスラエルシュケル=31.54円。

○特定資産の価格等の調査

（2019年１月26日～2020年１月27日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

（2020年１月27日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	25,403,864,855
コール・ローン等	113,669,671
投資証券(評価額)	24,904,886,156
未収入金	345,959,854
未収配当金	39,349,174
(B) 負債	423,014,388
未払金	385,121,221
未払解約金	37,893,000
未払利息	167
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	24,980,850,467
元本	20,554,057,909
次期繰越損益金	4,426,792,558
(D) 受益権総口数	20,554,057,909口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	12,154円

（注）当ファンドの期首元本額は11,241,072,465円、期中追加設定元本額は12,927,922,372円、期中一部解約元本額は3,614,936,928円です。

（注）2020年１月27日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	7,088,880,846円
・ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	3,606,261,847円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,925,038,738円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	1,694,870,173円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,399,700,399円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,104,622,763円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	772,832,258円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	629,745,255円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	606,478,095円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	490,532,590円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	460,611,716円
・つみたてバランスファンド	228,930,835円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	198,853,079円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	129,597,879円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	62,387,528円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	48,542,072円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	42,113,797円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	35,518,615円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	12,927,856円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	8,545,670円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	2,505,192円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,801,239円
・グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,788,384円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	494,721円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	476,362円

（注）当期末の１口当たり純資産額は1.2154円です。

○損益の状況

（2019年１月26日～2020年１月27日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	594,128,064
受取配当金	592,663,215
受取利息	554,878
その他収益金	975,502
支払利息	△　65,531
(B) 有価証券売買損益	2,003,811,147
売買益	2,521,694,496
売買損	△　517,883,349
(C) 保管費用等	△　9,933,232
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	2,588,005,979
(E) 前期繰越損益金	352,172,623
(F) 追加信託差損益金	1,976,796,028
(G) 解約差損益金	△　490,182,072
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	4,426,792,558
次期繰越損益金(Ｈ)	4,426,792,558

（注）損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

（注）損益の状況の中で(F)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

（注）損益の状況の中で(G)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。

ＲＡＭマネーマザーファンド

運 用 報 告 書

第１期（決算日　2020年２月17日）
（2019年１月17日～2020年２月17日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	2019年１月17日から無期限です。
運　用　方　針	主として、残存期間の短い国内の公社債への投資により利息等収益の獲得および流動性の確保を図ります。
主 要 投 資 対 象	国内の公社債を主要投資対象とします。
主 な 投 資 制 限	・株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。

りそなアセットマネジメント株式会社

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		
	円	%	%	百万円
(設定日)				
2019年１月17日	10,000	－	－	590
１期(2020年２月17日)	9,984	△0.2	54.6	15,576

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。
(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
(注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率
		騰落率	
	円	%	%
(設定日)			
2019年１月17日	10,000	－	－
１月末	10,000	0.0	67.8
２月末	9,998	△0.0	67.8
３月末	9,996	△0.0	67.2
４月末	9,995	△0.1	67.5
５月末	9,994	△0.1	67.5
６月末	9,994	△0.1	66.4
７月末	9,992	△0.1	66.4
８月末	9,993	△0.1	66.4
９月末	9,992	△0.1	64.6
10月末	9,989	△0.1	64.6
11月末	9,987	△0.1	58.1
12月末	9,986	△0.1	55.5
2020年１月末	9,985	△0.2	55.2
(期　末)			
2020年２月17日	9,984	△0.2	54.6

(注) 騰落率は設定日比です。

○運用経過

（2019年１月17日～2020年２月17日）

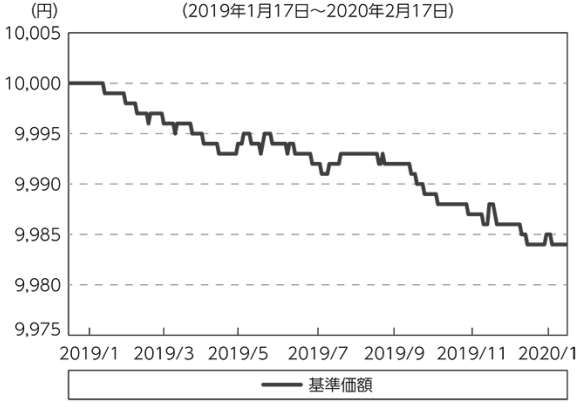
期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は設定時10,000円から当期末9,984円となり、16円の値下がりとなりました。

日銀によるマイナス金利政策の下で残存期間の短い国内の公社債を中心に投資したことが、主な基準価額の下落要因となりました。

基準価額等の推移
（2019年1月17日～2020年2月17日）



投資環境

国内債券市況

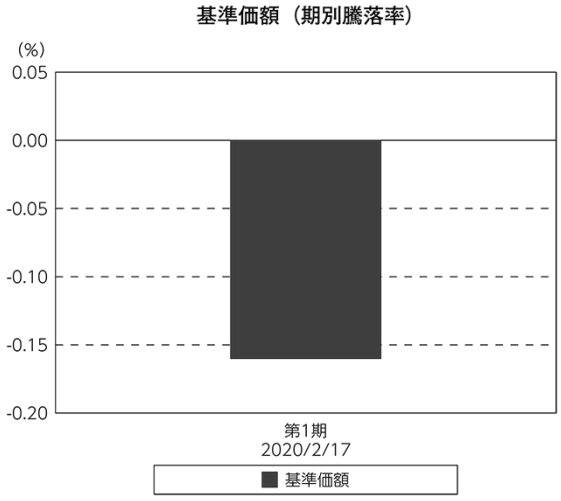
国内長期金利は、設定時と比較して横ばいでした。期の前半は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念から、長期金利は低下（債券価格は上昇）基調となりました。ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による利下げ等を受け、国内長期金利にも一層の低下圧力がかかりましたが、期の後半は世界的な製造業の調整一巡を反映し上昇に転じました。期末にかけては新型肺炎問題の影響が懸念され、投資家のリスク回避の動きから債券が買われる展開となり、国内長期金利は低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の公社債を主要投資対象とし、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して残存期間の短い国内の公社債へ投資することによりポートフォリオを構築しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数は設定しておりません。



○今後の運用方針

引き続き、残存期間の短い国内の公社債へ投資し、利息等収益の獲得および流動性の確保を目指して運用を行います。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月17日～2020年２月17日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	0	0.000	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、9,992円です。			

（注）期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月17日～2020年２月17日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	12,016,030	3,103,524
			(400,000)

（注）金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
（注）（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月17日～2020年２月17日）

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2019年１月17日～2020年２月17日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020年２月17日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	8,500,000	8,509,755	54.6	－	－	－	54.6
	(8,500,000)	(8,509,755)	(54.6)	(－)	(－)	(－)	(54.6)
合計	8,500,000	8,509,755	54.6	－	－	－	54.6
	(8,500,000)	(8,509,755)	(54.6)	(－)	(－)	(－)	(54.6)

（注）（ ）内は非上場債で内書きです。
（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
（注）格付のない債券については、ＢＢ格以下組入比率に含まれておりません。

（B）国内（邦貨建）公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第827回国庫短期証券	－	200,000	200,045	2020/４/20
第864回国庫短期証券	－	200,000	200,208	2020/10/20
第871回国庫短期証券	－	8,100,000	8,109,501	2020/11/20
合計		8,500,000	8,509,755	

○投資信託財産の構成

（2020年２月17日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	8,509,755	54.6
コール・ローン等、その他	7,066,354	45.4
投資信託財産総額	15,576,109	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

（2019年１月17日～2020年２月17日）

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年２月17日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	15,576,109,938
コール・ローン等	7,066,354,638
公社債(評価額)	8,509,755,300
(B) 負債	19,166
未払利息	19,166
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	15,576,090,772
元本	15,600,853,423
次期繰越損益金	△ 24,762,651
(D) 受益権総口数	15,600,853,423口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,984円

(注) 当ファンドの設定時元本額は590,600,000円、期中追加設定元本額は20,830,036,362円、期中一部解約元本額は5,819,782,939円です。

(注) 2020年２月17日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・りそなＤＡＡ先物ファンド（適格機関投資家専用）	14,847,905,697円
・りそなＤＡＡ先物Ⅱファンド（適格機関投資家専用）	704,850,955円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	17,013,611円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	10,012,015円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	10,006,004円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	7,510,515円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	3,000,700円
・りそなマネー・プール・ファンド（適格機関投資家専用）	553,926円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は0.9984円です。

(注) 2020年２月17日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は24,762,651円です。

○損益の状況 (2019年１月17日～2020年２月17日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,622,917
支払利息	△ 1,622,917
(B) 有価証券売買損益	△ 2,751,200
売買損	△ 2,751,200
(C) 保管費用等	△ 13,111
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 4,387,228
(E) 追加信託差損益金	△29,116,362
(F) 解約差損益金	8,740,939
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	△24,762,651
次期繰越損益金(Ｇ)	△24,762,651

(注) 損益の状況の中で(B)**有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) 損益の状況の中で(E)**追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 損益の状況の中で(F)**解約差損益金**とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○お知らせ

該当事項はございません。