りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２
愛称：みつぼしフライト２０１９－１２

運用報告書（全体版）

第２期（決算日　2021年11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２０１９－１２」は、2021年11月15日に第２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12月17日から2029年11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2019-12	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。
	ＲＭ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
	ＲＭ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
	ＲＭ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
	ＲＭ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）
	ＲＭ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）
	ＲＭ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）
	ＲＭ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。）
	ＲＭ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）
	ＲＭ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2019-12	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。
	ＲＭ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。
	ＲＭ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。
	ＲＭ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。
	ＲＭ先進国株式マザーファンド ＲＭ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。
	ＲＭ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。
	ＲＭ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。
	ＲＭ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。
	ＲＭ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12月17日	10,000	－	－	－	－	－	－	－	－	100.0
1期(2020年11月16日)	9,641	0	△359	△3.6	△3.9	5.6	1.1	50.1	1.8	82.6
2期(2021年11月15日)	9,869	0	228	2.4	△0.7	16.9	1.5	75.7	4.9	64.7

(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

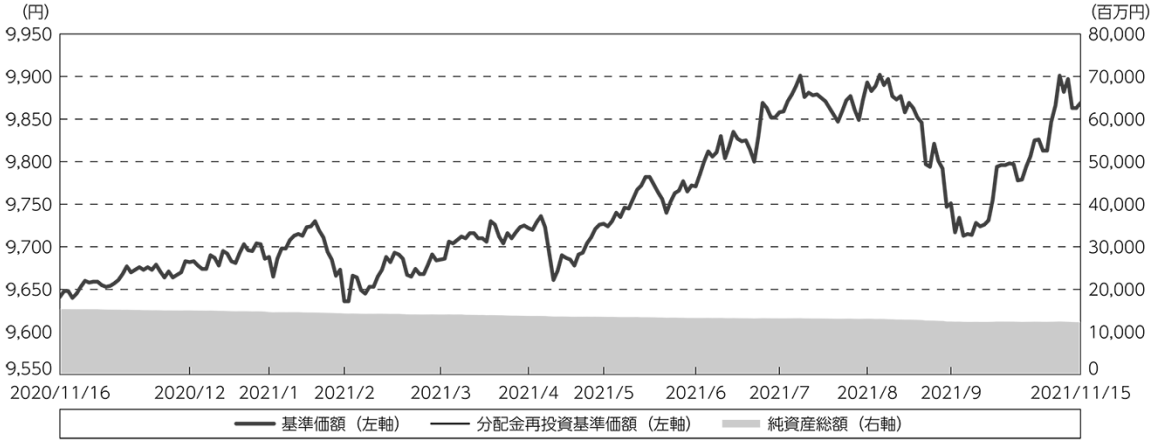
年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率				
(期首)	円	%	%	%	%	%
2020年11月16日	9,641	－	5.6	1.1	50.1	1.8
11月末	9,659	0.2	7.4	1.7	55.9	2.4
12月末	9,682	0.4	8.5	1.3	54.8	2.6
2021年１月末	9,688	0.5	8.9	1.9	56.9	2.9
２月末	9,636	△0.1	8.7	1.7	54.9	2.8
３月末	9,685	0.5	8.6	1.4	55.2	2.6
４月末	9,722	0.8	11.6	1.9	69.8	3.6
５月末	9,727	0.9	8.8	1.3	62.2	2.7
６月末	9,771	1.3	13.7	2.9	70.7	4.4
７月末	9,858	2.3	18.2	1.6	73.5	5.3
８月末	9,893	2.6	16.6	2.0	75.3	5.0
９月末	9,751	1.1	16.9	1.7	76.0	5.0
10月末	9,826	1.9	15.4	1.3	69.7	4.5
(期末) 2021年11月15日	9,869	2.4	16.9	1.5	75.7	4.9

(注) 騰落率は期首比です。
(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

（2020年11月17日～2021年11月15日）

期中の基準価額等の推移



期　首：9,641円
期　末：9,869円（既払分配金(税引前)：0円）
騰落率：　2.4%（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）分配金再投資基準価額は、期首（2020年11月16日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
（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前期末9,641円から当期末9,869円となり、228円の値上がりとなりました。先進国株式が基準価額の主な値上がり要因となった一方、先進国債券（為替ヘッジあり）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当期間の値動きは、先進国債券（為替ヘッジあり）が下落した一方、そのほかのすべての資産は上昇しました。

投資環境

国内債券市況

国内の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。期前半は、大規模な金融支援策が講じられるなか、長期金利は０％近傍での推移が続きました。その後、日銀の政策点検を通じた長期金利変動許容幅の拡大観測の強まりや、主要国金利の上昇を背景に、長期金利は一時0.1%台後半まで上昇する局面が見られました。期後半は、緊急事態宣言の発令・延長の影響から景気回復の遅れが懸念され、金利水準は徐々に切り下がりました。期末にかけて、主要国金利の上昇を受け、国内金利は水準を切り上げる展開となりました。

先進国債券市況

先進国の長期金利は、前期末と比較して上昇しました。期を通して、主要国中銀による低金利政策の長期化観測が主要国金利の上昇抑制要因となりました。期前半は、新型コロナワクチンの接種進展に伴う景気見通しの改善期待から主要国金利は上昇しました。期後半は、世界的に新型コロナワクチン接種ペースの加速がみられる一方、コロナ変異株の感染拡大に伴う景気下振れ懸念などを受けて、主要国金利は低下して始まりました。その後、主要国中銀による金融緩和策の調整を模索する動きや高インフレ環境の長期化懸念等に伴う早期利上げ観測から主要国金利は反転上昇する局面が見られましたが、期末にかけて、上昇幅を縮小しました。

国内株式市況

国内の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半にかけて、新型コロナワクチンの接種進展や、堅調な企業業績が支援材料となり、日経平均株価は約30年ぶりに30,000円台を回復しました。その後、新型コロナワクチン接種ペースの遅れや度重なる緊急事態宣言の発令・延長による景気回復の後ずれ懸念や、日銀による政策総点検後のＥＴＦ購入頻度低下なども響き、国内株式は一進一退の展開となりました。期後半には、菅前首相の次期自民党総裁選の不出馬表明等をきっかけに海外投資家の買いが膨らみ、一時騰勢を強める局面も見られましたが、入荷遅延など企業活動における供給制約長期化やインフレ懸念が残る中、岸田内閣発足や衆議院議員総選挙などを前に市場参加者の様子見姿勢が強まり上値の重い展開が続きました。

先進国株式市況

先進国の株式市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は、各国の大規模な財政・金融政策が支援材料となり、先進国株式は上昇しました。その後、新型コロナワクチン接種ペース加速による景気回復の加速期待などが上昇を後押ししました。期後半は、入荷遅延など企業活動における供給制約や、コロナ変異株の感染拡大に伴う景気下振れ懸念の強まりなどから上下する局面もみられました。期末にかけて、主要国中銀による金融緩和策の正常化を模索する動きや高インフレ環境の長期化懸念等から相場が不安定化する局面も見られましたが、業績改善期待や低金利環境を支えに先進国株式は上昇基調を維持しました。

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。期前半にかけて、新型コロナワクチン普及ペースに関する見通しに不透明感が残る中、大規模な金融緩和策の継続が支援材料となりましたが、期後半は上昇幅を縮小しました。地域別では、いち早くコロナ禍前の経済活動水準を回復した中国が新興国株式の上昇を牽引しましたが、期末にかけて大手不動産会社の債務不安問題や電力不足問題などによる景気下振れ懸念から上昇幅を縮小しました。他方、インドでは感染拡大抑制が進んだことによる経済活動正常化期待から上昇しました。

新興国債券市況

新興国の長期金利は、前期末と比較して下落しました。期初には、新型コロナワクチン普及ペースに関する見通しに不透明感が残る中、大規模な金融緩和策の継続等から新興国金利は低下しました。期央は、先進国金利の急速な上昇を受けて、新興国金利は急速に水準を切り上げました。期末にかけて、インドネシアなど景気悪化に伴い政策金利の引き下げに踏み切る地域が見られる一方、メキシコやブラジルなど高インフレ環境への対応から利上げを余儀なくされる地域の動きが優勢となり、新興国金利の上昇につながりました。

国内リート市況

国内のリート市場は、前期末と比較して上昇しました。期前半は新型コロナワクチン開発進展や主要各国の大規模な財政・金融支援策継続が支援材料となり上昇しました。新型コロナワクチン接種進展による経済活動正常化期待から、用途別ではオフィス指数の上昇が目立ちました。期後半は、日銀によるリートの買い入れが見送られる展開が続く中、コロナ変異株の感染者再拡大による緊急事態宣言の再発令に伴う景気回復の遅れや主要国金利上昇から買い圧力の乏しい展開となり、期末にかけて上昇幅を縮小しました。

先進国リート市況

先進国のリート市場は、前期末と比較して上昇しました。期初から新型コロナワクチン開発進展や主要各国の大規模な財政・金融支援策継続が支援材料となり上昇しました。セクター別では、感染拡大抑制に伴う行動制限緩和期待からホテル・娯楽・リゾートやリテールセクターの上昇が目立ちました。その後も、コロナ変異株の感染再拡大が懸念される中、新型コロナワクチン接種の着実な進展が買い安心材料となり上昇基調を維持しました。期末にかけて、中国の大手不動産会社による債務不安問題の影響が懸念され、一時下落する場面もみられましたが、先進国金利の低位安定が相場の支援材料となりました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドル・ユーロの双方に対して円安となりました。

米ドルに対して、期前半はＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による大規模な金融緩和継続による低金利環境の長期化観測を受け、一時102円台まで円高が進む場面も見られました。期後半では、米国における高インフレ環境が想定以上に長引くとの懸念等による政策金利の早期引上げ観測の高まりから日米金利差の拡大に繋がりました。金利差拡大を受け、期末にかけてドル円は114円台近辺まで円安が進みました。

ユーロに対して、期前半は新型コロナワクチン開発進展に伴うリスク選好の高まりから、ユーロ高が進みました。期後半には、コロナ変異株の感染拡大による行動制限措置の強化が嫌気され、一時円高が進む場面も見られました。期末にかけて、欧州における行動制限措置の緩和に伴う景気回復期待の強まりを受け、対円でユーロ高が進みましたが、エネルギー価格の上昇や入荷遅延など企業活動における供給制約の長期化に伴う景気悪化が懸念される場面も見られました。

新興国通貨は前期末と比較して米ドルに対して下落し、円に対して上昇しました。

地域別では、南アフリカでは、期前半は経済の基礎的条件の改善等から対米ドルで通貨高が進みましたが、期末にかけてエネルギー価格上昇による交易条件悪化や政情不安定化要因も重なり、対米ドルで通貨安へ転じました。他方、タイをはじめとするＡＳＥＡＮ地域では感染再拡大や新型コロナワクチン接種の遅れ等が嫌気され、対米ドルで通貨安が進みました。

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。

2020年11月から2021年１月にかけては、米国の次期大統領に民主党のバイデン氏が選出され追加的財政政策への期待が高まったことや、新型コロナワクチンの開発の進展、および一部先進国で新型コロナワクチン接種が開始されたことなどに伴う経済活動の正常化期待も高まり世界的な株価上昇が見られました。新興国の株式指標をはじめとして株式関連指標に順調な推移が観測されるなか、定量分析の結果に基づき成長性重視資産の配分比率を高位に引き上げました。また、キャッシュ等への投資については11月から段階的に引き下げを実施し、１月末には50%程度まで引き下げました。

２月から３月にかけては、米国のインフレ率上昇懸念を端緒として緩和的な金融政策の正常化時期などを巡る市場関係者の思惑が交錯し、国内外の債券市場や新興国の株式市場で力強さを欠く動きが見られました。一方、米国の堅調な経済指標が確認されたことや追加的財政政策が成立したことを背景に、主要国の株式市場は堅調に推移したことから、定量分析の結果に基づき、成長性重視資産の配分比率を高位に維持した運用を継続しました。また、キャッシュ等への投資については２月にかけて一時的な引き上げを実施したものの、３月末には55%程度への調整を行いました。

４月から５月にかけては、米国の雇用指標をはじめとして堅調な経済指標が確認され、海外主要国の株式市場は景気回復期待を背景に堅調に推移しましたが、国内では新型コロナウイルス感染者数の再拡大に伴い緊急事態宣言が発令され、景気後退懸念が強まったことから株式市場は小幅ながら軟調に推移しました。また、５月半ばに入ると米国においてインフレ率の上昇が観測され、早期の金融政策正常化が懸念されたことから国内外の株式市場で一時大幅安となる動きが観測されましたが、定量分析の結果に基づき、成長性重視資産の配分比率を高位に維持しました。また、キャッシュ等への投資については５月末にかけては50%程度で調整を継続しました。

６月から７月にかけては、米国では金融政策の早期縮小懸念が高まる一方で、米欧を中心に堅調な経済指標が確認され、ボラティリティ指標の上昇を伴いながらも、株価上昇が観測されました。他方、新興国市場では中国当局が企業部門への規制強化を進めたことや新興国での新型コロナワクチンの調達の遅れから景気減速が懸念され、株式指標が軟調に推移するなか、定量分析の結果に基づき、成長性重視資産の配分比率は高位の水準を維持した運用を行いました。また、キャッシュ等への投資については段階的な引き下げを実施し、７月下旬に解消しました。

８月から９月にかけては、米国の大規模なインフラ投資法案の成立期待などを背景に海外主要国の株式市場は概ね堅調に始まりましたが、９月に入ると米国の緩和策縮小開始時期を巡る動きのほか、中国における規制強化や大手企業の債務問題への懸念が広がり下落に転じました。一方、国内では菅首相が退陣を発表し、次期首相の経済対策に期待が集まり株価上昇が観測されるなか、定量分析の結果に基づき、成長性重視資産の配分比率は高位の水準を維持しました。また、キャッシュ等への投資については９月下旬に一時的に引き上げを実施しましたが、９月末時点では再度解消しました。

10月以降は、原油高を受けたインフレ懸念が燻りつつも、中国不動産セクターに対する懸念などが後退した

ことや、米大手銀行を中心とした好調な企業決算を背景に、海外主要国において株価の上昇が観測されました。対して国内においては、原油高に加えて円安が進行したことから原料のコスト増加が意識され、上値は重く推移しましたが、円安の恩恵を受ける輸出企業や、好調な決算を発表した企業に買いが集まったことが株式市場の下支えとなりました。このようななか、定量分析の結果に基づき、成長性重視資産の配分比率を高位に維持した運用を継続しました。また、キャッシュ等への投資については10月上旬に一時的に30%程度へ引き上げを実施しましたが、11月初旬に再び解消しました。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

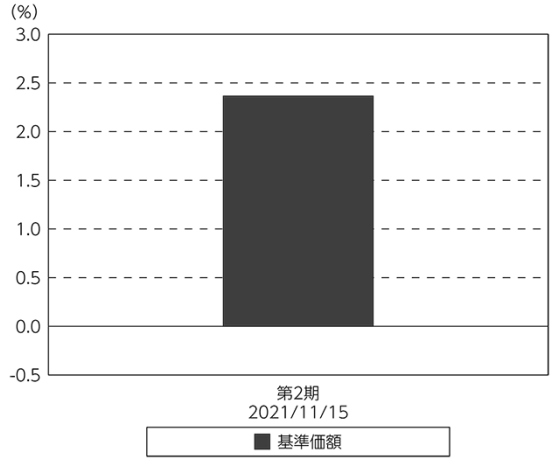
ＲＭマネーマザーファンド

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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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。

ＲＭ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

（2020年11月17日～2021年11月15日）

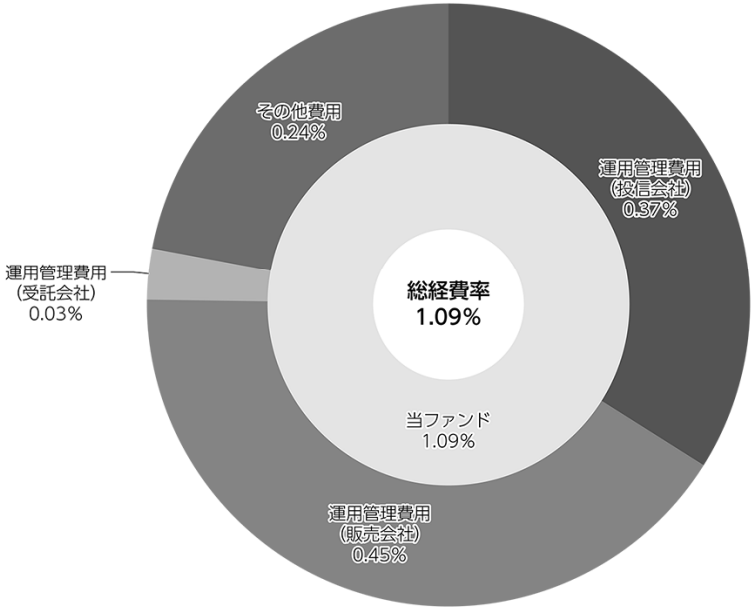
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	83	0.855	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(36)	(0.370)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(44)	(0.452)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.004	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.002)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(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)	(0.002)	
（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	0.236	(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）	(1)	(0.011)	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）	(21)	(0.215)	保証料は、保証契約に係る費用
（その他）	(0)	(0.001)	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	106	1.097	
期中の平均基準価額は、9,741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1.09％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

（2020年11月17日～2021年11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
ＲＭ国内株式マザーファンド	395,942	551,343	311,207	433,279
ＲＭ国内リートマザーファンド	185,073	262,895	145,528	206,535
ＲＭ先進国株式マザーファンド	1,786,702	3,129,801	1,495,924	2,619,929
ＲＭ新興国株式マザーファンド	341,325	569,182	263,402	433,985
ＲＭ先進国リートマザーファンド	454,350	548,725	386,316	466,595
ＲＭ国内債券マザーファンド	3,017,015	3,171,639	2,133,315	2,240,322
ＲＭ新興国債券マザーファンド	260,489	286,417	192,091	209,931
ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	12,146,112	12,692,593	8,539,164	8,920,300
ＲＭマネーマザーファンド	－	－	4,792,087	4,779,409

○株式売買比率

（2020年11月17日～2021年11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			
	ＲＭ国内株式マザーファンド	ＲＭ先進国株式マザーファンド	ＲＭ新興国株式マザーファンド	ＲＭ先進国リートマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	105,683,856千円	39,531,995千円	6,093,024千円	96,116千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	49,747,140千円	82,177,524千円	12,527,867千円	49,644千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	2.12	0.48	0.48	1.93

(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

（2020年11月17日～2021年11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

＜ＲＭ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	100	71	113

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（2020年11月17日～2021年11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（2020年11月17日～2021年11月15日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細（2021年11月15日現在）

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ＲＭ国内株式マザーファンド	106,597	191,332	286,328
ＲＭ国内リートマザーファンド	54,904	94,449	141,135
ＲＭ先進国株式マザーファンド	537,255	828,032	1,723,799
ＲＭ新興国株式マザーファンド	92,355	170,278	290,938
ＲＭ先進国リートマザーファンド	129,229	197,263	286,821
ＲＭ国内債券マザーファンド	915,287	1,798,987	1,893,254
ＲＭ新興国債券マザーファンド	61,950	130,347	143,252
ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	3,616,044	7,222,992	7,527,802
ＲＭマネーマザーファンド	4,792,087	－	－

○投資信託財産の構成

（2021年11月15日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ＲＭ国内株式マザーファンド	286,328	2.3
ＲＭ国内リートマザーファンド	141,135	1.1
ＲＭ先進国株式マザーファンド	1,723,799	13.9
ＲＭ新興国株式マザーファンド	290,938	2.3
ＲＭ先進国リートマザーファンド	286,821	2.3
ＲＭ国内債券マザーファンド	1,893,254	15.3
ＲＭ新興国債券マザーファンド	143,252	1.2
ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	7,527,802	60.6
コール・ローン等、その他	121,252	1.0
投資信託財産総額	12,414,581	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

（注）ＲＭ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（124,227,833千円）の投資信託財産総額（124,416,224千円）に対する比率は99.8％です。

（注）ＲＭ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（18,159,070千円）の投資信託財産総額（18,183,948千円）に対する比率は99.9％です。

（注）ＲＭ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（26,399,236千円）の投資信託財産総額（26,588,284千円）に対する比率は99.3％です。

（注）ＲＭ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（6,840,064千円）の投資信託財産総額（6,903,583千円）に対する比率は99.1％です。

（注）ＲＭ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（292,934,918千円）の投資信託財産総額（296,589,793千円）に対する比率は98.8％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=114.00円、1カナダドル=90.84円、1メキシコペソ=5.558円、1ブラジルレアル=20.887円、1チリペソ=0.142264円、1コロンビアペソ=0.029337円、1ユーロ=130.50円、1英ポンド=152.99円、1スイスフラン=123.83円、1スウェーデンクローナ=13.02円、1ノルウェークローネ=13.13円、1デンマーククローネ=17.55円、1トルコリラ=11.3728円、1チェココルナ=5.1719円、1ハンガリーフォリント=0.355518円、1ポーランドズロチ=28.1126円、1ロシアルーブル=1.56円、1オーストラリアドル=83.58円、1ニュージーランドドル=80.29円、1香港ドル=14.63円、1シンガポールドル=84.32円、1マレーシアリンギット=27.3726円、1タイバーツ=3.49円、1フィリピンペソ=2.286円、1インドネシアルピア=0.008円、1韓国ウォン=0.0966円、1新台湾ドル=4.0958円、1中国元=17.8686円、1オフショア人民元=17.8652円、1インドルピー=1.54円、1イスラエルシュケル=36.695円、1クウェートディナール=377.86円、1サウジアラビアリアル=30.44円、1カタールリアル=31.28円、1南アフリカランド=7.41円、1アラブディルハム=31.09円。

○特定資産の価格等の調査

（2020年11月17日～2021年11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 (2021年11月15日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,414,581,891
コール・ローン等	92,477,075
ＲＭ国内株式マザーファンド(評価額)	286,328,730
ＲＭ国内リートマザーファンド(評価額)	141,135,987
ＲＭ先進国株式マザーファンド(評価額)	1,723,799,007
ＲＭ新興国株式マザーファンド(評価額)	290,938,355
ＲＭ先進国リートマザーファンド(評価額)	286,821,563
ＲＭ国内債券マザーファンド(評価額)	1,893,254,004
ＲＭ新興国債券マザーファンド(評価額)	143,252,244
ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）(評価額)	7,527,802,926
未収入金	28,772,000
(B) 負債	111,335,536
未払解約金	27,616,400
未払信託報酬	69,173,518
未払利息	250
その他未払費用	14,545,368
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	12,303,246,355
元本	12,466,301,121
次期繰越損益金	△ 163,054,766
(D) 受益権総口数	12,466,301,121口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,869円

(注) 当ファンドの設定元本額は19,250,909,180円、期首元本額は15,904,875,360円、期末における元本残存率は64.7%です。
(注) 当期末の１口当たり純資産額は0.9869円です。
(注) 2021年11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163,054,766円です。

○損益の状況 (2020年11月17日～2021年11月15日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,762,719
支払利息	△ 1,762,719
(B) 有価証券売買損益	278,285,414
売買益	390,641,575
売買損	△112,356,161
(C) 有価証券評価差損益	188,924,554
(D) 信託報酬等	△146,016,046
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	319,431,203
(F) 前期繰越損益金	△571,095,589
(G) 解約差損益金	88,609,620
(H) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	△163,054,766
(I) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｈ＋Ｉ)	△163,054,766

(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**(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。
(注) 計算期間末における当ファンドの配当等収益額（△1,762,719円）に親ファンドの配当等収益額（143,259,115円）を加えた配当等収益合計額（141,496,396円）から経費（146,016,046円）を控除した額（△4,519,650円）に、期末の受益権口数（12,466,301,121口）を乗じて期中の平均受益権口数（14,069,197,535口）で除することにより分配可能額は（△4,004,728円）（１万口当たり0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、ＲＭ国内株式マザーファンド4,823,535円、ＲＭ国内リートマザーファンド4,214,407円、ＲＭ先進国株式マザーファンド19,252,973円、ＲＭ新興国株式マザーファンド4,375,560円、ＲＭ先進国リートマザーファンド6,788,935円、ＲＭ国内債券マザーファンド9,373,017円、ＲＭ新興国債券マザーファンド5,348,440円、ＲＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）89,922,868円、ＲＭマネーマザーファンド△840,620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

・投資する親投資信託の名称変更に伴い、約款に所要の変更を行いました。
（2021年４月24日）

＜当ファンドが投資対象とするＲM国内債券マザーファンド、ＲM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）、ＲM国内株式マザーファンド、ＲM先進国株式マザーファンド、ＲM新興国株式マザーファンド、ＲM新興国債券マザーファンド、ＲM国内リートマザーファンド、ＲM先進国リートマザーファンドおよびＲMマネーマザーファンドは以下の約款変更を行いました。＞

・ファンド名称の冒頭部分の「ＲＡＭ」を「ＲＭ」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。（2021年４月24日）

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

運 用 報 告 書

第５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
５期(2021年１月25日)	10,506	△1.3	386.571	△1.2	99.3	82,199

(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	%		%	%
2020年１月27日	10,645	－	391.374	－	99.3
１月末	10,654	0.1	391.771	0.1	99.2
２月末	10,736	0.9	394.745	0.9	99.2
３月末	10,561	△0.8	388.450	△0.7	99.5
４月末	10,597	△0.5	389.790	△0.4	99.5
５月末	10,551	△0.9	388.127	△0.8	99.2
６月末	10,508	△1.3	386.558	△1.2	99.3
７月末	10,543	△1.0	387.913	△0.9	99.0
８月末	10,495	△1.4	386.087	△1.4	99.3
９月末	10,525	△1.1	387.219	△1.1	99.0
10月末	10,508	△1.3	386.633	△1.2	99.3
11月末	10,522	△1.2	387.118	△1.1	99.3
12月末	10,523	△1.1	387.203	△1.1	99.2
(期末)					
2021年１月25日	10,506	△1.3	386.571	△1.2	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2020年１月28日～2021年１月25日）

期中の基準価額等の推移

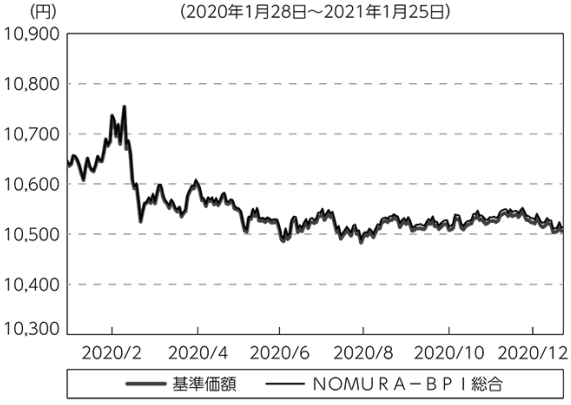
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,645円から当期末10,506円となり、139円の値下がりとなりました。

国内債券の市況（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合）の下落により、基準価額は下落しました。

基準価額等の推移

（2020年1月28日～2021年1月25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

国内債券市況

国内の長期金利は前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。2020年３月には新型肺炎の感染拡大に伴う不確実性の高まりが金融市場の混乱に繋がり、国内長期期金利は乱高下しました。その後、日銀による資金繰り支援策等の金融緩和策強化等が奏功し、国内長期金利は概ね０％近傍で推移しました。他方、超長期年限の国債利回りは、大規模な補正予算や2021年度予算案編成を受けて、国債発行額の増加や財政健全化の一時棚上げを懸念する動きが見られ、小幅に上昇しました。

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。

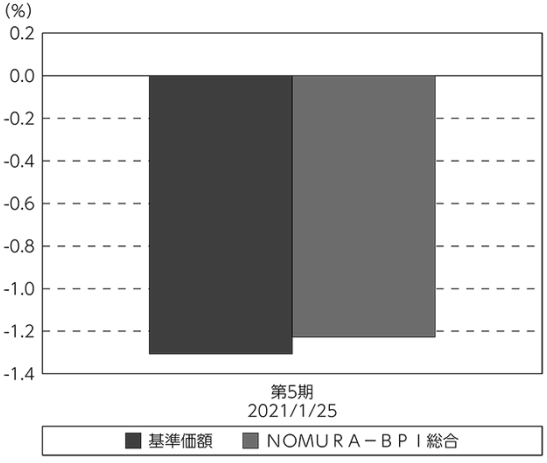
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は－1.3%となり、ベンチマークの－1.2%を0.1%下回りました。

（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

（2020年１月28日～2021年１月25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、10,560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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	66,300,402	64,472,432
	地方債証券	542,875	304,497
	特殊債券	1,568,381	302,436 （ 107,200）
	社債券（投資法人債券を含む）	1,001,529	602,082

（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

（2020年１月28日～2021年１月25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（2020年１月28日～2021年１月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2021年１月25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	63,185,000	67,987,913	82.7	－	54.9	18.3	9.5
	(　590,000)	(　584,991)	(0.7)	(－)	(0.7)	(　－)	(　－)
地方債証券	4,330,000	4,457,575	5.4	－	3.1	1.6	0.7
	(4,330,000)	(4,457,575)	(5.4)	(－)	(3.1)	(1.6)	(0.7)
特殊債券（除く金融債）	5,090,666	5,321,815	6.5	－	4.3	2.1	0.1
	(5,090,666)	(5,321,815)	(6.5)	(－)	(4.3)	(2.1)	(0.1)
金融債券	300,000	300,110	0.4	－	－	0.2	0.1
	(　300,000)	(　300,110)	(0.4)	(－)	(　－)	(0.2)	(0.1)
普通社債券（含む投資法人債券）	3,500,000	3,517,641	4.3	－	2.1	2.1	0.1
	(3,500,000)	(3,517,641)	(4.3)	(－)	(2.1)	(2.1)	(0.1)
合計	76,405,666	81,585,056	99.3	－	64.3	24.3	10.6
	(13,810,666)	(14,182,133)	(17.3)	(－)	(10.1)	(6.0)	(1.1)

（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409回利付国債（２年）	0.1	30,000	30,071	2022/２/１
第410回利付国債（２年）	0.1	410,000	411,074	2022/３/１
第412回利付国債（２年）	0.1	330,000	330,999	2022/５/１
第413回利付国債（２年）	0.1	550,000	551,776	2022/６/１
第414回利付国債（２年）	0.1	430,000	431,474	2022/７/１
第415回利付国債（２年）	0.1	240,000	240,854	2022/８/１
第416回利付国債（２年）	0.1	120,000	120,451	2022/９/１
第417回利付国債（２年）	0.1	350,000	351,414	2022/10/１
第418回利付国債（２年）	0.1	440,000	441,984	2022/11/１
第136回利付国債（５年）	0.1	910,000	915,141	2023/６/20
第137回利付国債（５年）	0.1	710,000	714,430	2023/９/20
第138回利付国債（５年）	0.1	700,000	704,781	2023/12/20
第139回利付国債（５年）	0.1	1,020,000	1,027,568	2024/３/20
第140回利付国債（５年）	0.1	670,000	675,373	2024/６/20
第141回利付国債（５年）	0.1	330,000	332,841	2024/９/20
第142回利付国債（５年）	0.1	480,000	484,420	2024/12/20
第143回利付国債（５年）	0.1	560,000	565,482	2025/３/20
第144回利付国債（５年）	0.1	500,000	505,195	2025/６/20
第145回利付国債（５年）	0.1	450,000	454,837	2025/９/20
第131回利付国債（５年）	0.1	360,000	360,946	2022/３/20
第132回利付国債（５年）	0.1	40,000	40,131	2022/６/20
第133回利付国債（５年）	0.1	1,280,000	1,284,966	2022/９/20
第134回利付国債（５年）	0.1	830,000	833,710	2022/12/20
第135回利付国債（５年）	0.1	1,000,000	1,004,940	2023/３/20
第１回利付国債（40年）	2.4	40,000	57,819	2048/３/20
第２回利付国債（40年）	2.2	100,000	140,214	2049/３/20
第３回利付国債（40年）	2.2	110,000	155,200	2050/３/20
第４回利付国債（40年）	2.2	150,000	212,896	2051/３/20
第５回利付国債（40年）	2.0	170,000	233,680	2052/３/20
第６回利付国債（40年）	1.9	170,000	230,486	2053/３/20
第７回利付国債（40年）	1.7	150,000	195,888	2054/３/20
第８回利付国債（40年）	1.4	190,000	232,088	2055/３/20
第９回利付国債（40年）	0.4	300,000	274,227	2056/３/20
第10回利付国債（40年）	0.9	290,000	310,764	2057/３/20
第11回利付国債（40年）	0.8	220,000	228,846	2058/３/20
第12回利付国債（40年）	0.5	250,000	234,945	2059/３/20
第13回利付国債（40年）	0.5	190,000	178,322	2060/３/20
第321回利付国債（10年）	1.0	241,000	244,123	2022/３/20
第322回利付国債（10年）	0.9	220,000	222,598	2022/３/20
第323回利付国債（10年）	0.9	340,000	344,899	2022/６/20
第324回利付国債（10年）	0.8	183,000	185,380	2022/６/20
第325回利付国債（10年）	0.8	330,000	335,072	2022/９/20
第326回利付国債（10年）	0.7	280,000	284,421	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	387,000	393,849	2022/12/20

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328回利付国債（10年）	0.6	411,000	417,452	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	297,000	303,640	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	257,000	263,317	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	90,000	91,746	2023/9/20
第332回利付国債（10年）	0.6	532,000	543,299	2023/12/20
第333回利付国債（10年）	0.6	225,000	230,186	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	261,000	267,501	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	345,000	352,969	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	210,000	215,182	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	170,000	172,862	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	631,000	644,932	2025/3/20
第339回利付国債（10年）	0.4	385,000	394,109	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	934,000	957,153	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	440,000	449,213	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	210,000	212,389	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	560,000	566,692	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	570,000	576,965	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	690,000	698,597	2026/12/20
第346回利付国債（10年）	0.1	820,000	830,389	2027/3/20
第347回利付国債（10年）	0.1	230,000	232,960	2027/6/20
第348回利付国債（10年）	0.1	340,000	344,433	2027/9/20
第349回利付国債（10年）	0.1	480,000	486,326	2027/12/20
第350回利付国債（10年）	0.1	520,000	526,723	2028/3/20
第351回利付国債（10年）	0.1	100,000	101,301	2028/6/20
第352回利付国債（10年）	0.1	680,000	688,622	2028/9/20
第353回利付国債（10年）	0.1	650,000	658,248	2028/12/20
第354回利付国債（10年）	0.1	460,000	465,639	2029/3/20
第355回利付国債（10年）	0.1	440,000	445,187	2029/6/20
第356回利付国債（10年）	0.1	840,000	849,466	2029/9/20
第357回利付国債（10年）	0.1	630,000	636,451	2029/12/20
第358回利付国債（10年）	0.1	600,000	605,760	2030/3/20
第359回利付国債（10年）	0.1	720,000	726,422	2030/6/20
第360回利付国債（10年）	0.1	660,000	665,082	2030/9/20
第１回利付国債（30年）	2.8	60,000	74,659	2029/9/20
第７回利付国債（30年）	2.3	40,000	49,899	2032/5/20
第11回利付国債（30年）	1.7	50,000	59,541	2033/6/20
第12回利付国債（30年）	2.1	40,000	49,713	2033/9/20
第13回利付国債（30年）	2.0	90,000	110,997	2033/12/20
第14回利付国債（30年）	2.4	60,000	77,302	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	160,000	208,969	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	100,000	130,994	2034/9/20
第17回利付国債（30年）	2.4	50,000	64,962	2034/12/20
第18回利付国債（30年）	2.3	60,000	77,332	2035/3/20
第19回利付国債（30年）	2.3	100,000	129,207	2035/6/20
第20回利付国債（30年）	2.5	100,000	132,451	2035/9/20
第21回利付国債（30年）	2.3	90,000	116,836	2035/12/20

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22回利付国債（30年）	2.5	50,000	66,562	2036/３/20
第23回利付国債（30年）	2.5	160,000	213,532	2036/６/20
第24回利付国債（30年）	2.5	100,000	133,784	2036/９/20
第25回利付国債（30年）	2.3	100,000	130,945	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	145,000	192,632	2037/３/20
第27回利付国債（30年）	2.5	215,000	290,465	2037/９/20
第28回利付国債（30年）	2.5	110,000	149,218	2038/３/20
第29回利付国債（30年）	2.4	70,000	94,166	2038/９/20
第30回利付国債（30年）	2.3	190,000	253,213	2039/３/20
第31回利付国債（30年）	2.2	130,000	171,502	2039/９/20
第32回利付国債（30年）	2.3	215,000	288,927	2040/３/20
第33回利付国債（30年）	2.0	290,000	374,868	2040/９/20
第34回利付国債（30年）	2.2	255,000	340,570	2041/３/20
第35回利付国債（30年）	2.0	316,000	411,258	2041/９/20
第36回利付国債（30年）	2.0	295,000	385,143	2042/３/20
第37回利付国債（30年）	1.9	320,000	412,755	2042/９/20
第38回利付国債（30年）	1.8	160,000	203,497	2043/３/20
第39回利付国債（30年）	1.9	190,000	245,803	2043/６/20
第40回利付国債（30年）	1.8	175,000	222,871	2043/９/20
第41回利付国債（30年）	1.7	155,000	194,413	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	190,000	238,533	2044/３/20
第43回利付国債（30年）	1.7	80,000	100,529	2044/６/20
第44回利付国債（30年）	1.7	180,000	226,398	2044/９/20
第45回利付国債（30年）	1.5	190,000	230,806	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	240,000	291,705	2045/３/20
第47回利付国債（30年）	1.6	230,000	285,013	2045/６/20
第48回利付国債（30年）	1.4	233,000	278,101	2045/９/20
第49回利付国債（30年）	1.4	180,000	214,918	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	250,000	263,515	2046/３/20
第51回利付国債（30年）	0.3	210,000	196,331	2046/６/20
第52回利付国債（30年）	0.5	230,000	225,639	2046/９/20
第53回利付国債（30年）	0.6	220,000	220,741	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	230,000	241,486	2047/３/20
第55回利付国債（30年）	0.8	120,000	125,899	2047/６/20
第56回利付国債（30年）	0.8	180,000	188,703	2047/９/20
第57回利付国債（30年）	0.8	230,000	240,931	2047/12/20
第58回利付国債（30年）	0.8	350,000	366,338	2048/３/20
第59回利付国債（30年）	0.7	190,000	194,012	2048/６/20
第60回利付国債（30年）	0.9	190,000	203,275	2048/９/20
第61回利付国債（30年）	0.7	180,000	183,205	2048/12/20
第62回利付国債（30年）	0.5	160,000	154,472	2049/３/20
第63回利付国債（30年）	0.4	210,000	196,942	2049/６/20
第64回利付国債（30年）	0.4	180,000	168,519	2049/９/20
第65回利付国債（30年）	0.4	190,000	177,579	2049/12/20
第66回利付国債（30年）	0.4	200,000	186,832	2050/３/20
第67回利付国債（30年）	0.6	200,000	197,288	2050/６/20

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68回利付国債（30年）	0.6	230,000	226,577	2050/9/20
第55回利付国債（20年）	2.0	100,000	102,448	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	10,000	10,298	2022/6/20
第57回利付国債（20年）	1.9	110,000	113,125	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	100,000	103,355	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	40,000	41,393	2022/12/20
第60回利付国債（20年）	1.4	30,000	30,873	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	50,000	51,215	2023/3/20
第62回利付国債（20年）	0.8	80,000	81,788	2023/6/20
第63回利付国債（20年）	1.8	60,000	62,784	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	120,000	126,458	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	380,000	402,385	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	20,000	21,282	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	90,000	96,622	2024/3/20
第69回利付国債（20年）	2.1	60,000	64,225	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	110,000	119,496	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	100,000	107,950	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	210,000	227,169	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	180,000	195,022	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	100,000	109,271	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	100,000	108,437	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	20,000	21,770	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	50,000	54,476	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	20,000	21,879	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	90,000	98,853	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	30,000	32,981	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	170,000	187,688	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	10,000	11,093	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	120,000	132,535	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	150,000	167,196	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	100,000	112,499	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	90,000	100,783	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	185,000	209,262	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	120,000	135,086	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	170,000	192,322	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	80,000	90,959	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	255,000	288,371	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	80,000	90,387	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	140,000	159,044	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	185,000	213,586	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	70,000	79,914	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	130,000	149,913	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	70,000	80,254	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	85,000	97,887	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	151,000	175,676	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	20,000	23,555	2028/3/20

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102回利付国債（20年）	2.4	145,000	171,630	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	100,000	117,622	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	10,000	11,613	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	12,000	13,991	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	40,000	46,946	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	80,000	93,676	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	220,000	254,119	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	80,000	92,758	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	195,000	229,286	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	50,000	59,436	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	205,000	241,961	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	85,000	100,699	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	160,000	190,152	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	100,000	119,736	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	140,000	168,243	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	225,000	268,332	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	131,000	155,546	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	150,000	175,290	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	200,000	229,962	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	205,000	242,115	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	190,000	222,569	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	265,000	318,980	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	200,000	238,766	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	120,000	146,115	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	100,000	119,743	2031/3/20
第127回利付国債（20年）	1.9	130,000	154,352	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	225,000	267,914	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	180,000	212,472	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	180,000	213,028	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	70,000	82,103	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	170,000	199,862	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	245,000	290,685	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	45,000	53,520	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	40,000	47,132	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	170,000	198,434	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	170,000	200,763	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	90,000	104,256	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	180,000	210,544	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	300,000	355,068	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	185,000	219,417	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	210,000	251,533	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	245,000	288,232	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	190,000	221,253	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	375,000	446,557	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	370,000	441,465	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	395,000	467,178	2033/12/20

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148回利付国債（20年）	1.5	335,000	392,539	2034/３/20
第149回利付国債（20年）	1.5	380,000	445,907	2034/６/20
第150回利付国債（20年）	1.4	340,000	394,995	2034/９/20
第151回利付国債（20年）	1.2	445,000	505,172	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	400,000	454,396	2035/３/20
第153回利付国債（20年）	1.3	270,000	310,691	2035/６/20
第154回利付国債（20年）	1.2	128,000	145,594	2035/９/20
第155回利付国債（20年）	1.0	380,000	421,237	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	370,000	377,270	2036/３/20
第157回利付国債（20年）	0.2	280,000	276,693	2036/６/20
第158回利付国債（20年）	0.5	160,000	165,152	2036/９/20
第159回利付国債（20年）	0.6	290,000	303,429	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	320,000	339,449	2037/３/20
第161回利付国債（20年）	0.6	310,000	323,773	2037/６/20
第162回利付国債（20年）	0.6	220,000	229,554	2037/９/20
第163回利付国債（20年）	0.6	330,000	343,985	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	430,000	440,431	2038/３/20
第165回利付国債（20年）	0.5	330,000	337,563	2038/６/20
第166回利付国債（20年）	0.7	440,000	464,437	2038/９/20
第167回利付国債（20年）	0.5	280,000	285,630	2038/12/20
第168回利付国債（20年）	0.4	260,000	260,218	2039/３/20
第169回利付国債（20年）	0.3	280,000	274,730	2039/６/20
第170回利付国債（20年）	0.3	370,000	362,318	2039/９/20
第171回利付国債（20年）	0.3	270,000	264,095	2039/12/20
第172回利付国債（20年）	0.4	280,000	278,513	2040/３/20
第173回利付国債（20年）	0.4	320,000	317,993	2040/６/20
第174回利付国債（20年）	0.4	200,000	198,372	2040/９/20
小計		63,185,000	67,987,913	
地方債証券				
第14回東京都公募公債	2.31	100,000	115,831	2028/３/17
第705回東京都公募公債	1.06	100,000	101,200	2022/３/18
第723回東京都公募公債	0.76	100,000	101,987	2023/９/20
第746回東京都公募公債	0.499	100,000	102,173	2025/６/20
第761回東京都公募公債	0.075	100,000	100,112	2026/９/18
平成28年度第８回北海道公募公債	0.06	100,000	99,959	2026/10/28
平成29年度第６回北海道公募公債	0.01	100,000	99,976	2022/７/28
第211回神奈川県公募公債	0.438	100,000	101,688	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債	0.08	100,000	100,128	2026/３/19
第164回大阪府公募公債	0.001	100,000	99,933	2024/７/30
第376回大阪府公募公債	0.82	110,000	112,333	2023/９/27
第451回大阪府公募公債	0.063	100,000	99,313	2029/12/26
平成27年度第13回京都府公募公債	0.11	100,000	100,282	2026/３/17
平成29年度第４回京都府公募公債	0.19	100,000	100,764	2027/６/21
平成29年度第１回兵庫県公募公債	0.187	100,000	100,672	2027/５/21
平成26年度第６回静岡県公募公債	0.566	100,000	102,010	2024/８/26
平成30年度第14回静岡県公募公債	0.15	100,000	100,431	2028/12/20

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24年度第５回愛知県公募公債	0.886	100,000	101,245	2022/６/28
平成28年度第８回愛知県公募公債	0.065	100,000	100,055	2026/８/26
平成29年度第11回愛知県公募公債	0.225	100,000	101,007	2027/10/27
平成29年度第３回広島県公募公債	0.15	100,000	100,531	2027/９/27
平成30年度第１回広島県公募公債	0.2	100,000	100,874	2028/５/25
第８回埼玉県公募公債	2.19	100,000	117,873	2029/９/20
第16回埼玉県公募公債	1.216	100,000	112,617	2035/８/14
平成26年度第６回埼玉県公募公債	0.554	100,000	102,014	2024/９/26
平成27年度第１回福岡県公募公債	0.578	100,000	102,530	2025/６/26
第19回千葉県公募公債	1.166	100,000	111,890	2035/10/15
平成29年度第６回千葉県公募公債	0.245	100,000	101,148	2028/１/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	101,354	2022/12/22
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	100,000	102,070	2023/６/23
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	102,220	2024/４/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,231	2026/３/25
第169回共同発行市場公募地方債	0.205	100,000	100,838	2027/４/23
平成27年度第１回静岡市公募公債	0.476	100,000	102,279	2025/11/25
第17回名古屋市公募公債	1.203	100,000	112,424	2035/５/28
第26回横浜市公募公債	1.776	100,000	118,273	2033/１/28
平成26年度第５回福岡市公募公債	0.539	100,000	102,005	2024/10/28
平成29年度第２回福岡市公募公債	0.01	100,000	99,999	2022/６/27
平成27年度第２回広島市公募公債	0.464	100,000	102,259	2025/12/25
平成29年度第３回千葉市公募公債	0.215	120,000	121,156	2027/12/28
平成29年度第１回鹿児島県公募公債	0.02	100,000	100,017	2022/10/31
平成29年度第５回福井県公募公債	0.19	100,000	100,793	2028/４/27
平成29年度第２回岡山県公募公債	0.235	100,000	101,081	2028/１/31
小計		4,330,000	4,457,575	
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	129,392	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	101,813	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	146,016	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	114,394	2028/８/15
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	116,492	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	129,518	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	101,807	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	102,119	2025/６/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.557	103,000	105,564	2025/７/31
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	135,104	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	100,570	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	100,888	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	101,167	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	100,615	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	101,837	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	101,250	2028/９/19
第31回国際協力機構債券	0.53	100,000	102,297	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	112,229	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16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	134,159	2036/9/19
第27回道路債券	2.42	100,000	107,533	2024/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	150,000	175,305	2028/6/20
第１回地方公共団体金融機構債券	1.864	100,000	125,425	2044/6/28
第13回公営企業債券	2.16	100,000	109,407	2025/6/20
Ｆ82回地方公共団体金融機構債券	1.381	100,000	105,214	2024/11/20
第97回地方公共団体金融機構債券	0.205	200,000	201,404	2027/6/28
Ｆ132回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	104,820	2025/7/30
Ｆ228回地方公共団体金融機構債券	1.269	100,000	110,852	2031/3/20
Ｆ305回地方公共団体金融機構債券	1.33	100,000	114,610	2040/10/26
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	0.03	100,000	100,021	2022/3/11
第２回一般担保住宅金融公庫債券	2.54	100,000	113,279	2026/6/19
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.06	85,539	85,249	2034/2/10
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.14	91,410	91,388	2034/2/10
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	2.15	100,000	105,645	2023/9/20
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	118,342	2032/3/12
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	108,830	2027/9/17
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,224	86,250	2052/8/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	85,350	86,142	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	86,606	87,272	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	86,048	86,834	2053/1/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	89,167	89,753	2053/8/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	90,196	91,355	2053/10/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	95,055	94,279	2054/11/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	96,978	96,890	2055/3/10
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	99,243	99,503	2055/10/10
第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.16	59,790	59,739	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	61,950	61,938	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	66,110	66,141	2033/1/10
第29回西日本高速道路株式会社社債	0.31	100,000	101,184	2026/2/12
第52回西日本高速道路株式会社社債	0.03	100,000	99,922	2024/12/20
第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.04	100,000	100,051	2023/9/20
小計		5,090,666	5,321,815	
金融債券				
第327回信金中金債	0.06	100,000	100,040	2022/2/25
第340回信金中金債	0.11	100,000	100,162	2023/3/27
第358回信金中金債（５年）	0.01	100,000	99,908	2024/9/27
小計		300,000	300,110	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第543回中部電力株式会社社債	0.12	100,000	99,999	2025/7/25
第413回中国電力株式会社社債	0.4	100,000	101,107	2029/2/22
第338回北陸電力株式会社社債	0.3	100,000	99,861	2030/8/23
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,498	2026/11/25
第462回九州電力株式会社社債	0.42	100,000	101,150	2028/5/25
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	98,780	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	99,704	2024/9/19

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12回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	100,000	99,920	2023/9/8
第３回株式会社電通無担保社債	0.424	100,000	100,569	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	98,914	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	99,913	2022/7/26
第10回株式会社資生堂無担保社債	0.08	100,000	99,586	2025/2/26
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	100,534	2029/4/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,436	2027/5/28
第12回株式会社小松製作所無担保社債	0.11	100,000	99,799	2024/6/6
第18回株式会社日立製作所無担保社債	0.06	100,000	99,873	2023/3/10
第17回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,692	2025/9/4
第５回大日本印刷株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,222	2030/3/8
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	99,622	2028/5/31
第147回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	0.89	100,000	101,938	2023/7/24
第14回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,913	2023/6/20
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	100,337	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	100,210	2025/1/23
第58回三井不動産株式会社無担保社債	0.1	100,000	99,900	2023/2/24
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,757	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	102,103	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	101,547	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	107,157	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	101,264	2023/3/20
第22回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	0.31	100,000	99,937	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	100,652	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	102,652	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	100,729	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	100,352	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	100,014	2023/7/6
小計		3,500,000	3,517,641	
合計		76,405,666	81,585,056	

○投資信託財産の構成

（2021年１月25日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	81,585,056	99.2
コール・ローン等、その他	624,476	0.8
投資信託財産総額	82,209,532	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

（2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	82,209,532,727
コール・ローン等	478,088,672
公社債(評価額)	81,585,056,038
未収利息	141,876,019
前払費用	4,511,998
(B) 負債	9,912,339
未払解約金	9,911,000
未払利息	1,295
その他未払費用	44
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	82,199,620,388
元本	78,237,277,839
次期繰越損益金	3,962,342,549
(D) 受益権総口数	78,237,277,839口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,506円

(注) 当ファンドの期首元本額は75,458,660,146円、期中追加設定元本額は65,516,965,042円、期中一部解約元本額は62,738,347,349円です。

(注) 2021年１月25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	45,122,154,760円
・りそなＦＴ　国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	7,334,607,433円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	5,764,666,983円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	2,624,064,867円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	2,606,166,309円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	2,310,078,109円
・つみたてバランスファンド	2,186,256,912円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,035,496,686円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,608,319,407円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	1,520,894,120円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	999,052,971円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	907,358,174円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	576,971,635円
・ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	520,309,132円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	477,791,188円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	386,002,233円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	343,170,086円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	339,041,188円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	136,725,623円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	123,625,014円
・りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド(適格機関投資家専用)	110,530,907円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	78,699,745円
・リスクコントロール・オープン	52,766,504円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	44,967,763円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	13,676,255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)	11,456,412円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,904,899円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	522,524円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.0506円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	621,447,684
受取利息	622,287,583
支払利息	△　839,899
(B) 有価証券売買損益	△1,819,116,773
売買益	19,562,962
売買損	△1,838,679,735
(C) 保管費用等	△　187,962
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△1,197,857,051
(E) 前期繰越損益金	4,865,525,406
(F) 追加信託差損益金	3,678,576,958
(G) 解約差損益金	△3,383,902,764
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	3,962,342,549
次期繰越損益金(Ｈ)	3,962,342,549

(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４期（決算日　2020年12月10日）
（2019年12月11日～2020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
４期(2020年12月10日)	10,723	4.7	429.26	5.7	99.8	204,734

（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	%		%	%
2019年12月10日	10,237	－	406.21	－	98.9
12月末	10,216	△0.2	405.42	△0.2	99.4
2020年１月末	10,402	1.6	412.91	1.6	98.3
２月末	10,520	2.8	417.52	2.8	99.1
３月末	10,620	3.7	423.40	4.2	98.0
４月末	10,601	3.6	423.84	4.3	97.6
５月末	10,589	3.4	423.57	4.3	100.1
６月末	10,664	4.2	426.81	5.1	99.6
７月末	10,770	5.2	431.07	6.1	98.8
８月末	10,637	3.9	425.73	4.8	100.3
９月末	10,752	5.0	430.39	6.0	97.6
10月末	10,732	4.8	429.55	5.7	97.8
11月末	10,742	4.9	429.92	5.8	100.2
（期　末）					
2020年12月10日	10,723	4.7	429.26	5.7	99.8

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2019年12月11日～2020年12月10日）

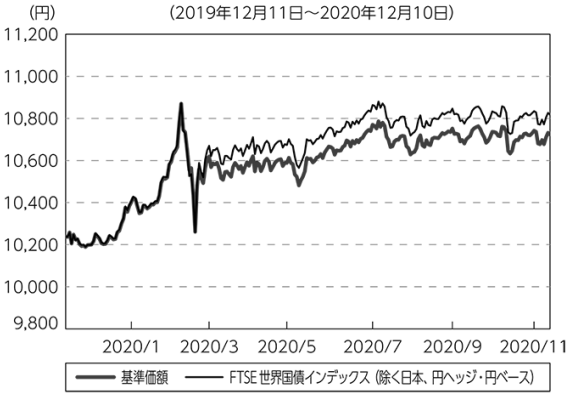
期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、前期末10,237円から当期末10,723円となり、486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
（2019年12月11日～2020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

先進国の長期金利は、前期末と比較して米欧ともに低下（債券価格は上昇）しました。2019年半ばよりＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）など主要国中央銀行が金融緩和姿勢に転じていたことに加え、新型肺炎問題への対応として緊急利下げ等の大規模な金融支援策を展開したことから、先進国の金利水準は大きく低下しました。その後も大規模な金融緩和策は当面継続されるとの見通しから長期金利は先高観の乏しい展開となり、低位で推移しました。

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。

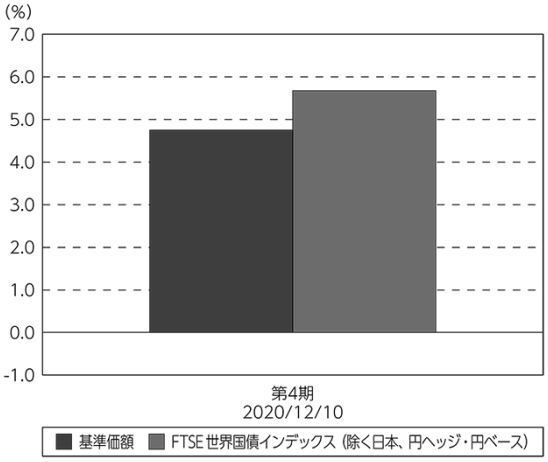
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋4.7%となり、ベンチマークの＋5.7%を0.9%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。

○１万口当たりの費用明細

（2019年12月11日～2020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	0.019	(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)	(0.018)	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	0.019	
期中の平均基準価額は、10,603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12月11日～2020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 936,143	千米ドル 784,289
	カナダ	国債証券	千カナダドル 55,569	千カナダドル 41,516
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 286,887	千メキシコペソ 197,087
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	133,534	86,153
	イタリア	国債証券	155,514	113,303
	フランス	国債証券	172,639	122,889
	オランダ	国債証券	32,488	23,737
	スペイン	国債証券	102,015	72,284
	ベルギー	国債証券	41,405	29,953
	オーストリア	国債証券	24,432	17,229
	フィンランド	国債証券	9,354	6,331
	アイルランド	国債証券	12,917	7,968
	イギリス	国債証券	千英ポンド 100,332	千英ポンド 71,196
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 49,630	千スウェーデンクローナ 41,388
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 41,878	千ノルウェークローネ 34,423
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 61,320	千デンマーククローネ 47,559
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 44,705	千ポーランドズロチ 30,038
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 73,135	千オーストラリアドル 40,589
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 10,959	千シンガポールドル 7,873
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 25,711	千マレーシアリンギット 14,847
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシュケル 29,593	千イスラエルシュケル 1,257
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 44,081	千南アフリカランド 140,349

（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

（2019年12月11日～2020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（2019年12月11日～2020年12月10日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2020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	782,120	844,401	88,054,178	43.0	－	18.7	16.1	8.2
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	45,410	49,790	4,050,443	2.0	－	0.9	0.6	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	289,706	326,507	1,714,161	0.8	－	0.5	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	105,930	126,924	15,988,648	7.8	－	4.7	2.1	1.0
イタリア	129,930	154,527	19,465,792	9.5	－	5.9	2.7	0.9
フランス	141,700	173,170	21,814,279	10.7	－	7.2	2.6	0.9
オランダ	26,240	32,097	4,043,320	2.0	－	1.3	0.5	0.2
スペイン	80,500	98,863	12,453,870	6.1	－	4.1	1.6	0.4
ベルギー	32,530	41,206	5,190,844	2.5	－	1.9	0.4	0.2
オーストリア	19,880	24,844	3,129,616	1.5	－	1.0	0.4	0.2
フィンランド	9,090	10,194	1,284,237	0.6	－	0.4	0.2	0.1
アイルランド	11,860	13,810	1,739,658	0.8	－	0.6	0.2	0.1
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	75,670	98,148	13,688,738	6.7	－	5.2	1.1	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	47,905	53,315	654,711	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	35,220	37,389	441,568	0.2	－	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	47,560	60,922	1,030,816	0.5	－	0.4	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	41,680	45,235	1,286,510	0.6	－	0.3	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	64,050	71,102	5,518,998	2.7	－	1.9	0.6	0.3
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	10,100	11,459	893,982	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	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	35,360	38,156	978,715	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千イスラエルシュケル	千イスラエルシュケル						
イスラエル	24,050	27,959	896,112	0.4	－	0.2	0.1	0.1
合計	－	－	204,319,207	99.8	－	55.9	30.2	13.7

（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）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	1.75	3,330	3,383	352,820	2021/11/30
		US TREASURY N/B	1.875	2,230	2,268	236,545	2021/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	3,200	3,243	338,238	2021/11/30
		US TREASURY N/B	2.625	2,400	2,461	256,642	2021/12/15
		US TREASURY N/B	2.0	3,730	3,804	396,724	2021/12/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,500	2,539	264,862	2021/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	4,000	4,104	428,020	2022/1/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,350	2,387	248,939	2022/1/31
		US TREASURY N/B	1.875	2,610	2,662	277,614	2022/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	3,000	3,043	317,337	2022/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	3,560	3,639	379,502	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,180	2,223	231,863	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.875	4,670	4,770	497,421	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.125	4,600	4,656	485,581	2022/2/28
		US TREASURY N/B	2.375	4,520	4,648	484,721	2022/3/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,300	2,348	244,931	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.875	1,770	1,810	188,771	2022/3/31
		US TREASURY N/B	0.375	4,250	4,263	444,618	2022/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,085	321,760	2022/4/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,190	2,239	233,516	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.875	2,450	2,509	261,678	2022/4/30
		US TREASURY N/B	0.125	5,530	5,530	576,668	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,750	2,813	293,407	2022/5/15
		US TREASURY N/B	1.875	2,990	3,066	319,793	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.75	2,800	2,866	298,924	2022/5/31
		US TREASURY N/B	0.125	4,500	4,498	469,150	2022/5/31
		US TREASURY N/B	1.75	3,100	3,175	331,122	2022/6/15
		US TREASURY N/B	2.125	1,370	1,412	147,269	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,900	1,947	203,089	2022/6/30
		US TREASURY N/B	0.125	4,000	3,998	416,989	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,200	2,256	235,294	2022/7/15
		US TREASURY N/B	2.0	2,420	2,493	260,026	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.875	2,950	3,033	316,356	2022/7/31
		US TREASURY N/B	0.125	6,000	5,997	625,435	2022/7/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,750	2,818	293,916	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,500	2,557	266,657	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	2,340	2,409	251,264	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	1,710	1,753	182,849	2022/8/31
		US TREASURY N/B	0.125	6,060	6,057	631,640	2022/8/31
		US TREASURY N/B	1.5	3,420	3,501	365,107	2022/9/15
		US TREASURY N/B	1.75	1,530	1,574	164,160	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	1,740	1,793	187,074	2022/9/30
		US TREASURY N/B	0.125	5,800	5,797	604,516	2022/9/30

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.375	2,480	2,536	264,458	2022/10/15
		US TREASURY N/B	1.875	5,100	5,266	549,164	2022/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	3,810	3,943	411,181	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	5,080	5,224	544,837	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	4,180	4,332	451,819	2022/11/30
		US TREASURY N/B	0.125	2,850	2,848	297,047	2022/11/30
		US TREASURY N/B	1.625	3,550	3,655	381,147	2022/12/15
		US TREASURY N/B	2.125	4,440	4,619	481,740	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	2,330	2,395	249,829	2023/1/15
		US TREASURY N/B	1.75	2,360	2,440	254,546	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.375	3,830	4,011	418,308	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	4,630	4,816	502,223	2023/2/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,566	267,629	2023/2/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,300	2,368	246,964	2023/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	1,500	1,581	164,968	2023/2/28
		US TREASURY N/B	0.5	3,500	3,527	367,795	2023/3/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,140	2,205	230,002	2023/3/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,350	2,476	258,229	2023/3/31
		US TREASURY N/B	0.25	3,500	3,507	365,721	2023/4/15
		US TREASURY N/B	1.625	1,650	1,707	178,050	2023/4/30
		US TREASURY N/B	2.75	4,140	4,395	458,313	2023/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	4,410	4,579	477,515	2023/5/15
		US TREASURY N/B	0.125	3,900	3,895	406,231	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,060	2,133	222,528	2023/5/31
		US TREASURY N/B	2.75	1,800	1,914	199,626	2023/5/31
		US TREASURY N/B	0.25	3,450	3,456	360,426	2023/6/15
		US TREASURY N/B	1.375	3,160	3,256	339,616	2023/6/30
		US TREASURY N/B	2.625	2,220	2,358	245,952	2023/6/30
		US TREASURY N/B	0.125	4,100	4,093	426,896	2023/7/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,100	2,159	225,155	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,390	2,551	266,115	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.5	3,500	3,717	387,691	2023/8/15
		US TREASURY N/B	0.125	4,200	4,193	437,274	2023/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,320	2,395	249,787	2023/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,130	2,278	237,586	2023/8/31
		US TREASURY N/B	0.125	4,500	4,491	468,380	2023/9/15
		US TREASURY N/B	1.375	3,960	4,091	426,659	2023/9/30
		US TREASURY N/B	0.125	4,050	4,041	421,443	2023/10/15
		US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,957	412,656	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.875	1,800	1,938	202,188	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.75	5,480	5,890	614,246	2023/11/15
		US TREASURY N/B	0.25	5,000	5,006	522,092	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	2,420	2,558	266,789	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.875	3,180	3,432	357,893	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	1,920	2,039	212,684	2023/12/31

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	2.625	2,700	2,898	302,254	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.25	3,410	3,627	378,326	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,000	2,142	223,456	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	3,280	3,543	369,561	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	1,800	1,909	199,156	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.375	3,360	3,591	374,510	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.125	5,350	5,682	592,592	2024/3/31
		US TREASURY N/B	2.0	2,320	2,458	256,331	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.25	2,940	3,139	327,373	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.5	5,840	6,291	656,025	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	3,140	3,330	347,328	2024/5/31
		US TREASURY N/B	2.0	2,380	2,527	263,542	2024/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	2,540	2,674	278,901	2024/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	1,480	1,580	164,764	2024/7/31
		US TREASURY N/B	1.75	4,000	4,215	439,572	2024/7/31
		US TREASURY N/B	2.375	6,110	6,584	686,629	2024/8/15
		US TREASURY N/B	1.875	2,640	2,796	291,645	2024/8/31
		US TREASURY N/B	1.25	2,480	2,569	267,938	2024/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	2,520	2,695	281,077	2024/9/30
		US TREASURY N/B	1.5	2,760	2,887	301,062	2024/9/30
		US TREASURY N/B	2.25	2,420	2,603	271,501	2024/10/31
		US TREASURY N/B	1.5	3,200	3,349	349,311	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	5,460	5,878	612,961	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	1,300	1,393	145,350	2024/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	6,150	6,440	671,659	2024/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	4,600	4,960	517,313	2024/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	3,800	4,020	419,234	2024/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,620	2,855	297,802	2025/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	5,470	5,706	595,122	2025/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	4,250	4,546	474,057	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,300	2,533	264,240	2025/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	2,530	2,777	289,675	2025/3/31
		US TREASURY N/B	2.875	2,540	2,820	294,079	2025/4/30
		US TREASURY N/B	0.375	4,650	4,655	485,489	2025/4/30
		US TREASURY N/B	2.125	3,950	4,258	444,118	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,470	2,746	286,417	2025/5/31
		US TREASURY N/B	0.25	3,920	3,901	406,861	2025/5/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,120	2,348	244,933	2025/6/30
		US TREASURY N/B	0.25	4,650	4,625	482,306	2025/6/30
		US TREASURY N/B	2.875	2,250	2,508	261,630	2025/7/31
		US TREASURY N/B	0.25	4,720	4,692	489,336	2025/7/31
		US TREASURY N/B	2.0	5,300	5,700	594,459	2025/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,890	2,099	218,953	2025/8/31
		US TREASURY N/B	0.25	5,000	4,968	518,120	2025/8/31
		US TREASURY N/B	3.0	2,430	2,731	284,887	2025/9/30

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	0.25	5,670	5,631	587,248	2025/9/30
		US TREASURY N/B	3.0	2,200	2,476	258,299	2025/10/31
		US TREASURY N/B	0.25	5,000	4,964	517,652	2025/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	5,570	6,073	633,296	2025/11/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,720	1,929	201,179	2025/11/30
		US TREASURY N/B	0.375	5,800	5,790	603,855	2025/11/30
		US TREASURY N/B	2.625	1,700	1,888	196,914	2025/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	2,820	3,136	327,060	2026/1/31
		US TREASURY N/B	1.625	4,940	5,242	546,715	2026/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	1,700	1,881	196,166	2026/2/28
		US TREASURY N/B	2.25	2,670	2,922	304,747	2026/3/31
		US TREASURY N/B	2.375	2,500	2,755	287,381	2026/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	5,420	5,758	600,456	2026/5/15
		US TREASURY N/B	2.125	2,700	2,942	306,819	2026/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	2,700	2,907	303,167	2026/6/30
		US TREASURY N/B	1.875	2,600	2,801	292,098	2026/7/31
		US TREASURY N/B	1.5	5,130	5,418	565,089	2026/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,880	3,022	315,155	2026/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,550	2,712	282,876	2026/9/30
		US TREASURY N/B	1.625	2,520	2,681	279,599	2026/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	3,910	4,247	442,885	2026/11/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,550	2,713	282,949	2026/11/30
		US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,216	335,374	2026/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	4,470	4,725	492,733	2027/1/31
		US TREASURY N/B	2.25	2,730	3,011	314,031	2027/2/15
		US TREASURY N/B	1.125	1,000	1,034	107,832	2027/2/28
		US TREASURY N/B	0.625	2,800	2,807	292,788	2027/3/31
		US TREASURY N/B	0.5	4,180	4,155	433,387	2027/4/30
		US TREASURY N/B	2.375	4,620	5,143	536,387	2027/5/15
		US TREASURY N/B	0.5	5,600	5,563	580,158	2027/5/31
		US TREASURY N/B	0.5	3,500	3,474	362,313	2027/6/30
		US TREASURY N/B	2.25	5,550	6,140	640,359	2027/8/15
		US TREASURY N/B	0.5	4,800	4,755	495,910	2027/8/31
		US TREASURY N/B	0.375	4,370	4,289	447,301	2027/9/30
		US TREASURY N/B	0.5	3,000	2,966	309,369	2027/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	5,240	5,806	605,488	2027/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	5,850	6,698	698,517	2028/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	6,090	7,045	734,740	2028/5/15
		US TREASURY N/B	5.5	220	298	31,161	2028/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	6,840	7,933	827,259	2028/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,480	7,659	798,712	2028/11/15
		US TREASURY N/B	5.25	530	718	74,970	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.625	5,640	6,460	673,672	2029/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	5,010	5,648	589,003	2029/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	5,000	5,333	556,207	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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.75	2,700	2,910	303,530	2029/11/15
		US TREASURY N/B	1.5	6,300	6,646	693,122	2030/２/15
		US TREASURY N/B	6.25	780	1,162	121,254	2030/５/15
		US TREASURY N/B	0.625	7,320	7,135	744,127	2030/５/15
		US TREASURY N/B	0.625	10,150	9,867	1,029,004	2030/８/15
		US TREASURY N/B	0.875	4,000	3,975	414,610	2030/11/15
		US TREASURY N/B	5.375	610	876	91,400	2031/２/15
		US TREASURY N/B	4.5	540	791	82,544	2036/２/15
		US TREASURY N/B	5.0	130	203	21,207	2037/５/15
		US TREASURY N/B	4.375	690	1,023	106,724	2038/２/15
		US TREASURY N/B	4.5	520	783	81,738	2038/５/15
		US TREASURY N/B	3.5	960	1,300	135,588	2039/２/15
		US TREASURY N/B	4.25	1,290	1,908	199,007	2039/５/15
		US TREASURY N/B	4.5	1,340	2,044	213,156	2039/８/15
		US TREASURY N/B	4.375	1,600	2,412	251,529	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	780	1,212	126,471	2040/２/15
		US TREASURY N/B	4.375	950	1,438	150,054	2040/５/15
		US TREASURY N/B	1.125	4,970	4,688	488,956	2040/５/15
		US TREASURY N/B	3.875	1,410	2,014	210,030	2040/８/15
		US TREASURY N/B	1.125	5,440	5,117	533,689	2040/８/15
		US TREASURY N/B	4.25	770	1,153	120,289	2040/11/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,800	2,749	286,760	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	900	1,433	149,510	2041/２/15
		US TREASURY N/B	4.375	1,130	1,726	180,050	2041/５/15
		US TREASURY N/B	3.75	1,080	1,528	159,387	2041/８/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,040	1,353	141,185	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	1,340	1,748	182,332	2042/２/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,550	1,983	206,859	2042/５/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,640	2,022	210,888	2042/８/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,860	2,291	238,935	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	2,240	2,924	304,922	2043/２/15
		US TREASURY N/B	2.875	3,200	4,022	419,505	2043/５/15
		US TREASURY N/B	3.625	2,430	3,414	356,047	2043/８/15
		US TREASURY N/B	3.75	2,260	3,235	337,444	2043/11/15
		US TREASURY N/B	3.625	3,140	4,421	461,036	2044/２/15
		US TREASURY N/B	3.375	2,710	3,684	384,246	2044/５/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,450	4,523	471,658	2044/８/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,800	3,600	375,450	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	3,380	4,002	417,342	2045/２/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,800	3,608	376,248	2045/５/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,590	3,273	341,341	2045/８/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,820	3,643	379,901	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,220	2,632	274,564	2046/２/15
		US TREASURY N/B	2.5	2,410	2,858	298,043	2046/５/15
		US TREASURY N/B	2.25	3,250	3,682	383,987	2046/８/15

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	3,620	4,592	478,871	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,140	2,778	289,740	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,060	2,677	279,177	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	3,430	4,269	445,228	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	2,690	3,351	349,479	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,050	5,275	550,156	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,940	5,249	547,443	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	5,050	6,591	687,354	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	3,600	5,018	523,371	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,480	5,862	611,359	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	4,470	5,724	596,939	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	5,010	5,684	592,727	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	4,150	4,832	503,931	2049/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	3,860	4,153	433,118	2050/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	6,400	5,742	598,827	2050/5/15
		US TREASURY N/B	1.375	7,900	7,315	762,862	2050/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	900	886	92,473	2050/11/15
小計						88,054,178	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	GOV OF CANADA	1.5	610	619	50,370	2022/2/1
		GOV OF CANADA	0.5	1,450	1,455	118,401	2022/3/1
		GOV OF CANADA	1.5	1,100	1,119	91,091	2022/5/1
		GOV OF CANADA	2.75	1,080	1,120	91,139	2022/6/1
		GOV OF CANADA	0.25	1,500	1,500	122,068	2022/8/1
		GOV OF CANADA	1.0	2,110	2,137	173,907	2022/9/1
		GOV OF CANADA	0.25	3,100	3,100	252,197	2022/11/1
		GOV OF CANADA	0.25	1,460	1,459	118,738	2023/2/1
		GOV OF CANADA	1.75	1,810	1,869	152,083	2023/3/1
		GOV OF CANADA	1.5	1,170	1,205	98,045	2023/6/1
		GOV OF CANADA	2.0	1,960	2,050	166,834	2023/9/1
		GOV OF CANADA	2.25	840	892	72,564	2024/3/1
		GOV OF CANADA	0.25	470	468	38,141	2024/4/1
		GOV OF CANADA	2.5	1,180	1,268	103,171	2024/6/1
		GOV OF CANADA	1.5	840	875	71,237	2024/9/1
		GOV OF CANADA	1.25	1,090	1,129	91,859	2025/3/1
		GOV OF CANADA	2.25	1,100	1,189	96,752	2025/6/1
		GOV OF CANADA	0.5	3,500	3,509	285,490	2025/9/1
		GOV OF CANADA	0.25	950	938	76,351	2026/3/1
		GOV OF CANADA	1.5	1,150	1,212	98,601	2026/6/1
		GOV OF CANADA	1.0	1,330	1,368	111,312	2027/6/1
		GOV OF CANADA	2.0	1,000	1,102	89,681	2028/6/1
		GOV OF CANADA	5.75	350	495	40,336	2029/6/1
		GOV OF CANADA	2.25	1,410	1,592	129,583	2029/6/1
		GOV OF CANADA	1.25	3,600	3,761	306,009	2030/6/1
		GOV OF CANADA	0.5	1,410	1,369	111,375	2030/12/1

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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	GOV OF CANADA	5.75	950	1,492	121,423	2033/6/1
		GOV OF CANADA	5.0	860	1,377	112,062	2037/6/1
		GOV OF CANADA	4.0	950	1,445	117,587	2041/6/1
		GOV OF CANADA	3.5	1,180	1,755	142,846	2045/12/1
		GOV OF CANADA	2.75	1,080	1,455	118,396	2048/12/1
		GOV OF CANADA	2.0	2,400	2,828	230,094	2051/12/1
		GOV OF CANADA	2.75	420	623	50,682	2064/12/1
小計						4,050,443	
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	7.25	19,950	20,509	107,675	2021/12/9
		UNITED MEXICAN STATE	6.5	26,930	27,745	145,662	2022/6/9
		UNITED MEXICAN STATE	6.75	21,050	22,110	116,080	2023/3/9
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	22,780	25,018	131,346	2023/12/7
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	21,980	24,572	129,008	2024/9/5
		UNITED MEXICAN STATE	10.0	24,140	28,855	151,492	2024/12/5
		UNITED MEXICAN STATE	5.75	18,620	19,383	101,761	2026/3/5
		UNITED MEXICAN STATE	7.5	27,110	30,685	161,097	2027/6/3
		UNITED MEXICAN STATE	8.5	27,620	33,546	176,118	2029/5/31
		UNITED MEXICAN STATE	7.75	13,346	15,608	81,944	2031/5/29
		UNITED MEXICAN STATE	7.75	7,560	8,831	46,366	2034/11/23
		UNITED MEXICAN STATE	10.0	6,300	8,715	45,754	2036/11/20
		UNITED MEXICAN STATE	8.5	17,820	21,673	113,786	2038/11/18
		UNITED MEXICAN STATE	7.75	18,100	20,378	106,988	2042/11/13
		UNITED MEXICAN STATE	8.0	16,400	18,872	99,078	2047/11/7
小計						1,714,161	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	－	1,350	1,360	171,391	2021/12/10
		GOV OF GERMANY	2.0	1,830	1,884	237,411	2022/1/4
		GOV OF GERMANY	－	1,440	1,453	183,141	2022/3/11
		GOV OF GERMANY	－	2,070	2,091	263,445	2022/4/8
		GOV OF GERMANY	－	1,220	1,234	155,469	2022/6/10
		GOV OF GERMANY	1.75	2,290	2,382	300,087	2022/7/4
		GOV OF GERMANY	1.5	2,220	2,309	290,944	2022/9/4
		GOV OF GERMANY	－	1,600	1,622	204,342	2022/9/16
		GOV OF GERMANY	－	1,850	1,877	236,493	2022/10/7
		GOV OF GERMANY	1.5	1,920	2,018	254,238	2023/2/15
		GOV OF GERMANY	－	1,860	1,895	238,838	2023/4/14
		GOV OF GERMANY	1.5	2,310	2,441	307,547	2023/5/15
		GOV OF GERMANY	2.0	1,840	1,980	249,526	2023/8/15
		GOV OF GERMANY	－	2,250	2,303	290,178	2023/10/13
		GOV OF GERMANY	1.75	2,020	2,187	275,575	2024/2/15
		GOV OF GERMANY	－	2,510	2,578	324,837	2024/4/5
		GOV OF GERMANY	1.5	2,020	2,183	274,994	2024/5/15
		GOV OF GERMANY	1.0	2,210	2,360	297,395	2024/8/15
		GOV OF GERMANY	－	3,370	3,476	437,906	2024/10/18

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	
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	0.5	2,650	2,798	352,580	2025/2/15
		GOV OF GERMANY	－	1,760	1,822	229,580	2025/4/11
		GOV OF GERMANY	1.0	2,480	2,694	339,448	2025/8/15
		GOV OF GERMANY	－	2,420	2,515	316,859	2025/10/10
		GOV OF GERMANY	－	350	363	45,832	2025/10/10
		GOV OF GERMANY	0.5	2,600	2,780	350,197	2026/2/15
		GOV OF GERMANY	－	2,990	3,127	394,003	2026/8/15
		GOV OF GERMANY	0.25	3,360	3,579	450,885	2027/2/15
		GOV OF GERMANY	6.5	1,010	1,507	189,922	2027/7/4
		GOV OF GERMANY	0.5	2,780	3,020	380,511	2027/8/15
		GOV OF GERMANY	－	2,030	2,135	268,994	2027/11/15
		GOV OF GERMANY	5.625	1,300	1,905	240,072	2028/1/4
		GOV OF GERMANY	0.5	2,720	2,968	373,960	2028/2/15
		GOV OF GERMANY	4.75	1,140	1,629	205,269	2028/7/4
		GOV OF GERMANY	0.25	2,380	2,562	322,755	2028/8/15
		GOV OF GERMANY	0.25	2,350	2,536	319,520	2029/2/15
		GOV OF GERMANY	－	2,450	2,595	326,940	2029/8/15
		GOV OF GERMANY	6.25	740	1,221	153,928	2030/1/4
		GOV OF GERMANY	－	2,710	2,873	362,003	2030/2/15
		GOV OF GERMANY	－	3,150	3,341	420,917	2030/8/15
		GOV OF GERMANY	－	700	744	93,761	2030/8/15
		GOV OF GERMANY	5.5	1,850	3,033	382,164	2031/1/4
		GOV OF GERMANY	4.75	2,240	3,905	491,937	2034/7/4
		GOV OF GERMANY	－	2,200	2,335	294,198	2035/5/15
		GOV OF GERMANY	4.0	2,530	4,403	554,667	2037/1/4
		GOV OF GERMANY	4.25	1,780	3,374	425,076	2039/7/4
		GOV OF GERMANY	4.75	1,920	3,926	494,560	2040/7/4
		GOV OF GERMANY	3.25	1,740	3,143	396,010	2042/7/4
		GOV OF GERMANY	2.5	2,660	4,483	564,726	2044/7/4
		GOV OF GERMANY	2.5	2,850	4,937	622,032	2046/8/15
		GOV OF GERMANY	1.25	2,440	3,460	435,916	2048/8/15
		GOV OF GERMANY	－	1,470	1,553	195,643	2050/8/15
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	2.15	2,150	2,208	278,148	2021/12/15
		GOV OF ITALY	5.0	1,690	1,803	227,172	2022/3/1
		GOV OF ITALY	1.2	1,920	1,961	247,112	2022/4/1
		GOV OF ITALY	1.35	1,630	1,669	210,300	2022/4/15
		GOV OF ITALY	1.0	1,380	1,412	177,966	2022/7/15
		GOV OF ITALY	0.9	1,900	1,943	244,776	2022/8/1
		GOV OF ITALY	5.5	1,010	1,113	140,327	2022/9/1
		GOV OF ITALY	1.45	1,600	1,654	208,402	2022/9/15
		GOV OF ITALY	5.5	1,460	1,623	204,542	2022/11/1
		GOV OF ITALY	0.05	1,330	1,343	169,227	2023/1/15
		GOV OF ITALY	0.95	1,370	1,411	177,763	2023/3/1
		GOV OF ITALY	0.95	1,690	1,742	219,455	2023/3/15
		GOV OF ITALY	4.5	1,940	2,169	273,255	2023/5/1

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	0.6	1,540	1,578	198,892	2023/6/15
			GOV OF ITALY	4.75	2,000	2,274	286,476	2023/8/1
			GOV OF ITALY	0.3	1,640	1,668	210,233	2023/8/15
			GOV OF ITALY	2.45	1,700	1,834	231,120	2023/10/1
			GOV OF ITALY	0.65	1,610	1,656	208,654	2023/10/15
			GOV OF ITALY	－	1,540	1,553	195,651	2024/1/15
			GOV OF ITALY	4.5	1,980	2,286	288,022	2024/3/1
			GOV OF ITALY	1.85	1,400	1,500	189,077	2024/5/15
			GOV OF ITALY	1.75	2,630	2,815	354,642	2024/7/1
			GOV OF ITALY	3.75	1,710	1,963	247,286	2024/9/1
			GOV OF ITALY	1.45	1,540	1,640	206,632	2024/11/15
			GOV OF ITALY	2.5	1,720	1,903	239,808	2024/12/1
			GOV OF ITALY	0.35	1,770	1,808	227,778	2025/2/1
			GOV OF ITALY	5.0	2,000	2,437	307,032	2025/3/1
			GOV OF ITALY	1.45	1,540	1,646	207,436	2025/5/15
			GOV OF ITALY	1.5	1,730	1,855	233,750	2025/6/1
			GOV OF ITALY	1.85	1,730	1,883	237,267	2025/7/1
			GOV OF ITALY	2.5	1,440	1,621	204,295	2025/11/15
			GOV OF ITALY	2.0	2,880	3,175	399,987	2025/12/1
			GOV OF ITALY	0.5	1,440	1,477	186,154	2026/2/1
			GOV OF ITALY	4.5	1,940	2,395	301,821	2026/3/1
			GOV OF ITALY	1.6	1,740	1,890	238,126	2026/6/1
			GOV OF ITALY	2.1	1,520	1,694	213,474	2026/7/15
			GOV OF ITALY	1.25	2,330	2,491	313,850	2026/12/1
			GOV OF ITALY	0.85	1,710	1,785	224,879	2027/1/15
			GOV OF ITALY	2.2	1,710	1,933	243,611	2027/6/1
			GOV OF ITALY	2.05	2,230	2,503	315,348	2027/8/1
			GOV OF ITALY	0.95	1,300	1,363	171,781	2027/9/15
			GOV OF ITALY	6.5	1,880	2,684	338,111	2027/11/1
			GOV OF ITALY	2.0	2,850	3,203	403,484	2028/2/1
			GOV OF ITALY	4.75	1,870	2,500	314,976	2028/9/1
			GOV OF ITALY	2.8	2,550	3,044	383,545	2028/12/1
			GOV OF ITALY	3.0	2,010	2,454	309,233	2029/8/1
			GOV OF ITALY	5.25	1,890	2,687	338,592	2029/11/1
			GOV OF ITALY	3.5	2,490	3,176	400,139	2030/3/1
			GOV OF ITALY	1.35	2,330	2,520	317,525	2030/4/1
			GOV OF ITALY	0.95	2,090	2,180	274,711	2030/8/1
			GOV OF ITALY	1.65	3,230	3,578	450,766	2030/12/1
			GOV OF ITALY	6.0	2,460	3,800	478,798	2031/5/1
			GOV OF ITALY	1.65	2,180	2,415	304,258	2032/3/1
			GOV OF ITALY	5.75	1,740	2,752	346,689	2033/2/1
			GOV OF ITALY	2.45	1,820	2,185	275,350	2033/9/1
			GOV OF ITALY	5.0	2,180	3,345	421,404	2034/8/1
			GOV OF ITALY	3.35	1,570	2,084	262,636	2035/3/1
			GOV OF ITALY	1.45	1,210	1,295	163,255	2036/3/1

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	2.25	1,410	1,674	210,940	2036/９/１
			GOV OF ITALY	4.0	2,580	3,719	468,536	2037/２/１
			GOV OF ITALY	2.95	1,230	1,600	201,601	2038/９/１
			GOV OF ITALY	5.0	2,160	3,575	450,413	2039/８/１
			GOV OF ITALY	3.1	1,540	2,051	258,391	2040/３/１
			GOV OF ITALY	5.0	1,920	3,209	404,333	2040/９/１
			GOV OF ITALY	1.8	1,060	1,169	147,262	2041/３/１
			GOV OF ITALY	4.75	1,610	2,740	345,267	2044/９/１
			GOV OF ITALY	3.25	1,620	2,287	288,138	2046/９/１
			GOV OF ITALY	2.7	1,700	2,198	276,927	2047/３/１
			GOV OF ITALY	3.45	1,540	2,259	284,654	2048/３/１
			GOV OF ITALY	3.85	1,170	1,843	232,238	2049/９/１
			GOV OF ITALY	2.45	1,220	1,519	191,375	2050/９/１
			GOV OF ITALY	1.7	870	921	116,081	2051/９/１
			GOV OF ITALY	2.8	860	1,147	144,600	2067/３/１
	フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	－	2,430	2,451	308,850	2022/２/25
			GOV OF FRANCE	3.0	4,180	4,396	553,831	2022/４/25
			GOV OF FRANCE	－	3,260	3,296	415,234	2022/５/25
			GOV OF FRANCE	2.25	3,520	3,721	468,764	2022/10/25
			GOV OF FRANCE	－	2,330	2,369	298,436	2023/２/25
			GOV OF FRANCE	－	3,740	3,806	479,452	2023/３/25
			GOV OF FRANCE	1.75	5,160	5,482	690,657	2023/５/25
			GOV OF FRANCE	4.25	3,830	4,390	553,114	2023/10/25
			GOV OF FRANCE	－	4,110	4,212	530,674	2024/３/25
			GOV OF FRANCE	2.25	3,030	3,348	421,861	2024/５/25
			GOV OF FRANCE	1.75	3,220	3,542	446,199	2024/11/25
			GOV OF FRANCE	－	4,550	4,689	590,691	2025/３/25
			GOV OF FRANCE	0.5	4,220	4,450	560,613	2025/５/25
			GOV OF FRANCE	6.0	2,270	3,026	381,269	2025/10/25
			GOV OF FRANCE	1.0	3,070	3,330	419,545	2025/11/25
			GOV OF FRANCE	－	2,370	2,451	308,768	2026/２/25
			GOV OF FRANCE	3.5	3,770	4,631	583,380	2026/４/25
			GOV OF FRANCE	0.5	4,200	4,470	563,092	2026/５/25
			GOV OF FRANCE	0.25	3,960	4,170	525,363	2026/11/25
			GOV OF FRANCE	1.0	3,030	3,349	421,957	2027/５/25
			GOV OF FRANCE	2.75	5,050	6,236	785,660	2027/10/25
			GOV OF FRANCE	0.75	4,130	4,536	571,469	2028/５/25
			GOV OF FRANCE	0.75	3,630	4,003	504,278	2028/11/25
			GOV OF FRANCE	5.5	3,440	5,210	656,388	2029/４/25
			GOV OF FRANCE	0.5	3,660	3,969	500,006	2029/５/25
			GOV OF FRANCE	－	3,650	3,795	478,074	2029/11/25
			GOV OF FRANCE	2.5	4,440	5,693	717,209	2030/５/25
			GOV OF FRANCE	－	2,840	2,944	370,964	2030/11/25
			GOV OF FRANCE	1.5	4,720	5,650	711,854	2031/５/25
			GOV OF FRANCE	5.75	2,700	4,681	589,789	2032/10/25

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	1.25	4,010	4,792	603,733	2034/5/25
		GOV OF FRANCE	4.75	2,540	4,369	550,427	2035/4/25
		GOV OF FRANCE	1.25	3,280	3,961	499,004	2036/5/25
		GOV OF FRANCE	4.0	2,360	4,079	513,910	2038/10/25
		GOV OF FRANCE	1.75	2,800	3,715	468,027	2039/6/25
		GOV OF FRANCE	0.5	930	1,007	126,912	2040/5/25
		GOV OF FRANCE	4.5	3,330	6,336	798,258	2041/4/25
		GOV OF FRANCE	3.25	2,410	4,182	526,915	2045/5/25
		GOV OF FRANCE	2.0	2,380	3,485	439,123	2048/5/25
		GOV OF FRANCE	1.5	2,780	3,725	469,315	2050/5/25
		GOV OF FRANCE	0.75	2,020	2,264	285,256	2052/5/25
		GOV OF FRANCE	4.0	1,720	3,753	472,816	2055/4/25
		GOV OF FRANCE	4.0	1,450	3,360	423,308	2060/4/25
		GOV OF FRANCE	1.75	1,180	1,824	229,809	2066/5/25
オランダ	国債証券	GOV OF NETHERLANDS	－	1,490	1,502	189,220	2022/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.25	1,430	1,499	188,858	2022/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	3.75	990	1,084	136,638	2023/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	1.75	1,830	1,951	245,810	2023/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	－	1,410	1,444	181,913	2024/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.0	1,480	1,629	205,268	2024/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.25	1,420	1,486	187,293	2025/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.5	1,510	1,614	203,435	2026/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	－	1,170	1,219	153,612	2027/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	1,360	1,490	187,765	2027/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	5.5	1,120	1,621	204,292	2028/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.75	1,520	1,684	212,190	2028/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.25	1,120	1,202	151,537	2029/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	－	1,250	1,315	165,665	2030/7/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.5	1,290	1,765	222,351	2033/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	4.0	1,430	2,466	310,720	2037/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	0.5	810	934	117,754	2040/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	3.75	1,510	2,837	357,407	2042/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	2.75	1,530	2,753	346,875	2047/1/15
		GOV OF NETHERLANDS	－	570	593	74,709	2052/1/15
スペイン	国債証券	GOV OF SPAIN	5.85	1,550	1,664	209,694	2022/1/31
		GOV OF SPAIN	0.4	2,570	2,606	328,360	2022/4/30
		GOV OF SPAIN	0.45	1,750	1,784	224,806	2022/10/31
		GOV OF SPAIN	5.4	2,020	2,281	287,379	2023/1/31
		GOV OF SPAIN	－	2,300	2,332	293,863	2023/4/30
		GOV OF SPAIN	0.35	1,980	2,028	255,540	2023/7/30
		GOV OF SPAIN	4.4	1,780	2,038	256,812	2023/10/31
		GOV OF SPAIN	4.8	1,540	1,802	227,060	2024/1/31
		GOV OF SPAIN	3.8	1,890	2,172	273,682	2024/4/30
		GOV OF SPAIN	0.25	1,590	1,637	206,217	2024/7/30
		GOV OF SPAIN	2.75	2,400	2,710	341,449	2024/10/31

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
	スペイン	国債証券	GOV OF SPAIN	—	2,190	2,235	281,661	2025/1/31
			GOV OF SPAIN	1.6	1,950	2,132	268,583	2025/4/30
			GOV OF SPAIN	4.65	2,050	2,545	320,669	2025/7/30
			GOV OF SPAIN	2.15	2,230	2,519	317,396	2025/10/31
			GOV OF SPAIN	—	400	408	51,504	2026/1/31
			GOV OF SPAIN	1.95	2,380	2,688	338,641	2026/4/30
			GOV OF SPAIN	5.9	1,990	2,706	340,876	2026/7/30
			GOV OF SPAIN	1.3	2,210	2,433	306,516	2026/10/31
			GOV OF SPAIN	1.5	1,950	2,181	274,755	2027/4/30
			GOV OF SPAIN	0.8	1,710	1,833	230,980	2027/7/30
			GOV OF SPAIN	1.45	1,920	2,148	270,637	2027/10/31
			GOV OF SPAIN	1.4	1,970	2,207	278,098	2028/4/30
			GOV OF SPAIN	1.4	2,080	2,336	294,367	2028/7/30
			GOV OF SPAIN	5.15	1,610	2,291	288,687	2028/10/31
			GOV OF SPAIN	6.0	2,170	3,264	411,232	2029/1/31
			GOV OF SPAIN	1.45	1,930	2,186	275,496	2029/4/30
			GOV OF SPAIN	0.6	2,460	2,611	328,917	2029/10/31
			GOV OF SPAIN	0.5	2,030	2,133	268,696	2030/4/30
			GOV OF SPAIN	1.95	2,030	2,417	304,478	2030/7/30
			GOV OF SPAIN	1.25	2,430	2,725	343,386	2030/10/31
			GOV OF SPAIN	5.75	1,920	3,172	399,650	2032/7/30
			GOV OF SPAIN	2.35	1,930	2,446	308,190	2033/7/30
			GOV OF SPAIN	1.85	1,940	2,360	297,360	2035/7/30
			GOV OF SPAIN	4.2	1,860	2,977	375,014	2037/1/31
			GOV OF SPAIN	4.9	1,770	3,220	405,702	2040/7/30
			GOV OF SPAIN	1.2	1,250	1,393	175,559	2040/10/31
			GOV OF SPAIN	4.7	1,920	3,460	435,923	2041/7/30
			GOV OF SPAIN	5.15	1,260	2,503	315,395	2044/10/31
			GOV OF SPAIN	2.9	1,630	2,460	309,927	2046/10/31
			GOV OF SPAIN	2.7	1,300	1,923	242,336	2048/10/31
			GOV OF SPAIN	1.0	1,270	1,325	166,945	2050/10/31
			GOV OF SPAIN	3.45	1,390	2,551	321,412	2066/7/30
	ベルギー	国債証券	GOV OF BELGIUM	4.0	1,140	1,210	152,533	2022/3/28
			GOV OF BELGIUM	4.25	1,560	1,702	214,457	2022/9/28
			GOV OF BELGIUM	2.25	1,220	1,314	165,582	2023/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.2	980	1,007	126,861	2023/10/22
			GOV OF BELGIUM	2.6	1,330	1,489	187,656	2024/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.5	1,230	1,289	162,469	2024/10/22
			GOV OF BELGIUM	0.8	1,770	1,893	238,480	2025/6/22
			GOV OF BELGIUM	4.5	930	1,189	149,855	2026/3/28
			GOV OF BELGIUM	1.0	1,610	1,760	221,784	2026/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.8	1,260	1,378	173,678	2027/6/22
			GOV OF BELGIUM	—	770	801	100,966	2027/10/22
			GOV OF BELGIUM	5.5	1,640	2,383	300,230	2028/3/28
			GOV OF BELGIUM	0.8	1,580	1,744	219,796	2028/6/22

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	0.9	1,540	1,725	217,331	2029/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.1	1,230	1,290	162,619	2030/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.0	1,470	1,682	211,920	2031/6/22
			GOV OF BELGIUM	4.0	700	1,048	132,044	2032/3/28
			GOV OF BELGIUM	1.25	970	1,154	145,486	2033/4/22
			GOV OF BELGIUM	3.0	700	1,006	126,759	2034/6/22
			GOV OF BELGIUM	5.0	1,750	3,063	385,936	2035/3/28
			GOV OF BELGIUM	1.45	490	610	76,928	2037/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.9	780	1,040	131,090	2038/6/22
			GOV OF BELGIUM	0.4	480	508	64,009	2040/6/22
			GOV OF BELGIUM	4.25	1,520	2,780	350,306	2041/3/28
			GOV OF BELGIUM	3.75	990	1,825	229,966	2045/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.6	1,020	1,365	171,963	2047/6/22
			GOV OF BELGIUM	1.7	670	931	117,311	2050/6/22
			GOV OF BELGIUM	2.25	550	900	113,444	2057/6/22
			GOV OF BELGIUM	2.15	650	1,106	139,371	2066/6/22
	オーストリア	国債証券	GOV OF AUSTRIA	3.65	700	741	93,443	2022/4/20
			GOV OF AUSTRIA	—	790	800	100,834	2022/9/20
			GOV OF AUSTRIA	3.4	870	940	118,481	2022/11/22
			GOV OF AUSTRIA	—	590	600	75,611	2023/4/20
			GOV OF AUSTRIA	—	1,060	1,080	136,111	2023/7/15
			GOV OF AUSTRIA	1.75	1,050	1,125	141,818	2023/10/20
			GOV OF AUSTRIA	—	930	954	120,297	2024/7/15
			GOV OF AUSTRIA	1.65	900	984	124,046	2024/10/21
			GOV OF AUSTRIA	1.2	1,020	1,117	140,727	2025/10/20
			GOV OF AUSTRIA	4.85	840	1,091	137,514	2026/3/15
			GOV OF AUSTRIA	0.75	1,240	1,345	169,480	2026/10/20
			GOV OF AUSTRIA	0.5	940	1,010	127,260	2027/4/20
			GOV OF AUSTRIA	6.25	880	1,290	162,550	2027/7/15
			GOV OF AUSTRIA	0.75	910	999	125,917	2028/2/20
			GOV OF AUSTRIA	0.5	1,040	1,129	142,272	2029/2/20
			GOV OF AUSTRIA	—	910	949	119,617	2030/2/20
			GOV OF AUSTRIA	2.4	760	1,040	131,012	2034/5/23
			GOV OF AUSTRIA	4.15	1,340	2,307	290,612	2037/3/15
			GOV OF AUSTRIA	—	290	293	37,001	2040/10/20
			GOV OF AUSTRIA	3.15	630	1,114	140,412	2044/6/20
			GOV OF AUSTRIA	1.5	690	960	120,988	2047/2/20
			GOV OF AUSTRIA	0.75	350	421	53,102	2051/3/20
			GOV OF AUSTRIA	3.8	350	861	108,528	2062/1/26
			GOV OF AUSTRIA	1.5	240	410	51,731	2086/11/2
			GOV OF AUSTRIA	2.1	560	1,272	160,241	2117/9/20
	フィンランド	国債証券	GOV OF FINLAND	—	430	434	54,722	2022/4/15
			GOV OF FINLAND	1.625	530	552	69,616	2022/9/15
			GOV OF FINLAND	1.5	340	358	45,130	2023/4/15
			GOV OF FINLAND	—	670	684	86,175	2023/9/15

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	
フィンランド	国債証券	GOV OF FINLAND	2.0	510	557	70,246	2024/4/15
		GOV OF FINLAND	－	280	287	36,268	2024/9/15
		GOV OF FINLAND	4.0	520	634	79,932	2025/7/4
		GOV OF FINLAND	0.875	620	668	84,149	2025/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	610	649	81,846	2026/4/15
		GOV OF FINLAND	0.5	550	592	74,618	2027/9/15
		GOV OF FINLAND	2.75	470	591	74,510	2028/7/4
		GOV OF FINLAND	0.5	510	553	69,667	2028/9/15
		GOV OF FINLAND	0.5	480	523	65,911	2029/9/15
		GOV OF FINLAND	－	360	375	47,307	2030/9/15
		GOV OF FINLAND	0.75	350	393	49,540	2031/4/15
		GOV OF FINLAND	1.125	390	463	58,423	2034/4/15
		GOV OF FINLAND	0.125	420	440	55,514	2036/4/15
		GOV OF FINLAND	0.25	320	342	43,092	2040/9/15
		GOV OF FINLAND	2.625	380	608	76,708	2042/7/4
		GOV OF FINLAND	1.375	350	483	60,851	2047/4/15
アイルランド	国債証券	GOV OF IRELAND	0.8	560	570	71,909	2022/3/15
		GOV OF IRELAND	－	510	517	65,126	2022/10/18
		GOV OF IRELAND	3.9	630	696	87,782	2023/3/20
		GOV OF IRELAND	3.4	790	897	112,998	2024/3/18
		GOV OF IRELAND	5.4	1,050	1,324	166,848	2025/3/13
		GOV OF IRELAND	1.0	1,040	1,131	142,571	2026/5/15
		GOV OF IRELAND	0.2	710	743	93,631	2027/5/15
		GOV OF IRELAND	0.9	770	849	107,051	2028/5/15
		GOV OF IRELAND	1.1	910	1,027	129,484	2029/5/15
		GOV OF IRELAND	2.4	830	1,050	132,287	2030/5/15
		GOV OF IRELAND	0.2	740	778	98,006	2030/10/18
		GOV OF IRELAND	1.35	640	750	94,565	2031/3/18
		GOV OF IRELAND	1.3	420	499	62,889	2033/5/15
		GOV OF IRELAND	0.4	390	417	52,638	2035/5/15
		GOV OF IRELAND	1.7	490	628	79,197	2037/5/15
		GOV OF IRELAND	2.0	840	1,204	151,771	2045/2/18
		GOV OF IRELAND	1.5	540	721	90,897	2050/5/15
小計						85,110,268	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.0	1,470	1,544	215,416	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	2,070	2,089	291,466	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	2,260	2,332	325,336	2022/9/7
		UK TREASURY	0.125	2,750	2,760	384,938	2023/1/31
		UK TREASURY	0.75	2,260	2,309	322,156	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	1,260	1,340	186,986	2023/9/7
		UK TREASURY	0.125	610	612	85,476	2024/1/31
		UK TREASURY	1.0	2,210	2,290	319,430	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	1,190	1,315	183,477	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	880	1,069	149,173	2025/3/7

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	0.625	2,910	2,997	418,114	2025/6/7
		UK TREASURY	2.0	1,250	1,371	191,238	2025/9/7
		UK TREASURY	0.125	1,910	1,920	267,889	2026/1/30
		UK TREASURY	1.5	1,470	1,595	222,496	2026/7/22
		UK TREASURY	1.25	1,710	1,844	257,237	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	1,310	1,692	236,105	2027/12/7
		UK TREASURY	0.125	1,310	1,310	182,835	2028/1/31
		UK TREASURY	1.625	1,520	1,700	237,099	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	950	1,391	194,019	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	1,810	1,916	267,348	2029/10/22
		UK TREASURY	0.375	2,260	2,282	318,374	2030/10/22
		UK TREASURY	4.75	1,430	2,063	287,788	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	1,750	2,514	350,753	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	1,250	1,917	267,422	2034/9/7
		UK TREASURY	0.625	1,660	1,667	232,522	2035/7/31
		UK TREASURY	4.25	1,690	2,599	362,613	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	2,270	2,664	371,645	2037/9/7
		UK TREASURY	4.75	1,320	2,244	312,986	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	1,280	2,086	290,988	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,380	2,290	319,474	2040/12/7
		UK TREASURY	1.25	1,790	1,960	273,399	2041/10/22
		UK TREASURY	4.5	1,780	3,134	437,146	2042/12/7
		UK TREASURY	3.25	1,940	2,952	411,842	2044/1/22
		UK TREASURY	3.5	2,000	3,190	444,919	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,470	2,662	371,378	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	2,080	2,428	338,698	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	930	1,153	160,912	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,260	2,390	333,360	2049/12/7
		UK TREASURY	0.625	1,580	1,505	209,938	2050/10/22
		UK TREASURY	3.75	1,190	2,182	304,394	2052/7/22
		UK TREASURY	1.625	1,310	1,637	228,435	2054/10/22
		UK TREASURY	4.25	1,570	3,255	454,087	2055/12/7
		UK TREASURY	1.75	1,820	2,406	335,604	2057/7/22
		UK TREASURY	4.0	1,140	2,409	336,085	2060/1/22
		UK TREASURY	0.5	960	886	123,701	2061/10/22
		UK TREASURY	2.5	1,340	2,251	314,052	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	1,400	2,982	415,998	2068/7/22
		UK TREASURY	1.625	710	1,017	141,968	2071/10/22
小計						13,688,738	
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	3.5	9,615	10,171	124,910	2022/6/1
		GOV OF SWEDEN	1.5	8,400	8,870	108,935	2023/11/13
		GOV OF SWEDEN	2.5	6,380	7,197	88,387	2025/5/12
		GOV OF SWEDEN	1.0	6,020	6,480	79,584	2026/11/12
		GOV OF SWEDEN	0.75	5,160	5,526	67,863	2028/5/12

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	
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	千円	
	国債証券	GOV OF SWEDEN	0.75	5,130	5,529	67,902	2029/11/12
		GOV OF SWEDEN	0.125	3,200	3,246	39,872	2031/5/12
		GOV OF SWEDEN	3.5	4,000	6,291	77,255	2039/3/30
小計						654,711	
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		
	国債証券	GOV OF NORWAY	2.0	7,480	7,794	92,050	2023/5/24
		GOV OF NORWAY	3.0	5,470	5,937	70,122	2024/3/14
		GOV OF NORWAY	1.75	4,040	4,255	50,262	2025/3/13
		GOV OF NORWAY	1.5	3,380	3,540	41,809	2026/2/19
		GOV OF NORWAY	1.75	3,560	3,793	44,803	2027/2/17
		GOV OF NORWAY	2.0	3,330	3,628	42,854	2028/4/26
		GOV OF NORWAY	1.75	3,790	4,080	48,196	2029/9/6
		GOV OF NORWAY	1.375	4,170	4,358	51,468	2030/8/19
小計						441,568	
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	0.25	5,400	5,495	92,984	2022/11/15
		GOV OF DENMARK	1.5	5,820	6,193	104,794	2023/11/15
		GOV OF DENMARK	1.75	5,900	6,607	111,801	2025/11/15
		GOV OF DENMARK	0.5	7,000	7,531	127,439	2027/11/15
		GOV OF DENMARK	0.5	9,770	10,667	180,488	2029/11/15
		GOV OF DENMARK	4.5	11,420	21,949	371,392	2039/11/15
		GOV OF DENMARK	0.25	2,250	2,477	41,915	2052/11/15
小計						1,030,816	
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	2.25	3,410	3,515	99,976	2022/4/25
		GOV OF POLAND	—	2,730	2,729	77,613	2022/7/25
		GOV OF POLAND	5.75	2,390	2,635	74,950	2022/9/23
		GOV OF POLAND	2.5	3,920	4,127	117,381	2023/1/25
		GOV OF POLAND	4.0	2,120	2,359	67,093	2023/10/25
		GOV OF POLAND	2.5	2,910	3,138	89,252	2024/4/25
		GOV OF POLAND	2.25	3,010	3,238	92,089	2024/10/25
		GOV OF POLAND	0.75	1,900	1,923	54,702	2025/4/25
		GOV OF POLAND	3.25	2,610	2,937	83,543	2025/7/25
		GOV OF POLAND	2.5	4,300	4,718	134,194	2026/7/25
		GOV OF POLAND	2.5	2,790	3,069	87,303	2027/7/25
		GOV OF POLAND	2.75	3,120	3,495	99,422	2028/4/25
		GOV OF POLAND	5.75	740	1,021	29,059	2029/4/25
		GOV OF POLAND	2.75	4,790	5,396	153,479	2029/10/25
		GOV OF POLAND	1.25	940	929	26,445	2030/10/25
小計						1,286,510	
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	2.0	1,350	1,377	106,893	2021/12/21
		GOV OF AUSTRALIA	5.75	2,040	2,225	172,717	2022/7/15
		GOV OF AUSTRALIA	2.25	2,890	3,011	233,738	2022/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	5.5	3,240	3,649	283,250	2023/4/21

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	2.75	2,980	3,242	251,713	2024/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	0.25	2,720	2,724	211,444	2024/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	2,930	3,309	256,863	2025/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	0.25	2,490	2,479	192,475	2025/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.25	2,750	3,314	257,309	2026/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	0.5	2,710	2,715	210,806	2026/9/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.75	2,880	3,638	282,418	2027/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	2,610	2,988	231,937	2027/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.25	2,740	3,048	236,628	2028/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	2,950	3,400	263,924	2028/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	2,940	3,515	272,840	2029/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	3,210	3,717	288,577	2029/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.5	3,310	3,769	292,589	2030/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	1.0	2,890	2,883	223,799	2030/12/21
		GOV OF AUSTRALIA	1.5	2,460	2,566	199,215	2031/6/21
		GOV OF AUSTRALIA	1.0	2,440	2,413	187,343	2031/11/21
		GOV OF AUSTRALIA	1.25	1,720	1,739	135,030	2032/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	4.5	1,300	1,797	139,502	2033/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	810	954	74,083	2035/6/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.75	1,220	1,612	125,199	2037/4/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.25	710	887	68,893	2039/6/21
		GOV OF AUSTRALIA	2.75	1,070	1,244	96,627	2041/5/21
		GOV OF AUSTRALIA	3.0	1,270	1,544	119,903	2047/3/21
		GOV OF AUSTRALIA	1.75	1,420	1,330	103,271	2051/6/21
小計						5,518,998	
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	1.75	500	509	39,730	2022/4/1
		GOV OF SINGAPORE	3.125	660	691	53,972	2022/9/1
		GOV OF SINGAPORE	1.75	610	628	49,013	2023/2/1
		GOV OF SINGAPORE	2.75	760	806	62,886	2023/7/1
		GOV OF SINGAPORE	2.0	290	304	23,769	2024/2/1
		GOV OF SINGAPORE	3.0	660	722	56,393	2024/9/1
		GOV OF SINGAPORE	2.375	540	584	45,630	2025/6/1
		GOV OF SINGAPORE	0.5	300	299	23,366	2025/11/1
		GOV OF SINGAPORE	2.125	490	529	41,302	2026/6/1
		GOV OF SINGAPORE	3.5	760	887	69,265	2027/3/1
		GOV OF SINGAPORE	2.625	420	473	36,974	2028/5/1
		GOV OF SINGAPORE	2.875	630	732	57,171	2029/7/1
		GOV OF SINGAPORE	2.875	620	732	57,129	2030/9/1
		GOV OF SINGAPORE	3.375	570	724	56,538	2033/9/1
		GOV OF SINGAPORE	2.25	540	626	48,906	2036/8/1
		GOV OF SINGAPORE	2.375	390	469	36,650	2039/7/1
		GOV OF SINGAPORE	2.75	400	513	40,065	2042/4/1
		GOV OF SINGAPORE	2.75	610	805	62,861	2046/3/1

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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	GOV OF SINGAPORE	1.875	350	414	32,354	2050/3/1
小計						893,982	
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	3.62	780	794	20,374	2021/11/30
		GOV OF MALAYSIA	3.882	1,200	1,232	31,603	2022/3/10
		GOV OF MALAYSIA	3.418	810	832	21,357	2022/8/15
		GOV OF MALAYSIA	3.795	1,250	1,294	33,191	2022/9/30
		GOV OF MALAYSIA	3.48	1,610	1,666	42,733	2023/3/15
		GOV OF MALAYSIA	3.757	610	635	16,298	2023/4/20
		GOV OF MALAYSIA	3.8	830	869	22,291	2023/8/17
		GOV OF MALAYSIA	3.478	760	796	20,429	2024/6/14
		GOV OF MALAYSIA	4.181	830	889	22,815	2024/7/15
		GOV OF MALAYSIA	4.059	1,260	1,350	34,631	2024/9/30
		GOV OF MALAYSIA	3.882	730	782	20,068	2025/3/14
		GOV OF MALAYSIA	3.955	1,700	1,837	47,127	2025/9/15
		GOV OF MALAYSIA	4.392	810	894	22,943	2026/4/15
		GOV OF MALAYSIA	3.906	1,190	1,285	32,982	2026/7/15
		GOV OF MALAYSIA	3.9	1,010	1,094	28,070	2026/11/30
		GOV OF MALAYSIA	3.502	1,790	1,896	48,632	2027/5/31
		GOV OF MALAYSIA	3.899	1,350	1,462	37,508	2027/11/16
		GOV OF MALAYSIA	3.733	1,310	1,409	36,160	2028/6/15
		GOV OF MALAYSIA	3.885	2,000	2,166	55,560	2029/8/15
		GOV OF MALAYSIA	4.498	1,130	1,283	32,928	2030/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.232	1,730	1,938	49,714	2031/6/30
		GOV OF MALAYSIA	3.844	1,060	1,135	29,121	2033/4/15
		GOV OF MALAYSIA	4.642	1,100	1,254	32,167	2033/11/7
		GOV OF MALAYSIA	3.828	1,540	1,632	41,878	2034/7/5
		GOV OF MALAYSIA	4.254	600	661	16,975	2035/5/31
		GOV OF MALAYSIA	4.762	930	1,073	27,543	2037/4/7
		GOV OF MALAYSIA	4.893	890	1,037	26,602	2038/6/8
		GOV OF MALAYSIA	3.757	1,270	1,309	33,576	2040/5/22
		GOV OF MALAYSIA	4.935	740	856	21,960	2043/9/30
		GOV OF MALAYSIA	4.736	790	889	22,828	2046/3/15
		GOV OF MALAYSIA	4.921	930	1,066	27,367	2048/7/6
		GOV OF MALAYSIA	4.065	820	829	21,268	2050/6/15
小計						978,715	
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		
	国債証券	GOV OF ISRAEL	5.5	1,570	1,741	55,813	2022/1/31
		GOV OF ISRAEL	0.75	1,860	1,884	60,405	2022/7/31
		GOV OF ISRAEL	1.25	1,120	1,145	36,698	2022/11/30
		GOV OF ISRAEL	4.25	1,610	1,808	57,960	2023/3/31
		GOV OF ISRAEL	0.15	910	908	29,126	2023/7/31
		GOV OF ISRAEL	1.5	1,820	1,888	60,538	2023/11/30
		GOV OF ISRAEL	3.75	1,450	1,654	53,027	2024/3/31
		GOV OF ISRAEL	0.5	920	929	29,791	2025/4/30

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	
イスラエル			%	千イスラエルシュケル	千イスラエルシュケル	千円	
	国債証券	GOV OF ISRAEL	1.75	1,840	1,968	63,102	2025/8/31
		GOV OF ISRAEL	6.25	1,610	2,163	69,348	2026/10/30
		GOV OF ISRAEL	2.0	1,800	1,992	63,859	2027/3/31
		GOV OF ISRAEL	2.25	1,540	1,730	55,469	2028/9/28
		GOV OF ISRAEL	1.0	1,310	1,335	42,810	2030/3/31
		GOV OF ISRAEL	1.5	930	931	29,864	2037/5/31
		GOV OF ISRAEL	5.5	1,860	3,218	103,163	2042/1/31
		GOV OF ISRAEL	3.75	1,900	2,656	85,131	2047/3/31
小計						896,112	
合計						204,319,207	

（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12月10日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	204,319,207	96.6
コール・ローン等、その他	7,234,581	3.4
投資信託財産総額	211,553,788	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（200,502,925千円）の投資信託財産総額（211,553,788千円）に対する比率は94.8％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=104.28円、1カナダドル=81.35円、1メキシコペソ=5.25円、1ユーロ=125.97円、1英ポンド=139.47円、1スウェーデンクローナ=12.28円、1ノルウェークローネ=11.81円、1デンマーククローネ=16.92円、1ポーランドズロチ=28.44円、1オーストラリアドル=77.62円、1シンガポールドル=78.01円、1マレーシアリンギット=25.65円、1イスラエルシュケル=32.05円。

○特定資産の価格等の調査

（2019年12月11日～2020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 (2020年12月10日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	420,374,074,403
コール・ローン等	1,322,653,226
公社債(評価額)	204,319,207,796
未収入金	213,668,074,166
未収利息	960,797,761
前払費用	103,341,454
(B) 負債	215,639,843,993
未払金	215,565,248,856
未払解約金	74,592,000
未払利息	3,137
(C) 純資産総額(A－B)	204,734,230,410
元本	190,933,135,042
次期繰越損益金	13,801,095,368
(D) 受益権総口数	190,933,135,042口
１万口当たり基準価額(C／D)	10,723円

(注) 当ファンドの期首元本額は147,652,755,545円、期中追加設定元本額は205,972,557,743円、期中一部解約元本額は162,692,178,246円です。

(注) 2020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)	100,495,565,512円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	19,785,232,065円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	11,290,547,881円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	9,971,217,951円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	9,798,822,493円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	9,436,100,413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)	7,280,297,840円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	5,787,879,896円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	4,479,168,297円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	3,808,099,658円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	1,616,769,500円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,417,374,046円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	1,288,878,112円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	1,212,988,548円
・ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	857,994,040円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	764,949,332円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ ８資産バランス 安定型	538,896,639円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ ８資産バランス 安定成長型	308,606,785円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	296,553,916円
・りそなリスクコントロール・オープン	202,028,519円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ ８資産バランス 成長型	107,806,969円
・りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	75,754,176円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	68,921,926円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	23,136,377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)	10,879,869円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	7,451,170円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	841,270円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	371,842円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.0723円です。

○損益の状況 (2019年12月11日～2020年12月10日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	3,359,902,309
受取利息	3,361,764,289
その他収益金	73,273
支払利息	△ 1,935,253
(B) 有価証券売買損益	3,044,829,400
売買益	28,439,099,751
売買損	△25,394,270,351
(C) 保管費用等	△ 32,462,584
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	6,372,269,125
(E) 前期繰越損益金	3,503,600,838
(F) 追加信託差損益金	11,473,568,257
(G) 解約差損益金	△ 7,548,342,852
(H) 計(D＋E＋F＋G)	13,801,095,368
次期繰越損益金(H)	13,801,095,368

(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５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
5期(2021年1月25日)	13,338	12.0	2,909.49	12.0	97.0	1.5	40,988

（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	%		%	%	%
2020年1月27日	11,913	－	2,597.26	－	98.3	1.9
1月末	11,786	△ 1.1	2,569.77	△ 1.1	98.5	1.8
2月末	10,574	△11.2	2,305.76	△11.2	98.4	1.8
3月末	9,940	△16.6	2,167.60	△16.5	97.4	3.0
4月末	10,369	△13.0	2,261.88	△12.9	97.3	2.7
5月末	11,075	△ 7.0	2,416.04	△ 7.0	97.8	2.5
6月末	11,057	△ 7.2	2,411.45	△ 7.2	98.1	2.0
7月末	10,612	△10.9	2,314.39	△10.9	98.7	1.6
8月末	11,479	△ 3.6	2,503.59	△ 3.6	98.3	1.6
9月末	11,627	△ 2.4	2,536.14	△ 2.4	98.4	1.8
10月末	11,297	△ 5.2	2,464.21	△ 5.1	98.1	1.4
11月末	12,556	5.4	2,738.72	5.4	98.2	1.8
12月末	12,928	8.5	2,819.93	8.6	98.4	1.8
（期末）						
2021年1月25日	13,338	12.0	2,909.49	12.0	97.0	1.5

（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

（2020年１月28日～2021年１月25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11,913円から当期末13,338円となり、1,425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

（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。2020年３月には新型肺炎問題に伴う経済活動の停滞懸念等から一時大幅に下落しましたが、政策当局による大規模な財政・金融支援に対する期待等から上昇基調に転じました。期後半にかけては、新型コロナウイルスのワクチン開発・普及に対する期待に加え、米国大統領選挙の結果が確定し、景気見通しや政治・政局を巡る不確実性が一定程度和らいだことから国内株式は上げ幅を拡大し、日経平均株価は約30年振りの高値水準を回復しました。

当ファンドのポートフォリオ

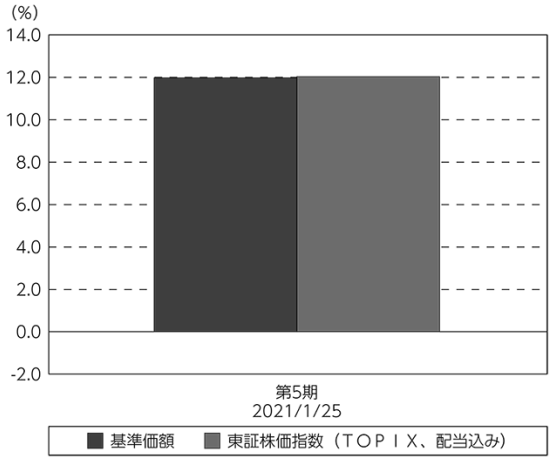
国内の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（業種構成比など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。株式組入比率は期を通じて高位に維持しました。

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＋12.0%となり、ベンチマークの＋12.0%とほぼ同水準となりました。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

（2020年１月28日～2021年１月25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	0.001	(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)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.001	(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)	(0.001)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、11,275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

（2020年１月28日～2021年１月25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	19,996 (△ 1,479)	41,172,516 (－)	22,093 (2)	41,484,816 (－)

（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	3,655	3,838	－	－

○株式売買比率

（2020年１月28日～2021年１月25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	82,657,333千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	29,791,841千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	2.77

(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

（2020年１月28日～2021年１月25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	67	66	67

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（2020年１月28日～2021年１月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年１月25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	0.8	0.7	2,170
日本水産	22.8	20.9	9,070
マルハニチロ	3.3	3	7,050
雪国まいたけ	－	1.3	2,359
カネコ種苗	0.7	0.6	931
サカタのタネ	2.7	2.5	9,075
ホクト	1.7	1.6	3,481
ホクリヨウ	0.4	0.3	211
鉱業（0.1%）			
住石ホールディングス	4.9	4.3	494
日鉄鉱業	0.5	0.5	2,880
三井松島ホールディングス	0.9	0.8	636
国際石油開発帝石	91.6	77	47,586
石油資源開発	3	2.7	5,567
K&Oエナジーグループ	1.1	1	1,435
建設業（2.3%）			
ヒノキヤグループ	0.6	0.5	1,027
ショーボンドホールディングス	3.3	3.3	15,262
ミライト・ホールディングス	6.8	6.2	10,564
タマホーム	1.1	1.1	2,103
サンヨーホームズ	0.2	0.2	172
日本アクア	1	0.8	496
ファーストコーポレーション	0.7	0.6	422
ベステラ	0.4	0.4	708
ＴＡＴＥＲＵ	4.7	4	712
キャンディル	－	0.4	219
スペースバリューホールディングス	2.8	2.6	1,812
ダイセキ環境ソリューション	0.4	0.4	316
第一カッター興業	0.3	0.5	703
明豊ファシリティワークス	0.6	－	－
安藤・間	13.6	12.5	9,187
東急建設	6.7	6.1	3,141
コムシスホールディングス	8.1	7.4	23,051
ビーアールホールディングス	2.6	2.3	1,524
高松コンストラクショングループ	1.4	1.3	2,693
東建コーポレーション	0.7	0.6	4,758
ソネック	0.2	0.2	173
ヤマウラ	1	0.9	835
大成建設	17.6	16.1	56,350
大林組	52.7	48.3	44,484
清水建設	53.5	49	37,926
飛島建設	1.5	1.4	1,496
長谷工コーポレーション	20.4	18.7	23,356
松井建設	2.1	1.9	1,350
錢高組	0.2	0.2	823
鹿島建設	41.4	37.9	53,969
不動テトラ	1.4	1.3	2,212
大末建設	0.6	0.6	493
鉄建建設	1.1	1	1,879
西松建設	4.1	3.7	8,891
三井住友建設	12.7	11.7	5,206
大豊建設	1.2	1.1	4,064
前田建設工業	13.2	12.1	10,684
佐田建設	1.2	1	440
ナカノフドー建設	1.5	1.3	510
奥村組	2.9	2.3	6,120
東鉄工業	2.3	2.1	5,756
イチケン	0.4	0.3	569
富士ピー・エス	0.8	0.7	410
淺沼組	0.6	0.5	2,105
戸田建設	21.9	20.1	14,813
熊谷組	2.4	2.2	5,823
北野建設	0.3	0.3	738
植木組	0.2	0.2	542
矢作建設工業	2.3	2.1	1,799
ピーエス三菱	1.7	1.6	1,000
日本ハウスホールディングス	3.6	3.3	1,098

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	6.3	5.3	51,198
新日本建設	2.2	2.1	1,782
ＮＩＰＰＯ	4.4	4	10,776
東亜道路工業	0.3	0.3	1,146
前田道路	5.6	4.3	7,542
日本道路	0.5	0.5	3,765
東亜建設工業	1.6	1.5	3,138
日本国土開発	3.1	4.7	2,608
若築建設	0.9	0.9	1,120
東洋建設	5.9	5.4	2,673
五洋建設	20.9	19.2	17,395
世紀東急工業	2.5	2.3	1,883
福田組	0.6	0.6	3,030
住友林業	13.4	12.2	25,229
日本基礎技術	1.8	1.6	744
巴コーポレーション	2.3	2.1	831
大和ハウス工業	52.2	47.8	145,168
ライト工業	3	2.8	4,818
積水ハウス	57.7	52.4	111,638
日特建設	1.4	1.3	1,011
北陸電気工事	0.9	0.8	982
ユアテック	3	2.8	2,517
日本リーテック	－	1	2,419
四電工	0.3	0.3	788
中電工	2.1	1.9	4,107
関電工	7.5	6.9	6,244
きんでん	12.5	11.5	19,814
東京エネシス	1.7	1.6	1,608
トーエネック	0.5	0.5	1,845
住友電設	1.5	1.4	3,733
日本電設工業	2.9	2.6	5,278
協和エクシオ	8	7.3	20,235
新日本空調	1.4	1.3	2,815
九電工	3.7	3.4	10,931
三機工業	3.8	3.4	4,239
日揮ホールディングス	16.2	14.9	17,641
中外炉工業	0.6	0.5	816
ヤマト	1.7	1.5	1,060

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
太平電業	1.3	1.2	3,082
高砂熱学工業	4.6	3.7	5,916
三晃金属工業	0.2	0.2	579
朝日工業社	0.4	0.3	916
明星工業	3.4	3.1	2,486
大氣社	2.6	2.4	6,729
ダイダン	1.3	1.2	3,493
日比谷総合設備	1.7	1.6	2,988
フィル・カンパニー	－	0.3	561
ＯＳＪＢホールディングス	8.3	7.6	2,090
東洋エンジニアリング	2.2	2	908
レイズネクスト	2.8	2.6	3,125
食料品（3.4%）			
ニップン	4.9	4.5	7,285
日清製粉グループ本社	19.1	17.5	29,330
日東富士製粉	0.1	0.1	679
昭和産業	1.5	1.4	4,249
鳥越製粉	1.5	1.4	1,220
中部飼料	2.1	1.9	2,741
フィード・ワン	11.3	2.1	1,806
東洋精糖	0.3	0.3	362
日本甜菜製糖	0.9	0.8	1,281
三井製糖	1.5	1.4	2,616
塩水港精糖	1.8	1.7	380
日新製糖	0.8	0.7	1,288
森永製菓	4	3.6	14,166
中村屋	0.4	0.4	1,540
江崎グリコ	5	4.3	19,694
名糖産業	0.8	0.7	985
井村屋グループ	0.7	0.9	2,322
不二家	0.9	1	2,243
山崎製パン	12.6	11.6	20,694
第一屋製パン	0.3	0.3	291
モロゾフ	0.2	0.3	1,734
亀田製菓	1	0.9	4,378
寿スピリッツ	1.6	1.5	8,250
カルビー	7.7	7	22,050
森永乳業	3.1	2.9	14,906

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	1.1	1	1,770
ヤクルト本社	11.6	10.6	58,936
明治ホールディングス	11.2	10.2	73,032
雪印メグミルク	4.1	3.7	8,469
プリマハム	2.6	2.4	7,608
日本ハム	6.4	5.9	26,019
林兼産業	0.6	0.5	300
丸大食品	1.8	1.6	2,732
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1.3	1.2	4,146
柿安本店	0.6	0.5	1,328
伊藤ハム米久ホールディングス	10.8	10	7,000
サッポロホールディングス	5.8	5.3	10,600
アサヒグループホールディングス	35.3	33.8	145,137
キリンホールディングス	71.6	65.6	150,716
宝ホールディングス	12.6	11.5	14,398
オエノンホールディングス	4.4	4.4	1,689
養命酒製造	0.5	0.5	928
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	11.8	11.8	18,585
サントリー食品インターナショナル	11.3	10.3	37,646
ダイドーグループホールディングス	0.9	0.8	4,104
伊藤園	5.1	4.7	30,503
キーコーヒー	1.7	1.5	3,222
ユニカフェ	0.5	0.5	496
ジャパンフーズ	0.2	0.2	244
日清オイリオグループ	2.2	2	6,060
不二製油グループ本社	4.1	3.8	11,647
かどや製油	0.1	0.2	795
Ｊ－オイルミルズ	0.9	0.8	2,936
キッコーマン	12.1	11.1	84,027
味の素	37.3	34.2	83,636
キユーピー	9.4	8.6	19,556
ハウス食品グループ本社	6.3	5.8	21,750
カゴメ	6.4	6.3	21,388
焼津水産化学工業	0.8	0.7	698
アリアケジャパン	1.5	1.4	9,394
ピエトロ	0.2	0.2	349
エバラ食品工業	0.4	0.4	997
やまみ	0.1	0.1	219
ニチレイ	8	7.4	21,652
東洋水産	8.7	8	41,280
イートアンドホールディングス	0.6	0.5	914
大冷	0.2	0.2	387
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.9	0.9	739
日清食品ホールディングス	7.2	6.6	59,532
永谷園ホールディングス	0.8	0.8	1,841
一正蒲鉾	0.7	0.6	673
フジッコ	1.8	1.7	3,449
ロック・フィールド	1.8	1.7	2,582
日本たばこ産業	97.4	82.9	170,235
ケンコーマヨネーズ	0.9	0.9	1,626
わらべや日洋ホールディングス	1.1	1	1,634
なとり	0.9	0.9	1,710
イフジ産業	0.2	0.3	259
ピックルスコーポレーション	0.4	0.3	1,120
北の達人コーポレーション	5.9	5.4	2,808
ユーグレナ	7.2	6.7	5,902
ミヨシ油脂	0.6	0.5	580
理研ビタミン	0.8	1.5	2,050
繊維製品（0.5%）			
片倉工業	2.4	2	2,744
グンゼ	1.2	1.1	3,630
東洋紡	6.5	6	8,112
ユニチカ	4.8	4.4	1,755
富士紡ホールディングス	0.8	0.7	2,975
倉敷紡績	1.7	1.5	2,709
シキボウ	0.9	0.8	827
日本毛織	5.4	5	4,815
ダイトウボウ	2.3	2.5	270
トーア紡コーポレーション	0.7	0.6	279
ダイドーリミテッド	2.2	2	366
帝国繊維	1.8	1.7	3,891
帝人	13.4	12.3	24,108
東レ	119.2	109.3	79,198
サカイオーベックス	0.4	0.4	824
住江織物	0.5	0.3	612
日本フエルト	1	0.9	387

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	0.2	0.2	253
日東製網	0.2	0.2	299
アツギ	1.4	1.2	588
ダイニック	0.6	0.6	471
セーレン	4	3.7	5,905
ソトー	0.7	0.6	493
東海染工	0.2	0.2	224
小松マテーレ	2.7	2.5	2,530
ワコールホールディングス	4.3	3.8	7,824
ホギメディカル	1.9	1.7	5,491
レナウン	4.3	－	－
クラウディアホールディングス	0.4	0.4	105
ＴＳＩホールディングス	5.5	4.6	1,159
マツオカコーポレーション	0.5	0.4	807
ワールド	2.3	2.1	2,744
三陽商会	0.9	0.8	488
ナイガイ	0.6	0.6	196
オンワードホールディングス	9.9	9.1	2,165
ルックホールディングス	0.6	0.5	460
キムラタン	8.6	8.9	204
ゴールドウイン	3	2.7	17,280
デサント	3.2	2.9	5,269
キング	0.8	0.7	419
ヤマトインターナショナル	1	1.3	430
パルプ・紙（0.2%）			
特種東海製紙	1	0.9	4,324
王子ホールディングス	68.8	63.1	40,573
日本製紙	7.3	6.7	8,321
三菱製紙	2	1.7	567
北越コーポレーション	10.9	9	3,906
中越パルプ工業	0.7	0.6	708
巴川製紙所	0.5	0.4	311
大王製紙	7.2	7.3	14,286
阿波製紙	0.4	0.4	178
レンゴー	15.6	14.3	12,283
トーモク	1	0.9	1,633
ザ・パック	1.2	1.1	2,839

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（7.5%）			
クラレ	25.9	23.8	26,965
旭化成	109.1	100	120,450
共和レザー	0.9	0.8	506
昭和電工	11.7	11.5	27,979
住友化学	121	110.9	55,450
住友精化	0.7	0.7	3,094
日産化学	9.2	8.3	50,796
ラサ工業	0.6	0.5	1,278
クレハ	1.4	1.3	8,801
多木化学	0.5	0.6	3,678
テイカ	1.2	1.1	1,657
石原産業	3	2.7	2,060
片倉コープアグリ	0.5	0.4	490
日本曹達	2.4	2.1	6,426
東ソー	25.5	23.3	41,683
トクヤマ	4.7	4.4	11,536
セントラル硝子	3.4	3.1	6,779
東亞合成	10.3	9.5	11,172
大阪ソーダ	1.7	1.5	3,930
関東電化工業	3.9	3.6	3,009
デンカ	6	5.5	22,990
信越化学工業	28.3	25.9	508,546
日本カーバイド工業	0.6	0.5	645
堺化学工業	1.1	1	2,058
第一稀元素化学工業	1.8	1.6	1,540
エア・ウォーター	15.3	14	24,612
日本酸素ホールディングス	15.8	14.5	30,348
日本化学工業	0.5	0.5	1,620
東邦アセチレン	0.3	0.2	296
日本パーカライジング	8.3	7.6	7,729
高圧ガス工業	2.6	2.4	1,891
チタン工業	0.2	0.2	378
四国化成工業	2.5	2.2	2,629
戸田工業	0.4	0.4	966
ステラ　ケミファ	0.9	0.8	2,980
保土谷化学工業	0.6	0.6	3,330
日本触媒	2.6	2.3	13,363

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大日精化工業	1.5	1.3	2,969
カネカ	4.3	3.9	14,410
三菱瓦斯化学	15.5	14	35,546
三井化学	15	14	42,840
ＪＳＲ	15.3	14.1	46,248
東京応化工業	2.8	2.6	20,176
大阪有機化学工業	1.5	1.4	5,383
三菱ケミカルホールディングス	110.1	100.9	75,271
ＫＨネオケム	2.9	2.5	6,315
ダイセル	22.5	18.8	14,908
住友ベークライト	2.6	2.4	9,024
積水化学工業	35.4	31.9	65,299
日本ゼオン	14.9	13.6	20,971
アイカ工業	4.9	4.5	16,065
宇部興産	8.3	7.6	15,488
積水樹脂	3	2.7	5,564
タキロンシーアイ	3.5	3.3	2,164
旭有機材	0.9	0.9	1,350
日立化成	7.6	－	－
ニチバン	0.9	0.8	1,354
リケンテクノス	4.1	3.7	1,709
大倉工業	0.8	0.7	1,354
積水化成品工業	2.2	2	1,090
群栄化学工業	0.4	0.3	727
タイガースポリマー	0.9	0.8	320
ミライアル	0.6	0.5	618
ダイキアクシス	0.6	0.5	571
ダイキョーニシカワ	3.5	3.2	2,579
竹本容器	0.6	0.5	457
森六ホールディングス	0.9	0.8	1,683
日本化薬	10.2	9.3	9,300
カーリットホールディングス	1.7	1.6	1,222
日本精化	1.3	1.2	1,670
扶桑化学工業	1.7	1.5	5,887
トリケミカル研究所	0.4	0.3	5,247
ＡＤＥＫＡ	7.6	6.9	12,461
日油	6.2	5.7	28,728
新日本理化	2.7	2.5	670
ハリマ化成グループ	1.4	1.2	1,144
花王	40.3	36.9	283,392
第一工業製薬	0.6	0.6	2,484
石原ケミカル	0.4	0.4	838
日華化学	0.6	0.5	429
ニイタカ	0.3	0.3	841
三洋化成工業	1	0.9	4,869
有機合成薬品工業	1.2	1.2	379
大日本塗料	1.9	1.7	1,581
日本ペイントホールディングス	13.6	12.5	117,875
関西ペイント	18.5	17	51,340
神東塗料	1.3	1.2	255
中国塗料	4.7	4.3	4,218
日本特殊塗料	1.2	1.1	1,177
藤倉化成	2.2	2	996
太陽ホールディングス	1.2	1.1	7,216
ＤＩＣ	7	6.4	16,704
サカタインクス	3.6	3.3	3,461
東洋インキＳＣホールディングス	3.5	3.2	5,977
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1.3	1.2	980
富士フイルムホールディングス	32.2	29.5	184,581
資生堂	33.4	30.6	214,475
ライオン	21.9	20	47,140
高砂香料工業	1.1	1	2,515
マンダム	3.8	3.5	5,558
ミルボン	2.2	2.1	14,259
ファンケル	6.8	6.2	24,924
コーセー	3.2	2.9	48,198
コタ	0.9	0.9	1,323
シーボン	0.1	0.2	388
ポーラ・オルビスホールディングス	7.2	6.6	14,269
ノエビアホールディングス	1.6	1.3	6,019
アジュバンコスメジャパン	0.4	0.3	316
エステー	1.1	1	1,985
アグロ　カネショウ	0.5	0.6	952
コニシ	2.8	2.5	3,865
長谷川香料	2.2	2.7	5,529
星光ＰＭＣ	1	0.9	710

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
小林製薬	4.7	4.3	51,084
荒川化学工業	1.5	1.4	1,689
メック	1.2	1.1	2,651
日本高純度化学	0.5	0.4	1,080
タカラバイオ	4.4	4	11,508
ＪＣＵ	2	1.9	7,676
新田ゼラチン	1.1	1	665
ＯＡＴアグリオ	0.3	0.3	391
デクセリアルズ	4.3	4	5,588
アース製薬	1.3	1.2	7,272
北興化学工業	1.8	1.4	1,817
大成ラミック	0.6	0.5	1,445
クミアイ化学工業	6.9	6.4	5,632
日本農薬	3	2.7	1,314
アキレス	1.2	1.1	1,603
有沢製作所	2.7	2.3	2,274
日東電工	11.6	10.6	98,474
レック	1.8	1.6	2,164
三光合成	2	1.8	842
きもと	2.9	2.6	465
藤森工業	1.5	1.4	6,650
前澤化成工業	1.1	1	968
未来工業	0.9	0.8	1,288
ウェーブロックホールディングス	0.6	0.5	442
ＪＳＰ	1	0.9	1,567
エフピコ	1.8	3.2	13,360
天馬	1.1	1	2,183
信越ポリマー	3	2.8	2,718
東リ	4.2	3.9	951
ニフコ	6.2	5.7	22,002
バルカー	1.4	1.3	2,808
ユニ・チャーム	32.4	32.7	157,679
ショーエイコーポレーション	0.2	0.3	309
医薬品（5.9%）			
協和キリン	16.9	15.5	45,229
武田薬品工業	139.9	128.2	476,134
アステラス製薬	147.9	133.6	229,792
大日本住友製薬	12.5	11.4	17,635
塩野義製薬	21.5	19.4	111,569
わかもと製薬	2	1.8	446
あすか製薬	1.9	1.8	2,842
日本新薬	4.4	4	29,120
ビオフェルミン製薬	0.3	0.3	741
中外製薬	17.5	48.2	272,281
科研製薬	2.9	2.6	10,660
エーザイ	20.1	18.4	144,440
ロート製薬	8.6	7.9	24,766
小野薬品工業	38.6	35.4	110,023
久光製薬	4.4	4.1	25,133
持田製薬	2.3	2.1	8,200
参天製薬	31.3	28.7	48,560
扶桑薬品工業	0.6	0.5	1,310
日本ケミファ	0.2	0.2	454
ツムラ	5.2	4.8	16,296
日医工	4.8	4.4	4,408
キッセイ薬品工業	3	2.7	6,015
生化学工業	3.3	3	3,093
栄研化学	3	2.7	5,386
日水製薬	0.7	0.6	600
鳥居薬品	1.1	1	3,270
ＪＣＲファーマ	1.2	4.3	10,676
東和薬品	2.2	2	3,972
富士製薬工業	1.1	1	1,219
沢井製薬	3.5	3.2	15,280
ゼリア新薬工業	3.1	2.8	5,392
第一三共	48.1	132.3	474,427
キョーリン製薬ホールディングス	3.7	3.4	6,657
大幸薬品	0.7	1.9	3,100
ダイト	1	1	3,665
大塚ホールディングス	32	32	143,296
大正製薬ホールディングス	3.6	3.3	22,209
ペプチドリーム	8.5	7.8	46,098
石油・石炭製品（0.4%）			
日本コークス工業	14.1	13.1	1,244
ニチレキ	2	1.8	2,728
ユシロ化学工業	0.9	0.9	1,004

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビーピー・カストロール	0.6	0.5	614
富士石油	4.7	4.2	890
ＭＯＲＥＳＣＯ	0.6	0.6	666
出光興産	18.9	17.1	43,160
ＥＮＥＯＳホールディングス	252.9	231.8	100,925
コスモエネルギーホールディングス	4.9	4.5	10,444
ゴム製品（0.6%）			
横浜ゴム	9.7	8.9	15,094
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9.7	8.1	13,275
ブリヂストン	51.7	41	168,100
住友ゴム工業	15.1	13.8	13,717
藤倉コンポジット	1.5	1.3	518
オカモト	1	0.9	3,514
フコク	0.8	0.7	469
ニッタ	1.9	1.7	3,782
住友理工	3.3	3	1,761
三ツ星ベルト	2.2	2	3,360
バンドー化学	2.9	2.7	1,782
ガラス・土石製品（0.8%）			
日東紡績	2.5	2.3	10,718
ＡＧＣ	16.6	14.1	54,003
日本板硝子	8	7.4	3,507
石塚硝子	0.3	0.3	565
日本山村硝子	0.7	0.6	517
日本電気硝子	6.8	5.7	12,864
オハラ	0.7	0.6	1,133
住友大阪セメント	3.2	2.8	8,722
太平洋セメント	10.6	9.7	25,811
日本ヒューム	1.7	1.5	1,180
日本コンクリート工業	3.8	3.3	1,019
三谷セキサン	0.8	0.7	3,325
アジアパイルホールディングス	2.4	2.2	1,097
東海カーボン	17.6	15.1	23,103
日本カーボン	0.9	0.8	3,308
東洋炭素	1	0.9	1,853
ノリタケカンパニーリミテド	0.9	0.9	2,889
ＴＯＴＯ	12	11	65,560
日本碍子	20.5	18.5	32,430
日本特殊陶業	13.1	11.7	21,036
ダントーホールディングス	1.4	1.1	509
ＭＡＲＵＷＡ	0.6	0.6	7,002
品川リフラクトリーズ	0.4	0.4	1,122
黒崎播磨	0.3	0.3	1,461
ヨータイ	1.4	1.2	1,006
イソライト工業	0.9	0.8	444
東京窯業	2.2	2	682
ニッカトー	0.8	0.7	573
フジミインコーポレーテッド	1.5	1.4	6,349
クニミネ工業	0.7	0.6	753
エーアンドエーマテリアル	0.3	0.3	326
ニチアス	4.6	4.2	10,348
ニチハ	2.3	2.1	6,909
鉄鋼（0.6%）			
日本製鉄	74.4	68.2	89,035
神戸製鋼所	30.4	27.9	14,535
中山製鋼所	2.4	2.1	743
合同製鐵	0.9	0.8	1,609
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	44.9	41.2	41,323
東京製鐵	8.1	7.4	4,987
共英製鋼	1.9	1.7	2,351
大和工業	3.5	3.2	8,601
東京鐵鋼	0.7	0.6	1,214
大阪製鐵	0.9	0.8	1,015
淀川製鋼所	2.2	2.1	4,414
丸一鋼管	5.4	4.9	11,152
モリ工業	0.5	0.5	1,173
大同特殊鋼	2.7	2.5	10,550
日本高周波鋼業	0.6	0.6	211
日本冶金工業	1.4	1.3	2,368
山陽特殊製鋼	1.2	1	1,468
愛知製鋼	0.9	0.9	2,866
日立金属	17.9	16.4	27,552
日本金属	0.4	0.4	487
大平洋金属	1.1	1	2,366
新日本電工	10.6	9.8	2,783
栗本鐵工所	0.8	0.8	1,337

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
虹技	0.3	0.2	223
日本鋳鉄管	0.2	0.2	263
三菱製鋼	1.2	1.1	706
日亜鋼業	2.6	2.2	660
日本精線	0.3	0.2	757
エンビプロ・ホールディングス	0.7	0.6	419
シンニッタン	2.7	2.4	492
新家工業	0.4	0.3	386
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム工業所	2.7	2.5	1,905
日本軽金属ホールディングス	42.1	3.9	7,729
三井金属鉱業	4.5	4.1	16,543
東邦亜鉛	0.9	0.8	1,904
三菱マテリアル	11	10.1	24,038
住友金属鉱山	21.3	19.5	99,508
ＤＯＷＡホールディングス	4.2	3.9	15,775
古河機械金属	3	2.7	3,364
エス・サイエンス	7.9	6.8	312
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.7	1.6	1,404
東邦チタニウム	3	2.7	2,443
ＵＡＣＪ	2.5	2.3	4,420
ＣＫサンエツ	0.3	0.3	1,117
古河電気工業	5.2	4.7	13,395
住友電気工業	62.2	57	82,593
フジクラ	20	18.4	8,960
昭和電線ホールディングス	1.9	1.8	3,238
東京特殊電線	0.2	0.2	482
タツタ電線	3.3	3	2,367
カナレ電気	0.3	0.3	545
平河ヒューテック	0.6	0.8	1,070
リョービ	2	1.9	2,359
アーレスティ	2.2	2	744
アサヒホールディングス	2.9	2.7	11,691
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	0.9	0.9	1,256
宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.5	1,225
トーカロ	4.6	4.2	6,505
アルファＣｏ	0.6	0.5	501

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＳＵＭＣＯ	19.9	19.5	47,697
川田テクノロジーズ	0.3	0.3	1,317
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	0.5	0.5	3,385
ジェイテックコーポレーション	－	0.1	392
信和	0.7	0.9	630
東洋製罐グループホールディングス	10.6	9.7	11,203
ホッカンホールディングス	0.9	0.8	1,148
コロナ	0.9	0.8	753
横河ブリッジホールディングス	3.1	2.8	5,759
駒井ハルテック	0.3	0.3	696
高田機工	0.2	0.1	255
三和ホールディングス	15.9	14.4	17,596
文化シヤッター	4.9	4.5	4,189
三協立山	2.3	2	1,626
アルインコ	1.2	1.1	1,039
東洋シヤッター	0.4	0.4	269
ＬＩＸＩＬ	24.5	22.5	55,957
日本フイルコン	1.3	1.1	558
ノーリツ	3.4	3.2	4,908
長府製作所	1.7	1.5	3,139
リンナイ	3.2	3	33,750
ダイニチ工業	0.9	0.8	738
日東精工	2.3	1.9	858
三洋工業	0.2	0.2	370
岡部	3.4	3.1	2,387
ジーテクト	2.1	1.9	2,812
東プレ	3.1	2.8	4,113
高周波熱錬	3.2	2.9	1,400
東京製綱	1.2	1.1	1,480
サンコール	1	1.1	521
モリテック　スチール	1.3	1.2	517
パイオラックス	2.5	2.3	3,539
エイチワン	1.7	1.5	1,137
日本発條	17.8	16.3	11,768
中央発條	0.2	0.2	561
アドバネクス	0.3	0.2	270
立川ブラインド工業	0.7	0.7	911
三益半導体工業	1.5	1.2	3,612

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
機械（5.8%）			
日本ドライケミカル	0.4	0.4	608
日本製鋼所	5	4.6	14,260
三浦工業	7.2	6.6	40,722
タクマ	5.6	5.2	11,263
ツガミ	3.4	3.2	5,939
オークマ	1.9	1.8	11,232
芝浦機械	1.9	1.7	4,270
アマダ	21.1	18.9	22,736
アイダエンジニアリング	4.3	4	3,968
滝澤鉄工所	0.5	0.5	503
ＦＵＪＩ	7.1	6.6	18,902
牧野フライス製作所	1.9	1.8	7,596
オーエスジー	7.7	7.5	14,617
ダイジェット工業	0.2	0.2	266
旭ダイヤモンド工業	4.3	4	1,900
ＤＭＧ森精機	10.5	9.6	15,542
ソディック	3.9	3.3	3,042
ディスコ	2.3	2.1	78,120
日東工器	0.9	0.8	1,396
日進工具	0.5	0.6	1,632
パンチ工業	1.6	1.4	623
冨士ダイス	0.8	0.7	464
豊和工業	0.9	0.8	701
ＯＫＫ	0.7	0.6	253
石川製作所	0.4	0.4	717
東洋機械金属	1.2	1.1	488
津田駒工業	0.3	0.3	265
エンシュウ	0.4	0.4	353
島精機製作所	2.7	2.4	4,512
オプトラン	1.9	1.9	4,444
ＮＣホールディングス	0.5	0.5	295
イワキポンプ	0.8	1	825
フリュー	1.6	1.5	1,689
ヤマシンフィルタ	3.6	3.4	3,542
日阪製作所	2	1.9	1,611
やまびこ	3.2	3	4,005
平田機工	0.8	0.7	5,901
ペガサスミシン製造	1.8	1.6	545
マルマエ	0.7	0.6	815
タツモ	0.8	0.6	971
ナブテスコ	9.8	9	45,720
三井海洋開発	1.8	1.6	3,316
レオン自動機	1.6	1.5	1,764
ＳＭＣ	5.3	4.8	325,152
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1.5	－	－
ホソカワミクロン	0.6	0.5	3,200
ユニオンツール	0.6	0.6	2,145
オイレス工業	2.1	2	3,372
日精エー・エス・ビー機械	0.6	0.4	2,372
サトーホールディングス	2.4	2.2	4,853
技研製作所	1.5	1.3	6,487
日本エアーテック	0.5	0.5	767
カワタ	0.5	0.4	406
日精樹脂工業	1.4	1.3	1,167
オカダアイヨン	0.5	0.5	581
ワイエイシイホールディングス	0.8	0.7	768
小松製作所	76.2	69.8	204,863
住友重機械工業	9.6	8.8	26,708
日立建機	6.7	6.2	19,964
日工	2.3	2.1	1,505
巴工業	0.7	0.6	1,221
井関農機	1.7	1.5	2,082
ＴＯＷＡ	1.7	1.6	3,456
丸山製作所	0.4	0.3	492
北川鉄工所	0.8	0.7	950
ローツェ	0.7	0.7	5,971
タカキタ	0.6	0.5	355
クボタ	89.2	81	191,160
荏原実業	0.4	0.4	1,588
三菱化工機	0.6	0.5	1,695
月島機械	3.1	2.8	3,880
帝国電機製作所	1.4	1.3	1,549
東京機械製作所	0.7	0.6	171
新東工業	4	3.7	2,786
澁谷工業	1.5	1.3	4,530

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイチ　コーポレーション	2.9	2.7	2,500
小森コーポレーション	4.3	3.9	2,776
鶴見製作所	1.3	1.2	2,175
住友精密工業	0.2	0.2	401
日本ギア工業	0.5	0.6	178
酒井重工業	0.3	0.3	636
荏原製作所	7	6.4	23,584
石井鐵工所	0.2	0.2	576
西島製作所	1.7	1.6	1,398
北越工業	1.7	1.6	1,670
ダイキン工業	21.4	19.6	457,268
オルガノ	0.6	0.6	4,116
トーヨーカネツ	0.7	0.7	1,791
栗田工業	9.1	8.3	36,810
椿本チエイン	2.4	2.2	6,072
大同工業	0.8	0.7	514
木村化工機	1.4	1.3	795
アネスト岩田	2.6	2.4	2,692
ダイフク	8.6	7.9	101,515
サムコ	0.5	0.4	1,684
加藤製作所	0.9	0.8	752
油研工業	0.3	0.3	470
タダノ	8.1	7.4	6,963
フジテック	6.1	5.6	13,288
ＣＫＤ	4.7	4.2	11,125
キトー	1.3	1.2	1,897
平和	4.7	4.3	6,265
理想科学工業	1.5	1.4	1,908
ＳＡＮＫＹＯ	3.7	3.4	9,996
日本金銭機械	1.9	1.7	887
マースグループホールディングス	1.1	1	1,518
フクシマガリレイ	1	1	4,335
オーイズミ	0.7	0.6	244
ダイコク電機	0.8	0.7	614
竹内製作所	2.8	2.6	6,250
アマノ	4.4	4	9,724
ＪＵＫＩ	2.3	2.1	1,152
サンデンホールディングス	2.2	2	750
蛇の目ミシン工業	1.6	1.4	1,164
マックス	2.6	2.4	3,508
グローリー	4.3	4	8,192
新晃工業	1.6	1.4	2,528
大和冷機工業	2.4	2.5	2,590
セガサミーホールディングス	16.7	15.3	26,101
日本ピストンリング	0.6	0.6	565
リケン	0.8	0.7	1,489
ＴＰＲ	2.3	2.1	3,005
ツバキ・ナカシマ	3.4	2.9	3,645
ホシザキ	4.9	4.9	44,247
大豊工業	1.4	1.3	988
日本精工	31.7	29	28,159
ＮＴＮ	38.8	35.7	9,817
ジェイテクト	16.1	14.8	13,112
不二越	1.6	1.4	6,153
日本トムソン	5	4.6	2,221
ＴＨＫ	9.8	9.6	35,136
ユーシン精機	1.3	1.2	1,158
前澤給装工業	0.6	0.6	1,325
イーグル工業	2.1	1.9	1,905
前澤工業	1.1	1	598
日本ピラー工業	1.7	1.6	2,712
キッツ	6.8	5.6	3,360
マキタ	21.9	20.1	103,515
日立造船	13.3	12.2	8,076
三菱重工業	28.2	25.8	81,476
ＩＨＩ	12.1	11.1	22,188
スター精密	2.6	2.4	3,900
電気機器（18.0%）			
日清紡ホールディングス	11.2	9.4	7,388
イビデン	10.3	9.4	48,034
コニカミノルタ	36.7	33.7	14,255
ブラザー工業	20.5	18.8	43,992
ミネベアミツミ	31.2	28.6	67,267
日立製作所	80.8	74.1	325,891
三菱電機	168.1	154.1	257,347
富士電機	10.1	9.3	38,595

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋電機製造	0.7	0.6	706
安川電機	18.1	16.6	96,612
シンフォニアテクノロジー	2.2	2	2,918
明電舎	3.1	2.8	6,983
オリジン	0.5	0.4	545
山洋電気	0.8	0.7	4,354
デンヨー	1.4	1.3	2,698
東芝テック	2.1	1.9	7,144
芝浦メカトロニクス	0.3	0.3	1,815
マブチモーター	4.7	4.3	17,974
日本電産	20.2	37.1	531,272
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1	0.9	432
トレックス・セミコンダクター	1	0.9	1,422
東光高岳	0.9	0.9	1,460
ダブル・スコープ	2.7	2.8	3,012
宮越ホールディングス	0.6	0.6	464
ダイヘン	1.8	1.7	8,457
ヤーマン	2.4	2.5	4,717
ＪＶＣケンウッド	13.6	12.6	2,192
ミマキエンジニアリング	1.6	1.4	670
Ｉ－ＰＥＸ	0.7	0.7	1,553
日新電機	3.9	3.6	5,040
大崎電気工業	3.3	3.1	1,835
オムロン	15.1	13.8	129,858
日東工業	2.5	2.3	4,770
ＩＤＥＣ	2.4	2.2	4,065
正興電機製作所	0.4	0.4	847
不二電機工業	0.2	0.3	393
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5.6	5.1	16,396
サクサホールディングス	0.4	0.4	554
メルコホールディングス	0.6	0.5	1,750
テクノメディカ	0.4	0.3	474
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.3	0.3	457
日本電気	20.4	18.7	110,891
富士通	16.2	14.9	249,426
沖電気工業	6.8	6.3	6,804
岩崎通信機	0.8	0.7	588
電気興業	0.8	0.7	1,934

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンケン電気	1.8	1.7	8,687
ナカヨ	0.3	0.3	426
アイホン	1	0.9	1,477
ルネサスエレクトロニクス	80.3	66.2	88,310
セイコーエプソン	20.9	19.1	31,744
ワコム	11.2	10.4	10,483
アルバック	3.3	2.8	14,420
アクセル	0.7	0.6	463
ＥＩＺＯ	1.3	1.2	4,500
ジャパンディスプレイ	48.3	44.9	2,155
日本信号	4.3	3.9	3,650
京三製作所	3.9	3.6	1,497
能美防災	2.2	2	4,446
ホーチキ	1.2	1.1	1,360
星和電機	0.9	0.8	529
エレコム	1.8	1.8	9,090
パナソニック	192.1	176.1	250,590
シャープ	19.5	17.8	36,899
アンリツ	10.8	9.9	26,274
富士通ゼネラル	4.6	4.2	11,071
ソニー	106.3	96.5	993,950
ＴＤＫ	8.1	7.4	131,350
帝国通信工業	0.7	0.7	770
タムラ製作所	5.6	5.1	2,937
アルプスアルパイン	14.9	13.6	20,984
池上通信機	0.5	0.5	431
日本電波工業	1.6	1.4	1,099
鈴木	0.9	0.8	941
日本トリム	0.2	0.2	909
ローランド　ディー．ジー．	0.9	0.9	1,570
フォスター電機	1.8	1.6	2,380
ＳＭＫ	0.4	0.4	1,240
ヨコオ	1.1	1	3,290
ティアック	1.1	1.1	116
ホシデン	4.6	4.2	4,032
ヒロセ電機	2.6	2.4	37,464
日本航空電子工業	3.9	3.5	5,694
ＴＯＡ	1.8	1.7	1,414

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マクセルホールディングス	3.6	3.3	4,458
古野電気	2.2	2	2,284
ユニデンホールディングス	0.5	0.4	866
スミダコーポレーション	1.3	1.3	1,326
アイコム	0.9	0.9	2,440
リオン	0.7	0.6	2,052
本多通信工業	1.5	1.3	646
船井電機	1.7	1.6	688
横河電機	15.4	14.1	32,683
新電元工業	0.6	0.5	1,462
アズビル	10.6	9.7	52,865
東亜ディーケーケー	0.8	0.8	667
日本光電工業	6.9	6.4	20,096
チノー	0.6	0.5	702
共和電業	1.8	1.6	625
日本電子材料	0.7	0.6	1,339
堀場製作所	3.3	3.1	21,514
アドバンテスト	12.5	11.5	105,455
小野測器	0.7	0.6	322
エスペック	1.5	1.4	2,849
キーエンス	15.2	14	804,580
日置電機	0.9	0.7	2,978
シスメックス	12	11	143,000
日本マイクロニクス	2.9	2.7	4,525
メガチップス	1.6	1.4	4,480
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	0.9	0.9	3,726
澤藤電機	0.2	0.2	435
原田工業	0.8	0.7	592
コーセル	2.1	2.1	2,564
イリソ電子工業	1.4	1.3	6,246
オプテックスグループ	2.8	2.5	5,225
千代田インテグレ	0.8	0.6	1,080
アイ・オー・データ機器	0.6	0.5	510
レーザーテック	6.9	6.8	102,408
スタンレー電気	11.8	10.8	35,640
岩崎電気	0.7	0.6	857
ウシオ電機	9.8	8.5	11,857
岡谷電機産業	1.3	1.2	434
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1.6	1.4	449
エノモト	0.5	0.5	812
日本セラミック	1.7	1.6	4,548
遠藤照明	0.9	0.8	416
古河電池	1.2	1.1	1,829
双信電機	0.8	0.7	315
山一電機	1.2	1.1	1,910
図研	1.1	1	2,859
日本電子	3.3	3	13,425
カシオ計算機	14.9	13.6	24,058
ファナック	16	14.5	390,920
日本シイエムケイ	3.9	3.6	1,522
エンプラス	0.9	0.8	3,176
大真空	0.6	0.6	1,528
ローム	7.5	6.4	74,816
浜松ホトニクス	12.1	11.1	72,372
三井ハイテック	1.9	1.7	7,471
新光電気工業	5.6	5.2	14,040
京セラ	23.7	21.7	150,858
太陽誘電	7.5	6.9	41,676
村田製作所	49.4	45.3	479,274
双葉電子工業	2.7	2.4	2,270
北陸電気工業	0.7	0.6	554
ニチコン	5.7	5.2	7,846
日本ケミコン	1.3	1.3	2,568
ＫＯＡ	2.5	2.3	3,893
市光工業	2.5	2.3	1,598
小糸製作所	10.1	9.2	65,044
ミツバ	3.1	2.8	1,265
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2.9	2.7	22,761
キヤノン電子	1.8	1.4	2,235
キヤノン	90.5	76.6	170,435
リコー	42.8	39.2	28,851
象印マホービン	4.9	4.2	7,303
ＭＵＴＯＨホールディングス	0.2	0.2	302
東京エレクトロン	11.2	9.8	430,906
輸送用機器（7.1%）			
トヨタ紡織	4.9	4.5	7,488

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
芦森工業	0.3	0.3	285
ユニプレス	3.3	3	2,937
豊田自動織機	13.6	12.5	108,500
モリタホールディングス	2.9	2.7	4,603
三櫻工業	2.1	2	1,922
デンソー	37	33.9	203,162
東海理化電機製作所	4.4	4.1	6,986
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	6.1	5.6	2,385
川崎重工業	13.1	12	28,704
名村造船所	5.4	5	895
サノヤスホールディングス	2.2	1.9	304
日本車輌製造	0.6	0.6	1,504
三菱ロジスネクスト	2.2	2	2,386
近畿車輛	0.3	0.2	247
日産自動車	198.3	181.8	99,899
いすゞ自動車	48.7	44.7	42,554
トヨタ自動車	187.6	172	1,320,444
日野自動車	21	19.2	17,644
三菱自動車工業	62.2	57	13,395
エフテック	1.2	1.1	673
レシップホールディングス	0.7	0.6	300
ＧＭＢ	0.3	0.3	334
ファルテック	0.3	0.3	211
武蔵精密工業	3.7	3.4	5,083
日産車体	3.3	3	2,601
新明和工業	4.5	4.2	3,817
極東開発工業	3.1	2.9	4,164
日信工業	3.2	－	－
トピー工業	1.4	1.3	1,667
ティラド	0.6	0.6	802
曙ブレーキ工業	9.2	8.5	1,326
タチエス	2.8	2.5	2,735
ＮＯＫ	9	8.3	10,333
フタバ産業	4.7	4.3	2,214
ＫＹＢ	1.9	1.7	3,961
大同メタル工業	3.2	3	1,560
プレス工業	8.3	7.7	2,387
ミクニ	2.2	2	546
太平洋工業	3.5	3.2	3,651
ケーヒン	3.8	－	－
河西工業	2.3	2.1	831
アイシン精機	13.8	12.7	39,751
マツダ	49.5	45.3	34,654
今仙電機製作所	1.6	1.4	1,029
本田技研工業	132.4	121.3	342,611
スズキ	33.3	30.5	156,678
ＳＵＢＡＲＵ	52.2	47.8	97,081
安永	0.8	0.7	903
ヤマハ発動機	21.9	21.8	47,851
ショーワ	3.8	－	－
ＴＢＫ	2.1	1.8	799
エクセディ	2.3	2.1	3,080
豊田合成	5.4	5	13,970
愛三工業	2.6	2.4	1,260
盟和産業	0.2	0.2	175
日本プラスト	1.4	1.2	596
ヨロズ	1.6	1.4	1,751
エフ・シー・シー	2.7	2.5	4,310
シマノ	6.3	5.8	152,076
テイ・エス　テック	3.9	3.6	11,124
ジャムコ	0.8	0.8	551
精密機器（2.6%）			
テルモ	47.6	43.6	182,814
クリエートメディック	0.6	0.5	484
日機装	5	5	5,170
日本エム・ディ・エム	1	0.9	2,075
島津製作所	20.1	18.4	76,452
ＪＭＳ	1.5	1.3	1,246
クボテック	0.4	0.4	145
長野計器	1.2	1.1	1,084
ブイ・テクノロジー	0.8	0.7	4,557
東京計器	1.1	1	916
愛知時計電機	0.2	0.2	850
インターアクション	0.9	0.8	2,116
オーバル	1.5	1.4	485
東京精密	3	2.8	14,336

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
マニー	6.7	6.1	17,726
ニコン	27.2	23.5	20,092
トプコン	8.5	7.8	10,179
オリンパス	93	85.3	175,419
理研計器	1.5	1.4	4,256
タムロン	1.4	1.2	2,438
ＨＯＹＡ	33.6	30.6	419,526
シード	0.7	0.7	424
ノーリツ鋼機	1.1	1	2,250
エー・アンド・デイ	1.5	1.4	1,814
朝日インテック	14.3	17.5	60,462
シチズン時計	19.7	18	5,508
リズム	0.5	0.5	344
大研医器	1.2	1.1	627
メニコン	2.3	2.2	15,026
シンシア	0.2	0.2	137
松風	0.8	0.7	1,248
セイコーホールディングス	2.4	2.2	2,908
ニプロ	11.6	10.7	13,225
その他製品（2.6%）			
中本パックス	0.4	0.4	664
スノーピーク	0.8	0.9	1,706
パラマウントベッドホールディングス	1.8	1.6	7,640
トランザクション	1.1	0.8	849
粧美堂	0.5	0.4	158
ニホンフラッシュ	0.8	1.4	1,870
前田工繊	1.9	1.7	4,630
永大産業	2.3	2	570
アートネイチャー	1.8	1.6	1,035
バンダイナムコホールディングス	17.4	15.9	151,749
アイフィスジャパン	0.4	0.4	283
共立印刷	2.8	2.6	306
ＳＨＯＥＩ	0.8	1.3	5,395
フランスベッドホールディングス	2.4	2.2	2,017
パイロットコーポレーション	2.7	2.7	8,067
萩原工業	0.9	0.9	1,337
トッパン・フォームズ	3.6	3.3	3,517
フジシールインターナショナル	3.8	3.5	6,758
タカラトミー	7.5	6.9	6,210
廣済堂	1.2	1.1	933
エステールホールディングス	0.5	0.4	241
アーク	6.5	－	－
タカノ	0.7	0.6	358
プロネクサス	1.4	1.3	1,392
ホクシン	1.1	1.1	123
ウッドワン	0.6	0.5	526
大建工業	1.1	1	1,757
凸版印刷	23.7	21.8	32,438
大日本印刷	22	20.2	37,349
共同印刷	0.5	0.5	1,782
ＮＩＳＳＨＡ	3.5	3.2	4,428
光村印刷	0.1	0.1	166
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	0.8	0.7	1,217
アシックス	13.9	13.6	24,235
ツツミ	0.5	0.5	932
小松ウオール工業	0.5	0.5	869
ヤマハ	10	9.2	55,844
河合楽器製作所	0.5	0.5	1,431
クリナップ	1.6	1.4	656
ピジョン	10.2	9.9	45,540
オリバー	0.4	0.3	744
兼松サステック	0.1	0.1	174
キングジム	1.4	1.3	1,119
リンテック	4	3.7	8,987
イトーキ	3.6	3.1	1,038
任天堂	10.3	9.5	595,460
三菱鉛筆	2.8	2.5	3,265
タカラスタンダード	3.5	3.2	4,828
コクヨ	8.1	7.4	9,938
ナカバヤシ	1.6	1.5	916
グローブライド	0.8	0.7	3,188
オカムラ	5.9	5.4	5,086
美津濃	1.5	1.4	2,906
電気・ガス業（1.3%）			
東京電力ホールディングス	134.2	123	50,307
中部電力	51.4	47.1	62,077

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
関西電力	63.7	58.4	63,042
中国電力	23.2	22.2	28,682
北陸電力	15.4	14.1	10,039
東北電力	42	38.5	35,035
四国電力	15.1	13.9	10,133
九州電力	34.6	31.8	32,595
北海道電力	15.7	14.4	6,148
沖縄電力	3.1	3	4,254
電源開発	13.4	12.3	21,832
エフオン	0.8	0.8	977
イーレックス	2.4	2.4	4,413
レノバ	2.8	2.6	11,622
東京瓦斯	32.3	29.6	69,737
大阪瓦斯	32.6	29.9	58,932
東邦瓦斯	8.3	7.6	47,804
北海道瓦斯	0.9	0.8	1,248
広島ガス	3.6	3.2	1,200
西部瓦斯	1.9	1.7	5,142
静岡ガス	4.8	4.4	4,386
メタウォーター	0.8	1.5	3,733
陸運業（3.4%）			
ＳＢＳホールディングス	1.5	1.1	2,664
東武鉄道	17.7	16.1	47,382
相鉄ホールディングス	5.4	4.9	12,009
東急	42.4	38.9	49,286
京浜急行電鉄	21.6	19.8	32,076
小田急電鉄	25	22.9	73,394
京王電鉄	8.7	8	65,520
京成電鉄	11.7	10.7	37,075
富士急行	2.3	2.1	10,426
新京成電鉄	0.4	0.4	876
東日本旅客鉄道	29.6	27.1	185,364
西日本旅客鉄道	15	13.7	73,843
東海旅客鉄道	14	12.8	188,800
西武ホールディングス	22.6	20.1	19,878
鴻池運輸	2.7	2.5	2,532
西日本鉄道	4.7	4.3	12,594
ハマキョウレックス	1.3	1.2	3,606

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サカイ引越センター	0.9	0.8	4,064
近鉄グループホールディングス	15.9	14.6	65,335
阪急阪神ホールディングス	21.2	19.5	65,617
南海電気鉄道	7.5	6.9	17,505
京阪ホールディングス	7.1	6.5	32,077
神戸電鉄	0.4	0.3	1,075
名古屋鉄道	13.1	12	31,932
山陽電気鉄道	1.1	1	1,985
日本通運	5.6	5.1	37,128
ヤマトホールディングス	27.9	24.2	63,307
山九	4.4	4.1	16,215
丸運	1	0.9	228
丸全昭和運輸	1.3	1.2	4,050
センコーグループホールディングス	8.8	8	7,952
トナミホールディングス	0.4	0.4	2,168
ニッコンホールディングス	5.7	5.2	10,961
日本石油輸送	0.2	0.2	530
福山通運	2	1.9	7,752
セイノーホールディングス	11.9	10.9	15,151
エスライン	0.5	0.4	352
神奈川中央交通	0.4	0.4	1,532
日立物流	2.9	2.7	8,437
丸和運輸機関	1.7	3.1	7,108
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1.6	1.5	3,178
九州旅客鉄道	14.2	12.8	27,353
ＳＧホールディングス	16.7	30.6	84,915
海運業（0.2%）			
日本郵船	13.3	12.2	31,537
商船三井	10.1	9.2	27,397
川崎汽船	4.9	4.5	8,869
ＮＳユナイテッド海運	0.9	0.8	1,167
明治海運	1.7	1.6	603
飯野海運	7.5	6.8	2,930
共栄タンカー	0.3	0.3	271
乾汽船	0.9	0.8	741
空運業（0.4%）			
日本航空	28.7	32.8	61,992
ＡＮＡホールディングス	29.1	36.3	81,057

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
パスコ	0.3	0.3	421
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	0.4	0.4	3,372
日新	1.4	1.3	1,609
三菱倉庫	5.1	4.6	14,260
三井倉庫ホールディングス	1.8	1.7	3,893
住友倉庫	5.9	5.2	6,697
澁澤倉庫	0.9	0.8	1,698
東陽倉庫	2.9	2.6	829
日本トランスシティ	3.5	3.2	1,689
ケイヒン	0.3	0.3	390
中央倉庫	1	0.9	1,025
川西倉庫	0.3	0.3	347
安田倉庫	1.3	1.2	1,143
ファイズホールディングス	0.3	0.3	341
東洋埠頭	0.5	0.4	560
宇徳	1.4	1.2	553
上組	9.1	8.1	15,074
サンリツ	0.4	0.3	210
キムラユニティー	0.4	0.4	432
キユーソー流通システム	0.4	0.4	626
近鉄エクスプレス	3.4	3.1	8,128
東海運	1	0.8	251
エーアイテイー	1.1	1	990
内外トランスライン	0.6	0.5	585
日本コンセプト	0.5	0.5	729
情報・通信業（9.3%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	1.6	4.3	8,243
クロスキャット	0.4	0.4	490
システナ	5.9	5.4	11,005
デジタルアーツ	0.8	0.7	7,259
日鉄ソリューションズ	2.5	2.3	7,440
キューブシステム	0.9	0.8	1,028
エイジア	0.3	0.3	584
コア	0.7	0.6	866
ラクーンホールディングス	－	0.7	1,344
ソリトンシステムズ	0.7	0.8	1,491
ソフトクリエイトホールディングス	0.7	0.7	1,969

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＩＳ	5.5	15.1	33,099
ＪＮＳホールディングス	0.7	0.6	342
電算システム	0.6	0.6	1,962
グリー	11.3	9.3	5,514
コーエーテクモホールディングス	3.4	3.1	18,631
三菱総合研究所	0.7	0.6	2,574
ボルテージ	0.3	0.4	209
電算	0.1	0.2	494
ＡＧＳ	1	0.9	747
ファインデックス	1.4	1.3	1,501
ブレインパッド	0.3	0.4	1,700
ＫＬａｂ	3.2	2.8	2,578
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2	1.8	2,199
イーブックイニシアティブジャパン	0.2	0.2	547
ネクソン	47	38.2	124,723
アイスタイル	4.2	4.2	1,835
エムアップホールディングス	0.5	0.4	1,017
エイチーム	1.1	1	1,184
エニグモ	1.2	1.4	1,783
テクノスジャパン	1.3	1.2	858
ｅｎｉｓｈ	0.8	0.8	390
コロプラ	5.4	5	4,650
オルトプラス	1.2	0.9	388
ブロードリーフ	8.1	7.5	4,905
クロス・マーケティンググループ	0.7	0.7	261
デジタルハーツホールディングス	0.9	0.8	1,071
システム情報	0.8	1.1	1,347
メディアドゥ	0.5	0.5	3,485
じげん	4.1	3.7	1,491
ブイキューブ	1.1	0.8	2,656
エンカレッジ・テクノロジ	0.3	0.3	207
サイバーリンクス	0.3	0.5	1,099
ディー・エル・イー	1.2	1.2	386
フィックスターズ	1.8	1.6	1,620
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.8	0.6	820
オプティム	0.4	0.8	2,588
セレス	0.5	0.5	1,281
ＳＨＩＦＴ	0.4	0.7	9,170

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ティーガイア	1.5	1.3	2,493
セック	0.2	0.2	569
日本アジアグループ	1.8	1.6	1,403
豆蔵ホールディングス	1.1	－	－
テクマトリックス	1.2	2.1	4,193
プロシップ	0.5	0.4	578
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4	3.6	9,334
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	2.7	3.2	50,048
ザッパラス	0.9	0.7	347
システムリサーチ	0.4	0.4	725
インターネットイニシアティブ	2.4	4.5	10,062
さくらインターネット	1.8	1.6	1,171
ヴィンクス	0.5	0.4	480
ＧＭＯグローバルサイン・ホールディングス	0.3	0.3	2,808
ＳＲＡホールディングス	0.9	0.8	2,031
システムインテグレータ	0.5	0.5	310
朝日ネット	1.2	1.1	959
ｅＢＡＳＥ	1	1.8	1,931
アバント	1.2	1.4	1,761
アドソル日進	0.6	0.5	1,672
フリービット	1	0.8	796
コムチュア	1.9	1.7	5,047
サイバーコム	0.3	0.3	511
アステリア	1.1	0.9	953
アイル	0.6	0.8	1,205
マークラインズ	0.8	0.6	1,528
メディカル・データ・ビジョン	1.3	1.7	5,134
ｇｕｍｉ	2.1	1.9	1,673
ショーケース	0.4	0.3	306
モバイルファクトリー	0.4	0.3	333
テラスカイ	0.6	0.5	1,915
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.7	0.6	972
ＰＣＩホールディングス	0.3	0.6	938
パイプドＨＤ	0.2	0.2	332
アイビーシー	0.3	0.2	223
ネオジャパン	0.3	0.3	607
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	0.1	0.3	1,236
ランドコンピュータ	0.3	0.2	223

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダブルスタンダード	0.2	0.2	901
オープンドア	0.8	0.7	1,204
マイネット	0.6	0.5	467
アカツキ	0.6	0.5	2,407
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	189
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	0.4	0.3	1,066
ＬＩＮＥ	3.8	－	－
カナミックネットワーク	1	1.4	1,037
ノムラシステムコーポレーション	0.4	0.7	266
チェンジ	0.3	2.1	7,917
シンクロ・フード	0.7	0.7	240
オークネット	1	0.8	1,088
セグエグループ	0.3	0.4	533
エイトレッド	0.2	0.3	806
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1.7	1.5	664
マクロミル	2.9	3.1	2,235
ビーグリー	0.3	0.3	531
オロ	0.4	0.5	2,027
ユーザーローカル	0.1	0.2	886
テモナ	0.2	0.3	312
ニーズウェル	0.2	0.3	204
サインポスト	0.3	0.3	292
ソルクシーズ	0.7	0.6	600
フェイス	0.6	0.5	406
プロトコーポレーション	1.5	1.4	1,496
ハイマックス	0.2	0.4	484
野村総合研究所	27.6	21.4	81,427
サイバネットシステム	1.2	1.1	1,085
ＣＥホールディングス	1	0.8	516
日本システム技術	0.3	0.2	318
インテージホールディングス	2.1	1.9	2,190
東邦システムサイエンス	0.5	0.4	371
ソースネクスト	7.8	7.2	2,030
インフォコム	1.8	1.7	5,805
ＨＥＲＯＺ	－	0.2	566
ラクスル	0.9	1.2	5,106
ＦＩＧ	1.8	1.7	450
システムサポート	0.1	0.3	479

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イーソル	0.6	0.8	982
アルテリア・ネットワークス	1.8	1.7	2,728
ＥｄｕＬａｂ	－	0.1	726
東海ソフト	－	0.1	121
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.4	0.3	589
東名	－	0.1	114
ヴィッツ	－	0.1	218
トビラシステムズ	－	0.1	139
Ｌｉｎｋ－Ｕ	－	0.1	136
フォーカスシステムズ	1	0.9	871
クレスコ	0.5	0.9	1,198
フジ・メディア・ホールディングス	15.9	14.6	17,096
オービック	5.7	5.2	108,836
ジャストシステム	2.7	2.5	19,725
ＴＤＣソフト	1.4	1.3	1,267
Ｚホールディングス	226.6	207.7	143,333
トレンドマイクロ	7.3	8.1	45,846
ＩＤホールディングス	0.6	0.6	742
日本オラクル	3.3	3.1	40,827
アルファシステムズ	0.5	0.5	1,765
フューチャー	2	1.8	3,268
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1.1	1	1,391
ＳＢテクノロジー	0.6	0.5	1,745
トーセ	0.5	0.4	318
オービックビジネスコンサルタント	1.7	1.5	10,365
伊藤忠テクノソリューションズ	7.5	6.9	25,702
アイティフォー	2	1.8	1,738
東計電算	0.2	0.2	842
エックスネット	0.3	0.2	197
大塚商会	8.9	8.2	43,460
サイボウズ	1.9	1.8	4,980
ソフトブレーン	1	－	－
電通国際情報サービス	1	1.9	7,505
ＡＣＣＥＳＳ	－	1.4	1,087
デジタルガレージ	3	2.7	10,192
ＥＭシステムズ	2.3	2.1	2,060
ウェザーニューズ	0.6	0.5	2,585
ＣＩＪ	1.2	1	880
ビジネスエンジニアリング	0.2	0.2	642
日本エンタープライズ	1.7	1.5	351
WOWOW	0.8	0.7	1,991
スカラ	1.2	1	847
インテリジェント　ウェイブ	0.6	0.9	657
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1.5	1.3	522
ネットワンシステムズ	6.3	5.8	22,127
システムソフト	3.9	3.3	303
アルゴグラフィックス	1.4	1.3	4,023
マーベラス	2.5	2.3	2,304
エイベックス	2.8	2.6	3,434
日本ユニシス	5.2	4.7	18,870
兼松エレクトロニクス	0.9	0.8	3,212
都築電気	－	0.5	846
ＴＢＳホールディングス	10	9.2	17,710
日本テレビホールディングス	13.8	12.6	14,527
朝日放送グループホールディングス	1.6	1.5	1,047
テレビ朝日ホールディングス	4.5	4.2	7,891
スカパーＪＳＡＴホールディングス	10.8	9.9	4,702
テレビ東京ホールディングス	1.4	1.2	2,796
日本ＢＳ放送	0.6	0.5	579
ビジョン	1.5	1.9	1,841
スマートバリュー	0.5	0.4	371
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.6	0.6	1,161
ワイヤレスゲート	0.8	0.6	406
コネクシオ	0.9	0.9	1,256
日本通信	12.7	11.8	2,171
クロップス	0.3	0.3	223
日本電信電話	220.5	202.1	553,754
ＫＤＤＩ	122.9	110.2	359,252
ソフトバンク	149.9	137.4	184,596
光通信	1.7	1.6	35,552
ＮＴＴドコモ	121.9	－	－
エムティーアイ	1.6	1.5	1,234
ＧＭＯインターネット	6.5	5.4	16,767
ファイバーゲート	0.3	0.5	1,081
アイドママーケティングコミュニケーション	0.5	0.5	224
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	4.4	4.1	14,309

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
学研ホールディングス	0.6	2	3,350
ゼンリン	3.3	3	3,558
昭文社ホールディングス	0.8	0.7	324
インプレスホールディングス	1.5	1.3	243
アイネット	0.8	0.8	1,279
松竹	1.1	1	14,240
東宝	9.9	8.9	35,155
東映	0.6	0.6	10,494
エヌ・ティ・ティ・データ	43.9	40.3	60,853
ピー・シー・エー	0.2	0.3	1,395
ビジネスブレイン太田昭和	0.3	0.5	801
ＤＴＳ	3.7	3.4	7,133
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7	6.4	37,760
シーイーシー	1.8	1.6	2,366
カプコン	7.8	7.1	51,120
アイ・エス・ビー	0.3	0.7	970
ジャステック	1.1	1	1,211
ＳＣＳＫ	3.8	3.5	19,460
日本システムウエア	0.5	0.5	1,090
アイネス	1.6	1.5	2,136
ＴＫＣ	1.4	1.3	9,347
富士ソフト	2.1	1.6	8,336
ＮＳＤ	5.4	4.9	10,005
コナミホールディングス	6	5.5	36,410
福井コンピュータホールディングス	0.6	0.6	2,292
ＪＢＣＣホールディングス	1.1	1	1,590
ミロク情報サービス	1.5	1.3	2,704
ソフトバンクグループ	130.9	120	1,039,680
卸売業（4.6%）			
ホウスイ	0.1	0.1	100
高千穂交易	0.6	0.6	731
オルバヘルスケアホールディングス	－	0.2	303
伊藤忠食品	0.4	0.4	2,108
エレマテック	1.5	1.4	1,402
ＪＡＬＵＸ	0.5	0.4	560
あらた	1.3	1.2	5,538
トーメンデバイス	0.2	0.2	730
東京エレクトロン　デバイス	0.6	0.5	1,757

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フィールズ	1.3	1.2	621
双日	91.5	83.8	20,782
アルフレッサ　ホールディングス	18.4	16.9	34,087
横浜冷凍	4.6	4	3,496
神栄	0.2	0.2	360
ラサ商事	0.9	0.8	720
ラクーンホールディングス	0.8	－	－
アルコニックス	1.8	1.6	2,688
神戸物産	5.7	10.5	31,867
ハイパー	－	0.2	106
あい　ホールディングス	2.4	2.2	4,492
ディーブイエックス	0.6	0.5	509
ダイワボウホールディングス	1.4	1.3	11,557
マクニカ・富士エレホールディングス	3.9	3.6	7,830
ラクト・ジャパン	0.6	0.7	1,866
グリムス	－	0.3	515
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3.1	2.9	2,311
八洲電機	1.3	1.2	1,176
メディアスホールディングス	1	0.9	719
レスターホールディングス	1.7	1.6	3,456
ジューテックホールディングス	0.4	0.3	310
大光	0.7	0.6	401
ＯＣＨＩホールディングス	0.4	0.4	525
ＴＯＫＡＩホールディングス	8.7	8	7,808
黒谷	0.4	0.4	300
Ｃｏｍｉｎｉｘ	0.3	0.3	228
三洋貿易	0.8	1.5	1,500
ビューティガレージ	0.3	0.2	489
ウイン・パートナーズ	1.2	1.1	1,238
ミタチ産業	0.5	0.5	300
シップヘルスケアホールディングス	2.7	2.4	14,664
明治電機工業	0.5	0.5	785
デリカフーズホールディングス	0.6	0.5	309
スターティアホールディングス	0.4	0.3	307
コメダホールディングス	3.6	3.3	6,240
ピーバンドットコム	－	0.2	232
アセンテック	0.1	0.3	589
富士興産	0.5	0.5	569

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
協栄産業	0.2	0.2	269
小野建	1.5	1.4	1,737
南陽	0.4	0.3	494
佐鳥電機	1.2	1	775
エコートレーディング	0.4	0.3	196
伯東	1	0.9	1,060
コンドーテック	1.3	1.2	1,287
中山福	1	0.9	493
ナガイレーベン	2.4	2	6,040
三菱食品	1.8	1.7	4,846
松田産業	1.2	1.1	2,082
第一興商	2.5	2.3	8,073
メディパルホールディングス	17.9	16.4	33,472
ＳＰＫ	0.4	0.7	875
萩原電気ホールディングス	0.6	0.6	1,540
アズワン	1.1	1	16,480
スズデン	0.6	0.5	615
尾家産業	0.5	0.4	509
シモジマ	1	0.9	1,241
ドウシシャ	1.6	1.4	2,765
小津産業	0.4	0.3	571
高速	1	0.9	1,349
たけびし	0.6	0.5	791
リックス	0.4	0.3	457
丸文	1.5	1.3	716
ハピネット	1.4	1.3	2,137
橋本総業ホールディングス	0.3	0.3	776
日本ライフライン	4.9	4.5	6,898
タカショー	0.8	1	797
エクセル	0.5	－	－
マルカ	0.6	0.5	955
ＩＤＯＭ	4.4	4.1	2,599
進和	1	0.9	1,906
エスケイジャパン	0.3	0.3	139
ダイトロン	0.7	0.6	987
シークス	2.1	1.9	3,159
田中商事	0.5	0.5	349
オーハシテクニカ	0.9	0.8	1,129

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	0.6	0.5	710
ダイコー通産	－	0.1	158
伊藤忠商事	115.8	106.2	332,406
丸紅	172.4	158	113,523
高島	0.3	0.2	332
長瀬産業	9.3	8.5	13,328
蝶理	1.1	1	1,572
豊田通商	18.5	16.9	72,332
三共生興	2.5	2.3	1,081
兼松	6.2	5.7	7,638
ツカモトコーポレーション	0.3	0.3	475
三井物産	145.5	131.4	267,661
日本紙パルプ商事	0.9	0.9	3,163
日立ハイテク	5.8	－	－
カメイ	2.2	2	2,408
東都水産	0.2	0.2	728
ＯＵＧホールディングス	0.2	0.2	563
スターゼン	0.6	0.6	2,517
山善	6.5	5.9	5,917
椿本興業	0.3	0.3	1,047
住友商事	104.5	95.8	137,856
内田洋行	0.7	0.6	2,481
三菱商事	116.2	99.5	269,396
第一実業	0.8	0.7	2,870
キヤノンマーケティングジャパン	4.7	3.8	9,211
西華産業	0.9	0.9	1,221
佐藤商事	1.4	1.3	1,188
菱洋エレクトロ	1.7	1.5	5,130
東京産業	1.5	1.4	859
ユアサ商事	1.6	1.4	4,501
神鋼商事	0.4	0.4	732
トルク	1	0.9	222
阪和興業	3.1	2.8	7,800
正栄食品工業	1.1	1	3,715
カナデン	1.3	1.2	1,530
菱電商事	1.2	1.1	1,753
フルサト工業	0.9	0.8	1,036
岩谷産業	3.7	3.9	27,183

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ナイス	0.7	0.6	905
昭光通商	0.6	0.5	323
ニチモウ	0.3	0.2	368
極東貿易	0.5	0.4	558
イワキ	2.3	2	1,376
三愛石油	4.1	3.7	4,162
稲畑産業	3.6	3.3	4,887
ＧＳＩクレオス	0.4	0.4	763
明和産業	1.6	1.4	639
クワザワホールディングス	0.6	0.5	311
ヤマエ久野	－	1.1	1,179
ワキタ	3.5	3.2	3,120
東邦ホールディングス	5.3	4.9	9,599
サンゲツ	4.5	4.1	6,400
ミツウロコグループホールディングス	2.4	2.2	3,025
シナネンホールディングス	0.7	0.6	1,812
伊藤忠エネクス	3.7	3.4	3,525
サンリオ	4.6	4.3	6,682
サンワテクノス	1.2	1.1	1,175
リョーサン	1.8	1.7	3,542
新光商事	2.6	2.3	1,715
トーホー	0.7	0.7	1,278
三信電気	0.9	0.8	1,506
東陽テクニカ	1.9	1.6	1,920
モスフードサービス	2.2	2	6,130
加賀電子	1.6	1.5	3,508
ソーダニッカ	1.8	1.6	844
立花エレテック	1.2	1.1	1,758
フォーバル	0.7	0.7	553
ＰＡＬＴＡＣ	2.7	2.4	13,368
三谷産業	2.3	2	886
太平洋興発	0.7	0.6	384
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	0.3	0.3	738
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.1	0.1	156
コーア商事ホールディングス	－	0.3	417
国際紙パルプ商事	4.1	3.6	864
ヤマタネ	0.8	0.8	1,094
丸紅建材リース	0.2	0.1	172

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日鉄物産	1.2	1.1	4,015
泉州電業	0.5	0.4	1,288
トラスコ中山	3.4	3.5	9,254
オートバックスセブン	6.1	5.6	7,946
モリト	1.2	1.1	669
加藤産業	2.6	2.2	7,645
北恵	0.3	0.4	358
イノテック	1	0.8	1,052
イエローハット	3.1	2.9	4,877
ＪＫホールディングス	1.5	1.4	1,132
日伝	1.5	1.4	3,092
北沢産業	1.3	1.1	298
杉本商事	0.9	0.8	1,841
因幡電機産業	4.7	4.3	10,676
東テク	0.5	0.5	1,386
ミスミグループ本社	20.7	19	60,990
アルテック	1.3	1.1	308
タキヒヨー	0.5	0.5	951
蔵王産業	0.3	0.3	406
スズケン	7	6.4	25,312
ジェコス	1.1	1	960
グローセル	1.7	1.5	757
小売業（4.7%）			
ローソン	4.2	3.8	18,430
サンエー	1.4	1.3	5,310
カワチ薬品	1.3	1.2	3,618
エービーシー・マート	2.6	2.4	14,208
ハードオフコーポレーション	0.7	0.6	460
アスクル	1.7	1.6	6,008
ゲオホールディングス	3	2.7	3,240
アダストリア	2.3	2.1	3,987
ジーフット	1	0.9	374
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.2	0.2	80
くら寿司	0.9	0.9	5,661
キャンドゥ	0.8	0.7	1,306
パルグループホールディングス	0.8	1.5	2,208
エディオン	7.6	7	7,147
サーラコーポレーション	3.3	3.1	1,770

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワッツ	0.8	0.7	617
ハローズ	0.6	0.6	2,025
フジオフードグループ本社	1.4	1.3	1,589
あみやき亭	0.4	0.3	856
ひらまつ	3	2.8	406
大黒天物産	0.4	0.4	2,312
ハニーズホールディングス	1.5	1.3	1,297
ファーマライズホールディングス	0.4	0.4	310
アルペン	1.3	1.2	2,829
ハブ	0.5	0.4	248
クオールホールディングス	2.4	2.2	2,534
ジンズホールディングス	0.9	0.8	5,480
ビックカメラ	9.8	9	10,233
ＤＣＭホールディングス	8.9	9.3	10,062
ペッパーフードサービス	1.3	1.6	400
ＭｏｎｏｔａＲＯ	11.8	10.8	56,484
東京一番フーズ	0.4	0.4	230
ＤＤホールディングス	0.7	0.6	350
きちりホールディングス	0.5	0.4	230
アークランドサービスホールディングス	1.2	1.3	2,753
Ｊ．フロント　リテイリング	19.8	18.1	15,620
ドトール・日レスホールディングス	2.6	2.2	3,436
マツモトキヨシホールディングス	6.8	6.3	26,995
ブロンコビリー	0.9	0.8	1,760
ＺＯＺＯ	11.4	10.4	31,668
トレジャー・ファクトリー	0.5	0.4	292
物語コーポレーション	0.4	0.4	4,520
ココカラファイン	1.7	1.6	11,264
三越伊勢丹ホールディングス	28.9	26.5	16,350
Ｈａｍｅｅ	0.5	0.5	891
ウエルシアホールディングス	4.9	9	32,625
クリエイトＳＤホールディングス	2.4	2.6	8,918
丸善ＣＨＩホールディングス	2	1.8	671
ミサワ	0.3	0.3	222
ティーライフ	0.2	0.2	232
エー・ピーホールディングス	0.3	0.3	118
チムニー	0.5	0.5	615
シュッピン	1.1	1	933
オイシックス・ラ・大地	－	1.5	4,935
ネクステージ	2.4	2.6	3,621
ジョイフル本田	4.8	4.4	6,274
鳥貴族	0.5	0.4	588
キリン堂ホールディングス	0.7	－	－
ホットランド	1.1	1.1	1,334
すかいらーくホールディングス	18.6	17	28,169
ＳＦＰホールディングス	0.7	0.9	1,221
綿半ホールディングス	0.6	1.1	1,559
ヨシックス	0.3	0.2	408
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4.8	4.4	4,945
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	0.8	701
ＢＥＥＮＯＳ	0.629	0.7	1,703
あさひ	1.2	1.1	1,813
日本調剤	0.5	0.9	1,353
コスモス薬品	0.7	1.3	21,125
トーエル	0.8	0.7	581
オンリー	0.3	0.3	137
セブン＆アイ・ホールディングス	64.8	59.4	237,897
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4.4	8.2	5,953
ツルハホールディングス	3.6	3.3	46,431
サンマルクホールディングス	1.3	1.2	1,789
フェリシモ	0.4	0.3	398
トリドールホールディングス	2	3.8	5,650
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1.6	1.4	646
ウイルプラスホールディングス	0.3	0.2	161
ＪＭホールディングス	0.8	1.1	2,324
サツドラホールディングス	0.2	0.2	405
アレンザホールディングス	0.8	0.8	1,032
串カツ田中ホールディングス	0.3	0.4	630
バロックジャパンリミテッド	1.2	1.1	834
クスリのアオキホールディングス	1.6	1.4	11,970
力の源ホールディングス	0.8	0.7	413
スシローグローバルホールディングス	1.8	8.3	32,121
ＬＩＸＩＬビバ	1.6	－	－
メディカルシステムネットワーク	1.7	1.5	927
はるやまホールディングス	0.8	0.7	473
ノジマ	2.9	2.7	7,784

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	2.3	2.1	3,154
ライトオン	1.3	1.1	664
ジーンズメイト	0.4	0.5	141
良品計画	22	20.2	48,621
三城ホールディングス	1.9	1.6	507
アドヴァン	2.5	2.3	2,640
アルビス	0.6	0.6	1,468
コナカ	2	1.8	556
ハウス　オブ　ローゼ	0.1	0.2	335
Ｇ－７ホールディングス	1	0.9	2,279
イオン北海道	1.7	2	1,996
コジマ	2.8	2.6	1,677
ヒマラヤ	0.6	0.5	487
コーナン商事	2.4	2.2	6,371
エコス	0.6	0.6	1,146
ワタミ	2	1.8	1,740
マルシェ	0.5	0.4	197
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	39.7	33.4	76,085
西松屋チェーン	3.6	3.3	4,649
ゼンショーホールディングス	7.9	7.3	21,111
幸楽苑ホールディングス	1.1	1	1,694
ハークスレイ	0.3	0.3	268
サイゼリヤ	2.7	2.3	4,756
ＶＴホールディングス	6.8	6.3	2,715
魚力	0.5	0.4	743
ポプラ	0.4	0.4	140
フジ・コーポレーション	0.4	0.4	852
ユナイテッドアローズ	1.7	1.6	2,452
ハイデイ日高	2.4	2.2	3,751
京都きもの友禅	1.1	1	211
コロワイド	5.5	5	9,140
ピーシーデポコーポレーション	2.3	2	1,148
壱番屋	1.2	1.1	5,676
トップカルチャー	0.5	0.6	212
ＰＬＡＮＴ	0.4	0.4	295
スギホールディングス	3.3	3	21,840
薬王堂ホールディングス	0.7	0.7	1,824
ヴィア・ホールディングス	2	1.9	471

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	2.7	2.3	2,056
ヨンドシーホールディングス	1.7	1.5	2,875
ファミリーマート	13.2	－	－
木曽路	2.2	2	4,794
ＳＲＳホールディングス	2	1.8	1,503
千趣会	3	2.8	904
タカキュー	1.4	1.3	195
リテールパートナーズ	－	2	2,728
ケーヨー	3.4	3.1	2,346
上新電機	2	1.8	5,108
日本瓦斯	2.6	2.3	11,638
ロイヤルホールディングス	2.9	2.6	4,726
東天紅	0.1	0.1	89
いなげや	2.1	1.9	3,338
島忠	3.1	2.9	15,892
チヨダ	1.7	1.6	1,425
ライフコーポレーション	1.3	1.2	3,936
リンガーハット	2	1.9	4,489
ＭｒＭａｘＨＤ	2.4	2.1	1,558
テンアライド	1.6	1.4	464
ＡＯＫＩホールディングス	3.3	3	1,611
オークワ	2.6	2.4	3,026
コメリ	2.6	2.3	6,771
青山商事	3.4	3.1	1,909
しまむら	1.9	1.8	20,880
はせがわ	0.9	0.8	231
高島屋	12.1	11.1	10,400
松屋	3.3	3.1	2,566
エイチ・ツー・オー　リテイリング	7.8	7.2	5,076
近鉄百貨店	0.6	0.6	1,869
パルコ	1.6	－	－
丸井グループ	15.2	13.9	24,811
アクシアル　リテイリング	1.4	1.3	6,643
井筒屋	0.9	0.9	180
イオン	63.7	58.4	196,282
イズミ	3.4	3.1	11,640
平和堂	3.4	3.1	6,730
フジ	2	1.8	3,592

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤオコー	1.9	1.7	11,407
ゼビオホールディングス	2	1.8	1,549
ケーズホールディングス	16	14.6	20,994
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	0.9	0.8	734
日産東京販売ホールディングス	2.5	2.3	588
シルバーライフ	－	0.2	421
一家ダイニングプロジェクト	－	0.2	108
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	0.8	0.7	2,796
ナルミヤ・インターナショナル	0.3	0.3	289
総合メディカルホールディングス	1.4	－	－
ブックオフグループホールディングス	1	0.9	757
ギフト	－	0.1	199
アインホールディングス	2.2	1.9	12,369
元気寿司	0.4	0.4	968
ヤマダホールディングス	50.4	46.2	24,901
アークランドサカモト	2.6	2.4	3,715
ニトリホールディングス	7.2	6.6	143,451
グルメ杵屋	1.2	1.1	1,067
愛眼	1.3	1.2	274
ケーユーホールディングス	0.9	0.8	667
吉野家ホールディングス	5.4	5	10,685
松屋フーズホールディングス	0.8	0.7	2,450
サガミホールディングス	2.2	2	2,370
関西スーパーマーケット	1.4	1.3	1,471
王将フードサービス	1.2	1.1	6,391
プレナス	1.9	1.7	3,315
ミニストップ	1.2	1.1	1,560
アークス	3.4	3.1	7,151
パローホールディングス	3.7	3.4	8,398
藤久	0.1	0.3	236
ベルク	0.8	0.7	4,046
大庄	0.9	0.8	780
ファーストリテイリング	2.2	2	188,000
サンドラッグ	6.2	5.7	23,085
サックスバー　ホールディングス	1.4	1.3	729
ヤマザワ	0.4	0.4	695
やまや	0.3	0.3	651
ベルーナ	3.5	3.3	3,903

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
銀行業（4.5%）			
島根銀行	0.3	0.4	264
じもとホールディングス	11.1	1	817
めぶきフィナンシャルグループ	86	79	16,590
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.2	2.1	2,341
九州フィナンシャルグループ	27.2	33.3	14,119
ゆうちょ銀行	47	43.1	38,746
富山第一銀行	3.9	3.6	1,040
コンコルディア・フィナンシャルグループ	97.5	86.8	34,112
西日本フィナンシャルホールディングス	11.3	10.1	6,595
関西みらいフィナンシャルグループ	9.8	10.1	5,221
三十三フィナンシャルグループ	1.5	1.4	1,768
第四北越フィナンシャルグループ	2.9	2.6	5,800
ひろぎんホールディングス	－	22.4	13,932
新生銀行	12.2	11.2	14,884
あおぞら銀行	9.9	9.1	17,708
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,141.5	1,039.8	499,104
りそなホールディングス	180.7	166.7	62,112
三井住友トラスト・ホールディングス	31.3	28.7	90,979
三井住友フィナンシャルグループ	114.7	105.1	348,511
千葉銀行	57	50.7	29,659
群馬銀行	32.6	29.2	9,490
武蔵野銀行	2.5	2.3	3,558
千葉興業銀行	4.5	4.2	1,008
筑波銀行	6.8	6.4	1,158
七十七銀行	5.6	5.1	7,007
青森銀行	1.3	1.2	2,911
秋田銀行	1.1	1	1,389
山形銀行	1.9	1.7	1,720
岩手銀行	1.1	1	1,951
東邦銀行	14.7	13.6	2,760
東北銀行	0.8	0.7	765
みちのく銀行	1.1	1	1,012
ふくおかフィナンシャルグループ	14	12.8	24,601
静岡銀行	41	37	28,638
十六銀行	2.1	1.9	3,573
スルガ銀行	16.9	15.6	4,945
八十二銀行	40	36.7	12,404

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
山梨中央銀行	1.9	1.8	1,431
大垣共立銀行	3.3	3	6,030
福井銀行	1.4	1.3	2,479
北國銀行	1.7	1.5	3,762
清水銀行	0.7	0.6	1,021
富山銀行	0.3	0.3	846
滋賀銀行	3.3	3	5,892
南都銀行	2.8	2.5	4,255
百五銀行	14.8	13.7	3,973
京都銀行	5.9	5.4	30,456
紀陽銀行	5.9	5.4	7,408
ほくほくフィナンシャルグループ	11	10.1	9,605
広島銀行	24.4	－	－
山陰合同銀行	9.8	9	4,410
中国銀行	14.3	13.1	10,768
鳥取銀行	0.6	0.5	558
伊予銀行	23.6	21.7	13,323
百十四銀行	1.8	1.6	2,372
四国銀行	2.5	2.3	1,531
阿波銀行	2.7	2.5	5,537
大分銀行	1	0.9	1,836
宮崎銀行	1.1	1	2,219
佐賀銀行	1	0.9	1,182
沖縄銀行	1.5	1.4	3,780
琉球銀行	3.8	3.5	2,590
セブン銀行	55.3	50.8	11,684
みずほフィナンシャルグループ	2,253.3	206.5	287,551
高知銀行	0.6	0.6	417
山口フィナンシャルグループ	20.7	19	11,571
長野銀行	0.5	0.5	623
名古屋銀行	1.3	1.1	2,977
北洋銀行	24.8	22.9	4,854
愛知銀行	0.6	0.5	1,430
中京銀行	0.7	0.6	1,150
大光銀行	0.6	0.5	634
愛媛銀行	2.3	2.1	2,039
トマト銀行	0.7	0.6	613
京葉銀行	7	6.5	2,645
栃木銀行	8	7.4	1,272
北日本銀行	0.5	0.5	945
東和銀行	2.9	2.7	1,806
福島銀行	1.6	1.4	294
大東銀行	0.9	0.8	507
トモニホールディングス	12.7	11.8	3,610
フィデアホールディングス	16	14.9	1,609
池田泉州ホールディングス	18.9	17.5	2,642
証券、商品先物取引業（0.8%）			
ＦＰＧ	5.1	4.7	2,340
ジャパンインベストメントアドバイザー	－	0.8	945
マーキュリアインベストメント	0.8	0.6	436
ＳＢＩホールディングス	18.5	17.5	47,250
日本アジア投資	1.4	1.3	312
ジャフコ　グループ	2.5	2.3	12,535
大和証券グループ本社	133.1	122	60,890
野村ホールディングス	291.8	267.5	150,602
岡三証券グループ	14	13	5,252
丸三証券	4.9	4.5	2,358
東洋証券	5.9	5.5	786
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18.9	17.5	5,652
光世証券	0.4	0.4	255
水戸証券	4.8	4.4	1,179
いちよし証券	3.1	2.8	1,416
松井証券	9.5	8.7	7,134
だいこう証券ビジネス	0.8	－	－
マネックスグループ	12.4	11.2	5,779
極東証券	2.2	2	1,526
岩井コスモホールディングス	1.6	1.4	2,030
藍澤證券	3	2.7	2,178
マネーパートナーズグループ	1.7	1.6	344
スパークス・グループ	5.7	7	2,079
小林洋行	0.4	0.5	136
保険業（1.9%）			
かんぽ生命保険	5.9	5.4	11,982
ＳＯＭＰＯホールディングス	31.2	28.6	120,777
アニコム　ホールディングス	1.4	5.1	5,900
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	43.4	39.7	123,546

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソニーフィナンシャルホールディングス	13.6	－	－
第一生命ホールディングス	93.8	86	140,696
東京海上ホールディングス	59.3	53.7	290,463
Ｔ＆Ｄホールディングス	49.6	45.4	56,886
アドバンスクリエイト	0.4	0.3	557
その他金融業（1.1%）			
全国保証	4.7	4.3	19,414
ジェイリース	0.5	0.4	268
イントラスト	0.6	0.5	408
日本モーゲージサービス	0.3	0.6	735
Ｃａｓａ	0.6	0.5	496
アルヒ	2.6	2.4	4,132
プレミアグループ	0.9	0.8	1,899
クレディセゾン	11.6	10.6	12,910
芙蓉総合リース	1.7	1.6	11,552
みずほリース	2.6	2.3	7,486
東京センチュリー	3.3	3.1	28,582
日本証券金融	7.3	6.7	3,484
アイフル	25.3	23.2	6,148
リコーリース	1.3	1.2	3,744
イオンフィナンシャルサービス	10.1	9.3	12,080
アコム	33.3	30.6	14,290
ジャックス	1.8	1.7	3,279
オリエントコーポレーション	44.9	41.1	5,014
日立キャピタル	3.9	3.6	9,572
アプラスフィナンシャル	8.6	－	－
オリックス	103.7	94.3	163,799
三菱ＵＦＪリース	42.1	38.6	20,458
九州リースサービス	0.8	0.7	431
日本取引所グループ	47.6	43.6	115,823
イー・ギャランティ	1.8	1.7	3,981
アサックス	0.9	0.8	584
ＮＥＣキャピタルソリューション	0.7	0.6	1,183
不動産業（1.9%）			
いちご	21	19.3	5,481
日本駐車場開発	18.1	15.1	2,068
スター・マイカ・ホールディングス	0.9	0.8	915
ＡＤワークスグループ	－	2.9	452
ヒューリック	35.4	32.2	36,450
三栄建築設計	0.7	0.6	1,096
野村不動産ホールディングス	10.1	9.2	20,470
三重交通グループホールディングス	3.3	3.1	1,497
サムティ	2.4	2.2	3,590
ディア・ライフ	2.1	2.1	921
コーセーアールイー	0.5	0.4	265
エー・ディー・ワークス	32.7	－	－
日本商業開発	1	1	1,709
プレサンスコーポレーション	2.7	2.5	3,715
ユニゾホールディングス	2.5	－	－
ＴＨＥグローバル社	0.9	0.7	177
ハウスコム	0.2	0.3	405
日本管理センター	1.1	0.8	957
サンセイランディック	0.5	0.4	294
エストラスト	0.2	0.2	142
フージャースホールディングス	3.3	3	2,016
オープンハウス	4.8	4.8	20,184
東急不動産ホールディングス	45.1	41.3	23,458
飯田グループホールディングス	13.8	12.7	30,137
イーグランド	0.3	0.2	167
ムゲンエステート	1.2	0.9	407
ビーロット	0.4	0.7	433
ファーストブラザーズ	0.4	0.3	296
ハウスドゥ	0.9	0.7	852
シーアールイー	0.4	0.4	528
プロパティエージェント	0.3	0.2	268
ケイアイスター不動産	0.5	0.5	1,342
アグレ都市デザイン	0.3	0.2	136
グッドコムアセット	0.4	0.7	921
ジェイ・エス・ビー	0.2	0.3	1,074
テンポイノベーション	0.4	0.3	269
グローバル・リンク・マネジメント	0.3	0.3	214
パーク２４	8.9	8.2	16,113
パラカ	0.4	0.4	638
三井不動産	81.8	73.9	151,827
三菱地所	116.2	106.5	175,245
平和不動産	3	2.8	10,332

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京建物	18.1	15	21,780
ダイビル	4.3	3.9	4,738
京阪神ビルディング	2.7	2.4	4,048
住友不動産	37.3	34.2	105,643
テーオーシー	3.2	3	2,172
東京楽天地	0.3	0.2	868
レオパレス２１	21.7	19.9	2,965
スターツコーポレーション	2.3	2.1	5,718
フジ住宅	1.9	1.8	1,139
空港施設	1.7	1.5	718
明和地所	1	0.8	466
ゴールドクレスト	1.3	1.2	2,024
エスリード	0.6	0.6	915
日神グループホールディングス	2.4	2.2	926
日本エスコン	3	2.8	2,209
タカラレーベン	7.5	7	2,219
ＡＶＡＮＴＩＡ	0.9	0.9	776
イオンモール	8.3	7.6	13,018
毎日コムネット	0.4	0.4	270
ファースト住建	0.7	0.6	646
ランド	95.2	83.5	751
カチタス	2.1	3.8	12,806
トーセイ	2.3	2.1	2,081
穴吹興産	0.4	0.3	487
サンフロンティア不動産	2.3	2.1	1,866
エフ・ジェー・ネクスト	1.4	1.3	1,332
インテリックス	0.5	0.4	220
ランドビジネス	0.7	0.5	166
サンネクスタグループ	0.4	0.5	472
グランディハウス	1.3	1.2	507
日本空港ビルデング	5.3	4.9	27,930
サービス業（5.8%）			
明豊ファシリティワークス	－	0.7	445
日本工営	1.1	1	2,718
ＬＩＦＵＬＬ	5.6	5.1	1,866
ミクシィ	－	2.8	7,064
ジェイエイシーリクルートメント	1.1	1	1,908
日本M&Aセンター	12.1	11.3	67,122
メンバーズ	0.5	0.4	1,078
中広	0.1	0.2	64
ＵＴグループ	1.9	2.3	7,624
アイティメディア	0.5	0.6	1,319
タケエイ	1.5	1.6	2,256
Ｅ・Ｊホールディングス	0.2	0.6	612
ビーネックスグループ	1.8	1.8	2,205
コシダカホールディングス	3.9	3.5	1,459
アルトナー	0.4	0.4	359
パソナグループ	2	1.6	3,108
ＣＤＳ	0.4	0.4	554
リンクアンドモチベーション	3.5	2.7	1,495
ＧＣＡ	1.9	1.9	1,337
エス・エム・エス	5	4.6	19,113
サニーサイドアップグループ	0.4	0.5	309
パーソルホールディングス	16.1	14.7	28,885
リニカル	0.8	0.7	553
クックパッド	5.6	4.6	1,435
エスクリ	0.5	0.5	156
アイ・ケイ・ケイ	0.8	0.7	424
学情	0.6	0.5	670
スタジオアリス	0.8	0.7	1,416
シミックホールディングス	0.9	0.7	1,059
エプコ	0.3	0.4	379
ＮＪＳ	0.4	0.4	799
綜合警備保障	6.4	5.9	30,857
カカクコム	12	10.9	32,274
アイロムグループ	0.6	0.5	922
セントケア・ホールディング	1.1	1	1,038
サイネックス	0.3	0.2	140
ルネサンス	0.9	0.8	749
ディップ	2.3	2	5,150
デジタルホールディングス	0.9	1	1,917
新日本科学	1.8	1.6	1,182
ツクイホールディングス	3.8	3.5	2,089
キャリアデザインセンター	0.4	0.3	273
ベネフィット・ワン	4.4	5.4	17,118
エムスリー	35.4	32.5	343,362

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツカダ・グローバルホールディング	1.1	1.2	316
プラス	0.2	0.2	95
アウトソーシング	9.2	8.4	11,264
ウェルネット	1.6	1.5	685
ワールドホールディングス	0.5	0.5	983
ディー・エヌ・エー	7.9	6.2	12,127
博報堂ＤＹホールディングス	22.3	20.5	30,176
ぐるなび	2.8	2.6	1,419
タカミヤ	1.7	1.6	896
ジャパンベストレスキューシステム	1.1	1.2	1,024
ファンコミュニケーションズ	4.4	4	1,636
ライク	0.6	0.5	1,002
ビジネス・ブレークスルー	0.7	0.6	273
エスプール	3.1	3.8	3,496
ＷＤＢホールディングス	0.7	0.7	1,845
手間いらず	－	0.1	485
ティア	1	0.9	372
ＣＤＧ	0.2	0.2	302
バリューコマース	0.9	1	3,230
インフォマート	17.6	14.9	13,857
ＪＰホールディングス	5	4.6	1,311
エコナックホールディングス	3.1	2.7	248
ＥＰＳホールディングス	2.4	2	2,048
レッグス	0.4	0.4	662
プレステージ・インターナショナル	6	5.5	5,043
アミューズ	0.9	0.8	2,025
ドリームインキュベータ	0.5	0.4	514
クイック	1	0.9	1,001
ＴＡＣ	0.9	0.9	240
ケネディクス	15.2	12.7	9,486
電通グループ	16.6	16.6	52,456
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.6	0.6	349
ぴあ	0.5	0.4	1,162
イオンファンタジー	0.6	0.6	1,296
シーティーエス	1.8	1.7	1,598
ネクシィーズグループ	0.6	0.4	365
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	4.5	4.1	12,956
アルプス技研	1.4	1.3	2,791

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サニックス	2.8	2.6	912
ダイオーズ	0.3	0.3	286
日本空調サービス	1.7	1.5	1,104
オリエンタルランド	17.1	15.7	254,811
ダスキン	4.1	3.7	10,441
明光ネットワークジャパン	1.9	1.9	1,113
ファルコホールディングス	0.9	0.8	1,292
秀英予備校	0.3	0.3	128
田谷	0.3	0.3	163
ラウンドワン	4.5	4.1	3,591
リゾートトラスト	7.4	6.8	10,179
ビー・エム・エル	2.1	1.9	6,973
ワタベウェディング	0.2	0.2	56
りらいあコミュニケーションズ	2.9	2.6	3,645
リソー教育	7.3	6.7	2,016
早稲田アカデミー	0.5	0.6	594
ユー・エス・エス	18	16.5	34,650
東京個別指導学院	0.6	0.5	334
サイバーエージェント	9.2	9.1	69,069
楽天	74.9	68.6	66,542
クリーク・アンド・リバー社	0.8	0.8	941
モーニングスター	－	1.6	784
テー・オー・ダブリュー	1.4	2.4	660
山田コンサルティンググループ	0.8	1	980
セントラルスポーツ	0.6	0.5	1,069
フルキャストホールディングス	1.6	1.3	2,220
エン・ジャパン	2.9	2.6	8,177
リソルホールディングス	0.1	0.2	761
テクノプロ・ホールディングス	3.2	2.9	24,476
アトラ	0.3	0.3	100
インターワークス	0.3	0.3	109
アイ・アールジャパンホールディングス	0.7	0.6	11,478
ＫｅｅＰｅｒ技研	0.6	1.1	2,275
ファーストロジック	0.4	0.3	239
三機サービス	0.4	0.3	297
Ｇｕｎｏｓｙ	1.1	0.9	674
デザインワン・ジャパン	0.2	0.5	107
イー・ガーディアン	0.8	0.6	1,896

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リブセンス	1	0.8	194
ジャパンマテリアル	4.9	4.5	7,182
ベクトル	2	1.8	2,480
ウチヤマホールディングス	0.8	0.7	237
チャーム・ケア・コーポレーション	1.2	1.3	1,817
ライクキッズ	0.4	－	－
キャリアリンク	0.5	0.5	1,287
ＩＢＪ	1.1	1.2	1,000
アサンテ	0.6	0.6	961
Ｎ・フィールド	1.2	1	864
バリューＨＲ	0.3	0.6	1,068
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1.1	1.2	6,276
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.6	0.6	1,278
ＥＲＩホールディングス	0.5	0.4	245
アビスト	0.2	0.2	589
シグマクシス	1.1	1	1,782
ウィルグループ	1	1	1,057
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.2	2.2	640
メドピア	－	0.7	5,880
レアジョブ	－	0.1	241
リクルートホールディングス	115.1	105.5	493,001
エラン	0.9	2	3,324
土木管理総合試験所	0.7	0.7	239
ネットマーケティング	0.6	0.6	432
日本郵政	131.7	120.7	100,881
ベルシステム２４ホールディングス	2.7	2.5	4,782
鎌倉新書	1.2	1.1	984
ＳＭＮ	0.3	0.3	240
一蔵	0.2	0.2	70
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	0.6	0.5	1,945
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	0.2	0.3	288
エアトリ	0.7	0.8	1,176
アトラエ	0.4	0.4	1,089
ストライク	0.6	0.6	2,853
ソラスト	4.4	4.1	6,760
セラク	0.5	0.5	948
インソース	0.8	1.2	2,341
ベイカレント・コンサルティング	1	0.9	16,704

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	0.3	0.3	664
アイモバイル	0.5	0.5	643
キャリアインデックス	0.6	0.6	333
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	0.5	0.5	578
船場	0.3	0.3	259
グレイステクノロジー	0.7	0.7	4,529
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1.7	3.4	8,938
フルテック	0.2	0.2	279
グリーンズ	0.6	0.4	186
ツナググループ・ホールディングス	0.2	0.3	95
ＧａｍｅＷｉｔｈ	0.4	0.4	228
ソウルドアウト	0.2	0.4	649
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	0.2	0.3	166
エル・ティー・エス	－	0.1	411
ミダック	－	0.2	627
日総工産	1.1	1	818
キュービーネットホールディングス	1	0.6	834
ＲＰＡホールディングス	0.9	1.1	695
スプリックス	0.5	0.4	321
マネジメントソリューションズ	0.2	0.7	1,353
プロレド・パートナーズ	－	0.2	742
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	－	0.1	75
テノ．ホールディングス	－	0.1	125
フロンティア・マネジメント	－	0.2	472
ピアラ	－	0.1	209
コプロ・ホールディングス	－	0.1	393
ギークス	－	0.2	317
カーブスホールディングス	－	4	3,264
フォーラムエンジニアリング	－	0.8	739
ダイレクトマーケティングミックス	－	0.6	2,094
アドバンテッジリスクマネジメント	0.8	0.7	459
リログループ	8.8	8.1	20,582
東祥	1	0.9	1,367
エイチ・アイ・エス	2.5	2.1	3,651
ラックランド	0.4	0.4	955
共立メンテナンス	2.7	2.4	8,148
イチネンホールディングス	1.8	1.6	2,004
建設技術研究所	1.1	0.9	2,268

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スペース	1	1	790
長大	0.6	0.6	948
燦ホールディングス	0.7	0.6	686
スバル興業	0.1	0.1	898
東京テアトル	0.6	0.6	761
タナベ経営	0.3	0.3	407
ナガワ	0.5	0.5	4,955
よみうりランド	0.3	0.3	1,809
東京都競馬	1.1	1	4,460
常磐興産	0.6	0.6	807
カナモト	2.6	2.6	5,922
東京ドーム	6.5	6	7,782
西尾レントオール	1.6	1.4	3,116
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	10.9	8.2	188
トランス・コスモス	1.5	1.4	3,710
乃村工藝社	6.9	6.3	5,077
藤田観光	0.7	0.6	874
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1	0.9	830
日本管財	1.7	1.6	3,219
トーカイ	1.6	1.4	2,788
白洋舎	0.2	0.2	481
セコム	17	15.6	147,732
セントラル警備保障	0.8	0.7	2,415
丹青社	3	2.8	2,139
メイテック	2	1.8	9,414
応用地質	1.7	1.7	2,208
船井総研ホールディングス	3.3	3	6,900
進学会ホールディングス	0.6	0.6	287
オオバ	1.3	1	734
いであ	0.3	0.4	710
学究社	0.5	0.4	530
ベネッセホールディングス	5.4	4.9	9,996
イオンディライト	2	1.8	4,906
ナック	0.9	0.8	739
ニチイ学館	2.3	－	－
ダイセキ	2.7	2.5	8,075
ステップ	0.6	0.5	770
合計 株数・金額	19,919	16,340	39,757,682
合計 銘柄数＜比率＞	2,151	2,171	＜97.0%＞

（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
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	百万円 613	百万円 －

○投資信託財産の構成

（2021年１月25日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	39,757,682	96.4
コール・ローン等、その他	1,481,078	3.6
投資信託財産総額	41,238,760	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

（2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	41,238,760,566
コール・ローン等	633,016,715
株式(評価額)	39,757,682,500
未収入金	788,516,322
未収配当金	56,645,029
差入委託証拠金	2,900,000
(B) 負債	250,001,954
未払金	249,051,222
未払解約金	949,000
未払利息	1,716
その他未払費用	16
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	40,988,758,612
元本	30,730,895,014
次期繰越損益金	10,257,863,598
(D) 受益権総口数	30,730,895,014口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	13,338円

(注) 当ファンドの期首元本額は34,456,230,681円、期中追加設定元本額は39,020,479,973円、期中一部解約元本額は42,745,815,640円です。

(注) 2021年１月25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	17,450,920,640円
・つみたてバランスファンド	2,604,209,212円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,419,395,682円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	1,179,719,445円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	1,001,004,694円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	862,200,668円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	838,236,767円
・りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	641,336,981円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	621,505,044円
・ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	531,427,671円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	446,775,004円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	413,882,777円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	411,211,621円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	364,685,851円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	364,616,923円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	332,616,766円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	266,725,304円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	239,972,979円
・ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	218,916,330円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	143,160,195円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	128,308,620円
・りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	63,604,162円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	60,926,609円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	38,817,727円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	27,999,795円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	19,219,906円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	16,940,770円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	13,481,835円
・リスクコントロール・オープン	8,035,074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）	1,039,962円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.3338円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	582,394,601
受取配当金	582,947,828
その他収益金	110,540
支払利息	△ 663,767
(B) 有価証券売買損益	△ 278,847,903
売買益	6,741,627,928
売買損	△ 7,020,475,831
(C) 先物取引等取引損益	30,370,600
取引益	192,261,750
取引損	△ 161,891,150
(D) 保管費用等	△ 172,145
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	333,745,153
(F) 前期繰越損益金	6,590,707,407
(G) 追加信託差損益金	6,027,769,027
(H) 解約差損益金	△ 2,694,357,989
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	10,257,863,598
次期繰越損益金(Ｉ)	10,257,863,598

(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５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
5期(2021年1月25日)	15,775	11.4	1,476,411.66	11.8	79.0	18.5	1.7	85,135

（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	%		%	%	%	%
2020年1月27日	14,161	−	1,320,229.10	−	74.0	24.0	2.1
1月末	14,054	△ 0.8	1,309,282.75	△ 0.8	73.6	24.4	2.1
2月末	12,914	△ 8.8	1,206,797.32	△ 8.6	80.7	18.3	2.3
3月末	10,999	△22.3	1,027,164.75	△22.2	73.8	28.9	2.0
4月末	12,102	△14.5	1,126,485.68	△14.7	67.2	31.0	1.8
5月末	12,618	△10.9	1,175,146.98	△11.0	62.8	29.6	1.7
6月末	12,841	△ 9.3	1,198,230.41	△ 9.2	70.6	27.6	1.8
7月末	13,276	△ 6.2	1,236,613.63	△ 6.3	68.9	29.4	1.8
8月末	14,301	1.0	1,333,631.08	1.0	67.9	30.4	1.6
9月末	13,729	△ 3.1	1,281,404.11	△ 2.9	79.1	19.1	1.9
10月末	13,345	△ 5.8	1,245,786.00	△ 5.6	81.8	15.0	1.9
11月末	14,867	5.0	1,390,282.99	5.3	78.3	20.2	1.8
12月末	15,291	8.0	1,430,471.43	8.4	84.5	14.3	1.9
（期末）							
2021年1月25日	15,775	11.4	1,476,411.66	11.8	79.0	18.5	1.7

（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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

期中の基準価額等の推移

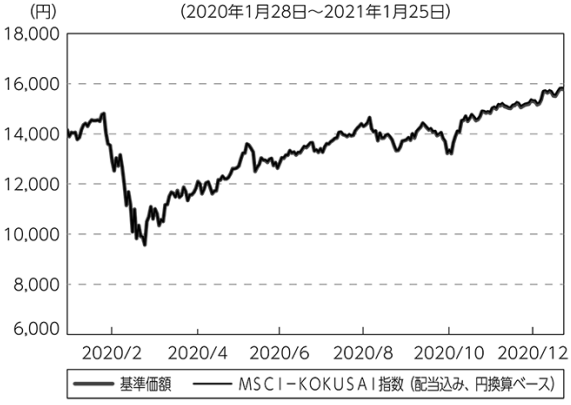
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末14,161円から当期末15,775円となり、1,614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
（2020年1月28日～2021年1月25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

先進国株式市況

先進国株式市場は前期末と比較して上昇しました。2020年３月には新型肺炎問題に伴う経済活動の停滞懸念等から一時大幅に下落しましたが、各国政策当局による大規模な財政・金融支援に対する期待等から上昇基調に転じました。その後も、低金利環境等を支援材料に好業績が期待される情報技術セクターが市場を牽引したほか、期後半にかけては新型コロナウイルスのワクチン開発・普及に対する期待や、米国大統領選挙の結果が確定し景気見通しや政治・政局を巡る不確実性が一定程度和らいだこと等が加わり、先進国株式は上げ幅を拡大して期を終えました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円高、ユーロに対して円安となりました。

米ドルに対しては、2020年３月には新型肺炎問題に伴う不確実性の高まりを受けて、投資家のリスク回避の動きに代表される円高圧力と企業等の米ドルを確保する動き等の円安圧力が交錯し、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、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による強力な金融緩和策の継続や追加経済対策に伴う財政赤字拡大観測から米ドル安（円高）基調で推移しました。

ユーロに対しては、米ドル安が進行したほかＥＵ（欧州連合）復興基金の創設合意などを背景に欧州地域の景気回復期待が高まり、対円でのユーロ高が進行しました。

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。

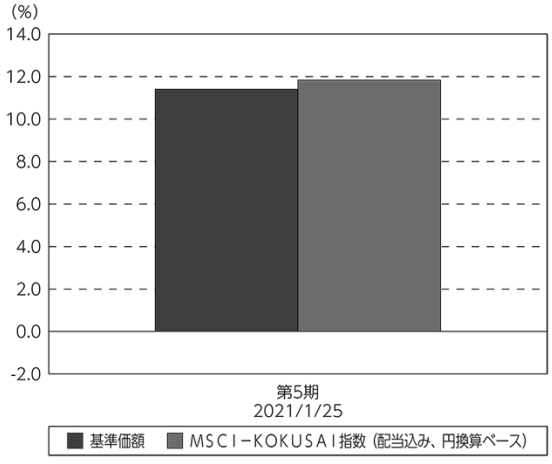
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋11.4%となり、ベンチマークの＋11.8%を0.4%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

（2020年１月28日～2021年１月25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	5	0.034	(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）	(1)	(0.008)	
（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	3	0.019	(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）	(2)	(0.019)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	4	0.030	(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）	(4)	(0.030)	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	12	0.083	
期中の平均基準価額は、13,361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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 19,427 (2,047)	千米ドル 187,593 (1,324)	百株 7,481 (86)	千米ドル 48,278 (1,650)
	カナダ	 2,455 (△ 37)	千カナダドル 12,504 (97)	 875 (55)	千カナダドル 3,130 (188)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	1,653 (57)	7,555 (67)	597 (－)	1,770 (101)
	イタリア	2,589 (△ 35)	1,536 (△ 30)	932	430
	フランス	1,619 (△ 66)	7,852 (△ 144)	561 (－)	2,261 (8)
	オランダ	1,271 (1)	4,130 (△ 764)	424	1,057
	スペイン	3,007 (5,221)	1,832 (109)	6,888 (－)	714 (110)
	ベルギー	118	716	41	194
	オーストリア	49	126	30	74
	ルクセンブルク	69 (13)	123 (－)	30	42
	フィンランド	597 (39)	832 (26)	295 (7)	236 (26)
	アイルランド	95 (6)	550 (58)	153	139
	ポルトガル	334 (238)	189 (2)	327 (－)	30 (2)
	その他	－ (189)	－ (946)	－ (189)	－ (946)
	イギリス	 19,341 (947)	千英ポンド 9,580 (986)	 8,809 (6)	千英ポンド 3,035 (140)
	スイス	 1,093 (0.02)	千スイスフラン 8,204 (△ 31)	 420 (－)	千スイスフラン 2,531 (2)
	スウェーデン	 1,717 (38)	千スウェーデンクローナ 28,387 (66)	 634 (－)	千スウェーデンクローナ 6,907 (66)
	ノルウェー	 427	千ノルウェークローネ 5,272	 106	千ノルウェークローネ 1,312

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	デンマーク	百株 271	千デンマーククローネ 14,117	百株 83	千デンマーククローネ 3,693
	オーストラリア	4,439 (46)	千オーストラリアドル 8,373 (5)	1,805 (2)	千オーストラリアドル 2,379 (5)
	ニュージーランド	484	千ニュージーランドドル 402	252	千ニュージーランドドル 171
	香港	5,138 (△ 395)	千香港ドル 21,325 (0.811)	2,031 (－)	千香港ドル 7,342 (0.811)
	シンガポール	1,810 (160)	千シンガポールドル 1,080 (8)	1,211 (－)	千シンガポールドル 470 (8)
	イスラエル	180 (4)	千イスラエルシュケル 773 (6)	89 (－)	千イスラエルシュケル 301 (6)

(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	アメリカ	証券 － (783)	千米ドル － (11)	証券 783	千米ドル 4
	スイス	－ (13,984)	千スイスフラン － (2)	13,984	千スイスフラン 2

(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
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	AGNC INVESTMENT CORP	3,614	55	－	－
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	947	153	156	19
	AMERICAN TOWER CORP	2,926	743	998	200
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	6,013	39	5,628	29
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	959	149	400	56
	BOSTON PROPERTIES INC	1,126	104	293	24
	CAMDEN PROPERTY TRUST	706	67	299	21
	CROWN CASTLE INTL CORP	3,011	506	1,014	133
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,152	316	651	82
	DUKE REALTY CORP	2,986	109	1,254	33
	EQUINIX INC	553	412	203	106
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	897	59	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL	2,538	146	1,044	60
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	511	122	121	23
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,030	106	265	21
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	－	－	617	53
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,075	141	1,510	31
	HOST HOTELS & RESORTS INC	3,985	55	－	－
	INVITATION HOMES INC	3,987	111	2,048	37
	IRON MOUNTAIN INC	2,024	60	－	－
	KIMCO REALTY CORP	－	－	3,824	42
	LIBERTY PROPERTY TRUST	－ (△ 1,416)	－ (△ 91)	－	－
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2,375	43	1,893	26
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	918	109	249	21
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	－	－	1,474	55
	PROLOGIS INC	4,979 (955)	485 (91)	1,731	111
	PUBLIC STORAGE	1,006	204	432	77
	REALTY INCOME CORP	2,932	178	937	44
	SBA COMMUNICATIONS CORP	704	216	367	89
	SL GREEN REALTY CORP	－	－	468	19
	SIMON PROPERTY GROUP INC	2,126	136	885	42
	SUN COMMUNITIES INC	601	86	－	－
	UDR INC	1,340	48	538	17
	VENTAS INC	2,985	121	1,106	23
	VEREIT INC	－ (△ 8,880)	－ (－)	－	－
	VICI PROPERTIES INC	4,771	109	1,751	21
	WP CAREY INC	978	67	－	－
	WELLTOWER INC	2,938	156	1,193	50

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	WEYERHAEUSER CO	5,194	127	2,456	37
	小計	78,887 (△ 9,341)	5,556 (－)	35,805	1,617
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	－	－	1,901	29
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	－	－	114	1
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	－	－	53	1
	小計	－	－	2,068	31
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	ICADE	－	－	30	1
	KLEPIERRE	－ (－)	－ (△ 1)	1,076	23
	GECINA SA	271	29	176	18
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,085	42	－	－
	小計	1,356 (－)	72 (△ 1)	1,282	44
	ユーロ計	1,356 (－)	72 (△ 1)	1,282	44
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	8,105	38	4,196	15
	SEGRO PLC	9,451	86	3,159	22
	小計	17,556	124	7,355	37
	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	30,712	64	－	－
	GPT GROUP	17,318	81	－	－
	STOCKLAND	15,193	50	13,953	29
	DEXUS	6,866	62	4,027	37
	GOODMAN GROUP	12,230	201	4,364	49
	SCENTRE GROUP	50,867	114	18,081	29
	小計	133,186	575	40,425	146
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	16,000	983	7,700	532
	小計	16,000	983	7,700	532
	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 INTEGRATED COMMER	33,800 (18,360)	65 (47)	－	－
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	17,100 (－)	56 (△ 1)	14,600 (－)	38 (0)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	－	－	－ (25,500)	－ (54)
	SUNTEC REIT	－ (－)	－ (△0.019)	－ (－)	－ (0)

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 LOGISTICS TRUST	38,500 (－)	78 (△0.251)	－ (－)	－ (0)
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	－ (－)	－ (△0.133)	－	－
	小計	89,400 (18,360)	201 (46)	14,600 (25,500)	38 (54)

(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 106,347	百万円 107,627	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

(2020年１月28日～2021年１月25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	35,350,651千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	43,436,509千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.81

(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

(2020年１月28日～2021年１月25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

(2020年１月28日～2021年１月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2021年１月25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	49	98	267	27,774	公益事業
AT&T INC	706	982	2,842	295,182	電気通信サービス
ABBVIE INC	140	242	2,687	279,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACUITY BRANDS INC	4	－	－	－	資本財
ADVANCE AUTO PARTS INC	5	9	153	15,933	小売
AGILENT TECHNOLOGIES INC	27	41	520	54,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLY FINANCIAL INC	35	56	230	23,943	各種金融
ALTICE USA INC- A	8	44	160	16,679	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	177	258	1,080	112,243	食品・飲料・タバコ
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	7	7	65	6,836	保険
AMERISOURCEBERGEN CORP	15	22	242	25,232	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	11	16	354	36,859	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	－	15	72	7,497	各種金融
AQUA AMERICA INC	23	－	－	－	公益事業
ARAMARK	22	22	78	8,159	消費者サービス
ARCONIC INC	31	－	－	－	資本財
ARISTA NETWORKS INC	4	7	241	25,109	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	5	8	120	12,551	保険
AVALARA INC	－	10	174	18,109	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	－	62	191	19,855	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAKER HUGHES COMPANY	66	71	159	16,540	エネルギー
BIO-RAD LABORATORIES-A	2	2	146	15,194	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	16	22	187	19,502	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	11	21	1,559	161,967	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	68	89	581	60,369	各種金融
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	15	15	147	15,350	ソフトウェア・サービス
BOSTON SCIENTIFIC CORP	133	187	694	72,143	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	72	91	426	44,317	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	222	310	2,002	207,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	10	16	249	25,874	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	25	26	127	13,245	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	30	41	299	31,147	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	5	8	225	23,390	小売
CBRE GROUP INC - A	27	47	312	32,467	不動産
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	15	29	128	13,326	素材
CIGNA CORP	36	51	1,141	118,505	ヘルスケア機器・サービス
CMS ENERGY CORP	28	38	226	23,551	公益事業
CSX CORP	75	107	937	97,393	運輸
ALBEMARLE CORP	6	15	274	28,536	素材
CVS HEALTH CORP	123	181	1,345	139,747	ヘルスケア機器・サービス
CABLE ONE INC	－	0.68	139	14,440	メディア・娯楽
CABOT OIL & GAS CORP	44	54	100	10,440	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	17	19	92	9,649	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46	61	642	66,746	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	30	43	238	24,778	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	17	23	279	28,987	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	37	66	134	13,931	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	－	110	436	45,294	資本財
CARVANA CO	－	9	246	25,614	小売
CATALENT INC	－	21	246	25,571	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CATERPILLAR INC	54	75	1,444	149,961	資本財
CELANESE CORP	11	17	231	24,000	素材
CENTENE CORP	58	76	472	49,085	ヘルスケア機器・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	39	68	146	15,183	公益事業
CENTURYLINK INC	102	－	－	－	電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	－	19	202	21,060	ソフトウェア・サービス
CHEVRON CORP	180	264	2,430	252,333	エネルギー
CHEWY INC - CLASS A	－	10	114	11,893	小売
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2	3	530	55,080	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	24	32	273	28,420	家庭用品・パーソナル用品
ALLEGHANY CORP	1	1	115	11,974	保険
CITIGROUP INC	218	286	1,757	182,515	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	36	56	217	22,622	銀行
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2	－	－	－	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	24	37	183	19,004	公益事業
CLOROX COMPANY	13	16	333	34,606	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	－	22	186	19,415	ソフトウェア・サービス
COCA-COLA CO/THE	392	560	2,718	282,318	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	77	112	882	91,658	家庭用品・パーソナル用品
ALLSTATE CORP	32	42	464	48,264	保険
COMERICA INC	13	－	－	－	銀行
CONAGRA BRANDS INC	37	65	224	23,297	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	17	－	－	－	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	109	180	771	80,129	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	34	44	307	31,969	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16	22	503	52,261	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3	－	－	－	エネルギー
COOPER COS INC/THE	4	7	276	28,686	ヘルスケア機器・サービス
CORNING INC	68	102	384	39,973	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	65	102	429	44,561	素材
COTY INC-CL A	25	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	14	15	141	14,698	素材
CUMMINS INC	15	19	485	50,424	資本財
DR HORTON INC	32	46	361	37,571	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	18	25	315	32,711	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	27	－	－	－	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	61	88	2,096	217,692	ヘルスケア機器・サービス
AMEREN CORPORATION	25	33	242	25,208	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	11	17	219	22,748	消費者サービス
DAVITA INC	9	11	140	14,591	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	29	41	1,267	131,635	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	13	32	250	25,990	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	13	13	52	5,466	運輸
DEVON ENERGY CORP	32	84	149	15,526	エネルギー
WALT DISNEY CO/THE	173	248	4,292	445,738	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	28	42	390	40,509	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	47	65	537	55,792	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
EVEREST RE GROUP LTD	3	5	125	13,074	保険
DOLLAR GENERAL CORP	25	33	682	70,833	小売
DOMINION ENERGY INC	76	117	848	88,142	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	2	5	224	23,303	消費者サービス
AMERICAN EXPRESS CO	68	95	1,207	125,416	各種金融
DOVER CORP	12	21	269	27,939	資本財
DOW INC	73	99	569	59,170	素材
DUKE ENERGY CORP	69	102	926	96,241	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	73	97	791	82,174	素材
DYNATRACE INC	－	24	110	11,461	ソフトウェア・サービス
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	83	116	465	48,303	保険
EOG RESOURCES INC	56	77	426	44,337	エネルギー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3	5	87	9,047	保険
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15	24	177	18,389	消費者サービス
EASTMAN CHEMICAL CO	12	18	199	20,725	素材
EATON VANCE CORP	11	－	－	－	各種金融
ECOLAB INC	25	36	766	79,594	素材
BUNGE LTD	14	14	97	10,136	食品・飲料・タバコ
EDISON INTERNATIONAL	36	50	302	31,392	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	20	81	697	72,401	ヘルスケア機器・サービス
ABBOTT LABORATORIES	167	243	2,748	285,386	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	24	54	165	17,168	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	59	78	661	68,669	資本財
ENTERGY CORP	20	27	253	26,355	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	4	7	267	27,825	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	9	16	293	30,513	商業・専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	44	55	150	15,648	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	－	24	112	11,636	公益事業
EVERGY INC	21	25	135	14,089	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	32	44	391	40,654	公益事業
EXELON CORP	93	128	548	56,952	公益事業
EXXON MOBIL CORP	408	582	2,761	286,731	エネルギー
FMC CORP	13	19	220	22,901	素材
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	3	5	167	17,391	各種金融
FAIR ISAAC CORP	－	3	193	20,041	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15	24	389	40,402	公益事業
AMETEK INC	19	30	362	37,617	資本財
FEDEX CORP	24	34	884	91,815	運輸
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	59	85	1,105	114,829	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	27	31	123	12,794	保険
AMPHENOL CORP-CL A	29	39	521	54,158	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIRST REPUBLIC BANK/CA	16	22	355	36,945	銀行
FIRSTENERGY CORP	54	80	251	26,119	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	9	11	298	31,016	ソフトウェア・サービス
FLOWSERVE CORP	11	－	－	－	資本財
FORD MOTOR CO	389	521	601	62,428	自動車・自動車部品
FORTIVE CORP	26	40	283	29,454	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	11	18	174	18,090	資本財
FRANKLIN RESOURCES INC	27	27	72	7,525	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	130	198	603	62,716	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	18	25	304	31,619	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	
GAP INC/THE	23	—	—	—	小売
GARTNER INC	7	11	191	19,921	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	24	34	1,098	114,055	ヘルスケア機器・サービス
GENERAC HOLDINGS INC	—	9	259	26,982	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	23	32	493	51,271	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	831	1,216	1,351	140,390	資本財
GENERAL MILLS INC	61	79	446	46,332	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	125	170	944	98,038	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	12	19	198	20,654	小売
APACHE CORP	29	—	—	—	エネルギー
GLOBAL PAYMENTS INC	29	41	781	81,140	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	9	15	143	14,900	保険
GODADDY INC - CLASS A	15	22	185	19,280	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	31	45	1,325	137,660	各種金融
WW GRAINGER INC	4	6	266	27,662	資本財
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	48	73	389	40,472	食品・飲料・タバコ
GRUBHUB INC	9	—	—	—	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	8	9	112	11,664	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	26	35	597	62,087	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	149	191	484	50,308	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	76	119	229	23,848	エネルギー
HANESBRANDS INC	40	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	12	—	—	—	自動車・自動車部品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	31	53	271	28,155	保険
HEICO CORP	2	6	83	8,646	資本財
HEICO CORP-CLASS A	8	8	93	9,665	資本財
ARROW ELECTRONICS INC	9	9	94	9,824	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HERSHEY CO/THE	12	19	291	30,239	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	28	40	244	25,384	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	117	192	233	24,271	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	27	37	394	40,958	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	17	—	—	—	エネルギー
HOME DEPOT INC	103	147	4,188	434,926	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	69	96	1,960	203,547	資本財
HORMEL FOODS CORP	29	43	197	20,535	食品・飲料・タバコ
HOWMET AEROSPACE INC	—	58	156	16,266	資本財
HUBSPOT INC	—	6	247	25,700	ソフトウェア・サービス
HUMANA INC	13	17	704	73,124	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	4	6	101	10,514	資本財
IDEX CORP	7	11	221	22,980	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	31	44	900	93,488	資本財
INGERSOLL-RAND INC	—	52	239	24,831	資本財
INGREDION INC	7	—	—	—	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	55	72	807	83,862	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	84	122	1,457	151,332	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9	11	136	14,214	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	33	55	285	29,669	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	36	58	144	14,992	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	14	25	471	48,988	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	304	417	5,581	579,577	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	10	17	197	20,460	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	27	—	—	—	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	254	360	5,896	612,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	4	—	—	—	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	32	45	113	11,786	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KKR & CO INC	43	69	278	28,936	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	10	13	285	29,665	運輸
KELLOGG CO	22	34	201	20,879	食品・飲料・タバコ
KEURIG DR PEPPER INC	—	82	260	27,028	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	85	129	236	24,523	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	20	25	369	38,376	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	32	44	585	60,804	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	200	271	415	43,192	エネルギー
ATMOS ENERGY CORP	9	13	120	12,516	公益事業
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	10	10	45	4,738	運輸
KOHLS CORP	15	—	—	—	小売
KROGER CO	72	105	352	36,619	食品・生活必需品小売り
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	21	28	525	54,547	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	9	13	303	31,493	ヘルスケア機器・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	13	21	166	17,325	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	29	51	277	28,833	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	20	31	781	81,121	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	3	7	129	13,445	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	12	19	219	22,840	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-A	26	37	315	32,801	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	3	4	137	14,307	資本財
AUTOLIV INC	7	7	65	6,828	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	82	118	2,445	253,912	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUTOZONE INC	2	3	381	39,630	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	20	20	104	10,845	保険
AVERY DENNISON CORP	7	9	145	15,098	素材
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	15	24	177	18,426	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORP	24	34	1,187	123,349	資本財
LOEWS CORP	24	29	135	14,028	保険
LOWE'S COS INC	75	104	1,794	186,342	小売
LUMEN TECHNOLOGIES INC	—	129	144	15,044	電気通信サービス
M & T BANK CORP	12	18	264	27,442	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	45	70	220	22,904	消費者サービス
MSCI INC	7	11	469	48,757	各種金融
MANPOWERGROUP INC	2	—	—	—	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	64	—	—	—	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	65	87	399	41,516	エネルギー
MARKEL CORP	1	2	205	21,361	保険
MARSH & MCLENNAN COS	49	67	749	77,784	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5	9	286	29,769	素材
MASCO CORP	30	30	177	18,390	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	87	122	4,027	418,215	ソフトウェア・サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12	32	301	31,328	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	72	102	2,191	227,556	消費者サービス
MCKESSON CORP	19	21	401	41,688	ヘルスケア機器・サービス
BALL CORP	27	44	400	41,543	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	
MERCK & CO. INC.	248	347	2,812	292,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	79	103	525	54,561	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	2	3	396	41,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANK OF AMERICA CORP	849	1,069	3,373	350,292	銀行
MOHAWK INDUSTRIES INC	5	5	84	8,771	耐久消費財・アパレル
MOLINA HEALTHCARE INC	—	8	180	18,697	ヘルスケア機器・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	14	27	141	14,662	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	17	22	595	61,840	各種金融
MORGAN STANLEY	123	187	1,389	144,277	各種金融
MOSAIC CO/THE	32	32	93	9,672	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	16	22	396	41,180	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	27	33	137	14,282	公益事業
NVR INC	0.36	0.54	242	25,154	耐久消費財・アパレル
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30	—	—	—	エネルギー
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	85	107	448	46,596	各種金融
NEWELL RUBBERMAID INC	41	55	137	14,251	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	81	106	655	68,051	素材
NEXTERA ENERGY INC	45	270	2,275	236,307	公益事業
NIKE INC -CL B	119	172	2,399	249,131	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	27	42	92	9,632	公益事業
NOBLE ENERGY INC	50	—	—	—	エネルギー
NORDSTROM INC	12	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	26	33	826	85,817	運輸
NORTHROP GRUMMAN CORP	15	20	620	64,460	資本財
NUCOR CORP	31	44	245	25,540	素材
OGE ENERGY CORP	21	29	93	9,671	公益事業
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	88	137	294	30,625	エネルギー
OMNICOM GROUP	19	32	202	21,031	メディア・娯楽
ONEOK INC	41	65	280	29,155	エネルギー
ORACLE CORP	226	275	1,660	172,426	ソフトウェア・サービス
OTIS WORLDWIDE CORP	—	55	357	37,135	資本財
OWENS CORNING	8	16	136	14,144	資本財
P G & E CORP	—	215	253	26,273	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	43	55	845	87,785	銀行
PPG INDUSTRIES INC	23	31	437	45,481	素材
PPL CORP	73	103	287	29,856	公益事業
PVH CORP	7	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PACKAGING CORP OF AMERICA	8	13	184	19,127	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	8	12	466	48,463	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	11	17	472	49,032	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	4	7	294	30,596	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	132	190	2,638	273,936	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	11	16	246	25,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	536	762	2,788	289,581	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAXTER INTERNATIONAL INC	46	67	533	55,449	ヘルスケア機器・サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	147	215	1,735	180,181	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	44	58	423	43,981	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	8	15	117	12,215	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	15	66	489	50,828	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	17	24	317	33,014	エネルギー
POLARIS INC	6	—	—	—	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	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	24	37	201	20,895	保険
PROCTER & GAMBLE CO/THE	241	340	4,432	460,228	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	57	82	763	79,291	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	39	53	438	45,538	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	51	67	393	40,881	公益事業
PULTEGROUP INC	22	36	180	18,697	耐久消費財・アパレル
QUEST DIAGNOSTICS INC	11	19	246	25,563	ヘルスケア機器・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	13	14	125	13,058	素材
RALPH LAUREN CORP	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	10	17	173	18,044	各種金融
RAYTHEON COMPANY	26	—	—	—	資本財
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	211	1,430	148,539	資本財
BECTON DICKINSON AND CO	25	40	1,046	108,656	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	86	127	226	23,518	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	4	10	112	11,681	保険
REPUBLIC SERVICES INC	23	30	284	29,554	商業・専門サービス
RESMED INC	14	19	417	43,349	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	7	9	374	38,930	ソフトウェア・サービス
ROBERT HALF INTL INC	6	15	106	11,101	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	10	15	412	42,808	資本財
ROLLINS INC	11	30	111	11,613	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	10	13	577	59,986	資本財
S&P GLOBAL INC	23	33	1,062	110,378	各種金融
SALESFORCE.COM INC	78	124	2,819	292,791	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	135	185	453	47,052	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	118	214	1,251	129,987	各種金融
SEALED AIR CORP	13	13	63	6,600	素材
SEMPRA ENERGY	26	38	470	48,805	公益事業
SERVICENOW INC	17	26	1,433	148,838	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	8	11	841	87,356	素材
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	51	219	22,750	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	7	15	87	9,038	資本財
JM SMUCKER CO/THE	10	12	143	14,911	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	4	7	137	14,267	資本財
SNAP INC - A	62	125	672	69,789	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	3	108	11,272	ソフトウェア・サービス
SOUTHERN CO/THE	99	147	888	92,262	公益事業
WR BERKLEY CORP	12	21	140	14,639	保険
SOUTHWEST AIRLINES CO	14	22	104	10,850	運輸
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	127	192	4,484	465,636	各種金融
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	10	—	—	—	資本財
SPRINT CORP	43	—	—	—	電気通信サービス
SQUARE INC - A	35	51	1,146	119,052	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	13	20	362	37,642	資本財
STATE STREET CORP	32	47	353	36,714	各種金融
STRYKER CORP	32	46	1,127	117,072	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	21	31	356	37,044	小売
SYNCHRONY FINANCIAL	54	79	298	30,962	各種金融
SYSCO CORP	48	64	484	50,297	食品・生活必需品小売り
TJX COMPANIES INC	116	165	1,110	115,307	小売
TAPESTRY INC	29	—	—	—	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	
TARGET CORP	49	69	1,326	137,761	小売
TARGA RESOURCES CORP	18	—	—	—	エネルギー
TELADOC HEALTH INC	—	14	387	40,254	ヘルスケア機器・サービス
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	3	5	214	22,226	資本財
TELEFLEX INC	4	6	244	25,360	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	95	128	160	16,705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON INC	24	31	154	16,023	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37	54	2,797	290,478	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	55	79	1,351	140,319	資本財
TIFFANY & CO	11	—	—	—	小売
TRANSDIGM GROUP INC	4	6	397	41,238	資本財
TRANSUNION	16	25	238	24,737	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	26	33	494	51,307	保険
TRUIST FINANCIAL CORP	129	186	955	99,254	銀行
TWILIO INC - A	11	18	718	74,655	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	77	106	513	53,368	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	4	5	248	25,780	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	25	39	262	27,242	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	15	30	114	11,933	公益事業
US BANCORP	143	188	862	89,579	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	10	127	695	72,169	運輸
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	4	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	10	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	67	93	1,943	201,791	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	67	97	1,556	161,661	運輸
UNITED RENTALS INC	6	9	254	26,395	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	77	—	—	—	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	91	130	4,529	470,355	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6	10	136	14,183	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	11	—	—	—	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	21	30	878	91,174	素材
VF CORP	34	44	375	39,020	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	2	5	151	15,708	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	41	54	326	33,879	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	7	13	235	24,452	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	12	17	515	53,569	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	400	569	3,273	339,967	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	166	230	4,665	484,460	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	28	48	103	10,756	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	7	11	151	15,726	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	8	17	100	10,445	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	11	18	290	30,127	素材
WABCO HOLDINGS INC	5	—	—	—	資本財
WEC ENERGY GROUP INC	32	41	366	38,072	公益事業
WABTEC CORP	19	26	216	22,527	資本財
WALMART INC	136	194	2,849	295,875	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	27	35	362	37,654	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	41	55	641	66,651	商業・専門サービス
WATERS CORP	5	8	230	23,951	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	3	8	259	26,909	小売
WELLS FARGO & CO	402	539	1,719	178,570	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	9	298	31,005	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN UNION CO	37	55	121	12,628	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	1	—	—	—	素材
WESTROCK CO	22	38	180	18,716	素材
WHIRLPOOL CORP	6	7	141	14,695	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	122	162	350	36,423	エネルギー
BOEING CO/THE	52	74	1,528	158,726	資本財
WORKDAY INC-CLASS A	16	22	538	55,958	ソフトウェア・サービス
XPO LOGISTICS INC	9	9	114	11,883	運輸
XCEL ENERGY INC	52	69	449	46,723	公益事業
XYLEM INC	16	26	275	28,595	資本財
XEROX HOLDINGS CORP	21	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUM! BRANDS INC	31	40	434	45,070	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	18	—	—	—	電気通信サービス
ZENDESK INC	—	16	252	26,262	ソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	20	27	444	46,128	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	45	65	1,075	111,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BORGWARNER INC	21	35	151	15,768	自動車・自動車部品
AERCAP HOLDINGS NV	8	—	—	—	資本財
INVESCO LTD	26	59	124	12,906	各種金融
CHUBB LTD	44	63	965	100,211	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	27	36	336	34,919	素材
ACCENTURE PLC-CL A	60	87	2,229	231,484	ソフトウェア・サービス
AON PLC	23	—	—	—	保険
TE CONNECTIVITY LTD	33	43	564	58,647	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND PLC	23	—	—	—	資本財
APTIV PLC	27	36	502	52,173	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	41	52	658	68,351	資本財
TECHNIPFMC PLC	32	—	—	—	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	16	16	97	10,102	資本財
ALLEGION PLC	8	10	116	12,103	資本財
STERIS PLC	7	11	218	22,678	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC	9	18	80	8,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	173	233	258	26,866	素材
CAPRI HOLDINGS LTD	16	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	31	487	50,651	資本財
AON PLC	—	30	631	65,538	保険
PENTAIR PLC	12	24	143	14,895	資本財
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	16	16	46	4,826	素材
MEDTRONIC PLC	130	185	2,158	224,100	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	27	—	—	—	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	78	99	518	53,892	資本財
ALLERGAN PLC	31	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	21	27	133	13,897	食品・飲料・タバコ
LINDE PLC	51	72	1,825	189,585	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	12	12	54	5,708	保険
CHENIERE ENERGY INC	24	25	165	17,229	エネルギー
ABIOMED INC	5	4	171	17,846	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	76	108	1,026	106,626	メディア・娯楽
ADOBE INC	46	65	3,110	322,949	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	101	161	1,499	155,706	半導体・半導体製造装置

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	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	16	21	236	24,586	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	7	10	537	55,847	ヘルスケア機器・サービス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11	16	290	30,143	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	30	41	7,820	812,124	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	28	41	7,791	809,086	メディア・娯楽
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1	—	—	—	運輸
ANSYS INC	7	11	424	44,029	ソフトウェア・サービス
BEIGENE LTD-ADR	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	19	26	231	24,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	18	21	579	60,182	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOOKING HOLDINGS INC	4	5	1,169	121,440	小売
BROADCOM INC	38	55	2,566	266,547	半導体・半導体製造装置
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12	12	117	12,248	各種金融
CDK GLOBAL INC	12	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	12	21	288	29,929	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	9	14	145	15,091	運輸
CME GROUP INC	34	50	930	96,623	各種金融
CADENCE DESIGN SYS INC	24	36	506	52,583	ソフトウェア・サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	—	12	41	4,335	各種金融
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22	29	473	49,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	27	40	327	34,000	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	15	19	1,292	134,170	メディア・娯楽
CINCINNATI FINANCIAL CORP	15	17	151	15,722	保険
CISCO SYSTEMS INC	405	582	2,606	270,613	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	9	11	383	39,792	商業・専門サービス
CITRIX SYSTEMS INC	13	17	216	22,440	ソフトウェア・サービス
COGNEX CORP	17	19	162	16,891	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	56	71	572	59,494	ソフトウェア・サービス
COMCAST CORP-CLASS A	430	627	3,053	317,116	メディア・娯楽
COPART INC	18	28	326	33,947	商業・専門サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	10	16	215	22,358	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	42	60	2,203	228,849	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	3	5	469	48,756	商業・専門サービス
COUPA SOFTWARE INC	—	8	303	31,491	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	19	427	44,424	ソフトウェア・サービス
AMAZON.COM INC	40	58	19,150	1,988,629	小売
FLEX LTD	45	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERCO	1	1	50	5,224	運輸
DATADOG INC - CLASS A	—	17	185	19,309	ソフトウェア・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	20	32	184	19,123	ヘルスケア機器・サービス
DEXCOM INC	9	12	452	46,965	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	16	—	—	—	エネルギー
DISCOVERY INC - A	17	17	64	6,703	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	33	33	109	11,393	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	21	36	112	11,719	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	10	22	583	60,620	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	23	31	343	35,623	小売
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	53	87	460	47,783	半導体・半導体製造装置
DRAFTKINGS INC - CL A	—	25	134	13,920	消費者サービス
DROPBOX INC-CLASS A	10	26	59	6,201	ソフトウェア・サービス
E*TRADE FINANCIAL CORP	19	—	—	—	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	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	35	61	203	21,102	保険
EAST WEST BANCORP INC	15	—	—	—	銀行
EBAY INC	82	98	555	57,666	小売
ELECTRONIC ARTS INC	30	38	567	58,959	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	—	17	362	37,634	半導体・半導体製造装置
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1	3	90	9,379	保険
ETSY INC	—	17	367	38,192	小売
EXACT SCIENCES CORP	11	23	345	35,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXPEDIA GROUP INC	14	19	267	27,757	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	17	25	235	24,410	運輸
FLIR SYSTEMS INC	10	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	231	329	9,035	938,297	メディア・娯楽
AMGEN INC	57	80	2,045	212,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FASTENAL CO	50	76	365	37,942	資本財
F5 NETWORKS INC	6	9	187	19,434	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIFTH THIRD BANCORP	72	102	316	32,821	銀行
ANALOG DEVICES INC	35	48	747	77,642	半導体・半導体製造装置
FISERV INC	55	79	848	88,117	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC	14	16	241	25,125	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	37	38	116	12,142	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	18	18	53	5,561	メディア・娯楽
GILEAD SCIENCES INC	121	173	1,163	120,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
APPLE INC	434	2,336	32,500	3,374,853	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	89	126	1,340	139,219	半導体・半導体製造装置
HD SUPPLY HOLDINGS INC	15	—	—	—	資本財
HASBRO INC	10	17	174	18,098	耐久消費財・アパレル
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	7	8	127	13,261	ソフトウェア・サービス
HOLOGIC INC	28	38	288	29,988	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7	11	170	17,694	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	89	146	202	21,042	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	—	11	225	23,445	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	8	—	—	—	メディア・娯楽
IPG PHOTONICS CORP	4	5	140	14,543	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEXX LABORATORIES INC	9	11	556	57,780	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	14	19	785	81,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	19	25	245	25,544	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	6	9	280	29,149	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	421	583	3,303	343,047	半導体・半導体製造装置
INTUIT INC	24	36	1,351	140,361	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	11	16	1,209	125,556	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	14	18	111	11,554	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP	16	20	619	64,294	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	66	89	294	30,561	食品・飲料・タバコ
LKQ CORP	28	28	105	10,975	小売
LAM RESEARCH CORP	14	20	1,135	117,920	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	21	30	913	94,812	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESSING	42	59	965	100,280	ソフトウェア・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	—	2	34	3,557	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	11	21	335	34,877	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	9	9	38	3,981	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	17	17	70	7,367	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	21	21	87	9,083	メディア・娯楽
LULULEMON ATHLETICA INC	9	16	567	58,914	耐久消費財・アパレル
MARKETAXESS HOLDINGS INC	3	5	265	27,522	各種金融
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	28	37	456	47,410	消費者サービス
MASIMO CORP	—	7	184	19,193	ヘルスケア機器・サービス
MATCH GROUP INC	6	—	—	—	メディア・娯楽
MATCH GROUP INC	—	33	476	49,488	メディア・娯楽
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23	37	353	36,756	半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	11	36	58	6,115	消費者サービス
MERCADOLIBRE INC	4	5	1,153	119,777	小売
MICROSOFT CORP	696	982	22,194	2,304,642	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	25	32	483	50,198	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	105	153	1,262	131,124	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	2	—	—	—	資本財
MODERNA INC	—	36	483	50,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	137	198	1,115	115,827	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	4	6	247	25,687	ソフトウェア・サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	6	241	25,100	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	40	52	459	47,725	食品・飲料・タバコ
NASDAQ INC	10	17	245	25,458	各種金融
NETAPP INC	22	24	160	16,616	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	41	60	3,432	356,466	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	9	9	112	11,702	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP - CLASS A	28	58	108	11,301	メディア・娯楽
NORDSON CORP	—	7	143	14,872	資本財
NORTHERN TRUST CORP	21	29	282	29,342	各種金融
NORTONLIFELOCK INC	62	62	129	13,453	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	54	84	4,632	480,995	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	7	9	449	46,679	小売
OKTA INC	9	15	406	42,217	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	5	12	265	27,556	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	31	54	202	21,009	半導体・半導体製造装置
PPD INC	—	17	61	6,421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PTC INC	11	16	209	21,785	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	34	46	455	47,319	資本財
PAYCHEX INC	31	42	372	38,635	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	105	153	3,856	400,444	ソフトウェア・サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	26	429	44,606	耐久消費財・アパレル
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	34	—	—	—	銀行
POOL CORP	—	5	213	22,165	小売
T ROWE PRICE GROUP INC	24	30	476	49,473	各種金融
QORVO INC	11	16	294	30,597	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	114	154	2,514	261,131	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	8	14	784	81,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROKU INC	7	14	611	63,535	メディア・娯楽
ROSS STORES INC	36	47	534	55,475	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	13	17	103	10,707	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	20	30	209	21,717	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	4	6	328	34,153	銀行
SABRE CORP	27	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	7	8	79	8,293	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	
HENRY SCHEIN INC	13	21	145	15,096	ヘルスケア機器・サービス
SEAGEN INC	—	16	300	31,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEATTLE GENETICS INC	11	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	5	—	—	—	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	154	103	62	6,439	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	17	21	353	36,741	半導体・半導体製造装置
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	7	229	23,875	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	13	20	357	37,125	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	116	162	1,684	174,895	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	23	23	91	9,451	素材
SUNRUN INC	—	15	133	13,904	資本財
SYNOPSYS INC	12	19	537	55,766	ソフトウェア・サービス
TD AMERITRADE HOLDING CORP	24	—	—	—	各種金融
T-MOBILE US INC	34	78	1,020	105,950	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	11	16	327	34,045	メディア・娯楽
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	8	166	17,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TERADYNE INC	18	23	326	33,949	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	12	102	8,644	897,613	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	88	125	2,173	225,689	半導体・半導体製造装置
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	5	443	46,092	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	10	16	260	27,099	小売
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	7	47	4,902	各種金融
TRIMBLE INC	22	34	241	25,107	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	4	—	—	—	メディア・娯楽
ULTA BEAUTY INC	4	7	217	22,610	小売
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	3	—	—	—	運輸
VERISIGN INC	9	13	269	28,008	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	13	20	397	41,233	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24	36	862	89,532	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOMCBS INC - CLASS B	45	80	365	37,911	メディア・娯楽
VIATRIS INC	—	177	309	32,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	76	99	472	49,055	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	31	41	207	21,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WYNN RESORTS LTD	10	10	109	11,347	消費者サービス
XILINX INC	24	31	456	47,393	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	4	7	324	33,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZILLOW GROUP INC - A	—	9	137	14,273	メディア・娯楽
ZILLOW GROUP INC - C	14	19	289	30,087	メディア・娯楽
ZIONS BANCORPORATION	18	—	—	—	銀行
ZSCALER INC	—	9	209	21,735	ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	23	919	95,469	ソフトウェア・サービス
GARMIN LTD	12	19	243	25,305	耐久消費財・アパレル
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	5	7	126	13,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	28	36	628	65,268	半導体・半導体製造装置
SEAGATE TECHNOLOGY	25	31	189	19,681	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13	13	32	3,409	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	35	35	86	9,017	電気通信サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	15	—	—	—	消費者サービス
IHS MARKIT LTD	32	50	445	46,230	商業・専門サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	13	17	357	37,139	保険
WIX.COM LTD	4	7	186	19,352	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	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	－	16	84	8,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	－	32	248	25,828	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5	7	115	11,996	ソフトウェア・サービス
MYLAN NV	45	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOCURE LTD	－	12	214	22,230	ヘルスケア機器・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	1	－	－	－	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	130	201	92	9,601	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	22	28	162	16,892	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	23	23	63	6,546	資本財
小計 株数・金額	28,568	42,475	464,089	48,191,078	
小計 銘柄数＜比率＞	608	592	－	＜56.6%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
AIR CANADA	8	8	18	1,515	運輸
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	62	89	196	16,062	公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	87	117	444	36,312	食品・生活必需品小売り
AURORA CANNABIS INC	43	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BCE INC	16	24	133	10,908	電気通信サービス
BAUSCH HEALTH COS INC	32	32	111	9,078	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKBERRY LTD	14	14	25	2,052	ソフトウェア・サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	86	179	878	71,736	各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	－	20	153	12,536	公益事業
B2GOLD CORP	－	101	65	5,313	素材
CAE INC	31	31	95	7,809	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	16	16	101	8,258	素材
CGI INC	20	34	350	28,637	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	7	7	12	1,049	各種金融
CAMECO CORP	24	24	38	3,169	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	43	59	659	53,895	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	69	99	1,359	111,015	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	120	162	504	41,174	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13	18	791	64,627	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	5	9	159	13,020	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	9	9	31	2,588	公益事業
CANOPY GROWTH CORP	11	36	157	12,840	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	103	103	77	6,306	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1	2	446	36,474	ソフトウェア・サービス
ALTAGAS LTD	29	29	57	4,718	公益事業
CRONOS GROUP INC	10	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	34	34	177	14,534	小売
EMERA INC	23	41	218	17,869	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	8	26	94	7,737	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	85	－	－	－	エネルギー
ENBRIDGE INC	195	285	1,262	103,078	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2	3	147	12,021	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	42	92	216	17,712	素材
FIRSTSERVICE CORP	－	6	116	9,490	不動産
FORTIS INC	36	64	338	27,607	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	16	26	411	33,570	素材
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	－	31	124	10,159	商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	18	18	60	4,901	耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFECO INC	18	43	131	10,713	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
HUSKY ENERGY INC	13	－	－	－	エネルギー
HYDRO ONE LTD	34	49	150	12,281	公益事業
IGM FINANCIAL INC	0.81	0.81	2	233	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	12	12	73	6,013	保険
IMPERIAL OIL LTD	28	28	73	6,017	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	13	20	298	24,399	保険
INTER PIPELINE LTD	34	34	46	3,767	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	8	8	32	2,643	公益事業
KEYERA CORP	22	22	56	4,654	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	102	190	170	13,939	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	23	31	160	13,108	素材
LOBLAW COMPANIES LTD	14	21	133	10,937	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	73	73	89	7,345	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	33	42	414	33,872	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	193	265	641	52,361	保険
METHANEX CORP	1	－	－	－	素材
METRO INC	26	41	234	19,138	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	35	46	339	27,727	銀行
BANK OF MONTREAL	61	85	829	67,769	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	117	160	1,111	90,805	銀行
NORTHLAND POWER INC	－	32	161	13,210	公益事業
NUTRIEN LTD	59	79	536	43,803	素材
BARRICK GOLD CORP	179	238	711	58,074	素材
ONEX CORPORATION	9	9	63	5,157	各種金融
OPEN TEXT CORP	26	42	255	20,873	ソフトウェア・サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	－	20	78	6,432	素材
PARKLAND FUEL CORP	17	－	－	－	エネルギー
PARKLAND CORP	－	17	70	5,793	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	46	86	305	24,918	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	34	83	257	21,034	保険
POWER FINANCIAL CORP	27	－	－	－	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	5	－	－	－	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	12	12	38	3,176	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERN	28	41	315	25,758	消費者サービス
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	－	18	145	11,853	商業・専門サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	34	51	318	25,986	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	136	197	2,115	172,775	銀行
SSR MINING INC	－	28	62	5,088	素材
SAPUTO INC	24	36	131	10,739	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	38	57	127	10,423	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	9	15	2,288	186,891	ソフトウェア・サービス
AGNICO EAGLE MINES LTD	25	34	307	25,128	素材
STARS GROUP INC/THE	28	－	－	－	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	59	80	490	40,060	保険
SUNCOR ENERGY INC	154	209	472	38,570	エネルギー
TMX GROUP LTD	－	5	66	5,452	各種金融
TC ENERGY CORP	91	125	707	57,802	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CLS B	60	74	193	15,764	素材
TELUS CORP	3	40	108	8,820	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	19	27	281	22,989	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	－	14	125	10,270	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
TORONTO-DOMINION BANK	174	250	1,842	150,448	銀行
WSP GLOBAL INC	12	13	158	12,932	資本財
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3	－	－	－	素材
WESTON (GEORGE) LTD	8	8	76	6,222	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	43	62	322	26,318	素材
BOMBARDIER INC-B	80	－	－	－	資本財
YAMANA GOLD INC	－	92	61	5,006	素材
小計 株数・金額	3,664	5,152	28,226	2,305,296	
小計 銘柄数＜比率＞	85	86	－	＜2.7%＞	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	17	27	756	95,541	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	37	57	221	27,982	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	14	7	28	3,550	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	0.56	10	52	6,592	素材
HANNOVER RUECK SE	4	7	95	12,122	保険
GEA GROUP AG	16	16	50	6,370	資本財
CONTINENTAL AG	10	16	195	24,705	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	99	132	565	71,444	運輸
MERCK KGAA	12	17	252	31,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	58	87	321	40,598	公益事業
SAP SE	93	144	1,512	191,164	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	235	304	264	33,424	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	9	15	123	15,544	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	7	15	135	17,120	耐久消費財・アパレル
BAYER AG-REG	90	129	682	86,197	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	18	23	212	26,881	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	89	129	858	108,434	素材
BEIERSDORF AG	10	11	103	13,054	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	0.17	0.17	1	178	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	13	21	140	17,775	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	19	29	204	25,894	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	40	58	1,144	144,667	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14	14	14	1,795	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14	18	432	54,708	保険
VOLKSWAGEN AG	1	4	83	10,508	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PREF	18	25	413	52,283	自動車・自動車部品
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	89	113	673	85,139	自動車・自動車部品
NEMETSCHEK SE	－	5	32	4,097	ソフトウェア・サービス
THYSSENKRUPP AG	20	－	－	－	素材
SIEMENS AG-REG	73	106	1,405	177,667	資本財
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	208	274	246	31,111	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	29	45	322	40,772	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	6	6	33	4,239	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	326	473	713	90,213	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	3	5	189	23,954	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	128	182	636	80,427	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	－	0.8	65	8,330	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	2	2	32	4,068	ヘルスケア機器・サービス
BECHTLE AG	－	4	72	9,207	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	19	25	341	43,126	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	17	17	106	13,458	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	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	3	—	—	—	運輸
WIRECARD AG	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS AG	7	7	47	6,053	素材
MTU AERO ENGINES AG	5	8	171	21,685	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	35	49	204	25,841	不動産
SYMRISE AG	12	18	183	23,211	素材
BRENNTAG AG	15	24	164	20,731	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	17	17	48	6,119	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	6	126	28	3,662	電気通信サービス
COMMERZBANK AG	56	138	80	10,131	銀行
LEG IMMOBILIEN AG	—	10	123	15,592	不動産
KION GROUP AG	7	7	56	7,163	資本財
VONOVIA SE	52	70	387	49,013	不動産
KNORR-BREMSE AG	2	11	131	16,566	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	15	34	154	19,524	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	19	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	22	98	12,396	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG	—	50	159	20,116	資本財
ZALANDO SE	8	21	210	26,655	小売
SCOUT24 AG	—	16	107	13,540	メディア・娯楽
COVESTRO AG	19	25	141	17,851	素材
HELLOFRESH SE	—	22	152	19,306	小売
UNIPER SE	21	28	85	10,766	公益事業
DELIVERY HERO SE	11	19	264	33,368	小売
小計 株数・金額	2,207	3,320	16,740	2,115,535	
小計 銘柄数＜比率＞	57	61	—	＜2.5%＞	
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	98	160	232	29,349	保険
INTESA SANPAOLO	1,445	2,230	420	53,109	銀行
MEDIOBANCA SPA	68	68	50	6,422	銀行
ENEL SPA	782	1,138	950	120,051	公益事業
ENI SPA	251	355	303	38,361	エネルギー
SNAM SPA	203	325	141	17,928	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	720	720	25	3,255	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	714	714	28	3,580	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	51	80	106	13,505	運輸
TERNA SPA	144	163	97	12,329	公益事業
RECORDATI SPA	8	8	35	4,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA	31	—	—	—	資本財
AMPLIFON SPA	—	20	69	8,737	ヘルスケア機器・サービス
PRYSMIAN SPA	12	28	80	10,144	資本財
DIASORIN SPA	—	2	44	5,661	ヘルスケア機器・サービス
MONCLER SPA	21	24	117	14,847	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	—	70	106	13,490	ソフトウェア・サービス
FINECOBANK SPA	67	70	93	11,774	銀行
UNICREDIT SPA	205	295	228	28,916	銀行
POSTE ITALIANE SPA	53	53	44	5,614	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	24	23	2,917	電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35	—	—	—	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	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PIRELLI & C SPA	17	－	－	－	自動車・自動車部品
小計 株数・金額	4,933	6,556	3,200	404,502	
小計 銘柄数＜比率＞	19	20	－	＜0.5%＞	
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES SA	17	34	119	15,073	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	50	85	191	24,199	公益事業
L'OREAL	24	34	1,035	130,827	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	26	38	1,970	249,051	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	0.11	0.11	9	1,215	資本財
THALES SA	12	17	133	16,868	資本財
CAPGEMINI SA	16	22	273	34,509	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	6	－	－	－	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	4	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	19	36	156	19,714	メディア・娯楽
FAURECIA	8	8	34	4,414	自動車・自動車部品
BOLLORE	32	32	11	1,440	メディア・娯楽
MICHELIN (CGDE)	15	23	265	33,562	自動車・自動車部品
PERNOD RICARD SA	21	28	436	55,197	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	18	30	106	13,479	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	0.18	2	38	4,867	食品・飲料・タバコ
SEB SA	1	1	24	3,058	耐久消費財・アパレル
SCHNEIDER ELECTRIC SE	53	73	918	116,015	資本財
VIVENDI	80	118	315	39,813	メディア・娯楽
ORANGE	199	281	269	34,079	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	3	4	382	48,353	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	13	18	297	37,636	ソフトウェア・サービス
KERING	7	10	553	69,982	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	10	10	13	1,718	保険
CARREFOUR SA	65	70	103	13,094	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	10	15	101	12,819	ソフトウェア・サービス
SANOFI	107	156	1,278	161,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR SA	18	23	68	8,706	消費者サービス
SOCIETE GENERALE SA	86	120	197	24,900	銀行
TELEPERFORMANCE	6	8	241	30,469	商業・専門サービス
EURAZEO	4	4	23	2,943	各種金融
SODEXO	10	10	83	10,559	消費者サービス
AXA SA	189	261	502	63,526	保険
PEUGEOT SA	51	－	－	－	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	0.6	－	－	－	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	28	38	472	59,661	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	101	165	163	20,717	銀行
BNP PARIBAS	109	149	642	81,223	銀行
ORPEA	－	5	58	7,435	ヘルスケア機器・サービス
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	52	72	308	38,959	資本財
WENDEL	2	2	29	3,691	各種金融
ILIAD SA	0.98	0.98	15	1,964	電気通信サービス
SAFRAN SA	32	43	478	60,449	資本財
ENGIE	184	251	330	41,753	公益事業
ALSTOM	19	39	190	24,058	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	4	－	－	－	メディア・娯楽
EDF	61	104	128	16,291	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IPSEN	1	1	11	1,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	8	8	78	9,926	素材
LEGRAND SA	23	37	296	37,482	資本財
EIFFAGE	7	13	100	12,693	資本財
TOTAL SE	228	350	1,268	160,267	エネルギー
ADP	3	3	29	3,731	運輸
NATIXIS	31	31	9	1,235	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT	8	10	93	11,786	メディア・娯楽
SCOR SE	15	15	41	5,296	保険
VINCI SA	49	73	594	75,149	資本財
DANONE	60	82	450	56,978	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE SA	46	66	877	110,836	素材
BUREAU VERITAS SA	34	45	101	12,844	商業・専門サービス
GETLINK	46	46	60	7,653	運輸
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	22	57	98	12,477	公益事業
EDENRED	23	37	175	22,165	ソフトウェア・サービス
VALEO SA	24	36	116	14,757	自動車・自動車部品
BIOMERIEUX	1	4	49	6,278	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	8	29	3,767	消費者サービス
WORLDLINE SA	5	30	225	28,534	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	2	4	146	18,504	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	6	6	40	5,080	各種金融
小計 株数・金額	2,440	3,431	17,873	2,258,715	
小計 銘柄数<比率>	67	64	—	<2.7%>	
(ユーロ…オランダ)					
AIRBUS SE	56	78	698	88,243	資本財
RANDSTAD NV	13	18	100	12,687	商業・専門サービス
WOLTERS KLUWER	28	36	257	32,528	商業・専門サービス
VOPAK	7	7	32	4,050	エネルギー
AEGON NV	165	165	57	7,314	保険
KONINKLIJKE KPN NV	378	589	155	19,590	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	60	87	284	36,001	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV	89	120	551	69,715	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV	25	34	304	38,456	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	11	18	138	17,456	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV	16	23	342	43,301	素材
UNILEVER NV	137	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
ASML HOLDING NV	40	58	2,713	342,907	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	115	146	346	43,807	食品・生活必需品小売り
FERRARI NV	12	17	307	38,844	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	95	162	182	23,038	資本財
AKZO NOBEL	20	26	228	28,917	素材
PROSUS NV	48	68	681	86,124	小売
JDE PEET'S BV	—	11	38	4,811	食品・飲料・タバコ
STELLANTIS NV	—	154	203	25,723	自動車・自動車部品
STELLANTIS NV	—	164	218	27,571	自動車・自動車部品
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	90	79	10,040	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV	28	40	144	18,306	保険
ARGENX SE	—	6	171	21,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	96	—	—	—	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	—	19	187	23,660	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…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ABN AMRO BANK NV-CVA		38	38	31	4,007	銀行
EXOR NV		11	13	85	10,782	各種金融
ALTICE EUROPE NV		73	73	39	4,935	電気通信サービス
QIAGEN N.V.		21	26	120	15,224	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADYEN NV		1	2	458	57,958	ソフトウェア・サービス
ING GROEP NV-CVA		374	513	395	49,991	銀行
小計	株数・金額	1,968	2,816	9,556	1,207,687	
	銘柄数＜比率＞	26	30	－	＜1.4%＞	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA SA		31	48	105	13,304	公益事業
BANKINTER SA		28	－	－	－	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		667	910	364	46,063	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		34	46	89	11,324	公益事業
REPSOL SA		129	217	183	23,207	エネルギー
BANCO SANTANDER SA		1,636	2,405	620	78,448	銀行
TELEFONICA SA		471	690	251	31,747	電気通信サービス
ENAGAS SA		12	26	47	6,032	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A.		4	22	81	10,360	資本財
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		28	28	77	9,809	資本財
FERROVIAL SA		51	70	141	17,886	資本財
MAPFRE SA		9	－	－	－	保険
BANCO DE SABADELL SA		551	－	－	－	銀行
CAIXABANK S.A		351	525	107	13,617	銀行
IBERDROLA SA		584	837	976	123,440	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA		39	61	335	42,356	ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		43	49	77	9,856	公益事業
(Right)ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS		－	28	1	154	資本財
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL		108	147	378	47,779	小売
AENA SME SA		7	10	136	17,259	運輸
CELLNEX TELECOM SA		27	44	225	28,507	電気通信サービス
GRIFOLS SA		28	33	81	10,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANKIA SA		16	－	－	－	銀行
小計	株数・金額	4,865	6,205	4,285	541,507	
	銘柄数＜比率＞	22	19	－	＜0.6%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV		21	35	209	26,460	銀行
SOFINA		－	1	46	5,827	各種金融
SOLVAY SA		8	9	90	11,488	素材
UCB SA		10	20	175	22,234	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		2	2	14	1,847	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		8	19	166	21,102	各種金融
PROXIMUS		9	9	15	2,013	電気通信サービス
GALAPAGOS NV		5	5	45	5,738	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV		－	3	35	4,473	公益事業
TELENET GROUP HOLDING NV		1	－	－	－	メディア・娯楽
AGEAS		16	27	121	15,325	保険
UMICORE		22	23	113	14,352	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		74	101	557	70,450	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	182	260	1,593	201,313	
	銘柄数＜比率＞	11	12	－	＜0.2%＞	

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…オーストリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG		14	14	53	6,810	エネルギー
VERBUND AG		7	7	63	8,082	公益事業
VOESTALPINE AG		7	24	76	9,711	素材
ERSTE GROUP BANK AG		33	39	102	12,897	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA		12	12	20	2,623	銀行
ANDRITZ AG		3	－	－	－	資本財
小計	株数・金額	79	98	317	40,125	
	銘柄数＜比率＞	6	5	－	＜0.0%＞	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		1	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		50	50	31	4,023	エネルギー
SES		22	22	16	2,060	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		104	104	61	7,735	不動産
EUROFINS SCIENTIFIC		－	15	119	15,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCELORMITTAL		74	113	212	26,815	素材
小計	株数・金額	253	306	440	55,716	
	銘柄数＜比率＞	5	5	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		－	44	97	12,370	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ ABP		27	27	23	2,975	資本財
UPM-KYMMENE OYJ		48	80	251	31,821	素材
STORA ENSO OYJ-R SHS		56	87	140	17,771	素材
SAMPO OYJ-A SHS		46	64	231	29,270	保険
FORTUM OYJ		39	63	135	17,083	公益事業
ELISA OYJ		12	21	101	12,814	電気通信サービス
METSO OYJ		7	－	－	－	資本財
NOKIA OYJ		597	760	257	32,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ		38	57	356	45,048	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ		4	－	－	－	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B		35	45	297	37,544	資本財
ORION OYJ-CLASS B		12	7	28	3,602	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	926	1,261	1,922	242,904	
	銘柄数＜比率＞	12	11	－	＜0.3%＞	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC		72	103	374	47,310	素材
KINGSPAN GROUP PLC		17	20	129	16,307	資本財
KERRY GROUP PLC-A		13	20	235	29,701	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		22	39	164	20,761	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC		104	－	－	－	銀行
AIB GROUP PLC		20	－	－	－	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		9	23	372	47,021	消費者サービス
小計	株数・金額	259	207	1,274	161,102	
	銘柄数＜比率＞	7	5	－	＜0.2%＞	
(ユーロ…ポルトガル)						
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA		183	371	196	24,893	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA		46	74	65	8,240	エネルギー
JERONIMO MARTINS		22	52	75	9,493	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	252	497	337	42,626	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.1%＞	
ユーロ計	株数・金額	18,369	24,962	57,543	7,271,737	
	銘柄数＜比率＞	235	235	－	＜8.5%＞	

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	
ANTOFAGASTA PLC	43	43	64	9,236	素材
ASHTEAD GROUP PLC	49	62	240	34,236	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	103	121	84	11,940	耐久消費財・アパレル
AVIVA PLC	342	607	212	30,134	保険
DIAGEO PLC	225	325	946	134,537	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	11	11	40	5,741	各種金融
DCC PLC	8	14	81	11,599	資本財
BAE SYSTEMS PLC	335	439	210	29,928	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	218	320	876	124,615	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	40	44	113	16,178	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	287	397	183	26,117	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	82	142	234	33,373	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	1,913	2,817	1,147	163,087	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	629	835	221	31,459	保険
MEGGITT PLC	70	—	—	—	資本財
WM MORRISON SUPERMARKETS	230	230	42	6,107	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	32	49	112	15,932	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	73	73	52	7,449	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	30	51	141	20,047	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	248	348	486	69,163	保険
RIO TINTO PLC	109	157	925	131,518	素材
ST JAMES'S PLACE PLC	57	77	92	13,084	各種金融
SSE PLC	93	143	222	31,549	公益事業
BP PLC	1,937	2,840	823	117,066	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	6,816	9,437	328	46,633	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	363	433	69	9,806	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	969	1,323	320	45,504	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	88	121	200	28,498	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	473	696	961	136,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	25	—	—	—	資本財
ASTRAZENECA PLC	124	181	1,409	200,337	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	765	1,296	174	24,858	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	17	—	—	—	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	91	—	—	—	小売
BARCLAYS PLC	1,674	2,315	331	47,078	銀行
INTERTEK GROUP PLC	17	18	102	14,508	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	32	58	102	14,522	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	12	18	148	21,121	小売
KINGFISHER PLC	127	298	81	11,561	小売
ITV PLC	429	—	—	—	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	95	278	68	9,733	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	175	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	11	27	81	11,527	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS	13	14	66	9,477	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	609	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	414	574	815	115,929	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	357	521	708	100,667	エネルギー
BUNZL PLC	33	47	115	16,391	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	172	208	109	15,611	商業・専門サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	13	34	4,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	32	42	387	55,133	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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
UNILEVER PLC	105	362	1,586	225,395	家庭用品・パーソナル用品
TUI AG-DI	41	—	—	—	消費者サービス
EXPERIAN PLC	93	121	321	45,693	商業・専門サービス
MONDI PLC	53	56	102	14,633	素材
SEVERN TRENT PLC	25	27	63	9,091	公益事業
WHITBREAD PLC	9	29	91	12,955	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	15	30	50	7,193	各種金融
SMITHS GROUP PLC	38	38	57	8,124	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	106	166	438	62,334	素材
3I GROUP PLC	88	140	160	22,846	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	67	99	623	88,633	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	189	257	480	68,304	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	—	28	31	4,490	素材
UNITED UTILITIES GROUP PLC	47	78	73	10,386	公益事業
OCADO GROUP PLC	28	63	171	24,354	小売
GLENCORE PLC	1,090	1,381	374	53,174	素材
ENTAIN PLC	69	69	88	12,642	消費者サービス
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	180	1,072	110	15,689	資本財
EVRAZ PLC	30	30	15	2,248	素材
NMC HEALTH PLC	4	4	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	1	—	—	—	運輸
NATWEST GROUP PLC	423	731	113	16,157	銀行
SAGE GROUP PLC/THE	123	151	92	13,100	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	114	195	155	22,084	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-DI	18	18	41	5,917	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	7	7	26	3,809	ソフトウェア・サービス
COMPASS GROUP PLC	156	243	338	48,155	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	333	467	409	58,168	公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	187	329	101	14,411	各種金融
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	87	60	8,647	保険
BHP GROUP PLC	206	281	595	84,636	素材
VODAFONE GROUP PLC	2,602	3,601	458	65,181	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	16	25	119	16,945	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	16	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	12	21	140	20,020	素材
FERGUSON PLC	23	30	280	39,888	資本財
M&G PLC	215	419	81	11,624	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	93	164	111	15,843	保険
INFORMA PLC	115	176	90	12,914	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC	103	113	65	9,246	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	8	8	98	14,057	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	74	195	62	8,931	保険
JD SPORTS FASHION PLC	49	49	41	5,843	小売
MELROSE INDUSTRIES PLC	445	766	134	19,102	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC	18	18	53	7,673	素材
小計 株数・金額	28,776	40,248	22,694	3,225,065	
小計 銘柄数<比率>	93	86	—	<3.8%>	
(スイス)			千スイスフラン		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.33	0.42	85	9,982	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.11	0.15	120	14,094	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	0.01	86	10,159	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	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
CLARIANT AG-REG	5	28	55	6,505	素材
TEMENOS GROUP AG-REG	6	7	83	9,761	ソフトウェア・サービス
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1	1	120	14,131	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	2	2	12	1,476	耐久消費財・アパレル
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	0.78	0.78	65	7,667	素材
SWISS PRIME SITE-REG	8	11	96	11,288	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	0.29	—	—	—	各種金融
DUFRY AG-REG	4	—	—	—	小売
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1	2	279	32,737	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2	2	50	5,982	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	23	213	25,011	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIKA AG-REG	10	19	472	55,419	素材
ALCON INC	42	66	432	50,689	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	2	25	3,036	銀行
VIFOR PHARMA AG	4	6	79	9,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	0.55	0.9	246	28,918	商業・専門サービス
SWISSCOM AG-REG	2	4	194	22,797	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	0.81	1	447	52,439	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	14	21	783	91,948	保険
NOVARTIS AG-REG	207	305	2,623	307,735	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD-REG	180	243	651	76,397	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	66	96	3,072	360,461	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO SA-REG	15	23	137	16,104	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	42	71	358	42,036	素材
NESTLE SA-REG	288	395	3,993	468,468	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	5	6	101	11,956	保険
SONOVA HOLDING AG-REG	4	8	188	22,112	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	253	329	401	47,055	各種金融
SWATCH GROUP AG/THE-BR	3	4	105	12,370	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	7	9	590	69,237	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	3	3	156	18,394	保険
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3	4	109	12,801	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	5	8	173	20,336	運輸
GEBERIT AG-REG	3	5	280	32,932	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	18	35	199	23,379	各種金融
SWISS RE AG	30	40	326	38,263	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	51	69	597	70,096	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	376	487	641	75,263	各種金融
小計 株数・金額	1,677	2,351	18,658	2,188,814	
小計 銘柄数＜比率＞	39	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	9	416	5,204	各種金融
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	144	238	2,216	27,726	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	99	133	2,193	27,435	銀行
SWEDISH MATCH AB	18	19	1,241	15,534	食品・飲料・タバコ
SECURITAS AB-B SHS	38	38	500	6,259	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	47	62	3,906	48,867	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	75	95	1,751	21,914	小売
ERICSSON LM-B SHS	312	394	3,842	48,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	268	311	1,128	14,122	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	37	49	1,113	13,927	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	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
LUNDIN ENERGY AB	10	10	262	3,285	エネルギー
ALFA LAVAL AB	36	45	1,079	13,503	資本財
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	1	—	—	—	電気通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	15	683	8,555	不動産
ICA GRUPPEN AB	5	14	606	7,584	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	28	28	308	3,863	耐久消費財・アパレル
ELECTROLUX AB-SER B	15	36	755	9,450	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES	25	45	1,065	13,329	資本財
VOLVO AB-B SHS	157	203	4,413	55,214	資本財
SANDVIK AB	119	156	3,422	42,813	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	17	493	6,171	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6	23	647	8,097	各種金融
SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	—	94	1,382	17,292	素材
HEXAGON AB-B SHS	24	39	3,014	37,708	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	54	74	854	10,689	電気通信サービス
ATLAS COPCO AB-A SHS	71	91	4,292	53,703	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	37	55	2,274	28,448	資本財
EPIROC AB-A	57	95	1,561	19,538	資本財
EPIROC AB-B	12	46	701	8,782	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	53	82	2,145	26,838	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB	—	23	530	6,638	各種金融
BOLIDEN AB	31	40	1,199	15,006	素材
EVOLUTION GAMING GROUP	—	18	1,636	20,475	消費者サービス
KINNEVIK AB - B	23	—	—	—	各種金融
KINNEVIK AB - B	—	38	1,618	20,253	各種金融
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	163	230	1,994	24,951	銀行
ASSA ABLOY AB-B	89	138	2,907	36,379	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	48	1,438	17,993	資本財
NORDEA BANK ABP	331	437	3,099	38,778	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	14	288	3,607	資本財
小計 株数・金額	2,399	3,520	62,991	788,021	
小計 銘柄数＜比率＞	32	38	—	＜0.9%＞	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	89	131	2,223	27,175	銀行
TELENOR ASA	85	92	1,344	16,434	電気通信サービス
SCHIBSTED ASA-CL A	—	11	383	4,688	メディア・娯楽
EQUINOR ASA	94	141	2,308	28,208	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	17	27	1,074	13,129	素材
MOWI ASA	50	56	1,063	12,991	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO ASA	81	202	795	9,724	素材
AKER BP ASA	2	—	—	—	エネルギー
ORKLA ASA	94	111	938	11,469	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	6	26	556	6,796	保険
ADEVINTA ASA	—	39	513	6,278	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS	5	5	154	1,888	メディア・娯楽
小計 株数・金額	526	847	11,357	138,785	
小計 銘柄数＜比率＞	10	11	—	＜0.2%＞	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	11	16	1,492	25,355	食品・飲料・タバコ
AP MOELLER-MAERSK A/S-B	0.67	0.99	1,419	24,111	運輸
AP MOELLER-MAERSK A/S-A	0.39	0.39	516	8,772	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	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
GN STORE NORD A/S	－	18	915	15,551	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	60	98	1,122	19,070	銀行
GENMAB A/S	6	9	2,397	40,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	－	1	329	5,597	資本財
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16	27	3,958	67,261	資本財
H LUNDBECK A/S	1	1	26	457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DSV PANALPINA A S	20	28	2,797	47,525	運輸
PANDORA A/S	10	16	1,045	17,757	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	11	12	644	10,955	素材
NOVOZYMES A/S-B SHARES	20	33	1,188	20,199	素材
COLOPLAST-B	12	16	1,538	26,145	ヘルスケア機器・サービス
AMBU A/S-B	－	15	364	6,193	ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	170	238	10,623	180,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	9	－	－	－	商業・専門サービス
TRYG A/S	6	6	141	2,410	保険
ORSTED A/S	20	26	3,266	55,499	公益事業
DEMANT A/S	5	5	131	2,240	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	386	574	33,921	576,322	
小計 銘柄数＜比率＞	17	19	－	＜0.7%＞	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	14	27	172	13,828	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP	279	376	926	74,308	銀行
WESTPAC BANKING CORP	334	476	1,038	83,278	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	162	234	569	45,705	素材
TELSTRA CORP LTD	327	723	231	18,570	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	32	－	－	－	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	51	51	67	5,401	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	14	32	233	18,699	各種金融
BHP GROUP LTD	285	412	1,901	152,535	素材
CALTEX AUSTRALIA LTD	30	－	－	－	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	4	－	－	－	小売
COMPUTERSHARE LTD	27	56	81	6,512	ソフトウェア・サービス
CSL LTD	43	63	1,731	138,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	5	5	80	6,447	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	274	375	503	40,363	運輸
COCHLEAR LTD	5	10	209	16,823	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LTD	143	264	134	10,822	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	170	245	2,085	167,268	銀行
BORAL LTD	129	－	－	－	素材
RIO TINTO LTD	38	50	608	48,765	素材
APA GROUP	119	138	130	10,493	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	62	91	284	22,829	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	257	352	176	14,151	保険
TPG CORP LTD	2	－	－	－	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	0.44	－	－	－	消費者サービス
ORICA LTD	23	62	99	7,966	素材
LENDLEASE GROUP	67	82	103	8,312	不動産
BLUESCOPE STEEL LTD	62	62	106	8,534	素材
WORLEY LTD	10	－	－	－	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	115	192	201	16,137	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	275	461	1,111	89,178	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
NEWCREST MINING LTD	70	113	304	24,410	素材
OIL SEARCH LTD	147	328	142	11,447	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	53	—	—	—	素材
AMP LTD	366	366	57	4,571	各種金融
QANTAS AIRWAYS LTD	87	87	42	3,384	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD	138	242	205	16,447	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	73	99	7,945	素材
CHALLENGER LTD	17	—	—	—	各種金融
SANTOS LTD	146	265	191	15,352	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	44	72	255	20,465	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	3	3	9	791	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD	212	212	88	7,118	消費者サービス
WESFARMERS LTD	114	151	808	64,817	小売
ALUMINA LTD	257	—	—	—	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	84	136	361	28,988	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	125	169	691	55,444	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	8	15	74	5,960	各種金融
SEEK LTD	33	33	94	7,555	メディア・娯楽
BRAMBLES LTD	153	174	186	14,927	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	33	45	627	50,337	各種金融
CROWN RESORTS LTD	7	7	7	616	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	—	161	74	5,980	素材
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	39	66	251	20,167	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	70	70	65	5,269	食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT	120	225	132	10,630	運輸
AURIZON HOLDINGS LTD	214	230	89	7,205	運輸
XERO LTD	—	18	259	20,775	ソフトウェア・サービス
AFTERPAY LTD	—	29	421	33,822	ソフトウェア・サービス
AMPOL LTD	—	30	92	7,428	エネルギー
TPG TELECOM LTD	—	2	2	171	電気通信サービス
AUSNET SERVICES	14	14	2	195	公益事業
MEDIBANK PRIVATE LTD	161	336	99	7,953	保険
AGL ENERGY LTD	66	75	89	7,179	公益事業
SOUTH32 LTD	585	748	207	16,623	素材
CIMIC GROUP LTD	6	6	17	1,418	資本財
COLES GROUP LTD	113	186	338	27,121	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	16	16	53	4,260	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	6,890	9,568	19,233	1,542,553	
小計 銘柄数<比率>	62	58	—	<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	55	86	6,462	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	75	78	85	6,398	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	63	66	232	17,401	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	101	—	—	—	素材
SPARK NEW ZEALAND LTD	217	229	110	8,278	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	72	72	52	3,926	公益事業
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	222	164	12,256	運輸
MERIDIAN ENERGY LTD	94	229	185	13,859	公益事業
小計 株数・金額	721	953	917	68,583	
小計 銘柄数<比率>	8	7	—	<0.1%>	

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	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	16	16	199	2,677	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	130	270	561	7,525	不動産
BANK OF EAST ASIA	36	36	60	812	銀行
CLP HOLDINGS LTD	180	240	1,744	23,380	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	121	172	8,780	117,660	各種金融
MTR CORP	195	195	850	11,392	運輸
HANG SENG BANK LTD	70	119	1,712	22,946	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	199	139	449	6,023	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	145	180	744	9,973	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	938	1,568	1,769	23,711	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	210	320	1,889	25,320	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	5	—	—	—	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	345	440	1,069	14,327	銀行
NWS HOLDINGS LTD	100	—	—	—	資本財
PCCW LTD	40	40	17	234	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	800	—	—	—	不動産
SINO LAND CO	180	180	187	2,513	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	172	197	2,147	28,773	不動産
SWIRE PACIFIC LTD - CL A	42	42	207	2,785	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	60	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WHEELOCK & CO LTD	94	—	—	—	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	125	215	2,614	35,032	資本財
XINYI GLASS HOLDINGS LTD	—	300	604	8,100	資本財
SJM HOLDINGS LTD	20	20	17	228	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	52	52	63	854	消費者サービス
AIA GROUP LTD	1,158	1,682	16,887	226,289	保険
HKT TRUST AND HKT LTD-SS	330	330	335	4,492	電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	226	310	950	12,732	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	50	50	117	1,574	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	140	230	964	12,928	不動産
ESR CAYMAN LTD	—	292	765	10,251	不動産
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	5	310	238	3,194	公益事業
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	100	220	531	7,119	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	1,205	1,520	991	13,279	食品・飲料・タバコ
NEW WORLD DEVELOPMENT	—	260	964	12,925	不動産
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	285	390	2,203	29,526	資本財
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	44	44	190	2,555	公益事業
CK ASSET HOLDINGS LTD	245	400	1,630	21,842	不動産
小計 株数・金額	8,068	10,779	52,461	702,989	
小計 銘柄数＜比率＞	36	33	—	＜0.8%＞	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	120	120	46	3,605	資本財
DBS GROUP HOLDINGS LTD	178	245	641	50,171	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	67	30	22	1,762	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	1	—	—	—	小売
SATS LTD	12	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	109	115	116	9,079	各種金融
CAPITALAND LTD	212	498	169	13,249	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	191	—	—	—	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD	74	263	111	8,725	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	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
UNITED OVERSEAS BANK LTD		110	166	393	30,785	銀行
UOL GROUP LTD		21	21	15	1,248	不動産
VENTURE CORP LTD		13	41	83	6,512	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		132	—	—	—	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		868	1,231	305	23,888	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		8	—	—	—	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		342	458	486	38,060	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		239	252	136	10,707	食品・飲料・タバコ
KEPPEL CORP LTD		159	190	107	8,385	資本財
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		15	—	—	—	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		808	808	71	5,563	消費者サービス
小計	株数・金額	3,679	4,438	2,706	211,747	
	銘柄数<比率>	20	14	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOALIM BM		99	182	435	13,825	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		168	179	374	11,869	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		2	3	164	5,210	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		75	75	100	3,189	銀行
ICL GROUP LTD		41	41	71	2,282	素材
NICE SYSTEMS LTD		7	9	839	26,650	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		14	14	113	3,593	銀行
AZRIELI GROUP		2	2	47	1,507	不動産
小計	株数・金額	411	507	2,147	68,129	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	104,139	146,380	—	67,279,123	
	銘柄数<比率>	1,253	1,226	—	<79.0%>	

(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	4,823	8,437	136	14,140	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	961	1,752	295	30,716	0.0
AMERICAN TOWER CORP	4,224	6,152	1,377	143,045	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,662	16,047	134	13,930	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,390	1,949	321	33,338	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	1,367	2,200	200	20,857	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	701	1,108	113	11,798	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	4,027	6,024	957	99,409	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,101	3,602	505	52,536	0.1
DUKE REALTY CORP	3,781	5,513	221	23,036	0.0
EQUINIX INC	820	1,170	843	87,615	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	2,445	154	16,066	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	3,681	5,175	318	33,080	0.0
ESSEX PROPERTY TRUST INC	580	970	236	24,521	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,155	1,920	221	23,009	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4,041	7,606	229	23,836	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	10,493	151	15,711	0.0
INVITATION HOMES INC	5,744	7,683	230	23,950	0.0
IRON MOUNTAIN INC	2,044	4,068	122	12,735	0.0
KIMCO REALTY CORP	3,824	—	—	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	1,416	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,450	5,932	127	13,225	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,033	1,702	228	23,714	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	—	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	2,330	83	8,702	0.0
PROLOGIS INC	6,108	10,311	1,043	108,375	0.1
PUBLIC STORAGE	1,557	2,131	474	49,299	0.1
REALTY INCOME CORP	2,774	4,769	285	29,633	0.0
REGENCY CENTERS CORP	1,514	1,514	71	7,378	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,173	1,510	411	42,760	0.1
SL GREEN REALTY CORP	468	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	3,017	4,258	406	42,220	0.0
SUN COMMUNITIES INC	788	1,389	204	21,193	0.0
UDR INC	2,553	3,355	131	13,625	0.0
VENTAS INC	3,668	5,547	272	28,298	0.0
VEREIT INC	11,100	—	—	—	—
VEREIT INC	—	2,220	79	8,232	0.0
VICI PROPERTIES INC	4,920	7,940	209	21,758	0.0
VORNADO REALTY TRUST	1,259	1,259	47	4,954	0.0
WP CAREY INC	1,458	2,436	163	17,016	0.0
WELLTOWER INC	4,008	5,753	362	37,677	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	%
WEYERHAEUSER CO		7,592	10,330	343	35,623	0.0
小計	口数・金額	135,259	169,000	11,720	1,217,028	
	銘柄数<比率>	42	37	－	<1.4%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		950	950	48	3,977	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		1,901	－	－	－	－
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		114	－	－	－	－
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		1,530	1,530	26	2,192	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		53	－	－	－	－
小計	口数・金額	4,548	2,480	75	6,170	
	銘柄数<比率>	5	2	－	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		30	－	－	－	－
KLEPIERRE		2,365	1,289	21	2,762	0.0
GECINA SA		474	569	66	8,420	0.0
COVIVIO		522	522	35	4,512	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		1,196	2,281	129	16,412	0.0
ユーロ計	口数・金額	4,587	4,661	254	32,107	
	銘柄数<比率>	5	4	－	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		9,933	13,842	60	8,655	0.0
SEGRO PLC		12,304	18,596	181	25,744	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		6,648	6,648	42	5,992	0.0
小計	口数・金額	28,885	39,086	284	40,392	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP		32,387	63,099	159	12,803	0.0
GPT GROUP		15,542	32,860	143	11,516	0.0
STOCKLAND		28,650	29,890	135	10,883	0.0
DEXUS		10,906	13,745	126	10,119	0.0
GOODMAN GROUP		15,409	23,275	413	33,133	0.0
SCENTRE GROUP		50,466	83,252	238	19,095	0.0
VICINITY CENTRES		42,168	42,168	65	5,224	0.0
小計	口数・金額	195,528	288,289	1,281	102,776	
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		23,000	31,300	2,151	28,835	0.0
小計	口数・金額	23,000	31,300	2,151	28,835	
	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 INTEGRATED COMMER		22,000	74,160	169	13,230	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		38,800	41,300	129	10,115	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		25,500	－	－	－	－
SUNTEC REIT		8,500	8,500	13	1,017	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		－	38,500	77	6,085	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	%
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		23,000	23,000	50	3,923	0.0
小計	口数・金額	117,800	185,460	439	34,372	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.0%>	
合計	口数・金額	509,607	720,276	－	1,461,682	
	銘柄数<比率>	68	59	－	<1.7%>	

(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。

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	SP500MIN2103	12,501	－
		STX E6002103	3,251	－

(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

(2021年１月25日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	67,279,123	78.9
投資証券	1,461,682	1.7
コール・ローン等、その他	16,492,634	19.4
投資信託財産総額	85,233,439	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（84,753,512千円）の投資信託財産総額（85,233,439千円）に対する比率は99.4%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=103.84円、1カナダドル=81.67円、1ユーロ=126.37円、1英ポンド=142.11円、1スイスフラン=117.31円、1スウェーデンクローナ=12.51円、1ノルウェークローネ=12.22円、1デンマーククローネ=16.99円、1オーストラリアドル=80.20円、1ニュージーランドドル=74.71円、1香港ドル=13.40円、1シンガポールドル=78.25円、1イスラエルシュケル=31.73円。

○特定資産の価格等の調査

(2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) **資産**	**86,239,252,470**
コール・ローン等	12,119,705,502
株式(評価額)	67,279,123,884
投資証券(評価額)	1,461,682,991
未収入金	1,540,748,578
未収配当金	47,662,731
差入委託証拠金	3,790,328,784
(B) **負債**	**1,103,764,154**
未払金	1,007,481,279
未払解約金	96,282,000
未払利息	874
その他未払費用	1
(C) **純資産総額(Ａ－Ｂ)**	**85,135,488,316**
元本	53,970,185,829
次期繰越損益金	31,165,302,487
(D) **受益権総口数**	**53,970,185,829口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**15,775円**

(注) 当ファンドの期首元本額は40,465,219,618円、期中追加設定元本額は63,567,187,120円、期中一部解約元本額は50,062,220,909円です。

(注) 2021年１月25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	21,509,121,776円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	6,460,819,835円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	4,752,507,172円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	4,294,463,552円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	2,902,849,412円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	2,116,113,240円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	2,100,939,318円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	1,864,511,815円
・つみたてバランスファンド	1,467,771,171円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	1,234,910,116円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,205,908,561円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	843,463,974円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	736,871,952円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	434,589,358円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	336,666,625円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	315,210,195円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	311,278,815円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	260,684,865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）	223,700,231円
・ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	149,863,613円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	136,723,311円
・りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	57,887,886円
・ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	55,270,573円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	50,787,586円
・リスクコントロール・オープン	44,304,753円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	37,955,470円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	26,960,815円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	18,337,110円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	12,929,008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）	6,783,721円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.5775円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) **配当等収益**	**798,292,568**
受取配当金	796,536,991
受取利息	10,639,199
その他収益金	1,752
支払利息	△　8,885,374
(B) **有価証券売買損益**	**4,016,798,405**
売買益	11,259,213,695
売買損	△ 7,242,415,290
(C) **先物取引等取引損益**	**3,487,250,873**
取引益	5,885,681,956
取引損	△ 2,398,431,083
(D) **保管費用等**	**△　17,015,490**
(E) **当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)**	**8,285,326,356**
(F) **前期繰越損益金**	**16,838,539,066**
(G) **追加信託差損益金**	**20,838,660,880**
(H) **解約差損益金**	**△14,797,223,815**
(I) **計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)**	**31,165,302,487**
次期繰越損益金(Ｉ)	**31,165,302,487**

(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５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
5期(2021年1月25日)	16,589	19.8	341,866.31	21.4	83.0	16.8	0.1	13,856

（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	%		%	%	%	%
2020年1月27日	13,853	－	281,695.65	－	71.2	29.0	0.2
1月末	13,299	△ 4.0	269,975.52	△ 4.2	70.5	29.6	0.2
2月末	12,746	△ 8.0	260,455.11	△ 7.5	73.4	26.6	0.1
3月末	10,240	△26.1	209,688.42	△25.6	69.9	31.6	0.1
4月末	11,164	△19.4	227,970.81	△19.1	67.0	32.8	0.1
5月末	11,245	△18.8	231,228.43	△17.9	64.0	38.4	0.1
6月末	12,186	△12.0	249,884.29	△11.3	65.6	34.3	0.0
7月末	12,933	△ 6.6	265,622.18	△ 5.7	71.0	29.0	0.1
8月末	13,547	△ 2.2	277,724.75	△ 1.4	69.5	30.3	0.1
9月末	12,948	△ 6.5	266,257.97	△ 5.5	78.4	22.1	0.1
10月末	13,408	△ 3.2	276,133.75	△ 2.0	75.3	22.9	0.0
11月末	14,662	5.8	301,472.78	7.0	75.5	24.6	0.1
12月末	15,064	8.7	309,849.40	10.0	83.0	18.3	0.1
（期末）							
2021年1月25日	16,589	19.8	341,866.31	21.4	83.0	16.8	0.1

（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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

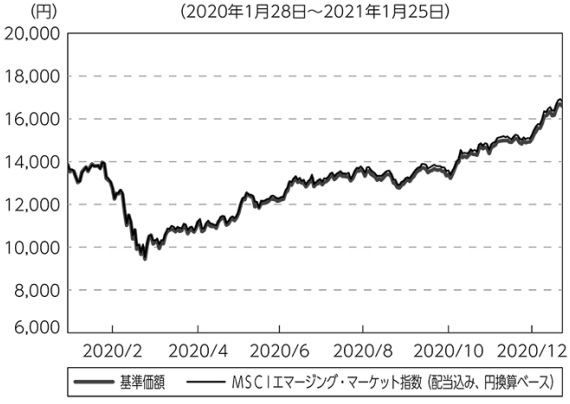
基準価額は前期末13,853円から当期末16,589円となり、2,736円の値上がりとなりました。

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

（2020年1月28日～2021年1月25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。2020年３月には、新型肺炎の世界的拡大に伴う経済活動の停滞懸念等から一時大幅に下落しましたが、その後は各国政策当局による財政・金融支援策に対する期待等から世界的株高が進むなか、新興国株式も上昇基調に転じました。特に、実体経済に着実な回復が見られる中国や、コロナ禍による新常態において旺盛な半導体需要が期待される韓国・台湾など、相対的に市場規模の大きい新興国の株式指数上昇が目立ちました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円高、ユーロに対して円安となりました。

米ドルに対しては、2020年３月には新型肺炎問題に伴う不確実性の高まりを受けて、投資家のリスク回避の動きに代表される円高圧力と企業等の米ドルを確保する動き等の円安圧力が交錯し、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、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による強力な金融緩和策の継続や追加経済対策に伴う財政赤字拡大観測から米ドル安（円高）基調で推移しました。

ユーロに対しては、米ドル安が進行したほかＥＵ（欧州連合）復興基金の創設合意などを背景に欧州地域の景気回復期待が高まり、対円でのユーロ高が進行しました。

新興国通貨は前期末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。新型肺炎問題に伴う不確実性の高まりから投資家のリスク回避の動きが強まり、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一部の新興国通貨では買戻しが進んだ一方、経済的な脆弱性から対米ドルで最安値を更新する新興国通貨も散見され、新興国への資金流入は地域ごとにまちまちとなりました。

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。

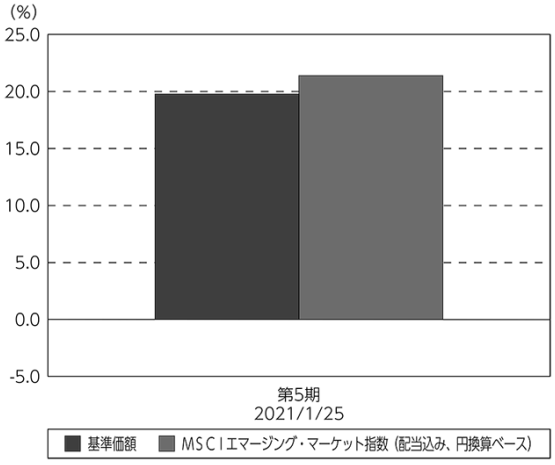
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は＋19.8%となり、ベンチマークの＋21.4%を1.6%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

（2020年１月28日～2021年１月25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	15	0.119	(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）	(11)	(0.086)	
（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）	(4)	(0.033)	
(b) 有価証券取引税	7	0.055	(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）	(7)	(0.055)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	40	0.315	(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）	(39)	(0.306)	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	62	0.489	
期中の平均基準価額は、12,786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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 1,915 (39)	千米ドル 8,280 (－)	百株 1,257	千米ドル 2,986
	メキシコ	 4,985 (346)	千メキシコペソ 14,937 (81)	 3,739 (－)	千メキシコペソ 9,182 (81)
	ブラジル	 4,820 (543)	千ブラジルレアル 13,871 (21)	 3,576 (－)	千ブラジルレアル 6,519 (21)
	チリ	 11,786 (0.29)	千チリペソ 166,221 (－)	 27,614	千チリペソ 112,882
	コロンビア	 419	千コロンビアペソ 285,299	 664	千コロンビアペソ 197,960
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	76 (－)	43 (△ 0.074)	595	64
	イギリス	 30	千英ポンド 61	 －	千英ポンド －
	トルコ	 1,406 (39)	千トルコリラ 1,320 (－)	 635	千トルコリラ 686
	チェコ	 40	千チェココルナ 590	 32	千チェココルナ 392
	ハンガリー	 47	千ハンガリーフォリント 26,119	 31	千ハンガリーフォリント 15,508
	ポーランド	 296	千ポーランドズロチ 1,299	 334	千ポーランドズロチ 702
	香港	 57,055 (1,518)	千香港ドル 83,045 (713)	 47,197 (210)	千香港ドル 42,787 (777)
	マレーシア	 4,286 (605)	千マレーシアリンギット 3,167 (－)	 3,441	千マレーシアリンギット 1,656
	タイ	 7,893 (250)	千タイバーツ 30,036 (－)	 9,184 (－)	千タイバーツ 15,392 (33)
	フィリピン	 2,299 (19)	千フィリピンペソ 16,108 (－)	 1,688	千フィリピンペソ 7,848

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	インドネシア	百株 21,408	千インドネシアルピア 8,281,500	百株 16,396	千インドネシアルピア 4,786,567
	韓国	910 (8)	千韓国ウォン 5,707,025 (3,871)	699 (－)	千韓国ウォン 2,549,117 (3,871)
	台湾	18,773 (382)	千新台湾ドル 141,845 (△ 134)	13,104 (－)	千新台湾ドル 69,136 (0)
	中国オフショア	6,881 (141)	千オフショア人民元 14,509 (－)	5,508	千オフショア人民元 7,291
	インド	6,241 (27)	千インドルピー 333,741 (316)	2,951 (－)	千インドルピー 116,828 (316)
	クウェート	2,268	千ｸｳｪｰﾄﾃﾞｨﾅｰﾙ 154	－	千ｸｳｪｰﾄﾃﾞｨﾅｰﾙ －
	サウジアラビア	1,233 (18)	千ｻｳｼﾞｱﾗﾋﾞｱﾘｱﾙ 4,852 (－)	621	千ｻｳｼﾞｱﾗﾋﾞｱﾘｱﾙ 1,837
	カタール	1,601	千カタールリアル 1,246	1,077	千カタールリアル 752
	南アフリカ	2,002 (445)	千南アフリカランド 25,399 (2,288)	2,014 (248)	千南アフリカランド 13,654 (2,288)
	アラブ首長国連邦	1,542	千アラブディルハム 1,085	704	千アラブディルハム 392

(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 － (9,555)	千タイバーツ － (33)	証券 9,555	千タイバーツ 26

(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	21,900 (－)	422 (△ 30)	11,600 (－)	208 (0)
	小計	21,900 (－)	422 (△ 30)	11,600 (－)	208 (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	25,920	332	11,146	146
	FORTRESS REIT LTD-A	－	－	12,100 (－)	134 (10)
	REDEFINE PROPERTIES LTD	－	－	62,770	126
	RESILIENT REIT LTD	－ (178)	－ (10)	155 (23)	4 (0.779)
	小計	25,920 (178)	332 (10)	86,171 (23)	411 (11)

(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 16,163	百万円 17,424	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

(2020年１月28日～2021年１月25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	7,129,090千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	6,809,869千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	1.04

(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

（2020年１月28日～2021年１月25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（2020年１月28日～2021年１月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年１月25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	188	248	6,421	666,812	小売
AUTOHOME INC-ADR	7	8	90	9,397	メディア・娯楽
BANCO MACRO SA-ADR	4	—	—	—	銀行
BEST INC - ADR	15	—	—	—	運輸
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	26	31	33	3,478	素材
CREDICORP LTD	7	8	130	13,570	銀行
58.COM INC-ADR	10	—	—	—	メディア・娯楽
GSX TECHEDU INC- ADR	—	10	92	9,553	消費者サービス
HUYA INC-ADR	9	9	21	2,245	メディア・娯楽
KE HOLDINGS INC	—	12	85	8,903	不動産
LUFAX HOLDING LTD	—	21	32	3,369	各種金融
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	57	70	63	6,578	電気通信サービス
NIO INC - ADR	74	169	1,046	108,715	自動車・自動車部品
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	15	20	346	35,998	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	4	5	24	2,574	各種金融
QUDIAN INC-SPON ADR	30	—	—	—	各種金融
SOUTHERN COPPER CORP	8	10	77	8,001	素材
TAL EDUCATION GROUP- ADR	44	51	387	40,248	消費者サービス
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	8	8	5	567	電気通信サービス
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	10	46	124	12,906	メディア・娯楽
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	50	61	179	18,628	小売
XPENG INC - ADR	—	22	124	12,882	自動車・自動車部品
YPF S.A.-SPONSORED ADR	19	19	6	688	エネルギー
YUM CHINA HOLDINGS INC	40	53	314	32,621	消費者サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	37	56	185	19,212	運輸
GLOBANT SA	4	5	107	11,205	ソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	30	36	922	95,796	メディア・娯楽
BAOZUN INC-SPN ADR	5	9	31	3,252	小売
BEIGENE LTD-ADR	—	6	224	23,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	—	15	200	20,832	メディア・娯楽
SINA CORP	6	6	27	2,818	メディア・娯楽
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	—	16	20	2,128	メディア・娯楽
51JOB INC-ADR	3	3	20	2,145	商業・専門サービス
GDS HOLDINGS LTD - ADR	7	12	135	14,058	ソフトウェア・サービス
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	12	—	—	—	銀行
HUAZHU GROUP LTD-ADR	15	22	105	10,965	消費者サービス
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	6	9	30	3,189	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQIYI INC-ADR	13	37	76	7,922	メディア・娯楽
JOYY INC	6	7	65	6,803	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR	83	114	1,083	112,549	小売
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	—	9	48	5,028	ソフトウェア・サービス
MOMO INC-SPON ADR	17	19	30	3,183	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR	7	55	643	66,805	メディア・娯楽
PINDUODUO INC-ADR	22	50	859	89,245	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	
TRIP.COM GROUP LTD	53	64	216	22,490	小売
WEIBO CORP-SPON ADR	5	6	27	2,810	メディア・娯楽
ZAI LAB LTD-ADR	—	9	163	16,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YANDEX NV-A	—	40	265	27,596	メディア・娯楽
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	132	—	—	—	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	100	100	8	833	不動産
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	172	189	75	7,793	銀行
GAZPROM PAO -SPON ADR	601	799	455	47,326	エネルギー
VTB BANK JSC -GDR-REG S	221	221	20	2,169	銀行
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	75	86	301	31,290	素材
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	31	—	—	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	47	52	82	8,547	食品・生活必需品小売り
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	—	16	43	4,565	メディア・娯楽
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	10	12	225	23,394	エネルギー
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	19	18	53	5,586	素材
ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	147	167	108	11,313	エネルギー
LUKOIL PJSC-SPON ADR	44	55	424	44,093	エネルギー
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	16	23	35	3,702	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR	6	8	86	8,972	素材
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	302	351	501	52,058	銀行
SEVERSTAL - GDR REG S	32	32	56	5,858	素材
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	140	147	67	7,017	エネルギー
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	30	33	134	13,918	エネルギー
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	16	18	70	7,289	食品・生活必需品小売り
DP WORLD PLC	19	—	—	—	運輸
小計 株数・金額	3,131	3,829	17,852	1,853,833	
小計 銘柄数＜比率＞	58	61	—	＜13.4%＞	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A	289	346	451	2,350	資本財
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	219	261	3,834	19,975	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	21	—	—	—	小売
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	273	339	1,163	6,061	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	156	204	860	4,480	食品・飲料・タバコ
GRUMA S.A.B.-B	24	28	661	3,448	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	27	27	445	2,321	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	56	74	452	2,358	資本財
CEMEX SAB-CPO	1,739	1,896	2,339	12,189	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	289	348	3,748	19,530	銀行
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	13	18	584	3,045	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	181	165	591	3,079	家庭用品・パーソナル用品
ALSEA SAB DE CV	60	—	—	—	消費者サービス
GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	24	30	967	5,038	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	398	422	3,806	19,833	素材
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	3,788	4,520	6,459	33,651	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	273	308	591	3,084	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	43	48	453	2,364	食品・飲料・タバコ
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	42	51	1,048	5,464	運輸
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	36	22	162	848	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	53	62	463	2,415	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	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコペソ	千円	
TELESITES SAB DE CV	－	197	422	2,199	電気通信サービス
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	100	142	659	3,435	素材
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	61	77	716	3,730	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO SAB DE CV	584	702	4,230	22,043	食品・生活必需品小売り
BECLE SAB DE CV	－	53	259	1,353	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	8,750	10,342	35,375	184,305	
小計 銘柄数＜比率＞	24	24	－	＜1.3%＞	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
BRF SA	65	59	122	2,316	食品・飲料・タバコ
VALE SA	357	488	4,546	86,296	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	－	11	71	1,363	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	96	－	－	－	電気通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	55	34	103	1,973	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	－	49	148	2,812	公益事業
BANCO DO BRASIL S.A.	94	107	360	6,841	銀行
ITAUSA SA	487	594	646	12,266	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	86	112	277	5,265	小売
GERDAU SA-PREF	126	152	385	7,316	素材
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	－	17	128	2,433	食品・生活必需品小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	－	495	1,372	26,052	エネルギー
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	81	96	200	3,808	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	824	632	1,712	32,495	エネルギー
CCR SA	139	134	167	3,181	運輸
WEG SA	94	115	1,027	19,503	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	575	588	1,472	27,954	銀行
BANCO BRADESCO S.A.	－	181	397	7,538	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	73	99	336	6,384	素材
BRADESPAR SA -PREF	－	33	233	4,438	素材
SUZANO SA	62	102	656	12,468	素材
CPFL ENERGIA SA	－	23	70	1,330	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	536	642	1,879	35,665	銀行
PORTO SEGURO SA	12	－	－	－	保険
BRASKEM SA-PREF A	23	－	－	－	素材
ALPARGATAS SA - PREF	－	27	109	2,073	耐久消費財・アパレル
LOCALIZA RENT A CAR	65	80	540	10,263	運輸
LOJAS RENNER S.A.	87	98	401	7,629	小売
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	71	104	227	4,324	エネルギー
COSAN SA	14	20	154	2,922	エネルギー
TOTVS SA	－	72	216	4,109	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	95	119	261	4,968	公益事業
EMBRAER SA	81	－	－	－	資本財
B2W CIA DIGITAL	23	28	250	4,746	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA	93	－	－	－	不動産
JBS SA	124	136	333	6,326	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	106	141	194	3,698	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	39	50	204	3,889	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	35	22	44	850	不動産
SUL AMERICA SA - UNITS	27	43	174	3,303	保険
HYPERA SA	43	40	138	2,630	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	
(ブラジル)		百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF		48	—	—	—	電気通信サービス
MAGAZINE LUIZA SA		79	390	1,013	19,238	小売
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		44	44	178	3,390	銀行
ENERGISA SA-UNITS		21	20	95	1,809	公益事業
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF		18	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CIELO SA		117	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TELEFONICA BRASIL S.A.		—	56	247	4,691	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA		26	140	350	6,653	食品・生活必需品小売り
VIA VAREJO SA		—	159	225	4,282	小売
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES		79	98	278	5,286	保険
ENGIE BRASIL ENERGIA SA		23	22	98	1,870	公益事業
NOTRE DAME INTERMED PAR SA		56	60	585	11,107	ヘルスケア機器・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE		20	172	298	5,673	ヘルスケア機器・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC		47	30	57	1,084	食品・生活必需品小売り
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO		230	278	1,627	30,893	各種金融
AMBEV SA		529	631	955	18,144	食品・飲料・タバコ
COGNA EDUCACAO		169	—	—	—	消費者サービス
KLABIN SA - UNIT		79	102	293	5,562	素材
NATURA &CO HOLDING SA		72	120	591	11,235	家庭用品・パーソナル用品
TIM SA		—	90	119	2,259	電気通信サービス
RUMO SA		125	171	356	6,767	運輸
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		79	—	—	—	保険
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		26	34	315	5,993	各種金融
小計	株数・金額	6,576	8,363	27,259	517,391	
	銘柄数<比率>	52	54	—	<3.7%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE		7,524	9,617	36,545	5,211	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		5	5	18,176	2,591	銀行
BANCO DE CHILE		4,906	6,016	45,725	6,520	銀行
EMPRESAS CMPC SA		144	148	31,276	4,460	素材
EMPRESAS COPEC SA		46	56	46,186	6,586	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		14	17	10,297	1,468	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		10	—	—	—	電気通信サービス
ENEL AMERICAS SA		4,538	4,436	50,178	7,155	公益事業
COLBUN SA		839	839	10,676	1,522	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A		400	—	—	—	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		28	28	5,671	808	食品・飲料・タバコ
LATAM AIRLINES GROUP SA		29	—	—	—	運輸
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		11	15	61,825	8,816	素材
FALABELLA SA		95	109	29,276	4,174	小売
CENCOSUD SA		134	188	26,046	3,714	食品・生活必需品小売り
CENCOSUD SHOPPING SA		—	52	6,063	864	不動産
ENEL CHILE SA		3,521	3,691	21,341	3,043	公益事業
ITAU CORPBANCA		18,800	—	—	—	銀行
小計	株数・金額	41,051	25,223	399,288	56,938	
	銘柄数<比率>	17	14	—	<0.4%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		57	66	172,718	5,095	公益事業
ECOPETROL SA		511	710	167,190	4,932	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	
(コロンビア)		百株	百株	千コロンビアペソ	千円	
GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF		430	—	—	—	銀行
GRUPO ARGOS SA		29	—	—	—	素材
BANCOLOMBIA SA		36	25	79,208	2,336	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		41	59	190,164	5,609	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		25	25	63,043	1,859	各種金融
小計	株数・金額	1,132	887	672,324	19,833	
	銘柄数<比率>	7	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		27	32	41	5,250	電気通信サービス
MOTOR OIL (HELLAS) SA		7	—	—	—	エネルギー
OPAP SA		22	21	22	2,832	消費者サービス
JUMBO SA		11	15	19	2,471	小売
NATIONAL BANK OF GREECE		66	—	—	—	銀行
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		3	—	—	—	素材
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A		307	—	—	—	銀行
ALPHA BANK AE		142	—	—	—	銀行
ユーロ計	株数・金額	588	69	83	10,554	
	銘柄数<比率>	8	3	—	<0.1%>	
(イギリス)				千英ポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		—	30	51	7,318	素材
小計	株数・金額	—	30	51	7,318	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.1%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		346	430	289	4,051	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		19	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS		10	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		36	79	145	2,037	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		138	227	337	4,731	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		4	5	84	1,180	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS		94	86	191	2,681	資本財
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		—	170	132	1,860	資本財
TURK HAVA YOLLARI AO		55	55	70	993	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		133	190	316	4,429	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI		278	317	309	4,337	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		177	250	166	2,336	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		14	17	187	2,625	エネルギー
YAPI VE KREDI BANKASI		—	296	92	1,290	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING		125	120	133	1,876	各種金融
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		48	59	442	6,192	食品・生活必需品小売り
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		15	—	—	—	運輸
小計	株数・金額	1,496	2,306	2,899	40,624	
	銘柄数<比率>	15	14	—	<0.3%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		7	7	503	2,436	銀行
CEZ AS		19	21	1,133	5,486	公益事業
MONETA MONEY BANK AS		64	70	472	2,287	銀行
小計	株数・金額	91	99	2,109	10,210	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	

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	
(ハンガリー)		百株	百株	千ハンガリーフォリント	千円	
OTP BANK PLC		25	28	38,338	13,552	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		15	20	16,532	5,844	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		45	54	12,150	4,295	エネルギー
小計	株数・金額	86	102	67,020	23,691	
	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		83	—	—	—	銀行
MBANK SA		1	—	—	—	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		16	18	340	9,491	素材
BANK PEKAO SA		19	26	174	4,861	銀行
ORANGE POLSKA SA		42	46	29	818	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN		32	40	239	6,662	エネルギー
LPP SA		0.13	0.19	149	4,160	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA		3	5	104	2,904	銀行
CD PROJEKT SA		7	8	214	5,967	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA		99	112	333	9,296	銀行
CCC SA		3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
GRUPA LOTOS SA		11	—	—	—	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		203	190	111	3,095	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA		29	31	98	2,738	メディア・娯楽
PGE SA		99	99	69	1,937	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		67	78	239	6,667	保険
DINO POLSKA SA		5	7	191	5,318	食品・生活必需品小売り
AMREST HOLDINGS SE		8	—	—	—	消費者サービス
ALLEGRO.EU SA		—	31	225	6,274	小売
小計	株数・金額	734	696	2,521	70,194	
	銘柄数＜比率＞	18	14	—	＜0.5%＞	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER CO LTD-H		150	150	214	2,878	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H		120	200	177	2,382	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H		220	260	109	1,463	運輸
CHINA MOBILE LTD		690	—	—	—	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H		145	175	848	11,373	素材
DATANG INTL POWER GEN CO-H		320	—	—	—	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HLDGS		50	60	158	2,118	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H		480	520	152	2,041	公益事業
YANZHOU COAL MINING CO-H		280	140	91	1,223	エネルギー
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS		—	120	268	3,601	不動産
HENGAN INTL GROUP CO LTD		85	90	498	6,681	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H		200	—	—	—	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H		260	—	—	—	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		380	340	219	2,947	自動車・自動車部品
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT		540	1,240	1,066	14,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST		440	535	999	13,391	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD		320	440	1,474	19,751	不動産
CITIC LTD		680	770	472	6,335	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H		180	200	115	1,549	運輸
LENOVO GROUP LTD		860	920	852	11,428	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H		2,360	2,680	678	9,085	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	720	—	—	—	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	188	244	376	5,041	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	2,920	3,300	1,306	17,511	エネルギー
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	90	130	244	3,278	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	260	340	1,137	15,239	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	91	109	1,379	18,491	公益事業
KUNLUN ENERGY CO LTD	400	520	370	4,968	公益事業
TOWNGAS CHINA CO LTD	110	—	—	—	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	180	180	101	1,357	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	740	1,040	162	2,174	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	140	180	200	2,686	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	480	660	171	2,299	素材
WHARF HOLDINGS LTD	130	200	360	4,824	不動産
CHINA EVERBRIGHT LTD	100	140	153	2,052	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	212	362	1,069	14,334	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	80	95	312	4,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	580	800	2,560	34,304	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	400	520	141	1,902	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	100	120	486	6,520	公益事業
BYD CO LTD-H	80	85	2,164	28,998	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	1,620	—	—	—	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	220	280	247	3,320	エネルギー
SINOTRANS LIMITED-H	150	—	—	—	運輸
MAANSHAN IRON & STEEL-H	240	—	—	—	素材
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	440	410	195	2,620	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	190	220	145	1,951	素材
CHINA YOUZAN LTD	—	2,040	816	10,934	ソフトウェア・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	780	860	517	6,937	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	260	440	322	4,327	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	240	260	226	3,031	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	360	430	1,124	15,067	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	840	1,000	1,740	23,316	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	580	740	711	9,539	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	240	320	481	6,449	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	200	260	552	7,403	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	100	—	—	—	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	340	—	—	—	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	70	—	—	—	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	100	—	—	—	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	240	260	353	4,738	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	40	60	455	6,102	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD	340	380	529	7,098	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	240	240	95	1,279	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	160	200	1,384	18,545	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	180	180	120	1,613	運輸
CNOOC LTD	2,010	2,390	1,864	24,980	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	805	1,422	1,135	15,211	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	320	370	1,713	22,955	食品・飲料・タバコ
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	630	785	7,653	102,560	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
LI NING CO LTD	230	285	1,439	19,285	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	560	580	190	2,549	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	1,180	1,390	164	2,197	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	590	590	102	1,375	公益事業
AIR CHINA LTD-H	180	300	161	2,166	運輸
ZTE CORP-H	90	88	195	2,617	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	380	—	—	—	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	400	430	660	8,850	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	345	390	405	5,435	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	960	1,110	485	6,499	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	260	300	138	1,857	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	10,710	12,730	7,714	103,372	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	87	113	1,749	23,439	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	340	320	272	3,653	自動車・自動車部品
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	180	180	181	2,436	不動産
MINTH GROUP LTD	—	100	388	5,199	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	170	200	239	3,205	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	460	480	478	6,412	素材
BANK OF CHINA LTD-H	8,900	10,590	2,869	38,456	銀行
SHUI ON LAND LTD	280	—	—	—	不動産
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	135	160	384	5,145	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	150	172	2,307	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	116	264	262	3,512	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	445	525	3,094	41,471	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	7,350	8,100	4,082	54,704	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	120	130	115	1,541	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	155	165	224	3,002	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	260	280	103	1,384	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	540	—	—	—	資本財
CHINA COAL ENERGY CO-H	350	—	—	—	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	80	80	233	3,124	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	53	67	287	3,856	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	150	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	240	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	870	1,060	1,072	14,374	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	450	480	269	3,614	素材
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	1,060	1,150	400	5,362	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	145	140	163	2,191	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	78	97	2,097	28,101	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	120	150	2,053	27,516	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	—	40	99	1,334	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL LTD	310	345	409	5,482	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	620	740	285	3,827	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	405	—	—	—	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	420	540	206	2,771	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	120	—	—	—	不動産
KINGSOFT CORP LTD	90	100	619	8,294	ソフトウェア・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	95	80	188	2,519	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	480	440	166	2,234	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	170	150	135	1,813	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	75	90	504	6,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	195	—	—	—	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	590	720	388	5,209	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	300	378	1,313	17,601	保険
CRRC CORP LTD - H	540	—	—	—	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	235	315	239	3,207	食品・生活必需品小売り
BBMG CORP-H	250	—	—	—	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	172	—	—	—	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	144	176	336	4,513	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	300	360	319	4,283	素材
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	320	—	—	—	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	360	400	323	4,330	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	130	260	183	2,456	素材
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	290	180	61	829	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	320	490	617	8,273	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	110	113	158	2,125	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	580	—	—	—	公益事業
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	280	360	1,180	15,822	不動産
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	120	—	—	—	不動産
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	194	196	215	2,894	資本財
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	205	250	1,112	14,907	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	97	107	333	4,473	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	841	751	351	4,709	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	320	370	152	2,037	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	60	128	235	3,155	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	400	470	155	2,078	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	3,290	3,840	1,125	15,076	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	65	80	396	5,317	小売
FAR EAST HORIZON LTD	290	290	234	3,136	各種金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	110	644	8,630	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	250	285	539	7,225	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	200	—	—	—	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	170	160	163	2,191	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	436	318	4,264	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	80	95	430	5,773	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	970	1,260	317	4,254	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	55	60	227	3,043	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	420	299	4,012	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	175	—	—	—	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	370	560	291	3,902	各種金融
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	110	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	150	130	173	2,327	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	100	200	189	2,540	商業・専門サービス
CHINA EVERGRANDE GROUP	220	240	376	5,042	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	76	—	—	—	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	940	1,250	658	8,827	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	60	60	816	10,934	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	100	180	198	2,658	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	365	—	—	—	半導体・半導体製造装置
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	—	25	68	921	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	140	190	1,297	17,389	商業・専門サービス
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	210	120	60	804	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	43	72	663	8,890	ヘルスケア機器・サービス
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	260	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	80	110	193	2,597	消費者サービス
HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	—	80	30	402	資本財
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	—	95	162	2,179	素材
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	—	40	59	799	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES	52	72	264	3,545	商業・専門サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	4,820	6,140	730	9,790	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	898	1,880	5,602	75,072	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTEC CO LTD-H	19	36	739	9,906	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN	113	475	18,059	241,997	小売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	—	144	201	2,693	小売
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	40	100	670	8,984	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	360	520	991	13,281	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	95	135	1,344	18,017	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	1,050	161	2,166	各種金融
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	—	80	224	3,012	小売
LOGAN GROUP CO LTD	160	190	242	3,248	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	190	210	804	10,777	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	—	12	82	1,103	不動産
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	—	200	344	4,614	ヘルスケア機器・サービス
CHINA AOYUAN GROUP LTD	140	140	109	1,467	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	60	60	102	1,374	消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	—	6	154	2,074	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	—	140	174	2,341	小売
SHENZHEN INTL HOLDINGS	95	155	204	2,741	運輸
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	60	160	727	9,744	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	—	160	396	5,317	食品・飲料・タバコ
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	—	21	357	4,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	—	70	591	7,926	食品・飲料・タバコ
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	—	405	4,912	65,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAIER SMART HOME CO LTD-H	—	288	1,022	13,700	耐久消費財・アパレル
TENCENT HOLDINGS LTD	639	756	52,239	700,010	メディア・娯楽
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	—	395	171	2,302	銀行
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	—	30	504	6,753	小売
SEAZEN GROUP LIMITED	—	240	178	2,386	不動産
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	—	19	359	4,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	175	221	653	8,750	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	165	175	68	916	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	140	1,876	メディア・娯楽
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	30	50	262	3,520	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	420	540	1,501	20,116	ヘルスケア機器・サービス
CGN POWER CO LTD-H	1,310	1,100	210	2,815	公益事業
BAIC MOTOR CORP LTD-H	235	—	—	—	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	192	156	190	2,558	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	52	76	429	5,753	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	210	174	232	3,119	各種金融
3SBIO INC	130	130	99	1,327	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	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	175	110	48	650	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	98	1,324	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	34	42	230	3,089	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD	220	100	46	623	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	230	305	144	1,937	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	150	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	—	120	87	1,175	消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	—	150	80	1,081	不動産
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	550	—	—	—	保険
BOC AVIATION LTD	22	35	222	2,975	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	39	52	229	3,069	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	—	160	325	4,363	自動車・自動車部品
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	172	176	405	5,436	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	65	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	—	11	125	1,675	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	102,960	114,126	195,070	2,613,942	
小計 銘柄数＜比率＞	207	197	—	＜18.9%＞	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	190	234	78	2,005	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	30	30	28	743	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	536	802	319	8,190	銀行
DIGI.COM BHD	361	397	158	4,074	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	135	129	67	1,721	運輸
RHB BANK BHD	197	181	96	2,480	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	68	76	60	1,554	資本財
GAMUDA BHD	233	210	74	1,902	資本財
YTL CORP BHD	193	—	—	—	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	32	18	30	770	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	65	72	126	3,244	銀行
IJM CORP BHD	236	—	—	—	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	43	64	150	3,855	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	17	21	65	1,683	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	445	537	429	11,023	銀行
MISC BHD	140	176	112	2,885	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	8	10	138	3,541	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	58	82	154	3,973	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	29	29	58	1,503	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	71	104	172	4,419	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	18	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TELEKOM MALAYSIA BHD	141	184	110	2,832	電気通信サービス
TENAGA NASIONAL BHD	357	294	287	7,378	公益事業
QL RESOURCES BHD	82	171	102	2,640	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	430	500	163	4,182	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	353	391	846	21,731	銀行
AIRASIA GROUP BHD	226	—	—	—	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	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
TOP GLOVE CORP BHD	146	665	415	10,664	ヘルスケア機器・サービス
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	—	166	69	1,784	ヘルスケア機器・サービス
SUPERMAX CORP BHD	—	192	125	3,219	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	204	329	131	3,376	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	289	326	78	2,007	消費者サービス
IOI CORP BHD	197	325	141	3,636	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	360	331	74	1,919	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	136	237	291	7,492	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	320	304	105	2,699	電気通信サービス
MAXIS BHD	229	302	148	3,820	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	280	307	225	5,790	素材
IHH HEALTHCARE BHD	262	318	165	4,243	ヘルスケア機器・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	68	68	29	767	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	174	167	145	3,723	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD	244	304	151	3,884	食品・飲料・タバコ
小計 株数・金額	7,604	9,053	6,132	157,369	
小計 銘柄数<比率>	40	38	—	<1.1%>	
(タイ)			千タイバーツ		
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	41	78	955	3,306	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	120	165	585	2,026	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	414	250	305	1,055	銀行
RATCH GROUP PCL-NVDR	—	112	568	1,966	公益事業
ROBINSON PCL-NVDR	33	—	—	—	小売
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	98	99	935	3,237	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	1,421	851	282	977	電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	198	213	2,747	9,507	銀行
TMB BANK PCL-NVDR	2,150	—	—	—	銀行
IRPC PCL - NVDR	1,377	—	—	—	エネルギー
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	530	—	—	—	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	34	40	748	2,588	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	—	286	1,651	5,714	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	449	567	1,601	5,542	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	138	166	2,938	10,166	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	690	881	1,233	4,267	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	51	2,774	9,599	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	1,257	1,544	6,098	21,101	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	340	486	690	2,387	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	—	82	520	1,801	各種金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	985	964	780	2,701	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR	90	108	4,244	14,685	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	490	593	3,543	12,259	運輸
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	257	294	1,550	5,365	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,079	1,326	2,797	9,680	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	43	60	750	2,595	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	325	486	1,275	4,414	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	132	132	732	2,534	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	669	794	4,605	15,933	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	760	1,055	1,018	3,522	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	157	200	2,230	7,715	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	
(タイ)		百株	百株	千タイバーツ	千円	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR		—	97	322	1,115	電気通信サービス
TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN		92	—	—	—	電気通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		165	165	606	2,098	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		262	328	2,009	6,951	素材
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		198	179	1,105	3,824	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO		789	895	738	2,554	運輸
B GRIMM POWER PCL-NVDR		72	95	491	1,701	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR		62	322	1,086	3,760	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR		65	65	224	775	食品・飲料・タバコ
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR		—	183	386	1,336	各種金融
RATCH GROUP PCL-FOREIGN		70	—	—	—	公益事業
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR		—	622	291	1,007	消費者サービス
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR		—	206	665	2,301	小売
INTOUCH HOLDINGS PCL-F		184	—	—	—	電気通信サービス
SRISAWAD CORP PCL-NVDR		70	90	596	2,063	各種金融
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR		—	134	532	1,842	ヘルスケア機器・サービス
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR		78	76	497	1,722	各種金融
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR		70	73	578	2,001	公益事業
小計	株数・金額	16,454	15,413	58,298	201,711	
	銘柄数＜比率＞	40	42	—	＜1.5%＞	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC		838	1,054	4,158	8,981	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		238	233	1,014	2,192	資本財
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN		98	264	2,139	4,620	銀行
GLOBE TELECOM INC		4	4	927	2,002	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		94	117	1,503	3,247	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC		332	401	2,927	6,323	資本財
JOLLIBEE FOODS CORP		45	69	1,297	2,802	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST		217	276	1,286	2,779	銀行
MEGAWORLD CORP		980	980	393	850	不動産
ROBINSONS LAND CO		245	—	—	—	不動産
SECURITY BANK CORP		14	—	—	—	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC		1,147	1,288	4,842	10,460	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP		103	132	1,978	4,274	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP		27	31	3,296	7,120	資本財
AYALA CORPORATION		32	37	3,068	6,626	資本財
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		1,450	1,450	623	1,346	各種金融
ABOITIZ POWER CORP		160	160	416	898	公益事業
MANILA ELECTRIC COMPANY		27	31	894	1,932	公益事業
BDO UNIBANK INC		227	281	3,121	6,743	銀行
PUREGOLD PRICE CLUB INC		—	95	365	788	食品・生活必需品小売り
GT CAPITAL HOLDINGS INC		11	15	865	1,870	資本財
PLDT INC		8	9	1,362	2,942	電気通信サービス
小計	株数・金額	6,303	6,933	36,484	78,805	
	銘柄数＜比率＞	21	20	—	＜0.6%＞	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
BARITO PACIFIC TBK PT		3,135	3,775	385,050	2,849	素材
UNITED TRACTORS TBK PT		201	221	556,367	4,117	エネルギー
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P		509	482	321,735	2,380	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	
(インドネシア)	百株	百株	千インドネシアルピア	千円	
CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	846	1,083	687,705	5,089	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT	47	66	269,610	1,995	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT	911	—	—	—	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	215	232	352,640	2,609	素材
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	269	269	349,700	2,587	素材
BUKIT ASAM TBK PT	400	—	—	—	エネルギー
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	2,129	2,308	1,661,760	12,297	銀行
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	150	—	—	—	素材
UNILEVER INDONESIA TBK PT	885	1,007	732,592	5,421	家庭用品・パーソナル用品
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	6,287	7,402	3,493,744	25,853	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	1,315	1,315	220,920	1,634	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	869	1,055	662,012	4,898	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	347	322	391,230	2,895	素材
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	1,114	1,322	4,679,880	34,631	銀行
XL AXIATA TBK PT	280	—	—	—	電気通信サービス
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	185	—	—	—	運輸
BUMI SERPONG DAMAI PT	660	—	—	—	不動産
ADARO ENERGY TBK PT	1,509	1,509	203,715	1,507	エネルギー
PAKUWON JATI TBK PT	970	—	—	—	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	273	327	309,832	2,292	食品・飲料・タバコ
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	260	—	—	—	銀行
KALBE FARMA TBK PT	2,527	2,265	365,797	2,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACE HARDWARE INDONESIA	500	500	79,750	590	小売
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	2,310	2,508	1,680,360	12,434	自動車・自動車部品
SARANA MENARA NUSANTARA PT	—	3,473	347,300	2,570	電気通信サービス
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	5,581	6,650	2,254,350	16,682	電気通信サービス
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	—	1,605	388,410	2,874	素材
小計 株数・金額	34,684	39,696	20,394,461	150,919	
小計 銘柄数<比率>	28	22	—	<1.1%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
CHEIL WORLDWIDE INC	8	10	21,052	1,983	メディア・娯楽
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	2	4	54,520	5,135	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	3	3	68,580	6,460	保険
DB INSURANCE CO LTD	4	7	29,040	2,735	保険
COWAY CO LTD	5	5	39,028	3,676	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	12	15	127,402	12,001	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	2	2	19,220	1,810	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	2	5	17,902	1,686	公益事業
CJ CORP	1	1	20,458	1,927	資本財
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	5	5	14,135	1,331	資本財
SK TELECOM	2	5	135,636	12,776	電気通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	3	—	—	—	資本財
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	47	43	42,159	3,971	各種金融
NCSOFT CORP	1	2	217,580	20,496	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	13	23	28,309	2,666	電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	—	28	38,136	3,592	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	30	—	—	—	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	5	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	1	1	195,250	18,392	家庭用品・パーソナル用品

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	
LG CHEM LTD	5	6	591,825	55,749	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	—	0.88	43,472	4,095	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	—	0.31	21,979	2,070	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	50	55	182,120	17,155	銀行
S-OIL CORP	4	4	35,259	3,321	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORP	12	14	81,874	7,712	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	41	23	8,202	772	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	6	8	33,825	3,186	各種金融
LOTTE CHEMICAL CORP	1	2	69,071	6,506	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	3	4	35,856	3,377	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	4	5	58,485	5,509	資本財
HYUNDAI MOBIS CO LTD	7	8	309,750	29,178	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	61	72	931,625	87,759	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	9	8	38,539	3,630	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	—	3	40,992	3,861	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	19	19	508,603	47,910	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	7	12	56,098	5,284	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	25	25	21,971	2,069	銀行
KCC CORP	0.54	—	—	—	素材
KIA MOTORS CORP	29	35	307,826	28,997	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	0.95	1	51,667	4,867	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	29	34	82,375	7,759	公益事業
HANWHA CORPORATION	—	8	27,600	2,599	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	5	9	33,377	3,144	運輸
OCI CO LTD	1	—	—	—	素材
CJ LOGISTICS	1	1	23,085	2,174	運輸
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	2	2	41,529	3,912	素材
DOUZONE BIZON CO LTD	—	1	20,805	1,959	ソフトウェア・サービス
LG ELECTRONICS INC	11	13	239,980	22,606	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	2	2	8,808	829	資本財
LG CORP	11	12	130,968	12,337	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	15	15	17,864	1,682	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	8	8	35,699	3,362	資本財
NAVER CORP	15	16	559,561	52,710	メディア・娯楽
HYUNDAI DEPT STORE CO	1	—	—	—	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	4	5	48,347	4,554	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.13	0.13	7,397	696	食品・飲料・タバコ
AMOREPACIFIC GROUP	3	4	27,498	2,590	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	13	13	35,091	3,305	消費者サービス
POSCO	8	9	258,129	24,315	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	16	24	32,106	3,024	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	5	7	578,952	54,537	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	5	7	153,850	14,492	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	564	627	5,449,304	513,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	53	69	46,760	4,404	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	52	108	844,210	79,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE INC	0.79	1	27,359	2,577	小売
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	—	4	39,960	3,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORP	1	5	39,023	3,676	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
HANON SYSTEMS	22	23	43,074	4,057	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	7	9	20,279	1,910	保険
GS HOLDINGS	4	4	19,134	1,802	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	22	33	78,609	7,405	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANA FINANCIAL GROUP	31	40	146,381	13,789	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	2	2	46,209	4,352	運輸
LOTTE SHOPPING CO	1	0.8	9,280	874	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	8	9	74,575	7,024	保険
AMOREPACIFIC CORP	3	4	100,436	9,461	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	3	5	16,647	1,568	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	5	7	208,500	19,640	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	0.85	0.88	39,028	3,676	食品・飲料・タバコ
PAN OCEAN CO LTD	32	32	16,778	1,580	運輸
LG INNOTEK CO LTD	1	1	30,600	2,882	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK HOLDINGS CO LTD	4	4	148,912	14,027	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	42	52	231,262	21,784	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	9	10	31,000	2,920	資本財
BNK FINANCIAL GROUP INC	25	—	—	—	銀行
HANMI PHARM CO LTD	0.67	0.87	31,494	2,966	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	—	—	—	保険
FILA HOLDINGS CORP	5	6	29,953	2,821	耐久消費財・アパレル
E-MART INC	2	2	44,718	4,212	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO., LTD.	4	1	6,981	657	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	8	9	42,552	4,008	自動車・自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2	—	—	—	資本財
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	1	1	29,260	2,756	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	0.57	0.57	8,664	816	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	2	2	30,496	2,872	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	—	1	45,155	4,253	素材
NETMARBLE CORPORATION	2	2	34,417	3,242	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	49	74	70,571	6,647	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	—	2	34,163	3,218	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG SDS CO LTD	4	4	86,860	8,182	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	10	10	156,658	14,757	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1	2	180,238	16,978	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	19,256	1,813	資本財
KAKAO CORP	5	7	351,880	33,147	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	1	1	18,509	1,743	小売
KMW CO LTD	1	3	27,881	2,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POSCO CHEMICAL CO LTD	2	2	39,897	3,758	素材
HLB INC	3	5	51,789	4,878	耐久消費財・アパレル
CELLTRION INC	10	12	400,210	37,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HELIXMITH CO LTD	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC	—	2	42,364	3,990	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDY-TOX INC	0.47	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	—	2	41,136	3,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALTEOGEN INC	—	2	35,280	3,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	0.7	0.7	19,026	1,792	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	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	5	8	123,199	11,605	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	1,695	1,915	16,570,417	1,560,933	
小計 銘柄数＜比率＞	105	106	—	＜11.3%＞	
(台湾)			千新台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	60	70	2,040	7,570	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	310	380	908	3,369	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	80	90	2,560	9,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	50	60	2,976	11,040	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	220	310	1,263	4,686	素材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	30	50	1,157	4,294	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN BUSINESS BANK	605	796	737	2,737	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	100	120	1,476	5,475	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	70	100	1,335	4,952	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	170	1,717	6,370	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	70	50	439	1,631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	300	370	3,048	11,311	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	100	66	284	1,055	不動産
EVA AIRWAYS CORP	260	—	—	—	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	70	90	1,836	6,811	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	625	716	1,217	4,516	銀行
CHINA AIRLINES LTD	170	—	—	—	運輸
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	190	220	924	3,428	自動車・自動車部品
CHINA STEEL CORP	1,320	1,500	3,547	13,161	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	263	278	629	2,334	保険
ADVANTECH CO LTD	40	52	1,833	6,802	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	490	460	979	3,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	220	260	7,566	28,069	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	120	170	1,451	5,386	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	420	510	5,533	20,529	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	860	1,220	1,769	6,562	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	180	210	2,030	7,533	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE CORP LTD	115	315	1,104	4,096	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	320	390	1,029	3,819	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	34	60	1,127	4,184	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	20	20	820	3,042	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	70	70	2,961	10,985	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	500	520	4,711	17,478	素材
FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	100	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	390	450	3,631	13,472	素材
GIANT MANUFACTURING	30	40	1,140	4,229	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	170	200	18,340	68,041	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	740	840	3,885	14,413	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	897	1,074	1,874	6,954	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	30	40	2,440	9,052	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	150	240	1,449	5,378	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	1,130	1,259	2,612	9,693	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	870	990	4,014	14,893	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	1,390	1,760	1,591	5,902	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,174	1,409	3,424	12,703	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	
(台湾)	百株	百株	千新台湾ドル	千円	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	1,388	1,658	20,144	74,736	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	1,220	1,490	4,261	15,809	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	15	13	3,969	14,724	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	1,087	1,187	1,508	5,596	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	998	1,548	1,274	4,727	保険
INVENTEC CORP	270	280	646	2,399	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	220	270	1,431	5,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	1,209	1,449	1,609	5,971	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	2,080	2,380	4,569	16,953	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,125	1,306	2,664	9,886	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	80	100	1,035	3,839	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	580	700	4,844	17,971	素材
WISTRON CORP	339	299	919	3,411	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	230	340	969	3,594	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	540	650	4,335	16,084	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	60	80	2,132	7,909	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	140	150	1,417	5,258	エネルギー
PHISON ELECTRONICS CORP	20	10	414	1,535	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	63	94	375	1,392	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	24	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	100	140	1,058	3,926	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	31	31	171	635	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	170	170	795	2,951	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	551	614	2,495	9,260	素材
TATUNG CO LTD	210	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2,750	3,240	210,276	780,123	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	1,300	1,460	8,249	30,603	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	340	420	1,176	4,362	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	31	51	3,160	11,725	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	220	220	641	2,379	運輸
INNOLUX CORP	910	900	1,224	4,541	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	159	179	780	2,895	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	21	31	1,436	5,328	資本財
PEGATRON CORP	210	260	2,017	7,485	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	10	20	2,290	8,495	資本財
WIN SEMICONDUCTORS CORP	40	40	1,830	6,789	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	135	159	2,687	9,970	各種金融
ONENESS BIOTECH CO LTD	—	30	621	2,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	—	5	927	3,441	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	60	60	702	2,604	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,026	1,183	2,308	8,563	銀行
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	380	490	1,911	7,089	銀行
WIWYNN CORP	10	10	868	3,220	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	390	410	4,305	15,971	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	—	10	2,650	9,831	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	20	30	2,148	7,969	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	20	20	762	2,827	耐久消費財・アパレル
小計 株数・金額	36,144	42,196	421,433	1,563,519	
小計 銘柄数<比率>	88	87	—	<11.3%>	

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	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	88	88	71	1,141	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	3	40	69	1,111	ソフトウェア・サービス
PICC HOLDING CO-A	—	35	21	348	保険
CSC FINANCIAL CO LTD-A	34	25	100	1,615	各種金融
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1	11	95	1,530	資本財
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	27	—	—	—	素材
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	—	3	32	521	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	5	6	22	356	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	36	36	156	2,503	素材
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	4	4	34	553	食品・飲料・タバコ
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	60	13	17	287	各種金融
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	—	6	59	952	食品・生活必需品小売り
JUEWEI FOOD CO LTD-A	10	3	24	390	食品・飲料・タバコ
OPPEIN HOME GROUP INC-A	1	1	20	325	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	2	2	25	400	素材
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	25	25	43	688	食品・飲料・タバコ
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	15	15	17	273	各種金融
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	15	15	15	242	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	15	—	—	—	素材
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	9	2	33	538	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	70	16	18	289	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	12	38	56	896	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOTRANS LIMITED-A	120	20	8	135	運輸
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	4	5	113	1,811	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTEC CO LTD-A	14	14	253	4,055	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	—	—	—	自動車・自動車部品
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	—	7	88	1,416	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	—	7	31	496	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	—	7	61	977	資本財
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	—	14	27	440	不動産
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	5	8	258	4,128	半導体・半導体製造装置
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	—	43	24	386	各種金融
PROYA COSMETICS CO LTD-A	—	1	19	308	家庭用品・パーソナル用品
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	—	104	58	943	運輸
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	—	22	38	620	各種金融
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	—	6	27	442	ヘルスケア機器・サービス
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	—	4	86	1,382	食品・飲料・タバコ
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	1	—	—	—	メディア・娯楽
PETROCHINA CO LTD-A	51	217	90	1,451	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	314	362	182	2,919	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	417	503	157	2,527	銀行
BANK OF CHINA LTD-A	234	163	51	826	銀行
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	198	118	48	768	エネルギー
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	8	25	95	1,520	保険
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	15	55	102	1,642	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	139	173	893	14,293	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	77	89	745	11,933	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	137	180	412	6,603	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	168	194	189	3,038	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	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
CHINA MINSHENG BANKING-A	246	298	153	2,450	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	50	69	162	2,605	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	8	10	2,079	33,279	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	262	272	122	1,958	銀行
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	6	—	—	—	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	63	86	260	4,173	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	35	44	165	2,644	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	10	10	4	73	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	159	174	329	5,264	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	51	111	71	1,150	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	256	349	142	2,272	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	326	298	147	2,355	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	79	253	106	1,704	資本財
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	28	89	110	1,774	各種金融
HUAXIA BANK CO LTD-A	44	44	26	430	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	37	42	193	3,093	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	75	187	89	1,433	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	185	—	—	—	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	80	189	125	2,010	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	32	28	146	2,342	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	19	67	176	2,817	各種金融
HUANENG POWER INTL INC-A	8	8	3	55	公益事業
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	72	83	123	1,969	不動産
CRRC CORP LTD-A	154	—	—	—	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	25	41	470	7,530	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	9	146	素材
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	38	—	—	—	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	71	55	103	1,658	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	3	—	—	—	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	180	214	117	1,879	資本財
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	7	19	100	1,611	保険
HAIER SMART HOME CO LTD-A	20	57	194	3,114	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	25	62	256	4,096	資本財
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	28	—	—	—	公益事業
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	30	30	19	315	銀行
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	2	12	62	993	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	11	2	44	エネルギー
GEMDALE CORP-A	6	33	39	630	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	3	44	153	2,454	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	25	23	267	4,286	素材
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	8	8	4	70	資本財
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	11	14	15	252	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	3	3	2	42	メディア・娯楽
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	1	1	2	32	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	18	177	191	3,067	素材
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	8	72	62	1,004	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	11	66	56	907	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	14	35	110	1,761	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	
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	5	5	2	35	エネルギー
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	16	17	481	7,697	小売
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	2	—	—	—	自動車・自動車部品
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	179	179	21	337	素材
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	1	1	9	149	食品・飲料・タバコ
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	55	—	—	—	運輸
AVIC CAPITAL CO LTD -A	9	9	3	61	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	21	21	7	118	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	13	13	23	382	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-A	8	8	5	89	運輸
TBEA CO LTD-A	4	4	5	82	資本財
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	5	5	2	47	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	18	18	5	85	資本財
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	7	—	—	—	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	40	40	15	248	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	3	10	71	1,138	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	2	2	6	96	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	6	107	素材
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	38	38	19	310	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	10	14	43	688	自動車・自動車部品
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	3	43	66	1,060	各種金融
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	4	4	6	98	素材
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	7	7	7	116	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2	2	3	62	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	2	2	1	28	メディア・娯楽
AECC AVIATION POWER CO-A	2	14	105	1,690	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	24	89	73	1,170	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	2	2	3	61	ヘルスケア機器・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12	99	152	2,439	運輸
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	68	68	44	708	素材
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4	4	3	53	素材
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	6	6	2	34	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	7	67	59	950	各種金融
BEIJING TONGRENTANG CO-A	2	—	—	—	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	4	15	35	566	素材
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	6	6	22	354	家庭用品・パーソナル用品
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2	20	79	1,271	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	4	—	—	—	素材
BBMG CORPORATION-A	9	9	2	41	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	31	31	22	352	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO-A	9	9	9	156	エネルギー
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	2	2	2	45	資本財
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	7	7	3	57	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	13	13	5	93	運輸
CHINA SPACESAT CO LTD -A	1	—	—	—	資本財
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	2	2	5	81	小売
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	6	6	6	111	資本財
HUADIAN POWER INTL CORP-A	13	13	4	67	公益事業
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	12	12	3	59	不動産

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	
AISINO CORP-A	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	3	3	1	28	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	5	5	3	52	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	1	6	68	1,099	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2	23	110	1,764	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	15	—	—	—	資本財
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	12	12	20	333	素材
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	11	91	50	813	運輸
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	56	56	16	267	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	2	19	118	1,901	自動車・自動車部品
XIAMEN C & D INC-A	3	3	2	38	資本財
YOUNGOR GROUP CO-A	—	31	22	360	不動産
AVICOPTER PLC-A	5	5	31	501	資本財
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	160	32	11	189	各種金融
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	10	—	—	—	運輸
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	3	3	2	43	各種金融
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	—	14	43	696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	49	—	—	—	公益事業
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	35	35	15	253	素材
SINOCHEM INTL CORP-A	23	—	—	—	資本財
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	3	—	—	—	資本財
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	7	—	—	—	資本財
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	2	4	3	53	資本財
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	1	6	179	2,875	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	14	6	109	素材
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1	8	299	4,794	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	11	11	25	401	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	20	20	11	181	エネルギー
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	—	32	76	1,225	素材
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	35	—	—	—	資本財
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	22	—	—	—	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	—	—	—	各種金融
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	50	50	58	931	小売
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	23	23	17	285	資本財
CHINA MEHECO CO LTD -A	9	—	—	—	資本財
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	9	9	15	245	不動産
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	22	—	—	—	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	8	2	14	233	ソフトウェア・サービス
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	9	—	—	—	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	23	18	298	素材
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	19	4	17	280	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	100	100	35	563	素材
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	190	—	—	—	運輸
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	9	10	44	717	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	—	—	—	素材
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	22	22	15	247	公益事業
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	34	—	—	—	不動産
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	26	26	28	452	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	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	10	3	20	324	食品・飲料・タバコ
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	14	14	16	262	資本財
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	240	—	—	—	運輸
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	9	9	18	302	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	12	33	535	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	8	10	170	運輸
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	16	16	22	359	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	10	26	420	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	20	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TONGWEI CO LTD-A	4	33	148	2,368	食品・飲料・タバコ
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	38	—	—	—	素材
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	10	4	24	399	ソフトウェア・サービス
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	20	20	52	846	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	4	4	55	894	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	6	6	28	453	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	11	11	21	351	素材
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	19	—	—	—	資本財
ANXIN TRUST CO LTD-A	5	—	—	—	各種金融
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	14	14	59	948	素材
CHINA JUSHI CO LTD -A	29	29	69	1,108	素材
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	74	—	—	—	素材
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	60	60	26	420	小売
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	7	10	130	2,082	資本財
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	2	2	2	42	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGKUN GROUP CO LTD-A	15	15	39	635	素材
WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	—	15	13	222	半導体・半導体製造装置
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	3	3	46	736	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	7	7	41	660	食品・飲料・タバコ
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	9	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	8	—	—	—	消費者サービス
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	—	24	25	407	公益事業
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	12	26	311	4,979	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	2	2	43	688	自動車・自動車部品
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	7	7	13	223	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	—	—	—	小売
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	25	25	27	436	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	13	23	466	7,470	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	10	10	56	906	食品・飲料・タバコ
NANJING IRON & STEEL CO-A	37	—	—	—	素材
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	12	12	33	543	自動車・自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	12	3	16	264	資本財
DONGXING SECURITIES CO LT-A	2	2	2	37	各種金融
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	—	8	41	665	自動車・自動車部品
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	40	—	—	—	運輸
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	25	69	119	1,913	各種金融
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	43	43	21	342	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	5	5	32	517	食品・飲料・タバコ
SKSHU PAINT CO LTD-A	—	4	62	1,002	素材
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	4	4	2	45	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	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	32	32	17	278	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5	58	84	1,354	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	2	2	2	37	メディア・娯楽
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1	1	4	70	自動車・自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	5	1	15	246	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	2	2	5	92	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	—	40	47	753	運輸
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	2	—	—	—	銀行
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	2	2	36	584	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	—	8	61	989	耐久消費財・アパレル
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	—	28	32	524	各種金融
SDIC CAPITAL CO LTD-A	6	36	48	783	各種金融
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	5	—	—	—	小売
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	25	—	—	—	不動産
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	5	1	31	508	ヘルスケア機器・サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	—	10	105	1,687	半導体・半導体製造装置
TOLY BREAD CO LTD-A	5	5	28	454	食品・飲料・タバコ
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	3	4	42	683	食品・生活必需品小売り
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	1	1	31	499	メディア・娯楽
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	3	4	45	725	資本財
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	2	2	21	344	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	6	52	56	907	各種金融
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	12	—	—	—	素材
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	—	24	40	640	素材
SPRING AIRLINES CO LTD-A	1	1	4	79	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	4	32	55	893	各種金融
DAWNING INFORMATION INDUST-A	8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	8	8	77	1,235	商業・専門サービス
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	12	12	6	111	不動産
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	8	8	35	568	不動産
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	14	—	—	—	商業・専門サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	8	15	168	2,688	資本財
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	12	—	—	—	素材
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	16	16	30	486	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	6	6	17	273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	—	24	30	488	各種金融
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	—	8	17	272	ソフトウェア・サービス
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	6	6	42	672	食品・飲料・タバコ
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	—	19	27	433	半導体・半導体製造装置
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	2	11	153	2,456	素材
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	—	5	25	413	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	18	—	—	—	素材
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1	18	44	710	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	—	25	21	346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	17	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	22	22	35	575	素材
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	9	9	32	515	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	3	3	55	882	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOYOUNG CO LTD -A	—	6	19	313	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	
(中国オフショア)	百株	百株	千オフショア人民元	千円	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	13	13	36	578	資本財
HUAGONG TECH CO LTD-A	—	10	24	390	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	—	4	14	231	ソフトウェア・サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	1	4	186	2,988	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	29	76	1,231	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	10	10	18	292	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	19	14	236	運輸
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	5	13	120	1,927	メディア・娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	—	10	19	314	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	7	7	16	265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YINTAI GOLD CO LTD-A	17	23	18	303	素材
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	6	6	2	41	保険
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	11	11	15	249	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	26	4	11	176	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	12	18	95	1,527	素材
GEM CO LTD-A	35	35	30	484	素材
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	—	3	44	714	ソフトウェア・サービス
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	6	6	23	372	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	—	30	19	310	メディア・娯楽
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	—	15	148	2,371	資本財
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	8	13	65	1,049	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	—	22	9	157	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	28	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1	1	4	65	耐久消費財・アパレル
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	31	31	25	401	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	17	17	72	1,166	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	—	—	—	素材
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	10	10	27	442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEO GROUP CO LTD-A	—	41	12	201	メディア・娯楽
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	9	9	70	1,126	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	9	9	25	400	食品・飲料・タバコ
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	11	2	8	134	ヘルスケア機器・サービス
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	6	6	26	426	資本財
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	20	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	14	14	70	1,128	資本財
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	20	7	13	212	ソフトウェア・サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	20	7	12	193	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	13	13	80	1,283	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	10	10	42	675	資本財
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	30	30	37	603	資本財
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	9	—	—	—	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	5	15	244	ヘルスケア機器・サービス
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	20	—	—	—	自動車・自動車部品
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	1	1	2	36	自動車・自動車部品
VENUSTECH GROUP INC-A	15	4	12	202	ソフトウェア・サービス
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	20	—	—	—	小売
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	25	—	—	—	公益事業
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	12	29	241	3,856	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	5	13	213	3,411	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	
GLODON CO LTD-A	18	5	45	730	ソフトウェア・サービス
BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	20	—	—	—	素材
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	11	11	20	327	食品・飲料・タバコ
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	27	—	—	—	不動産
WESTONE INFORMATION INDUST-A	8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	4	5	2	45	エネルギー
ADDSINO CO LTD -A	—	17	43	701	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	27	—	—	—	メディア・娯楽
TIANQI LITHIUM CORP-A	2	—	—	—	素材
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	26	26	47	752	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	24	24	17	275	食品・飲料・タバコ
TIANMA MICROELECTRONICS-A	3	3	5	80	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	13	13	7	117	素材
YANGO GROUP CO LTD-A	34	34	22	352	不動産
NAVINFO CO LTD-A	35	9	14	237	耐久消費財・アパレル
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	9	9	16	256	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	13	33	540	家庭用品・パーソナル用品
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	—	6	25	404	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	7	7	5	80	不動産
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	32	10	15	240	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	2	2	3	60	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	7	40	641	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	4	34	123	1,972	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	1	1	2	42	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	5	65	1,055	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	12	6	17	280	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAHOE GROUP CO LTD-A	21	—	—	—	不動産
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	10	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	21	346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	4	4	4	76	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	33	—	—	—	素材
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	48	48	17	285	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	11	35	284	4,546	ヘルスケア機器・サービス
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	12	—	—	—	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	7	28	457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	5	—	—	—	素材
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	2	—	—	—	商業・専門サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-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
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	7	7	20	335	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	11	11	6	98	資本財
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	6	6	24	390	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	58	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	50	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	55	耐久消費財・アパレル
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	2	2	7	112	ヘルスケア機器・サービス
CITIC GUOAN INFORMATION-A	5	—	—	—	メディア・娯楽
YANTAI JEREH OILFIELD-A	9	9	41	669	エネルギー
TONGLING NONFERROUS METALS-A	15	15	3	60	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 2345 NETWORK HOLD-A	7	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	4	4	2	39	不動産
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	2	9	29	476	メディア・娯楽
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	10	10	24	384	資本財
BOHAI LEASING CO LTD-A	100	—	—	—	資本財
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	5	10	239	3,825	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	7	18	177	2,845	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	5	5	5	80	食品・飲料・タバコ
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	30	30	27	444	各種金融
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	23	23	71	1,140	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	6	10	16	264	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	1	1	3	50	ソフトウェア・サービス
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	100	25	13	213	各種金融
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	6	6	3	61	不動産
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	—	8	18	293	メディア・娯楽
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	9	9	5	95	ソフトウェア・サービス
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	—	19	20	327	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	2	5	64	1,034	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	6	—	—	—	公益事業
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	5	6	3	55	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	54	13	16	259	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	30	55	318	5,089	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	52	資本財
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	4	4	3	49	各種金融
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	17	121	140	2,255	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	26	26	56	906	食品・飲料・タバコ
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	4	—	—	—	自動車・自動車部品
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	—	51	14	232	不動産
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	4	24	59	951	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	4	4	3	51	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	3	10	51	829	ソフトウェア・サービス
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	13	13	16	266	資本財
HESTEEL CO LTD-A	15	15	3	51	素材
GOERTEK INC -A	5	20	81	1,310	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	66	各種金融
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	26	26	19	309	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	34	50	188	3,023	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	13	46	166	2,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	19	62	61	986	耐久消費財・アパレル
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	12	12	3	59	各種金融
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	8	68	54	873	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	11	11	7	120	消費者サービス
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	5	43	86	1,385	自動車・自動車部品
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	5	5	5	86	各種金融
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	4	24	117	1,874	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	11	11	152	2,442	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	4	25	88	1,419	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	27	84	331	5,301	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	7	14	269	4,319	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	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	28	32	945	15,132	食品・飲料・タバコ
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	38	—	—	—	メディア・娯楽
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	—	29	22	365	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNING.COM CO LTD-A	33	33	24	387	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	205	343	244	3,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	65	36	46	737	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	72	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	6	46	59	949	各種金融
PING AN BANK CO LTD-A	102	131	288	4,617	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	42	56	102	1,637	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	152	152	75	1,211	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	55	89	260	4,166	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	2	—	—	—	資本財
ZTE CORP-A	13	27	91	1,463	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	9	64	74	1,197	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	8	59	113	1,820	資本財
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	5	5	21	336	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	59	99	1,589	各種金融
ANGANG STEEL CO LTD-A	7	—	—	—	素材
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	4	4	6	107	資本財
BYD CO LTD -A	2	16	388	6,218	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	52	25	29	467	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	—	7	80	1,294	素材
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	11	11	12	196	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	—	6	56	911	素材
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	—	7	15	246	不動産
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	17	17	71	1,141	素材
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	52	11	10	167	メディア・娯楽
STO EXPRESS CO LTD-A	—	34	31	500	運輸
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	—	22	60	969	素材
CHACHA FOOD CO LTD-A	—	4	25	408	食品・飲料・タバコ
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	—	9	22	361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	13	13	22	367	資本財
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	4	2	44	707	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	20	20	33	538	食品・飲料・タバコ
EAST GROUP CO LTD-A	—	30	21	347	資本財
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	—	8	23	368	半導体・半導体製造装置
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	35	35	16	262	素材
PERFECT WORLD CO LTD-A	1	13	36	591	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	3	3	69	1,118	食品・飲料・タバコ
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	23	23	14	225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	15	19	28	456	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	—	9	40	648	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	9	3	23	381	耐久消費財・アパレル
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	—	10	53	848	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NINESTAR CORP-A	1	1	2	47	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	21	—	—	—	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	9	11	19	318	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	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	43	43	17	280	半導体・半導体製造装置
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	2	2	3	57	メディア・娯楽
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	4	4	39	627	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	3	3	42	686	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	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	2	2	67	1,084	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	7	113	ヘルスケア機器・サービス
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	—	9	18	302	資本財
S F HOLDING CO LTD-A	2	35	351	5,621	運輸
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	—	4	69	1,114	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	5	5	4	65	各種金融
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	8	8	40	649	素材
XIAMEN INTRETECH INC-A	—	3	20	329	耐久消費財・アパレル
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	37	37	22	359	エネルギー
CHONGQING FULING ZHACAI-A	7	7	34	547	食品・飲料・タバコ
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	5	3	25	402	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	6	6	84	1,358	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	—	5	53	860	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	5	5	28	448	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C&S PAPER CO LTD-A	—	10	24	394	家庭用品・パーソナル用品
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	3	2	34	559	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	4	4	29	476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	—	3	28	456	ヘルスケア機器・サービス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	7	3	32	514	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	3	3	53	854	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	4	38	614	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	3	6	101	1,630	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	7	334	5,355	ヘルスケア機器・サービス
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	—	10	37	598	消費者サービス
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	—	5	18	295	素材
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	3	3	3	51	各種金融
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	5	1	31	504	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	9	3	34	546	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	—	1	33	528	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	18	19	775	12,403	資本財
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	—	2	133	2,140	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	—	8	24	392	ソフトウェア・サービス
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	72	72	14	238	素材
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	—	30	36	578	各種金融
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	—	3	85	1,364	ヘルスケア機器・サービス
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	—	12	49	792	半導体・半導体製造装置
小計 株数・金額	11,679	13,193	31,461	503,384	
小計 銘柄数<比率>	461	448	—	<3.6%>	
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	317	375	76,960	110,053	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	73	85	3,405	4,869	エネルギー
EICHER MOTORS LTD	1	—	—	—	自動車・自動車部品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	85	107	8,601	12,299	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	0.99	1	3,554	5,082	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)	百株	百株	千インドルピー	千円	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	71	81	1,828	2,614	エネルギー
LIC HOUSING FINANCE LTD	35	－	－	－	銀行
TATA STEEL LTD	34	92	5,977	8,548	素材
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	－	81	4,768	6,818	食品・飲料・タバコ
NESTLE INDIA LTD	2	4	7,950	11,369	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	149	244	3,280	4,690	公益事業
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	－	73	13,441	19,221	銀行
VEDANTA LTD	211	199	3,308	4,731	素材
TITAN CO LTD	35	47	7,117	10,178	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	276	264	2,456	3,513	エネルギー
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	7	16	2,560	3,662	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	26	23	2,550	3,646	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACC LTD	－	11	1,872	2,678	素材
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	183	224	58,076	83,048	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	80	93	2,043	2,921	メディア・娯楽
INFOSYS LTD	377	449	60,222	86,118	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	130	142	6,355	9,087	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	－	0.27	2,492	3,563	自動車・自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	207	244	2,342	3,349	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	73	108	26,148	37,392	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	－	13	3,377	4,829	ヘルスケア機器・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	122	144	14,276	20,415	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	61	71	3,835	5,484	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	11	16	5,443	7,784	自動車・自動車部品
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	－	12	2,039	2,916	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	13	14	7,409	10,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IPCA LABORATORIES LTD	－	10	2,046	2,926	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	273	153	8,832	12,630	電気通信サービス
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	96	108	6,266	8,961	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	18	6,678	9,549	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	11	18	14,504	20,740	自動車・自動車部品
AUROBINDO PHARMA LTD	25	37	3,418	4,887	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	－	59	2,350	3,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	113	128	2,003	2,864	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	20	27	3,149	4,503	各種金融
PETRONET LNG LTD	66	78	1,901	2,718	エネルギー
CIPLA LTD	33	62	5,066	7,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	53	94	12,938	18,502	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	11	14	7,892	11,286	素材
ASHOK LEYLAND LTD	139	－	－	－	資本財
BOSCH LTD	0.73	－	－	－	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	101	123	40,918	58,513	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	270	636	5,990	8,566	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	8	11	1,781	2,548	各種金融
AMBUJA CEMENTS LTD	73	77	1,994	2,852	素材
BHARAT FORGE LTD	25	30	1,907	2,727	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	111	215	5,149	7,363	素材
ITC LTD	386	395	8,332	11,914	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	14	21	3,694	5,282	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)	百株	百株	千インドルピー	千円	
UPL LTD	60	53	3,018	4,316	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	－	4	1,291	1,846	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS LTD	7	7	1,274	1,822	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	6	9	5,149	7,364	メディア・娯楽
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	41	53	4,250	6,078	家庭用品・パーソナル用品
MARICO LTD	45	70	2,972	4,250	家庭用品・パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	0.54	0.54	1,584	2,266	耐久消費財・アパレル
DLF LTD	64	92	2,480	3,546	不動産
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	208	291	5,654	8,085	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	69	66	3,574	5,112	運輸
REC LTD	70	140	1,961	2,804	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	4	5	4,725	6,758	保険
BAJAJ AUTO LTD	9	8	3,602	5,152	自動車・自動車部品
JUBILANT FOODWORKS LTD	－	11	3,078	4,402	消費者サービス
MUTHOOT FINANCE LTD	－	18	2,114	3,023	各種金融
COAL INDIA LTD	132	161	2,144	3,066	エネルギー
TATA MOTORS LTD	183	229	6,652	9,512	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	140	－	－	－	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	38	－	－	－	各種金融
INDUS TOWERS LTD	24	24	579	828	電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	－	11	2,551	3,648	素材
ASIAN PAINTS LTD	32	51	13,318	19,045	素材
BAJAJ FINANCE LTD	19	36	18,323	26,203	各種金融
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	－	7	2,939	4,203	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	－	56	5,867	8,391	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	－	47	2,519	3,602	公益事業
TRENT LTD	－	25	1,678	2,400	小売
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	50	87	6,013	8,599	保険
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	4	7	2,201	3,148	各種金融
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	24	41	1,760	2,518	運輸
BANDHAN BANK LTD	44	98	3,108	4,444	銀行
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	6	14	5,282	7,553	食品・飲料・タバコ
YES BANK LTD	－	1,414	2,405	3,439	銀行
EICHER MOTORS LTD	－	18	5,466	7,817	自動車・自動車部品
AXIS BANK LTD	235	299	19,314	27,619	銀行
HAVELLS INDIA LTD	29	27	3,120	4,462	資本財
STATE BANK OF INDIA	202	222	6,298	9,006	銀行
ICICI BANK LTD	530	673	35,925	51,373	銀行
BERGER PAINTS INDIA LTD	25	26	2,041	2,918	素材
TECH MAHINDRA LTD	52	84	8,304	11,875	ソフトウェア・サービス
GRASIM INDUSTRIES LTD	33	32	3,244	4,640	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	11	20	5,731	8,195	食品・生活必需品小売り
UNITED SPIRITS LTD	33	30	1,911	2,733	食品・飲料・タバコ
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	16	25	3,721	5,321	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	37	37	1,870	2,674	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	8	12	2,133	3,050	運輸
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	38	49	4,305	6,157	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	
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
JSW STEEL LTD		79	93	3,493	4,995	素材
小計	株数・金額	7,058	10,375	721,477	1,031,712	
	銘柄数<比率>	84	96	—	<7.4%>	
(クウェート)				千ｸｳｪｰﾄﾃﾞｨﾅｰﾙ		
KUWAIT FINANCE HOUSE		—	552	38	13,400	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO		—	283	17	6,165	電気通信サービス
GULF BANK		—	197	4	1,497	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT		—	853	73	25,234	銀行
AGILITY		—	170	12	4,442	運輸
MABANEE CO KPSC		—	73	5	1,791	不動産
BOUBYAN BANK K.S.C		—	137	7	2,725	銀行
小計	株数・金額	—	2,268	160	55,256	
	銘柄数<比率>	—	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	36	234	6,498	素材
JARIR MARKETING CO		6	6	104	2,887	小売
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE		6	6	51	1,422	保険
ETIHAD ETISALAT CO		42	55	162	4,513	電気通信サービス
SAUDI BRITISH BANK		80	89	242	6,721	銀行
AL RAJHI BANK		138	164	1,206	33,450	銀行
ARAB NATIONAL BANK		67	87	177	4,925	銀行
BANK ALBILAD		42	53	152	4,217	銀行
BANK AL-JAZIRA		35	53	72	2,013	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI		62	75	254	7,062	銀行
RIYAD BANK		136	166	351	9,748	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP		111	136	430	11,933	銀行
SAUDI TELECOM CO		44	81	894	24,798	電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO		18	25	233	6,461	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		84	120	1,238	34,346	素材
SAUDI CEMENT		8	12	81	2,266	素材
SAUDI ELECTRICITY CO		94	123	280	7,786	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP		25	29	78	2,171	素材
SAVOLA		29	33	134	3,738	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C		37	37	50	1,405	素材
ALMARAI CO		28	31	171	4,759	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY		42	42	38	1,074	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH		35	35	63	1,756	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO		12	11	74	2,063	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		80	81	116	3,231	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV		59	39	33	942	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE		30	16	23	639	エネルギー
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO		—	52	70	1,963	電気通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE		2	8	92	2,564	保険
ALINMA BANK		84	123	202	5,610	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS		—	4	50	1,407	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO		48	54	228	6,339	素材
SAUDI AIRLINES CATERING CO		4	4	32	898	消費者サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO		114	296	1,034	28,691	エネルギー
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL		—	7	90	2,506	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	
(サウジアラビア)		百株	百株	ｻｳｼﾞｱﾗﾋﾞｱﾘｱﾙ	千円	
NATIONAL COMMERCIAL BANK		135	199	887	24,616	銀行
小計	株数・金額	1,772	2,404	9,644	267,435	
	銘柄数＜比率＞	33	36	—	＜1.9%＞	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR INSURANCE CO		113	—	—	—	保険
QATAR NATIONAL BANK		511	601	1,087	30,984	銀行
COMMERCIAL BANK PQSC		224	217	95	2,724	銀行
OOREDOO QPSC		94	124	104	2,978	電気通信サービス
QATAR FUEL QSC		54	64	121	3,472	エネルギー
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		64	80	146	4,185	公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC		84	93	83	2,390	銀行
INDUSTRIES QATAR		210	239	286	8,172	資本財
QATAR ISLAMIC BANK		120	159	270	7,710	銀行
QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)		—	370	128	3,661	エネルギー
MASRAF AL RAYAN		432	449	198	5,643	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		214	247	84	2,405	不動産
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI		486	486	99	2,836	素材
小計	株数・金額	2,608	3,133	2,709	77,166	
	銘柄数＜比率＞	12	12	—	＜0.6%＞	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD		—	16	472	3,233	素材
BIDVEST GROUP LTD		33	41	657	4,503	資本財
CLICKS GROUP LTD		29	34	907	6,216	食品・生活必需品小売り
DISCOVERY LTD		44	55	717	4,912	保険
GOLD FIELDS LTD		95	119	1,712	11,731	素材
REMGRO LTD		61	70	704	4,827	各種金融
THE FOSCHINI GROUP LTD		23	—	—	—	小売
NORTHAM PLATINUM LTD		38	49	1,034	7,087	素材
HARMONY GOLD MINING CO LTD		—	68	449	3,079	素材
EXXARO RESOURCES LTD		24	28	462	3,171	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		4	9	1,267	8,683	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD		8	—	—	—	保険
MTN GROUP LTD		191	207	1,336	9,157	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		47	56	1,921	13,162	素材
TELKOM SA SOC LTD		25	—	—	—	電気通信サービス
FIRSTRAND LTD		383	647	3,121	21,379	各種金融
PSG GROUP LTD		18	—	—	—	各種金融
NASPERS LTD-N SHS		48	57	20,421	139,888	小売
NEDBANK GROUP LTD		39	52	643	4,410	銀行
PICK N PAY STORES LTD		41	—	—	—	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD		91	—	—	—	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD		6	6	1,100	7,535	素材
SASOL LTD		63	70	1,133	7,762	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD		53	65	890	6,101	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD		142	173	2,161	14,804	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE		22	25	492	3,373	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		95	129	522	3,579	小売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		45	51	750	5,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIGER BRANDS LTD		15	20	422	2,893	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	
(南アフリカ)		百株	百株	千南アフリカランド	千円	
SANLAM LTD		212	219	1,273	8,722	保険
INVESTEC LTD		36	－	－	－	各種金融
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		87	108	2,347	16,081	素材
KUMBA IRON ORE LTD		7	7	475	3,258	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		127	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
VODACOM GROUP LTD		72	79	983	6,740	電気通信サービス
SIBANYE GOLD LTD		248	－	－	－	素材
NEPI ROCKCASTLE PLC		43	59	540	3,703	不動産
OLD MUTUAL LTD		547	591	760	5,212	保険
REINET INVESTMENTS SCA		17	22	633	4,341	各種金融
ABSA GROUP LTD		76	98	1,126	7,719	銀行
PEPKOR HOLDINGS LTD		99	－	－	－	小売
MULTICHOICE GROUP LTD		49	61	797	5,463	メディア・娯楽
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED		100	－	－	－	保険
SIBANYE STILLWATER LTD		－	279	1,750	11,990	素材
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL		85	100	302	2,071	保険
MR PRICE GROUP LTD		24	28	474	3,247	小売
BID CORP LTD		37	43	1,172	8,029	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	3,572	3,757	55,944	383,219	
	銘柄数＜比率＞	44	36	－	＜2.8%＞	
(アラブ首長国連邦)				千アラブディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK		199	204	103	2,917	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC		403	491	193	5,486	不動産
EMIRATES NBD PJSC		－	349	403	11,422	銀行
EMAAR MALLS PJSC		306	306	58	1,650	不動産
ABU DHABI ISLAMIC BANK		－	203	102	2,896	銀行
EMIRATES TELECOM GROUP CO		184	212	414	11,735	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		296	337	223	6,328	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		310	373	558	15,815	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC		450	510	177	5,027	不動産
小計	株数・金額	2,150	2,988	2,234	63,281	
	銘柄数＜比率＞	7	9	－	＜0.5%＞	
合計	株数・金額	298,329	319,407	－	11,503,556	
	銘柄数＜比率＞	1,375	1,352	－	＜83.0%＞	

(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	
(メキシコ)		口	口	千メキシコペソ	千円	%
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		35,500	45,800	1,006	5,244	0.0
小計	口数・金額	35,500	45,800	1,006	5,244	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		33,820	48,594	584	4,001	0.0
FORTRESS REIT LTD-A		12,100	－	－	－	－
REDEFINE PROPERTIES LTD		62,770	－	－	－	－
小計	口数・金額	108,690	48,594	584	4,001	
	銘柄数<比率>	3	1	－	<0.0%>	
合計	口数・金額	144,190	94,394	－	9,245	
	銘柄数<比率>	4	2	－	<0.1%>	

(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
外国	株式先物取引	MSCIEMG 2103	百万円 2,325	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

（2021年１月25日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	11,503,556	82.8
投資証券	9,245	0.1
コール・ローン等、その他	2,379,341	17.1
投資信託財産総額	13,892,142	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（13,824,217千円）の投資信託財産総額（13,892,142千円）に対する比率は99.5%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=103.84円、1メキシコペソ=5.21円、1ブラジルレアル=18.98円、1チリペソ=0.1426円、1コロンビアペソ=0.0295円、1ユーロ=126.37円、1英ポンド=142.11円、1トルコリラ=14.01円、1チェココルナ=4.84円、1ハンガリーフォリント=0.3535円、1ポーランドズロチ=27.84円、1香港ドル=13.40円、1マレーシアリンギット=25.66円、1タイバーツ=3.46円、1フィリピンペソ=2.16円、1インドネシアルピア=0.0074円、1韓国ウォン=0.0942円、1新台湾ドル=3.71円、1オフショア人民元=16.00円、1インドルピー=1.43円、1クウェートディナール=343.84円、1サウジアラビアリアル=27.73円、1カタールリアル=28.48円、1南アフリカランド=6.85円、1アラブディルハム=28.32円。

○特定資産の価格等の調査

（2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	13,892,058,912
コール・ローン等	1,222,072,879
株式(評価額)	11,503,556,613
投資証券(評価額)	9,245,907
未収入金	207,484,600
未収配当金	2,070,130
差入委託証拠金	947,628,783
(B) 負債	35,640,813
未払金	72,629
未払解約金	35,568,000
未払利息	183
その他未払費用	1
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	13,856,418,099
元本	8,352,954,743
次期繰越損益金	5,503,463,356
(D) 受益権総口数	8,352,954,743口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	16,589円

(注) 当ファンドの期首元本額は7,682,410,355円、期中追加設定元本額は7,723,340,015円、期中一部解約元本額は7,052,795,627円です。

(注) 2021年１月25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	2,140,237,769円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	1,130,924,356円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	968,977,413円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	957,416,691円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	515,406,963円
・つみたてバランスファンド	357,193,819円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	338,419,501円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	331,999,735円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	296,238,342円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	295,856,310円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	197,492,813円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	153,540,142円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	117,869,840円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	116,502,402円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	103,545,348円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	91,586,088円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	87,528,566円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	49,372,789円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	39,522,240円
・ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	13,968,701円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,141,960円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	9,063,086円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	8,925,591円
・リスクコントロール・オープン	6,667,110円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	6,111,418円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	4,454,328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）	991,422円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.6589円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	142,226,113
受取配当金	135,102,713
受取利息	7,207,142
その他収益金	2,310
支払利息	△　86,052
(B) 有価証券売買損益	1,146,233,051
売買益	2,842,308,645
売買損	△1,696,075,594
(C) 先物取引等取引損益	611,487,312
取引益	1,293,489,127
取引損	△　682,001,815
(D) 保管費用等	△　29,056,293
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	1,870,890,183
(F) 前期繰越損益金	2,959,902,287
(G) 追加信託差損益金	2,053,976,985
(H) 解約差損益金	△1,381,306,099
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	5,503,463,356
次期繰越損益金(Ｉ)	5,503,463,356

(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５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
5期(2021年1月25日)	10,776	△ 4.5	33,073.13	△ 3.3	98.2	5,087

（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	%		%	%
2020年1月27日	11,280	－	34,193.00	－	98.4
1月末	11,176	△ 0.9	33,847.00	△ 1.0	97.9
2月末	10,938	△ 3.0	33,243.73	△ 2.8	99.8
3月末	9,411	△16.6	28,753.19	△15.9	99.3
4月末	9,607	△14.8	29,315.06	△14.3	99.2
5月末	10,209	△ 9.5	31,237.36	△ 8.6	98.2
6月末	10,293	△ 8.8	31,553.01	△ 7.7	99.3
7月末	10,294	△ 8.7	31,502.50	△ 7.9	97.7
8月末	10,346	△ 8.3	31,592.84	△ 7.6	99.2
9月末	10,101	△10.5	30,913.68	△ 9.6	99.2
10月末	10,053	△10.9	30,873.65	△ 9.7	99.2
11月末	10,592	△ 6.1	32,444.02	△ 5.1	99.6
12月末	10,886	△ 3.5	33,305.11	△ 2.6	99.5
（期末）					
2021年1月25日	10,776	△ 4.5	33,073.13	△ 3.3	98.2

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2020年１月28日～2021年１月25日）

期中の基準価額等の推移

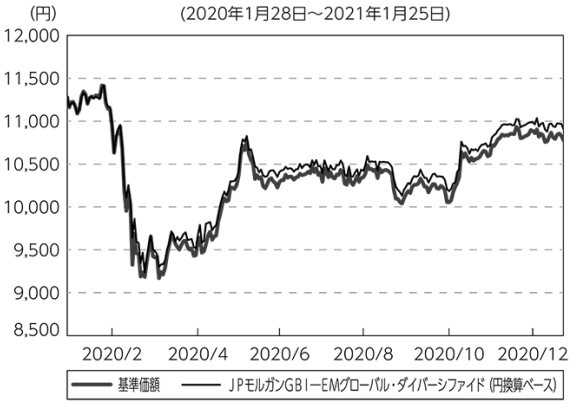
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末11,280円から当期末10,776円となり、504円の値下がりとなりました。

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））の下落により、基準価額は下落しました。

主に、新興国の債券価格よりも為替市況が下落したことが影響しました。

基準価額等の推移
（2020年1月28日～2021年1月25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

新興国の長期金利は前期末と比較して多くの国で低下（債券価格は上昇）しました。2020年３月には新型肺炎問題に伴い先行きの不透明感が高まったことから、経済基盤が脆弱な国からの資金流出が加速し新興国金利は上昇しました。その後は、経済基盤の脆弱性から一部地域で国債格付が引き下げられるなどありましたが、各国の大規模な政策支援措置等を受けて金融市場は落ち着きを取り戻し、新興国の長期金利は低下基調に転じました。新興国各国の中央銀行による政策金利引下げが相次いだことも新興国金利の低下要因となりました。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円高、ユーロに対して円安となりました。

米ドルに対しては、2020年３月には新型肺炎問題に伴う不確実性の高まりを受けて、投資家のリスク回避の動きに代表される円高圧力と企業等の米ドルを確保する動き等の円安圧力が交錯し、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、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による強力な金融緩和策の継続や追加経済対策に伴う財政赤字拡大観測から米ドル安（円高）基調で推移しました。

ユーロに対しては、米ドル安が進行したほかＥＵ（欧州連合）復興基金の創設合意などを背景に欧州地域の景気回復期待が高まり、対円でのユーロ高が進行しました。

新興国通貨は前期末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。新型肺炎問題に伴う不確実性の高まりから投資家のリスク回避の動きが強まり、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一部の新興国通貨では買戻しが進んだ一方、経済的な脆弱性から対米ドルで最安値を更新する新興国通貨も散見され、新興国への資金流入は地域ごとにまちまちとなりました。

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。

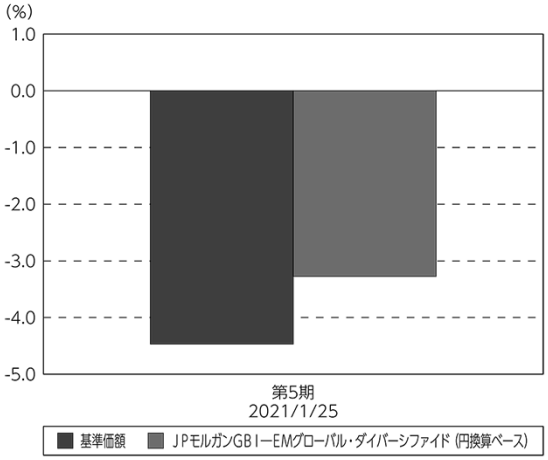
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は－4.5%となり、ベンチマークの－3.3%を1.2%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

（2020年１月28日～2021年１月25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	6	0.054	(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）	(6)	(0.054)	
(b) 有価証券取引税	0	0.001	(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)	(0.001)	
(c) その他費用	2	0.017	(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)	(0.017)	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)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	8	0.072	
期中の平均基準価額は、10,325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

（2020年１月28日～2021年１月25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	364,175	11,464	656,337	20,345
	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	419,330	23,600	340,408	17,805
	小計	783,505	35,064	996,745	38,150

（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

（2020年１月28日～2021年１月25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（2020年１月28日～2021年１月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2021年１月25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		733,834	441,672	14,473	1,502,937	29.5
ISHARES JPM EM LCL GOV BND		498,965	577,887	33,633	3,492,453	68.6
合計	口数・金額	1,232,799	1,019,559	48,106	4,995,390	
	銘柄数＜比率＞	2	2	－	＜98.2%＞	

（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。

○投資信託財産の構成

（2021年１月25日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	4,995,390	97.8
コール・ローン等、その他	111,235	2.2
投資信託財産総額	5,106,625	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（5,067,172千円）の投資信託財産総額（5,106,625千円）に対する比率は99.2%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=103.84円。

○特定資産の価格等の調査

（2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,106,625,278
コール・ローン等	40,716,015
投資信託受益証券(評価額)	4,995,390,884
未収配当金	70,518,379
(B) 負債	19,067,535
未払金	17,081,475
未払解約金	1,986,000
未払利息	60
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	5,087,557,743
元本	4,721,029,528
次期繰越損益金	366,528,215
(D) 受益権総口数	4,721,029,528口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,776円

(注) 当ファンドの期首元本額は5,408,384,361円、期中追加設定元本額は4,205,922,121円、期中一部解約元本額は4,893,276,954円です。

(注) 2021年１月25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	925,299,667円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	772,759,480円
・つみたてバランスファンド	522,388,167円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	504,162,479円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	270,988,402円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	253,878,992円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	253,345,286円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	224,163,228円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	220,542,906円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	147,845,826円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	112,236,934円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	88,202,265円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	85,679,303円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	85,223,520円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	68,246,174円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	66,015,174円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	38,589,960円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	37,396,892円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	13,377,485円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	9,774,670円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	7,092,820円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	4,982,575円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	3,437,276円
・リスクコントロール・オープン	2,444,188円
・ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	2,180,500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）	775,359円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.0776円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	225,740,790
受取配当金	225,723,310
受取利息	70,450
支払利息	△　52,970
(B) 有価証券売買損益	△622,935,732
売買益	42,866,107
売買損	△665,801,839
(C) 保管費用等	△　797,775
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△397,992,717
(E) 前期繰越損益金	692,336,569
(F) 追加信託差損益金	145,367,879
(G) 解約差損益金	△　73,183,516
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	366,528,215
次期繰越損益金(Ｈ)	366,528,215

(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５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
5期(2021年1月25日)	12,646	△14.5	3,887.39	△14.3	2.3	95.2	24,302

（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	%		%	%	%
2020年1月27日	14,787	－	4,533.90	－	2.1	97.8
1月末	15,032	1.7	4,608.85	1.7	2.4	97.6
2月末	13,755	△ 7.0	4,218.40	△ 7.0	2.7	98.3
3月末	10,877	△26.4	3,343.59	△26.3	2.8	97.6
4月末	10,779	△27.1	3,313.25	△26.9	2.6	97.2
5月末	11,666	△21.1	3,586.37	△20.9	2.7	96.2
6月末	11,469	△22.4	3,525.99	△22.2	2.5	97.5
7月末	11,500	△22.2	3,535.10	△22.0	2.3	97.7
8月末	12,149	△17.8	3,735.15	△17.6	2.3	97.7
9月末	12,032	△18.6	3,698.94	△18.4	3.0	97.0
10月末	11,426	△22.7	3,512.43	△22.5	2.3	97.1
11月末	11,827	△20.0	3,635.82	△19.8	2.7	97.2
12月末	12,538	△15.2	3,854.76	△15.0	2.8	97.2
（期末）						
2021年1月25日	12,646	△14.5	3,887.39	△14.3	2.3	95.2

（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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

期中の基準価額等の推移

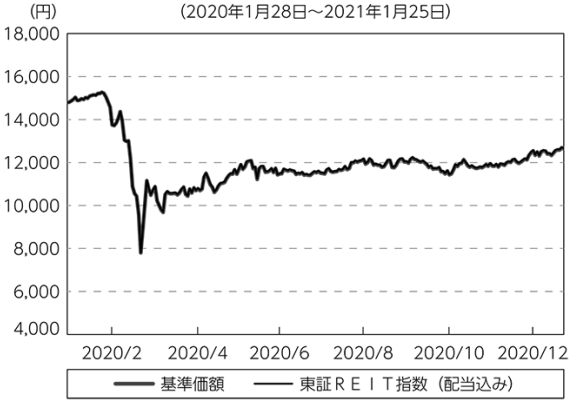
○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末14,787円から当期末12,646円となり、2,141円の値下がりとなりました。

国内リートの市況（東証ＲＥＩＴ指数（配当込み））の下落により、基準価額は下落しました。

基準価額等の推移

（2020年1月28日～2021年1月25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下落しました。新型肺炎問題に伴う中長期的な収益見通しの不透明感が嫌気され、国内リート市場は一時大幅下落しました。その後、政策当局による大規模な財政・金融支援策に対する期待等から上昇に転じましたが、新型肺炎問題の収束見通しが立たないことから収益環境に対する構造的な逆風が意識され、国内株式市場に比べ上昇ペースは不芳なものとなり、期初水準の回復には至りませんでした。

当ファンドのポートフォリオ

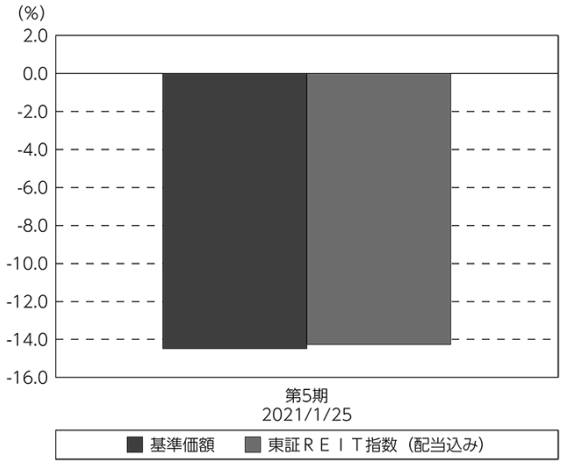
国内の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（用途別の比率など）をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。不動産投資信託証券の組入比率は期を通じて高位に維持しました。

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－14.5%となり、ベンチマークの－14.3%を0.2%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

（2020年１月28日～2021年１月25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	1	0.006	(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)	(0.004)	
（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	1	0.006	
期中の平均基準価額は、12,087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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	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	362	40,886	191	19,994
	サンケイリアルエステート投資法人	536	51,909	261	25,534
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	955	118,838	324	37,951
	日本アコモデーションファンド投資法人	582	347,279	470	273,281
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2,050	179,191	1,873	155,097
	森ヒルズリート投資法人	1,972	284,282	1,628	223,567
	産業ファンド投資法人	2,498	447,465	1,876	302,148
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,567	490,772	1,327	387,091
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,076	194,310	849	139,550
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	826	333,363	701	274,760
	ＧＬＰ投資法人	5,933	934,562	3,791	526,111
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	756	233,996	605	173,222
	日本プロロジスリート投資法人	2,646	838,727	2,105	628,888
	星野リゾート・リート投資法人	252	119,409	214	93,863
	Ｏｎｅリート投資法人	258	66,996	219	55,881
	イオンリート投資法人	1,717	211,822	1,605	181,659
	ヒューリックリート投資法人	1,358	196,345	1,256	173,598
	日本リート投資法人	537	190,365	456	160,486
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	10,595	158,296	8,996	138,482
	日本ヘルスケア投資法人	11 (△ 82)	2,170 (△ 17,462)	33	5,828
	積水ハウス・リート投資法人	4,858	356,059	4,088	289,390
	トーセイ・リート投資法人	370	40,370	307	32,461
	ケネディクス商業リート投資法人	617	136,648	565	112,203
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	351	43,849	298	34,745
	サムティ・レジデンシャル投資法人	324	33,308	293	27,644
	野村不動産マスターファンド投資法人	5,343	774,049	4,526	610,809
	いちごホテルリート投資法人	299	20,799	235	16,595
	ラサールロジポート投資法人	2,083	347,456	1,408	212,249
	スターアジア不動産投資法人	1,222 (1,450)	68,678 (39,518)	920	53,070
	マリモ地方創生リート投資法人	157	16,883	144	14,437
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	723	362,124	415	193,283
	大江戸温泉リート投資法人	272	18,401	251	16,430
	さくら総合リート投資法人	147 (△ 436)	11,594 (△ 39,518)	176	12,327
	投資法人みらい	1,821	72,557	1,675	66,192
	森トラスト・ホテルリート投資法人	368	39,718	353	36,258
	三菱地所物流リート投資法人	408	164,845	291	108,668

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国内	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	681	102,790	317	42,927
	ザイマックス・リート投資法人	267	25,842	211	20,329
	タカラレーベン不動産投資法人	518	47,302	408	36,249
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	968	133,521	370	44,939
	日本ビルファンド投資法人	1,992	1,228,417	1,374	900,080
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,649	986,265	1,400	849,119
	日本リテールファンド投資法人	3,108	521,888	2,665	425,406
	オリックス不動産投資法人	3,287	531,695	2,791	444,036
	日本プライムリアルティ投資法人	1,081	374,555	949	320,189
	プレミア投資法人	1,487	181,462	1,262	149,374
	東急リアル・エステート投資法人	1,105	171,532	938	139,763
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,144	117,467	971	98,099
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,603	455,471	3,300	406,293
	森トラスト総合リート投資法人	1,180	159,737	1,003	138,477
	インヴィンシブル投資法人	7,038	231,452	6,438	206,018
	フロンティア不動産投資法人	564	207,638	531	183,114
	平和不動産リート投資法人	1,021	118,966	888	98,053
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,076	312,252	914	240,199
	福岡リート投資法人	853	119,350	725	95,029
	ケネディクス・オフィス投資法人	512	330,967	435	275,472
	いちごオフィスリート投資法人	1,442	109,467	1,117	86,757
	大和証券オフィス投資法人	362	230,594	348	217,044
	阪急阪神リート投資法人	747	95,086	635	79,671
	スターツプロシード投資法人	256	50,073	217	40,689
	大和ハウスリート投資法人	2,345	614,566	1,820	451,762
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,316	266,541	4,514	216,819
	大和証券リビング投資法人	2,228 (168)	214,702 (17,462)	1,682	157,670
	ジャパンエクセレント投資法人	1,534	196,631	1,297	166,092
合計		103,214 (1,100)	16,084,582 (－)	84,245	12,343,454

(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	3,066	2,927	－	－

○利害関係人との取引状況等

（2020年１月28日～2021年１月25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（2020年１月28日～2021年１月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2021年１月25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	392	48,490	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	312	587	59,580	0.2
ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	－	631	79,758	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人	715	827	459,812	1.9
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2,760	2,937	277,252	1.1
森ヒルズリート投資法人	2,475	2,819	413,265	1.7
産業ファンド投資法人	2,771	3,393	654,849	2.7
アドバンス・レジデンス投資法人	2,040	2,280	695,400	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,339	1,566	285,168	1.2
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,078	1,203	501,651	2.1
ＧＬＰ投資法人	5,358	7,500	1,278,750	5.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	896	1,047	308,027	1.3
日本プロロジスリート投資法人	3,091	3,632	1,211,272	5.0
星野リゾート・リート投資法人	327	365	188,340	0.8
Ｏｎｅリート投資法人	335	374	97,464	0.4
イオンリート投資法人	2,322	2,434	333,701	1.4
ヒューリックリート投資法人	1,830	1,932	296,175	1.2
日本リート投資法人	699	780	276,900	1.1
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13,821	15,420	220,197	0.9
日本ヘルスケア投資法人	104	－	－	－
積水ハウス・リート投資法人	6,290	7,060	521,734	2.1
トーセイ・リート投資法人	468	531	61,011	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	831	883	220,396	0.9
ヘルスケア＆メディカル投資法人	459	512	68,966	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	431	462	51,051	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	6,945	7,762	1,187,586	4.9
いちごホテルリート投資法人	356	420	28,728	0.1
ラサールロジポート投資法人	2,000	2,675	439,235	1.8
スターアジア不動産投資法人	714	2,466	121,080	0.5
マリモ地方創生リート投資法人	212	225	25,380	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	530	838	444,140	1.8
大江戸温泉リート投資法人	366	387	26,548	0.1
さくら総合リート投資法人	465	－	－	－
投資法人みらい	2,446	2,592	103,550	0.4
森トラスト・ホテルリート投資法人	505	520	59,748	0.2
三菱地所物流リート投資法人	423	540	224,640	0.9
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	404	768	116,352	0.5
ザイマックス・リート投資法人	312	368	37,094	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	611	721	68,927	0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	333	931	121,216	0.5
日本ビルファンド投資法人	2,083	2,701	1,601,693	6.6
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,151	2,400	1,449,600	6.0

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
日本リテールファンド投資法人		4,066	4,509	848,142	3.5
オリックス不動産投資法人		4,286	4,782	807,679	3.3
日本プライムリアルティ投資法人		1,362	1,494	536,346	2.2
プレミア投資法人		1,943	2,168	275,986	1.1
東急リアル・エステート投資法人		1,442	1,609	265,163	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人		1,494	1,667	172,201	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人		4,830	5,133	686,795	2.8
森トラスト総合リート投資法人		1,538	1,715	228,609	0.9
インヴィンシブル投資法人		9,436	10,036	349,252	1.4
フロンティア不動産投資法人		764	797	329,559	1.4
平和不動産リート投資法人		1,340	1,473	192,079	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人		1,406	1,568	489,216	2.0
福岡リート投資法人		1,113	1,241	193,099	0.8
ケネディクス・オフィス投資法人		665	742	484,526	2.0
いちごオフィスリート投資法人		1,666	1,991	155,098	0.6
大和証券オフィス投資法人		497	511	333,172	1.4
阪急阪神リート投資法人		972	1,084	137,884	0.6
スターツプロシード投資法人		335	374	73,004	0.3
大和ハウスリート投資法人		2,900	3,425	924,065	3.8
ジャパン・ホテル・リート投資法人		6,930	7,732	408,249	1.7
大和証券リビング投資法人		2,420	3,134	304,311	1.3
ジャパンエクセレント投資法人		1,990	2,227	278,597	1.1
合計	口数・金額	125,224	145,293	23,137,777	
	銘柄数<比率>	63	62	<95.2%>	

(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
国内	不動産投信指数先物取引	東証ＲＥＩＴ指数	百万円 561	百万円 －

○投資信託財産の構成

（2021年１月25日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	23,137,777	94.6
コール・ローン等、その他	1,325,000	5.4
投資信託財産総額	24,462,777	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

（2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	24,462,777,509
コール・ローン等	407,950,647
投資証券(評価額)	23,137,777,600
未収入金	750,049,370
未収配当金	118,804,292
差入委託証拠金	48,195,600
(B) 負債	160,710,133
未払金	130,572,010
未払解約金	30,137,000
未払利息	1,106
その他未払費用	17
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	24,302,067,376
元本	19,216,952,787
次期繰越損益金	5,085,114,589
(D) 受益権総口数	19,216,952,787口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	12,646円

(注) 当ファンドの期首元本額は16,608,377,856円、期中追加設定元本額は17,317,627,913円、期中一部解約元本額は14,709,052,982円です。

(注) 2021年１月25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	5,196,817,301円
・ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	3,279,594,598円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	2,472,946,146円
・Ｊ-ＲＥＩＴインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,180,284,404円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,391,549,311円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	999,648,137円
・つみたてバランスファンド	911,030,444円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	656,602,487円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	530,267,959円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	228,455,111円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	218,849,353円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	217,800,344円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	192,983,598円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	127,102,756円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	117,070,385円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	91,876,450円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	88,554,381円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	75,823,501円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	70,808,447円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	56,898,122円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	33,177,565円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	32,219,210円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	17,333,705円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	10,260,388円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	7,376,669円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	4,975,434円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	3,470,911円
・リスクコントロール・オープン	2,137,407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)	1,038,263円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.2646円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	758,939,782
受取配当金	757,926,332
その他収益金	1,387,506
支払利息	△　374,056
(B) 有価証券売買損益	△4,634,214,227
売買益	488,592,897
売買損	△5,122,807,124
(C) 先物取引等取引損益	△　104,928,680
取引益	54,223,370
取引損	△　159,152,050
(D) 保管費用等	△　54,376
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△3,980,257,501
(F) 前期繰越損益金	7,950,636,804
(G) 追加信託差損益金	3,424,844,087
(H) 解約差損益金	△2,310,108,801
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	5,085,114,589
次期繰越損益金(Ｉ)	5,085,114,589

(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５期（決算日　2021年１月25日）
（2020年１月28日～2021年１月25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
5期(2021年1月25日)	10,369	△14.7	124,243.52	△13.8	0.1	97.4	22,787

（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Ｏ・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Ｏ・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	%		%	%	%
2020年1月27日	12,154	－	144,187.15	－	－	99.7
1月末	12,063	△ 0.7	143,073.05	△ 0.8	－	99.6
2月末	11,345	△ 6.7	134,573.20	△ 6.7	－	99.5
3月末	8,483	△30.2	100,830.59	△30.1	－	99.0
4月末	9,060	△25.5	107,670.68	△25.3	－	99.4
5月末	9,138	△24.8	108,781.65	△24.6	－	99.2
6月末	9,242	△24.0	110,069.34	△23.7	－	99.4
7月末	9,406	△22.6	112,029.74	△22.3	－	99.5
8月末	9,697	△20.2	115,692.66	△19.8	－	99.6
9月末	9,298	△23.5	110,930.24	△23.1	0.1	99.1
10月末	8,992	△26.0	107,293.45	△25.6	0.1	98.6
11月末	10,120	△16.7	120,978.87	△16.1	0.1	99.5
12月末	10,225	△15.9	122,316.30	△15.2	0.1	99.0
（期末）						
2021年1月25日	10,369	△14.7	124,243.52	△13.8	0.1	97.4

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2020年１月28日～2021年１月25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12,154円から当期末10,369円となり、1,785円の値下がりとなりました。

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））の下落により、基準価額は下落しました。

主に、為替市況の影響よりも先進国のリート価格が下落したことが作用しました。

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

先進国リート市況

先進国リート市場は前期末と比較して下落しました。新型肺炎問題に伴う中長期的な収益見通しに対する不透明感が嫌気され、先進国リート市場は一時大幅下落しました。その後、政策当局による大規模な財政・金融支援策や新型コロナウイルスのワクチン開発・普及に対する期待を背景に上昇基調となりましたが、新型肺炎問題の収束見通しが依然立たないことから、収益環境に対する構造的な不透明感は払拭されず、期初水準の回復には至りませんでした。

為替市況

前期末と比較して、円は米ドルに対して円高、ユーロに対して円安となりました。

米ドルに対しては、2020年３月には新型肺炎問題に伴う不確実性の高まりを受けて、投資家のリスク回避の動きに代表される円高圧力と企業等の米ドルを確保する動き等の円安圧力が交錯し、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、ＦＲＢ（米連邦準備制度理事会）による強力な金融緩和策の継続や追加経済対策に伴う財政赤字拡大観測から米ドル安（円高）基調で推移しました。

ユーロに対しては、米ドル安が進行したほかＥＵ（欧州連合）復興基金の創設合意などを背景に欧州地域の景気回復期待が高まり、対円でのユーロ高が進行しました。

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。

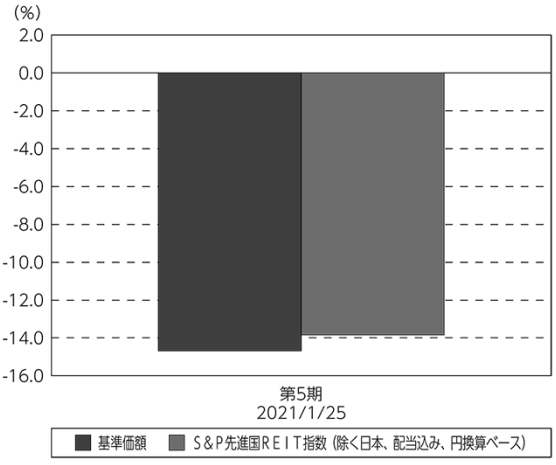
当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は－14.7%となり、ベンチマークの－13.8%を0.9%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

（2020年１月28日～2021年１月25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	8	0.085	(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）	(8)	(0.085)	
(b) 有価証券取引税	4	0.044	(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）	(4)	(0.044)	
(c) その他費用	17	0.170	(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）	(9)	(0.088)	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）	(8)	(0.082)	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	29	0.299	
期中の平均基準価額は、9,755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

（2020年１月28日～2021年１月25日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千オーストラリアドル	百株	千オーストラリアドル
外国	オーストラリア	840	179	－	－

（注）金額は受け渡し代金。

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	7,600	106	6,763	123
	AGREE REALTY CORP	7,907	512	4,813	295
	ALEXANDER & BALDWIN INC	14,100	188	1,661	28
	ALEXANDER'S INC	140	33	101	23
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,677	3,021	18,123	2,695
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,700	215	7,414	219
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	18,500	689	17,668	629
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	7,600	56	5,745	47
	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	34,018	930	30,668	771
	AMERICOLD REALTY TRUST	28,625	1,013	25,672	830
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	－	－	709	29
		(26,149)	(1,386)	(－)	(1,191)
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,021	620	14,369	536
外		(5,841)	(180)	(32,378)	(1,386)
	APARTMENT INCOME REIT CO	3,192	121	3,504	136
		(25,440)	(1,191)		
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	38,800	436	37,820	401
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,000	90	－	－
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	－	－	－	－
		(△ 10,525)	(－)		
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	－	－	1,169	2
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,682	3,206	19,234	3,120
	BOSTON PROPERTIES INC	21,244	2,035	21,127	2,055
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	－	－	5,009	13
	BRANDYWINE REALTY TRUST	21,783	247	21,136	232
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	39,344	539	38,582	546
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,400	93	10,040	145
国	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	－	－	17,115	3
	CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	21	－	－
	CAMDEN PROPERTY TRUST	12,657	1,189	12,077	1,095
	CARETRUST REIT INC	12,046	224	10,927	194
	CEDAR REALTY TRUST INC	－	－	15,920	12
	CHATHAM LODGING TRUST	3,600	20	2,755	12
	CITY OFFICE REIT INC	2,700	26	4,062	36
	COLONY CAPITAL INC	64,950	223	59,691	205
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12,279	159	12,456	166
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	1,770	74	1,517	56
	CORESITE REALTY CORP	5,839	700	4,901	544
	CORECIVIC INC	8,949	104	27,818	232
	COREPOINT LODGING INC	3,500	18	2,800	9
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,035	357	13,276	295
	COUSINS PROPERTIES INC	22,237	697	22,069	676

	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	CTO REALTY GROWTH INC	900	37	－	－
	CUBESMART	24,640	722	23,264	651
	CYRUSONE INC	15,041	1,083	13,695	802
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	23,179	158	20,799	143
	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,372	6,617	34,350	4,491
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	31,471	160	28,195	133
	DOUGLAS EMMETT INC	22,810	704	21,964	671
	DUKE REALTY CORP	53,694	1,931	51,613	1,717
	EPR PROPERTIES	9,332	325	9,554	334
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	9,274	216	8,169	190
	EASTGROUP PROPERTIES INC	4,992	612	4,719	545
	EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	18,900	155	19,212	164
	EQUINIX INC	12,522	8,713	11,555	7,153
	EQUITY COMMONWEALTH	15,075	463	13,893	411
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	23,735	1,507	25,476	1,520
	EQUITY RESIDENTIAL	50,254	3,076	49,814	3,082
	ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	12,504	207	9,440	167
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,260	2,208	9,157	2,136
	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,047	1,925	18,642	1,827
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,664	754	8,613	767
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	16,374	641	15,696	557
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	7,041	171	5,733	126
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4,300	21	4,358	19
	FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	3,300	27	10,375	157
	GEO GROUP INC/THE	11,129	131	11,336	142
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	27,750 (1,103)	1,026 (43)	25,888	875
	GETTY REALTY CORP	2,950	87	2,795	66
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,000	78	2,158	20
	GLOBAL NET LEASE INC	9,617	157	8,701	133
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,300	36	2,540	24
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	18,943	565	17,799	528
	HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	30,403	821	27,410	722
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	77,537	2,135	68,972	1,855
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	－	－	1,200	10
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,323	478	11,797	434
	HOST HOTELS & RESORTS INC	101,300	1,238	100,397	1,259
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	19,932	509	18,997	461
	INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	10,638	126	8,900	99
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	8,400	177	7,331	140
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,267	346	1,514	156
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,786	123	1,307	86
	INVITATION HOMES INC	80,450	2,212	75,285	1,867
	IRON MOUNTAIN INC	37,290	1,028	36,510	995
	JBG SMITH PROPERTIES	12,924	393	13,750	419

	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	KILROY REALTY CORP	14,883	908	13,299	800
	KIMCO REALTY CORP	57,118	749	53,600	740
	KITE REALTY GROUP TRUST	9,546	113	9,134	120
	LTC PROPERTIES INC	4,371	163	4,212	149
	LEXINGTON REALTY TRUST	43,796	446	38,575	382
	LIBERTY PROPERTY TRUST	－ (△ 26,194)	－ (△ 1,698)	－	－
	LIFE STORAGE INC	5,413	549	4,811	458
	MACERICH CO/THE	15,300 (620)	161 (4)	15,098	190
	MACK-CALI REALTY CORP	10,559	181	10,239	179
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	75,795	1,443	66,337	1,195
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,412	1,954	16,061	1,834
	MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	10,339	148	9,304	121
	NATL HEALTH INVESTORS INC	6,493	412	5,956	351
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	23,453	893	22,370	869
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,370	194	5,454	163
	NETSTREIT CORP	2,174	41	－	－
	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	7,500	24	7,500	27
	NEXPOINT RESIDENTIAL	2,430	91	2,494	94
	OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,157	178	6,524	166
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	29,900	977	27,973	891
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	700 (25)	12 (0.439)	750	8
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,802	371	2,791	362
	PARAMOUNT GROUP INC	27,234	223	32,180	283
	PARK HOTELS & RESORTS INC	35,330	441	35,333	457
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	18,700	271	17,401	265
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	－	－	8,385	3
	PHYSICIANS REALTY TRUST	31,598	547	25,833	421
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,130	224	13,571	227
	PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,000	26	－	－
	PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	3,600	27	2,944	20
	PROLOGIS INC	103,225 (17,680)	9,673 (1,698)	100,341	8,368
	PUBLIC STORAGE	21,835	4,494	21,019	4,257
	QTS REALTY TRUST INC-CL A	8,244	516	6,916	377
	RLJ LODGING TRUST	15,900	156	15,887	155
	RPT REALTY	6,300	42	7,189	67
	REALTY INCOME CORP	50,943	3,069	45,355	2,686
	REGENCY CENTERS CORP	24,045	1,079	24,941	1,099
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13,353	152	13,195	150
	RETAIL PROPERTIES OF AME - A	29,956	211	28,684	210
	RETAIL VALUE INC	1,800 (100)	28 (1)	856	7
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	17,238	753	13,725	577

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
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,870	364	7,705	365
		SL GREEN REALTY CORP	10,171	564	9,794	569
			(349)	(20)	(14,407)	(1,007)
		SL GREEN REALTY CORP	－	－	－	－
			(13,998)	(1,007)		
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	26,329	386	23,608	322
		SAFEHOLD INC	2,310	133	1,558	91
		SAUL CENTERS INC	850	27	462	11
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,600	43	3,998	51
		SERVICE PROPERTIES TRUST	18,200	182	16,371	190
		SIMON PROPERTY GROUP INC	47,661	3,629	43,083	3,455
		SITE CENTERS CORP	21,803	186	20,192	178
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	14,028	504	11,129	385
		STAG INDUSTRIAL INC	18,161	530	17,458	462
外		STORE CAPITAL CORP	32,601	848	27,965	738
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	8,100	45	6,995	37
		SUN COMMUNITIES INC	15,755	2,235	13,022	1,775
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	29,900	280	29,961	277
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	9,772	80	11,016	115
		TAUBMAN CENTERS INC	6,136	247	16,869	734
		TERRENO REALTY CORP	8,877	478	8,361	432
		UDR INC	38,369	1,466	37,185	1,415
		UMH PROPERTIES INC	3,100	40	1,586	15
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,259	92	1,171	95
		URBAN EDGE PROPERTIES	10,819	139	10,357	127
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	2,200	23	1,952	28
		VENTAS INC	54,343	2,191	52,565	2,059
		VEREIT INC	127,200	838	123,183	790
			(△ 143,336)	(－)		
国		VEREIT INC	4,600	164	3,647	130
		VICI PROPERTIES INC	77,732	1,710	63,329	1,269
		VORNADO REALTY TRUST	21,862	871	21,450	829
		WP CAREY INC	25,050	1,699	24,208	1,552
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	－	－	13,394	25
			(△ 18,026)	(－)		
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	－	－	－	－
			(1)	(－)		
		WASHINGTON REIT	11,834	277	10,788	253
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	14,797	289	14,390	285
		WELLTOWER INC	60,635	3,432	57,425	3,319
		WHITESTONE REIT	3,300	22	1,478	9
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,200	165	15,079	186
		KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,000	86	－	－
		PRIME US REIT	38,000	29	10,000	5
			(－)	(△ 1)		

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ARA US HOSPITALITY TRUST	－ (　　－)	－ (△　　1)	92,000	38
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	246,000 (　　－)	204 (△　　3)	240,400	191
	小計	3,339,881 (△　106,775)	118,576 (　3,830)	3,162,955 (　46,785)	106,071 (　3,585)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	11,650	506	11,264	486
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,900	77	8,374	75
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	36	－	－
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,900	91	2,906	96
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,400	58	4,026	45
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,820	637	12,334	605
	CHOICE PROPERTIES REIT	22,600	291	22,088	283
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,800	107	13,825	127
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	3,800	50	1,699	17
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,400	45	3,336	72
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	8,200	98	6,058	65
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	10,700	166	10,134	154
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,800	343	3,785	253
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,400	261	19,844	289
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,300	90	5,468	82
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,300	56	2,072	37
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,500	26	791	14
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	1,800	28	700	7
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	2,950	101	8,083	280
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	10,200	112	7,645	80
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	37	－	－
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,000	437	24,368	447
	SLATE RETAIL REIT - U	1,800	24	2,000	11
	SLATE GROCERY REIT	2,700	30	－	－
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,000	146	7,429	168
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	8,100	98	6,648	73
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8,000	146	1,500	24
	小計	219,520	4,108	186,377	3,803
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	HAMBORNER REIT AG	7,467	65	7,390	62
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,413 (　　－)	372 (△　16)	22,030	310
	小計	33,880 (　　－)	438 (△　16)	29,420	372

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	6,000	22	2,369	8
		小計	6,000	22	2,369	8
	フランス					
		ICADE	4,395	277	3,600	252
		ALTAREA	280 (－)	34 (△ 3)	200 (－)	21 (0)
		KLEPIERRE	31,465 (－)	583 (△ 21)	30,464	635
		GECINA SA	8,227	1,002	8,100	1,025
		COVIVIO	7,301	510	6,715	471
		MERCIALYS	3,600	19	－	－
		CARMILA	8,000	53	－	－
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,535	1,153	19,015	1,325
		小計	82,803 (－)	3,635 (△ 25)	68,094 (－)	3,731 (0)
	オランダ					
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	5,600	76	6,290	86
		VASTNED RETAIL NV	1,650	33	1,995	37
		WERELDHAVE NV	2,900	23	3,043	36
		NSI NV	1,300	42	1,723	62
		小計	11,450	176	13,051	222
	スペイン					
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,700 (－)	344 (△ 1)	37,764	323
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,700	21	2,813	11
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	53,400	449	59,099	515
		小計	98,800 (－)	815 (△ 1)	99,676	850
	ベルギー					
		BEFIMMO	4,140	162	3,461	139
		COFINIMMO	3,400	428	2,957	369
		RETAIL ESTATES	1,200	73	1,374	81
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	1,750	39	903	17
		MONTEA	1,130	104	1,360	118
		AEDIFICA	5,260	497	3,894 (－)	373 (7)
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,300	515	18,833	473
		CARE PROPERTY INVEST	4,100	108	－	－
		(Right)AEDIFICA SA	－ (4,601)	－ (7)	4,601	4
		XIOR STUDENT HOUSING NV	2,300	112	－	－
		小計	42,580 (4,601)	2,042 (7)	37,383 (－)	1,576 (7)

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	アイルランド				
	HIBERNIA REIT PLC	84,000	94	96,474	106
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	29,100	41	20,696	24
	小計	113,100	135	117,170	130
	その他				
	CROMWELL EUROPEAN REIT	306,000	146	80,300	38
	小計	306,000	146	80,300	38
	ユーロ計	694,613 (4,601)	7,412 (△ 35)	447,463 (－)	6,931 (7)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND CO PLC	143,700	600	141,627	596
	DERWENT LONDON PLC	17,442	547	16,155	529
	BIG YELLOW GROUP PLC	24,400	256	21,516	217
	HAMMERSON PLC	83,000 (△ 108,449)	90 (－)	75,493	105
	UNITE GROUP PLC	57,872	566	48,944	465
	SHAFTESBURY PLC	43,003	240	29,461	187
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	36	－	－
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	45,000	14	28,137	10
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	41,000	28	29,600	17
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	－	－	61,038	70
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	87,000	56	106,909	70
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	23,000	170	22,301	154
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	163,900	360	145,386	287
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	101	－	－
	SEGRO PLC	180,300	1,642	160,705	1,344
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	193,000	305	48,395	69
	WORKSPACE GROUP PLC	11,213	74	11,684	97
	GCP STUDENT LIVING PLC	103,000	144	25,573	36
	NEWRIVER REIT PLC	23,000	14	20,615	21
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	77,500	84	67,492	63
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	54,000	57	58,427	54
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	137,000	148	24,864	26
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	40,166	270	37,871	255
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	264,100	387	250,766	333
	RDI REIT PLC	21,000	18	13,432	7
	CUSTODIAN REIT PLC	77,000	73	－	－
	HAMMERSON PLC	756,273	178	135,605 (－)	32 (210)
	(Right)HAMMERSON PLC-NIL PAID	－ (650,688)	－ (210)	650,688	43
	CAPITAL & REGIONAL PLC	－	－	4,620	2
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	35,818	22	36,607	27
	ASSURA PLC	277,322	216	229,437	169

	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
	LXI REIT PLC	62,889	72	73,870	85
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	166,527	253	152,896	220
	REGIONAL REIT LTD	47,080	35	47,169	33
	LAND SECURITIES GROUP PLC	113,000	719	110,240	743
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,000	63	－	－
	小計	3,639,505 (542,239)	7,855 (210)	2,887,523 (－)	6,381 (210)
	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	56,934	221	56,685	203
	MIRVAC GROUP	522,433	1,263	497,339	1,198
	CROMWELL PROPERTY GROUP	231,000	207	216,862	192
	CHARTER HALL RETAIL REIT	82,403	288	49,694	185
	GPT GROUP	262,088	1,173	250,027	1,083
	ABACUS PROPERTY GROUP	67,683	188	57,419	170
	STOCKLAND	332,867	1,228	323,671	1,159
	DEXUS	161,300	1,547	154,444	1,538
	GOODMAN GROUP	242,400	3,905	220,243	3,222
	CHARTER HALL GROUP	67,120	732	65,541	696
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	27,600	90	18,527	53
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	32,100	145	25,688	103
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	176,976	422	141,905	347
	ARENA REIT	43,839	115	21,785	47
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	93,000	296	10,496	32
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	63,000	282	47,276	213
	NATIONAL STORAGE REIT	149,739	274	123,884	232
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,000	45	8,000	12
	GDI PROPERTY GROUP	33,000	36	22,953	25
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	28,500	68	9,619	18
	APN INDUSTRIA REIT	25,000	72	9,160	18
	HOME CONSORTIUM	24,000	94	－ (－)	－ (14)
	RURAL FUNDS GROUP	48,000	103	51,055	111
	IRONGATE GROUP	96,000	138	－	－
	CENTURIA OFFICE REIT	29,000	59	23,858	50
	WAYPOINT REIT LTD	86,180	228	32,143	83
	SCENTRE GROUP	780,842	1,920	777,453	1,904
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	54,745 (12,000)	68 (14)	－	－
	VICINITY CENTRES	637,748	1,013	507,147	789
	AVENTUS GROUP	62,000	156	－	－
	VIVA ENERGY REIT	54,000	136	45,988	97
	小計	4,586,497 (12,000)	16,525 (14)	3,768,862 (－)	13,790 (14)

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	68,000	112	58,373	103
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	54,000	156	41,152	109
	GOODMAN PROPERTY TRUST	183,000	410	178,505	396
	ARGOSY PROPERTY LTD	86,000	110	68,217	81
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	185,000	205	192,221	227
	小計	576,000	996	538,468	917
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	300,600	20,064	291,900	19,886
	PROSPERITY REIT	90,000	209	44,000	105
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	111,000	402	100,000	421
	CHAMPION REIT	196,000	812	169,000	719
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	144,000	536	155,000	577
	FORTUNE REIT	267,000	1,933	252,000	1,808
	小計	1,108,600	23,959	1,011,900	23,519
	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 INTEGRATED COMMER	519,500 (320,832)	1,079 (740)	532,400	1,091
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	477,400 (－)	1,512 (△ 13)	420,900	1,230
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	287,100	504	327,000 (445,600)	552 (855)
	SUNTEC REIT	338,000 (－)	504 (△ 0.874)	348,000	509
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	430,200 (－)	854 (△ 6)	448,800 (－)	802 (0)
	STARHILL GLOBAL REIT	132,400 (－)	67 (△ 0.255)	93,400	43
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	－ (－)	－ (△ 0.685)	35,800 (73,300)	35 (120)
	KEPPEL REIT	356,000	396	373,000	398
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	214,000	528	111,800	273
	ESR REIT	293,000	118	244,100	93
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	94,000 (－)	108 (△ 1)	105,700	116
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	165,000 (－)	214 (△ 5)	113,700	141
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	46,800 (－)	33 (△ 2)	28,500	17
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	60,300 (－)	214 (△ 1)	54,500	193
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	690,000 (－)	42 (△ 1)	139,700 (－)	16 (1)
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	228,200 (－)	665 (△ 0.241)	201,700	517

	銘柄	買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	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
外国	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	323,000 (—)	656 (△ 2)	296,100	591
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	123,000 (—)	76 (△ 0.233)	91,700 (—)	47 (0)
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	33,000 (—)	40 (△ 0.327)	22,700	22
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	70,200	25	47,500	12
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	294,000 (—)	271 (△ 6)	305,100 (—)	274 (0)
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	80,000	39	69,100	35
	SPH REIT	86,000	74	71,500	55
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	65,000 (—)	30 (△ 0.381)	— (—)	— (0)
	EC WORLD REIT	50,000	34	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	32,800	25	30,200	18
	ASCOTT TRUST	290,000 (—)	276 (△ 0.645)	272,500 (—)	243 (0.803)
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	329,000 (—)	127 (△ 0.311)	371,100	144
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	177,100 (—)	124 (△ 0.678)	38,000	25
	(Right)LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS	— (318,560)	— (1)	318,560	—
	(Right)IREIT GLOBAL-RIGHTS	— (24,970)	— (3)	24,970	2
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	52,700 (—)	24 (△ 0.022)	47,800	18
	IREIT GLOBAL	55,000	40	— (—)	— (3)
	KEPPEL DC REIT	192,800	518	185,000	442
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	329,200 (90,379)	426 (99)	230,600 (—)	271 (0)
	小計	6,914,700 (754,741)	9,660 (797)	6,001,430 (518,900)	8,241 (981)
	韓国		千韓国ウォン		千韓国ウォン
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,000	64,258	—	—
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,500	30,642	— (—)	— (177)
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	19,030	—	—
	LOTTE REIT CO LTD	15,600	87,524	—	—
	(Right)SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	— (373)	— (177)	373	138

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	JR REIT XXVII	18,000	96,015	－	－
	小計	58,100 (373)	297,471 (177)	373 (－)	138 (177)
	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	10,400	134	10,500	160
	小計	10,400	134	10,500	160

(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

(2020年１月28日～2021年１月25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	13,569千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,609千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.86

(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

(2020年１月28日～2021年１月25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

(2020年１月28日～2021年１月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年１月25日現在)

外国株式

銘柄		期首(前期末) 株数	当期末 株数	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額	業種等
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
CENTURIA CAPITAL GROUP		－	840	203	16,303	不動産
合計	株数・金額	－	840	203	16,303	
	銘柄数＜比率＞	－	1	－	＜0.1%＞	

(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) 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	%
ACADIA REALTY TRUST	14,100	14,937	225	23,405	0.1
AGREE REALTY CORP	6,948	10,042	651	67,612	0.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	12,439	207	21,544	0.1
ALEXANDER'S INC	329	368	102	10,687	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,378	20,932	3,534	366,987	1.6
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,318	8,604	249	25,891	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	22,399	23,231	968	100,593	0.4
AMERICAN FINANCE TRUST INC	17,369	19,224	150	15,610	0.1
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	41,984	45,334	1,413	146,732	0.6
AMERICOLD REALTY TRUST	31,589	34,542	1,222	126,974	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	—	25,440	122	12,706	0.1
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,885	—	—	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO	—	25,128	985	102,284	0.4
APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,824	35,804	472	49,113	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	—	10,000	115	11,951	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,694	—	—	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,180	23,628	3,892	404,170	1.8
BRT APARTMENTS CORP	877	877	13	1,407	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	3,420	39	4,059	0.0
BOSTON PROPERTIES INC	23,797	23,914	2,183	226,718	1.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	28,747	29,394	334	34,704	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,043	49,805	857	89,057	0.4
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	10,124	6,484	111	11,614	0.1
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	—	—	—	—
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	—	2,000	32	3,366	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,884	16,464	1,688	175,321	0.8
CARETRUST REIT INC	15,349	16,468	378	39,347	0.2
CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	—	—	—	—
CENTERSPACE	—	2,204	161	16,720	0.1
CHATHAM LODGING TRUST	7,636	8,481	98	10,224	0.0
CITY OFFICE REIT INC	10,006	8,644	84	8,751	0.0
CLIPPER REALTY INC	1,350	1,350	9	1,019	0.0
COLONY CAPITAL INC	77,590	82,849	395	41,036	0.2
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,907	19,730	278	28,969	0.1
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,483	3,736	183	19,063	0.1
CORESITE REALTY CORP	6,265	7,203	930	96,651	0.4
CORECIVIC INC	18,869	—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC	6,500	7,200	53	5,525	0.0
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	18,565	19,324	507	52,673	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	24,783	24,951	825	85,733	0.4
CTO REALTY GROWTH INC	—	900	40	4,240	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	%
CUBESMART	31,588	32,964	1,152	119,701	0.5
CYRUSONE INC	18,981	20,327	1,443	149,863	0.7
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	32,057	34,437	305	31,754	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	34,401	47,423	6,661	691,681	3.0
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37,686	40,962	181	18,800	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	26,820	27,666	787	81,760	0.4
DUKE REALTY CORP	60,785	62,866	2,529	262,686	1.2
EPR PROPERTIES	13,136	12,914	481	50,005	0.2
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,895	14,000	320	33,291	0.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,387	6,660	932	96,792	0.4
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,413	24,101	218	22,724	0.1
EQUINIX INC	14,120	15,087	10,880	1,129,793	5.0
EQUITY COMMONWEALTH	19,750	20,932	588	61,142	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,392	28,651	1,813	188,265	0.8
EQUITY RESIDENTIAL	57,518	57,958	3,567	370,490	1.6
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15,080	18,144	371	38,548	0.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,928	11,031	2,685	278,862	1.2
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,453	21,858	2,522	261,950	1.1
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	3,259	36	3,742	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,528	11,579	1,025	106,445	0.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,048	21,726	910	94,527	0.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,428	12,736	347	36,104	0.2
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,048	15,990	74	7,737	0.0
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,075	—	—	—	—
GEO GROUP INC/THE	20,928	20,721	173	17,987	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,517	36,482	1,506	156,456	0.7
GETTY REALTY CORP	6,020	6,175	168	17,466	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,336	6,178	113	11,791	0.1
GLADSTONE LAND CORP	2,563	2,563	42	4,374	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	14,471	15,387	261	27,114	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,693	7,453	98	10,262	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,267	23,411	729	75,798	0.3
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	33,769	36,762	1,066	110,779	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,380	90,945	2,744	285,011	1.3
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,293	4,093	32	3,323	0.0
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,369	17,895	710	73,752	0.3
HOST HOTELS & RESORTS INC	118,017	118,920	1,714	178,067	0.8
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25,269	26,204	625	64,950	0.3
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	14,706	16,444	225	23,427	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,160	11,229	249	25,920	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,062	3,815	741	77,003	0.3
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,725	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	89,672	94,837	2,847	295,633	1.3
IRON MOUNTAIN INC	47,905	48,685	1,467	152,421	0.7
JBG SMITH PROPERTIES	19,991	19,165	601	62,469	0.3

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	%
KILROY REALTY CORP	16,056	17,640	1,023	106,259	0.5
KIMCO REALTY CORP	69,316	72,834	1,213	126,000	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	14,063	14,475	243	25,266	0.1
LTC PROPERTIES INC	6,590	6,749	270	28,095	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	42,425	47,646	498	51,800	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	26,194	—	—	—	—
LIFE STORAGE INC	7,597	8,199	1,003	104,183	0.5
MACERICH CO/THE	18,451	19,273	274	28,518	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	14,367	14,687	197	20,512	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86,411	95,869	2,058	213,734	0.9
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,997	19,348	2,596	269,580	1.2
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	15,829	16,864	298	30,995	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,159	7,696	514	53,375	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,168	29,251	1,176	122,165	0.5
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,836	10,752	391	40,617	0.2
NETSTREIT CORP	—	2,174	38	4,011	0.0
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	12,195	66	6,939	0.0
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,914	3,850	167	17,386	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,699	8,332	204	21,266	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,316	38,243	1,375	142,842	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,220	2,195	44	4,649	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,441	3,452	473	49,158	0.2
PARAMOUNT GROUP INC	33,791	28,845	259	26,957	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	39,457	39,454	716	74,399	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,276	22,575	463	48,102	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	—	—	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	30,064	35,829	652	67,750	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,159	21,718	349	36,241	0.2
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	4,100	62	6,458	0.0
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,928	8,584	64	6,747	0.0
PROLOGIS INC	104,605	125,169	12,669	1,315,611	5.8
PUBLIC STORAGE	24,931	25,747	5,736	595,644	2.6
QTS REALTY TRUST INC-CL A	9,783	11,111	711	73,921	0.3
RLJ LODGING TRUST	28,449	28,462	406	42,204	0.2
RPT REALTY	13,829	12,940	122	12,670	0.1
REALTY INCOME CORP	53,749	59,337	3,550	368,707	1.6
REGENCY CENTERS CORP	27,475	26,579	1,247	129,525	0.6
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20,132	20,290	291	30,318	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	35,573	36,845	344	35,811	0.2
RETAIL VALUE INC	2,471	3,515	55	5,734	0.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,483	21,996	1,092	113,472	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,029	9,194	612	63,611	0.3
SL GREEN REALTY CORP	13,681	—	—	—	—
SL GREEN REALTY CORP	—	13,998	879	91,355	0.4
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,884	35,605	615	63,888	0.3

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	%
SAFEHOLD INC	1,750	2,502	190	19,771	0.1
SAUL CENTERS INC	1,742	2,130	67	6,973	0.0
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,784	5,386	82	8,618	0.0
SERVICE PROPERTIES TRUST	26,627	28,456	315	32,739	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	50,891	55,469	5,296	550,012	2.4
SITE CENTERS CORP	24,303	25,914	294	30,595	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,758	19,657	780	81,034	0.4
STAG INDUSTRIAL INC	24,974	25,677	797	82,815	0.4
STORE CAPITAL CORP	35,171	39,807	1,262	131,075	0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,935	19,040	166	17,319	0.1
SUN COMMUNITIES INC	15,464	18,197	2,673	277,654	1.2
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,251	37,190	416	43,252	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,481	15,237	203	21,122	0.1
TAUBMAN CENTERS INC	10,733	－	－	－	－
TERRENO REALTY CORP	11,248	11,764	671	69,702	0.3
UDR INC	48,611	49,795	1,947	202,226	0.9
UMH PROPERTIES INC	5,542	7,056	109	11,356	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,113	2,201	144	14,961	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	18,399	18,861	268	27,869	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,201	5,449	78	8,164	0.0
VENTAS INC	61,518	63,296	3,109	322,914	1.4
VEREIT INC	175,153	－	－	－	－
VEREIT INC	－	36,787	1,313	136,410	0.6
VICI PROPERTIES INC	76,311	90,714	2,393	248,586	1.1
VORNADO REALTY TRUST	25,956	26,368	999	103,772	0.5
WP CAREY INC	28,763	29,605	1,991	206,800	0.9
WASHINGTON PRIME GROUP INC	33,673	－	－	－	－
WASHINGTON PRIME GROUP INC	－	2,254	25	2,679	0.0
WASHINGTON REIT	13,121	14,167	318	33,070	0.1
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,312	20,719	476	49,440	0.2
WELLTOWER INC	67,359	70,569	4,450	462,169	2.0
WHITESTONE REIT	5,894	7,716	65	6,794	0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,506	19,627	311	32,344	0.1
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	－	118,000	83	8,638	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	82,000	11	1,166	0.0
PRIME US REIT	57,000	85,000	70	7,370	0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST	92,000	－	－	－	－
MANULIFE US REAL ESTATE INV	235,900	241,500	179	18,682	0.1
小計 口数・金額	4,134,047	4,157,413	156,084	16,207,767	
小計 銘柄数＜比率＞	158	155	－	＜71.1%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,226	10,612	405	33,107	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,399	10,925	117	9,591	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	－	3,500	37	3,101	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,844	3,838	140	11,440	0.1

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	%
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		8,585	8,959	140	11,502	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		13,890	14,376	736	60,183	0.3
CHOICE PROPERTIES REIT		26,627	27,139	347	28,370	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		14,739	14,714	121	9,937	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTME		6,405	8,506	122	10,045	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV		4,818	3,882	79	6,512	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE		11,081	13,223	168	13,790	0.1
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		18,100	18,666	277	22,653	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		4,114	5,129	395	32,270	0.1
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS		23,204	23,760	299	24,488	0.1
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		10,895	11,727	171	13,973	0.1
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		7,249	8,477	153	12,565	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		2,685	3,394	68	5,593	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT		2,747	3,847	61	5,001	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL EST		5,133	—	—	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		11,225	13,780	181	14,799	0.1
PLAZA RETAIL REIT		—	10,000	36	2,948	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		25,805	26,437	463	37,892	0.2
SLATE OFFICE REIT		4,169	4,169	18	1,481	0.0
SLATE RETAIL REIT - U		2,120	—	—	—	—
SLATE GROCERY REIT		—	4,620	55	4,554	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		12,019	11,590	280	22,944	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI		11,841	13,293	181	14,808	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		4,800	4,800	30	2,520	0.0
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I		—	6,500	128	10,484	0.0
小計	口数・金額	256,720	289,863	5,223	426,563	
	銘柄数<比率>	25	27	—	<1.9%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		11,095	11,172	100	12,735	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		25,773	30,156	430	54,456	0.2
小計	口数・金額	36,868	41,328	531	67,192	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		7,320	10,951	38	4,885	0.0
小計	口数・金額	7,320	10,951	38	4,885	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		4,570	5,365	313	39,593	0.2
ALTAREA		579	659	93	11,842	0.1
KLEPIERRE		34,025	35,026	594	75,068	0.3
GECINA SA		8,999	9,126	1,068	135,045	0.6
COVIVIO		7,462	8,048	550	69,564	0.3
MERCIALYS		3,481	7,081	50	6,366	0.0
CARMILA		—	8,000	88	11,241	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		22,801	23,321	1,327	167,806	0.7
小計	口数・金額	81,917	96,626	4,087	516,530	
	銘柄数<比率>	7	8	－	<2.3%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		7,000	6,310	98	12,423	0.1
VASTNED RETAIL NV		3,177	2,832	64	8,105	0.0
WERELDHAVE NV		7,312	7,169	81	10,246	0.0
NSI NV		2,995	2,572	88	11,132	0.0
小計	口数・金額	20,484	18,883	331	41,907	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.2%>	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		40,526	43,462	341	43,196	0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		9,624	11,511	53	6,727	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		60,726	55,027	422	53,404	0.2
小計	口数・金額	110,876	110,000	817	103,329	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO		3,744	4,423	152	19,227	0.1
COFINIMMO		4,201	4,644	574	72,653	0.3
RETAIL ESTATES		1,878	1,704	102	12,984	0.1
INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES		3,311	4,158	91	11,533	0.1
MONTEA		1,974	1,744	171	21,708	0.1
AEDIFICA		4,133	5,499	544	68,795	0.3
WAREHOUSES DE PAUW SCA		21,482	21,949	644	81,435	0.4
CARE PROPERTY INVEST		－	4,100	106	13,419	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		－	2,300	117	14,910	0.1
小計	口数・金額	40,723	50,521	2,505	316,668	
	銘柄数<比率>	7	9	－	<1.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
HIBERNIA REIT PLC		123,689	111,215	122	15,431	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		67,357	75,761	107	13,633	0.1
小計	口数・金額	191,046	186,976	229	29,064	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<0.1%>	
(ユーロ…その他)						
CROMWELL EUROPEAN REIT		－	225,700	113	14,403	0.1
小計	口数・金額	－	225,700	113	14,403	
	銘柄数<比率>	－	1	－	<0.1%>	
ユーロ計	口数・金額	489,234	740,985	8,656	1,093,981	
	銘柄数<比率>	26	30	－	<4.8%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND CO PLC		155,182	157,255	691	98,329	0.4
DERWENT LONDON PLC		17,440	18,727	588	83,564	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC		25,414	28,298	314	44,758	0.2
HAMMERSON PLC		128,054	－	－	－	－
INTU PROPERTIES PLC		117,549	117,549	－	－	－

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	%
UNITE GROUP PLC		59,477	68,405	652	92,787	0.4
SHAFTESBURY PLC		38,216	51,758	271	38,615	0.2
STANDARD LIFE INV PROP INC		—	69,000	41	5,863	0.0
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		86,640	103,503	40	5,699	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		87,000	98,400	80	11,508	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC		61,038	—	—	—	—
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		151,619	131,710	86	12,222	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		35,358	36,057	296	42,094	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		136,689	155,203	354	50,419	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		—	141,000	105	14,927	0.1
SEGRO PLC		181,625	201,220	1,960	278,576	1.2
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE		—	144,605	191	27,166	0.1
WORKSPACE GROUP PLC		22,311	21,840	157	22,346	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC		—	77,427	111	15,778	0.1
NEWRIVER REIT PLC		53,666	56,051	46	6,579	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		95,927	105,935	112	15,957	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		63,121	58,694	63	9,049	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		—	112,136	119	16,971	0.1
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		41,068	43,363	271	38,514	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC		279,045	292,379	541	76,909	0.3
RDI REIT PLC		40,782	48,350	43	6,156	0.0
CUSTODIAN REIT PLC		—	77,000	67	9,662	0.0
HAMMERSON PLC		—	647,780	131	18,733	0.1
CAPITAL & REGIONAL PLC		4,620	—	—	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		101,846	101,057	73	10,483	0.0
ASSURA PLC		406,515	454,400	339	48,301	0.2
AEW UK REIT PLC		20,000	20,000	15	2,270	0.0
LXI REIT PLC		93,342	82,361	98	14,045	0.1
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		210,813	224,444	333	47,333	0.2
REGIONAL REIT LTD		63,560	63,471	49	6,972	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		123,385	126,145	800	113,707	0.5
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		—	60,000	65	9,293	0.0
小計	口数・金額	2,901,302	4,195,523	9,116	1,295,602	
	銘柄数＜比率＞	29	34	—	＜5.7%＞	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST		82,525	82,774	355	28,545	0.1
MIRVAC GROUP		650,551	675,645	1,709	137,092	0.6
CROMWELL PROPERTY GROUP		304,913	319,051	268	21,493	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		54,211	86,920	314	25,234	0.1
GPT GROUP		322,007	334,068	1,459	117,082	0.5
ABACUS PROPERTY GROUP		64,226	74,490	205	16,488	0.1
STOCKLAND		400,425	409,621	1,859	149,146	0.7
DEXUS		180,102	186,958	1,716	137,645	0.6
GOODMAN GROUP		266,913	289,070	5,130	411,505	1.8
CHARTER HALL GROUP		78,188	79,767	1,115	89,498	0.4

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	%
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		43,404	52,477	172	13,804	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP		43,577	49,989	247	19,845	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		147,977	183,048	437	35,086	0.2
ARENA REIT		42,342	64,396	189	15,235	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		－	82,504	250	20,115	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		71,605	87,329	388	31,166	0.1
NATIONAL STORAGE REIT		133,471	159,326	308	24,725	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS		23,020	30,020	92	7,391	0.0
GDI PROPERTY GROUP		78,244	88,291	100	8,072	0.0
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		36,680	55,561	173	13,902	0.1
APN INDUSTRIA REIT		11,379	27,219	79	6,374	0.0
HOME CONSORTIUM		－	24,000	95	7,679	0.0
RURAL FUNDS GROUP		60,734	57,679	142	11,425	0.1
IRONGATE GROUP		－	96,000	118	9,470	0.0
CENTURIA OFFICE REIT		－	69,642	137	11,058	0.0
WAYPOINT REIT LTD		－	132,972	336	26,980	0.1
SCENTRE GROUP		888,152	891,541	2,549	204,494	0.9
HOMECO DAILY NEEDS REIT		－	66,745	83	6,717	0.0
CENTURIA METROPOLITAN REIT		64,500	－	－	－	－
VICINITY CENTRES		531,994	662,595	1,023	82,101	0.4
AVENTUS GROUP		－	62,000	168	13,524	0.1
VIVA ENERGY REIT		70,923	－	－	－	－
小計	口数・金額	4,652,063	5,481,698	21,233	1,702,906	
	銘柄数＜比率＞	25	30	－	＜7.5%＞	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL		176,114	185,741	317	23,729	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		51,700	64,548	212	15,865	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST		185,089	189,584	428	32,010	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		127,750	145,533	222	16,635	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		278,014	270,793	346	25,895	0.1
小計	口数・金額	818,667	856,199	1,527	114,135	
	銘柄数＜比率＞	5	5	－	＜0.5%＞	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		345,700	354,400	24,365	326,491	1.4
PROSPERITY REIT		180,000	226,000	544	7,298	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN		259,000	270,000	1,034	13,856	0.1
CHAMPION REIT		311,000	338,000	1,541	20,653	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST		175,000	164,000	613	8,219	0.0
FORTUNE REIT		225,000	240,000	1,720	23,058	0.1
小計	口数・金額	1,495,700	1,592,400	29,819	399,577	
	銘柄数＜比率＞	6	6	－	＜1.8%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMER		470,400	778,332	1,774	138,862	0.6
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		488,000	544,500	1,704	133,360	0.6
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		485,500	－	－	－	－

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	%
SUNTEC REIT		378,400	368,400	563	44,105	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		501,500	482,900	975	76,329	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		212,500	251,500	130	10,233	0.0
FRASERS COMMERCIAL TRUST		109,100	—	—	—	—
KEPPEL REIT		309,500	292,500	345	27,007	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		126,800	229,000	593	46,410	0.2
ESR REIT		354,300	403,200	163	12,777	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		140,800	129,100	162	12,728	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS		114,800	166,100	235	18,456	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		89,100	107,400	26	2,058	0.0
PARKWAYLIFE REAL ESTATE		60,400	66,200	266	20,876	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL		338,800	889,100	57	4,522	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		259,800	286,300	821	64,296	0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		347,900	374,800	817	63,935	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		159,000	190,300	131	10,274	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT		70,800	81,100	105	8,249	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		137,400	160,100	63	4,948	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC		361,400	350,300	350	27,410	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		149,300	160,200	97	7,646	0.0
SPH REIT		146,700	161,200	137	10,784	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		100,900	165,900	89	7,010	0.0
EC WORLD REIT		—	50,000	36	2,836	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		89,500	92,100	75	5,909	0.0
ASCOTT TRUST		302,696	320,196	336	26,308	0.1
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		445,200	403,100	159	12,459	0.1
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		—	139,100	108	8,489	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		128,800	133,700	70	5,544	0.0
IREIT GLOBAL		—	55,000	36	2,861	0.0
KEPPEL DC REIT		211,800	219,600	623	48,801	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		267,400	456,379	657	51,424	0.2
小計	口数・金額	7,358,496	8,507,607	11,717	916,924	
	銘柄数<比率>	30	31	—	<4.0%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		—	16,000	62,080	5,847	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		4,100	8,600	60,286	5,678	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		—	4,000	18,840	1,774	0.0
LOTTE REIT CO LTD		—	15,600	82,212	7,744	0.0
JR REIT XXVII		—	18,000	92,160	8,681	0.0
小計	口数・金額	4,100	62,200	315,578	29,727	
	銘柄数<比率>	1	5	—	<0.1%>	

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	
(イスラエル)		口	口	千イスラエルシュケル	千円	%
REIT 1 LTD		29,365	29,265	456	14,485	0.1
小計	口数・金額	29,365	29,265	456	14,485	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
合計	口数・金額	22,139,694	25,913,153	－	22,201,672	
	銘柄数<比率>	306	324	－	<97.4%>	

(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

(2021年１月25日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	16,303	0.1
投資証券	22,201,672	97.4
コール・ローン等、その他	581,529	2.5
投資信託財産総額	22,799,504	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（22,660,176千円）の投資信託財産総額（22,799,504千円）に対する比率は99.4%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=103.84円、1カナダドル=81.67円、1ユーロ=126.37円、1英ポンド=142.11円、1オーストラリアドル=80.20円、1ニュージーランドドル=74.71円、1香港ドル=13.40円、1シンガポールドル=78.25円、1韓国ウォン=0.0942円、1イスラエルシュケル=31.73円。

○特定資産の価格等の調査

(2020年１月28日～2021年１月25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 (2021年１月25日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	23,455,838,554
コール・ローン等	105,635,643
株式(評価額)	16,303,056
投資証券(評価額)	22,201,672,961
未収入金	1,096,043,710
未収配当金	36,183,184
(B) 負債	668,186,110
未払金	656,345,043
未払解約金	11,841,000
未払利息	66
その他未払費用	1
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	22,787,652,444
元本	21,976,415,392
次期繰越損益金	811,237,052
(D) 受益権総口数	21,976,415,392口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,369円

(注) 当ファンドの期首元本額は20,554,057,909円、期中追加設定元本額は21,048,096,808円、期中一部解約元本額は19,625,739,325円です。

(注) 2021年１月25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	8,194,970,791円
・ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	4,321,919,288円
・りそなラップ型ファンド（成長型）	1,856,311,025円
・りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,570,919,217円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	1,414,505,202円
・りそなラップ型ファンド（安定成長型）	579,903,244円
・つみたてバランスファンド	551,267,883円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	531,760,524円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	531,564,450円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	470,339,857円
・りそなラップ型ファンド（安定型）	397,667,105円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	318,251,854円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	310,207,980円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	185,069,154円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	162,368,764円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	126,342,674円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	112,155,037円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	97,202,064円
・りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	78,741,500円
・埼玉りそな・グローバルバランス・プラスＥＳＧ	69,657,309円
・Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	40,504,365円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,940,208円
・リスクコントロール・オープン	10,329,749円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	10,114,525円
・ＤＣりそな　グローバルバランス	6,880,518円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	6,841,243円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	4,872,922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）	1,806,940円

(注) 当期末の１口当たり純資産額は1.0369円です。

○損益の状況 (2020年１月28日～2021年１月25日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	658,682,618
受取配当金	658,576,048
受取利息	227,694
支払利息	△　121,124
(B) 有価証券売買損益	△4,599,373,968
売買益	1,352,700,678
売買損	△5,952,074,646
(C) 保管費用等	△　31,646,704
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△3,972,338,054
(E) 前期繰越損益金	4,426,792,558
(F) 追加信託差損益金	△　891,678,808
(G) 解約差損益金	1,248,461,356
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	811,237,052
次期繰越損益金(Ｈ)	811,237,052

(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２期（決算日　2021年２月15日）
（2020年２月18日～2021年２月15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		
(設定日)	円	%	%	百万円
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
２期(2021年２月15日)	9,977	△0.1	68.8	25,015

(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	
(期　首)	円	%	%
2020年２月17日	9,984	－	54.6
２月末	9,985	0.0	55.3
３月末	9,988	0.0	48.1
４月末	9,986	0.0	54.1
５月末	9,985	0.0	59.2
６月末	9,985	0.0	60.1
７月末	9,983	△0.0	75.0
８月末	9,982	△0.0	74.7
９月末	9,981	△0.0	57.7
10月末	9,980	△0.0	67.5
11月末	9,979	△0.1	71.5
12月末	9,978	△0.1	69.9
2021年１月末	9,977	△0.1	68.8
(期　末) 2021年２月15日	9,977	△0.1	68.8

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2020年２月18日～2021年２月15日）

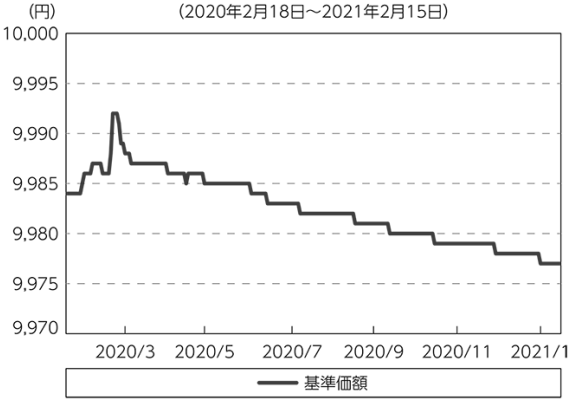
期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末9,984円から当期末9,977円となり、７円の値下がりとなりました。

日銀による低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
（2020年2月18日～2021年2月15日）



投資環境

国内債券市況

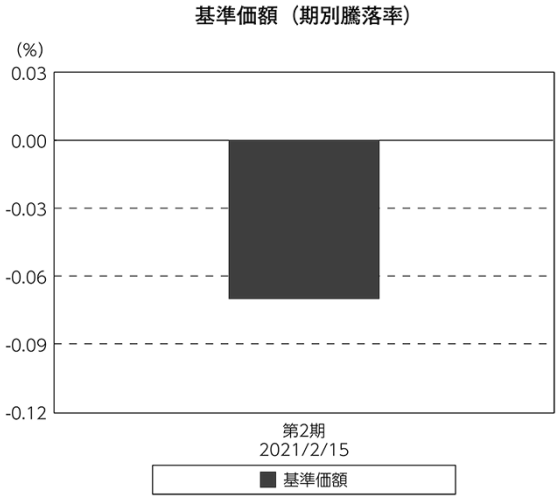
国内長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。期初は新型コロナウイルス問題を背景とした金融市場の混乱から債券に対する需給が交錯する場面も見られましたが、日銀をはじめ主要国中央銀行による大規模な金融緩和策が奏功し、国内長期金利は概ね０％近傍で推移しました。期末にかけては、追加経済対策等による国債発行増加観測等から超長期年限の国債利回りを中心に上昇が見られました。2021年１月、日銀は経済・物価情勢の展望において、2022年度末まで物価目標未達の見方を示唆する一方、現行の各種金融施策について点検を実施する方針についても示しましたが、国内長期金利の水準に大きな変化は見られませんでした。

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

（2020年２月18日～2021年２月15日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	1	0.007	(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）	(1)	(0.007)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合計	1	0.007	
期中の平均基準価額は、9,982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

（2020年２月18日～2021年２月15日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	99,369,991	39,116,788
			(51,500,000)

（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

（2020年２月18日～2021年２月15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（2020年２月18日～2021年２月15日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2021年２月15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	17,200,000	17,202,511	68.8	－	－	－	68.8
	(17,200,000)	(17,202,511)	(68.8)	(－)	(－)	(－)	(68.8)
合計	17,200,000	17,202,511	68.8	－	－	－	68.8
	(17,200,000)	(17,202,511)	(68.8)	(－)	(－)	(－)	(68.8)

（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951回国庫短期証券	－	1,500,000	1,500,021	2021/２/22
第955回国庫短期証券	－	1,500,000	1,500,081	2021/３/８
第956回国庫短期証券	－	1,500,000	1,500,109	2021/３/15
第958回国庫短期証券	－	1,500,000	1,500,139	2021/３/22
第961回国庫短期証券	－	1,800,000	1,800,201	2021/３/29
第962回国庫短期証券	－	1,800,000	1,800,264	2021/４/５
第964回国庫短期証券	－	1,800,000	1,800,297	2021/４/12
第965回国庫短期証券	－	1,800,000	1,800,351	2021/４/19
第968回国庫短期証券	－	1,000,000	1,000,209	2021/４/26
第970回国庫短期証券	－	1,500,000	1,500,406	2021/５/17
第972回国庫短期証券	－	1,500,000	1,500,430	2021/５/24
合計		17,200,000	17,202,511	

○投資信託財産の構成

（2021年２月15日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	17,202,511	68.8
コール・ローン等、その他	7,813,358	31.2
投資信託財産総額	25,015,869	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

（2020年２月18日～2021年２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

（2021年２月15日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	25,015,869,038
コール・ローン等	7,813,357,838
公社債(評価額)	17,202,511,200
(B) 負債	21,192
未払利息	21,192
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	25,015,847,846
元本	25,073,134,387
次期繰越損益金	△ 57,286,541
(D) 受益権総口数	25,073,134,387口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	9,977円

（注）当ファンドの期首元本額は15,600,853,423円、期中追加設定元本額は88,589,140,762円、期中一部解約元本額は79,116,859,798円です。

（注）2021年２月15日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９　11,687,316,697円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０　6,613,979,753円
・りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２　4,792,087,450円
・りそなＤＡＡ先物ファンド（適格機関投資家専用）　1,699,527,507円
・りそなＤＡＡ先物Ⅱファンド（適格機関投資家専用）　279,669,054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0.9977円です。

（注）2021年２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57,286,541円です。

○損益の状況

（2020年２月18日～2021年２月15日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	△ 12,278,582
支払利息	△ 12,278,582
(B) 有価証券売買損益	△ 60,446,200
売買益	208,800
売買損	△ 60,655,000
(C) 保管費用等	△ 2,974,875
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	△ 75,699,657
(E) 前期繰越損益金	△ 24,762,651
(F) 追加信託差損益金	△ 80,040,762
(G) 解約差損益金	123,216,529
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	△ 57,286,541
次期繰越損益金(Ｈ)	△ 57,286,541

（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。