ＪＰ４資産バランスファンド（ＤＣ）

運用報告書（全体版）

第３期（決算日　2020年１月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
「ＪＰ４資産バランスファンド（ＤＣ）」は、2020年１月15日に第３期の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き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	追加型投信／内外／資産複合			
信託期間	無期限（2017年８月31日設定）			
運用方針	日本と海外の債券と株式に資産を分散することで、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。海外債券は、信用力の高い先進国の債券に、海外株式は、より安定的な先進国の株式に投資します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ＜基本組入比率＞			
	日本株式	日本債券	海外株式	海外債券
	30%	40%	20%	10%
主な投資対象	ＪＰ４資産バランスファンド（ＤＣ）	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）、FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	日本株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	日本債券を主要投資対象とします。		
	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	海外株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	海外債券を主要投資対象とします。		
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 デリバティブの直接利用は行いません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。			
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。			

JP投信株式会社
東京都中央区日本橋本町一丁目５番11号

＜照会先＞
ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp
サポートダイヤル：0120-104-017
（受付時間：営業日の午前９時～午後５時）

目　次

ＪＰ４資産バランスファンド（ＤＣ）・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・・ 1

（ご参考）投資対象先の直近の内容

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）・・・・ 12

FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）・・・・ 58

野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）・・・・ 91

FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）・・・ 137

【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			参考指数		投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率		
(設定日)	円	円	%		%	%	百万円
2017年８月31日	10,000	－	－	10,000	－	－	1
１期(2018年１月15日)	10,707	0	7.1	10,771	7.7	88.1	8
２期(2019年１月15日)	9,949	0	△ 7.1	9,899	△ 8.1	99.5	57
３期(2020年１月15日)	11,053	0	11.1	10,992	11.0	99.6	161

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
(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) 参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。

○当期中の基準価額と市況等の推移

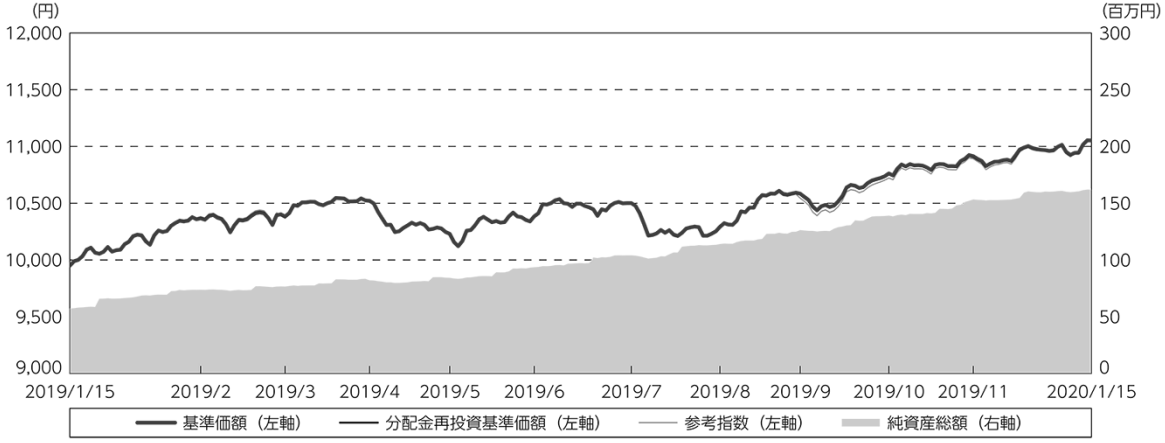
年月日	基準価額		参考指数		投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率	
(期　首)	円	%		%	%
2019年１月15日	9,949	－	9,899	－	99.5
１月末	10,091	1.4	10,045	1.5	99.4
２月末	10,367	4.2	10,329	4.3	99.5
３月末	10,383	4.4	10,315	4.2	99.3
４月末	10,521	5.7	10,466	5.7	100.0
５月末	10,230	2.8	10,174	2.8	99.3
６月末	10,384	4.4	10,327	4.3	99.2
７月末	10,501	5.5	10,444	5.5	99.5
８月末	10,292	3.4	10,238	3.4	99.3
９月末	10,584	6.4	10,493	6.0	98.3
10月末	10,762	8.2	10,668	7.8	99.6
11月末	10,914	9.7	10,837	9.5	98.6
12月末	11,014	10.7	10,944	10.6	99.6
(期　末)					
2020年１月15日	11,053	11.1	10,992	11.0	99.6

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2019年１月16日～2020年１月15日）

期中の基準価額等の推移



期　首：9,949円
期　末：11,053円（既払分配金(税込み)：０円）
騰落率：　11.1%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）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。
（注）分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
（注）分配金再投資基準価額および参考指数は、期首（2019年１月15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）参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。
（注）上記騰落率は、小数点以下第２位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,949円から期末11,053円となり、値上がり額は1,104円となりました。

投資対象とする４本の組入投資信託証券の当期間の値動きは、海外株式、日本株式、海外債券、日本債券が上昇しました。海外株式、日本株式、海外債券、日本債券などの上昇が主な値上がり要因となりました。

投資環境

日本債券市場	期を通じて、日本債券市場は2019年8月にかけて利回りが低下（価格が上昇）しましたが、その後上昇（価格は下落）に転じた結果、概ね横ばいの水準で期を終えました。2019年1月中旬から2月下旬は利上げに慎重な姿勢が見られたFOMC（米連邦公開市場委員会）などを受けて債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.05％まで低下しました。3月上旬には債券が売られる場面もありましたが、下旬にかけてFOMCで年内の利上げ見送りが示されたことなどから債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.1％近辺まで低下しました。4月上旬から中旬は米中通商協議で最終合意が間近であるとの報道などを受けて債券が売られました。その後、4月下旬から6月下旬にかけて米中貿易摩擦長期化への懸念や米欧の金融緩和観測などによって債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.19％台まで低下しました。7月上旬から中旬は良好な米雇用統計によって過度な米利下げ観測が後退したことなどから債券が売られましたが、8月下旬にかけて米欧の金融緩和への期待感、米中通商協議を巡る不透明感や世界景気の減速懸念などから債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.29％台まで低下し2016年7月以来の低水準となりました。9月上旬から2020年1月中旬は低調な米経済指標から米景気の減速懸念が高まったことなどを背景に債券が買われる場面がありましたが、日銀の追加緩和への期待感が後退したこと、米国と中国が部分的な貿易合意に達したとの報道から米中通商協議に対する楽観的な見方が広がったことなどを受けて債券が売られ、10年国債利回りはプラス圏に浮上しました。
日本株式市場	期を通じて、日本株式市場は上昇しました。2019年1月中旬から2月下旬は良好な米雇用統計を背景とした米株高や米中通商協議進展への期待感などを受けて上昇しました。3月上旬から4月下旬はECB（欧州中央銀行）による経済見通しの引き下げ・利上げ延期の表明、米中通商協議進展への期待感などを受けて一進一退の展開となりました。5月はトランプ米大統領による対中関税引き上げ、メキシコへの追加関税の表明などを嫌気して下落しました。6月に入り、日経平均株価が20,500円を下回る場面がありましたが、7月上旬にかけてトランプ米大統領による対メキシコ関税の発動見送り、FOMCで金融緩和に前向きな姿勢が強まったことなどを好感して上昇し、日経平均株価は21,500円を上回りました。7月中旬から8月下旬はトランプ米大統領による対中追加関税第4弾の発動表明などを受けて下落し、日経平均株価は20,500円を下回る場面がありました。9月上旬から10月上旬は10月に閣僚級の米中通商協議が行われる見通しとの報道などから上昇しましたが、米国でISM製造業景況感指数が悪化したことなどを受けて上昇幅を縮めました。10月中旬から12月下旬は米国と中国が部分的な貿易合意に達したとの報道などを好感して上昇し、日経平均株価は年初来高値を更新し24,000円台まで上昇する場面がありました。2020年1月上旬から中旬は米国とイランの対立激化が懸念され下落する場面がありましたが、米国とイランの問題が一段と深刻化するとの懸念が後退し、戻りを試す展開となりました。
海外債券市場	期を通じて、海外債券市場は利回りが低下（価格が上昇）しました。2019年1月中旬から3月下旬は世界景気の減速懸念やECBが利上げ時期を先送りしたこと、FOMCで年内は利上げを見送る方針が示されたことなどから債券が買われ、米国10年国債利回りは2.3％台と約1年3カ月ぶりの低水準を付けました。4月上旬から中旬は米国株式市場の上昇や米中通商協議進展への期待感などから債券が売られました。その後、4月下旬から6月下旬にかけて米中貿易摩擦の長期化懸念、欧州経済の先行き不透明感、FOMCで早期利下げの可能性が示唆されたことなどから債券が買われ、米国10年国債利回りは2％を下回る場面がありました。7月上旬はパウエルFRB（米連邦準備制度理事会）議長の議会証言を見極めたいとの思惑が広がり、債券の売りが優勢となりましたが、8月下旬にかけて米中対立の長期化が意識されたことで世界景気の減速が見込まれたことなどから債券が買われ、米国10年国債利回りは1.5％を下回りました。9月上旬から中旬は海外株式市場の上昇などを受けて債券が売られましたが、10月上旬にかけて米中対立の先行きの不透明感が意識されるなどして債券が買われました。10月中旬から2020年1月中旬は米中通商協議の「第1段階の合意」報道、英国の下院総選挙で与党・保守党が勝利したことなどによって債券の売りが優勢となり、米国10年国債利回りは一時1.9％台まで上昇する場面がありました。

海外株式市場	期を通じて、海外株式市場は上昇しました。2019年1月中旬から2月下旬は米中通商協議進展への期待感、堅調な米経済指標を背景に米景気の先行き不透明感が後退したことなどを受けて上昇しました。3月に入り、世界景気減速への警戒感から下落する場面がありましたが、4月下旬にかけてパウエルFRB議長が利上げを「急ぐ必要はない」と発言したこと、英国のEU離脱時期の延期合意などを好感して上昇しました。5月はトランプ米大統領が対中関税引き上げ、メキシコへの追加関税を表明したことなどを嫌気して下落し、NYダウは25,000ドルを下回りました。6月上旬から7月下旬はFRBによる早期の米利下げ観測の高まり、米中首脳会談での貿易協議再開への合意などから上昇し、NYダウは過去最高値を更新しました。8月は米中貿易摩擦が激化するとの懸念、米国債券市場で逆イールドが発生し景気後退の兆候との見方が広がったことなどを嫌気して下落し、NYダウは25,500ドルを下回る場面がありました。9月上旬から中旬はECBによる利下げや量的緩和の再開決定、FRBによる利下げなどから上昇しましたが、10月上旬にかけて米国でISM製造業景況感指数が好不況の境目である50を2カ月連続で割り込んだことなどを受けて下落しました。10月中旬から2020年1月中旬は米中通商協議が「第1段階の合意」に達したことなどを好感して上昇し、NYダウは過去最高値を更新し29,000ドル台まで上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

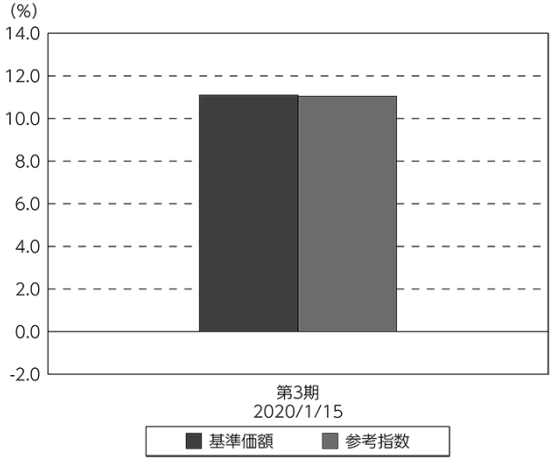
組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、日々のリバランスや資金の追加解約に対応した売買により、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは、基準価額と参考指数の対比です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項　　目	第３期 2019年１月16日～ 2020年１月15日
当期分配金	－
（対基準価額比率）	－％
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,052

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

引き続き、組入投資信託証券を通じて、日本株式、日本債券、海外株式、海外債券に分散投資を行い、信託財産の着実な成長を目指します。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2019年１月16日～2020年１月15日）

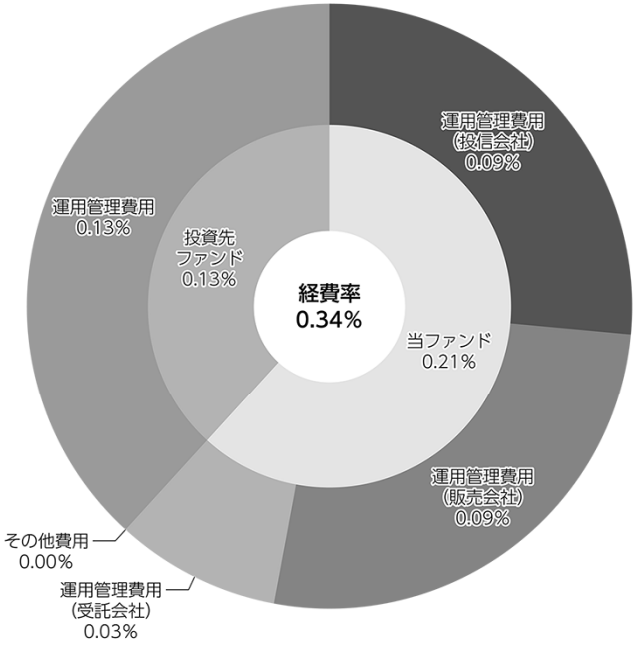
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	22	0.209	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(9)	(0.088)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(9)	(0.088)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	0	0.004	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	22	0.213	
期中の平均基準価額は、10,503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）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。
（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）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料およ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経費率（年率）は0.34％です。



（単位：％）

経費率（①＋②）	**0.34**
①当ファンドの費用の比率	0.21
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.13

（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、売買委託手数料およ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）投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
（注）当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
（注）投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。
（注）上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

（2019年１月16日～2020年１月15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	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）	13,475,205	18,480	1,369,789	1,918
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	42,944,300	43,760	2,325,307	2,367
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	25,453,771	29,049	2,385,059	2,797
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	11,009,494	10,240	278,011	259
合計		92,882,770	101,529	6,358,166	7,341

（注）金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

（2019年１月16日～2020年１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

（2019年１月16日～2020年１月15日）

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2019年１月16日～2020年１月15日）

当期首残高（元本）	当期設定元本	当期解約元本	当期末残高（元本）	取引理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	－	－	1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

（2020年１月15日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	口数	口数	評価額	比率
	口	口	千円	%
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド(適格機関投資家専用)	9,228,671	21,334,087	32,873	20.3
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	22,712,038	63,331,031	63,958	39.5
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	15,618,918	38,687,630	48,336	29.8
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	6,280,020	17,011,503	16,101	9.9
合計	53,839,647	140,364,251	161,269	99.6

（注）比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

（2020年１月15日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	161,269	99.4
コール・ローン等、その他	906	0.6
投資信託財産総額	162,175	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年１月15日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	162,175,094
コール・ローン等	905,681
投資信託受益証券(評価額)	161,269,413
(B) 負債	181,714
未払解約金	39,872
未払信託報酬	137,362
未払利息	2
その他未払費用	4,478
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	161,993,380
元本	146,567,069
次期繰越損益金	15,426,311
(D) 受益権総口数	146,567,069口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	11,053円

(注) 当ファンドの期首元本額は57,517,997円、期中追加設定元本額は99,092,169円、期中一部解約元本額は10,043,097円です。
(注) １口当たり純資産額は1.1053円です。

○損益の状況 (2019年１月16日～2020年１月15日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	1,570,017
受取配当金	1,571,003
支払利息	△ 986
(B) 有価証券売買損益	9,712,196
売買益	10,389,323
売買損	△ 677,127
(C) 信託報酬等	△ 221,926
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	11,060,287
(E) 前期繰越損益金	△ 2,338,335
(F) 追加信託差損益金	6,704,359
(配当等相当額)	(5,991,833)
(売買損益相当額)	(712,526)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	15,426,311
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	15,426,311
追加信託差損益金	6,704,359
(配当等相当額)	(5,991,833)
(売買損益相当額)	(712,526)
分配準備積立金	8,721,952

(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**(C)信託報酬等**には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注) 損益の状況の中で**(F)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) 分配金の計算過程 (2019年１月16日～2020年１月15日) は以下の通りです。

項　　目	2019年１月16日～2020年１月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,539,125円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	6,721,068円
c. 信託約款に定める収益調整金	6,704,359円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	461,759円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	15,426,311円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	1,052円
g. 分配金	0円
h. 分配金(１万口当たり)	0円

○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

2019年１月16日から2020年１月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

合成指数について

合成指数は、下記の指数と基本組入比率をもとにＪＰ投信が計算したものです。

資　　産	指　　数	基本組入比率
日本株式	TOPIX（東証株価指数、配当なし）	30%
日本債券	NOMURA-BPI総合	40%
海外株式	MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・配当込み・為替ヘッジなし）	20%
海外債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	10%

＊「TOPIX（東証株価指数、配当なし）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

＊「NOMURA-BPI総合」とは、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、一定の組み入れ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基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われるＪＰ投信株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

＊「MSCI-KOKUSAI指数」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

＊「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	国内株式インデックスマザーファンド	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。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。	

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)

運用報告書(全体版)

第20期 (決算日 2019年 9月9日)
第21期 (決算日 2019年11月7日)
第22期 (決算日 2020年 1月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

ホームページ https://www.smtam.jp/

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号
＜610058＞

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
		円	円	%		%	%	%	百万円
第4	第 8期(2017年 9月7日)	11,429	1	△0.5	11,365	△0.5	98.9	1.1	12,875
	第 9期(2017年11月7日)	12,988	80	14.3	12,894	13.5	98.7	1.8	17,759
	第10期(2018年 1月9日)	13,531	15	4.3	13,435	4.2	98.8	0.9	25,629
第5	第11期(2018年 3月7日)	12,205	2	△9.8	12,117	△9.8	98.8	1.1	29,487
	第12期(2018年 5月7日)	12,711	107	5.0	12,609	4.1	98.8	2.0	34,079
	第13期(2018年 7月9日)	12,274	16	△3.3	12,173	△3.5	98.9	1.2	42,991
第6	第14期(2018年 9月7日)	12,075	4	△1.6	11,977	△1.6	99.2	0.8	50,804
	第15期(2018年11月7日)	11,857	86	△1.1	11,750	△1.9	98.9	1.8	60,853
	第16期(2019年 1月7日)	10,856	16	△8.3	10,756	△8.5	98.9	1.2	67,071
第7	第17期(2019年 3月7日)	11,492	5	5.9	11,389	5.9	98.7	1.3	72,972
	第18期(2019年 5月7日)	11,481	124	1.0	11,376	△0.1	98.8	2.1	73,394
	第19期(2019年 7月8日)	11,328	16	△1.2	11,224	△1.3	98.7	1.1	79,617
第8	第20期(2019年 9月9日)	11,132	2	△1.7	11,030	△1.7	98.9	1.0	81,080
	第21期(2019年11月7日)	12,193	111	10.5	12,075	9.5	98.3	2.0	79,038
	第22期(2020年 1月7日)	12,383	18	1.7	12,267	1.6	99.0	1.0	74,910

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)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」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

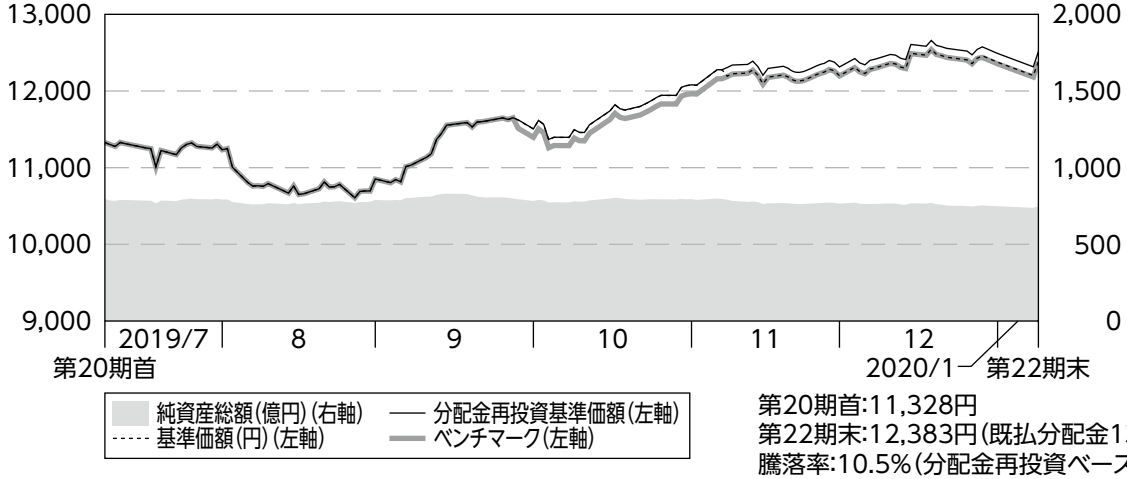
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年　月　日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率
		円	%		%	%	%
第20期	(期　首)2019年 7月8日	11,328	－	11,224	－	98.7	1.1
	7月末	11,233	△0.8	11,130	△0.8	98.9	1.0
	8月末	10,853	△4.2	10,751	△4.2	98.9	1.1
	(期　末)2019年 9月9日	11,134	△1.7	11,030	△1.7	98.9	1.0
第21期	(期　首)2019年 9月9日	11,132	－	11,030	－	98.9	1.0
	9月末	11,504	3.3	11,291	2.4	98.1	1.8
	10月末	12,078	8.5	11,854	7.5	97.9	1.9
	(期　末)2019年11月7日	12,304	10.5	12,075	9.5	98.3	2.0
第22期	(期　首)2019年11月7日	12,193	－	12,075	－	98.3	2.0
	11月末	12,200	0.1	12,084	0.1	98.1	1.8
	12月末	12,375	1.5	12,241	1.4	98.9	1.1
	(期　末)2020年 1月7日	12,401	1.7	12,267	1.6	99.0	1.0

(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)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」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



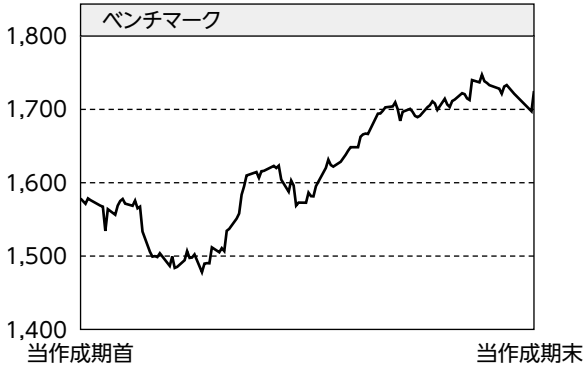
第20期首:11,328円
第22期末:12,383円(既払分配金131円)
騰落率:10.5%(分配金再投資ベース)

(注1)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。
(注2)分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
(注3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2019年7月8日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、当作成期末は当作成期首比で上昇しました。

投資環境



当作成期初は、米国の対中関税引き上げなど、米中対立の激化を受けて世界景気減速への警戒感が高まり、下落しました。その後は、米中通商協議再開への期待や、ECB（欧州中央銀行）が量的金融緩和の再開を決定したことなどを受け、世界景気減速への過度な警戒感が後退したことから上昇し、当作成期末にかけては、米中通商協議の進展期待や、企業業績の底入れ期待から、上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

【「国内株式インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。

（2）東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX（東証株価指数）の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

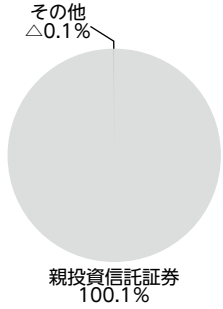
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

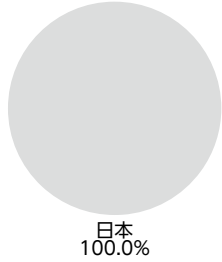
	当作成期末
	2020年1月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

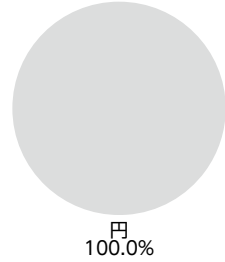
○資産別配分



○国別配分



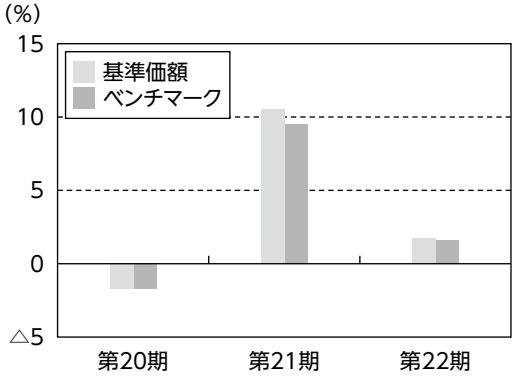
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当作成期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。
差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)および信託報酬要因(マイナス)です。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第20期	第21期	第22期
		2019年7月9日～2019年9月9日	2019年9月10日～2019年11月7日	2019年11月8日～2020年1月7日
当期分配金	（円）	2	111	18
（対基準価額比率）	（%）	(0.018)	(0.902)	(0.145)
当期の収益	（円）	2	111	18
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	3,928	3,929	4,053

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

国内株式インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期 (2019年7月9日~2020年1月7日) 金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	7円	0.060%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,707円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(5)	(0.044)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.005)	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)	(1)	(0.011)	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	0.000	(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〕×10,000
(株式)	(0)	(0.000)	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
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	−	−	(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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(d) その他費用	0	0.001	(d)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(−)	(−)	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)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	7	0.061	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンド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2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当作成期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	3,035,536	4,291,873	11,198,015	17,132,195

株式売買比率

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

＜国内株式インデックス マザーファンド＞

項目	当作成期
(a) 当作成期中の株式売買金額	74,999,637千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	305,156,135千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.24

(注1) (b)当作成期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	50	50	100.0	50	50	100.0
コール・ローン	25,900	4,311	16.6	25,855	4,325	16.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜国内株式インデックス マザーファンド＞

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	276	276	100.0	276	276	100.0
コール・ローン	434,991	84,337	19.4	430,258	84,938	19.7

〈平均保有割合　24.9%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

■利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式インデックス マザーファンド＞

種類	当作成期		
	買付額	売付額	当作成期末保有額
株式	126百万円	95百万円	1,070百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当作成期末保有額は評価額です。
(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	前作成期末	当作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	54,799,464	46,636,985	74,982,945

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、204,387,711千口です。

投資信託財産の構成

項目	当作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内株式インデックス マザーファンド	74,982,945	99.8
コール・ローン等、その他	132,615	0.2
投資信託財産総額	75,115,560	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第 20 期 末 2019年9月9日現在	第 21 期 末 2019年11月7日現在	第 22 期 末 2020年1月7日現在
(A)資産	**81,112,191,789円**	**80,525,038,756円**	**75,115,560,944円**
コール・ローン等	56,035,188	545,239,020	104,487,668
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	81,040,730,461	79,718,483,976	74,982,945,203
未収入金	15,426,140	261,315,760	28,128,073
(B)負債	**31,286,622**	**1,486,321,637**	**204,600,047**
未払収益分配金	14,567,577	719,556,955	108,894,776
未払解約金	399,999	750,999,997	79,999,997
未払信託報酬	15,995,285	15,455,868	15,387,741
未払利息	124	758	117
その他未払費用	323,637	308,059	317,416
(C)純資産総額(A-B)	**81,080,905,167**	**79,038,717,119**	**74,910,960,897**
元本	72,837,885,232	64,824,950,910	60,497,097,818
次期繰越損益金	8,243,019,935	14,213,766,209	14,413,863,079
(D)受益権総口数	**72,837,885,232口**	**64,824,950,910口**	**60,497,097,818口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**11,132円**	**12,193円**	**12,383円**

■損益の状況

項目	第 20 期 自 2019年7月9日 至 2019年9月9日	第 21 期 自 2019年 9月10日 至 2019年11月 7日	第 22 期 自 2019年11月8日 至 2020年 1月7日
(A)配当等収益	**△14,338円**	**△21,631円**	**△25,952円**
支払利息	△14,338	△21,631	△25,952
(B)有価証券売買損益	**△1,244,313,662**	**7,605,842,416**	**1,269,375,504**
売買益	1,230,201	8,041,563,892	1,328,854,903
売買損	△1,245,543,863	△435,721,476	△59,479,399
(C)信託報酬等	**△16,318,991**	**△15,764,019**	**△15,705,218**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△1,260,646,991**	**7,590,056,766**	**1,253,644,334**
(E)前期繰越損益金	**△3,622,176,521**	**△4,346,970,082**	**2,344,150,218**
(F)追加信託差損益金	**13,140,411,024**	**11,690,236,480**	**10,924,963,303**
(配当等相当額)	(25,298,721,426)	(22,523,634,053)	(21,032,638,452)
(売買損益相当額)	(△12,158,310,402)	(△10,833,397,573)	(△10,107,675,149)
(G)計(D+E+F)	**8,257,587,512**	**14,933,323,164**	**14,522,757,855**
(H)収益分配金	**△14,567,577**	**△719,556,955**	**△108,894,776**
次期繰越損益金(G+H)	**8,243,019,935**	**14,213,766,209**	**14,413,863,079**
追加信託差損益金	13,140,411,024	11,690,236,480	10,924,963,303
(配当等相当額)	(25,298,869,249)	(22,523,641,966)	(21,032,923,646)
(売買損益相当額)	(△12,158,458,225)	(△10,833,405,486)	(△10,107,960,343)
分配準備積立金	3,318,122,097	2,948,356,894	3,488,899,776
繰越損益金	△8,215,513,186	△424,827,165	―

(注1)(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(C)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3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの第20期首元本額は70,286,259,362円、第20～22期中追加設定元本額は3,994,251,013円、第20～22期中一部解約元本額は13,783,412,557円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　20　期	第　21　期	第　22　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	15,096,852円	722,717,683円	111,238,044円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	747,777,022円
(C) 収益調整金額	25,298,869,249円	22,523,641,966円	21,032,923,646円
(D) 分配準備積立金額	3,317,592,822円	2,945,196,166円	2,738,779,486円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	28,631,558,923円	26,191,555,815円	24,630,718,198円
(F) 期末残存口数	72,837,885,232口	64,824,950,910口	60,497,097,818口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	3,930円	4,040円	4,071円
(H) 分配金額(1万口当たり)	2円	111円	18円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	14,567,577円	719,556,955円	108,894,776円

分配金のお知らせ

	第20期	第21期	第22期
1万口当たり分配金	2円	111円	18円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

お知らせ

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第19期（決算日　2019年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運　用　方　針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組　入　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。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第15期(2015年5月29日)	14,114	42.0	1,673.65	39.4	97.9	1.8	157,438
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	1.9	151,002
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	1.8	162,440
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	1.8	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	2.2	272,283

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

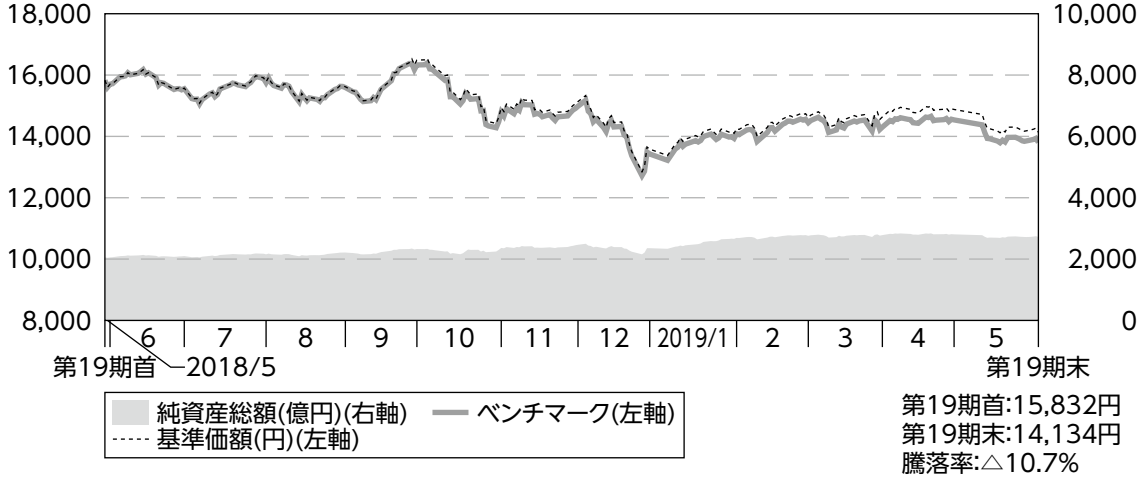
年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(当期首) 2018年 5月29日	15,832	－	1,761.85	－	98.1	1.8
5月末	15,703	△0.8	1,747.45	△0.8	98.1	1.9
6月末	15,574	△1.6	1,730.89	△1.8	98.1	1.9
7月末	15,776	△0.4	1,753.29	△0.5	98.7	1.3
8月末	15,619	△1.3	1,735.35	△1.5	98.9	1.2
9月末	16,488	4.1	1,817.25	3.1	98.1	1.8
10月末	14,937	△5.7	1,646.12	△6.6	97.5	2.5
11月末	15,136	△4.4	1,667.45	△5.4	98.3	1.7
12月末	13,585	△14.2	1,494.09	△15.2	98.9	1.1
2019年 1月末	14,253	△10.0	1,567.49	△11.0	98.7	1.3
2月末	14,623	△7.6	1,607.66	△8.8	98.8	1.2
3月末	14,636	△7.6	1,591.64	△9.7	97.8	2.2
4月末	14,879	△6.0	1,617.93	△8.2	98.1	2.0
(当期末) 2019年 5月29日	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	2.2

(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。
TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

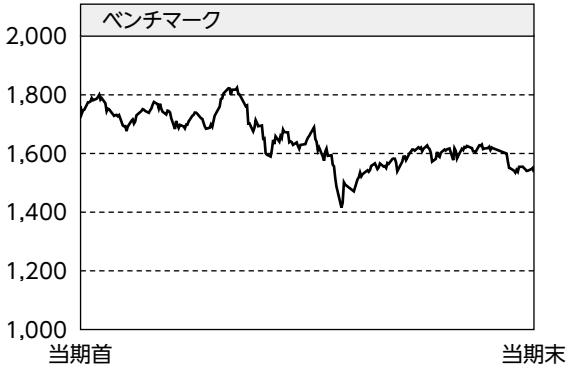


(注)ベンチマークは、2018年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、期首比では下落しました。

投資環境



期初は、国内企業の業績が堅調であった一方、米中貿易摩擦の激化が重石となり、国内株式市場はボックス圏での推移が続きました。10月に入り米長期金利の上昇をきっかけとして米国株式市場が調整すると、国内株式市場も追随して下落し、年末にかけては米中貿易摩擦激化への懸念や世界的な景気減速懸念、米国政権運営の不透明感などが嫌気され大幅に下落しました。年明け以降は、FRB（米連邦準備理事会）が利上げを急がない姿勢を示したことや、米中貿易協議の進展期待などから投資家心理が改善に向かい、国内株式市場は回復傾向となりましたが、5月には、米中貿易摩擦への警戒感が再燃したことから、期末にかけて下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）株式組入比率は期を通じて100％に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。

（2）東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX（東証株価指数）の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

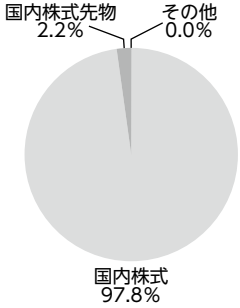
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

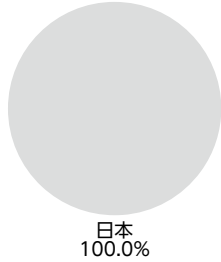
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.3%
2	東証株価指数先物　1906	日本	2.2%
3	ソフトバンクグループ	日本	1.9%
4	ソニー	日本	1.6%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.5%
6	武田薬品工業	日本	1.5%
7	日本電信電話	日本	1.5%
8	キーエンス	日本	1.4%
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.2%
10	リクルートホールディングス	日本	1.1%
組入銘柄数		2,079	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

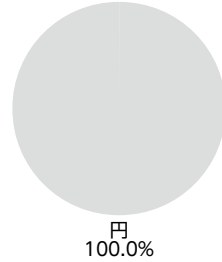
○資産別配分



○国別配分



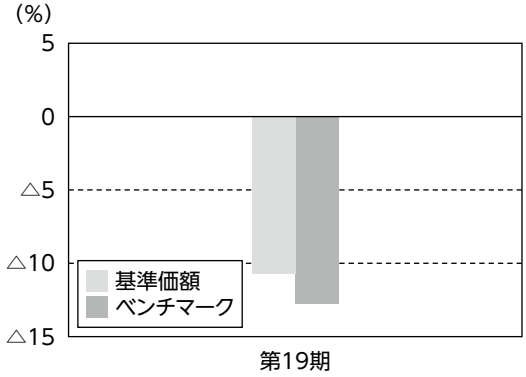
○通貨別配分



（注1）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
（注2）国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。
差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因（プラス）です。

今後の運用方針

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2018年5月30日～2019年5月29日） 金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料	0円	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〕×10,000
（株式）	(0)	(0.000)	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
（新株予約権証券）	(−)	(−)	
（オプション証券等）	(−)	(−)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(−)	(−)	
（投資信託証券）	(−)	(−)	
（商品）	(−)	(−)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	−	−	(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〕×10,000
（株式）	(−)	(−)	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
（新株予約権証券）	(−)	(−)	
（オプション証券等）	(−)	(−)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(−)	(−)	
（公社債）	(−)	(−)	
（投資信託証券）	(−)	(−)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(−)	(−)	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）	(−)	(−)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（15,100円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株　式＞

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	56,386 (△4,181)	112,094,929 (5,104)	8,671	17,875,512

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)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＞

	当期			
	買付		売付	
	証券数	金額	証券数	金額
	証券	千円	証券	千円
国内	－ (8,300)	－ (－)	－ (8,300)	－ (－)

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、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		当期			
		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	株式先物取引	41,772	39,176	－	－

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜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) 当期中の株式売買金額	129,970,441千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	238,221,837千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.54

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	46,445	46,445	100.0	46,445	46,445	100.0
コール・ローン	863,398	97,836	11.3	862,219	97,693	11.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
株式	377百万円	40百万円	930百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。
(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

※ 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。

組入資産の明細

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	3.5	5.3	14,601
日本水産	101.1	164	106,600
マルハニチロ	17	23.7	81,054
カネコ種苗	3	5	6,605
サカタのタネ	13.3	20	67,600
ホクト	9.1	13.8	25,005
ホクリヨウ	1.5	2.2	1,317
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	29.8	35.2	4,012
日鉄鉱業	2.7	3.8	15,675
三井松島ホールディングス	5.2	6.9	8,424
国際石油開発帝石	437.8	658	592,923
石油資源開発	14.6	23.6	54,988
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5.9	8	13,048
建設業(2.9%)			
ヒノキヤグループ	2.3	4.6	9,614
ショーボンドホールディングス	8.5	11.7	88,452
ミライト・ホールディングス	27.6	46.1	77,770
タマホーム	6.6	7.9	8,042
サンヨーホームズ	1.5	2.4	1,617
日本アクア	2.6	5.2	2,423
ファーストコーポレーション	2.9	5	3,860
ベステラ	1.6	3.1	3,896
ＴＡＴＥＲＵ	8.5	14.2	3,308
スペースバリューホールディングス	－	19.9	10,905
ダイセキ環境ソリューション	2.1	3.1	1,906
第一カッター興業	1.2	2	3,314
安藤・間	70	105.9	74,765
東急建設	34.6	48.6	37,179
コムシスホールディングス	31.6	58.2	151,436
ミサワホーム	7.5	13.6	13,572
ビーアールホールディングス	8.7	17.8	5,624
高松コンストラクショングループ	5.8	10.4	24,232
東建コーポレーション	3.4	5.1	32,997
ソネック	1.1	1.7	1,242
ヤマウラ	4.2	7	5,901
大成建設	89.5	134.8	547,962
大林組	269.6	406.3	401,424
清水建設	275	414.5	363,516
飛島建設	82.1	12	15,384
長谷工コーポレーション	104.9	169.7	190,233
松井建設	10	15.7	9,765
錢高組	1.3	1.7	7,616
鹿島建設	395	317.5	473,710
不動テトラ	67.3	9.7	12,949
大末建設	2.9	5.4	4,962
鉄建建設	5.5	8.4	24,889
西松建設	20.8	29.4	60,975
三井住友建設	62.6	95.8	57,959
大豊建設	33	9.4	25,944
前田建設工業	64.1	97.1	85,156
佐田建設	5.8	10.2	3,621
ナカノフドー建設	6.8	11.5	4,956
奥村組	14.8	22.4	76,272
東鉄工業	10.8	16.2	49,977
イチケン	1.6	2.8	4,712
富士ピー・エス	－	5.6	2,464
淺沼組	32	5	18,025
戸田建設	105	158.2	93,654
熊谷組	14.1	19.5	56,160
青木あすなろ建設	5.9	7.3	5,986
北野建設	19	3	8,073
植木組	1.1	1.9	4,047
三井ホーム	12	－	－
矢作建設工業	12	18.3	13,340
ピーエス三菱	10.5	15	9,450
日本ハウスホールディングス	16.9	25.7	10,537
大東建託	32	48.2	690,947
新日本建設	10.6	16.7	15,013
ＮＩＰＰＯ	20.8	35.8	76,146
東亜道路工業	1.8	2.5	7,377
前田道路	28.1	42.4	92,686
日本道路	2.4	3.7	22,940
東亜建設工業	6.6	9.7	14,530
日本国土開発	－	22	13,684
若築建設	4.8	6.8	9,193
東洋建設	28.1	49.3	19,522
五洋建設	106.8	160.9	77,392
世紀東急工業	12.1	19.6	12,054
福田組	2.9	4.5	19,710
住友林業	57.5	96.3	119,797
日本基礎技術	9.7	13.8	4,940
日成ビルド工業	13.3	－	－
巴コーポレーション	11	18.5	6,345
大和ハウス工業	265.5	374.9	1,252,915
ライト工業	17.2	26	34,866
積水ハウス	292.4	414.7	733,811
日特建設	7.5	11.5	6,911
北陸電気工事	4.9	6.5	5,395

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ユアテック	13.9	21.6	15,789
西部電気工業	1.5	－	－
四電工	1.4	2.1	5,548
中電工	11.6	17.4	38,906
関電工	35.8	61.6	54,700
きんでん	59.8	90	149,850
東京エネシス	10.2	14	12,754
トーエネック	2.5	3.8	11,396
住友電設	7.1	9.4	15,566
日本電設工業	13.8	23.1	54,700
協和エクシオ	32.3	53	133,189
新日本空調	6.9	11.7	20,241
ＮＤＳ	1.4	－	－
九電工	17.7	26.7	84,772
三機工業	19	31	38,502
日揮	77.4	117	169,182
中外炉工業	2.7	4.1	6,744
ヤマト	7.3	13.3	6,876
太平電業	6.1	9.2	18,924
高砂熱学工業	24.8	33.2	56,174
三晃金属工業	1	1.9	4,772
朝日工業社	1.9	3	7,347
明星工業	16.2	24.4	16,055
大氣社	11.7	18.6	61,194
ダイダン	6	9.3	20,153
日比谷総合設備	10	12.2	22,557
東芝プラントシステム	19.5	29.6	57,216
ＯＳＪＢホールディングス	39.7	59.7	16,477
東洋エンジニアリング	10.1	10.1	4,605
千代田化工建設	58.4	－	－
新興プランテック	17.2	24.3	29,330
食料品(4.2%)			
日本製粉	26.7	38.4	69,811
日清製粉グループ本社	98.5	136.9	355,803
日東富士製粉	0.6	0.9	5,274
昭和産業	7.4	11.1	33,855
鳥越製粉	7	10.7	7,843
中部飼料	9.8	14.8	17,404
フィード・ワン	54.1	81	14,742
東洋精糖	1.3	1.8	1,747
日本甜菜製糖	4.6	6.9	13,317
三井製糖	6.4	9.6	22,291
塩水港精糖	9.3	13.1	2,724
日新製糖	3.8	5.7	10,470
森永製菓	18.9	30.5	152,195
中村屋	2.1	3.1	13,407
江崎グリコ	22.5	36.4	191,100
名糖産業	3.8	5.8	8,270
井村屋グループ	3.2	5.2	11,486

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
不二家	5.1	6.8	13,396
山崎製パン	65.8	99.1	165,001
第一屋製パン	1.4	2.1	2,085
モロゾフ	1.4	2.1	10,479
亀田製菓	5	7.5	35,587
寿スピリッツ	7.8	12.8	73,856
カルビー	36.7	55.2	176,088
森永乳業	16.1	24.3	99,144
六甲バター	5.3	8.8	17,872
ヤクルト本社	46.9	89.8	565,740
明治ホールディングス	53.2	85.9	669,161
雪印メグミルク	19.4	29.2	63,860
プリマハム	57	17	37,111
日本ハム	34.8	50.2	222,135
林兼産業	2.8	4	2,384
丸大食品	43	12.9	25,142
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5.6	10.9	40,875
伊藤ハム米久ホールディングス	51.8	78	52,104
サッポロホールディングス	29.4	44.3	102,731
アサヒグループホールディングス	168.6	253.8	1,213,671
キリンホールディングス	386.9	548.3	1,300,567
宝ホールディングス	60.3	90.8	115,134
オエノンホールディングス	22.9	34.3	12,725
養命酒製造	2.5	3.7	7,466
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	56.5	92.8	236,825
サントリー食品インターナショナル	61.6	81.1	373,871
ダイドーグループホールディングス	4.1	6.8	31,994
伊藤園	26.7	36.8	197,248
キーコーヒー	7.9	11.9	24,930
ユニカフェ	2.4	3.3	3,237
ジャパンフーズ	1.1	1.7	1,914
日清オイリオグループ	9.5	15.6	50,856
不二製油グループ本社	21.8	29.6	101,380
かどや製油	0.9	1.3	5,538
Ｊ－オイルミルズ	4.2	6.3	25,735
キッコーマン	62.9	80	384,800
味の素	185.1	267.7	512,511
キユーピー	44.8	67.5	169,762
ハウス食品グループ本社	30.7	45.3	208,606
カゴメ	32.2	48.6	128,206
焼津水産化学工業	3.8	5.9	6,436
アリアケジャパン	7.4	11.1	80,364
ピエトロ	1	1.6	2,556
エバラ食品工業	1.8	2.9	6,090
ニチレイ	38.3	63	171,423
東洋水産	44.2	62.4	272,064
イートアンド	2.2	4.2	6,904
大冷	0.9	1.4	2,485

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.6	3.3	3,006
日清食品ホールディングス	35.1	51.5	340,415
永谷園ホールディングス	9	6.5	14,183
一正蒲鉾	3.1	4.7	5,329
フジッコ	8.7	13.1	28,505
ロック・フィールド	8.7	13.1	21,182
日本たばこ産業	498.1	699.9	1,749,400
ケンコーマヨネーズ	5.3	6.8	16,517
わらべや日洋ホールディングス	5.3	7.9	13,682
なとり	4.5	6.8	10,669
イフジ産業	1.4	2.1	1,400
ビックルスコーポレーション	1.6	2.9	5,614
北の達人コーポレーション	24.6	47.6	26,227
ユーグレナ	32	51.7	45,185
ミヨシ油脂	3	4.6	5,193
理研ビタミン	3	5.7	19,893
繊維製品(0.6%)			
片倉工業	9.7	14.6	17,797
グンゼ	6.3	8	38,000
東洋紡	31.1	50.2	60,290
ユニチカ	24.5	34.7	12,422
富士紡ホールディングス	4.7	6.2	14,514
倉敷紡績	85	11.3	22,114
シキボウ	4.2	6.2	5,759
日本毛織	23.8	39	32,838
トーア紡コーポレーション	3.5	5	2,200
ダイドーリミテッド	9.3	14.4	4,550
帝国繊維	8.8	13.3	30,310
帝人	69.1	96.5	171,770
東レ	609.5	917.7	686,531
サカイオーベックス	2.2	3	5,046
住江織物	2.2	3.5	9,901
日本フエルト	4.5	6.9	3,153
イチカワ	6	1.8	2,329
日東製網	0.9	1.4	1,849
アツギ	5.7	9.9	9,068
ダイニック	3.1	4.8	3,470
セーレン	19.4	29.2	41,785
ソトー	3.3	4.8	4,545
東海染工	1.3	1.7	1,919
小松マテーレ	12.9	19.6	15,170
ワコールホールディングス	23.2	34.5	95,496
ホギメディカル	10.6	14.7	51,891
レナウン	22.1	34	3,332
クラウディアホールディングス	2.3	3.1	1,556
ＴＳＩホールディングス	30.7	43.8	28,207
マツオカコーポレーション	2	3.8	10,263
ワールド	－	15.5	36,301
三陽商会	4.4	7.2	12,412

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ナイガイ	3.2	4.5	2,268
オンワードホールディングス	50.3	71.3	42,067
ルックホールディングス	15	4.4	6,182
ゴールドウイン	4.8	10.7	157,932
デサント	19.2	28.9	54,881
キング	4.4	6.4	4,044
ヤマトインターナショナル	5.8	7.8	3,166
パルプ・紙(0.3%)			
特種東海製紙	4.6	7.5	28,275
王子ホールディングス	354	532.5	309,382
日本製紙	37.6	56.7	108,637
三菱製紙	11.9	19.2	10,886
北越コーポレーション	46.9	78.5	43,489
中越パルプ工業	3.3	5	7,080
巴川製紙所	13	3.9	3,545
大王製紙	33.5	57.6	75,110
阿波製紙	2	3	1,305
レンゴー	81	122	120,170
トーモク	4.8	7.3	12,928
ザ・パック	5.9	9	27,900
化学(7.3%)			
クラレ	141.4	199.6	245,707
旭化成	523.9	841.5	969,408
共和レザー	4.8	7.4	5,683
昭和電工	55.9	78.6	238,944
住友化学	618	931.1	442,272
住友精化	3.5	5.8	19,140
日産化学	48.9	72.6	331,056
ラサ工業	3	4.2	5,531
クレハ	7.3	10.9	76,300
多木化学	1.2	3.5	16,117
テイカ	6.4	9.6	22,185
石原産業	15	22.7	23,744
片倉コープアグリ	2	3.4	3,791
日東エフシー	4.9	7.4	8,872
日本曹達	58	18.7	49,592
東ソー	121.4	182.8	252,264
トクヤマ	24.4	34.1	83,476
セントラル硝子	17.1	25.8	63,751
東亜合成	49.3	74.2	88,891
大阪ソーダ	8.1	12.7	32,778
関東電化工業	20	27.9	19,223
デンカ	30.9	46.5	148,102
信越化学工業	139.9	208.4	1,922,281
日本カーバイド工業	2.7	4	5,320
堺化学工業	5.7	7.9	19,710
第一稀元素化学工業	－	12.8	9,561
エア・ウォーター	69.3	96.9	157,365
大陽日酸	64.7	97.4	204,540

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
日本化学工業	3.1	4	6,960
東邦アセチレン	1.2	1.8	2,374
日本パーカライジング	42.9	64.6	77,649
高圧ガス工業	12.5	18.7	15,184
チタン工業	0.9	1.5	3,843
四国化成工業	12.1	19.9	20,576
戸田工業	1.7	2.5	5,225
ステラ　ケミファ	4.3	6.9	18,071
保土谷化学工業	2.7	4.1	10,528
日本触媒	13.2	19.9	127,360
大日精化工業	6.5	9.8	28,224
カネカ	113	30.6	115,362
三菱瓦斯化学	69.3	121.6	164,646
三井化学	76.4	107.4	255,182
ＪＳＲ	84.5	118.7	182,560
東京応化工業	14.6	20.3	63,234
大阪有機化学工業	7.2	11	10,857
三菱ケミカルホールディングス	562.7	790.8	562,812
ＫＨネオケム	12.9	18	51,930
ダイセル	113.3	174.2	164,619
住友ベークライト	68	20.5	76,977
積水化学工業	174.5	258.5	412,049
日本ゼオン	70.8	106.7	110,754
アイカ工業	23.6	35.5	131,172
宇部興産	42.3	59.7	124,892
積水樹脂	13	19.5	40,404
タキロンシーアイ	17	25.5	16,167
旭有機材	4.9	8.2	11,439
日立化成	41.5	54.7	159,888
ニチバン	4.1	6.2	14,601
リケンテクノス	18.1	32.1	15,600
大倉工業	20	6.1	10,687
積水化成品工業	10.4	17.5	12,547
群栄化学工業	2	3	7,176
タイガースポリマー	4.1	6.3	3,654
ミライアル	2.8	3.5	3,692
ダイキアクシス	2.8	4.3	3,612
ダイキョーニシカワ	16.6	25	20,725
竹本容器	1.3	4.3	4,859
森六ホールディングス	4.2	6.4	15,424
日本化薬	54.5	75.3	93,372
カーリットホールディングス	7.7	12.7	8,382
日本精化	7	9.5	12,245
扶桑化学工業	8	12	23,124
トリケミカル研究所	2	2.6	12,714
ＡＤＥＫＡ	36.1	58.3	90,773
日油	32.5	44.6	175,501
ハリマ化成グループ	6.4	9.8	9,760
花王	197.2	293.2	2,548,494

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
第一工業製薬	16	4.4	12,667
石原ケミカル	2	3	4,476
日華化学	2.6	4.1	3,718
ニイタカ	1.2	1.9	2,832
三洋化成工業	5.3	8	42,560
有機合成薬品工業	5.5	9.3	2,259
大日本塗料	9.5	13.4	12,904
日本ペイントホールディングス	64.8	97.6	429,928
関西ペイント	88.3	132.9	268,989
神東塗料	6.2	9.6	1,603
中国塗料	24	38.8	36,782
日本特殊塗料	5.3	8.9	10,368
藤倉化成	10.6	15.9	8,999
太陽ホールディングス	6.5	9.7	32,107
ＤＩＣ	33.2	53.5	144,343
サカタインクス	17.1	25.8	24,742
東洋インキＳＣホールディングス	83	25	57,625
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5.6	9.2	8,390
富士フイルムホールディングス	166.6	250.9	1,340,056
資生堂	149.4	240	1,932,240
ライオン	111.8	168.3	359,657
高砂香料工業	5	8.3	25,356
マンダム	15.6	27.2	72,515
ミルボン	10.7	14.9	79,417
ファンケル	19.5	53.8	155,535
コーセー	13.6	20.5	352,805
コタ	3.8	6.4	7,596
シーズ・ホールディングス	9.7	－	－
シーボン	1	1.5	3,606
ポーラ・オルビスホールディングス	34.2	51.6	156,864
ノエビアホールディングス	5.1	11.5	66,470
アジュバンコスメジャパン	1.8	2.8	2,559
エステー	5.7	8.7	15,303
アグロ　カネショウ	3.3	4.9	10,059
コニシ	13.2	21.4	33,341
長谷川香料	10.5	16	28,784
星光ＰＭＣ	4.6	8.1	6,002
小林製薬	22.5	33.8	279,864
荒川化学工業	7.2	10.8	13,532
メック	5.5	8.3	8,300
日本高純度化学	2.2	3.3	7,537
タカラバイオ	21	31.6	77,799
ＪＣＵ	9.7	15.7	30,976
新田ゼラチン	5.5	7.6	5,221
ＯＡＴアグリオ	1.3	1.7	2,184
デクセリアルズ	20.6	31.2	21,621
アース製薬	6	9.1	45,955
北興化学工業	8	12.3	5,940
大成ラミック	2.5	4	11,400

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
クミアイ化学工業	36.3	49.9	36,776
日本農薬	20.6	21.4	8,688
アキレス	6.1	8.8	17,177
有沢製作所	13.4	18.9	14,193
日東電工	60.6	83.3	406,087
レック	4.8	12.9	16,254
三光合成	－	13.9	4,600
きもと	13.5	20.9	3,135
藤森工業	6.7	10.9	30,105
前澤化成工業	5.4	8.3	8,532
未来工業	－	6.5	13,923
ウェーブロックホールディングス	－	3.4	2,206
ＪＳＰ	4.7	7.1	14,079
エフピコ	6.6	13.3	85,386
天馬	6.3	8.4	15,136
信越ポリマー	16.4	21.6	16,286
東リ	19.8	30.2	7,550
ニフコ	29.5	48.4	134,455
バルカー	6.5	9.8	20,384
ユニ・チャーム	170.1	256.1	843,849
ショーエイコーポレーション	－	1	738
医薬品(5.6%)			
協和発酵キリン	100.5	141.7	297,853
武田薬品工業	295.5	1,054.4	4,059,440
アステラス製薬	824.3	1,113.5	1,712,563
大日本住友製薬	59.5	89.5	206,029
塩野義製薬	113	154.4	947,552
田辺三菱製薬	97.9	126.3	161,916
わかもと製薬	9.4	14.3	3,818
あすか製薬	9	14.9	17,507
日本新薬	21	31.6	250,272
ビオフェルミン製薬	1.4	2.1	4,817
中外製薬	83.6	125.9	911,516
科研製薬	14.5	21.8	113,578
エーザイ	96	144.6	947,274
ロート製薬	44.1	61.9	191,890
小野薬品工業	189.4	285.2	553,573
久光製薬	23.7	35.7	162,078
持田製薬	5.6	18.3	94,794
参天製薬	152	224.8	364,176
扶桑薬品工業	2.8	4.3	8,909
日本ケミファ	1.1	1.6	4,662
ツムラ	28.7	37.4	119,493
日医工	21	31.8	40,672
キッセイ薬品工業	14.7	21.4	56,881
生化学工業	15.5	23.4	28,758
栄研化学	13	21.2	40,280
日水製薬	3.3	5.1	6,099
鳥居薬品	5	6.5	15,021
ＪＣＲファーマ	5.7	8.5	58,055
東和薬品	3.8	17.4	47,815
富士製薬工業	2.7	8.2	12,193
沢井製薬	16.1	24.8	145,576
ゼリア新薬工業	17.2	23.9	49,807
第一三共	229.5	345.6	1,860,019
キョーリン製薬ホールディングス	22.4	26.6	51,816
大幸薬品	4.3	5.4	10,378
ダイト	4.7	7	23,660
大塚ホールディングス	166.7	230.1	866,556
大正製薬ホールディングス	18	27	244,080
ペプチドリーム	36.7	60.5	326,700
石油・石炭製品(0.6%)			
日本コークス工業	67.8	101.5	9,642
昭和シェル石油	75.1	－	－
ニチレキ	10.3	15.4	15,692
ユシロ化学工業	4.4	6.3	8,082
ビーピー・カストロール	3.4	4.3	6,338
富士石油	19.5	29.2	7,738
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.9	4.4	6,050
出光興産	67.3	139.4	427,958
ＪＸＴＧホールディングス	1,280.1	2,031.3	1,061,760
コスモエネルギーホールディングス	23.2	35	75,705
ゴム製品(0.8%)			
横浜ゴム	46.4	69.9	130,992
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	47.5	62	83,638
ブリヂストン	265.5	371.2	1,524,518
住友ゴム工業	82.6	108.5	132,370
藤倉コンポジット	6.8	10.5	4,032
オカモト	28	8.4	41,664
フコク	3.4	5.3	3,731
ニッタ	8.3	13.6	41,820
住友理工	15.5	23.3	18,989
三ツ星ベルト	19	15.9	32,833
バンドー化学	15.2	23	21,344
ガラス・土石製品(0.9%)			
日東紡績	11.9	18	36,090
ＡＧＣ	80.9	119.4	432,825
日本板硝子	39.1	53	38,690
石塚硝子	1.1	2	4,404
日本山村硝子	33	5	7,515
日本電気硝子	34.7	52.3	138,647
オハラ	3.2	4.8	6,292
住友大阪セメント	156	24.4	106,262
太平洋セメント	50.7	76.3	251,790
日本ヒューム	7.9	12.1	8,506
日本コンクリート工業	16.9	26	7,592
三谷セキサン	4.2	5.6	16,223
アジアパイルホールディングス	10.4	17.1	10,191

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
東海カーボン	72.8	109.7	116,940
日本カーボン	4.1	5.8	23,171
東洋炭素	5.2	7.1	14,384
ノリタケカンパニーリミテド	4.7	7.2	33,156
ＴＯＴＯ	61.7	92.9	380,425
日本碍子	97.9	147.4	221,100
日本特殊陶業	68.8	101.9	193,508
ＭＡＲＵＷＡ	2.8	4.2	20,496
品川リフラクトリーズ	2.1	3.2	9,424
黒崎播磨	1.6	2.4	14,736
ヨータイ	6.3	10.6	5,872
イソライト工業	4.1	6.2	2,895
東京窯業	10	15.4	4,604
ニッカトー	3.6	5.5	3,740
フジミインコーポレーテッド	7.2	10.8	22,215
クニミネ工業	2.2	5.4	4,368
エーアンドエーマテリアル	1.7	2.3	2,341
ニチアス	44	33.1	62,492
ニチハ	12.1	16.8	47,241
鉄鋼(0.9%)			
日本製鉄	355	554.9	1,016,576
神戸製鋼所	145.2	218.6	148,866
中山製鋼所	11	16.5	7,887
合同製鐵	4.3	5.8	11,977
ジェイ エフ イー ホールディングス	214.2	322.6	490,997
日新製鋼	21.9	－	－
東京製鐵	42.5	64	54,912
共英製鋼	8.9	13.5	24,961
大和工業	16.9	25.4	78,994
東京鐵鋼	3.2	4.9	5,747
大阪製鐵	5.3	7.9	14,077
淀川製鋼所	11.6	16.1	32,280
東洋鋼鈑	19	－	－
丸一鋼管	28.1	42.3	119,709
モリ工業	2.6	3.6	6,552
大同特殊鋼	14.1	19.6	75,950
日本高周波鋼業	2.9	4.4	2,103
日本冶金工業	65.3	98.9	20,571
山陽特殊製鋼	9.2	15.1	22,453
愛知製鋼	4.5	6.7	21,741
日立金属	85.4	128.7	141,312
日本金属	2	2.8	2,377
大平洋金属	4.9	8.1	18,087
新日本電工	47.3	71.3	14,117
栗本鐵工所	4	6	8,088
虹技	1.2	1.8	2,237
日本鋳鉄管	8	－	－
三菱製鋼	5.9	8.9	10,154
日亜鋼業	11.3	17.5	5,722
日本精線	1.3	1.7	4,321
エンビプロ・ホールディングス	－	4.5	2,619
シンニッタン	12	18.5	6,345
新家工業	1.8	2.7	3,726
非鉄金属(0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	13.2	19.8	13,246
日本軽金属ホールディングス	232.1	326	75,958
三井金属鉱業	21.4	32.3	71,802
東邦亜鉛	4.4	6.7	15,497
三菱マテリアル	52.4	78.9	223,050
住友金属鉱山	101.4	163.6	477,712
ＤＯＷＡホールディングス	20.1	27.9	95,278
古河機械金属	13.2	19.8	27,046
大阪チタニウムテクノロジーズ	8.3	13.9	21,753
東邦チタニウム	14.3	21.5	22,940
ＵＡＣＪ	12.1	18.2	32,250
ＣＫサンエツ	1.5	2.3	6,377
古河電気工業	26.4	34.5	98,497
住友電気工業	296.6	446.6	593,978
フジクラ	96	144.6	52,345
昭和電線ホールディングス	9.8	13.8	10,570
東京特殊電線	1.1	1.6	2,585
タツタ電線	15.7	23.9	10,611
カナレ電気	1.4	2.1	3,927
平河ヒューテック	4	5.1	5,579
リョービ	9.8	14.8	30,206
アーレスティ	9.9	14.9	7,882
アサヒホールディングス	13.7	22.5	46,237
金属製品(0.5%)			
稲葉製作所	4.4	6.7	9,567
宮地エンジニアリンググループ	2.3	3.6	6,249
トーカロ	22.1	30.7	21,490
アルファＣｏ	2.8	4.2	5,002
ＳＵＭＣＯ	73	132	158,796
川田テクノロジーズ	1.6	2.7	21,006
RS Technologies	1.2	2.4	5,719
信和	－	6.3	6,255
東洋製罐グループホールディングス	54.2	76.1	159,049
ホッカンホールディングス	20	6.1	10,778
コロナ	4.3	6.6	6,666
横河ブリッジホールディングス	14.8	22.2	33,788
駒井ハルテック	1.7	2.3	3,684
高田機工	0.7	1.1	2,768
三和ホールディングス	76.1	123.4	135,493
文化シヤッター	23.3	35.2	29,040
三協立山	10.9	16.6	19,521
アルインコ	5.7	9.5	9,129
東洋シヤッター	2	2.9	1,586
ＬＩＸＩＬグループ	116.9	176.2	242,979

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
日本フイルコン	6	9.1	4,550
ノーリツ	17.7	26.7	37,219
長府製作所	9	12.2	26,596
リンナイ	14.1	21.3	154,851
ダイニチ工業	4.2	6.4	4,006
日東精工	10.8	16.5	9,141
三洋工業	1	1.6	2,859
岡部	16.1	24.2	23,619
ジーテクト	8.8	13.2	19,496
東プレ	14.8	22.3	39,783
高周波熱錬	15.2	23	19,504
東京製綱	5.7	7.3	7,241
サンコール	4.4	6.7	3,370
モリテック　スチール	6.2	9.3	3,255
パイオラックス	11.7	19.1	34,933
エイチワン	7.7	11.7	8,646
日本発條	79	119	95,795
中央発條	1	1.4	3,970
アドバネクス	1.3	1.6	2,728
立川ブラインド工業	3.5	5.3	6,476
三益半導体工業	6.7	10.7	15,803
機械(5.0%)			
日本ドライケミカル	1.1	3.3	3,623
日本製鋼所	26	36.3	59,931
三浦工業	34.4	51.7	175,004
タクマ	27	43.7	63,583
ツガミ	21	27	22,788
オークマ	9.3	15.2	80,256
東芝機械	45	13.6	30,504
アマダホールディングス	122.6	179.6	201,152
アイダエンジニアリング	20.4	32.5	23,887
滝澤鉄工所	2.5	3.8	5,339
ＦＵＪＩ	23.8	47.8	56,547
牧野フライス製作所	41	14.1	52,804
オーエスジー	36.7	58.9	119,567
ダイジェット工業	1.1	1.5	1,974
旭ダイヤモンド工業	23.7	31.5	20,664
ＤＭＧ森精機	44.1	75.7	100,832
ソディック	17.2	26.2	24,130
ディスコ	10.7	16.2	247,698
日東工器	4.9	6.6	14,183
日進工具	2.1	3.6	7,884
パンチ工業	6.5	8.4	4,065
冨士ダイス	3.9	5.4	3,099
豊和工業	4.5	6.8	5,820
ＯＫＫ	3.2	5.1	3,819
東洋機械金属	6.1	8.7	4,941
津田駒工業	－	2.7	4,293
島精機製作所	10.1	16.5	49,302

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
オプトラン	7.7	11.7	26,687
ＮＣホールディングス	2.5	4	1,888
イワキポンプ	－	5.2	5,080
フリュー	5.5	9.6	9,715
ヤマシンフィルタ	12.1	20.8	11,252
日阪製作所	11.4	14.8	13,349
やまびこ	15.3	23.3	21,319
平田機工	2.9	5.7	29,754
ペガサスミシン製造	7.2	11.3	5,989
マルマエ	－	5	3,795
タツモ	－	5.1	3,774
ナブテスコ	43.7	65.8	181,739
三井海洋開発	8.4	12.7	34,569
レオン自動機	7.1	11.8	19,009
ＳＭＣ	25.2	35.4	1,288,914
新川	5.9	5.9	2,017
ホソカワミクロン	3	4.2	19,593
ユニオンツール	3.6	5.2	14,128
オイレス工業	10.3	16.8	25,284
日精エー・エス・ビー機械	2.6	4.1	11,607
サトーホールディングス	10.4	14.4	39,110
技研製作所	5.5	10.5	34,125
日本エアーテック	2.7	3.9	2,312
カワタ	1.6	3.3	3,507
日精樹脂工業	6.9	10.2	9,404
オカダアイヨン	2.6	4.2	5,460
ワイエイシイホールディングス	2.6	4.7	3,680
小松製作所	387.4	546.9	1,317,208
住友重機械工業	46	69.2	239,778
日立建機	37.6	48.5	124,208
日工	2.3	3.4	8,809
巴工業	3.4	5.2	11,975
井関農機	8.2	12.2	18,129
ＴＯＷＡ	6.1	10.4	7,852
丸山製作所	1.9	2.8	3,099
北川鉄工所	3.9	5.5	11,242
ローツェ	4	5.3	11,628
タカキタ	2.7	4.4	2,296
クボタ	430.4	647.1	1,065,126
荏原実業	2.5	3.6	6,771
三菱化工機	2.9	4.3	6,170
月島機械	16.1	24.1	32,510
帝国電機製作所	5.5	8.5	10,259
新東工業	19.2	28.8	26,841
澁谷工業	7.1	10.6	30,506
アイチ　コーポレーション	14.2	21	13,797
小森コーポレーション	20.4	32.9	36,650
鶴見製作所	6.9	9.5	17,993
住友精密工業	13	2	5,674

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
酒井重工業	1.6	2.3	5,761
荏原製作所	33	53.6	148,472
石井鐵工所	1.4	1.9	3,697
酉島製作所	8.5	12.5	12,387
北越工業	8.9	12.5	15,575
ダイキン工業	109.5	164.9	2,275,620
オルガノ	3	4.4	14,784
トーヨーカネツ	3.5	4.6	10,106
栗田工業	43.5	65.4	168,143
椿本チエイン	48	15.8	51,666
大同工業	3.2	5.9	4,814
木村化工機	7.1	10.6	3,593
アネスト岩田	13.5	18.9	17,369
ダイフク	40.9	66.5	359,765
サムコ	2.2	3.4	2,658
加藤製作所	3.9	6.3	12,644
油研工業	1.7	2.1	3,410
タダノ	38.9	58.4	59,743
フジテック	25.6	44	62,656
ＣＫＤ	22.3	33.7	33,295
キトー	6.1	9.2	14,057
平和	24.9	33.7	75,252
理想科学工業	8	10.7	18,885
ＳＡＮＫＹＯ	20.1	30.3	126,957
日本金銭機械	7.3	13.4	15,034
マースグループホールディングス	5.1	7.7	15,969
福島工業	4.9	7.5	26,512
オーイズミ	3.3	5.3	2,014
ダイコク電機	3.6	5.6	7,431
竹内製作所	13.4	20.3	36,803
アマノ	24.8	34.5	98,118
ＪＵＫＩ	11.9	16.8	15,103
サンデンホールディングス	9.8	－	－
蛇の目ミシン工業	7.1	11.1	4,739
マックス	12.3	18.5	27,972
グローリー	23.9	33.5	92,259
新晃工業	8.1	11.3	18,091
大和冷機工業	12.9	17.5	21,000
セガサミーホールディングス	79.6	119.9	158,028
日本ピストンリング	2.9	4.5	6,169
リケン	3.7	5.6	25,536
ＴＰＲ	9	16.3	29,796
ツバキ・ナカシマ	8.1	18.4	31,703
ホシザキ	25.2	35.3	281,694
大豊工業	6.4	10	8,190
日本精工	164.7	248.1	221,801
ＮＴＮ	185.6	259.9	74,331
ジェイテクト	85.5	115.9	135,834
不二越	7.4	11.2	47,264
日本トムソン	25.5	35.9	15,831
ＴＨＫ	50	75.3	168,144
ユーシン精機	7	9.4	9,954
前澤給装工業	3.1	4.8	9,048
イーグル工業	9.9	15	15,555
前澤工業	5.7	8.3	2,822
日本ピラー工業	8	12.3	13,308
キッツ	35.1	49.1	34,566
マキタ	104.6	147	556,395
日立造船	64.1	96.2	34,728
三菱重工業	134.5	202.4	976,580
ＩＨＩ	61.7	92.9	226,861
スター精密	12.8	20.7	27,696
電気機器(13.0%)			
日清紡ホールディングス	49	67.2	51,475
イビデン	49.3	74.1	125,747
コニカミノルタ	188.1	264.2	261,558
ブラザー工業	98.1	157.5	294,682
ミネベアミツミ	149.1	224.4	356,571
日立製作所	1,926	543.7	2,048,661
三菱電機	802.1	1,207.7	1,675,079
富士電機	242	78.4	282,632
東洋電機製造	3.2	4.9	6,242
安川電機	93	140	442,400
シンフォニアテクノロジー	52	16.9	20,246
明電舎	68	24	36,096
オリジン	2.3	3.4	4,858
山洋電気	3.9	5.9	22,833
デンヨー	7.4	11.2	15,041
東芝テック	57	15.2	41,313
芝浦メカトロニクス	13	2.2	5,860
マブチモーター	22.5	33.5	124,285
日本電産	96.5	145.3	1,989,157
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3	6.8	7,724
トレックス・セミコンダクター	2.5	5.7	6,384
東光高岳	4.3	6.4	7,289
ダブル・スコープ	11.8	17.8	24,635
ダイヘン	44	13.3	38,330
ヤーマン	11.8	17.8	17,266
ＪＶＣケンウッド	59.6	93.2	22,181
ミマキエンジニアリング	7.6	11.3	6,565
第一精工	3.9	5.3	7,287
日新電機	18.7	28.4	29,280
大崎電気工業	17.2	24.1	15,255
オムロン	85.3	128.4	662,544
日東工業	12.8	19.4	36,976
ＩＤＥＣ	9.9	16.3	30,904
正興電機製作所	－	2.6	2,004
不二電機工業	1.2	1.6	2,076

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	145	43.6	85,586
サクサホールディングス	2	3.1	5,673
メルコホールディングス	4	5.1	15,300
テクノメディカ	1.8	1.8	3,798
日本電気	103.8	156.3	636,922
富士通	825	116.4	873,349
沖電気工業	32.6	52.4	72,154
岩崎通信機	3.4	5.6	4,300
電気興業	4.6	6.4	16,940
サンケン電気	47	14.2	30,359
ナカヨ	1.6	2.5	3,720
アイホン	4.5	6.9	11,074
ルネサスエレクトロニクス	41.9	125.7	59,079
セイコーエプソン	119.4	149.9	241,339
ワコム	62.5	88.3	29,580
アルバック	18.4	24.1	73,746
アクセル	3.9	5.6	3,141
ＥＩＺＯ	7.4	11.1	44,233
日本信号	22	30.9	34,144
京三製作所	18.8	26.2	9,458
能美防災	10.7	16.1	33,117
ホーチキ	6	7.9	9,258
星和電機	3.2	7.1	3,542
エレコム	7.1	11.5	41,285
パナソニック	916.3	1,379.8	1,226,642
シャープ	74.5	119.9	119,420
アンリツ	58.5	77.8	128,681
富士通ゼネラル	24.5	37	57,683
ソニー	536.2	810.3	4,305,934
ＴＤＫ	42	63.2	469,576
帝国通信工業	3.8	5.6	6,428
タムラ製作所	30.8	46.8	24,289
アルプスアルパイン	69.2	125.9	226,620
池上通信機	25	3.8	4,237
パイオニア	133	－	－
日本電波工業	7.8	－	－
鈴木	3.8	7	4,312
日本トリム	1.8	2.3	12,006
ローランド　ディー．ジー．	4.2	6.3	15,120
フォスター電機	9.3	13.7	21,550
クラリオン	42	－	－
ＳＭＫ	21	3.4	8,731
ヨコオ	5.4	8.8	17,538
ホシデン	20.6	35.8	38,341
ヒロセ電機	13.6	17.3	208,119
日本航空電子工業	21	27.8	42,228
ＴＯＡ	8.5	13.1	16,584
マクセルホールディングス	16.1	26.2	47,422
古野電気	10	15.9	14,580
ユニデンホールディングス	22	3.6	6,480
アルパイン	19.1	－	－
スミダコーポレーション	8.4	10.5	11,770
アイコム	4.4	6.7	14,699
リオン	3.5	5.7	11,913
本多通信工業	6.6	10.9	5,232
船井電機	7.3	－	－
横河電機	80.3	120.9	257,396
新電元工業	2.8	4.3	15,136
アズビル	24	78	201,552
東亜ディーケーケー	4.3	6.4	5,299
日本光電工業	33.6	53.3	163,631
チノー	2.7	4.3	4,962
共和電業	8.9	12.9	5,172
日本電子材料	3.1	5	2,535
堀場製作所	15.9	24	120,720
アドバンテスト	44.7	82.4	212,180
小野測器	3.9	6.1	3,531
エスペック	7.3	10.8	24,181
キーエンス	39.4	59.3	3,716,331
日置電機	4.3	6.4	22,720
シスメックス	62.5	94.1	726,828
日本マイクロニクス	14.1	21.3	19,659
メガチップス	6.4	9.7	11,640
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	4.7	6.2	22,599
澤藤電機	1.1	1.7	2,888
原田工業	－	5.3	3,895
コーセル	11.4	15.6	16,317
イリソ電子工業	6.8	11.1	56,166
新日本無線	4.7	－	－
オプテックスグループ	13.2	21.4	28,355
千代田インテグレ	4	5.2	10,280
アイ・オー・データ機器	3.7	4.7	4,794
レーザーテック	16.5	24.8	96,224
スタンレー電気	61.5	85.5	218,367
岩崎電気	3.3	4.9	6,688
ウシオ電機	48.9	70.4	96,940
岡谷電機産業	6.3	9.5	3,553
ヘリオス　テクノ　ホールディング	7.2	11.6	6,902
エノモト	－	3.7	2,708
日本セラミック	8.3	12.4	35,563
遠藤照明	4.4	6.5	4,719
古河電池	6.1	9.1	5,669
双信電機	4.2	6.7	2,974
山一電機	6	9.1	8,062
図研	5.4	8.1	11,988
日本電子	30	23.9	55,017
カシオ計算機	64.5	106.9	132,342
ファナック	76.2	114.8	2,104,858

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
日本シイエムケイ	14.4	27	16,848
エンプラス	3.7	5.6	17,108
大真空	3.2	4.7	4,812
ローム	36	57.8	374,544
浜松ホトニクス	58.5	86.7	342,465
三井ハイテック	10.7	13.6	14,157
新光電気工業	30.7	40.9	35,255
京セラ	131.7	184.1	1,235,679
太陽誘電	36.2	53.9	108,824
村田製作所	84.2	380.2	1,775,914
ユーシン	12.1	－	－
双葉電子工業	13.3	19.9	27,680
北陸電気工業	3.5	4.8	4,560
ニチコン	25.4	38.4	29,952
日本ケミコン	6.5	8.6	13,562
ＫＯＡ	11.2	18.5	22,533
市光工業	12.2	18.5	10,933
小糸製作所	48.1	72.4	382,996
ミツバ	15	22.6	12,678
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	15.2	21	79,905
キヤノン電子	7.5	11.2	19,454
キヤノン	431.8	650.2	2,000,015
リコー	241.2	363.2	383,539
象印マホービン	15	30.2	34,669
ＭＵＴＯＨホールディングス	1.3	1.8	2,961
東京エレクトロン	53.5	80.5	1,182,142
輸送用機器(7.8%)			
トヨタ紡織	23.4	42.3	58,754
芦森工業	1.7	2.6	4,183
ユニプレス	15.5	23.4	40,669
豊田自動織機	64.9	97.8	543,768
モリタホールディングス	12.9	21.2	41,615
三櫻工業	10.2	15.4	6,052
デンソー	178	265.9	1,153,208
東海理化電機製作所	21.1	31.8	53,964
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	28.9	41.9	36,830
川崎重工業	62.4	94	231,522
名村造船所	24.1	36.1	10,757
サノヤスホールディングス	9.5	－	－
日本車輌製造	29	4.4	10,991
三菱ロジスネクスト	10	14.4	16,531
近畿車輛	1.1	1.1	1,921
日産自動車	946	1,424.3	1,109,814
いすゞ自動車	232.4	381.7	471,399
トヨタ自動車	975.1	1,345.8	8,856,709
日野自動車	114.5	150.8	132,553
三菱自動車工業	296.9	447	236,463
エフテック	5	8.5	6,332
レシップホールディングス	2.8	4.3	3,126
ＧＭＢ	1.3	2.4	1,850
ファルテック	1.4	2.2	1,667
武蔵精密工業	8.6	29.4	39,778
日産車体	31.3	23.6	23,836
新明和工業	34.9	50.6	65,324
極東開発工業	15	24	32,928
日信工業	16.3	22.1	30,785
トピー工業	6.6	10	22,390
ティラド	2.9	4.4	8,254
曙ブレーキ工業	36.6	65.1	7,095
タチエス	13.6	19.9	26,825
ＮＯＫ	43.1	65	93,015
フタバ産業	24.4	33.6	18,345
ＫＹＢ	8.3	12.1	33,734
大同メタル工業	10.1	19.6	13,249
プレス工業	42.6	60	28,860
ミクニ	10.2	15.5	5,859
太平洋工業	16.7	25.3	36,609
ケーヒン	18.4	27.8	40,504
河西工業	9.7	14.8	11,248
アイシン精機	66	99.5	364,170
マツダ	251.7	379	438,692
今仙電機製作所	7.3	11.3	9,921
本田技研工業	721.8	1,018.8	2,810,869
スズキ	159	220.9	1,185,349
ＳＵＢＡＲＵ	249	374.9	981,300
安永	3.9	5.9	8,808
ヤマハ発動機	113.3	170.6	320,045
ショーワ	20.8	28.6	40,097
ＴＢＫ	9.3	14.5	5,539
エクセディ	9.7	16.4	36,080
豊田合成	29.1	39	76,635
愛三工業	14.1	18.9	13,286
盟和産業	1.2	1.9	2,033
日本プラスト	4.3	9.5	6,612
ヨロズ	8	11.3	15,051
エフ・シー・シー	13.1	21.7	49,432
シマノ	32.3	48.7	816,212
テイ・エス　テック	18.6	28.1	76,460
ジャムコ	4	6.1	13,493
精密機器(2.1%)			
テルモ	122.9	341.7	1,053,119
クリエートメディック	2.6	4	3,652
日機装	27.8	39	53,742
島津製作所	95.9	155.4	430,302
ＪＭＳ	7.3	11.1	7,237
長野計器	6.2	9.5	6,574
ブイ・テクノロジー	1.9	5.6	26,236
東京計器	5	7.7	7,114

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
愛知時計電機	1.1	1.6	6,368
インターアクション	4.2	6.1	8,454
オーバル	7.7	11.8	2,737
東京精密	14.5	21.8	55,088
マニー	9.8	16	108,320
ニコン	139.8	210.5	325,854
トプコン	43.1	64.9	90,016
オリンパス	119.5	719.6	942,676
理研計器	7.7	10.7	20,469
タムロン	6.5	10.7	24,374
ＨＯＹＡ	161.5	243.1	1,913,197
シード	1.1	5.2	5,642
ノーリツ鋼機	8.1	9.5	16,577
エー・アンド・デイ	7.2	11	8,712
朝日インテック	－	51.2	293,888
シチズン時計	95.8	132.2	66,761
リズム時計工業	3.1	4.1	4,961
大研医器	7	9.6	5,529
メニコン	11	16.6	61,669
シンシア	0.7	1.8	1,054
松風	3.9	5.9	7,528
セイコーホールディングス	12.4	18.6	38,334
ニプロ	55.5	83.6	102,828
その他製品(2.2%)			
中本パックス	2	3.4	5,038
スノーピーク	2.4	4.6	6,642
パラマウントベッドホールディングス	8.5	13.9	61,994
トランザクション	4.3	7.6	6,102
ＳＨＯ－ＢＩ	2.6	3.5	1,260
ニホンフラッシュ	3.7	5.2	13,364
前田工繊	8.8	13.3	26,161
永大産業	10.3	15.7	5,212
アートネイチャー	8.6	12.8	7,974
バンダイナムコホールディングス	82.9	124.9	671,962
アイフィスジャパン	1.7	2.7	1,620
共立印刷	13	20	3,500
ＳＨＯＥＩ	3.9	5.8	26,535
フランスベッドホールディングス	9.5	17.1	16,980
パイロットコーポレーション	14	21.1	84,927
萩原工業	4.4	6.7	8,703
トッパン・フォームズ	17.1	25.9	23,154
フジシールインターナショナル	18	27.1	101,896
タカラトミー	33.6	50.5	65,549
廣済堂	7.3	11.2	7,123
エステールホールディングス	2.3	3.2	1,926
アーク	40.1	45.9	4,681
タカノ	3.5	4.7	3,487
プロネクサス	7.4	10.4	13,010
ホクシン	5.5	7.4	932
ウッドワン	2.7	4.1	4,104
大建工業	6.3	9.1	20,020
凸版印刷	226	170.5	279,620
大日本印刷	105	170.2	411,203
図書印刷	5.3	11.3	14,780
共同印刷	2.5	3.7	9,823
ＮＩＳＳＨＡ	16.5	24.8	25,494
光村印刷	0.7	1	1,926
宝印刷	4.2	5.8	9,512
アシックス	79.7	113.9	147,272
ツツミ	2.5	3.8	7,216
小松ウオール工業	2.7	3.7	6,774
ヤマハ	54	71.8	360,436
河合楽器製作所	2.7	3.7	9,749
クリナップ	7.3	11.2	6,014
ピジョン	48.5	73	321,200
兼松サステック	0.6	0.8	1,263
キングジム	6.6	10	8,840
リンテック	19.1	28.7	62,365
イトーキ	16.9	22.1	8,994
任天堂	49.4	69.1	2,692,136
三菱鉛筆	13.2	19.9	39,402
タカラスタンダード	16.5	25	42,025
コクヨ	38.5	57.9	83,491
ナカバヤシ	7.7	11.8	5,911
グローブライド	3.6	5.8	19,430
オカムラ	27.9	42.1	45,510
美津濃	7.9	12	29,532
電気・ガス業(1.7%)			
東京電力ホールディングス	640.3	964.1	561,106
中部電力	245.4	369.5	555,912
関西電力	327.3	492.8	641,625
中国電力	110.9	167	229,124
北陸電力	78.6	118.3	94,048
東北電力	187.8	282.8	314,190
四国電力	72.2	108.7	108,591
九州電力	177.1	248.9	266,571
北海道電力	80.4	113	67,461
沖縄電力	16.125	22.4	38,147
電源開発	63.8	96.1	227,468
エフオン	3.9	5.6	4,272
イーレックス	12.7	21	27,048
レノバ	4	19.8	17,384
東京瓦斯	171.1	236.9	639,037
大阪瓦斯	155.6	234.4	451,923
東邦瓦斯	39.7	59.8	251,160
北海道瓦斯	22	6.5	9,581
広島ガス	16.1	24.7	8,348
西部瓦斯	9.7	13.6	31,293

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
静岡ガス	22.7	37.1	30,978
メタウォーター	4.5	5.8	19,314
陸運業(4.9%)			
ＳＢＳホールディングス	7.8	11.9	20,646
東武鉄道	84.6	127.4	404,495
相鉄ホールディングス	25.7	41.4	126,684
東京急行電鉄	217.9	328	636,976
京浜急行電鉄	109.9	165.4	308,471
小田急電鉄	119.3	193.4	517,345
京王電鉄	44.8	67.5	490,725
京成電鉄	55.8	90.5	369,240
富士急行	10.9	16.5	67,650
新京成電鉄	2.1	3.1	6,382
東日本旅客鉄道	144.1	214.7	2,244,688
西日本旅客鉄道	72.4	108.3	932,679
東海旅客鉄道	71.8	108.1	2,463,599
西武ホールディングス	102.2	149.6	271,524
鴻池運輸	11.2	19.2	31,987
西日本鉄道	22.2	33.5	81,036
ハマキョウレックス	5.7	9.3	33,759
サカイ引越センター	4.2	6.3	42,273
近鉄グループホールディングス	76	114.4	596,024
阪急阪神ホールディングス	101.3	152.5	602,375
南海電気鉄道	36	51	146,880
京阪ホールディングス	33.8	50.9	239,230
神戸電鉄	1.8	2.9	11,614
名古屋鉄道	60.5	93.8	281,869
山陽電気鉄道	5.8	8.8	19,632
日本通運	29.8	44.1	249,165
ヤマトホールディングス	133.2	200.5	441,501
山九	19.5	31.8	176,172
丸運	4.2	6.5	1,807
丸全昭和運輸	27	9.3	29,899
センコーグループホールディングス	45.5	63	52,101
トナミホールディングス	1.8	2.7	15,309
ニッコンホールディングス	28.9	43.5	109,011
日本石油輸送	0.9	1.4	3,955
福山通運	11.1	14.6	56,794
セイノーホールディングス	56.9	85.7	120,665
エスライン	2	3.4	3,230
神奈川中央交通	1.9	2.8	10,808
日立物流	16.7	25.1	80,696
丸和運輸機関	4	6	23,910
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	8.2	11.6	15,810
九州旅客鉄道	63.8	96	320,640
ＳＧホールディングス	71.8	108.1	314,895
海運業(0.2%)			
日本郵船	63.8	96.1	157,700
商船三井	48.2	68.2	158,974
川崎汽船	35.3	34.7	42,750
ＮＳユナイテッド海運	3.8	6.6	14,605
飯野海運	39.7	56.3	19,873
共栄タンカー	0.9	1.5	2,236
乾汽船	5.7	10.2	7,925
空運業(0.6%)			
日本航空	140.9	209.4	724,733
ＡＮＡホールディングス	147.5	209.1	765,933
パスコ	7	2.2	1,773
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	2.1	3.2	20,736
日新	6.6	9.9	17,691
三菱倉庫	26.3	39.6	115,394
三井倉庫ホールディングス	43	14	22,722
住友倉庫	53	42.1	59,066
澁澤倉庫	4.1	6.3	11,277
東陽倉庫	13.4	20.5	6,334
日本トランスシティ	18.4	25.1	11,219
ケイヒン	1.4	2.2	2,620
中央倉庫	4.6	7	7,056
川西倉庫	1.5	2.3	2,421
安田倉庫	6.7	9.4	8,366
ファイズ	－	2	1,508
東洋埠頭	2.3	3.5	4,858
宇徳	6.3	9.7	4,956
上組	46.9	70.5	180,762
サンリツ	1.9	2.7	1,657
キムラユニティー	2	3.1	3,186
キユーソー流通システム	2.2	2.9	5,640
近鉄エクスプレス	14.3	21.6	30,412
東海運	4.2	6.5	1,612
エーアイテイー	5.3	7.4	7,488
内外トランスライン	2.6	3.6	4,248
日本コンセプト	1.4	4.2	4,935
情報・通信業(9.1%)			
ＮＥＣネッツエスアイ	8.7	13.1	36,496
クロスキャット	－	3.3	3,379
システナ	25.2	42.4	67,755
デジタルアーツ	3.9	6.4	56,192
日鉄ソリューションズ	12.2	17.8	58,918
キューブシステム	4.6	6.5	6,240
エイジア	1.7	2.5	2,757
コア	3.4	5.1	7,609
ソリトンシステムズ	3.5	6.9	6,644
ソフトクリエイトホールディングス	3.8	5.3	7,854
ＴＩＳ	26.3	39.5	215,670
ネオス	2.6	2.6	2,184
電算システム	2.8	4.6	19,527
グリー	42.2	82.1	40,721

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
コーエーテクモホールディングス	13.5	24.3	48,381
三菱総合研究所	3.4	5.1	16,549
ボルテージ	1.7	－	－
電算	0.9	1.4	2,695
ＡＧＳ	4.5	6.9	4,754
ファインデックス	6.5	10.2	8,945
ヒト・コミュニケーションズ	1.8	－	－
ブレインパッド	1.7	2.3	18,584
ＫＬａｂ	15	21.2	19,419
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	5.8	15.9	16,933
イーブックイニシアティブジャパン	1.3	2	4,454
ネクソン	176.9	302.4	499,867
アイスタイル	20.1	30.6	24,755
エムアップ	2.7	4.2	8,198
エイチーム	5.4	8.3	12,948
テクノスジャパン	7.1	10.2	5,814
コロプラ	25.4	39.1	27,409
モバイルクリエイト	6.5	－	－
ブロードリーフ	39.1	59.1	34,100
クロス・マーケティンググループ	2.4	4.9	1,754
デジタルハーツホールディングス	4.2	5.6	5,756
システム情報	－	6.2	5,332
メディアドゥホールディングス	2.6	3.7	13,431
じげん	－	16.9	11,982
エンカレッジ・テクノロジ	－	1.8	1,585
サイバーリンクス	1.3	2	2,226
フィックスターズ	7.5	12.7	23,291
CARTA HOLDINGS	4.2	5.8	9,674
オプティム	1.4	5.3	11,697
セレス	2.5	4	7,008
ベリサーブ	1.1	－	－
ティーガイア	7.9	12	21,456
セック	1.1	2	6,600
日本アジアグループ	8.1	12.4	4,426
豆蔵ホールディングス	6	8.2	10,578
テクマトリックス	4.4	8.4	15,766
プロシップ	1.2	3.6	4,122
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	213.8	286.1	92,982
GMOペイメントゲートウェイ	6.5	19.5	144,300
ザッパラス	4.1	6.6	2,488
システムリサーチ	1.1	1.6	4,612
インターネットイニシアティブ	12.9	19.4	41,050
さくらインターネット	9.4	14.4	7,286
ヴィンクス	2.3	4.1	5,793
GMOクラウド	1.8	2.7	8,653
ＳＲＡホールディングス	4.2	6.4	15,737
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	1.6	2.4	3,825
朝日ネット	7.2	9.9	5,682

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ｅＢＡＳＥ	2.1	7.2	7,725
アバント	2.2	4.3	8,853
アドソル日進	3.1	4.3	7,310
フリービット	5.6	7.2	7,502
コムチュア	4	6.7	29,949
サイバーコム	1.5	2.2	4,373
アステリア	4	8.1	8,982
マークラインズ	－	5.5	10,978
メディカル・データ・ビジョン	6	10.6	15,709
ｇｕｍｉ	9.2	－	－
ショーケース	1.6	2.9	1,615
モバイルファクトリー	2	3.4	5,259
テラスカイ	－	2	2,842
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3.6	5.3	10,011
ＰＣＩホールディングス	1.4	2.5	5,032
パイプドHD	1.3	2	2,282
アイビーシー	1.4	2.3	3,132
ネオジャパン	1.9	2.4	2,347
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	－	1.1	3,261
ランドコンピュータ	－	2	2,390
ダブルスタンダード	－	1.1	5,247
オープンドア	3.2	5.9	17,410
マイネット	2.2	4	3,120
アカツキ	2.1	4.2	24,570
ベネフィットジャパン	0.5	1.1	947
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	1.3	2.3	3,502
ＬＩＮＥ	23.8	36.2	118,555
カナミックネットワーク	－	2.5	5,650
ノムラシステムコーポレーション	－	1.5	1,134
チェンジ	－	2.2	5,915
シンクロ・フード	2.7	5.3	3,079
オークネット	3.4	6.4	8,108
エイトレッド	－	1.4	2,384
AOI TYO Holdings	6.4	13.1	9,903
マクロミル	9.9	21.1	25,784
ビーグリー	1.8	3.2	2,844
オロ	0.8	3.2	8,992
ソルクシーズ	3.1	5.2	4,139
フェイス	2.8	4.9	3,900
プロトコーポレーション	－	5.4	10,173
ハイマックス	1.1	1.5	2,682
野村総合研究所	50	75.4	397,358
サイバネットシステム	6.5	10	6,610
ＣＥホールディングス	2.3	3.6	3,657
日本システム技術	1.3	2	3,060
インテージホールディングス	9.4	15.3	15,651
東邦システムサイエンス	2.7	3.7	3,381
ソースネクスト	11	46.4	20,926
インフォコム	－	13	29,848

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ＦＩＧ	－	11	3,388
アルテリア・ネットワークス	－	13.3	15,534
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	－	2.8	4,734
フォーカスシステムズ	4.5	8.1	7,038
クレスコ	1.8	3.7	12,968
フジ・メディア・ホールディングス	82.5	123.1	186,496
オービック	24.8	41.1	546,219
ジャストシステム	12.9	16.9	57,882
ＴＤＣソフト	3.5	10.5	8,578
ヤフー	567.8	773.3	238,949
トレンドマイクロ	38.5	63.2	313,156
ＩＤホールディングス	2.5	4.7	5,071
日本オラクル	12.8	24	177,840
アルファシステムズ	2.6	3.8	10,602
フューチャー	10.8	16.2	31,995
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5.9	8.6	15,110
ソフトバンク・テクノロジー	3.3	5.1	11,995
トーセ	2.2	3.4	2,985
オービックビジネスコンサルタント	4	12.1	59,713
伊藤忠テクノソリューションズ	35.9	54.1	146,124
アイティフォー	9.5	14.6	12,249
東計電算	1.4	1.8	5,499
エックスネット	1.4	2.4	2,220
大塚商会	47.3	64.2	273,171
サイボウズ	10.5	14	16,534
ソフトブレーン	6.3	9.7	4,665
電通国際情報サービス	4.9	7.4	26,344
デジタルガレージ	14.2	23.1	86,625
ＥＭシステムズ	5.4	9.7	14,491
ウェザーニューズ	2.7	4.1	13,304
ＣＩＪ	6.4	9.4	9,663
東洋ビジネスエンジニアリング	0.9	1.3	2,832
日本エンタープライズ	8.4	13.3	2,167
WOWOW	3.8	5.8	15,712
スカラ	6.4	8.4	6,997
インテリジェント　ウェイブ	－	4.7	3,821
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	6.8	10.3	5,706
ネットワンシステムズ	32.2	42	125,286
システムソフト	19	29.8	2,860
アルゴグラフィックス	3.7	10.1	24,492
マーベラス	13.3	18.3	15,390
エイベックス	14.6	20.5	28,249
日本ユニシス	21.9	37.1	134,673
兼松エレクトロニクス	5	6.5	20,735
東京放送ホールディングス	43.6	78.7	143,155
日本テレビホールディングス	72.3	108.9	172,715
朝日放送グループホールディングス	7.8	12	8,772
テレビ朝日ホールディングス	21.7	32.7	58,173
スカパーＪＳＡＴホールディングス	60	90.9	38,178
テレビ東京ホールディングス	6.5	9.8	22,236
日本ＢＳ放送	2.7	4.2	4,464
ビジョン	2.1	3.7	20,942
スマートバリュー	－	3.7	2,804
ワイヤレスゲート	3.7	5.6	2,329
コネクシオ	5.6	8.5	11,441
クロップス	1.8	2.4	1,500
日本電信電話	564.9	810.6	3,988,152
ＫＤＤＩ	708.8	1,044.4	2,914,920
ソフトバンク	－	1,256.6	1,782,487
光通信	9.5	14	314,580
ＮＴＴドコモ	565.2	750.4	1,883,504
エムティーアイ	10.5	11.7	7,616
ＧＭＯインターネット	28.7	43.3	75,904
アイドママーケティングコミュニケーション	1.9	2.9	1,856
カドカワ	23.1	34.7	50,488
学研ホールディングス	2.7	4	18,360
ゼンリン	14.3	23.7	49,106
昭文社	3.7	5.9	2,236
インプレスホールディングス	6.4	9.8	1,303
アイネット	4.5	6.9	8,804
松竹	5.2	7.9	102,305
東宝	51.8	78	372,060
東映	3	5	73,300
エヌ・ティ・ティ・データ	244.6	315.7	410,094
ピー・シー・エー	1.2	1.6	5,592
ビジネスブレイン太田昭和	1.4	2.1	4,281
ＤＴＳ	8.2	13.3	59,517
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36.6	55.2	203,688
シーイーシー	4.7	12.8	25,779
カプコン	33.8	50.9	114,932
アイ・エス・ビー	1.6	2.4	3,938
ジャステック	4.6	7.1	6,418
ＳＣＳＫ	18.2	31.3	162,134
日本システムウエア	2.6	4	9,744
アイネス	10.1	15.2	18,711
ＴＫＣ	7.2	10.1	45,096
富士ソフト	10.9	17.7	83,278
ＮＳＤ	13	19.5	59,670
コナミホールディングス	32.2	48.5	249,290
福井コンピュータホールディングス	2.4	4	9,948
ＪＢＣＣホールディングス	6.2	9.5	12,511
ミロク情報サービス	7	11.8	39,058
ソフトバンクグループ	356.3	495.2	5,199,600
卸売業(4.9%)			
ホウスイ	0.6	1	836
高千穂交易	3	4.6	4,471
伊藤忠食品	2	2.9	12,832

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
エレマテック	3.7	11.2	11,972
ＪＡＬＵＸ	2.2	3.4	9,503
あらた	3.9	8.8	33,792
トーメンデバイス	1.2	1.8	4,077
東京エレクトロン　デバイス	2.9	4.3	7,860
フィールズ	5.9	10.4	5,553
双日	467.5	656.9	233,856
アルフレッサ　ホールディングス	87.8	132.2	367,912
横浜冷凍	20.1	33.4	32,197
神栄	1.1	1.6	1,240
ラサ商事	3.4	6.3	4,876
ラクーンホールディングス	4.8	5.7	3,682
アルコニックス	8.3	12.6	17,136
神戸物産	5.1	18	91,800
ペッパーフードサービス	5.7	－	－
あい　ホールディングス	12.7	17	30,090
ディーブイエックス	2.8	4.7	3,755
ダイワボウホールディングス	6.7	10.8	49,140
マクニカ・富士エレホールディングス	15.1	33	41,778
ラクト・ジャパン	1.5	5	22,175
バイタルケーエスケー・ホールディングス	14.8	22.4	23,766
八洲電機	6	9.2	7,534
メディアスホールディングス	4.3	6.7	4,958
レスターホールディングス	5.1	13	19,929
ジューテックホールディングス	1.8	2.7	2,473
大光	2	5	3,305
ＯＣＨＩホールディングス	2.3	3.5	3,930
ＴＯＫＡＩホールディングス	41.8	62.9	56,861
黒谷	－	2.7	1,188
Ｃｏｍｉｎｉｘ	1.2	2.1	1,818
三洋貿易	4.3	6	13,254
ビューティガレージ	1.1	1.9	2,426
ウイン・パートナーズ	5.6	7.7	8,246
ミタチ産業	1.8	3.6	2,487
シップヘルスケアホールディングス	16.5	24.8	119,908
明治電機工業	2.7	3.7	4,810
デリカフーズホールディングス	1.5	2.1	3,150
スターティアホールディングス	1.8	2.3	1,225
コメダホールディングス	14.6	27.5	57,530
富士興産	3	4.6	3,169
協栄産業	1	1.4	2,100
小野建	7	10.7	14,605
南陽	－	2.4	3,734
佐鳥電機	5.7	8.8	7,744
エコートレーディング	1.8	2.7	1,447
伯東	4.8	8.2	9,643
コンドーテック	6.2	9.2	8,344
中山福	4.4	6.8	3,495
ナガイレーベン	11.4	17.2	41,744

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
三菱食品	8.7	13.1	37,806
松田産業	5.7	8.7	12,841
第一興商	11.8	17.7	88,146
メディパルホールディングス	79.2	128.4	307,518
ＳＰＫ	1.7	2.6	6,120
萩原電気ホールディングス	2.8	4.4	11,668
アズワン	6.2	8.5	82,875
スズデン	2.7	4.1	5,576
尾家産業	2.3	3.8	4,776
シモジマ	4.8	7.3	7,723
ドウシシャ	8.4	11.2	19,790
小津産業	1.7	2.6	4,490
高速	4.6	7.1	7,838
たけびし	2.7	4.2	5,195
リックス	1.8	2.7	3,982
丸文	6.9	10.5	5,733
ハピネット	5.3	9.9	13,473
橋本総業ホールディングス	1.6	2.4	3,408
日本ライフライン	22.5	37.3	67,997
タカショー	－	5.8	2,673
エクセル	2.9	2.9	4,901
マルカ	2.6	3.9	7,218
ＩＤＯＭ	23.9	40	11,040
日本エム・ディ・エム	5.2	7	9,975
進和	4.7	7	14,861
エスケイジャパン	1.9	2.9	1,470
ダイトロン	3.6	5.5	6,286
シークス	10.1	15.1	19,282
田中商事	2.4	4	2,332
オーハシテクニカ	4.4	6.7	9,359
白銅	2.8	3.8	4,978
伊藤忠商事	579.7	832	1,666,496
丸紅	649.2	1,172.9	804,022
高島	1.4	1.9	3,148
長瀬産業	47.6	66.9	106,036
蝶理	5.1	7.6	12,008
豊田通商	88.2	132.8	421,640
三共生興	13.2	20.2	10,504
兼松	33.7	47.5	58,567
ツカモトコーポレーション	1.4	2.1	2,076
三井物産	671.1	979.9	1,630,063
日本紙パルプ商事	4.1	6.8	26,792
日立ハイテクノロジーズ	27.4	36.2	167,787
カメイ	10.3	15.5	18,011
東都水産	1.2	1.7	4,318
ＯＵＧホールディングス	1.3	1.9	4,864
スターゼン	3.1	4.4	17,424
山善	30.9	46.5	46,872
椿本興業	1.8	2.7	7,970

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
住友商事	498.3	703.5	1,098,867
内田洋行	3.6	5.1	18,385
三菱商事	554.4	834.7	2,373,052
第一実業	3.6	5.4	18,090
キヤノンマーケティングジャパン	22.6	34	79,220
西華産業	4.8	6.7	8,509
佐藤商事	7	10.6	9,296
菱洋エレクトロ	7.4	12.1	19,723
東京産業	7.7	11.8	5,451
ユアサ商事	7.5	12.2	36,661
神鋼商事	1.8	2.7	6,161
小林産業	5.2	7.1	2,300
阪和興業	14.8	20.6	57,103
正栄食品工業	4.4	8.3	25,979
カナデン	7.6	10.7	13,792
菱電商事	5.6	9.4	14,739
フルサト工業	4.3	6.6	9,662
岩谷産業	17.5	26.4	95,700
すてきナイスグループ	3.3	5	3,010
昭光通商	28	4.2	2,667
ニチモウ	1.2	1.9	3,306
極東貿易	11	3.7	5,742
イワキ	11	14.2	6,503
三愛石油	21.1	32	30,176
稲畑産業	18.9	28.6	39,325
ＧＳＩクレオス	2.1	3.2	3,651
明和産業	7.1	11	3,839
クワザワ	－	4.2	2,142
ワキタ	16.8	25.4	26,898
東邦ホールディングス	23.4	35.2	88,000
サンゲツ	26.3	35.4	74,233
ミツウロコグループホールディングス	11.3	15.7	12,073
シナネンホールディングス	3.6	4.9	9,158
伊藤忠エネクス	17.4	26.3	22,328
サンリオ	22.2	36.7	92,630
サンワテクノス	5.1	7.2	5,745
リョーサン	9.9	13.1	34,649
新光商事	8.6	11.2	20,809
トーホー	3.6	5.4	11,907
三信電気	7.3	8.2	14,825
東陽テクニカ	9	13.7	12,330
モスフードサービス	10.4	15.6	37,689
加賀電子	7.2	11.8	19,304
ソーダニッカ	8	12.2	6,380
立花エレテック	5.4	8.8	13,464
フォーバル	3.4	5.2	4,820
ＰＡＬＴＡＣ	11.1	21.4	121,766
三谷産業	8.4	13.9	3,947
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2.1	2.7	11,313
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.6	1	1,220
国際紙パルプ商事	－	27.7	7,451
ヤマタネ	4	6	8,220
丸紅建材リース	8	1.2	2,017
日鉄物産	6.2	8.5	35,657
泉州電業	2.6	4	9,512
トラスコ中山	16.4	24.8	59,718
オートバックスセブン	31.4	47.3	81,166
モリト	6.2	8.6	6,888
加藤産業	12.4	18.6	65,751
北恵	－	2.3	1,805
イノテック	6.7	7.1	5,822
イエローハット	7.5	22.5	31,252
ＪＫホールディングス	7.8	10.7	5,992
日伝	6.6	9.9	16,344
北沢産業	6.4	9	2,547
杉本商事	4.3	6.4	13,260
因幡電機産業	10.5	16.9	74,022
バイテックホールディングス	3.6	－	－
東テク	2.6	3.9	8,034
ミスミグループ本社	91.8	149	379,354
アルテック	6.6	8.8	1,786
タキヒヨー	2.6	3.6	6,339
蔵王産業	1.3	2	2,614
スズケン	36	54.3	368,697
ジェコス	5.4	8.2	7,781
ルネサスイーストン	7.1	10.9	4,817
小売業(4.6%)			
ローソン	20	30.1	155,316
サンエー	6	9	39,375
カワチ薬品	6.2	9.3	16,953
エービーシー・マート	14.4	18.6	126,666
ハードオフコーポレーション	3.6	4.9	3,449
アスクル	6.9	12.5	35,225
ゲオホールディングス	14.5	18.2	25,298
アダストリア	12.3	16.5	48,196
ジーフット	4.9	7.3	4,686
くら寿司	4.7	7	30,625
キャンドゥ	3.8	5.7	9,444
パルグループホールディングス	4.1	6.1	20,435
エディオン	30.7	50.5	49,136
サーラコーポレーション	13.8	24.4	13,883
ワッツ	3.2	5.4	3,715
ハローズ	3	4.5	10,098
フジオフードシステム	－	5	14,080
あみやき亭	1.7	2.6	8,775
ひらまつ	10.9	23.9	8,221
大黒天物産	1.9	2.9	10,164
ハニーズホールディングス	7.7	10.6	10,727

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ファーマライズホールディングス	2	3	1,590
アルペン	6.1	9.2	15,262
ハブ	2.1	3.9	5,042
クオールホールディングス	8.8	17.6	26,329
ジンズ	5.4	6.3	41,391
ビックカメラ	42.1	70.7	81,658
ＤＣＭホールディングス	42.7	64.3	70,858
ペッパーフードサービス	－	9.5	18,078
ＭｏｎｏｔａＲＯ	28.1	75.2	169,952
東京一番フーズ	2.1	3.2	1,920
ＤＤホールディングス	1.8	2.6	5,184
きちりホールディングス	2.3	3.3	2,465
アークランドサービスホールディングス	6.7	8.8	17,168
Ｊ．フロント　リテイリング	94.4	152.3	179,561
ドトール・日レスホールディングス	13.9	20.9	43,890
マツモトキヨシホールディングス	32.7	49.2	157,440
ブロンコビリー	4.2	6.3	14,112
ＺＯＺＯ	77.7	128.6	237,910
トレジャー・ファクトリー	2.5	3.6	2,552
物語コーポレーション	2.3	2.9	25,520
ココカラファイン	8.3	13.4	57,419
三越伊勢丹ホールディングス	147.8	222.7	202,211
Ｈａｍｅｅ	2.3	3.8	2,557
ウエルシアホールディングス	20.9	31.5	122,377
クリエイトＳＤホールディングス	11.7	17.6	41,395
丸善ＣＨＩホールディングス	9	13.8	5,216
ティーライフ	1.2	1.7	1,463
エー・ピーカンパニー	1.7	2.5	1,077
チムニー	2.5	3.7	9,312
シュッピン	4.8	8.2	7,011
ネクステージ	8.5	18.6	21,706
ジョイフル本田	11.6	34.9	43,729
鳥貴族	2.9	4	7,844
キリン堂ホールディングス	2.9	4.8	7,939
ホットランド	4.6	6.3	10,029
すかいらーくホールディングス	49.2	110.9	220,912
ＳＦＰホールディングス	－	5.1	9,363
綿半ホールディングス	3	4.5	10,912
ヨシックス	1.3	2	5,080
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	26.3	34.7	33,312
ブックオフコーポレーション	4.4	－	－
ゴルフダイジェスト・オンライン	3.3	5	3,555
ＢＥＥＮＯＳ	1.9	4.2	8,068
あさひ	5.9	9.9	13,345
日本調剤	2.8	4.2	15,141
コスモス薬品	4	5.3	94,711
トーエル	3.9	5.9	4,124
一六堂	2	－	－
オンリー	1.5	2.2	1,755
セブン＆アイ・ホールディングス	331.1	498.6	1,874,736

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
薬王堂	3.5	5.2	11,523
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	21.2	32.1	46,416
ツルハホールディングス	17.1	25.9	227,920
サンマルクホールディングス	5.7	9.4	22,654
フェリシモ	2.1	2.8	2,531
トリドールホールディングス	9.8	14.7	27,680
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	7.1	10.8	8,996
ウイルプラスホールディングス	0.9	2	1,538
ジャパンミート	－	6.1	10,559
サツドラホールディングス	1.4	1.8	3,366
デファクトスタンダード	－	0.9	315
アレンザホールディングス	3.8	6.6	5,702
バロックジャパンリミテッド	6.4	9.8	9,084
クスリのアオキホールディングス	6.3	11.8	84,134
力の源ホールディングス	1.8	4.6	3,270
スシローグローバルホールディングス	8.7	13.1	101,394
ＬＩＸＩＬビバ	10.1	10.2	12,821
メディカルシステムネットワーク	9.2	12.8	6,412
総合メディカル	6.9	－	－
はるやまホールディングス	3.8	5.7	4,662
ノジマ	14	21.2	40,407
カッパ・クリエイト	9.7	16.7	23,329
ライトオン	6.7	9	6,363
良品計画	10.5	16.9	334,282
三城ホールディングス	9.8	15	4,995
アドヴァン	8.1	18.3	19,526
アルビス	2.6	4.6	11,113
コナカ	10.1	14.2	5,694
ハウス　オブ　ローゼ	1	1.5	2,361
Ｇ－７ホールディングス	2.4	3.5	10,552
イオン北海道	7.9	12.1	8,675
コジマ	13.7	20.6	10,135
ヒマラヤ	2.6	4.3	3,676
コーナン商事	11.3	15.7	36,204
エコス	3.3	4.5	6,421
ワタミ	－	15.7	22,231
マルシェ	2.2	3.3	2,560
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	51.2	71.2	489,856
西松屋チェーン	17.4	26.2	23,318
ゼンショーホールディングス	41.1	56.2	130,327
幸楽苑ホールディングス	5	7.6	23,560
ハークスレイ	2	2.6	2,654
サイゼリヤ	13.1	19.7	48,698
ＶＴホールディングス	27.1	54	24,354
魚力	2.3	3.4	5,045
ポプラ	2	－	－
フジ・コーポレーション	1.4	3.2	6,953
ユナイテッドアローズ	9.8	13.6	50,456
ハイデイ日高	10.4	17.2	35,122
京都きもの友禅	5.2	7.9	2,796

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
コロワイド	26.3	39.6	83,991
ピーシーデポコーポレーション	12	16	6,448
壱番屋	5.6	8.4	38,850
トップカルチャー	3.1	－	－
ＰＬＡＮＴ	1.9	3.2	2,432
スギホールディングス	17.4	26.1	134,937
ヴィア・ホールディングス	9.4	－	－
スクロール	12.2	18.6	6,491
ヨンドシーホールディングス	8.1	13.3	32,398
ユニー・ファミリーマートホールディングス	25.3	133.1	362,697
木曽路	9.7	14.6	37,244
ＳＲＳホールディングス	9.5	14.1	14,255
タカキュー	6.7	9.8	1,715
ケーヨー	14.4	22.2	11,033
上新電機	9.4	14.1	31,710
日本瓦斯	14.5	19.4	50,149
ロイヤルホールディングス	14.1	20.8	57,428
いなげや	8.7	13.4	18,371
島忠	17.9	25.2	63,327
チヨダ	9.4	12.6	20,928
ライフコーポレーション	6	9.1	19,346
リンガーハット	9.8	14.7	35,015
ＭｒＭａｘＨＤ	10.1	16.5	7,507
テンアライド	7.1	10.9	4,490
ＡＯＫＩホールディングス	15.9	23.9	24,640
オークワ	11	17.1	18,143
コメリ	12.2	18.4	39,744
青山商事	15.2	20.8	44,158
しまむら	9.2	13.9	115,231
はせがわ	4.4	6.6	2,593
高島屋	124	93.4	111,239
松屋	15.9	24.1	22,943
エイチ・ツー・オー　リテイリング	37.5	61.2	72,889
近鉄百貨店	3.1	4.6	15,157
パルコ	7.6	11.5	12,270
丸井グループ	75.7	100.7	226,877
アクシアル　リテイリング	6.6	9.9	39,946
イオン	304	457.8	890,192
イズミ	14.3	24.2	113,014
東武ストア	1	－	－
平和堂	16.1	24.2	46,464
フジ	9.5	14.4	25,732
ヤオコー	9	13.5	72,090
ゼビオホールディングス	10.7	14.5	18,067
ケーズホールディングス	69.4	123.7	132,977
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	4.8	7.2	4,860
日産東京販売ホールディングス	11.7	17.9	5,029
Ｇｅｎｋｙ ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3.3	5.9	15,930
総合メディカルホールディングス	－	10.4	18,959
ブックオフグループホールディングス	－	6.2	5,319
アインホールディングス	10.6	16	134,400
元気寿司	2	3.4	12,563
ヤマダ電機	265	362.6	183,475
アークランドサカモト	13.5	20.3	27,831
ニトリホールディングス	31.4	51.5	669,500
グルメ杵屋	6	8.6	9,915
愛眼	6.1	9.4	2,359
ケーユーホールディングス	4.2	6.3	5,216
吉野家ホールディングス	26	41.6	75,504
松屋フーズホールディングス	3.8	5.8	19,662
サガミホールディングス	10.7	16	21,264
関西スーパーマーケット	6	9.1	9,882
王将フードサービス	5.8	8.7	60,204
プレナス	8.8	13.4	25,058
ミニストップ	5.9	8.9	14,960
アークス	14.9	22.4	48,048
バローホールディングス	18.4	25.7	58,904
藤久	0.7	－	－
ベルク	3.5	5.9	30,562
大庄	4.3	6.4	10,028
ファーストリテイリング	10.6	15.9	1,036,362
サンドラッグ	33.5	44.8	124,096
サックスバー　ホールディングス	7.5	10.2	10,312
ヤマザワ	1.7	2.5	4,047
やまや	1.7	2.1	4,223
ベルーナ	19.4	29.2	22,396
銀行業(5.9%)			
島根銀行	1.6	3.8	2,644
じもとホールディングス	52.5	80.1	7,128
めぶきフィナンシャルグループ	411.1	622	168,562
東京さらぼしフィナンシャルグループ	10.7	16.6	27,257
九州フィナンシャルグループ	129.8	197.4	85,079
ゆうちょ銀行	224.1	338.2	378,107
富山第一銀行	19.8	30.8	9,825
コンコルディア・フィナンシャルグループ	472.4	749.2	314,664
西日本フィナンシャルホールディングス	52.8	76	60,420
関西みらいフィナンシャルグループ	34.4	57.1	40,712
三十三フィナンシャルグループ	6.7	10.9	15,608
第四北越フィナンシャルグループ	－	21	59,283
新生銀行	68.5	87.4	136,256
あおぞら銀行	47.1	66.5	174,695
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,538.4	8,199.5	4,144,847
りそなホールディングス	868.2	1,307.1	608,193
三井住友トラスト・ホールディングス	155.5	234.1	930,547
三井住友フィナンシャルグループ	598.8	839.5	3,206,050
第四銀行	9.7	－	－
北越銀行	7.9	－	－
千葉銀行	280.2	411.3	216,343
群馬銀行	160.7	240.4	92,073
武蔵野銀行	12.6	18.1	36,869
千葉興業銀行	21.7	36.4	8,772
筑波銀行	32.7	49.3	8,381

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
七十七銀行	24.8	37.9	62,345
青森銀行	6.1	9.5	26,818
秋田銀行	5.1	8	17,368
山形銀行	8.9	13.9	22,796
岩手銀行	5.5	8.6	24,828
東邦銀行	70.7	106.5	26,944
東北銀行	4	6.1	6,417
みちのく銀行	5	7.6	12,593
ふくおかフィナンシャルグループ	321	105.3	201,649
静岡銀行	208.9	300.8	263,200
十六銀行	10.6	16.4	37,752
スルガ銀行	80.9	－	－
八十二銀行	143.2	289.3	130,474
山梨中央銀行	49	15	18,420
大垣共立銀行	12.5	25.4	62,077
福井銀行	6.8	10.7	16,510
北國銀行	9	12.5	37,875
清水銀行	2.7	5.4	9,369
富山銀行	1.5	2.6	6,466
滋賀銀行	74	24.2	63,113
南都銀行	9.3	19	40,451
百五銀行	75.6	109.7	35,652
京都銀行	30.2	42.9	181,467
紀陽銀行	29.8	42.7	63,708
ほくほくフィナンシャルグループ	52.7	80	94,480
広島銀行	116.8	177.3	99,465
山陰合同銀行	46.9	71.8	51,193
中国銀行	54.7	103.3	107,018
鳥取銀行	2.5	4.7	6,406
伊予銀行	112.9	159.3	89,685
百十四銀行	84	13	28,769
四国銀行	12	17.8	16,696
阿波銀行	63	18.5	50,005
大分銀行	4.6	7.6	24,662
宮崎銀行	5.3	8.3	21,472
佐賀銀行	4.8	7.7	12,604
十八銀行	49	－	－
沖縄銀行	7.7	11.1	38,406
琉球銀行	15.3	28.2	33,078
セブン銀行	296.7	405.3	114,699
みずほフィナンシャルグループ	10,748.6	16,185.5	2,513,608
高知銀行	2.8	4.3	3,061
山口フィナンシャルグループ	99	149.7	122,754
長野銀行	2.6	4.5	7,438
名古屋銀行	6.4	9.9	35,145
北洋銀行	119.3	182.9	46,639
愛知銀行	2.7	4.5	16,672
中京銀行	3.2	5.3	11,744
大光銀行	2.7	4.6	7,217
愛媛銀行	10.9	17.4	18,792
トマト銀行	3	5.5	5,555
京葉銀行	70	54	33,642
栃木銀行	40.7	66.3	11,735
北日本銀行	2.5	4.2	7,001
東和銀行	13.9	20.8	15,142
福島銀行	7.3	7.3	2,000
大東銀行	3.7	5.7	3,294
トモニホールディングス	65.2	94.4	32,662
フィデアホールディングス	76.8	115.1	13,696
池田泉州ホールディングス	83.6	130.4	28,427
証券、商品先物取引業(0.8%)			
ＦＰＧ	27.2	37.5	33,487
マーキュリアインベストメント	2.3	4.7	3,153
ＳＢＩホールディングス	89.5	142	367,354
ジャフコ	11.4	19.6	75,950
大和証券グループ本社	677	956	457,541
野村ホールディングス	1,361.3	2,096.2	734,508
岡三証券グループ	68	101.8	39,193
丸三証券	25.2	35.6	20,683
東洋証券	29	43.3	5,282
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	87.8	142.4	48,558
光世証券	2	3	1,992
水戸証券	24.2	34.9	7,084
いちよし証券	16.6	25	19,425
松井証券	38.9	58.4	60,736
だいこう証券ビジネス	4	5.1	2,131
マネックスグループ	82.7	110.2	38,239
カブドットコム証券	50.7	86.9	48,490
極東証券	10.7	16.1	15,150
岩井コスモホールディングス	8.1	12.3	14,145
藍澤證券	15	21.6	15,076
マネーパートナーズグループ	10.2	14.3	4,161
スパークス・グループ	－	47.4	11,613
保険業(2.3%)			
かんぽ生命保険	29.9	45	91,440
ＳＯＭＰＯホールディングス	155.2	210	870,660
アニコム　ホールディングス	5.4	9.8	34,692
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	206.8	311.4	1,069,036
ソニーフィナンシャルホールディングス	65	97.9	235,939
第一生命ホールディングス	447.5	673.9	1,075,881
東京海上ホールディングス	298	425.9	2,365,022
アドバンテッジリスクマネジメント	2.5	－	－
Ｔ＆Ｄホールディングス	244.7	368.4	423,475
アドバンスクリエイト	1.8	2.8	4,888
その他金融業(1.1%)			
全国保証	22.3	33.6	137,928
ジェイリース	1.5	3.3	1,098
イントラスト	1.6	3.3	1,623
日本モーゲージサービス	－	2.1	2,383
Ｃａｓａ	－	5.4	5,761
アルヒ	8.9	10.8	20,412

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
プレミアグループ	－	6.8	13,715
クレディセゾン	60	83.4	98,412
アクリーティブ	4.2	－	－
芙蓉総合リース	9.1	13.6	72,624
興銀リース	14.9	22.4	57,052
東京センチュリー	15.9	24	108,000
日本証券金融	32.2	52.5	30,030
アイフル	132.8	181.7	37,975
リコーリース	6.2	9.4	31,537
イオンフィナンシャルサービス	56.2	76.1	130,587
アコム	159	239.4	88,338
ジャックス	9.6	13.2	25,146
オリエントコーポレーション	170.3	322.2	36,730
日立キャピタル	21.8	28.1	65,416
アプラスフィナンシャル	37	56.9	4,210
オリックス	527.7	794.7	1,228,208
三菱ＵＦＪリース	200.8	268.7	148,322
九州リースサービス	3.3	5.8	3,659
日本取引所グループ	227.1	321.8	541,911
イー・ギャランティ	4.2	11.2	15,433
アサックス	1.1	4.9	2,690
ＮＥＣキャピタルソリューション	3.2	4.8	8,544
不動産業(2.5%)			
いちご	113.2	155.2	51,526
日本駐車場開発	95.2	138	24,150
ヒューリック	165.2	250	218,000
三栄建築設計	3.2	5.6	8,237
スター・マイカ	3.8	6.4	8,089
野村不動産ホールディングス	52.7	79.9	181,532
三重交通グループホールディングス	16.1	26.2	15,720
サムティ	6.8	17.4	24,847
ディア・ライフ	8.8	18.3	7,686
コーセーアールイー	1.8	5.2	3,884
エー・ディー・ワークス	103.2	115	3,910
日本商業開発	4.4	8.3	12,284
プレサンスコーポレーション	10.9	19.8	27,621
ユニゾホールディングス	10.9	18.7	33,847
ＴＨＥグローバル社	3.7	－	－
日本管理センター	5.2	9	9,990
サンセイランディック	2.3	4.9	3,542
エストラスト	1.1	1.2	842
フージャースホールディングス	19.3	21.2	12,698
オープンハウス	12.9	17.5	80,762
東急不動産ホールディングス	191.6	322.4	201,177
飯田グループホールディングス	66	100.1	175,875
イーグランド	1.3	3.6	2,408
ムゲンエステート	4.8	10.5	6,037
ビーロット	1.2	－	－
ファーストブラザーズ	2.2	4.4	4,686
ハウスドゥ	1.3	6.6	9,233
シーアールイー	1.3	4.2	4,162
ケイアイスター不動産	2.9	4.1	6,219

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
グッドコムアセット	－	3.6	5,112
ジェイ・エス・ビー	－	0.9	3,145
テンポイノベーション	－	2.2	3,341
パーク２４	44.2	70.2	151,421
パラカ	2.5	3.7	7,318
三井不動産	395	632.4	1,713,804
三菱地所	588.9	835.1	1,700,263
平和不動産	14	23.1	49,295
東京建物	86.5	131.2	156,915
ダイビル	20.3	36.4	34,944
京阪神ビルディング	13.2	22.4	22,601
住友不動産	190	268.1	1,098,137
大京	12.6	－	－
テーオーシー	27.2	29.2	19,126
東京楽天地	1.3	2	10,200
レオパレス２１	94.4	－	－
スターツコーポレーション	10.8	16.7	43,202
フジ住宅	10	16.8	12,902
空港施設	8.1	16.4	8,528
明和地所	4.3	8.9	4,734
ゴールドクレスト	6.3	10.1	17,765
日本エスリード	3.1	5.5	8,442
日神不動産	10.4	20.4	8,894
日本エスコン	14.3	23.4	16,216
タカラレーベン	37	57.8	21,617
サンヨーハウジング名古屋	4.4	8.1	7,136
イオンモール	51	60.5	97,949
毎日コムネット	－	4.2	3,095
ファースト住建	2.9	5.5	6,259
カチタス	10.8	13.6	54,468
トーセイ	9.7	17.8	16,215
穴吹興産	0.9	1.7	5,125
エヌ・ティ・ティ都市開発	49.2	－	－
サンフロンティア不動産	9.6	17.7	17,877
エフ・ジェー・ネクスト	6	11.7	11,466
インテリックス	2.3	5.1	3,519
ランドビジネス	4.6	5	3,895
グランディハウス	6.8	13.2	5,940
日本空港ビルデング	23.1	38.3	158,945
サービス業(5.4%)			
日本工営	5.2	7.8	18,774
ＬＩＦＵＬＬ	26.6	40.5	24,259
ジェイエイシーリクルートメント	6.2	9.3	24,933
日本Ｍ＆Ａセンター	53.1	86.1	255,544
メンバーズ	2.6	3.9	8,112
中広	0.9	1.5	826
アイティメディア	－	2.6	1,307
タケエイ	7.9	12.1	9,655
Ｅ・Ｊホールディングス	－	1.6	1,776
トラスト・テック	3.6	6.4	20,192
コシダカホールディングス	20.4	27.9	41,264
アルトナー	－	3	2,364

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
パソナグループ	7.2	14.2	24,211
ＣＤＳ	2.1	3	3,966
リンクアンドモチベーション	14.1	21.4	13,268
ＧＣＡ	8.7	11.8	8,578
エス・エム・エス	15.2	42.5	111,860
サニーサイドアップ	－	1.3	2,559
パーソルホールディングス	70.8	115.4	270,036
リニカル	5	6.6	7,906
クックパッド	24.2	36.5	11,169
エスクリ	2.8	3.3	2,616
アイ・ケイ・ケイ	4.5	5.8	3,944
学情	3.5	4.8	5,265
スタジオアリス	3.9	5.9	12,183
シミックホールディングス	4.3	6.5	13,084
ＮＪＳ	1.9	2.6	4,214
綜合警備保障	30.5	45.9	244,647
カカクコム	57.7	86.5	197,133
アイロムグループ	2.6	4.4	7,062
セントケア・ホールディング	3.3	8.7	4,158
サイネックス	1.2	2.2	1,430
ルネサンス	3.8	6.5	12,941
ディップ	10.8	18.7	30,462
オプトホールディング	5.3	7.2	10,080
ツクイ	18.2	27.5	14,932
キャリアデザインセンター	2	3	4,611
ベネフィット・ワン	－	32	69,280
エムスリー	80.7	243	519,534
ツカダ・グローバルホールディング	6.1	7.6	4,727
ブラス	0.5	1.5	934
アウトソーシング	22.9	61	69,723
ウェルネット	7.7	11.1	11,155
ワールドホールディングス	2.6	3.3	5,395
ディー・エヌ・エー	41.4	62.3	135,066
博報堂ＤＹホールディングス	106.6	160.5	277,986
ぐるなび	12.2	16.6	8,814
タカミヤ	9	12.1	9,002
ジャパンベストレスキューシステム	9.3	7.8	9,835
ファンコミュニケーションズ	21.4	31.9	16,588
ライク	3.1	4.7	5,954
ビジネス・ブレークスルー	3.7	5.2	1,788
ＷＤＢホールディングス	3.5	5.3	14,447
ティア	4.1	6.9	4,491
ＣＤＧ	0.7	1.2	1,497
バリューコマース	6.8	7.8	20,334
インフォマート	38.9	63.3	107,926
ＪＰホールディングス	24.4	33.3	9,523
エコナックホールディングス	－	21.9	2,715
ＥＰＳホールディングス	11.6	17.4	31,354
レッグス	2	3	4,074
ブレステージ・インターナショナル	15.9	21.7	33,700
アミューズ	5.1	7	18,137
ドリームインキュベータ	2.6	3.6	6,145

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
クイック	4.7	7.2	12,657
ＴＡＣ	4.8	7	1,379
ケネディクス	101.7	101.6	53,848
電通	93.4	140.6	511,784
テイクアンドギヴ・ニーズ	3.6	4.5	4,900
ぴあ	2.6	3.3	16,219
イオンファンタジー	2.5	3.8	8,774
シーティーエス	7.6	13.2	8,949
ネクシィーズグループ	3	4.1	9,864
みらかホールディングス	22.9	32.3	83,463
アルプス技研	6.8	10.2	18,951
ダイオーズ	1.6	2.8	3,841
日本空調サービス	8	13.2	8,923
オリエンタルランド	90.6	136.4	1,831,852
ダスキン	20.7	29.7	85,417
明光ネットワークジャパン	9.8	13.7	13,193
ファルコホールディングス	4	6.4	10,451
ラウンドワン	23.8	35.9	58,911
リゾートトラスト	32.5	48.9	84,939
ビー・エム・エル	9.9	14.9	47,605
ワタベウェディング	1.4	2.1	1,230
りらいあコミュニケーションズ	12.2	21	25,662
リソー教育	12.9	58.9	25,974
早稲田アカデミー	1.1	3.5	2,726
ユー・エス・エス	93.7	141	287,781
東京個別指導学院	2.8	4.2	3,948
サイバーエージェント	47.2	66.4	283,528
楽天	393.1	538	618,700
クリーク・アンド・リバー社	4	6.9	8,618
テー・オー・ダブリュー	7.3	10.2	7,945
山田コンサルティンググループ	－	5.7	11,593
セントラルスポーツ	2.9	4.3	14,168
フルキャストホールディングス	6.7	11.6	25,183
エン・ジャパン	－	16.8	65,100
リソルホールディングス	0.9	1.3	5,083
テクノプロ・ホールディングス	14.5	23.2	140,128
アトラ	1.4	2.8	806
インターワークス	1.8	2.4	1,447
アイ・アールジャパンホールディングス	－	4.7	12,675
ＫｅｅＰｅｒ技研	2.5	4.3	5,981
ファーストロジック	1.6	2.9	1,595
三機サービス	1.2	2.5	3,032
Ｇｕｎｏｓｙ	4.6	8.1	15,584
デザインワン・ジャパン	1.6	2.7	796
イー・ガーディアン	3.9	5.9	10,920
リブセンス	5	6.9	1,697
ジャパンマテリアル	20.9	31.7	42,256
ベクトル	9.3	14.2	17,238
ウチヤマホールディングス	3.9	5.9	3,156
チャーム・ケア・コーポレーション	－	3.8	6,532
ライクキッズネクスト	1.4	2.9	2,694
キャリアリンク	2.6	4.6	2,028

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ＩＢＪ	6.2	7.9	7,315
アサンテ	2.8	4.7	10,039
Ｎ・フィールド	4.3	7.6	5,745
バリューＨＲ	1.8	2.5	8,362
M&Aキャピタルパートナーズ	2	4.1	26,568
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.2	4.9	5,914
ＥＲＩホールディングス	2.2	3.4	3,107
アビスト	1.2	1.8	4,537
シグマクシス	4.1	5.6	7,677
ウィルグループ	3.3	7.7	6,868
エスクロー・エージェント・ジャパン	10.5	16.3	4,466
日本ビューホテル	2.5	3.8	4,335
リクルートホールディングス	591.3	826.7	2,986,867
エラン	1.9	8	14,328
土木管理総合試験所	2.5	5.3	2,279
日本郵政	435	946	1,148,444
ベルシステム24ホールディングス	12.9	19.4	31,214
鎌倉新書	1.4	8.5	14,195
ソネット・メディア・ネットワークス	－	1.6	1,336
一蔵	1.1	1.5	907
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	1.8	2.7	4,519
グローバルキッズCOMPANY	0.9	1.9	1,744
エボラブルアジア	2.2	5	10,885
アトラエ	－	3	9,420
ストライク	2	4.4	8,558
ソラスト	4.7	28.4	28,201
セラク	1.8	3.8	2,337
インソース	2.6	4.5	13,081
ベイカレント・コンサルティング	－	8.2	30,832
Orchestra Holdings	－	2.1	2,635
アイモバイル	－	3.8	3,085
キャリアインデックス	1.1	4.1	3,415
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	0.8	4.8	7,612
船場	1.5	2	1,838
グレイステクノロジー	－	4.2	10,500
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	－	9.1	19,747
フルテック	0.9	1.7	2,002
グリーンズ	1.7	4.4	6,881
ツナググループ・ホールディングス	－	1.6	886
ソウルドアウト	－	1.2	2,859
MS&Consulting	－	2	2,016
日総工産	1.3	7.7	11,650
キュービーネットホールディングス	3.8	7	16,254
ＲＰＡホールディングス	－	2.3	14,099
スプリックス	－	3.9	7,066
アドバンテッジリスクマネジメント	－	4.7	3,355
リログループ	41.9	63.1	189,931
東祥	4.8	7.2	22,212
エイチ・アイ・エス	12	20.6	66,126
ラックランド	1.5	2.4	5,481
共立メンテナンス	13.7	17.7	101,067
イチネンホールディングス	8.7	12.1	13,685
建設技術研究所	5.3	8.1	11,988
スペース	5	7.6	8,983
長大	3.2	4.8	3,432
燦ホールディングス	1.9	2.6	5,951
スバル興業	0.5	0.8	4,288
東京テアトル	3.2	4.6	6,081
タナベ経営	1.5	2.3	2,762
ナガワ	1.6	3.2	18,304
よみうりランド	1.7	2.5	13,250
東京都競馬	5.8	7.6	25,650
カナモト	11.7	17.3	42,661
東京ドーム	31	43.3	48,322
西尾レントオール	7.8	11.8	33,571
トランス・コスモス	8.5	12.9	31,179
乃村工藝社	18	54	78,732
藤田観光	3.1	4.6	12,052
KNT－CTホールディングス	4.7	6.1	8,954
日本管財	8.3	12.4	23,088
トーカイ	7.5	11.2	28,369
白洋舎	0.9	1.4	4,081
セコム	81.3	122.5	1,180,042
セントラル警備保障	3.7	5.6	32,480
丹青社	15.7	21.9	25,009
メイテック	9	14.3	75,361
応用地質	8.5	12.5	13,350
船井総研ホールディングス	16	23.9	64,362
進学会ホールディングス	3.6	5.5	3,311
オオバ	6.3	9.2	6,108
いであ	1.6	2.4	2,724
学究社	2.8	3.9	5,077
ベネッセホールディングス	28.1	42.3	108,711
イオンディライト	9.5	14.3	45,903
ナック	5.2	7.4	6,867
ニチイ学館	14.6	16.5	23,925
ダイセキ	12.9	19.4	52,981
ステップ	2.8	4.3	6,273
合計 株数・金額	96,800	140,334	266,318,229
合計 銘柄数＜比率＞	2,036	2,078	＜97.8%＞

(注1)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です。
(注2)合計欄の＜　＞内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末 買建額(百万円)	当期末 売建額(百万円)
国内	ＴＯＰＩＸ	5,879	－

投資信託財産の構成

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	266,318,229	97.2
コール・ローン等、その他	7,538,281	2.8
投資信託財産総額	273,856,510	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2019年5月29日現在
(A)資産	**273,856,510,931円**
コール・ローン等	4,354,717,010
株式(評価額)	266,318,229,660
未収配当金	2,872,624,071
差入委託証拠金	310,940,190
(B)負債	**1,573,013,748**
未払金	1,523,473,740
未払解約金	49,533,021
未払利息	6,987
(C)純資産総額(A-B)	**272,283,497,183**
元本	192,648,275,463
次期繰越損益金	79,635,221,720
(D)受益権総口数	**192,648,275,463口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**14,134円**

■損益の状況

項目	当期 自 2018年5月30日 至 2019年5月29日
(A)配当等収益	**5,850,015,774円**
受取配当金	5,849,865,667
受取利息	677
その他収益金	3,268,440
支払利息	△3,119,010
(B)有価証券売買損益	**△29,988,213,947**
売買益	8,777,947,262
売買損	△38,766,161,209
(C)先物取引等取引損益	**△444,708,900**
取引益	464,351,030
取引損	△909,059,930
(D)その他費用	**△268,957**
(E)当期損益金(A+B+C+D)	**△24,583,176,030**
(F)前期繰越損益金	**75,865,136,410**
(G)追加信託差損益金	**36,398,023,489**
(H)解約差損益金	**△8,044,762,149**
(I)計 (E+F+G+H)	**79,635,221,720**
次期繰越損益金(I)	**79,635,221,720**

(注1) (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2) (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3) (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。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は130,081,844,048円、期中追加設定元本額は78,213,667,102円、期中一部解約元本額は15,647,235,687円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	53,382,133,848円
DCマイセレクション50	19,055,041,347円
DCマイセレクション75	17,567,704,592円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	12,820,304,270円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,828,192,421円
DCマイセレクションS50	7,804,310,879円
DCマイセレクション25	6,685,564,991円
DC日本株式インデックス・オープンS	6,346,850,737円
DC日本株式インデックス・オープン	5,582,709,223円
日本株式インデックス・オープン	5,482,756,725円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,162,966,236円
DCマイセレクションS75	5,066,854,050円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,401,733,668円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,981,750,710円
DCマイセレクションS25	2,706,939,072円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,610,074,483円
分散投資コア戦略ファンドS	2,122,008,187円
世界経済インデックスファンド	1,996,308,744円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,917,782,245円
DC世界経済インデックスファンド	1,743,123,347円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,376,660,216円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,239,424,723円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,102,902,132円
分散投資コア戦略ファンドA	1,010,794,099円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	910,370,976円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	854,353,577円
コア投資戦略ファンド(切替型)	792,730,531円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	759,211,959円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	673,595,588円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	669,509,904円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	665,753,754円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	637,236,172円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	613,215,929円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	603,647,048円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	541,672,429円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	482,126,942円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	418,539,640円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	386,110,619円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	374,640,033円
グローバル経済コア	322,166,096円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	305,739,372円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	259,488,312円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	253,531,829円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	228,819,377円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	224,294,636円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	109,865,200円
SMT インデックスバランス・オープン	75,994,654円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	62,323,726円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	56,058,768円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	53,418,854円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	48,311,082円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	45,259,456円

マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	43,826,513円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	41,876,524円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	39,847,094円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	21,222,871円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	16,342,633円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,975,519円
SMT 世界経済インデックス・オープン	11,653,766円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,124,471円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	9,885,413円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	7,828,524円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,717,839円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,128,834円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	885,656円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	23,834円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	21,791円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	19,408円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	17,365円

お知らせ

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。
なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。
このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	外貨建資産への投資は行いません。
	国内債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1)分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 (2)分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。	

FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）

運用報告書（全体版）

第20期（決算日　2019年 9月9日）
第21期（決算日　2019年11月7日）
第22期（決算日　2020年 1月7日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

ホームページ　https://www.smtam.jp/

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011　東京都港区芝公園一丁目1番1号
＜610057＞

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
		円	円	%		%	%	%	百万円
第4	第 8期(2017年 9月7日)	10,041	11	0.7	10,160	0.8	99.6	－	18,901
	第 9期(2017年11月7日)	10,025	9	△0.1	10,155	△0.0	99.6	－	26,005
	第10期(2018年 1月9日)	9,999	9	△0.2	10,141	△0.1	99.8	－	35,200
第5	第11期(2018年 3月7日)	10,034	10	0.5	10,187	0.5	99.6	－	41,876
	第12期(2018年 5月7日)	10,036	9	0.1	10,200	0.1	99.6	0.0	48,104
	第13期(2018年 7月9日)	10,056	10	0.3	10,234	0.3	99.7	－	60,225
第6	第14期(2018年 9月7日)	9,958	9	△0.9	10,144	△0.9	99.5	0.1	73,316
	第15期(2018年11月7日)	9,932	9	△0.2	10,129	△0.2	99.7	－	85,662
	第16期(2019年 1月7日)	10,061	9	1.4	10,271	1.4	99.7	－	94,983
第7	第17期(2019年 3月7日)	10,082	10	0.3	10,305	0.3	99.5	0.1	104,156
	第18期(2019年 5月7日)	10,129	9	0.6	10,363	0.6	99.8	0.1	107,321
	第19期(2019年 7月8日)	10,234	11	1.1	10,486	1.2	99.7	－	112,354
第8	第20期(2019年 9月9日)	10,325	11	1.0	10,593	1.0	99.8	－	113,705
	第21期(2019年11月7日)	10,164	8	△1.5	10,439	△1.5	99.7	－	111,255
	第22期(2020年 1月7日)	10,115	7	△0.4	10,398	△0.4	99.7	0.0	109,216

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、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、一定の組入れ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基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

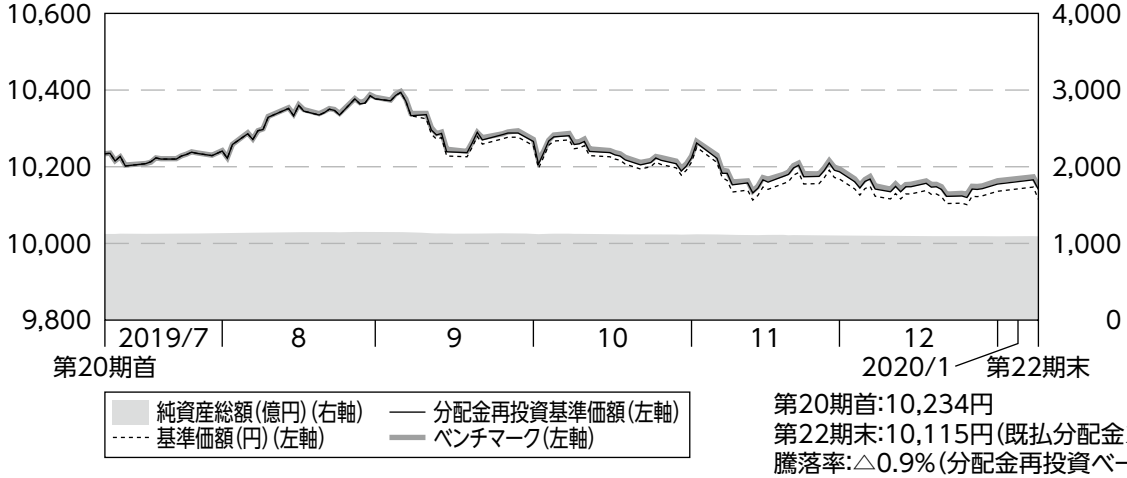
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年　月　日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
			騰落率		騰落率		
		円	%		%	%	%
第20期	(期　首)2019年 7月8日	10,234	－	10,486	－	99.7	－
	7月末	10,241	0.1	10,494	0.1	99.7	－
	8月末	10,377	1.4	10,637	1.4	99.6	－
	(期　末)2019年 9月9日	10,336	1.0	10,593	1.0	99.8	－
第21期	(期　首)2019年 9月9日	10,325	－	10,593	－	99.8	－
	9月末	10,255	△0.7	10,524	△0.7	99.8	0.0
	10月末	10,212	△1.1	10,479	△1.1	99.7	－
	(期　末)2019年11月7日	10,172	△1.5	10,439	△1.5	99.7	－
第22期	(期　首)2019年11月7日	10,164	－	10,439	－	99.7	－
	11月末	10,168	0.0	10,445	0.1	99.6	0.0
	12月末	10,136	△0.3	10,413	△0.2	99.9	－
	(期　末)2020年 1月7日	10,122	△0.4	10,398	△0.4	99.7	0.0

(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



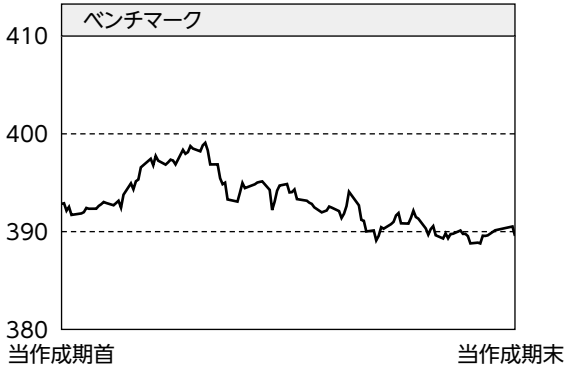
第20期首:10,234円
第22期末:10,115円(既払分配金26円)
騰落率:△0.9%(分配金再投資ベース)

(注1)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。
(注2)分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
(注3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2019年7月8日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額(分配金再投資ベース)は、下落しました。2019年9月上旬にかけて、米中対立の激化による世界経済の減速懸念の高まりから、国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。9月中旬以降12月上旬にかけて、国内金利が、米金利上昇に追随する動きがあったことに加え、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、大幅に反発上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額は下落しました。12月中旬以降は、10年国債利回りが一時プラス水準を回復する場面もありましたが、金利の絶対水準に着目する投資家の買いなどから国内金利の上昇が抑えられ、基準価額はレンジ内推移となりました。

投資環境



2019年9月上旬にかけて、米中対立の激化による世界経済の減速懸念の高まりから、国内金利は低下しました。9月中旬以降12月上旬にかけて、国内金利は、米金利上昇に追随する動きがあったことに加え、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、大幅に反発上昇しました。12月中旬以降は、10年国債利回りが一時プラス水準を回復する場面もありましたが、金利の絶対水準に着目する投資家の買いなどから利回りの上昇が抑えられ、国内金利はレンジ内推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「国内債券インデックス マザーファンド」への投資を通じて、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

【「国内債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

(1)債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2)ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

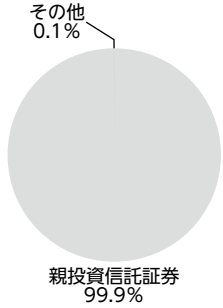
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

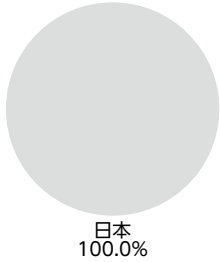
	当作成期末
	2020年1月7日
国内債券インデックス マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

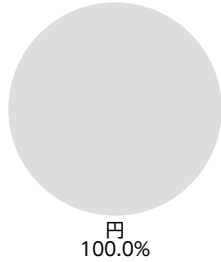
○資産別配分



○国別配分



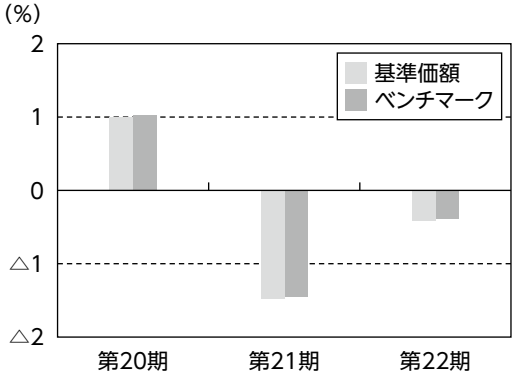
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離の主な要因は、信託報酬によるものです。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第20期 2019年7月9日～ 2019年9月9日	第21期 2019年9月10日～ 2019年11月7日	第22期 2019年11月8日～ 2020年1月7日
当期分配金	（円）	11	8	7
（対基準価額比率）	（％）	(0.106)	(0.079)	(0.069)
当期の収益	（円）	11	8	7
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	564	567	570

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

国内債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期 (2019年7月9日~2020年1月7日) 金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	6円	0.055%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,231円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(4)	(0.039)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.005)	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)	(1)	(0.011)	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	0.000	(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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	−	−	(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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(d) その他費用	0	0.001	(d)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(−)	(−)	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)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	6	0.056	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンド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2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当作成期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内債券インデックス マザーファンド	1,434,547	2,048,315	2,970,205	4,248,308

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	5	5	100.0	5	5	100.0
コール・ローン	8,585	1,640	19.1	8,708	1,686	19.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜国内債券インデックス マザーファンド＞

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	184	184	100.0	184	184	100.0
コール・ローン	253,964	50,574	19.9	251,226	50,717	20.2

〈平均保有割合　21.0%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	前作成期末	当作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内債券インデックス マザーファンド	78,469,992	76,934,333	109,162,126

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、389,772,834千口です。

投資信託財産の構成

項目	当作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内債券インデックス マザーファンド	109,162,126	99.6
コール・ローン等、その他	477,852	0.4
投資信託財産総額	109,639,978	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第 20 期 末 2019年9月9日現在	第 21 期 末 2019年11月7日現在	第 22 期 末 2020年1月7日現在
(A)資産	**114,450,377,302円**	**111,481,648,882円**	**109,639,978,521円**
コール・ローン等	77,524,524	128,564,283	74,577,516
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	113,648,893,707	111,200,316,590	109,162,126,460
未収入金	723,959,071	152,768,009	403,274,545
(B)負債	**744,650,604**	**225,704,512**	**423,109,066**
未払収益分配金	121,137,515	87,568,164	75,580,900
未払解約金	601,999,997	117,999,998	327,000,001
未払信託報酬	21,156,208	19,799,369	20,179,712
未払利息	172	178	84
その他未払費用	356,712	336,803	348,369
(C)純資産総額(A-B)	**113,705,726,698**	**111,255,944,370**	**109,216,869,455**
元本	110,125,014,101	109,460,205,933	107,972,714,448
次期繰越損益金	3,580,712,597	1,795,738,437	1,244,155,007
(D)受益権総口数	**110,125,014,101口**	**109,460,205,933口**	**107,972,714,448口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**10,325円**	**10,164円**	**10,115円**

■損益の状況

項目	第 20 期 自 2019年7月9日 至 2019年9月9日	第 21 期 自 2019年 9月10日 至 2019年11月 7日	第 22 期 自 2019年11月8日 至 2020年 1月7日
(A)配当等収益	**△8,174円**	**△4,816円**	**△7,817円**
支払利息	△8,174	△4,816	△7,817
(B)有価証券売買損益	**1,150,099,217**	**△1,653,204,601**	**△428,928,762**
売買益	1,183,013,957	7,619,603	5,152,659
売買損	△32,914,740	△1,660,824,204	△434,081,421
(C)信託報酬等	**△21,512,934**	**△20,136,184**	**△20,528,084**
(D)当期損益金(A+B+C)	**1,128,578,109**	**△1,673,345,601**	**△449,464,663**
(E)前期繰越損益金	**2,212,384,222**	**3,191,958,913**	**1,401,459,118**
(F)追加信託差損益金	**360,887,781**	**364,693,289**	**367,741,452**
(配当等相当額)	(3,001,234,719)	(2,991,990,661)	(2,974,207,784)
(売買損益相当額)	(△2,640,346,938)	(△2,627,297,372)	(△2,606,466,332)
(G)計(D+E+F)	**3,701,850,112**	**1,883,306,601**	**1,319,735,907**
(H)収益分配金	**△121,137,515**	**△87,568,164**	**△75,580,900**
次期繰越損益金(G+H)	**3,580,712,597**	**1,795,738,437**	**1,244,155,007**
追加信託差損益金	360,887,781	364,693,289	367,741,452
(配当等相当額)	(3,001,682,692)	(2,992,081,468)	(2,974,496,252)
(売買損益相当額)	(△2,640,794,911)	(△2,627,388,179)	(△2,606,754,800)
分配準備積立金	3,219,824,816	3,216,146,022	3,190,703,619
繰越損益金	―	△1,785,100,874	△2,314,290,064

(注1)(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(C)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3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの第20期首元本額は109,788,975,315円、第20～22期中追加設定元本額は2,273,607,097円、第20～22期中一部解約元本額は4,089,867,964円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　20　期	第　21　期	第　22　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	146,945,872円	111,755,273円	116,630,459円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	981,632,237円	－円	－円
(C) 収益調整金額	3,001,682,692円	2,992,081,468円	2,974,496,252円
(D) 分配準備積立金額	2,212,384,222円	3,191,958,913円	3,149,654,060円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	6,342,645,023円	6,295,795,654円	6,240,780,771円
(F) 期末残存口数	110,125,014,101口	109,460,205,933口	107,972,714,448口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	575円	575円	577円
(H) 分配金額(1万口当たり)	11円	8円	7円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	121,137,515円	87,568,164円	75,580,900円

分配金のお知らせ

	第20期	第21期	第22期
1万口当たり分配金	11円	8円	7円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第19期（決算日　2019年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運　用　方　針	わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組　入　制　限	外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト･アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第15期(2015年5月29日)	13,215	2.3	362.770	2.3	99.6	－	319,978
第16期(2016年5月30日)	14,107	6.7	387.276	6.8	99.4	0.2	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379.592	△2.0	99.7	－	300,760
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382.463	0.8	99.9	－	379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390.052	2.0	99.7	0.0	462,300

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(当期首) 2018年 5月29日	13,934	－	382.463	－	99.9	－
5月末	13,935	0.0	382.498	0.0	99.7	－
6月末	13,942	0.1	382.669	0.1	99.8	0.1
7月末	13,917	△0.1	381.979	△0.1	99.7	－
8月末	13,842	△0.7	379.893	△0.7	99.5	0.1
9月末	13,808	△0.9	378.986	△0.9	99.7	0.0
10月末	13,833	△0.7	379.645	△0.7	99.7	－
11月末	13,891	△0.3	381.238	△0.3	99.7	－
12月末	13,992	0.4	384.131	0.4	99.8	－
2019年 1月末	14,050	0.8	385.580	0.8	99.7	0.0
2月末	14,079	1.0	386.427	1.0	99.7	0.2
3月末	14,177	1.7	389.143	1.7	99.8	－
4月末	14,132	1.4	387.945	1.4	99.7	0.0
(当期末) 2019年 5月29日	14,211	2.0	390.052	2.0	99.7	0.0

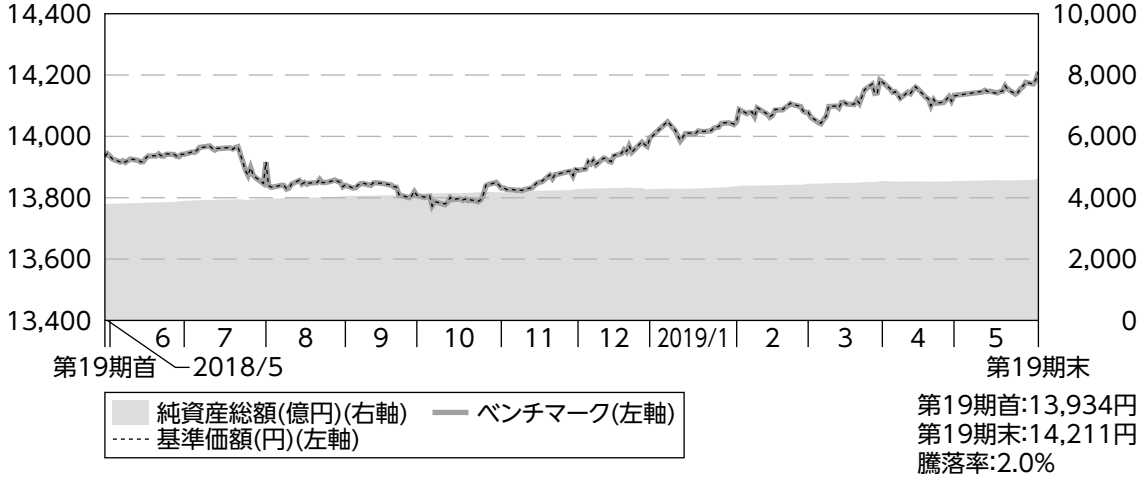
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、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、一定の組入れ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基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

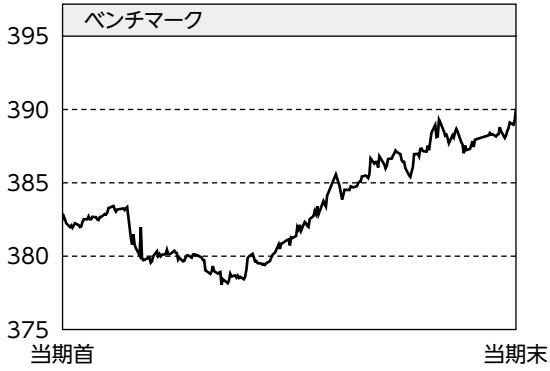


(注)ベンチマークは、2018年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

期初より2018年10月上旬にかけて、7月末の日銀金融政策決定会合で長期金利変動幅の拡大容認が決定されたことに加え、買い入れオペ減額に対する警戒感や米国金利上昇の影響を受けて金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬以降2019年1月上旬にかけて、世界的な株安の動きにより投資家のリスク回避姿勢が強まったことに加え、米長期金利が低下した影響を受けて金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。その後も3月末にかけて、日銀の国債買い入れオペで債券需給の引き締まりが意識されたほか、欧州や中国の軟調な経済指標を背景に世界景気減速への警戒感の高まりから金利は低下し、基準価額は上昇しました。4月以降期末にかけては、米中通商協議の進展や中国景気の底入れ観測から金利が反転上昇する局面があったものの、米政権が対中追加関税の発動を表明したことや欧米の長期金利の低下を受けて金利が再び低下し、基準価額はもみ合いながらも堅調な推移となりました。

投資環境



期初より2018年10月上旬にかけて、日銀金融政策決定会合で長期金利変動幅の拡大容認が決定されたことに加え、買い入れオペ減額に対する警戒感や米国金利上昇の影響を受けて、金利は上昇しました。10月中旬以降2019年3月末にかけて、日銀の国債買い入れオペで債券需給の引き締まりが意識されたほか、欧州や中国の軟調な経済指標により世界景気減速への警戒感が高まったことから、金利は低下しました。4月以降期末にかけては、米中通商協議の進展や中国景気の底入れ観測から金利が反転上昇する局面があったものの、米政権が対中追加関税の発動を表明したことや欧米の長期金利の低下の影響を受けて、金利は再び低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、公社債の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2)ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

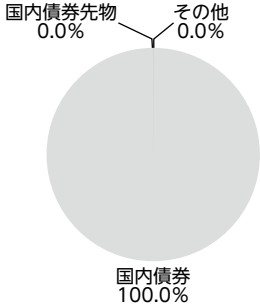
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

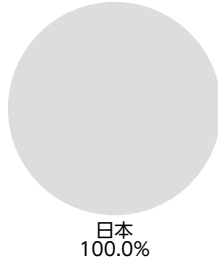
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第138回利付国債(5年)	日本	2.0%
2	第136回利付国債(5年)	日本	1.3%
3	第135回利付国債(5年)	日本	1.2%
4	第131回利付国債(5年)	日本	1.2%
5	第132回利付国債(5年)	日本	1.0%
6	第353回利付国債(10年)	日本	1.0%
7	第127回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第133回利付国債(5年)	日本	1.0%
9	第320回利付国債(10年)	日本	1.0%
10	第339回利付国債(10年)	日本	0.9%
組入銘柄数		869	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

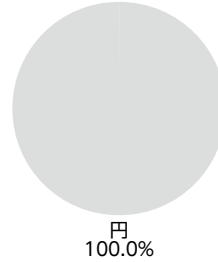
○資産別配分



○国別配分



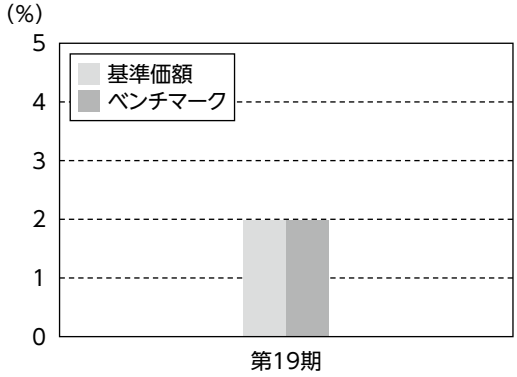
○通貨別配分



(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.0%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、そ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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2018年5月30日~2019年5月29日) 金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(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〕×10,000 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)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	−	−	(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〕×10,000 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)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(−)	(−)	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)	(−)	(−)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(13,966円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

		当期 買付額	当期 売付額
		千円	千円
国内	国債証券	124,469,398	60,427,779
	地方債証券	4,919,889	611,537
	特殊債券	7,713,647	2,018,276 (432,135)
	社債券(投資法人債券を含む)	5,940,325	2,324,012 (330,000)

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)
(注2)(　)内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)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		当期 買建 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券先物取引	75,968	75,811	－	－

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期 買付額等A	当期 買付額等A うち利害関係人との取引状況B	当期 買付額等A B/A	当期 売付額等C	当期 売付額等C うち利害関係人との取引状況D	当期 売付額等C D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	20,991	20,991	100.0	20,991	20,991	100.0
コール・ローン	342,368	46,705	13.6	341,895	46,714	13.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

組入資産の明細

＜国内(邦貨建)公社債＞

(A)債券種類別開示

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	350,880,000 (5,680,000)	385,586,817 (5,744,240)	83.4 (1.2)	－ (－)	52.9 (－)	20.5 (1.2)	9.9 (－)
地方債証券	23,936,220 (23,936,220)	25,302,814 (25,302,814)	5.5 (5.5)	－ (－)	3.7 (3.7)	1.3 (1.3)	0.5 (0.5)
特殊債券 (除く金融債)	27,586,092 (27,586,092)	29,295,963 (29,295,963)	6.3 (6.3)	－ (－)	4.3 (4.3)	1.5 (1.5)	0.4 (0.4)
金融債券	2,300,000 (2,300,000)	2,306,456 (2,306,456)	0.5 (0.5)	－ (－)	0.0 (0.0)	0.3 (0.3)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	18,066,000 (18,066,000)	18,545,202 (18,545,202)	4.0 (4.0)	－ (－)	2.2 (2.2)	1.4 (1.4)	0.4 (0.4)
合計	422,768,312 (77,568,312)	461,037,253 (81,194,676)	99.7 (17.6)	－ (－)	63.3 (10.3)	25.0 (5.8)	11.4 (1.5)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注2)(　)内は非上場債で内書きです。
(注3)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。

(B)個別銘柄開示

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
国債証券				
第389回利付国債（2年）	0.1	2,670,000	2,677,235	2020/6/1
第390回利付国債（2年）	0.1	3,320,000	3,329,760	2020/7/1
第391回利付国債（2年）	0.1	2,850,000	2,859,034	2020/8/1
第392回利付国債（2年）	0.1	730,000	732,482	2020/9/1
第393回利付国債（2年）	0.1	740,000	742,730	2020/10/1
第394回利付国債（2年）	0.1	1,040,000	1,044,076	2020/11/1
第395回利付国債（2年）	0.1	560,000	562,324	2020/12/1
第396回利付国債（2年）	0.1	2,010,000	2,018,803	2021/1/1
第397回利付国債（2年）	0.1	1,360,000	1,366,283	2021/2/1
第398回利付国債（2年）	0.1	2,360,000	2,371,611	2021/3/1
第399回利付国債（2年）	0.1	1,190,000	1,196,140	2021/4/1
第400回利付国債（2年）	0.1	630,000	633,395	2021/5/1
第124回利付国債（5年）	0.1	1,950,000	1,955,577	2020/6/20
第125回利付国債（5年）	0.1	3,610,000	3,622,779	2020/9/20
第126回利付国債（5年）	0.1	2,960,000	2,972,698	2020/12/20
第127回利付国債（5年）	0.1	4,780,000	4,804,234	2021/3/20
第128回利付国債（5年）	0.1	1,610,000	1,619,305	2021/6/20
第129回利付国債（5年）	0.1	3,340,000	3,362,077	2021/9/20
第130回利付国債（5年）	0.1	1,360,000	1,370,132	2021/12/20

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第131回利付国債（5年）	0.1	5,540,000	5,585,261	2022/3/20
第132回利付国債（5年）	0.1	4,800,000	4,842,768	2022/6/20
第133回利付国債（5年）	0.1	4,740,000	4,786,546	2022/9/20
第134回利付国債（5年）	0.1	3,170,000	3,203,506	2022/12/20
第135回利付国債（5年）	0.1	5,680,000	5,744,240	2023/3/20
第136回利付国債（5年）	0.1	5,900,000	5,971,154	2023/6/20
第137回利付国債（5年）	0.1	3,430,000	3,473,972	2023/9/20
第138回利付国債（5年）	0.1	8,960,000	9,081,497	2023/12/20
第139回利付国債（5年）	0.1	2,280,000	2,312,626	2024/3/20
第1回利付国債（40年）	2.4	400,000	610,576	2048/3/20
第2回利付国債（40年）	2.2	470,000	696,220	2049/3/20
第3回利付国債（40年）	2.2	550,000	821,513	2050/3/20
第4回利付国債（40年）	2.2	850,000	1,281,698	2051/3/20
第5回利付国債（40年）	2.0	890,000	1,299,186	2052/3/20
第6回利付国債（40年）	1.9	640,000	921,753	2053/3/20
第7回利付国債（40年）	1.7	720,000	998,337	2054/3/20
第8回利付国債（40年）	1.4	800,000	1,037,552	2055/3/20
第9回利付国債（40年）	0.4	1,090,000	1,054,476	2056/3/20
第10回利付国債（40年）	0.9	1,760,000	1,999,729	2057/3/20
第11回利付国債（40年）	0.8	1,700,000	1,871,819	2058/3/20

当	期	末		
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第３０８回利付国債（１０年）	1.3	1,490,000	1,513,199	2020/6/20
第３０９回利付国債（１０年）	1.1	2,450,000	2,482,952	2020/6/20
第３１０回利付国債（１０年）	1.0	1,410,000	1,431,643	2020/9/20
第３１１回利付国債（１０年）	0.8	1,080,000	1,093,748	2020/9/20
第３１２回利付国債（１０年）	1.2	3,810,000	3,891,876	2020/12/20
第３１３回利付国債（１０年）	1.3	1,350,000	1,386,180	2021/3/20
第３１４回利付国債（１０年）	1.1	470,000	480,894	2021/3/20
第３１５回利付国債（１０年）	1.2	3,140,000	3,229,458	2021/6/20
第３１６回利付国債（１０年）	1.1	1,170,000	1,200,923	2021/6/20
第３１７回利付国債（１０年）	1.1	890,000	916,415	2021/9/20
第３１８回利付国債（１０年）	1.0	1,960,000	2,013,625	2021/9/20
第３１９回利付国債（１０年）	1.1	1,710,000	1,766,481	2021/12/20
第３２０回利付国債（１０年）	1.0	4,570,000	4,709,202	2021/12/20
第３２１回利付国債（１０年）	1.0	2,470,000	2,552,893	2022/3/20
第３２２回利付国債（１０年）	0.9	750,000	773,055	2022/3/20
第３２３回利付国債（１０年）	0.9	970,000	1,002,514	2022/6/20
第３２４回利付国債（１０年）	0.8	1,280,000	1,318,963	2022/6/20
第３２５回利付国債（１０年）	0.8	2,330,000	2,407,216	2022/9/20
第３２６回利付国債（１０年）	0.7	1,660,000	1,713,236	2022/12/20
第３２７回利付国債（１０年）	0.8	1,280,000	1,325,632	2022/12/20
第３２８回利付国債（１０年）	0.6	2,770,000	2,854,401	2023/3/20
第３２９回利付国債（１０年）	0.8	2,250,000	2,341,552	2023/6/20
第３３０回利付国債（１０年）	0.8	1,440,000	1,502,265	2023/9/20
第３３１回利付国債（１０年）	0.6	1,380,000	1,427,679	2023/9/20
第３３２回利付国債（１０年）	0.6	3,430,000	3,555,400	2023/12/20
第３３３回利付国債（１０年）	0.6	2,330,000	2,419,844	2024/3/20
第３３４回利付国債（１０年）	0.6	2,790,000	2,903,274	2024/6/20
第３３５回利付国債（１０年）	0.5	3,620,000	3,754,953	2024/9/20
第３３６回利付国債（１０年）	0.5	510,000	529,915	2024/12/20
第３３７回利付国債（１０年）	0.3	3,380,000	3,473,997	2024/12/20
第３３８回利付国債（１０年）	0.4	2,450,000	2,535,578	2025/3/20
第３３９回利付国債（１０年）	0.4	3,890,000	4,031,868	2025/6/20
第３４０回利付国債（１０年）	0.4	3,770,000	3,913,260	2025/9/20
第３４１回利付国債（１０年）	0.3	3,430,000	3,542,778	2025/12/20
第３４２回利付国債（１０年）	0.1	2,910,000	2,969,189	2026/3/20
第３４３回利付国債（１０年）	0.1	3,030,000	3,093,963	2026/6/20
第３４４回利付国債（１０年）	0.1	2,420,000	2,472,005	2026/9/20
第３４５回利付国債（１０年）	0.1	1,980,000	2,023,243	2026/12/20
第３４６回利付国債（１０年）	0.1	2,860,000	2,922,233	2027/3/20
第３４７回利付国債（１０年）	0.1	2,270,000	2,320,053	2027/6/20
第３４８回利付国債（１０年）	0.1	1,340,000	1,369,332	2027/9/20
第３４９回利付国債（１０年）	0.1	3,210,000	3,279,560	2027/12/20
第３５０回利付国債（１０年）	0.1	3,940,000	4,024,276	2028/3/20
第３５１回利付国債（１０年）	0.1	2,680,000	2,736,494	2028/6/20
第３５２回利付国債（１０年）	0.1	3,890,000	3,970,561	2028/9/20
第３５３回利付国債（１０年）	0.1	4,710,000	4,805,518	2028/12/20
第３５４回利付国債（１０年）	0.1	1,760,000	1,793,968	2029/3/20
第１回利付国債（３０年）	2.8	110,000	142,413	2029/9/20
第２回利付国債（３０年）	2.4	160,000	202,392	2030/2/20

当	期	末		
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第３回利付国債（３０年）	2.3	120,000	151,029	2030/5/20
第４回利付国債（３０年）	2.9	110,000	147,116	2030/11/20
第５回利付国債（３０年）	2.2	50,000	63,245	2031/5/20
第６回利付国債（３０年）	2.4	190,000	246,585	2031/11/20
第７回利付国債（３０年）	2.3	180,000	232,799	2032/5/20
第８回利付国債（３０年）	1.8	50,000	61,717	2032/11/22
第９回利付国債（３０年）	1.4	240,000	283,442	2032/12/20
第１０回利付国債（３０年）	1.1	160,000	182,657	2033/3/20
第１１回利付国債（３０年）	1.7	90,000	110,421	2033/6/20
第１２回利付国債（３０年）	2.1	190,000	244,298	2033/9/20
第１３回利付国債（３０年）	2.0	290,000	369,596	2033/12/20
第１４回利付国債（３０年）	2.4	300,000	400,959	2034/3/20
第１５回利付国債（３０年）	2.5	340,000	460,703	2034/6/20
第１６回利付国債（３０年）	2.5	370,000	502,759	2034/9/20
第１７回利付国債（３０年）	2.4	570,000	768,496	2034/12/20
第１８回利付国債（３０年）	2.3	345,000	460,944	2035/3/20
第１９回利付国債（３０年）	2.3	380,000	508,899	2035/6/20
第２０回利付国債（３０年）	2.5	480,000	659,577	2035/9/20
第２１回利付国債（３０年）	2.3	320,000	430,467	2035/12/20
第２２回利付国債（３０年）	2.5	400,000	552,728	2036/3/20
第２３回利付国債（３０年）	2.5	430,000	595,588	2036/6/20
第２４回利付国債（３０年）	2.5	380,000	527,546	2036/9/20
第２５回利付国債（３０年）	2.3	350,000	475,079	2036/12/20
第２６回利付国債（３０年）	2.4	430,000	592,647	2037/3/20
第２７回利付国債（３０年）	2.5	600,000	841,512	2037/9/20
第２８回利付国債（３０年）	2.5	1,130,000	1,592,373	2038/3/20
第２９回利付国債（３０年）	2.4	1,400,000	1,956,248	2038/9/20
第３０回利付国債（３０年）	2.3	1,090,000	1,508,821	2039/3/20
第３１回利付国債（３０年）	2.2	960,000	1,316,726	2039/9/20
第３２回利付国債（３０年）	2.3	1,340,000	1,874,003	2040/3/20
第３３回利付国債（３０年）	2.0	1,670,000	2,243,110	2040/9/20
第３４回利付国債（３０年）	2.2	1,265,000	1,758,704	2041/3/20
第３５回利付国債（３０年）	2.0	1,690,000	2,288,344	2041/9/20
第３６回利付国債（３０年）	2.0	1,680,000	2,284,732	2042/3/20
第３７回利付国債（３０年）	1.9	1,640,000	2,202,060	2042/9/20
第３８回利付国債（３０年）	1.8	1,060,000	1,403,917	2043/3/20
第３９回利付国債（３０年）	1.9	940,000	1,268,924	2043/6/20
第４０回利付国債（３０年）	1.8	720,000	957,103	2043/9/20
第４１回利付国債（３０年）	1.7	930,000	1,216,681	2043/12/20
第４２回利付国債（３０年）	1.7	1,090,000	1,427,474	2044/3/20
第４３回利付国債（３０年）	1.7	960,000	1,258,560	2044/6/20
第４４回利付国債（３０年）	1.7	1,080,000	1,418,979	2044/9/20
第４５回利付国債（３０年）	1.5	1,100,000	1,393,502	2044/12/20
第４６回利付国債（３０年）	1.5	1,100,000	1,394,437	2045/3/20
第４７回利付国債（３０年）	1.6	1,340,000	1,733,772	2045/6/20
第４８回利付国債（３０年）	1.4	1,390,000	1,731,175	2045/9/20
第４９回利付国債（３０年）	1.4	1,160,000	1,447,181	2045/12/20
第５０回利付国債（３０年）	0.8	1,070,000	1,172,195	2046/3/20
第５１回利付国債（３０年）	0.3	1,240,000	1,199,464	2046/6/20

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第５２回利付国債（３０年）	0.5	1,540,000	1,568,259	2046/9/20
第５３回利付国債（３０年）	0.6	1,120,000	1,168,350	2046/12/20
第５４回利付国債（３０年）	0.8	1,330,000	1,455,831	2047/3/20
第５５回利付国債（３０年）	0.8	1,040,000	1,139,184	2047/6/20
第５６回利付国債（３０年）	0.8	1,260,000	1,379,385	2047/9/20
第５７回利付国債（３０年）	0.8	1,160,000	1,269,167	2047/12/20
第５８回利付国債（３０年）	0.8	1,340,000	1,467,072	2048/3/20
第５９回利付国債（３０年）	0.7	170,000	181,386	2048/6/20
第６０回利付国債（３０年）	0.9	1,310,000	1,468,339	2048/9/20
第６１回利付国債（３０年）	0.7	1,350,000	1,438,047	2048/12/20
第６２回利付国債（３０年）	0.5	280,000	282,564	2049/3/20
第４６回利付国債（２０年）	2.2	170,000	174,289	2020/6/22
第４７回利付国債（２０年）	2.2	90,000	92,805	2020/9/21
第４８回利付国債（２０年）	2.5	130,000	135,444	2020/12/21
第４９回利付国債（２０年）	2.1	140,000	145,798	2021/3/22
第５０回利付国債（２０年）	1.9	220,000	228,313	2021/3/22
第５１回利付国債（２０年）	2.0	100,000	104,508	2021/6/21
第５２回利付国債（２０年）	2.1	110,000	115,823	2021/9/21
第５３回利付国債（２０年）	2.1	80,000	84,699	2021/12/20
第５４回利付国債（２０年）	2.2	200,000	212,264	2021/12/20
第５５回利付国債（２０年）	2.0	140,000	148,654	2022/3/21
第５６回利付国債（２０年）	2.0	150,000	160,102	2022/6/20
第５７回利付国債（２０年）	1.9	240,000	255,424	2022/6/20
第５８回利付国債（２０年）	1.9	300,000	320,934	2022/9/20
第５９回利付国債（２０年）	1.7	200,000	213,582	2022/12/20
第６０回利付国債（２０年）	1.4	350,000	370,006	2022/12/20
第６１回利付国債（２０年）	1.0	240,000	250,994	2023/3/20
第６２回利付国債（２０年）	0.8	320,000	333,020	2023/6/20
第６３回利付国債（２０年）	1.8	200,000	216,274	2023/6/20
第６４回利付国債（２０年）	1.9	320,000	349,059	2023/9/20
第６５回利付国債（２０年）	1.9	220,000	241,144	2023/12/20
第６６回利付国債（２０年）	1.8	330,000	360,198	2023/12/20
第６７回利付国債（２０年）	1.9	130,000	143,175	2024/3/20
第６８回利付国債（２０年）	2.2	190,000	212,021	2024/3/20
第６９回利付国債（２０年）	2.1	390,000	433,309	2024/3/20
第７０回利付国債（２０年）	2.4	400,000	452,904	2024/6/20
第７１回利付国債（２０年）	2.2	200,000	224,408	2024/6/20
第７２回利付国債（２０年）	2.1	630,000	707,376	2024/9/20
第７３回利付国債（２０年）	2.0	360,000	404,290	2024/12/20
第７４回利付国債（２０年）	2.1	200,000	225,730	2024/12/20
第７５回利付国債（２０年）	2.1	130,000	147,474	2025/3/20
第７６回利付国債（２０年）	1.9	270,000	303,123	2025/3/20
第７７回利付国債（２０年）	2.0	290,000	327,279	2025/3/20
第７８回利付国債（２０年）	1.9	170,000	191,771	2025/6/20
第７９回利付国債（２０年）	2.0	270,000	306,234	2025/6/20
第８０回利付国債（２０年）	2.1	220,000	250,872	2025/6/20
第８１回利付国債（２０年）	2.0	390,000	444,541	2025/9/20
第８２回利付国債（２０年）	2.1	600,000	687,744	2025/9/20
第８３回利付国債（２０年）	2.1	290,000	333,995	2025/12/20

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第８４回利付国債（２０年）	2.0	470,000	538,182	2025/12/20
第８５回利付国債（２０年）	2.1	290,000	335,669	2026/3/20
第８６回利付国債（２０年）	2.3	210,000	245,966	2026/3/20
第８７回利付国債（２０年）	2.2	550,000	640,409	2026/3/20
第８８回利付国債（２０年）	2.3	420,000	494,629	2026/6/20
第８９回利付国債（２０年）	2.2	350,000	409,689	2026/6/20
第９０回利付国債（２０年）	2.2	630,000	741,056	2026/9/20
第９１回利付国債（２０年）	2.3	450,000	532,660	2026/9/20
第９２回利付国債（２０年）	2.1	880,000	1,033,357	2026/12/20
第９３回利付国債（２０年）	2.0	410,000	480,187	2027/3/20
第９４回利付国債（２０年）	2.1	610,000	719,251	2027/3/20
第９５回利付国債（２０年）	2.3	610,000	732,488	2027/6/20
第９６回利付国債（２０年）	2.1	320,000	379,030	2027/6/20
第９７回利付国債（２０年）	2.2	400,000	479,096	2027/9/20
第９８回利付国債（２０年）	2.1	440,000	523,300	2027/9/20
第９９回利付国債（２０年）	2.1	1,150,000	1,373,146	2027/12/20
第１００回利付国債（２０年）	2.2	480,000	579,619	2028/3/20
第１０１回利付国債（２０年）	2.4	715,000	876,125	2028/3/20
第１０２回利付国債（２０年）	2.4	410,000	504,607	2028/6/20
第１０３回利付国債（２０年）	2.3	400,000	488,640	2028/6/20
第１０４回利付国債（２０年）	2.1	360,000	433,180	2028/6/20
第１０５回利付国債（２０年）	2.1	680,000	821,732	2028/9/20
第１０６回利付国債（２０年）	2.2	380,000	462,779	2028/9/20
第１０７回利付国債（２０年）	2.1	260,000	315,356	2028/12/20
第１０８回利付国債（２０年）	1.9	660,000	787,769	2028/12/20
第１０９回利付国債（２０年）	1.9	520,000	622,367	2029/3/20
第１１０回利付国債（２０年）	2.1	950,000	1,155,817	2029/3/20
第１１１回利付国債（２０年）	2.2	970,000	1,194,234	2029/6/20
第１１２回利付国債（２０年）	2.1	790,000	964,613	2029/6/20
第１１３回利付国債（２０年）	2.1	1,450,000	1,776,743	2029/9/20
第１１４回利付国債（２０年）	2.1	940,000	1,155,748	2029/12/20
第１１５回利付国債（２０年）	2.2	700,000	868,105	2029/12/20
第１１６回利付国債（２０年）	2.2	1,060,000	1,319,106	2030/3/20
第１１７回利付国債（２０年）	2.1	780,000	962,184	2030/3/20
第１１８回利付国債（２０年）	2.0	660,000	809,985	2030/6/20
第１１９回利付国債（２０年）	1.8	530,000	638,665	2030/6/20
第１２０回利付国債（２０年）	1.6	790,000	934,412	2030/6/20
第１２１回利付国債（２０年）	1.9	1,500,000	1,829,565	2030/9/20
第１２２回利付国債（２０年）	1.8	440,000	531,674	2030/9/20
第１２３回利付国債（２０年）	2.1	1,280,000	1,595,302	2030/12/20
第１２４回利付国債（２０年）	2.0	540,000	666,759	2030/12/20
第１２５回利付国債（２０年）	2.2	820,000	1,034,799	2031/3/20
第１２６回利付国債（２０年）	2.0	730,000	903,959	2031/3/20
第１２７回利付国債（２０年）	1.9	670,000	821,734	2031/3/20
第１２８回利付国債（２０年）	1.9	1,290,000	1,586,480	2031/6/20
第１２９回利付国債（２０年）	1.8	320,000	389,683	2031/6/20
第１３０回利付国債（２０年）	1.8	1,045,000	1,275,756	2031/9/20
第１３１回利付国債（２０年）	1.7	640,000	773,446	2031/9/20
第１３２回利付国債（２０年）	1.7	840,000	1,017,416	2031/12/20

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第１３３回利付国債（２０年）	1.8	1,080,000	1,321,650	2031/12/20
第１３４回利付国債（２０年）	1.8	1,000,000	1,226,570	2032/3/20
第１３５回利付国債（２０年）	1.7	590,000	716,142	2032/3/20
第１３６回利付国債（２０年）	1.6	570,000	684,592	2032/3/20
第１３７回利付国債（２０年）	1.7	1,120,000	1,362,379	2032/6/20
第１３８回利付国債（２０年）	1.5	320,000	380,934	2032/6/20
第１３９回利付国債（２０年）	1.6	510,000	613,744	2032/6/20
第１４０回利付国債（２０年）	1.7	1,750,000	2,133,180	2032/9/20
第１４１回利付国債（２０年）	1.7	1,610,000	1,966,437	2032/12/20
第１４２回利付国債（２０年）	1.8	520,000	642,122	2032/12/20
第１４３回利付国債（２０年）	1.6	720,000	871,214	2033/3/20
第１４４回利付国債（２０年）	1.5	1,470,000	1,758,619	2033/3/20
第１４５回利付国債（２０年）	1.7	2,455,000	3,012,039	2033/6/20
第１４６回利付国債（２０年）	1.7	2,100,000	2,581,299	2033/9/20
第１４７回利付国債（２０年）	1.6	1,690,000	2,056,713	2033/12/20
第１４８回利付国債（２０年）	1.5	1,870,000	2,251,947	2034/3/20
第１４９回利付国債（２０年）	1.5	2,540,000	3,062,935	2034/6/20
第１５０回利付国債（２０年）	1.4	2,010,000	2,396,764	2034/9/20
第１５１回利付国債（２０年）	1.2	1,735,000	2,018,099	2034/12/20
第１５２回利付国債（２０年）	1.2	2,160,000	2,514,045	2035/3/20
第１５３回利付国債（２０年）	1.3	2,160,000	2,549,469	2035/6/20
第１５４回利付国債（２０年）	1.2	1,680,000	1,957,704	2035/9/20
第１５５回利付国債（２０年）	1.0	2,160,000	2,448,727	2035/12/20
第１５６回利付国債（２０年）	0.4	1,960,000	2,027,012	2036/3/20
第１５７回利付国債（２０年）	0.2	2,110,000	2,108,248	2036/6/20
第１５８回利付国債（２０年）	0.5	2,210,000	2,317,030	2036/9/20
第１５９回利付国債（２０年）	0.6	1,870,000	1,991,811	2036/12/20
第１６０回利付国債（２０年）	0.7	1,950,000	2,110,368	2037/3/20
第１６１回利付国債（２０年）	0.6	1,710,000	1,819,679	2037/6/20
第１６２回利付国債（２０年）	0.6	2,050,000	2,179,416	2037/9/20
第１６３回利付国債（２０年）	0.6	1,680,000	1,784,277	2037/12/20
第１６４回利付国債（２０年）	0.5	1,780,000	1,856,575	2038/3/20
第１６５回利付国債（２０年）	0.5	1,040,000	1,083,347	2038/6/20
第１６６回利付国債（２０年）	0.7	1,320,000	1,422,854	2038/9/20
第１６７回利付国債（２０年）	0.5	2,070,000	2,150,440	2038/12/20
第１６８回利付国債（２０年）	0.4	440,000	448,223	2039/3/20
小　計		350,880,000	385,586,817	
地方債証券				
第3回東京都公募公債（２０年）	2.26	100,000	110,886	2024/3/19
第6回東京都公募公債（２０年）	2.0	100,000	111,609	2025/3/19
第9回東京都公募公債（３０年）	2.37	100,000	135,975	2039/3/18
第１１回東京都公募公債（３０年）	2.19	100,000	134,232	2040/9/20
第１３回東京都公募公債（３０年）	1.93	100,000	130,353	2042/3/19
第１５回東京都公募公債（３０年）	1.827	100,000	129,687	2044/6/20
第１７回東京都公募公債（２０年）	2.09	100,000	119,396	2028/12/20
第１９回東京都公募公債（２０年）	2.13	100,000	120,703	2029/6/20
第２６回東京都公募公債（２０年）	1.74	200,000	239,952	2032/6/18
第２７回東京都公募公債（２０年）	1.68	200,000	239,256	2032/12/20
第６９５回東京都公募公債	1.2	100,000	102,174	2021/3/19

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第６９６回東京都公募公債	1.19	100,000	102,454	2021/6/18
第７００回東京都公募公債	1.02	100,000	102,360	2021/9/17
第７０２回東京都公募公債	1.04	200,000	205,352	2021/12/20
第７１６回東京都公募公債	0.77	100,000	102,758	2022/12/20
第７１７回東京都公募公債	0.63	100,000	102,417	2023/3/20
第７２０回東京都公募公債	0.87	100,000	103,551	2023/6/20
第７２８回東京都公募公債	0.65	100,000	102,987	2023/12/20
第７５１回東京都公募公債	0.37	100,000	102,358	2025/12/19
第７６４回東京都公募公債	0.215	150,000	152,320	2026/12/18
第７６５回東京都公募公債	0.21	100,000	101,558	2027/3/19
第７７０回東京都公募公債	0.18	100,000	101,367	2027/6/18
平成２３年度第６回北海道公募公債	1.11	200,000	204,942	2021/8/31
平成２４年度第１４回北海道公募公債	0.8	100,000	102,944	2023/2/28
平成２７年度第１５回北海道公募公債	0.22	100,000	101,415	2026/2/26
平成２８年度第１回北海道公募公債	0.085	100,000	100,518	2026/4/28
平成２８年度第１４回北海道公募公債	0.24	200,000	203,476	2027/2/24
第４回神奈川県公募公債（３０年）	2.62	100,000	139,384	2038/3/19
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	1.706	100,000	119,391	2032/6/18
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	1.398	100,000	116,585	2034/9/20
第２１０回神奈川県公募公債	0.451	200,000	204,958	2024/12/20
第２１８回神奈川県公募公債	0.195	100,000	101,211	2025/12/19
第２２６回神奈川県公募公債	0.195	200,000	202,884	2027/3/19
第２２７回神奈川県公募公債	0.18	100,000	101,367	2027/6/18
第７回大阪府公募公債（２０年）	1.84	200,000	239,768	2031/9/26
第３４５回大阪府公募公債（１０年）	1.26	100,000	101,961	2020/12/25
第３４９回大阪府公募公債（１０年）	1.38	100,000	102,609	2021/4/27
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	0.92	100,000	102,789	2022/6/28
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	0.58	100,000	102,207	2023/4/26
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	0.835	100,000	103,483	2023/8/29
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	0.53	100,000	102,792	2024/10/30
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	0.435	151,000	154,794	2025/4/28
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	0.529	100,000	103,246	2025/8/28
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	0.493	100,000	103,136	2025/11/27
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	0.09	156,000	156,861	2026/4/27
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	0.001	200,000	199,870	2026/7/28
平成２２年度第２回京都府公募公債	1.16	100,000	101,533	2020/9/24
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	1.79	100,000	119,731	2031/10/17
平成２５年度第７回京都府公募公債	0.8	100,000	103,468	2023/9/19
平成２７年度第４回京都府公募公債	0.553	100,000	103,346	2025/6/19
第１回兵庫県公募公債（１２年）	1.1	100,000	105,502	2024/6/26
第３回兵庫県公募公債（１２年）	0.56	100,000	103,233	2025/4/16
第４回兵庫県公募公債（１２年）	0.73	200,000	210,338	2026/8/6
第７回兵庫県公募公債（１５年）	1.12	100,000	109,718	2028/12/25
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	0.82	100,000	103,395	2023/8/18
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	0.46	100,000	102,576	2025/2/26
第９回静岡県公募公債（３０年）	1.539	100,000	123,138	2045/6/20
第１２回静岡県公募公債（３０年）	0.822	100,000	106,002	2048/3/19
平成２３年度第３回静岡県公募公債	1.193	103,290	105,749	2021/5/25
平成２３年度第８回静岡県公募公債	1.025	100,000	102,480	2021/10/25

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	0.678	100,000	102,604	2023/3/22
平成２９年度第５回静岡県公募公債	0.19	100,000	101,447	2027/6/18
平成２９年度第８回静岡県公募公債	0.21	100,000	101,608	2027/6/18
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	0.215	100,000	101,657	2027/9/17
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	2.28	100,000	122,080	2029/6/20
平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	1.38	100,000	102,650	2021/4/28
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	1.212	100,000	102,425	2021/5/27
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	1.006	100,000	102,534	2021/11/30
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	0.639	100,000	102,465	2023/3/28
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	0.665	100,000	103,297	2024/4/30
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	0.38	100,000	102,463	2026/1/27
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	0.07	200,000	200,848	2026/6/29
平成２８年度第１３回愛知県公募公債（１０年）	0.13	200,000	201,798	2026/11/30
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	0.22	200,000	203,424	2027/7/28
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	0.777	100,000	105,716	2048/6/19
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	2.34	100,000	121,225	2028/9/21
平成２４年度第４回広島県公募公債	0.81	100,000	102,853	2022/11/28
平成２７年度第４回広島県公募公債	0.476	125,230	129,099	2025/11/25
平成２９年度第１回広島県公募公債	0.175	200,000	202,632	2027/5/25
第３回埼玉県公募公債（２０年）	2.42	100,000	119,382	2027/6/18
第６回埼玉県公募公債（３０年）	0.957	100,000	109,075	2046/12/20
平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	1.26	100,000	102,109	2021/1/28
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	1.28	193,000	197,325	2021/2/25
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	1.05	100,000	103,070	2022/4/26
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	0.844	100,000	103,120	2023/1/31
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	0.655	100,000	103,187	2024/3/26
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	0.469	100,000	103,014	2025/12/25
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	0.085	100,000	100,549	2026/9/29
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	0.249	100,000	101,847	2027/2/24
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	0.19	100,000	101,449	2027/6/22
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	2.38	100,000	119,468	2027/8/20
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	2.05	100,000	118,790	2028/12/20
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	1.67	100,000	110,832	2025/11/21
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	2.008	100,000	121,935	2031/5/23
平成２３年度第１回福岡県公募公債	1.18	200,000	204,932	2021/6/28
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	1.491	100,000	111,090	2026/11/27
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	2.12	100,000	134,694	2042/9/19
平成２７年度第７回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,981	2025/12/25
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	0.777	100,000	105,062	2048/6/19
第１３回千葉県公募公債（２０年）	1.701	100,000	119,569	2032/10/15
平成２２年度第８回千葉県公募公債	1.0	120,000	121,795	2020/11/25
平成２５年度第５回千葉県公募公債	0.84	100,000	103,583	2023/8/25
平成２６年度第７回千葉県公募公債	0.429	100,000	102,456	2025/2/25
平成２７年度第１回千葉県公募公債	0.549	100,000	103,283	2025/5/23
平成２８年度第４回千葉県公募公債	0.085	100,000	100,548	2026/9/25
平成２８年度第６回千葉県公募公債	0.18	320,000	324,160	2027/1/25

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	0.205	100,000	101,553	2027/10/29
第９４回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	102,065	2021/1/25
第９５回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	102,241	2021/2/25
第９７回共同発行市場公募地方債	1.38	356,000	365,369	2021/4/23
第９８回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	102,354	2021/5/25
第１０２回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	153,603	2021/9/24
第１０８回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	102,864	2022/3/25
第１０９回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,067	2022/4/25
第１１０回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	102,674	2022/5/25
第１１２回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	102,667	2022/7/25
第１１７回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	102,584	2022/12/22
第１１９回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	206,022	2023/2/24
第１２５回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	103,497	2023/8/25
第１２７回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,019	2023/10/25
第１２８回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,984	2023/11/24
第１３０回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	207,130	2024/1/25
第１３２回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	309,630	2024/3/25
第１３６回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,124	2024/7/25
第１３７回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	102,940	2024/8/23
第１４０回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,747	2024/11/25
第１４５回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	204,778	2025/4/25
第１４６回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,606	2025/5/23
第１４８回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	129,671	2025/7/25
第１５２回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	103,220	2025/11/25
第１５６回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,613	2026/3/25
第１５７回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,482	2026/4/24
第１５９回共同発行市場公募地方債	0.07	300,000	301,272	2026/6/25
第１６０回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	200,570	2026/7/24
第１６１回共同発行市場公募地方債	0.06	500,000	501,805	2026/8/25
第１６４回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	100,299	2026/11/25
第１６６回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	101,300	2027/1/25
第１６７回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	101,817	2027/2/25
第１７１回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	202,820	2027/6/25
第１７４回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	196,316	2027/9/24
第１７５回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	101,593	2027/10/25
第１８１回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	303,600	2028/4/25
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	0.8	200,000	205,488	2022/10/26
平成２２年度第１回静岡市公募公債	1.008	100,000	101,508	2020/11/25
平成２９年度第１回静岡市公募公債	0.22	100,000	101,651	2027/11/24
第１３回大阪市公募公債（２０年）	2.08	200,000	242,990	2030/6/14
平成２２年度第５回大阪市公募公債	1.2	100,000	101,564	2020/9/17
第５回名古屋市公募公債（３０年）	2.49	100,000	137,919	2039/3/18
第９回名古屋市公募公債（２０年）	2.07	100,000	119,206	2028/12/20
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	1.774	100,000	127,646	2044/9/20
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	0.744	100,000	102,667	2022/12/20
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	0.225	100,000	101,680	2027/3/26
平成２２年度第２回京都市公募公債	1.11	102,000	103,410	2020/8/27
平成２３年度第４回京都市公募公債	1.067	100,000	102,752	2021/12/22
平成２４年度第４回京都市公募公債	0.801	100,000	102,736	2022/10/21

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
平成２４年度第５回京都市公募公債	0.854	100,000	103,157	2023/1/31
平成２８年度第６回京都市公募公債	0.18	300,000	303,903	2027/1/27
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	2.54	120,000	141,399	2026/6/19
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	2.38	200,000	241,910	2028/5/26
第５回横浜市公募公債（２０年）	2.17	100,000	113,156	2025/6/20
第２０回横浜市公募公債（２０年）	2.1	100,000	120,761	2029/10/19
平成２３年度第５回横浜市公募公債	1.011	100,000	102,710	2022/1/28
平成２８年度第４回横浜市公募公債	0.175	100,000	101,261	2027/1/22
平成２９年度第２回横浜市公募公債	0.24	200,000	203,734	2027/7/16
平成３０年度第１回横浜市公募公債	0.195	100,000	101,374	2028/4/17
平成３０年度第４回横浜市公募公債	0.289	200,000	204,284	2028/10/17
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	1.493	100,000	111,417	2027/2/12
平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	0.8	100,000	102,865	2022/12/20
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	0.43	100,000	102,362	2024/12/20
第１１回川崎市公募公債（２０年）	1.84	100,000	119,264	2030/10/18
第８９回川崎市公募公債	0.16	100,000	101,131	2026/12/18
平成２６年度第２回北九州市公募公債	0.451	100,000	102,485	2024/12/24
平成２７年度第２回北九州市公募公債	0.484	100,000	103,104	2025/12/18
平成２８年度第１回北九州市公募公債	0.08	200,000	200,960	2026/4/15
平成２８年度第４回北九州市公募公債	0.165	145,000	146,693	2026/12/16
平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	2.14	100,000	121,061	2029/9/18
平成２６年度第５回福岡市公募公債	0.539	200,000	205,788	2024/10/28
平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	0.289	100,000	102,245	2028/10/30
平成２２年度第６回広島市公募公債	1.21	100,000	102,436	2021/5/31
平成２５年度第３回広島市公募公債	0.67	150,000	154,803	2024/2/23
平成２６年度第２回広島市公募公債	0.456	100,000	102,514	2024/12/25
平成２８年度第４回広島市公募公債	0.165	105,000	106,230	2026/12/25
平成２９年度第６回広島市公募公債	0.23	170,000	172,888	2028/2/25
平成２３年度第２回千葉市公募公債	1.06	200,000	205,312	2021/11/25
平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	0.33	200,000	203,712	2025/1/30
第１１３回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	119,140	2027/12/20
小　計		23,936,220	25,302,814	
特殊債券（除く金融債）				
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	2.2	300,000	313,332	2021/5/21
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	126,000	126,427	2026/3/13
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	101,549	2027/7/20
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	212,100	2027/9/24
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	190,913	2028/9/15
第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	104,922	2021/9/13
第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	100,000	102,709	2023/3/15
第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	109,123	2023/6/19
第３７回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.085	100,000	100,868	2026/12/14
第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	103,401	2021/2/26
第９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	207,102	2021/3/26

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	149,517	2049/6/30
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	242,534	2029/9/28
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	135,154	2040/5/31
第１２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	200,000	203,944	2020/12/28
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	122,968	2030/12/27
第１２６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	102,081	2021/1/29
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	102,585	2021/4/30
第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	102,486	2021/7/30
第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	300,000	307,590	2021/10/29
第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	301,000	308,624	2022/1/31
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	200,000	205,694	2022/5/31
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	100,000	102,907	2022/6/30
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	102,759	2022/8/31
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	300,000	308,385	2022/12/28
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	119,790	2032/12/28
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	103,236	2023/1/31
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	309,696	2023/2/28
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	205,426	2023/3/17
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	204,594	2023/4/28
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	300,000	307,821	2023/5/31
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	200,000	207,590	2023/6/30
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	153,439	2023/9/29
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	103,345	2024/3/29
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	236,090	2034/3/31
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	102,000	105,592	2024/4/30
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	103,429	2024/6/28
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	103,270	2024/7/31
第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	103,093	2024/10/31

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	102,773	2024/12/27
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	306,006	2025/1/31
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	200,000	204,676	2026/1/30
第２６９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	101,182	2026/2/27
第２７７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.394	100,000	96,446	2046/5/31
第２９４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	107,281	2026/11/30
第２９７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.085	316,000	318,758	2026/12/28
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	205,000	207,281	2027/1/29
第３０６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	101,373	2027/3/31
第３０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.14	300,000	304,044	2027/4/30
第３２１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	101,530	2027/8/31
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	520,000	530,254	2028/2/29
第３４８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	200,000	203,170	2028/5/31
第３６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	214,000	218,628	2028/10/31
第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	101,924	2020/12/14
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	103,428	2021/3/12
第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	103,558	2021/4/16
第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	102,517	2022/1/25
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	103,206	2023/2/17
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	102,286	2023/4/21
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	102,580	2023/5/16
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	103,711	2023/8/14
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	206,674	2024/2/16
第７９回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	102,678	2025/12/12
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	100,339	2026/3/13
第９１回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,868	2026/12/14
第９２回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	100,000	101,110	2027/1/19
第９５回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	254,368	2027/4/16
第９８回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	101,547	2027/7/16
第９９回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	101,520	2027/8/13
第１０５回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	112,160	2028/2/15
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	159,235	2028/8/15
第１１３回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	102,155	2028/10/16
第７５回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	101,064	2027/1/18
第５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.21	100,000	114,299	2025/12/19
第１２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.52	100,000	117,359	2026/6/19
第１４回道路債券	1.91	100,000	106,706	2022/12/20
第１７回道路債券	1.54	100,000	105,390	2022/12/20
第１７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	400,000	466,764	2026/9/18

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第２１回道路債券	2.75	100,000	134,314	2033/6/20
第２８回道路債券	2.83	200,000	272,670	2033/12/20
第３３回道路債券	2.91	200,000	276,788	2034/6/20
第３４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	120,432	2028/3/17
第３６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	157,806	2048/3/20
第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	121,150	2028/6/20
第４２回道路債券	2.22	100,000	112,599	2025/3/21
第４７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	122,616	2029/4/20
第８１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.03	100,000	102,627	2021/12/20
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	300,000	308,958	2022/3/18
第９５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	120,236	2032/9/17
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	102,703	2023/3/20
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	103,932	2023/3/20
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	103,160	2023/9/20
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	102,418	2024/12/20
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	137,534	2055/3/19
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	114,184	2058/3/19
第２回公営企業債券（２０年）	1.45	100,000	105,145	2022/12/20
第３回公営企業債券（２０年）	1.03	110,000	114,298	2023/3/22
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	1.176	100,000	110,342	2029/1/26
第７回公営企業債券（２０年）	2.2	100,000	110,569	2024/3/22
第７回公営企業債券（３０年）	2.67	100,000	136,618	2035/6/20
第８回公営企業債券（２０年）	2.25	40,000	44,323	2024/3/22
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	2.043	200,000	241,668	2030/6/28
第１５回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	202,692	2020/8/28
第１９回公営企業債券（２０年）	2.37	100,000	117,276	2026/12/18
第２３回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	102,707	2021/4/28
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	1.702	100,000	119,361	2032/9/28
第３８回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	513,130	2022/7/28
第４２回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	102,787	2022/11/28
第５８回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	103,548	2024/3/28
第６５回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	308,115	2024/10/28
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	1.519	200,000	221,630	2026/10/20
第８７回地方公共団体金融機構債券	0.125	100,000	100,541	2026/8/28
第８８回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	100,182	2026/9/28
Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	111,167	2027/4/23
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	106,596	2025/7/30
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	214,208	2025/10/28
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	105,375	2026/2/4
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	106,969	2027/4/28
第７回阪神高速道路債券	2.18	100,000	112,367	2025/3/21
第１９回阪神高速道路株式会社社債	0.02	100,000	99,962	2021/12/20
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	123,180	2031/5/9
第４３回都市再生債券	1.29	100,000	101,666	2020/9/18
第１２７回都市再生債券	0.075	400,000	400,436	2026/9/18

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第５回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	112,024	2024/12/20
第３４４回東京交通債券	1.67	100,000	106,137	2023/2/17
第３４６回東京交通債券	1.13	20,000	20,891	2023/6/20
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	14,814	15,475	2042/5/10
第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.08	15,066	15,807	2037/11/10
第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.27	15,463	16,364	2037/11/10
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.18	265,404	266,948	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	185,444	186,326	2033/1/10
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	15,482	16,316	2042/8/10
第４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.03	16,492	17,426	2038/5/10
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.76	13,424	13,827	2036/11/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.26	27,590	28,829	2037/5/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.94	16,024	16,846	2038/11/10
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	119,224	2027/6/18
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.15	14,591	15,285	2037/5/10
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.09	16,888	17,881	2039/5/10
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.19	14,537	15,252	2037/5/10
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.09	16,736	17,706	2039/11/10
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	118,980	2027/12/20
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.7	15,977	16,325	2032/5/10
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.65	16,309	16,660	2032/5/10
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	22,271	23,985	2044/4/10
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	22,714	24,527	2044/5/10
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	25,224	27,398	2044/6/10
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	28,514	30,686	2044/9/10
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	30,415	32,851	2044/11/10
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	31,451	33,894	2044/12/10
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	66,230	71,309	2045/3/10
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	14,977	15,599	2040/11/10
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	33,307	35,553	2045/5/10
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	14,914	15,525	2041/2/10
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	14,731	15,533	2041/5/10
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	36,338	38,927	2046/2/10
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	13,712	14,368	2041/9/10
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	36,051	38,688	2046/3/10
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	33,783	36,216	2046/5/10
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	15,600	16,578	2041/12/10
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	67,824	72,204	2046/7/10
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	36,757	39,202	2046/8/10
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	15,365	16,156	2042/4/10
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	48,027	51,044	2046/12/10
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	45,768	48,627	2047/1/10
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	45,757	48,646	2047/2/10
第５８回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	101,339	2020/9/18
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	97,606	103,504	2047/5/10
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	102,061	2020/12/18
第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	102,105	2020/12/18

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第６４回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	111,645	2025/12/19
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	104,882	110,156	2047/11/10
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	52,957	55,556	2047/12/10
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	52,949	55,972	2048/1/10
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	54,018	57,175	2048/2/10
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	47,725	50,307	2048/3/10
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	47,631	49,844	2048/5/10
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	53,575	56,825	2048/6/10
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	183,327	2031/6/13
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	49,226	51,525	2048/12/10
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	55,541	58,021	2049/5/10
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	56,825	59,417	2049/6/10
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	57,540	60,009	2049/8/10
第８７回一般担保住宅金融支援機構債券	1.53	100,000	110,767	2026/9/18
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	120,246	2031/11/18
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	121,224	126,413	2049/10/10
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	62,043	64,426	2049/11/10
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	128,514	132,626	2050/1/10
第９３回一般担保住宅金融支援機構債券	1.557	100,000	111,211	2026/12/18
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	72,316	74,894	2050/3/10
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	76,075	78,571	2050/5/10
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	75,379	78,264	2050/6/10
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	154,754	161,194	2050/8/10
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	76,132	79,142	2050/9/10
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	80,675	83,968	2051/1/10
第１１１回一般担保住宅金融支援機構債券	1.404	100,000	110,766	2027/6/18
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	89,297	90,296	2051/10/10
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	89,511	90,314	2051/11/10
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	111,575	2027/9/17
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	89,642	90,851	2051/12/10
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	90,096	91,734	2052/1/10
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	90,660	92,171	2052/2/10
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	111,286	2027/9/17
第１２２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	92,516	93,949	2052/7/10
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	93,010	94,570	2052/8/10
第１２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,137	94,465	2052/9/10
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	93,337	94,701	2052/10/10
第１２６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	93,884	95,317	2052/11/10
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	188,850	191,308	2052/12/10
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,339	95,743	2053/1/10
第１２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	190,122	193,479	2053/2/10
第１３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	95,185	96,626	2053/3/10
第１３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,334	193,913	2053/4/10
第１３３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	96,292	97,736	2053/6/10
第１３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	194,182	196,620	2053/7/10
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	194,520	196,951	2053/8/10
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	133,730	2043/3/20
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	97,784	99,600	2053/10/10
第１３８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	98,357	100,411	2053/11/10

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	98,745	99,884	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	198,858	200,186	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	99,876	100,444	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	100,000	100,727	2054/5/10
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	200,000	201,002	2054/6/10
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	0.495	100,000	102,674	2025/9/19
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	0.617	200,000	208,940	2027/9/17
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	0.075	100,000	100,147	2026/10/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	116,924	2027/3/19
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	112,091	2025/6/20
第38回東日本高速道路株式会社社債	0.03	100,000	99,988	2021/9/17
第33回中日本高速道路株式会社社債	1.084	200,000	204,828	2021/9/17
第59回中日本高速道路株式会社社債	0.309	100,000	100,702	2021/12/20
第27回西日本高速道路株式会社社債	0.58	100,000	103,281	2025/9/2
第32回西日本高速道路株式会社社債	0.2	100,000	100,881	2026/10/19
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	205,660	2022/12/20
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	102,932	2023/9/20
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	100,036	2026/8/19
小　計		27,586,092	29,295,963	
金融債券				
い第786号商工債	0.22	300,000	300,825	2020/11/27
い第795号商工債	0.03	200,000	199,910	2021/8/27
い第795号農林債	0.03	100,000	99,999	2021/8/27
い第796号農林債	0.03	200,000	200,000	2021/9/27
第309回信金中金債（5年）	0.25	100,000	100,280	2020/8/27
第317回信金中金債（5年）	0.06	200,000	200,152	2021/4/27
第337回信金中金債（5年）	0.11	100,000	100,268	2022/12/27
第338回信金中金債（5年）	0.11	100,000	100,274	2023/1/27
第339回信金中金債（5年）	0.11	200,000	200,560	2023/2/27
第342回信金中金債（5年）	0.11	100,000	100,298	2023/5/26
第350回信金中金債（5年）	0.08	100,000	100,211	2024/1/26
第218号商工債（3年）	0.12	300,000	300,462	2021/3/26
第221号商工債（3年）	0.11	200,000	200,248	2021/6/25
第2回信金中金債（10年）	0.52	100,000	102,969	2025/9/26
小　計		2,300,000	2,306,456	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	100,075	2019/6/13
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	104,136	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,180	2025/3/25
第507回中部電力株式会社社債	0.605	100,000	102,490	2026/1/23
第496回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	103,776	2025/2/25
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	100,315	2023/8/25
第508回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	100,963	2027/4/23
第510回関西電力株式会社社債	0.49	100,000	101,190	2027/7/23
第511回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	100,526	2027/9/17
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	103,028	2025/7/25
第398回中国電力株式会社社債	0.425	100,000	101,075	2027/7/23
第400回中国電力株式会社社債	0.34	100,000	100,367	2027/9/24
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,190	2024/10/25

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	105,556	2026/6/25
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	100,751	2027/6/25
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	131,647	2023/12/25
第481回東北電力株式会社社債	0.803	100,000	103,420	2025/7/25
第487回東北電力株式会社社債	0.17	100,000	100,021	2023/9/25
第496回東北電力株式会社社債	0.355	100,000	100,407	2027/9/24
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	103,436	2023/6/23
第426回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	104,059	2024/2/23
第449回九州電力株式会社社債	0.43	200,000	201,852	2027/4/23
第465回九州電力株式会社社債	0.38	100,000	100,188	2028/7/25
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	100,637	2028/8/25
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	102,100	2021/12/24
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	100,000	102,755	2025/12/25
第340回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	100,691	2027/4/23
第351回北海道電力株式会社社債	0.18	100,000	99,650	2023/7/25
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,709	2021/12/3
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	100,913	2027/11/30
第7回住友林業株式会社無担保社債	0.16	100,000	100,112	2024/3/6
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,340	2024/9/13
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,371	2024/6/13
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	100,000	102,559	2025/2/28
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,508	2025/8/29
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	100,868	2022/7/15
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	103,380	2024/4/24
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	100,398	2028/10/20
第7回J．フロント　リテイリング株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,118	2024/5/22
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.856	100,000	102,930	2024/7/29
第11回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,985	2022/5/31
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,719	2023/8/30
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.45	100,000	101,153	2028/11/29
第12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	103,230	2024/6/19
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,364	2024/9/13
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	100,900	2028/8/31
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.948	100,000	100,904	2020/6/4
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	100,809	2028/2/25
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	101,166	2028/3/23
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	100,324	2026/3/6
第42回DIC株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,856	2023/4/17
第8回楽天株式会社無担保社債	0.32	100,000	99,872	2024/6/25
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	103,652	2024/10/23

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	103,074	2024/6/4
第１１回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	100,500	2027/4/21
第１３回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	100,000	100,128	2026/4/17
第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	102,641	2024/9/19
第２８回ジェイ　エフ　イーホールディングス株式会社無担保社	0.26	100,000	100,269	2026/5/27
第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.494	100,000	101,020	2022/2/25
第３３回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.15	100,000	100,025	2024/6/20
第３６回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	201,774	2021/6/11
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	200,000	202,440	2022/3/18
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,527	2023/9/20
第１７回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	200,000	202,782	2026/9/18
第１２回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,850	2021/9/17
第１８回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	100,777	2028/3/17
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	0.662	100,000	102,411	2024/9/3
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,525	2027/8/27
第６回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,168	2022/1/27
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,056	2023/9/7
第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	0.304	100,000	100,174	2021/8/2
第１回明治安田生命２０１７基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,254	2022/8/4
第１６回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	200,000	200,350	2026/9/25
第２１回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	103,341	2024/3/14
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	103,096	2024/5/30
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	100,551	2027/7/12
第２７回豊田通商株式会社無担保社債	0.07	100,000	100,008	2021/3/5
第２回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保	0.24	100,000	100,582	2024/2/22
第７０回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	121,079	2033/3/4
第５３回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,716	2027/7/26
第５６回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	101,449	2028/9/14
第７６回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	102,416	2021/5/24
第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	103,012	2024/4/24
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	2.91	100,000	124,225	2029/10/16
第２５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	1.31	100,000	101,780	2020/11/12
第３２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	1.62	100,000	103,048	2021/6/9
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	2.34	100,000	116,618	2027/4/20
第１４１回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	0.82	100,000	102,752	2023/1/23
第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	0.849	100,000	102,271	2024/9/12
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	100,000	102,131	2024/12/20
第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	0.95	300,000	307,203	2024/7/16

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第２２回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	1.43	100,000	101,763	2020/9/28
第３回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	2.04	100,000	102,330	2020/8/7
第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.233	100,000	100,386	2021/9/17
第２３回リコーリース株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,877	2021/9/24
第２回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,641	2021/3/18
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	105,108	2026/9/18
第７７回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,061	2023/12/20
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,921	2024/9/13
第２１回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,388	2023/11/27
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,796	2023/10/25
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,115	2022/1/26
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	201,662	2027/7/13
第５６回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	101,388	2028/1/18
第３１回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	100,118	2027/8/27
第１回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	200,000	200,196	2023/9/4
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	200,382	2026/3/13
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,706	2027/6/18
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,166	2024/4/26
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	102,858	2024/9/9
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	104,031	2023/6/26
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	106,006	2026/6/17
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	105,145	2025/12/12
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	101,451	2028/9/7
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	2.3	100,000	103,996	2021/2/25
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.36	100,000	106,467	2022/2/25
第４７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	117,150	2026/9/18
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	241,386	2028/12/12
第１１５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.06	100,000	99,751	2026/7/28
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	111,513	2047/7/26
第１３３回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	113,323	2058/9/27
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	20,219	2022/3/25
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	119,865	2028/3/17
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	105,711	2056/12/13
第５０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.042	100,000	109,380	2047/8/30
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	21,294	2022/5/10
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	135,471	2039/12/16
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	130,214	2044/10/28
第３１回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	112,630	2058/5/24
第６回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	100,385	2025/9/4

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,358	2024/12/6
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	200,000	204,902	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	103,161	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	101,249	2028/11/22
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	102,851	2023/9/20
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	110,462	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	103,369	2023/12/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,432	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,604	2028/7/20
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	103,338	2023/6/20
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	100,000	101,245	2022/12/16
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	200,000	201,578	2028/6/6
第20回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.16	100,000	99,900	2021/10/14
第24回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.384	100,000	100,517	2024/10/11
第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	0.367	100,000	99,957	2024/6/28
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	200,000	200,760	2020/12/11
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,913	2026/6/17
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	100,143	2024/1/26
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,607	2023/1/25
第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.435	100,000	100,240	2020/6/26
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	200,000	199,762	2021/7/9
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.202	200,000	199,552	2022/6/9
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	99,943	2024/6/7
第6回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンAB円貨社債	0.292	100,000	100,209	2020/9/3
第1回HSBC・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	0.45	100,000	100,479	2021/9/24
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	2.45	100,000	105,529	2021/12/28
第11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	0.3	300,000	300,612	2021/1/22
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	200,000	200,542	2023/7/6
第9回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	0.343	100,000	100,271	2020/7/24
第8回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,821	2023/6/2
小計		18,066,000	18,545,202	
合計		422,768,312	461,037,253	

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
国内	１０年国債標準物	153	ー

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	461,037,253	99.0
コール・ローン等、その他	4,717,094	1.0
投資信託財産総額	465,754,347	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2019年5月29日現在
(A) 資産	**465,854,394,801円**
コール・ローン等	3,651,434,694
公社債(評価額)	461,037,253,321
未収入金	1,425,788
未収利息	1,045,370,519
前払費用	18,903,479
差入委託証拠金	100,007,000
(B) 負債	**3,553,445,347**
未払金	3,398,844,900
未払解約金	54,547,588
未払利息	5,859
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C) 純資産総額(A-B)	**462,300,949,454**
元本	325,310,168,792
次期繰越損益金	136,990,780,662
(D) 受益権総口数	**325,310,168,792口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**14,211円**

■損益の状況

項目	当期 自 2018年5月30日 至 2019年5月29日
(A) 配当等収益	**3,506,472,102円**
受取利息	3,507,712,775
支払利息	△1,240,673
(B) 有価証券売買損益	**5,448,631,427**
売買益	6,490,422,816
売買損	△1,041,791,389
(C) 先物取引等取引損益	**△3,964,972**
取引益	17,167,484
取引損	△21,132,456
(D) その他費用	**△169,368**
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	**8,950,969,189**
(F) 前期繰越損益金	**107,044,577,611**
(G) 追加信託差損益金	**29,281,816,205**
(H) 解約差損益金	**△8,286,582,343**
(I) 計(E+F+G+H)	**136,990,780,662**
次期繰越損益金(I)	**136,990,780,662**

(注1)(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2)(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3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は272,091,024,387円、期中追加設定元本額は74,219,696,546円、期中一部解約元本額は21,000,552,141円です。
※担保に供している資産
先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。
国債証券　102,139,000円
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	84,038,060,144円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	76,505,945,777円
DC日本債券インデックス・オープンP	38,792,453,664円
DCマイセレクション50	21,872,971,518円
DCマイセレクション25	20,002,766,368円
SMT 国内債券インデックス・オープン	15,220,233,954円
日本債券ファンド・シリーズ1	10,097,030,927円
DCマイセレクションS50	8,961,657,882円
DCマイセレクションS25	8,095,019,058円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,524,182,637円
DCマイセレクション75	5,867,642,495円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	4,502,636,076円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,876,871,785円

バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,659,003,786円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,826,452,263円
世界経済インデックスファンド	1,805,109,839円
DCマイセレクションS75	1,692,366,313円
DC世界経済インデックスファンド	1,575,334,940円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,483,885,036円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,296,979,543円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,253,649,663円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,168,495,941円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	969,342,742円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	843,636,637円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	751,166,155円
DC日本債券インデックス・オープン	457,210,701円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	419,415,205円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	324,450,544円
グローバル経済コア	239,040,729円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	222,002,408円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	166,821,664円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	160,191,237円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	112,243,399円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	85,678,877円
SMT インデックスバランス・オープン	65,210,008円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	63,173,989円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	57,771,933円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	51,980,930円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	50,535,901円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,490,331円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	29,254,801円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	21,351,745円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,481,838円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,941,064円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	9,722,058円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	9,696,465円
SMT 世界経済インデックス・オープン	9,047,258円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	4,937,984円
エマージング株式オープン	2,227,240円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,076,820円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	866,233円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	400,895円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	18,784円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	14,886円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	10,633円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	7,089円

お知らせ

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。
なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。
このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）
第20期～第22期(2019年７月９日～2020年１月７日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	―	
信託期間	2016年２月17日以降、無期限とします。	
運用方針	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。実質組入外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主な投資対象	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。
	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。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

○最近15期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		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
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
8期(2017年9月7日)	12,405	45	△ 0.8	128.88	△ 0.7	96.0	1.4	2.6	7,513
9期(2017年11月7日)	13,482	25	8.9	140.22	8.8	96.3	1.1	2.5	10,157
10期(2018年1月9日)	14,116	40	5.0	147.57	5.2	96.1	1.4	2.4	14,743
11期(2018年3月7日)	12,950	30	△ 8.0	135.78	△ 8.0	96.2	1.4	2.3	17,575
12期(2018年5月7日)	13,176	50	2.1	138.73	2.2	96.3	1.3	2.4	20,000
13期(2018年7月9日)	13,591	65	3.6	144.03	3.8	96.1	1.4	2.4	25,407
14期(2018年9月7日)	13,810	40	1.9	146.89	2.0	96.1	1.4	2.4	29,857
15期(2018年11月7日)	13,531	25	△ 1.8	144.11	△ 1.9	96.8	0.6	2.4	36,432
16期(2019年1月7日)	12,055	20	△10.8	128.83	△10.6	95.6	1.8	2.5	39,149
17期(2019年3月7日)	13,555	60	12.9	145.65	13.1	96.5	0.8	2.6	43,824
18期(2019年5月7日)	14,075	30	4.1	151.69	4.1	96.4	0.9	2.6	44,356
19期(2019年7月8日)	14,032	100	0.4	152.43	0.5	95.7	1.6	2.7	47,613
20期(2019年9月9日)	13,654	40	△ 2.4	148.99	△ 2.3	96.0	1.1	2.8	47,978
21期(2019年11月7日)	14,385	35	5.6	157.38	5.6	96.3	1.0	2.7	47,357
22期(2020年1月7日)	15,043	30	4.8	164.96	4.8	95.9	1.3	2.7	44,771

＊基準価額の騰落率は分配金込み。
＊当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
＊株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＊ベンチマーク（＝MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし））は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。
＊MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。
ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。
請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。
（出所）MSCI

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		円	%		%	%	%	%
第20期	(期首) 2019年７月８日	14,032	－	152.43	－	95.7	1.6	2.7
	７月末	14,052	0.1	152.66	0.1	95.8	1.3	2.6
	８月末	13,352	△4.8	145.19	△4.8	95.6	1.4	2.8
	(期末) 2019年９月９日	13,694	△2.4	148.99	△2.3	96.0	1.1	2.8
第21期	(期首) 2019年９月９日	13,654	－	148.99	－	96.0	1.1	2.8
	９月末	13,738	0.6	149.87	0.6	96.0	1.0	2.8
	10月末	14,281	4.6	155.66	4.5	95.9	1.3	2.8
	(期末) 2019年11月７日	14,420	5.6	157.38	5.6	96.3	1.0	2.7
第22期	(期首) 2019年11月７日	14,385	－	157.38	－	96.3	1.0	2.7
	11月末	14,774	2.7	161.62	2.7	95.7	1.5	2.7
	12月末	15,220	5.8	166.50	5.8	95.8	1.5	2.7
	(期末) 2020年１月７日	15,073	4.8	164.96	4.8	95.9	1.3	2.7

＊期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
＊当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
＊株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当作成期中の運用経過と今後の運用方針

[基準価額の推移]

基準価額は、当作成期首14,032円から当作成期末15,043円（分配落ち後）となりました。この間、合計105円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は1,116円となりました。当作成期の基準価額の騰落率は＋8.0%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの＋8.2%を0.2%下回りました。米中貿易協議の進展への期待や市場予想を上回る米国の経済指標の発表などを受けて、基準価額は上昇しました。

[運用経過]

［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］受益証券を主要な投資対象とし、当作成期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］の運用につきましては、株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、当作成期を通じ高位に維持しました。MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

[分配金]

当作成期を通じて、配当等収益から、１万口当たり計105円の収益分配を行いました。尚、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

[今後の運用方針]

主要投資対象である［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］受益証券を高位に組み入れ、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）※の中長期的な動きを捉える投資成果を目指します。

［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］の運用につきましては、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）※の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

※野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）のベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）」は、主要投資対象である外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドのベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」と同一の指数です。

○１万口当たりの費用明細

（2019年７月９日～2020年１月７日）

項目	第20期～第22期 金額	第20期～第22期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	13	0.088	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(10)	(0.072)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（販売会社）	(1)	(0.005)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（受託会社）	(2)	(0.011)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	1	0.004	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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）	(1)	(0.004)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.007	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.005)	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）	(0)	(0.002)	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
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	15	0.100	
作成期間の平均基準価額は、14,236円です。			

＊作成期間の費用（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。
＊各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
＊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マザーファンド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。
＊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）を作成期間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７月９日～2020年１月７日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第20期～第22期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	965,696	2,597,304	3,165,023	9,163,026

＊単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

（2019年７月９日～2020年１月７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	第20期～第22期
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	75,343,619千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	593,750,506千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.12

＊(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2019年７月９日～2020年１月７日）

利害関係人との取引状況

＜野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）＞

該当事項はございません。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

区分	第20期～第22期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	53,308	－	－	32,702	743	2.3

平均保有割合　7.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

（2019年７月９日～2020年１月７日）

第20期首残高（元本）	設定元本	解約元本	第22期末残高（元本）	取　引　の　理　由
百万円 1	百万円 －	百万円 －	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

（2020年１月７日現在）

親投資信託残高

銘　　柄	第19期末	第22期末	
	口　　数	口　　数	評　価　額
	千口	千口	千円
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16,908,292	14,708,966	44,766,738

＊口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

（2020年１月７日現在）

項　　目	第22期末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	44,766,738	99.1
コール・ローン等、その他	392,514	0.9
投資信託財産総額	45,159,252	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。
＊外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第22期末における外貨建て純資産（658,751,132千円）の投資信託財産総額（659,646,210千円）に対する比率は99.9％です。
＊外貨建て資産は、第22期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。１米ドル＝108.44円、１カナダドル＝83.66円、１英ポンド＝142.85円、１スイスフラン＝111.92円、１スウェーデンクローナ＝11.53円、１ノルウェークローネ＝12.33円、１デンマーククローネ＝16.24円、１ユーロ＝121.36円、１香港ドル＝13.95円、１シンガポールドル＝80.37円、１豪ドル＝75.16円、１ニュージーランドドル＝72.25円、１新シェケル＝31.20円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項　　目	第20期末 2019年９月９日現在	第21期末 2019年11月７日現在	第22期末 2020年１月７日現在
	円	円	円
(A) 資産	**48,149,869,690**	**47,574,247,170**	**45,159,252,977**
コール・ローン等	18,593,415	18,011,688	20,543,133
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	47,973,853,837	47,352,674,648	44,766,738,757
未収入金	157,422,438	203,560,834	371,971,087
(B) 負債	**171,215,946**	**216,825,995**	**388,055,163**
未払収益分配金	140,558,650	115,225,130	89,287,751
未払解約金	16,559,999	88,004,998	285,043,998
未払信託報酬	13,837,830	13,345,636	13,470,830
未払利息	30	19	25
その他未払費用	259,437	250,212	252,559
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	**47,978,653,744**	**47,357,421,175**	**44,771,197,814**
元本	35,139,662,562	32,921,465,958	29,762,583,938
次期繰越損益金	12,838,991,182	14,435,955,217	15,008,613,876
(D) 受益権総口数	**35,139,662,562口**	**32,921,465,958口**	**29,762,583,938口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**13,654円**	**14,385円**	**15,043円**

(注) 第20期首元本額は33,931,518,877円、第20～22期中追加設定元本額は1,969,335,535円、第20～22期中一部解約元本額は6,138,270,474円、１口当たり純資産額は、第20期1.3654円、第21期1.4385円、第22期1.5043円です。

○損益の状況

項　　目	第20期 2019年７月９日～ 2019年９月９日	第21期 2019年９月10日～ 2019年11月７日	第22期 2019年11月８日～ 2020年１月７日
	円	円	円
(A) 配当等収益	**△ 1,115**	**△ 572**	**△ 792**
支払利息	△ 1,115	△ 572	△ 792
(B) 有価証券売買損益	**△ 1,055,762,854**	**2,537,130,487**	**2,059,576,144**
売買益	4,267,912	2,618,371,304	2,164,671,417
売買損	△ 1,060,030,766	△ 81,240,817	△ 105,095,273
(C) 信託報酬等	**△ 14,097,267**	**△ 13,595,848**	**△ 13,723,389**
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**△ 1,069,861,236**	**2,523,534,067**	**2,045,851,963**
(E) 前期繰越損益金	**3,100,198,169**	**1,763,334,372**	**3,764,958,117**
(F) 追加信託差損益金	**10,949,212,899**	**10,264,311,908**	**9,287,091,547**
（配当等相当額）	(11,617,724,961)	(10,900,162,647)	(9,861,331,811)
（売買損益相当額）	(△ 668,512,062)	(△ 635,850,739)	(△ 574,240,264)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**12,979,549,832**	**14,551,180,347**	**15,097,901,627**
(H) 収益分配金	**△ 140,558,650**	**△ 115,225,130**	**△ 89,287,751**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**12,838,991,182**	**14,435,955,217**	**15,008,613,876**
追加信託差損益金	10,949,212,899	10,264,311,908	9,287,091,547
（配当等相当額）	(11,622,041,027)	(10,900,901,959)	(9,861,447,784)
（売買損益相当額）	(△ 672,828,128)	(△ 636,590,051)	(△ 574,356,237)
分配準備積立金	3,107,404,806	4,171,643,309	5,721,522,329
繰越損益金	△ 1,217,626,523	－	－

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

○お知らせ

該当事項はございません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

第17期(計算期間：2018年４月３日～2019年４月１日)

○当期中の運用経過と今後の運用方針

[運用経過]

（１）株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じて高位に維持しました。MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させました。MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

（２）基準価額は、期首24,752円から期末27,269円となりました。ベンチマークとしているMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）が10.6%の上昇となったのに対して、基準価額は10.2%の上昇となりました。

[今後の運用方針]

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

＊MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が円換算しています。

＊MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。
ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。
請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

（出所）MSCI

○１万口当たりの費用明細

（2018年４月３日～2019年４月１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	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	2	0.009	(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)	(0.008)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	4	0.016	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.009)	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）	(2)	(0.006)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	7	0.028	
期中の平均基準価額は、26,428円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2018年４月３日～2019年４月１日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		百株	千米ドル	百株	千米ドル
外国	アメリカ	70,856	525,308	13,451	82,014
		(7,037)	(25,626)	(6,058)	(45,379)
			千カナダドル		千カナダドル
	カナダ	11,716	43,943	1,586	3,098
		(1,793)	(2,310)	(860)	(1,483)
			千英ポンド		千英ポンド
	イギリス	71,996	41,131	18,560	14,593
		(241,935)	(2,484)	(240,207)	(1,846)
			千スイスフラン		千スイスフラン
	スイス	4,003	24,683	159	1,504
		(247)	(△613)	(95)	(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	5,614	71,036	432	4,871
		(4,440)	(52,449)	(3,120)	(53,623)
			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	1,431	22,085	－	－
			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	951	32,792	1,174	11,200
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	5,315	23,993	616	2,364
		(835)	(△4,126)	(979)	(143)
	イタリア	12,915	7,145	1,570	439
		(277)	(－)	(220)	(1,121)
	フランス	6,019	27,157	251	1,127
		(104)	(977)		
	イギリス	－	－	－	－
		(1,160)	(1,951)	(1,160)	(1,951)
	オランダ	3,170	9,205	1,108	1,808
		(△888)	(165)	(310)	(2,389)
	スペイン	11,757	7,761	1,991	2,229
		(41,907)	(512)	(41,213)	(512)
	ベルギー	399	2,484	16	119
	オーストリア	245	865	－	－
		(－)	(△42)		
	ルクセンブルグ	1,086	981	－	－
	フィンランド	1,715	2,438	－	－
	アイルランド	1,175	3,086	7	49
		(364)	(4,087)	(364)	(4,087)
	ポルトガル	1,090	466	－	－

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	香港	百株 18,593 (1,152)	千香港ドル 74,355 (－)	百株 14,916	千香港ドル 5,506
	シンガポール	9,253	千シンガポールドル 5,470	750	千シンガポールドル 284
	オーストラリア	16,013 (5,292)	千豪ドル 25,756 (2,659)	3,102 (3,369)	千豪ドル 2,510 (2,203)
	ニュージーランド	2,050 (412)	千ニュージーランドドル 1,905 (221)	880 (206)	千ニュージーランドドル 284 (23)
	イスラエル	1,500 (11)	千新シェケル 3,447 (510)	11 (48)	千新シェケル 573 (1,560)

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

投資信託証券

銘柄		買付 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	AGNC INVESTMENT CORP	28,200	519	－	－
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,400	424	－	－
	AMERICAN TOWER CORP	10,100	1,507	－	－
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	64,000	656	－	－
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,900	512	－	－
	BOSTON PROPERTIES	3,000	367	－	－
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	－	－	37,000	587
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	7,000 (30,832)	119 (583)	22,832	427
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,600	237	－	－
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	－	－	59,000	347
	CROWN CASTLE INTL CORP	10,000	1,091	－	－
	DIGITAL REALTY TRUST INC	3,500	417	－	－
	DUKE REALTY CORP	8,900	237	－	－
	EQUINIX INC	1,810	714	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL	7,900	517	－	－
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,440	354	－	－
	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,800	332	－	－
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,900	227	－	－
	GGP INC	13,800	279	－ (82,000)	－ (1,675)
	HCP INC	14,500	375	－	－
	HOST HOTELS & RESORTS INC	12,000	241	－	－
	INVITATION HOMES INC	11,000	232	－	－
	IRON MOUNTAIN INC	7,000	238	－	－
	KIMCO REALTY CORP	7,000	111	－	－
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,900	118	－	－
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,300	130	－	－
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	4,900	233	－	－
	PROLOGIS INC	24,900	1,613	－	－
	PUBLIC STORAGE	3,200	663	－	－
	REALTY INCOME CORP	7,200	425	－	－
	REGENCY CENTERS CORP	4,000	248	－	－
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,200	359	800	153
	SL GREEN REALTY CORP	1,500	119	－	－
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,300	1,252	1,100	201
	UDR INC	5,900	242	－	－
	VENTAS INC	9,000	505	－	－
	VEREIT INC	16,000	127	－	－
	VORNADO REALTY TRUST	3,700	240	－	－
	WP CAREY INC	21,500	1,420	－	－
	WELLTOWER INC	8,200	535	－	－
	WEYERHAEUSER CO	17,800	516	5,500	140
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	－	－	509,000	139
	小計	367,250 (30,832)	18,472 (583)	635,232 (82,000)	1,997 (1,675)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	－ (20,000)	－ (416)	－	－

銘柄			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外国	カナダ		口	千カナダドル	口	千カナダドル
		H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	6,400 (△ 20,000)	130 (△ 416)	－	－
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	5,100	122	－	－
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	4,100	125	－	－
	小計		15,600	377	－	－
	イギリス			千英ポンド		千英ポンド
		BRITISH LAND	14,000	84	－	－
		HAMMERSON PLC	19,000	85	－	－
		SEGRO PLC	27,000	169	－	－
		LAND SECURITIES GROUP PLC	10,000	83	－	－
	小計		70,000	423	－	－
	ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
		フランス				
		ICADE	1,400	91	－	－
		KLEPIERRE	3,100	92	－	－
		GECINA SA	800	98	－	－
		COVIVIO	2,600	222	－	－
		UNIBAIL RODAMCO-NA	4,790 (△ 16,470)	917 (△ 3,085)	－	－
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,630 (16,470)	413 (3,085)	－	－
	小計		15,320	1,835	－	－
	ユーロ計		15,320	1,835	－	－
	香港			千香港ドル		千香港ドル
		LINK REIT	36,000	2,612	－	－
		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	110,000	836	－	－
	小計		146,000	3,448	－	－
	シンガポール			千シンガポールドル		千シンガポールドル
		CAPITALAND MALL TRUST	70,000	168	－	－
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	98,000 (－)	254 (△ 3)	－	－
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,000	119	－	－
		SUNTEC REIT	－ (－)	－ (△ 4)	－	－
	小計		238,000 (－)	542 (△ 8)	－	－
	オーストラリア			千豪ドル		千豪ドル
		MIRVAC GROUP	60,000	140	－	－
		GPT GROUP	53,000	279	－	－
		LENDLEASE GROUP	16,000	274	－	－
		STOCKLAND TRUST GROUP	74,000	283	－	－
		DEXUS	27,000	268	－	－
		GOODMAN GROUP	28,000	296	15,000	140
		SCENTRE GROUP	111,000	440	－	－
		WESTFIELD CORP	－	－	234,000	2,068
		VICINITY CENTRES	107,000	276	－	－
	小計		476,000	2,260	249,000	2,208

＊金額は受け渡し代金。
＊金額の単位未満は切り捨て。
＊（ ）内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。
＊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 108,195	百万円 107,516	百万円 －	百万円 －

＊単位未満は切り捨て。
＊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

（2018年４月３日～2019年４月１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	100,856,545千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	498,589,134千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.20

＊(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

（2018年４月３日～2019年４月１日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	91,588	－	－	29,711	66	0.2

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野村信託銀行です。

○組入資産の明細

（2019年４月１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	
AFLAC INC	924	1,053	5,265	584,941	保険
AGCO CORP	78	—	—	—	機械
AES CORP	740	910	1,645	182,790	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC	7,144	9,938	31,165	3,462,494	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	2,012	2,396	19,153	2,127,967	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	1,858	2,059	16,593	1,843,535	バイオテクノロジー
ABIOMED INC	—	58	1,676	186,249	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	840	1,004	4,571	507,861	娯楽
ACUITY BRANDS INC	50	50	600	66,665	電気設備
ADOBE INC	574	665	17,740	1,970,940	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	83	99	1,688	187,564	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES	900	1,260	3,215	357,244	半導体・半導体製造装置
AETNA INC	381	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	65	75	803	89,249	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC	365	444	3,568	396,501	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS	251	304	5,805	644,955	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	191	225	1,613	179,257	情報技術サービス
ALBEMARLE CORP	122	148	1,213	134,798	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	263	307	4,150	461,067	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC	88	102	2,900	322,208	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP	17	21	1,286	142,879	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	59	66	1,154	128,305	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP	253	310	1,461	162,320	電力
ALLSTATE CORP	411	466	4,388	487,594	保険
ALLY FINANCIAL INC	527	574	1,577	175,307	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	99	127	1,186	131,855	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C	365	429	50,440	5,603,950	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL A	346	408	48,075	5,341,238	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALTICE USA INC-A	—	470	1,009	112,162	メディア
ALTRIA GROUP INC	2,223	2,561	14,707	1,634,039	タバコ
AMAZON.COM INC	476	568	101,182	11,241,344	インターネット販売・通信販売
AMERCO	6	11	434	48,291	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	287	328	2,412	268,022	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	146	146	463	51,516	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER	573	683	5,720	635,505	電力
AMERICAN EXPRESS CO	862	999	10,919	1,213,108	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	84	108	1,039	115,440	保険
AMERICAN INTL GROUP	1,052	1,198	5,158	573,119	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	208	247	2,575	286,107	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	192	220	1,749	194,362	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	173	192	2,459	273,252	資本市場
AMETEK INC	268	318	2,638	293,131	電気設備
AMGEN INC	785	872	16,566	1,840,511	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	359	413	3,900	433,331	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE	633	678	3,083	342,581	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC	433	510	5,368	596,470	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	177	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	99	115	2,101	233,439	ソフトウェア

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	
ANTERO RESOURCES CORP	270	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ANTHEM INC	297	354	10,182	1,131,225	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
APACHE CORPORATION	439	541	1,875	208,324	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	5,967	6,488	123,239	13,691,915	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,236	1,363	5,405	600,568	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	286	354	1,046	116,218	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	644	755	3,256	361,776	食品
ARCONIC INC	516	570	1,089	121,017	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC	56	74	2,327	258,530	通信機器
ARROW ELECTRS INC	105	121	932	103,592	電子装置・機器・部品
ASSURANT INC	63	76	721	80,138	保険
ATMOS ENERGY CORP	117	156	1,605	178,394	ガス
AUTODESK INC.	227	300	4,674	519,348	ソフトウェア
AUTOLIV INC	97	119	875	97,213	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	514	595	9,504	1,055,953	情報技術サービス
AUTONATION INC	71	—	—	—	専門小売り
AUTOZONE	32	34	3,492	387,988	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	99	122	1,378	153,162	容器・包装
AVNET INC	150	—	—	—	電子装置・機器・部品
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	310	624	69,364	各種金融サービス
BB&T CORPORATION	913	1,049	4,880	542,278	銀行
BAKER HUGHES,A GE CO,LLC	473	681	1,887	209,727	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	397	454	2,626	291,842	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	11,525	12,735	35,135	3,903,594	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,197	1,368	6,898	766,459	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC.	571	696	5,659	628,734	ヘルスケア機器・用品
BECTON,DICKINSON	309	369	9,215	1,023,790	ヘルスケア機器・用品
BEIGENE, LTD ADR	—	46	607	67,459	バイオテクノロジー
WR BERKLEY CORP	115	130	1,101	122,361	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,478	1,768	35,517	3,945,977	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	319	338	2,401	266,843	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	202	241	2,140	237,843	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	247	275	6,502	722,462	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	138	161	6,893	765,865	資本市場
H & R BLOCK INC	235	279	667	74,206	各種消費者サービス
BOEING CO	658	739	28,206	3,133,687	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC	56	63	11,045	1,227,130	インターネット販売・通信販売
BORGWARNER INC	236	296	1,136	126,313	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,611	1,891	7,257	806,325	ヘルスケア機器・用品
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	102	139	504	56,042	保険
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,908	2,222	10,601	1,177,789	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	130	163	1,690	187,775	情報技術サービス
BROADCOM INC	—	565	17,014	1,890,274	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CL B	285	356	1,878	208,753	飲料
BURLINGTON STORES INC	—	89	1,394	154,923	専門小売り
CBS CORP-CL B	400	470	2,233	248,187	メディア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	122	150	1,431	159,050	資本市場
CBRE GROUP INC	355	455	2,249	249,972	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	146	167	982	109,132	ソフトウェア
CDW CORPORATION	182	211	2,033	225,911	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	264	314	1,283	142,611	化学
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	155	183	1,591	176,861	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	284	—	—	—	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
CIGNA CORP	—	519	8,346	927,302	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ

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	
CIT GROUP INC	164	134	642	71,414	銀行
CME GROUP INC	398	488	8,031	892,300	資本市場
CMS ENERGY CORP	330	378	2,099	233,244	総合公益事業
CSX CORP	978	1,090	8,155	906,062	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,183	1,781	9,604	1,067,108	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
CA INC	348	—	—	—	ソフトウェア
CABOT OIL & GAS CORP	533	585	1,526	169,633	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	321	378	2,400	266,715	ソフトウェア
CAMPBELL SOUP CO	216	248	945	105,058	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	557	656	5,358	595,369	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	363	410	1,974	219,328	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
CARMAX INC	204	239	1,668	185,339	専門小売り
CARNIVAL CORP	411	586	2,972	330,210	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	688	811	10,988	1,220,793	機械
CELANESE CORP-SERIES A	155	180	1,774	197,200	化学
CELGENE CORP	911	962	9,075	1,008,288	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	198	558	2,962	329,187	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
CENTERPOINT ENERGY INC	452	704	2,161	240,118	総合公益事業
CENTURYLINK INC	1,080	1,360	1,630	181,164	各種電気通信サービス
CERNER CORP	342	406	2,322	258,054	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	217	217	7,555	839,438	メディア
CHEMOURS CO/THE	206	234	869	96,606	化学
CHENIERE ENERGY INC	243	286	1,955	217,211	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	2,210	2,619	32,260	3,584,179	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	28	33	2,407	267,523	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	287	329	2,343	260,359	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	106	138	964	107,169	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	184	216	1,855	206,139	保険
CISCO SYSTEMS	5,753	6,163	33,274	3,696,745	通信機器
CINTAS CORP	107	127	2,566	285,171	商業サービス・用品
CITIGROUP	3,077	3,345	20,812	2,312,278	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	578	639	2,076	230,726	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	173	185	1,843	204,836	ソフトウェア
CLOROX CO	150	177	2,840	315,539	家庭用品
COCA COLA CO	4,712	5,520	25,866	2,873,792	飲料
COGNEX CORP	192	248	1,261	140,133	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	680	804	5,824	647,155	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	967	1,127	7,724	858,187	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	5,431	6,220	24,867	2,762,785	メディア
COMERICA INC	204	230	1,686	187,354	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	228	228	495	55,043	通信機器
CONAGRA BRANDS INC	472	667	1,850	205,563	食品
CONCHO RESOURCES INC	172	276	3,062	340,243	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,377	1,586	10,584	1,175,989	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	359	423	3,587	398,567	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	198	228	3,997	444,124	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	114	139	622	69,137	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	56	65	1,948	216,511	ヘルスケア機器・用品
COPART INC	—	279	1,690	187,810	商業サービス・用品
CORNING INC	1,001	1,080	3,574	397,160	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	510	597	14,455	1,606,034	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	41	51	2,392	265,832	専門サービス
COTY INC-CL A	550	650	747	83,047	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	145	191	1,042	115,798	容器・包装

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	
CUMMINS INC	180	205	3,236	359,556	機械
DR HORTON INC	420	480	1,986	220,671	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	206	251	3,130	347,851	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	333	378	2,430	270,074	情報技術サービス
DANAHER CORP	732	860	11,353	1,261,398	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	143	166	2,016	224,022	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	175	175	950	105,553	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
DEERE & COMPANY	314	422	6,745	749,397	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	233	—	—	—	ソフトウェア
DELL TECHNOLOGIES-C	—	207	1,220	135,560	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC	201	224	1,156	128,538	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	272	303	1,502	166,936	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	573	624	1,969	218,794	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	—	116	1,381	153,491	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	104	216	2,193	243,647	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO	1,759	2,459	27,305	3,033,628	娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	428	463	3,294	366,042	消費者金融
DISCOVERY INC - A	193	193	521	57,937	メディア
DISCOVERY INC - C	353	398	1,011	112,401	メディア
DISH NETWORK CORP-A	251	319	1,010	112,312	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	312	361	4,306	478,477	複合小売り
DOLLAR TREE INC	280	324	3,403	378,106	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	747	1,024	7,852	872,465	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	52	52	1,360	151,116	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	181	197	1,847	205,297	機械
DOWDUPONT INC	2,725	3,141	16,744	1,860,332	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	211	—	—	—	飲料
DUKE ENERGY CORP	819	973	8,757	972,902	電力
EOG RESOURCES INC	676	800	7,614	845,959	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	282	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	307	350	1,625	180,543	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	162	207	992	110,319	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	171	186	1,411	156,802	化学
EATON VANCE CORP	138	164	661	73,446	資本市場
EBAY INC	1,157	1,237	4,594	510,417	インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC	303	360	6,355	706,089	化学
EDISON INTERNATIONAL	368	450	2,786	309,569	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	249	284	5,433	603,692	ヘルスケア機器・用品
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	—	361	1,158	128,751	医薬品
ELECTRONIC ARTS	361	408	4,146	460,676	娯楽
EMERSON ELEC	745	861	5,895	654,964	電気設備
ENTERGY CORP	210	254	2,429	269,862	電力
ENVISION HEALTHCARE CORP	149	—	—	—	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
EQUIFAX INC	139	161	1,907	211,962	専門サービス
EVERGY INC	—	372	2,159	239,916	電力
EVERSOURCE ENERGY	363	442	3,135	348,408	電力
EXELON CORPORATION	1,107	1,322	6,627	736,280	電力
EXPEDIA GROUP INC	144	173	2,058	228,721	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	213	230	1,745	193,947	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	661	—	—	—	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
EXXON MOBIL CORP	4,928	5,784	46,734	5,192,227	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	156	178	846	94,093	電子装置・機器・部品
FMC CORP	148	180	1,382	153,624	化学
FACEBOOK INC-A	2,773	3,283	54,724	6,079,872	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ・ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ

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	
FASTENAL CO	341	387	2,488	276,505	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	297	344	6,240	693,319	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	73	81	1,271	141,222	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	384	451	5,100	566,699	情報技術サービス
FNF GROUP	299	372	1,359	151,058	保険
FIFTH THIRD BANCORP	813	1,063	2,680	297,846	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	490	740	1,943	215,976	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	185	226	2,270	252,240	銀行
FISERV INC	480	541	4,775	530,607	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	520	714	2,970	330,072	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	102	121	2,983	331,493	情報技術サービス
FLUOR CORP	164	184	677	75,228	建設・土木
FLOWSERVE CORP	150	172	776	86,258	機械
FORD MOTOR COMPANY	4,310	5,160	4,530	503,336	自動車
FORTINET INC	170	199	1,671	185,648	ソフトウェア
FORTIVE CORP	369	406	3,405	378,399	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	171	194	923	102,615	建設関連製品
FOX CORP-CLASS A	—	480	1,763	195,901	メディア
FOX CORP-CLASS B	—	198	710	78,928	メディア
FRANKLIN RESOURCES INC	397	434	1,438	159,792	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,570	1,870	2,410	267,798	金属・鉱業
ARTHUR J GALLAGHER & CO	214	249	1,944	216,055	保険
GAP INC	271	315	824	91,620	専門小売り
GARTNER INC	100	127	1,926	214,015	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	292	345	5,840	648,841	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	10,100	11,980	11,968	1,329,647	コングロマリット
GENERAL MILLS	650	805	4,165	462,828	食品
GENERAL MOTORS CO	1,498	1,757	6,518	724,202	自動車
GENUINE PARTS CO	172	196	2,195	243,952	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,510	1,762	11,454	1,272,624	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	189	212	2,894	321,548	情報技術サービス
GODADDY INC - CLASS A	—	227	1,706	189,626	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	415	457	8,773	974,785	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	283	340	617	68,559	自動車部品
WR GRACE & CO	83	—	—	—	化学
GRAINGER(W.W.) INC	62	64	1,934	214,976	商社・流通業
GRUBHUB INC	—	119	826	91,845	インターネット販売・通信販売
HCA HEALTHCARE INC	333	375	4,889	543,195	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
HD SUPPLY HOLDINGS INC	229	229	992	110,290	商社・流通業
HP INC	1,942	2,190	4,255	472,749	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	1,023	1,196	3,504	389,325	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	433	510	911	101,309	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	194	224	798	88,744	自動車
HARRIS CORP	135	160	2,555	283,900	航空宇宙・防衛
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	424	482	2,396	266,251	保険
HASBRO INC	126	158	1,343	149,242	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	128	146	811	90,121	エネルギー設備・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	88	106	1,470	163,388	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	166	190	2,181	242,394	食品
HESS CORP	319	366	2,204	244,910	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,860	2,000	3,086	342,854	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	220	395	3,282	364,724	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	197	236	1,162	129,183	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	311	408	1,974	219,391	ヘルスケア機器・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	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
HOME DEPOT	1,359	1,548	29,704	3,300,177	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	844	1,009	16,035	1,781,491	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	328	391	1,750	194,437	食品
HUMANA INC	166	185	4,944	549,382	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	98	118	1,195	132,789	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,260	1,410	1,787	198,633	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	51	56	1,172	130,292	航空宇宙・防衛
IAC/INTERACTIVE CORP	91	104	2,185	242,769	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IPG PHOTONICS CORP	42	47	717	79,760	電子装置・機器・部品
IDEX CORP	85	103	1,562	173,640	機械
IDEXX LABORATORIES INC	102	121	2,705	300,587	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	358	405	5,812	645,820	機械
ILLUMINA INC	170	201	6,247	694,150	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	212	249	2,141	237,937	バイオテクノロジー
INGREDION INC	84	96	909	100,992	食品
INTEL CORP	5,445	6,256	33,594	3,732,373	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	685	785	5,976	664,043	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,024	1,244	17,552	1,950,120	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	87	115	1,481	164,548	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	445	523	2,419	268,853	容器・包装
INTERPUBRIC GROUP	443	500	1,050	116,710	メディア
INTUIT INC	280	337	8,809	978,737	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	131	155	8,866	985,102	ヘルスケア機器・用品
IQVIA HOLDINGS INC	155	224	3,222	357,990	ライフサイエンス・ツール/サービス
JPMORGAN CHASE & CO	4,035	4,544	45,998	5,110,479	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	141	179	1,345	149,529	建設・土木
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	—	420	789	87,677	各種金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	3,124	3,665	51,233	5,691,990	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	54	63	971	107,915	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	424	467	1,236	137,336	通信機器
KLA TENCOR CORP	183	219	2,615	290,535	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC-A	—	680	1,597	177,462	資本市場
KANSAS CITY SOUTHERN	118	142	1,646	182,972	陸運・鉄道
KELLOGG CO	302	356	2,042	226,947	食品
KEYCORP	1,240	1,460	2,299	255,474	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	252	2,197	244,135	電子装置・機器・部品
KIMBERLY-CLARK CORP	409	469	5,810	645,592	家庭用品
KINDER MORGAN INC	2,330	2,730	5,462	606,909	石油・ガス・消耗燃料
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	143	167	545	60,633	陸運・鉄道
KOHLS CORP	196	225	1,547	171,907	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	702	847	2,765	307,242	食品
KROGER CO	1,009	1,076	2,646	294,077	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	270	303	835	92,843	専門小売り
LKQ CORP	363	450	1,277	141,885	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	90	109	2,249	249,912	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	118	142	2,172	241,344	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	188	212	3,795	421,625	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	193	1,446	160,688	食品
LAS VEGAS SANDS CORP	465	549	3,346	371,818	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	262	299	4,949	549,938	パーソナル用品
LEAR CORP	77	93	1,262	140,219	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	159	189	797	88,653	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	161	200	1,281	142,407	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	326	407	1,997	221,973	家庭用耐久財

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	
LENNOX INTERNATIONAL INC	45	51	1,348	149,811	建設関連製品
LEUCADIA NATIONAL CORP	366	—	—	—	各種金融サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C	124	139	1,275	141,673	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	532	—	—	—	インターネット販売・通信販売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	98	129	492	54,719	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	197	224	856	95,165	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	224	293	1,026	114,095	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,157	1,224	15,887	1,765,136	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	258	299	1,755	194,994	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	161	208	1,321	146,833	娯楽
LOCKHEED MARTIN	301	349	10,499	1,166,505	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	333	361	1,730	192,233	保険
LOWES COS INC	960	1,098	12,019	1,335,400	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	121	138	2,261	251,242	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	157	179	2,810	312,264	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	535	700	1,796	199,557	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	104	120	2,386	265,093	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	95	—	—	—	運送インフラ
MACYS INC	359	437	1,050	116,667	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	80	80	661	73,494	専門サービス
MARATHON OIL CORP	990	1,110	1,854	206,069	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	563	946	5,661	629,027	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	16	18	1,853	205,869	保険
MARSH & MCLENNAN COS	593	691	6,488	720,871	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	362	394	4,928	547,561	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	75	89	1,790	198,924	建設資材
MASCO CORP	357	428	1,682	186,922	建設関連製品
MASTERCARD INC	1,094	1,259	29,643	3,293,354	情報技術サービス
MATTEL INC	400	480	624	69,326	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	329	374	1,988	220,928	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	139	168	2,530	281,147	食品
MCDONALD'S CORP	929	1,056	20,053	2,227,937	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	238	270	3,160	351,144	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	283	340	768	85,331	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	49	57	2,899	322,094	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	3,173	3,564	29,641	3,293,202	医薬品
METLIFE INC	1,025	1,159	4,933	548,152	保険
METTLER-TOLEDO INTL	30	34	2,472	274,712	ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ
MICROSOFT CORP	8,519	9,970	117,586	13,063,824	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	267	330	2,737	304,156	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,337	1,545	6,385	709,427	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	65	75	975	108,347	機械
MOHAWK INDUSTRIES	72	87	1,097	121,932	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B	220	256	1,527	169,654	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,731	1,985	9,909	1,100,903	食品
MONSANTO CO	515	—	—	—	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	454	559	3,051	338,968	飲料
MOODYS CORP	202	235	4,255	472,798	資本市場
MORGAN STANLEY	1,580	1,753	7,397	821,880	資本市場
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	—	450	377	41,945	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	394	488	1,332	148,066	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	190	221	3,103	344,774	通信機器
NRG ENERGY INC	—	400	1,699	188,781	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NVR INC	3	4	1,328	147,558	家庭用耐久財

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	
NASDAQ INC	140	154	1,347	149,690	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	442	506	1,347	149,761	エネルギー設備・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	—	250	840	93,324	医薬品
NETAPP INC	300	352	2,440	271,169	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	504	595	21,215	2,357,022	娯楽
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,430	1,610	1,144	127,177	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	255	307	1,914	212,695	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	266	300	1,122	124,754	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	560	—	—	—	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC	565	670	1,027	114,186	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO	229	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	612	717	2,564	284,939	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	460	550	684	76,014	メディア
NEXTERA ENERGY INC	549	651	12,585	1,398,208	電力
NIKE INC-B	1,531	1,742	14,669	1,629,768	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	382	476	1,364	151,564	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	518	644	1,592	176,939	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	150	150	665	73,959	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	335	371	6,933	770,325	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	247	284	2,567	285,265	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	193	223	6,030	670,038	航空宇宙・防衛
NUCOR CORP	366	427	2,491	276,810	金属・鉱業
NVIDIA CORP	705	796	14,292	1,587,949	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	225	286	1,233	137,012	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	98	110	4,298	477,561	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	896	1,029	6,811	756,810	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	69	86	1,241	137,958	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	268	303	2,211	245,708	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	—	590	1,213	134,834	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	436	560	3,911	434,516	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,645	3,631	19,502	2,166,683	ソフトウェア
OWENS CORNING INC	124	142	669	74,337	建設関連製品
PG&E CORP	585	—	—	—	電力
PNC FINANCIAL	550	627	7,690	854,445	銀行
PPG INDUSTRIES	299	326	3,679	408,799	化学
PPL CORPORATION	815	976	3,097	344,168	電力
PVH CORP	90	99	1,207	134,131	繊維・アパレル・贅沢品
PTC INC	—	147	1,355	150,545	ソフトウェア
PACCAR	415	478	3,257	361,862	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	109	132	1,311	145,742	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	107	126	3,060	339,997	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP	157	181	3,106	345,112	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	261	370	714	79,336	石油・ガス・消耗燃料
PAYCHEX INC	374	450	3,609	400,959	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,332	1,526	15,845	1,760,488	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	410	500	822	91,324	銀行
PEPSICO INC	1,656	1,926	23,603	2,622,307	飲料
PFIZER INC	6,937	7,924	33,653	3,738,873	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,808	2,121	18,747	2,082,849	タバコ
PHILLIPS 66	505	594	5,653	628,059	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	124	154	1,471	163,531	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	198	232	3,532	392,504	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	190	190	473	52,603	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	71	83	700	77,855	レジャー用品

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	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
PRAXAIR INC	329	—	—	—	化学
T ROWE PRICE GROUP INC	285	324	3,243	360,395	資本市場
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	334	380	1,907	211,892	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,953	3,403	35,408	3,933,852	家庭用品
PROGRESSIVE CO	677	808	5,824	647,143	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	497	572	5,255	583,890	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	597	695	4,128	458,731	総合公益事業
PULTEGROUP INC	293	379	1,059	117,730	家庭用耐久財
QORVO INC	142	176	1,262	140,257	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,720	1,655	9,438	1,048,613	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	153	191	1,717	190,811	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
QURATE RETAIL INC - A	—	580	926	102,971	インターネット販売・通信販売
RALPH LAUREN CORPORATION	68	78	1,011	112,378	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP	310	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	149	177	1,423	158,123	資本市場
RAYTHEON COMPANY	334	394	7,173	797,026	航空宇宙・防衛
RED HAT INC	203	243	4,439	493,240	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	92	110	4,533	503,643	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,370	1,390	1,966	218,517	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	72	90	1,277	141,965	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	276	308	2,475	275,050	商業サービス・用品
RESMED INC	169	192	1,996	221,780	ヘルスケア機器・用品
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	151	171	1,114	123,791	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	146	168	2,947	327,492	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC	192	—	—	—	航空宇宙・防衛
ROLLINS INC	120	210	874	97,103	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	119	143	4,907	545,197	コングロマリット
ROSS STORES INC	443	505	4,701	522,342	専門小売り
S&P GLOBAL INC	296	344	7,242	804,688	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	150	191	997	110,875	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	198	306	1,948	216,524	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	59	74	1,645	182,811	銀行
SABRE CORP	260	360	770	85,551	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC	794	1,043	16,517	1,835,148	ソフトウェア
SCANA CORP	141	—	—	—	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC	174	205	1,232	136,903	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
SCHLUMBERGER LTD	1,616	1,911	8,326	925,043	エネルギー設備・サービス
SCHWAB(CHARLES)CORP	1,409	1,662	7,106	789,555	資本市場
SEALED AIR CORP	219	219	1,008	112,068	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	134	154	1,127	125,309	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	279	371	4,669	518,771	総合公益事業
SERVICENOW INC	202	248	6,112	679,148	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	97	116	5,017	557,474	化学
SIGNATURE BANK	65	76	973	108,137	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,820	2,290	1,298	144,255	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	211	238	1,963	218,091	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	165	186	991	110,183	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	135	159	1,852	205,796	食品
SNAP-ON INC	67	74	1,158	128,681	機械
SOUTHERN CO.	1,151	1,402	7,245	804,979	電力
SOUTHWEST AIRLINES	176	198	1,027	114,190	旅客航空輸送業
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	26	—	—	—	家庭用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	132	146	1,336	148,467	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	162	197	2,454	272,708	ソフトウェア

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	
SPRINT CORP	900	1,090	615	68,420	無線通信サービス
SQUARE INC - A	319	418	3,131	347,926	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	181	211	2,873	319,211	機械
STARBUCKS CORP	1,656	1,696	12,608	1,400,755	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	435	522	3,435	381,659	資本市場
STEEL DYNAMICS	271	334	1,178	130,877	金属・鉱業
STERICYCLE INC	89	—	—	—	商業サービス・用品
STRYKER CORP	394	465	9,184	1,020,417	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	547	607	3,596	399,568	銀行
SYMANTEC CORP	713	830	1,908	211,997	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	180	207	2,383	264,818	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	920	872	2,781	309,044	消費者金融
SYSCO CORP	574	678	4,526	502,875	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	334	379	1,894	210,492	資本市場
TJX COS INC	740	1,696	9,024	1,002,612	専門小売り
T-MOBILE US INC	334	472	3,261	362,354	無線通信サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	102	1,298	144,236	ソフトウェア
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	135	157	1,481	164,606	娯楽
TAPESTRY INC	330	383	1,244	138,249	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	591	686	5,505	611,698	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	249	299	1,242	138,024	石油・ガス・消耗燃料
TELEFLEX INC	53	63	1,909	212,162	ヘルスケア機器・用品
TESARO INC	37	—	—	—	バイオテクノロジー
TESLA INC	156	175	4,903	544,739	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,050	1,330	2,085	231,692	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,149	1,314	13,937	1,548,467	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	313	335	1,697	188,548	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	468	548	15,019	1,668,612	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	693	797	16,560	1,839,823	コングロマリット
TIFFANY & CO	139	144	1,519	168,863	専門小売り
TIME WARNER INC	909	—	—	—	メディア
TOLL BROTHERS INC	185	—	—	—	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	125	140	1,147	127,465	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	195	222	2,109	234,334	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	149	163	1,593	177,036	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	60	63	2,882	320,283	航空宇宙・防衛
TRUNSUNION	218	253	1,691	187,875	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	316	367	5,033	559,252	保険
TRIMBLE INC	284	349	1,409	156,646	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	123	146	751	83,454	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,225	—	—	—	娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	510	—	—	—	娯楽
TWITTER INC	741	942	3,097	344,109	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TYSON FOODS INC-CL A	349	410	2,846	316,260	食品
UGI CORP	204	227	1,258	139,767	ガス
US BANCORP	1,918	2,112	10,177	1,130,745	銀行
ULTA BEAUTY INC	65	78	2,751	305,689	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	184	240	507	56,367	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	187	250	471	52,411	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	918	1,005	16,803	1,866,879	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	92	92	733	81,544	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	802	946	10,570	1,174,394	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	101	112	1,279	142,163	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	885	1,128	14,538	1,615,259	航空宇宙・防衛

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	
UNITED THERAPEUTICS CORP	52	63	739	82,150	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,127	1,313	32,485	3,609,085	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	98	118	1,578	175,369	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	250	312	1,055	117,265	保険
V F CORP	393	454	3,945	438,368	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	44	54	1,175	130,608	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	504	580	4,920	546,627	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	107	129	1,828	203,111	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	126	167	2,118	235,372	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	101	147	2,668	296,518	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	4,801	5,643	33,367	3,707,080	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	184	219	2,912	323,600	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	296	350	6,438	715,289	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	413	502	1,409	156,552	娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	2,110	2,404	37,548	4,171,591	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP	290	482	1,254	139,391	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A	84	116	2,093	232,634	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	217	217	1,084	120,447	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	153	186	2,202	244,668	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	60	70	922	102,524	機械
WEC ENERGY GROUP INC	358	435	3,439	382,181	総合公益事業
WABTEC CORP	103	179	1,322	146,884	機械
WALMART INC	1,740	1,989	19,398	2,155,197	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	970	1,101	6,966	773,925	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	303	368	3,260	362,198	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	500	578	6,005	667,266	商業サービス・用品
WATERS CORP	93	106	2,668	296,428	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A	—	75	1,113	123,695	インターネット販売・通信販売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	70	1,901	211,283	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WELLS FARGO CO	5,442	6,129	29,615	3,290,262	銀行
WESTAR ENERGY INC	158	—	—	—	電力
WESTERN DIGITAL CORP	342	383	1,840	204,501	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	528	590	1,089	121,069	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	50	339	37,696	化学
WESTROCK CO	292	342	1,311	145,715	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	82	93	1,235	137,305	家庭用耐久財
WILLIAMS COS	976	1,681	4,827	536,372	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	155	207	3,991	443,510	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A	350	407	4,619	513,220	情報技術サービス
WYNDHAM DESTINATIONS INC	119	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	98	138	1,646	182,939	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC	—	180	967	107,469	航空貨物・物流サービス
XCEL ENERGY INC	600	708	3,979	442,141	電力
XILINX INC	286	349	4,424	491,614	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	244	289	924	102,681	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC	206	239	1,889	209,874	機械
YUM BRANDS INC	377	422	4,211	467,951	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	222	264	750	83,356	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	133	160	555	61,753	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	239	284	3,626	402,924	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORP NA	226	275	1,248	138,738	銀行
ZOETIS INC	567	660	6,644	738,172	医薬品
ALKERMES PLC	174	201	733	81,486	バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	108	136	1,233	137,059	建設関連製品

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	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
ALLERGAN PLC	386	464	6,793	754,749	医薬品
AON PLC	288	329	5,616	623,940	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	145	560	1,809	201,082	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	189	214	873	97,003	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	85	—	—	—	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	249	292	736	81,784	化学
ACCENTURE PLC-CL A	717	870	15,313	1,701,356	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	156	191	1,013	112,615	食品
CAPRI HOLDINGS LTD	—	199	910	101,148	繊維・アパレル・贅沢品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	243	292	1,510	167,850	飲料
EATON CORP PLC	504	601	4,841	537,907	電気設備
EVEREST RE GROUP LTD	45	56	1,209	134,361	保険
IHS MARKIT LTD	469	547	2,974	330,476	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	293	334	3,605	400,574	機械
INVESCO LTD	469	580	1,119	124,429	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	70	78	1,115	123,877	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,086	1,271	4,695	521,622	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	598	66,446	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	646	695	1,682	186,936	メディア
LINDE PLC	—	751	13,212	1,467,891	化学
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	465	860	1,710	190,040	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,578	1,838	16,740	1,859,869	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	179	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
APTIV PLC	303	367	2,917	324,110	自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	427	472	1,117	124,123	専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	245	302	1,659	184,402	ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	42	59	846	94,062	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	343	378	1,810	201,117	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	205	232	1,032	114,725	機械
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	194	214	963	107,036	電気設備
TECHNIPFMC PLC	516	610	1,434	159,397	エネルギー設備・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	148	178	3,126	347,361	保険
PERRIGO CO PLC	142	165	794	88,284	医薬品
XL GROUP LTD	290	—	—	—	保険
CHUBB LTD	542	633	8,867	985,130	保険
GARMIN LTD	133	152	1,312	145,820	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	413	479	3,867	429,726	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	153	172	2,175	241,712	ソフトウェア
WIX.COM LTD	—	57	688	76,518	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	149	169	786	87,383	商社・流通業
LYONDELLBASELL INDU-CL A	386	455	3,825	425,028	化学
MYLAN NV	524	693	1,963	218,196	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV	386	468	4,136	459,582	半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	195	227	2,601	289,068	ホテル・レストラン・レジャー
BROADCOM LTD	471	—	—	—	半導体・半導体製造装置
FLEX LTD	620	760	760	84,436	電子装置・機器・部品
小計 株数・金額	354,673	413,057	3,311,089	367,862,014	
小計 銘柄数＜比率＞	600	596	—	＜64.9%＞	
（カナダ）			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	400	500	456	37,934	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD	281	331	1,923	159,983	金属・鉱業
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	506	596	4,691	390,303	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	208	338	594	49,459	ガス
ATCO LTD CL1	96	96	432	35,938	総合公益事業

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
AURORA CANNABIS INC	—	970	1,172	97,559	医薬品
BCE INC	174	198	1,174	97,742	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	753	876	8,759	728,671	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,400	1,682	11,965	995,430	銀行
BARRICK GOLD	1,340	2,366	4,334	360,588	金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC	—	425	1,401	116,567	医薬品
BLACKBERRY LTD	600	710	956	79,560	ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS	2,320	2,620	673	56,015	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	969	1,168	7,271	604,955	資本市場
CAE INC	310	360	1,065	88,677	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	155	212	1,146	95,412	容器・包装
CGI INC	—	338	3,105	258,322	情報技術サービス
CI FINANCIAL CORP	336	336	612	50,984	資本市場
CAMECO CORP	480	560	882	73,373	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	507	600	6,336	527,091	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	865	1,001	11,974	996,197	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,262	1,631	5,984	497,820	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	166	198	5,451	453,529	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	77	86	1,238	103,015	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	157	157	572	47,645	総合公益事業
CANOPY GROWTH CORP	—	275	1,590	132,276	医薬品
CENOVUS ENERGY INC	1,170	1,400	1,624	135,100	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	24	27	3,080	256,258	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP	650	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CRONOS GROUP INC	—	250	613	51,057	医薬品
DOLLARAMA INC	120	418	1,490	123,967	複合小売り
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	490	—	—	—	各種金融サービス
EMERA INC	76	76	379	31,593	電力
EMPIRE CO LTD A	210	260	752	62,573	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	1,170	2,060	1,994	165,887	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,934	2,759	13,353	1,110,882	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	32	38	2,401	199,799	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	196	240	570	47,438	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	180	250	535	44,506	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	800	990	1,499	124,772	金属・鉱業
FORTIS INC	490	583	2,879	239,540	電力
FRANCO-NEVADA CORP	222	254	2,544	211,704	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	241	278	1,335	111,124	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	1,010	1,210	1,850	153,908	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFECO INC	332	420	1,359	113,065	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	300	—	—	—	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	430	520	689	57,317	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	350	420	871	72,535	電力
IGM FINANCIAL INC	103	103	354	29,458	資本市場
IA FINANCIAL CORP INC	—	147	724	60,264	保険
IMPERIAL OIL	344	375	1,368	113,803	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	121	—	—	—	保険
INTACT FINANCIAL CORP	163	189	2,137	177,794	保険
INTER PIPELINE LTD	460	520	1,149	95,645	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	94	—	—	—	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	245	285	898	74,707	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,400	1,740	800	66,585	金属・鉱業
LINAMAR CORP	65	—	—	—	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	240	261	1,720	143,129	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
LUNDIN MINING CORP	730	950	589	48,998	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC	393	445	2,895	240,886	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,280	2,750	6,215	517,025	保険
METHANEX CORP	103	86	652	54,301	化学
METRO INC	267	334	1,643	136,704	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	392	—	—	—	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	—	460	2,774	230,790	銀行
NUTRIEN LTD	744	831	5,856	487,234	化学
ONEX CORPORATION	92	109	821	68,352	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	295	354	1,816	151,104	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP	571	706	3,465	288,316	石油・ガス・消耗燃料
POWER CORPORATION OF CANADA	409	460	1,433	119,241	保険
POWER FINANCIAL CORP	278	325	1,014	84,408	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	246	310	558	46,420	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	259	320	2,782	231,441	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	412	502	3,607	300,139	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,699	1,962	19,780	1,645,571	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	197	—	—	—	建設・土木
SNC-LAVALIN GROUP INC	—	252	854	71,088	建設・土木
SAPUTO INC	239	321	1,462	121,636	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	290	370	357	29,702	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	520	630	1,752	145,751	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	104	122	3,365	279,975	情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE	—	230	537	44,696	ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC	721	838	4,302	357,907	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,919	2,180	9,441	785,445	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B	665	680	2,102	174,911	金属・鉱業
TELUS CORP	193	293	1,449	120,557	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	341	282	2,233	185,804	専門サービス
TORONTO DOMINION BANK	2,155	2,495	18,093	1,505,218	銀行
TOURMALINE OIL CORP	265	330	681	56,662	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP	1,004	1,257	7,544	627,628	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,260	1,260	277	23,060	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	380	—	—	—	医薬品
VERMILION ENERGY INC	120	185	610	50,772	石油・ガス・消耗燃料
WSP GLOBAL INC	—	132	963	80,194	建設・土木
WEST FRASER TIMBER	84	84	546	45,421	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD	59	107	1,028	85,532	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	512	630	2,004	166,715	金属・鉱業
小計 株数・金額	47,222	58,286	250,259	20,819,098	
小計 銘柄数＜比率＞	88	89	—	＜3.7%＞	
(イギリス)			千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	480	590	569	82,379	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP PLC	590	680	1,259	182,077	商社・流通業
BHP BILLITON PLC	2,430	—	—	—	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,130	1,450	868	125,582	家庭用耐久財
SKY PLC	1,210	—	—	—	メディア
AVIVA PLC	4,590	5,420	2,235	323,076	保険
DIAGEO PLC	2,889	3,319	10,415	1,505,387	飲料
SCHRODERS PLC	133	158	426	61,706	資本市場
DCC PLC	98	128	849	122,754	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	3,720	4,410	2,127	307,492	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,672	3,125	9,981	1,442,689	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	3,830	3,830	2,264	327,336	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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
IMPERIAL BRANDS PLC	1,111	1,295	3,398	491,252	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	23,270	27,340	17,041	2,463,109	銀行
LEGAL & GENERAL	7,040	8,080	2,224	321,518	保険
MEGGITT PLC	950	1,110	558	80,668	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	2,460	3,150	716	103,603	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	422	494	1,204	174,151	食品
PEARSON	910	1,090	911	131,742	メディア
PERSIMMON PLC	355	426	924	133,615	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	3,021	3,550	5,458	788,917	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,417	1,578	7,039	1,017,483	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	620	700	719	104,010	資本市場
TRAVIS PERKINS PLC	302	—	—	—	商社・流通業
SSE PLC	1,160	1,370	1,626	235,049	電力
BP PLC	23,050	27,490	15,353	2,219,146	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	84,100	97,300	6,046	873,920	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	3,660	4,500	789	114,117	家庭用耐久財
TESCO PLC	11,210	13,620	3,161	456,920	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	1,020	1,230	1,873	270,765	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	5,740	6,760	10,794	1,560,217	医薬品
WEIR GROUP PLC	266	370	576	83,321	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	259	390	192	27,818	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,477	1,727	10,595	1,531,422	医薬品
GKN PLC	1,930	—	—	—	自動車部品
BT GROUP PLC	9,930	11,450	2,552	368,978	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	220	229	862	124,620	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,810	2,080	580	83,849	複合小売り
BARCLAYS PLC	19,600	23,700	3,665	529,871	銀行
INTERTEK GROUP PLC	179	216	1,049	151,638	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	504	550	1,074	155,376	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	162	198	1,104	159,693	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,460	3,080	723	104,529	専門小売り
ITV PLC	4,000	5,000	635	91,855	メディア
SAINSBURY	1,990	2,550	601	86,873	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	109	—	—	—	金属・鉱業
G4S PLC	1,790	2,190	401	58,085	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	229	270	585	84,685	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	148	171	630	91,178	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	6,500	7,800	890	128,750	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	5,294	6,170	14,891	2,152,387	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	4,365	5,107	12,399	1,792,266	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	405	444	1,124	162,493	商社・流通業
COBHAM PLC	2,540	—	—	—	航空宇宙・防衛
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	363	426	2,023	292,538	資本市場
UNILEVER PLC	1,429	1,509	6,632	958,597	パーソナル用品
TUI AG-DI	490	600	441	63,794	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	750	920	406	58,815	資本市場
EXPERIAN PLC	1,067	1,262	2,623	379,229	専門サービス
MONDI PLC	408	494	838	121,241	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	277	324	640	92,537	水道
WHITBREAD PLC	206	245	1,244	179,823	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	303	401	747	108,009	資本市場
SMITHS GROUP PLC	470	540	774	112,004	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,554	1,433	2,942	425,332	金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,140	1,320	1,299	187,892	資本市場

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	
CAPITA PLC	760	—	—	—	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	782	913	5,826	842,200	家庭用品
RELX PLC	1,212	2,710	4,448	642,981	専門サービス
SHIRE PLC	1,047	—	—	—	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC	260	260	226	32,725	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	760	960	781	113,004	水道
GLENCORE PLC	14,300	15,330	4,874	704,513	金属・鉱業
WOOD GROUP (JOHN) PLC	730	860	436	63,072	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC	630	710	396	57,366	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,880	2,370	2,140	309,400	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC	5,740	—	—	—	保険
NMC HEALTH PLC	—	133	303	43,907	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
EASYJET PLC	163	210	234	33,919	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	4,250	6,500	1,605	232,058	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,290	1,430	1,002	144,932	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	375	—	—	—	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
WPP PLC	1,440	1,690	1,370	198,056	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	223	290	758	109,611	飲料
CONVATEC GROUP PLC-WI	1,570	2,100	297	42,965	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	1,843	2,150	3,879	560,768	ホテル・レストラン・レジャー
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	213	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	516	580	1,157	167,372	ソフトウェア
NATIONAL GRID PLC	3,970	4,610	3,922	566,913	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	1,080	1,360	324	46,843	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	890	890	305	44,162	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	—	3,590	947	136,963	各種金融サービス
FERGUSON PLC	291	—	—	—	商社・流通業
FERGUSON PLC	—	325	1,587	229,428	商社・流通業
IMI PLC	320	—	—	—	機械
BHP GROUP PLC	—	2,890	5,342	772,198	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	31,140	36,500	5,102	737,544	無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	237	1,096	158,424	ホテル・レストラン・レジャー
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,240	1,400	710	102,756	保険
INFORMA PLC	—	1,730	1,287	186,090	メディア
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,110	—	—	—	各種金融サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	1,190	1,380	719	104,041	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ・ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,570	1,830	645	93,371	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	155	172	866	125,249	化学
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	6,800	1,245	180,013	電気設備
JOHNSON MATTHEY PLC	218	267	838	121,256	化学
小計 株数・金額	355,372	410,536	241,277	34,874,320	
小計 銘柄数＜比率＞	99	92	—	＜6.2%＞	
（スイス）			千スイスフラン		
SIKA AG-BR	2	—	—	—	化学
SGS SA-REG	6	7	1,848	206,265	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG	2	3	539	60,186	食品
SWISSCOM AG-REG	29	35	1,709	190,731	各種電気通信サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	947	105,755	食品
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.12	0.15	1,168	130,381	食品
GIVAUDAN-REG	10	12	3,172	353,972	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	177	207	6,826	761,646	保険
NOVARTIS-REG	2,589	2,960	28,350	3,163,391	医薬品
ABB LTD	2,159	2,500	4,677	521,915	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	818	959	26,310	2,935,688	医薬品

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	
（スイス）	百株	百株	千スイスフラン	千円	
ADECCO GROUP AG-REG	193	215	1,142	127,433	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	537	670	3,295	367,737	建設資材
CLARIANT AG-REG	259	259	542	60,486	化学
NESTLE SA-REG	3,621	4,184	39,706	4,430,413	食品
BALOISE HOLDING AG	58	66	1,085	121,142	保険
TEMENOS AG-REG	—	84	1,233	137,591	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG-REG	58	76	1,497	167,057	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG	11	14	1,178	131,455	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	2,800	3,470	4,026	449,325	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B	35	41	1,174	131,017	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	60	74	407	45,495	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG	85	103	3,208	357,996	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG	38	45	1,995	222,621	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	9	12	658	73,508	化学
SWISS PRIME SITE-REG	81	101	881	98,327	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	43	58	452	50,478	各種金融サービス
DUFRY AG-REG	44	44	460	51,353	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	20	24	1,759	196,304	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	44	55	1,135	126,665	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG	24	30	618	68,956	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	65	73	997	111,265	海運業
GEBERIT AG-REG	43	50	2,035	227,065	建設関連製品
JULIUS BAER GROUP LTD	259	310	1,247	139,154	資本市場
SWISS RE LTD	361	414	4,027	449,376	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	601	716	5,193	579,531	繊維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG	—	180	2,503	279,374	化学
UBS GROUP AG	4,240	5,330	6,433	717,828	資本市場
VIFOR PHARMA AG	57	57	767	85,638	医薬品
小計 株数・金額	19,447	23,443	165,213	18,434,537	
小計 銘柄数＜比率＞	37	38	—	＜3.3%＞	
（スウェーデン）			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	46	92	2,704	32,349	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	1,750	2,210	17,786	212,721	銀行
SWEDBANK AB	1,069	1,260	16,550	197,939	銀行
SWEDISH MATCH AB	215	234	11,089	132,627	タバコ
NORDEA BANK AB	3,510	—	—	—	銀行
SECURITAS AB-B SHS	333	450	6,761	80,864	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	539	617	25,833	308,972	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	1,075	1,180	18,290	218,748	専門小売り
ERICSSON LM-B	3,490	4,170	35,620	426,016	通信機器
TELIA CO AB	3,300	3,960	16,612	198,681	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	382	450	7,600	90,901	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB	217	248	7,807	93,372	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	350	389	8,301	99,283	機械
GETINGE AB-B SHS	268	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	82	97	5,475	65,488	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	105	105	3,916	46,841	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	450	550	4,176	49,953	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	265	340	8,122	97,146	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	427	550	8,492	101,564	機械
VOLVO AB-B SHS	1,820	2,140	30,816	368,559	機械
SANDVIK AB	1,310	1,510	22,801	272,699	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	206	250	4,868	58,230	各種金融サービス
BOLIDEN AB	327	—	—	—	金属・鉱業

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	
（スウェーデン）	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
HEXAGON AB-B SHS	302	361	17,508	209,401	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	420	690	8,545	102,205	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B	266	337	8,114	97,054	各種金融サービス
ATLAS COPCO AB-A	—	940	23,467	280,666	機械
ATLAS COPCO AB-B	—	529	12,172	145,580	機械
BOLIDEN AB	—	363	9,604	114,875	金属・鉱業
EPIROC AB - A	—	920	8,635	103,276	機械
EPIROC AB - B	—	580	5,162	61,737	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B	696	817	21,903	261,969	家庭用品
ATLAS COPCO AB-A	783	—	—	—	機械
ATLAS COPCO AB-B	450	—	—	—	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	1,810	2,120	20,797	248,734	銀行
ASSA ABLOY AB-B	1,184	1,360	27,295	326,450	建設関連製品
NORDEA BANK ABP	—	4,130	29,219	349,468	銀行
小計 株数・金額	27,447	33,949	456,052	5,454,383	
小計 銘柄数＜比率＞	31	32	—	＜1.0%＞	
（ノルウェー）			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	1,120	1,350	21,438	276,764	銀行
TELENOR ASA	856	1,020	17,615	227,414	各種電気通信サービス
EQUINOR ASA	1,363	1,610	30,404	392,526	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	206	232	8,184	105,667	化学
MOWI ASA	467	620	11,935	154,080	食品
NORSK HYDRO	1,610	1,840	6,430	83,021	金属・鉱業
AKER AB ASA	—	141	4,328	55,883	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA	910	1,150	7,613	98,283	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	250	250	3,725	48,089	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	129	129	3,986	51,460	メディア
小計 株数・金額	6,911	8,342	115,661	1,493,193	
小計 銘柄数＜比率＞	9	10	—	＜0.3%＞	
（デンマーク）			千デンマーククローネ		
CARLSBERG B	126	145	12,052	201,275	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S	7	8	7,428	124,063	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	4	5	4,186	69,906	海運業
DANSKE BANK AS	881	970	11,329	189,204	銀行
GENMAB A/S	69	84	9,702	162,023	バイオテクノロジー
TDC A/S	970	—	—	—	各種電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	252	268	15,008	250,633	電気設備
H LUNDBECK A/S	82	105	3,024	50,500	医薬品
DSV A/S	221	251	13,815	230,711	陸運・鉄道
PANDORA A/S	124	162	5,047	84,300	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S	114	137	9,242	154,341	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES	271	311	9,516	158,927	化学
COLOPLAST-B	142	164	11,975	199,987	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B	2,155	2,475	86,229	1,440,024	医薬品
ISS A/S	186	218	4,414	73,722	商業サービス・用品
TRYG A/S	118	160	2,921	48,790	保険
ORSTED A/S	218	254	12,811	213,956	電力
DEMANT A/S	130	130	2,558	42,725	ヘルスケア機器・用品
小計 株数・金額	6,070	5,848	221,263	3,695,093	
小計 銘柄数＜比率＞	18	17	—	＜0.7%＞	
（ユーロ…ドイツ）			千ユーロ		
ADIDAS AG	216	246	5,328	664,446	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA	484	576	2,866	357,412	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	144	168	546	68,149	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FUCHS PETROLUB SE -PFD	82	105	385	48,053	化学
HANNOVER RUECK SE	71	79	1,011	126,096	保険
GEA GROUP AG	207	242	565	70,464	機械
CONTINENTAL AG	128	154	2,066	257,714	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	1,138	1,371	3,975	495,794	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	59	59	271	33,873	メディア
MERCK KGAA	151	173	1,758	219,290	医薬品
RWE AG	579	720	1,720	214,583	総合公益事業
SAP SE	1,146	1,340	13,802	1,721,109	ソフトウェア
E.ON SE	2,600	3,070	3,042	379,460	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	123	144	1,220	152,183	家庭用品
PUMA SE	—	10	548	68,402	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG	964	1,273	7,332	914,360	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	208	246	2,238	279,153	家庭用品
BASF SE	1,071	1,254	8,217	1,024,717	化学
BEIERSDORF AG	118	137	1,270	158,436	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	20	26	335	41,824	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	173	203	1,302	162,415	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	255	294	2,113	263,598	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
ALLIANZ SE-REG	520	580	11,500	1,434,079	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	267	310	606	75,632	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	179	207	4,367	544,652	保険
VOLKSWAGEN AG	38	45	652	81,422	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	216	252	3,536	440,947	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,124	1,257	6,567	819,007	自動車
MAN SE	37	—	—	—	機械
THYSSENKRUPP AG	518	620	759	94,670	金属・鉱業
SIEMENS AG	892	1,042	9,996	1,246,619	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG	59	80	253	31,663	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,410	2,750	1,996	248,963	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	385	449	3,086	384,933	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	64	78	457	56,997	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	3,900	4,600	6,805	848,670	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	—	45	688	85,799	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,324	1,550	2,741	341,824	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	221	256	2,926	364,882	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	171	203	1,135	141,607	自動車
FRAPORT AG	49	63	429	53,610	運送インフラ
WIRECARD AG	140	159	1,776	221,470	情報技術サービス
LANXESS	103	120	570	71,138	化学
MTU AERO ENGINES AG	58	69	1,392	173,634	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE	413	484	2,092	260,913	不動産管理・開発
SYMRISE AG	136	163	1,309	163,259	化学
BRENNTAG AG	186	206	945	117,908	商社・流通業
K+S AG	234	—	—	—	化学
EVONIK INDUSTRIES AG	195	227	551	68,729	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	746	970	271	33,856	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG	76	93	566	70,603	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG	1,240	1,350	931	116,158	銀行
OSRAM LICHT AG	116	143	438	54,708	電気設備
KION GROUP AG	80	99	461	57,516	機械
VONOVIA SE	555	664	3,069	382,705	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	256	340	432	53,930	メディア
SIEMENS HEALTHINEERS AG	174	199	739	92,188	ヘルスケア機器・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	
（ユーロ…ドイツ）	百株	百株	千ユーロ	千円	
METRO AG	182	250	369	46,107	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	171	195	803	100,232	総合公益事業
LINDE AG - TENDER	214	—	—	—	化学
ZALANDO SE	134	171	594	74,099	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	188	270	1,323	165,045	化学
QIAGEN NV	245	314	1,134	141,509	ライフサイエンス・ツール/サービス
SCHAEFFLER AG	210	—	—	—	自動車部品
UNIPER SE	224	262	704	87,853	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	—	119	383	47,782	インターネット販売・通信販売
小計 株数・金額	28,588	33,144	141,290	17,618,879	
小計 銘柄数＜比率＞	63	62	—	＜3.1%＞	
（ユーロ…イタリア）					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,470	1,620	2,673	333,323	保険
INTESA SANPAOLO	15,780	20,620	4,476	558,232	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP	1,180	—	—	—	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.	680	880	815	101,637	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	203	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
ENEL SPA	9,360	11,040	6,297	785,262	電力
ENI SPA	2,960	3,450	5,435	677,760	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA	2,740	2,980	1,364	170,158	石油・ガス・消耗燃料
TENARIS SA	530	600	750	93,637	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA	13,600	15,300	848	105,774	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	6,800	8,800	445	55,570	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	532	700	1,616	201,552	運送インフラ
TERNA SPA	1,630	1,850	1,044	130,296	電力
RECORDATI SPA	112	141	489	61,029	医薬品
LEONARDO SPA	470	550	569	71,054	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA	230	309	521	64,984	電気設備
UNIPOLSAI SPA	1,070	—	—	—	保険
FERRARI NV	143	171	2,043	254,818	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	1,210	1,410	1,278	159,369	機械
MONCLER SPA	—	252	905	112,876	繊維・アパレル・贅沢品
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,230	1,500	1,990	248,252	自動車
UNICREDIT SPA	2,350	2,710	3,096	386,194	銀行
EXOR NV	121	151	874	109,023	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	640	770	667	83,267	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	650	760	665	82,925	飲料
PIRELLI & C. SPA	—	530	304	37,923	自動車部品
小計 株数・金額	65,691	77,094	39,173	4,884,925	
小計 銘柄数＜比率＞	24	23	—	＜0.9%＞	
（ユーロ…フランス）					
BOUYGUES	257	314	1,000	124,711	建設・土木
AIRBUS SE	679	793	9,349	1,165,878	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	569	710	1,415	176,454	総合公益事業
LOREAL-ORD	294	344	8,256	1,029,562	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	325	378	12,411	1,547,653	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	2	3	433	54,113	航空宇宙・防衛
THALES SA	124	141	1,505	187,695	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	190	219	2,367	295,213	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	59	83	320	40,003	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	67	81	515	64,260	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	239	292	1,393	173,796	メディア
FAURECIA	85	105	393	49,074	自動車部品
LAGARDERE S.C.A	148	—	—	—	メディア

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	
BOLLORE	1,060	1,060	426	53,242	航空貨物・物流サービス
MICHELIN (CGDE)	200	238	2,508	312,812	自動車部品
PERNOD RICARD SA	247	291	4,656	580,603	飲料
RENAULT SA	227	255	1,502	187,324	自動車
REMY COINTREAU	23	30	356	44,480	飲料
SEB SA	24	30	450	56,115	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	663	754	5,273	657,602	電気設備
VIVENDI SA	1,209	1,437	3,711	462,857	娯楽
ORANGE SA	2,340	2,770	4,016	500,857	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	36	44	2,605	324,934	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	28	38	301	37,648	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	150	178	2,362	294,659	ソフトウェア
KERING SA	88	105	5,367	669,339	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	212	212	415	51,868	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	674	800	1,332	166,100	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	112	136	1,169	145,849	情報技術サービス
SANOFI	1,326	1,536	12,094	1,508,179	医薬品
ACCOR SA	214	262	946	117,976	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	753	970	1,277	159,242	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	884	1,043	2,688	335,235	銀行
TELEPERFORMANCE	64	77	1,233	153,822	専門サービス
EURAZEO SE	54	56	379	47,372	各種金融サービス
SODEXO	101	121	1,187	148,110	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	2,249	2,650	5,943	741,210	保険
PEUGEOT CITROEN	674	820	1,782	222,300	自動車
JC DECAUX SA	93	93	252	31,451	メディア
ESSILORLUXOTTICA	242	399	3,885	484,517	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	1,290	1,540	1,658	206,824	銀行
BNP PARIBAS	1,311	1,529	6,515	812,429	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	583	669	2,161	269,543	建設関連製品
WENDEL	34	34	381	47,612	各種金融サービス
ILIAD SA	31	39	349	43,526	各種電気通信サービス
SES FDR	430	480	665	82,990	メディア
IMERYS	38	38	168	21,058	建設資材
SAFRAN SA	385	457	5,586	696,677	航空宇宙・防衛
ENGIE	2,130	2,510	3,333	415,660	総合公益事業
ALSTOM	181	205	791	98,726	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	200	241	375	46,867	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	670	820	999	124,647	電力
IPSEN	40	55	672	83,810	医薬品
ARKEMA	77	99	840	104,762	化学
LEGRAND SA	302	370	2,207	275,265	電気設備
EIFFAGE SA	87	108	925	115,363	建設・土木
TOTAL SA	2,798	3,294	16,311	2,034,092	石油・ガス・消耗燃料
ADP	34	39	672	83,843	運送インフラ
NATIXIS	1,110	1,280	610	76,152	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT	70	111	880	109,847	娯楽
SCOR SE	206	232	880	109,819	保険
REXEL SA	350	450	452	56,423	商社・流通業
VINCI	594	702	6,087	759,141	建設・土木
DANONE	695	844	5,797	722,940	食品
AIR LIQUIDE	501	592	6,710	836,776	化学
BUREAU VERITAS SA	301	342	714	89,133	専門サービス
GETLINK	530	620	837	104,489	運送インフラ

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	
SUEZ		450	520	614	76,580	総合公益事業
EDENRED		253	328	1,330	165,937	商業サービス・用品
VALEO SA		276	331	855	106,697	自動車部品
BIOMERIEUX		46	59	434	54,223	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	41	462	57,722	ライフサイエンス・ツール/サービス
AMUNDI SA		67	82	460	57,364	資本市場
小計	株数・金額	33,058	38,931	179,238	22,351,085	
	銘柄数＜比率＞	72	72	—	＜3.9%＞	
（ユーロ…オランダ）						
RELX NV		1,095	—	—	—	専門サービス
RANDSTAD NV		135	174	756	94,320	専門サービス
AKZO NOBEL		297	—	—	—	化学
WOLTERS KLUWER		351	390	2,367	295,202	専門サービス
VOPAK		90	90	383	47,877	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		2,080	2,460	1,053	131,416	保険
KONINKLIJKE KPN NV		4,000	4,460	1,260	157,171	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		1,085	1,259	4,572	570,135	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV		303	357	3,358	418,824	飲料
HEINEKEN HOLDING NV		135	160	1,428	178,171	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		209	247	2,399	299,261	化学
UNILEVER NV-CVA		1,901	2,102	10,884	1,357,254	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		96	—	—	—	建設・土木
ASML HOLDING NV		453	560	9,363	1,167,591	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,495	1,606	3,810	475,136	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL		—	310	2,450	305,568	化学
NN GROUP NV		346	429	1,588	198,096	保険
ARCELORMITTAL		761	885	1,598	199,287	金属・鉱業
ABN AMRO GROUP NV-CVA		489	581	1,167	145,625	銀行
ALTICE EUROPE N.V.		640	—	—	—	メディア
ADYEN NV		—	14	1,033	128,820	情報技術サービス
ING GROEP NV		4,540	5,280	5,693	710,035	銀行
小計	株数・金額	20,501	21,365	55,170	6,879,796	
	銘柄数＜比率＞	20	18	—	＜1.2%＞	
（ユーロ…スペイン）						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		809	—	—	—	運送インフラ
ENDESA S.A.		356	444	1,009	125,904	電力
BANKINTER S.A.		750	880	597	74,510	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.		7,660	9,230	4,700	586,194	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		412	493	1,229	153,262	ガス
REPSOL SA		1,435	1,882	2,872	358,183	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		18,810	22,110	9,163	1,142,687	銀行
TELEFONICA SA		5,430	6,400	4,780	596,085	各種電気通信サービス
ENAGAS		267	304	788	98,335	石油・ガス・消耗燃料
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		300	300	425	53,103	電気設備
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV		282	350	1,372	171,182	建設・土木
FERROVIAL SA		540	665	1,388	173,177	建設・土木
MAPFRE SA		1,260	1,630	400	49,920	保険
BANCO DE SABADELL SA		6,250	7,900	701	87,459	銀行
CAIXABANK		4,130	5,050	1,405	175,318	銀行
IBERDROLA SA		6,810	8,586	6,719	837,974	電力
AMADEUS IT GROUP SA		511	595	4,248	529,763	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		750	—	—	—	旅客航空輸送業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		482	590	1,121	139,788	電力
INDITEX SA		1,270	1,480	3,877	483,536	専門小売り

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
（ユーロ…スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
AENA SME SA		80	93	1,492	186,133	運送インフラ
GRIFOLS SA		329	401	1,000	124,811	バイオテクノロジー
BANKIA SA		1,510	1,510	348	43,496	銀行
小計	株数・金額	60,435	70,894	49,645	6,190,829	
	銘柄数＜比率＞	23	21	－	＜1.1％＞	
（ユーロ…ベルギー）						
KBC GROEP NV		285	346	2,154	268,714	銀行
SOLVAY SA		87	103	992	123,791	化学
UCB SA		151	165	1,263	157,526	医薬品
COLRUYT SA		73	87	573	71,494	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		89	110	952	118,816	各種金融サービス
PROXIMUS		184	216	555	69,250	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		67	67	287	35,825	メディア
AGEAS		213	258	1,109	138,342	保険
UMICORE		247	280	1,108	138,232	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		889	1,036	7,745	965,818	飲料
小計	株数・金額	2,285	2,668	16,742	2,087,812	
	銘柄数＜比率＞	10	10	－	＜0.4％＞	
（ユーロ…オーストリア）						
OMV AG		171	210	1,015	126,666	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		－	90	385	48,011	電力
VOESTALPINE AG		128	165	446	55,697	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		353	400	1,310	163,406	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		169	201	402	50,154	銀行
ANDRITZ AG		92	92	351	43,870	機械
小計	株数・金額	913	1,158	3,911	487,808	
	銘柄数＜比率＞	5	6	－	＜0.1％＞	
（ユーロ…ルクセンブルグ）						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		12	14	527	65,800	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		39	54	262	32,793	メディア
AROUNDTOWN SA		－	1,070	786	98,070	不動産管理・開発
小計	株数・金額	51	1,138	1,577	196,664	
	銘柄数＜比率＞	2	3	－	＜0.0％＞	
（ユーロ…フィンランド）						
WARTSILA OYJ		525	630	906	113,009	機械
UPM-KYMMENE OYJ		615	733	1,905	237,653	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		620	730	795	99,178	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		527	612	2,473	308,394	保険
FORTUM OYJ		500	600	1,093	136,396	電力
ELISA OYJ		172	195	784	97,800	各種電気通信サービス
METSO OYJ		124	162	496	61,937	機械
NOKIA OYJ		6,800	7,810	3,962	494,160	通信機器
NESTE OYJ		146	176	1,672	208,498	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		134	158	471	58,792	自動車部品
KONE OYJ		384	456	2,050	255,656	機械
ORION OYJ		130	130	434	54,177	医薬品
小計	株数・金額	10,677	12,392	17,046	2,125,656	
	銘柄数＜比率＞	12	12	－	＜0.4％＞	
（ユーロ…アイルランド）						
CRH PLC		996	1,136	3,141	391,687	建設資材
KINGSPAN GROUP PLC		－	222	915	114,221	建設関連製品
KERRY GROUP PLC-A		193	221	2,198	274,209	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	－	－	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		－	320	796	99,281	容器・包装

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
（ユーロ…アイルランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
BANK OF IRELAND GROUP PLC		1,090	1,330	706	88,066	銀行
AIB GROUP PLC		1,050	1,250	500	62,381	銀行
PADDY POWER PLC		101	119	818	102,020	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額	4,828	5,996	9,076	1,131,867	
	銘柄数＜比率＞	6	8	－	＜0.2%＞	
（ユーロ…ポルトガル）						
ENERGIAS DE PORTUGAL		2,620	3,610	1,265	157,783	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		570	670	956	119,307	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS		310	310	407	50,833	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	3,500	4,590	2,629	327,925	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.1%＞	
ユーロ計	株数・金額	230,528	269,371	515,503	64,283,253	
	銘柄数＜比率＞	240	238	－	＜11.3%＞	
（香港）				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		380	380	3,326	47,075	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,510	2,510	4,809	68,049	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,400	1,670	4,260	60,279	銀行
CLP HLDGS		1,870	2,270	20,657	292,296	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,380	1,624	44,432	628,721	資本市場
LI & FUNG LTD		7,496	－	－	－	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP		1,810	2,010	9,768	138,225	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO		2,260	－	－	－	各種金融サービス
HANG LUNG GROUP LTD		1,030	1,030	2,595	36,727	不動産管理・開発
HANG SENG BANK		870	1,058	20,493	289,982	銀行
HENDERSON LAND		1,325	1,858	9,274	131,231	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,630	1,910	10,399	147,159	電力
WHARF(HOLDING)		1,340	1,740	4,123	58,351	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS		9,602	12,403	23,342	330,300	ガス
HYSAN DEVELOPMENT		650	830	3,490	49,385	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,710	3,330	17,798	251,853	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		790	790	2,768	39,180	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		4,210	4,950	16,087	227,638	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,595	2,205	3,783	53,540	コングロマリット
PCCW LTD		5,500	5,500	2,684	37,978	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		970	970	2,619	37,058	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		6,796	8,396	10,932	154,694	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,603	1,603	1,789	25,318	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		3,600	4,800	7,286	103,102	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,660	2,170	29,229	413,603	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		535	640	6,464	91,465	不動産管理・開発
WHEELOCK & COMPANY LTD		980	1,170	6,727	95,194	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,560	1,950	10,286	145,550	家庭用耐久財
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD		4,500	－	－	－	資本市場
MINTH GROUP LTD		820	1,120	2,766	39,144	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED		2,700	2,700	2,419	34,231	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,840	2,280	4,218	59,684	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		1,240	1,240	2,036	28,810	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		14,080	16,470	128,713	1,821,289	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		4,496	5,196	6,557	92,786	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,864	3,360	13,255	187,561	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,460	1,730	5,838	82,618	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,470	1,640	9,585	135,639	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		10,200	11,700	9,828	139,066	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		3,120	3,710	30,592	432,880	コングロマリット

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	750	890	5,736	81,165	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,980	3,610	25,200	356,588	不動産管理・開発
小計 株数・金額	120,586	125,416	526,178	7,445,432	
小計 銘柄数＜比率＞	42	39	—	＜1.3%＞	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,980	1,980	740	60,774	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,400	9,400	263	21,601	食品
DBS GROUP HLDGS	2,067	2,430	6,130	503,162	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	510	510	461	37,879	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	100	140	454	37,330	販売
SATS LTD	770	770	393	32,292	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	930	1,110	811	66,592	資本市場
CAPITALAND LIMITED	2,850	3,300	1,204	98,853	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	7,200	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,500	3,100	796	65,385	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD	630	770	744	61,077	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK	1,550	1,850	4,660	382,458	銀行
UOL GROUP LIMITED	650	650	451	37,075	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	—	350	627	51,531	電子装置・機器・部品
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,870	2,400	578	47,469	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	9,650	11,100	3,352	275,115	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES	990	1,400	357	29,307	コングロマリット
OCBC-ORD	3,670	4,330	4,784	392,676	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,750	2,470	817	67,097	食品
STARHUB LTD	690	—	—	—	無線通信サービス
KEPPEL CORP.	1,620	2,020	1,256	103,116	コングロマリット
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	2,700	3,800	570	46,779	機械
GENTING SINGAPORE LTD	—	8,700	904	74,256	ホテル・レストラン・レジャー
小計 株数・金額	54,078	62,581	30,362	2,491,831	
小計 銘柄数＜比率＞	21	21	—	＜0.4%＞	
(オーストラリア)			千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	158	205	1,319	104,333	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	3,432	3,930	10,229	809,074	銀行
AMCOR	1,340	1,550	2,385	188,665	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP	3,962	4,690	12,156	961,456	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	420	560	509	40,304	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,870	2,230	1,585	125,399	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	4,870	5,900	1,958	154,921	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	540	670	648	51,294	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	600	770	666	52,677	飲料
ASX LTD	219	263	1,836	145,271	資本市場
BHP GROUP LIMITED	3,750	4,010	15,434	1,220,713	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	291	333	872	69,029	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	530	971	390	30,877	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	560	630	1,076	85,104	情報技術サービス
CSL LIMITED	524	618	12,047	952,820	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	54	69	515	40,765	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,570	3,720	4,910	388,363	運送インフラ
COCHLEAR LTD	67	81	1,403	111,008	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,050	2,390	1,720	136,098	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,043	2,424	17,123	1,354,268	銀行
BORAL LTD	1,330	1,530	702	55,542	建設資材
RIO TINTO LTD	480	512	5,012	396,477	金属・鉱業
APA GROUP	1,440	1,590	1,586	125,501	ガス

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	
（オーストラリア）	百株	百株	千豪ドル	千円	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	630	760	1,862	147,325	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,770	3,080	2,365	187,082	保険
TPG TELECOM LTD	359	520	361	28,583	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	73	73	306	24,277	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD	420	500	881	69,717	化学
BLUESCOPE STEEL LTD	670	680	948	75,024	金属・鉱業
WORLEYPARSONS LTD	—	470	665	52,635	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,490	1,810	2,494	197,264	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	3,138	3,710	9,375	741,482	銀行
NEWCREST MINING	890	1,030	2,627	207,811	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,620	1,790	1,405	111,133	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,960	2,330	726	57,495	化学
AMP LIMITED	3,440	3,900	819	64,774	各種金融サービス
QBE INSURANCE	1,520	1,790	2,203	174,274	保険
CHALLENGER LIMITED	660	800	662	52,389	各種金融サービス
SANTOS LTD.	2,120	2,320	1,584	125,322	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD	490	620	1,522	120,431	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	—	170	447	35,374	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS	2,184	2,470	1,141	90,252	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED	1,308	1,540	5,336	422,032	複合小売り
ALUMINA LTD	2,900	3,500	847	66,989	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM	1,107	1,270	4,396	347,738	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,522	1,810	5,502	435,184	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD	400	480	841	66,587	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	59	85	369	29,189	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD	1,890	2,180	2,563	202,761	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED	378	439	5,681	449,352	資本市場
CROWN RESORTS LTD	430	550	633	50,067	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	520	580	1,052	83,212	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD	820	1,000	1,493	118,081	飲料
SYDNEY AIRPORT	1,250	1,440	1,069	84,619	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD	2,390	2,730	1,242	98,241	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD	1,760	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSNET SERVICES	2,300	2,300	408	32,288	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,080	3,500	966	76,400	保険
AGL ENERGY LTD	790	930	2,024	160,126	総合公益事業
SOUTH32 LTD	6,140	7,000	2,611	206,503	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD	117	117	564	44,657	建設・土木
COLES GROUP LTD	—	1,610	1,907	150,891	食品・生活必需品小売り
小計 株数・金額	86,695	101,530	168,005	13,287,552	
小計 銘柄数＜比率＞	59	61	—	＜2.3%＞	
（ニュージーランド）			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	450	580	710	53,848	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	—	1,060	1,516	114,962	食品
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	640	740	1,161	88,052	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	690	1,126	557	42,253	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,290	2,600	988	74,880	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	880	—	—	—	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,080	1,300	1,058	80,200	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD	1,590	1,590	665	50,431	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計 株数・金額	7,620	8,996	6,658	504,630	
小計 銘柄数＜比率＞	7	7	—	＜0.1%＞	
（イスラエル）			千新シェケル		
BANK HAPOALIM BM	1,250	1,410	3,405	104,095	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	
（イスラエル）		百株	百株	千新シェケル	千円	
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,610	2,140	5,097	155,829	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		2,040	2,800	714	21,835	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		28	36	1,690	51,680	航空宇宙・防衛
FRUTAROM		48	－	－	－	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		910	910	1,746	53,384	化学
NICE LTD		68	86	3,834	117,228	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		170	170	1,268	38,768	銀行
AZRIELI GROUP		41	65	1,377	42,105	不動産管理・開発
小計	株数・金額	6,165	7,617	19,134	584,927	
	銘柄数＜比率＞	9	8	－	＜0.1％＞	
合計	株数・金額	1,322,817	1,528,975	－	541,230,271	
	銘柄数＜比率＞	1,260	1,248	－	＜95.6％＞	

＊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。
＊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。
＊株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。
＊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	42,800	71,000	1,278	141,985	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,000	14,400	2,052	228,073	0.0
AMERICAN TOWER CORP	50,100	60,200	11,863	1,317,980	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	132,000	196,000	1,958	217,538	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,300	19,200	3,854	428,181	0.1
BOSTON PROPERTIES	17,700	20,700	2,771	307,893	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	37,000	—	—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	—	15,000	307	34,146	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	10,500	13,100	1,329	147,724	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	59,000	—	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	46,800	56,800	7,270	807,741	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	24,300	27,800	3,308	367,541	0.1
DUKE REALTY CORP	38,900	47,800	1,461	162,397	0.0
EQUINIX INC	9,120	10,930	4,953	550,282	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	43,400	51,300	3,863	429,281	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,590	9,030	2,611	290,175	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,100	17,900	1,824	202,667	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,900	9,800	1,350	150,088	0.0
GGP INC	68,200	—	—	—	—
HCP INC	51,600	66,100	2,068	229,858	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	88,000	100,000	1,890	209,979	0.0
INVITATION HOMES INC	34,000	45,000	1,094	121,637	0.0
IRON MOUNTAIN INC	31,300	38,300	1,358	150,886	0.0
KIMCO REALTY CORP	51,000	58,000	1,073	119,210	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	16,900	19,800	958	106,513	0.0
MACERICH CO /THE	14,200	14,200	615	68,389	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,700	15,000	1,639	182,198	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	17,100	22,000	1,218	135,384	0.0
PROLOGIS INC	61,400	86,300	6,209	689,851	0.1
PUBLIC STORAGE	18,300	21,500	4,682	520,200	0.1
REALTY INCOME CORP	32,100	39,300	2,890	321,179	0.1
REGENCY CENTERS CORP	17,000	21,000	1,417	157,460	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	13,800	15,200	3,034	337,169	0.1
SL GREEN REALTY CORP	11,000	12,500	1,124	124,876	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	36,100	42,300	7,707	856,301	0.2
UDR INC	30,800	36,700	1,668	185,357	0.0
VENTAS INC	40,200	49,200	3,139	348,793	0.1
VEREIT INC	109,000	125,000	1,046	116,238	0.0
VORNADO REALTY TRUST	20,500	24,200	1,632	181,320	0.0
WP CAREY INC	—	21,500	1,684	187,102	0.0
WELLTOWER INC	43,500	51,700	4,011	445,724	0.1
WEYERHAEUSER CO	88,200	100,500	2,647	294,100	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	—	—	—	—
小計 口数・金額	1,985,410	1,666,260	106,871	11,873,432	
小計 銘柄数＜比率＞	41	39	—	＜2.1%＞	

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	%
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		—	20,000	468	38,949	0.0
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		13,600	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		16,900	22,000	582	48,444	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		6,900	11,000	385	32,037	0.0
小計	口数・金額	37,400	53,000	1,435	119,431	
	銘柄数＜比率＞	3	3	—	＜0.0%＞	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		114,000	128,000	753	108,971	0.0
HAMMERSON PLC		89,000	108,000	362	52,419	0.0
SEGRO PLC		118,000	145,000	976	141,133	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		89,000	99,000	904	130,702	0.0
小計	口数・金額	410,000	480,000	2,997	433,226	
	銘柄数＜比率＞	4	4	—	＜0.1%＞	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		3,700	5,100	384	47,952	0.0
KLEPIERRE		24,900	28,000	873	108,868	0.0
GECINA SA		5,600	6,400	843	105,186	0.0
COVIVIO		4,000	6,600	624	77,857	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		11,680	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	19,100	2,791	348,071	0.1
ユーロ計	口数・金額	49,880	65,200	5,516	687,936	
	銘柄数＜比率＞	5	5	—	＜0.1%＞	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		252,000	288,000	26,438	374,103	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	370,000	2,967	41,988	0.0
小計	口数・金額	512,000	658,000	29,405	416,092	
	銘柄数＜比率＞	2	2	—	＜0.1%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		310,000	380,000	904	74,224	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		282,000	380,000	1,105	90,753	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		299,972	369,972	717	58,905	0.0
SUNTEC REIT		300,000	300,000	585	48,010	0.0
小計	口数・金額	1,191,972	1,429,972	3,312	271,893	
	銘柄数＜比率＞	4	4	—	＜0.0%＞	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		430,000	490,000	1,347	106,573	0.0
GPT GROUP		203,000	256,000	1,589	125,734	0.0
LENDLEASE GROUP		61,000	77,000	953	75,393	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		274,000	348,000	1,339	105,964	0.0
DEXUS		113,000	140,000	1,783	141,064	0.0
GOODMAN GROUP		214,000	227,000	3,030	239,678	0.0
SCENTRE GROUP		612,000	723,000	2,971	235,018	0.0
WESTFIELD CORP		234,000	—	—	—	—
VICINITY CENTRES		373,000	480,000	1,248	98,704	0.0
小計	口数・金額	2,514,000	2,741,000	14,263	1,128,131	
	銘柄数＜比率＞	9	8	—	＜0.2%＞	
合計	口数・金額	6,700,662	7,093,432	—	14,930,145	
	銘柄数＜比率＞	68	65	—	＜2.6%＞	

＊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。
＊比率は、純資産総額に対する評価額の比率。
＊金額の単位未満は切り捨て。
＊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	当期末 売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	CAN60	382	－
		EURO50	1,203	－
		FT100	656	－
		SPI200	219	－
		SPEMINI	7,046	－
		SWISSMKT	342	－

＊単位未満は切り捨て。
＊邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

（2019年４月１日現在）

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	541,230,271	95.5
投資証券	14,930,145	2.6
コール・ローン等、その他	10,411,841	1.9
投資信託財産総額	566,572,257	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。
＊当期末における外貨建て純資産（565,681,183千円）の投資信託財産総額（566,572,257千円）に対する比率は99.8％です。
＊外貨建て資産は、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＝111.10円、１カナダドル＝83.19円、１英ポンド＝144.54円、１スイスフラン＝111.58円、１スウェーデンクローナ＝11.96円、１ノルウェークローネ＝12.91円、１デンマーククローネ＝16.70円、１ユーロ＝124.70円、１香港ドル＝14.15円、１シンガポールドル＝82.07円、１豪ドル＝79.09円、１ニュージーランドドル＝75.79円、１新シェケル＝30.57円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2019年４月１日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	567,260,286,271
コール・ローン等	7,504,273,359
株式(評価額)	541,230,271,182
投資証券(評価額)	14,930,145,435
未収入金	819,484,322
未収配当金	887,471,799
差入委託証拠金	1,888,640,174
(B) 負債	825,176,257
未払金	692,028,843
未払解約金	129,901,375
未払利息	1,939
その他未払費用	3,244,100
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	566,435,110,014
元本	207,721,483,594
次期繰越損益金	358,713,626,420
(D) 受益権総口数	207,721,483,594口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	27,269円

(注) 期首元本額は183,716,815,590円、期中追加設定元本額は44,186,701,350円、期中一部解約元本額は20,182,033,346円、１口当たり純資産額は2.7269円です。

○損益の状況 （2018年４月３日～2019年４月１日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	11,412,095,732
受取配当金	11,355,374,257
受取利息	38,845,407
その他収益金	20,901,604
支払利息	△ 3,025,536
(B) 有価証券売買損益	38,192,089,606
売買益	71,481,073,962
売買損	△ 33,288,984,356
(C) 先物取引等取引損益	266,769,299
取引益	1,566,970,648
取引損	△ 1,300,201,349
(D) 保管費用等	△ 81,834,239
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	49,789,120,398
(F) 前期繰越損益金	271,026,723,845
(G) 追加信託差損益金	71,122,618,466
(H) 解約差損益金	△ 33,224,836,289
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	358,713,626,420
次期繰越損益金(Ｉ)	358,713,626,420

＊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。
＊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。
＊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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	63,997,504,201
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	36,258,875,006
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	19,080,973,010
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	16,271,949,033
のむラップ・ファンド（普通型）	7,217,903,390
野村世界６資産分散投信（分配コース）	6,506,101,443
マイバランス70（確定拠出年金向け）	6,467,075,123
マイバランス50（確定拠出年金向け）	5,832,867,516
のむラップ・ファンド（積極型）	4,853,146,300
野村世界６資産分散投信（成長コース）	4,540,862,087
野村インデックスファンド・外国株式	4,242,346,060
野村外国株(含む新興国)インデックス B コース(野村投資一任口座向け)	3,776,887,278
野村世界６資産分散投信（安定コース）	3,692,630,642
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,296,823,805
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,397,070,588
野村つみたて外国株投信	2,112,611,282
マイバランスDC50	1,770,590,184
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,432,614,839

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイバランスDC70	1,430,273,403
マイ・ロード	1,387,068,202
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,382,890,602
野村外国株インデックス　Bコース(野村SMA・EW向け)	1,174,813,197
のむラップ・ファンド（保守型）	1,059,979,266
マイバランスDC30	935,508,168
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	791,178,271
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	676,723,480
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	619,098,219
野村外国株式インデックスファンド	539,802,166
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	395,671,531
のむラップ・ファンド（やや積極型）	288,046,203
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	286,397,231
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	281,457,269
野村６資産均等バランス	251,541,825
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	228,470,727
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	203,547,131
のむラップ・ファンド（やや保守型）	182,910,807

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	176,028,505
バランスセレクト70	162,217,714
バランスセレクト50	154,741,541
野村DC運用戦略ファンド	129,881,261
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	128,696,106
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	123,253,380
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	106,415,216
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	88,872,482
世界6資産分散ファンド	72,282,023
野村資産設計ファンド2040	67,664,000
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	66,882,448
バランスセレクト30	49,364,097
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	49,057,295
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	47,817,841
野村資産設計ファンド2030	38,865,877
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	37,053,007
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	35,270,485
野村資産設計ファンド2025	34,228,928
野村資産設計ファンド2035	29,349,531
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	27,519,405
野村資産設計ファンド2020	21,828,867
インデックス・ブレンド（タイプＶ）	18,888,313
野村資産設計ファンド2015	18,540,760
ネクストコア	16,152,133
野村資産設計ファンド2050	15,853,030

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	14,728,769
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	14,203,001
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	13,147,093
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	11,172,818
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	11,053,628
野村資産設計ファンド2045	10,029,435
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	9,290,601
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	8,846,047
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	6,621,445
野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型	4,945,046
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	4,741,695
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	4,559,866
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	3,621,490
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	3,368,912
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	3,176,738
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,074,488
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	2,970,991
インデックス・ブレンド（タイプＩ）	2,471,601
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,359,989
野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型	1,973,036
野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型	1,396,576
野村資産設計ファンド（ＤＣ）2050	942,038
野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型	874,537
野村資産設計ファンド（ＤＣ）2040	530,932
野村資産設計ファンド（ＤＣ）2030	449,092

○お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／海外／債券／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1)分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 (2)分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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。	

FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）

運用報告書（全体版）

第20期（決算日　2019年 9月9日）
第21期（決算日　2019年11月7日）
第22期（決算日　2020年 1月7日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

ホームページ　https://www.smtam.jp/

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011　東京都港区芝公園一丁目1番1号
＜610059＞

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
		円	円	%		%	%	%	百万円
第4	第 8期(2017年 9月7日)	9,408	28	0.3	9,632	0.2	98.3	0.6	5,332
	第 9期(2017年11月7日)	9,618	28	2.5	9,926	3.0	98.3	0.6	7,194
	第10期(2018年 1月9日)	9,670	26	0.8	9,976	0.5	97.3	1.3	10,003
第5	第11期(2018年 3月7日)	9,059	25	△6.1	9,424	△5.5	98.1	0.7	11,921
	第12期(2018年 5月7日)	9,200	27	1.9	9,565	1.5	97.9	0.9	13,565
	第13期(2018年 7月9日)	9,255	27	0.9	9,643	0.8	98.3	0.5	17,290
第6	第14期(2018年 9月7日)	9,123	27	△1.1	9,583	△0.6	97.7	1.0	20,631
	第15期(2018年11月7日)	9,167	27	0.8	9,619	0.4	98.3	0.6	24,138
	第16期(2019年 1月7日)	8,953	23	△2.1	9,384	△2.4	98.3	0.6	26,040
第7	第17期(2019年 3月7日)	9,234	28	3.5	9,753	3.9	98.6	0.4	29,391
	第18期(2019年 5月7日)	9,207	24	△0.0	9,765	0.1	97.9	0.8	29,955
	第19期(2019年 7月8日)	9,304	28	1.4	9,875	1.1	98.6	0.4	31,905
第8	第20期(2019年 9月9日)	9,337	28	0.7	9,951	0.8	98.4	0.6	32,456
	第21期(2019年11月7日)	9,389	27	0.8	10,050	1.0	98.4	0.6	31,711
	第22期(2020年 1月7日)	9,382	24	0.2	10,050	0.0	98.1	0.8	30,957

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

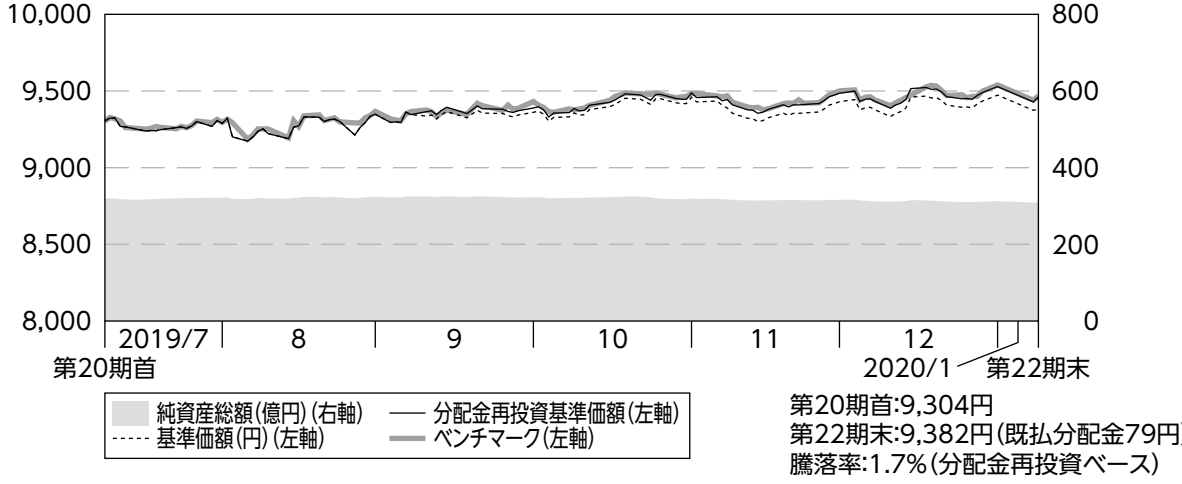
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年　月　日	基準価額	騰落率	ベンチマーク	騰落率	債券組入比率	債券先物比率
		円	%		%	%	%
第20期	(期　首)2019年 7月8日	9,304	－	9,875	－	98.6	0.4
	7月末	9,289	△0.2	9,865	△0.1	97.9	0.9
	8月末	9,348	0.5	9,942	0.7	97.9	0.9
	(期　末)2019年 9月9日	9,365	0.7	9,951	0.8	98.4	0.6
第21期	(期　首)2019年 9月9日	9,337	－	9,951	－	98.4	0.6
	9月末	9,361	0.3	10,010	0.6	97.9	1.7
	10月末	9,459	1.3	10,066	1.1	98.4	0.5
	(期　末)2019年11月7日	9,416	0.8	10,050	1.0	98.4	0.6
第22期	(期　首)2019年11月7日	9,389	－	10,050	－	98.4	0.6
	11月末	9,430	0.4	10,084	0.3	98.4	0.5
	12月末	9,473	0.9	10,125	0.7	99.1	1.7
	(期　末)2020年 1月7日	9,406	0.2	10,050	0.0	98.1	0.8

(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)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」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

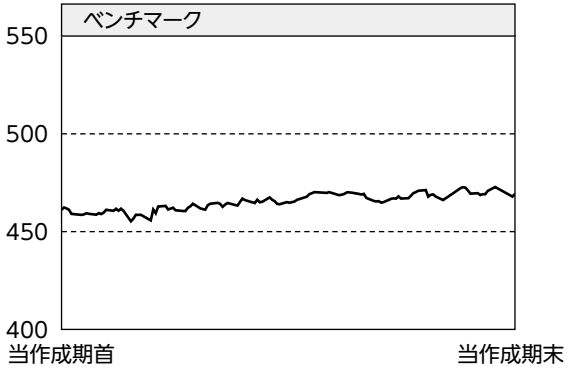


(注1)分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
(注2)分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
(注3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2019年7月8日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額(分配金再投資ベース)は、当作成期初から2019年8月下旬にかけて、世界景気の減速懸念が強まる中、FRB(米連邦準備理事会)やECB(欧州中央銀行)の金融緩和観測が高まったことから、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)した一方で、英国の合意なきEU(欧州連合)離脱やイタリアの政局混迷への警戒感を背景としたリスク回避姿勢の強まりを受けて、外国為替市場で主要通貨が対円で下落したことから、レンジ内推移となりました。その後は、ECBによる大規模金融緩和期待の後退や欧州における財政拡大への懸念などにより、主要国の長期金利は上昇(債券価格は下落)基調で推移したものの、米中通商協議の進展期待が高まったことや世界経済の減速懸念が和らいだことなどを背景に、リスク回避姿勢が後退したことから主要通貨が対円で上昇し、基準価額は上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2019年8月下旬にかけて、FRBやECBの金融緩和観測が高まったことから、低下しました。その後当作成期末にかけては、ECBによる大規模金融緩和期待の後退や欧州での財政拡大への懸念などにより、主要国の長期金利は上昇基調で推移しました。
外国為替市場では、2019年8月下旬にかけて、英国の合意なきEU離脱懸念によるリスク回避姿勢の強まりから、主要通貨は対円で下落しました。9月から当作成期末にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景にリスク回避姿勢が後退し、主要通貨は対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100％組み入れ、運用しました。

【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】
ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。
（1）債券組入比率
先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。
（2）ポートフォリオ構成
ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

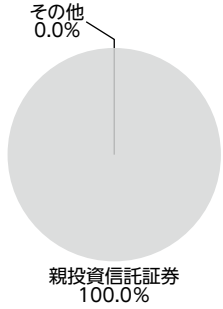
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

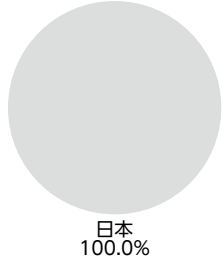
	当作成期末
	2020年1月7日
外国債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

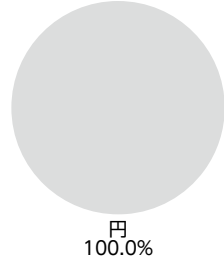
○資産別配分



○国別配分



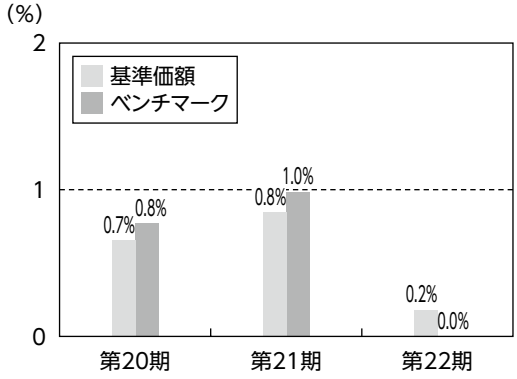
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬および為替評価差要因※です。

※当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第20期	第21期	第22期
		2019年7月9日～2019年9月9日	2019年9月10日～2019年11月7日	2019年11月8日～2020年1月7日
当期分配金	（円）	28	27	24
（対基準価額比率）	（％）	（0.299）	（0.287）	（0.255）
当期の収益	（円）	28	27	24
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	513	518	527

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

外国債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期 (2019年7月9日~2020年1月7日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.066%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,393円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(5)	(0.050)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.005)	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)	(1)	(0.011)	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	0.000	(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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	−	−	(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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(d) その他費用	1	0.013	(d)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(1)	(0.010)	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)	(0)	(0.003)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	7	0.079	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンド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2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当作成期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	235,981	657,486	767,323	2,169,448

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	2,421	464	19.2	2,443	475	19.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜外国債券インデックス マザーファンド＞

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	22,709	3	0.0	9,513	552	5.8
金銭信託	225	225	100.0	225	225	100.0
コール・ローン	398,165	80,241	20.2	389,263	80,736	20.7

〈平均保有割合　8.1%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	前作成期末	当作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	11,439,530	10,908,187	30,942,165

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、141,489,176千口です。

投資信託財産の構成

項目	当作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	30,942,165	99.6
コール・ローン等、その他	118,795	0.4
投資信託財産総額	31,060,960	100.0

(注1)外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(390,682,637千円)の投資信託財産総額(410,710,425千円)に対する比率は95.1%です。

(注2)外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル＝108.44円
1ユーロ＝121.36円
1ノルウェークローネ＝12.33円
1オーストラリアドル＝75.16円
1南アフリカランド＝7.62円
1カナダドル＝83.66円
1イギリスポンド＝142.85円
1デンマーククローネ＝16.24円
1シンガポールドル＝80.37円
1メキシコペソ＝5.75円
1スウェーデンクローナ＝11.53円
1ポーランドズロチ＝28.68円
1マレーシアリンギット＝26.45円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第 20 期 末 2019年9月9日現在	第 21 期 末 2019年11月7日現在	第 22 期 末 2020年1月7日現在
(A)資産	**32,561,318,826円**	**31,822,804,473円**	**31,060,960,337円**
コール・ローン等	23,511,138	22,809,087	21,816,263
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	32,440,354,882	31,695,689,506	30,942,165,578
未収入金	97,452,806	104,305,880	96,978,496
(B)負債	**104,769,846**	**111,272,121**	**103,369,483**
未払収益分配金	97,328,328	91,195,463	79,192,392
未払解約金	－	13,000,000	16,999,999
未払信託報酬	7,160,698	6,810,444	6,900,847
未払利息	52	31	24
その他未払費用	280,768	266,183	276,221
(C)純資産総額(A-B)	**32,456,548,980**	**31,711,532,352**	**30,957,590,854**
元本	34,760,117,435	33,776,097,649	32,996,830,007
次期繰越損益金	△2,303,568,455	△2,064,565,297	△2,039,239,153
(D)受益権総口数	**34,760,117,435口**	**33,776,097,649口**	**32,996,830,007口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**9,337円**	**9,389円**	**9,382円**

■損益の状況

項目	第 20 期 自 2019年7月9日 至 2019年9月9日	第 21 期 自 2019年 9月10日 至 2019年11月 7日	第 22 期 自 2019年11月8日 至 2020年 1月7日
(A)配当等収益	**△2,367円**	**△1,315円**	**△2,046円**
支払利息	△2,367	△1,315	△2,046
(B)有価証券売買損益	**221,640,058**	**271,670,982**	**64,636,171**
売買益	230,076,005	279,570,140	71,940,312
売買損	△8,435,947	△7,899,158	△7,304,141
(C)信託報酬等	**△7,441,470**	**△7,076,631**	**△7,177,069**
(D)当期損益金(A+B+C)	**214,196,221**	**264,593,036**	**57,457,056**
(E)前期繰越損益金	**124,969,747**	**234,443,860**	**396,367,415**
(F)追加信託差損益金	**△2,545,406,095**	**△2,472,406,730**	**△2,413,871,232**
(配当等相当額)	(1,366,336,637)	(1,328,769,607)	(1,300,292,306)
(売買損益相当額)	(△3,911,742,732)	(△3,801,176,337)	(△3,714,163,538)
(G)計(D+E+F)	**△2,206,240,127**	**△1,973,369,834**	**△1,960,046,761**
(H)収益分配金	**△97,328,328**	**△91,195,463**	**△79,192,392**
次期繰越損益金(G+H)	**△2,303,568,455**	**△2,064,565,297**	**△2,039,239,153**
追加信託差損益金	△2,545,406,095	△2,472,406,730	△2,413,871,232
(配当等相当額)	(1,366,505,853)	(1,328,805,977)	(1,300,348,503)
(売買損益相当額)	(△3,911,911,948)	(△3,801,212,707)	(△3,714,219,735)
分配準備積立金	418,658,229	423,710,281	440,224,575
繰越損益金	△176,820,589	△15,868,848	△65,592,496

(注1)(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(C)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3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの第20期首元本額は34,291,154,832円、第20～22期中追加設定元本額は774,172,634円、第20～22期中一部解約元本額は2,068,497,459円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　20　期	第　21　期	第　22　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	118,508,475円	109,047,287円	107,627,150円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	1,366,505,853円	1,328,805,977円	1,300,348,503円
(D) 分配準備積立金額	397,478,082円	405,858,457円	411,789,817円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,882,492,410円	1,843,711,721円	1,819,765,470円
(F) 期末残存口数	34,760,117,435口	33,776,097,649口	32,996,830,007口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	541円	545円	551円
(H) 分配金額(1万口当たり)	28円	27円	24円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	97,328,328円	91,195,463円	79,192,392円

分配金のお知らせ

	第20期	第21期	第22期
1万口当たり分配金	28円	27円	24円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第19期（決算日　2019年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運　用　方　針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組　入　制　限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第15期(2015年5月29日)	28,802	14.8	477.014	15.1	98.2	0.7	217,598
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7	436.679	△8.5	97.9	0.9	212,962
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440.540	0.9	97.3	1.4	219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441.246	0.2	98.0	0.8	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454.282	3.0	97.3	1.4	310,994

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

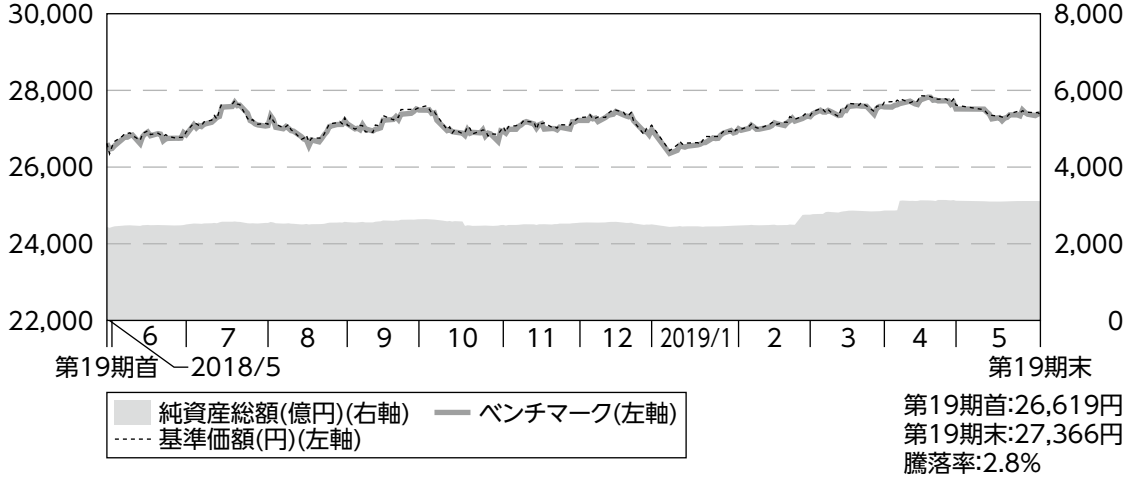
年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(当期首) 2018年 5月29日	26,619	－	441.246	－	98.0	0.8
5月末	26,536	△0.3	439.032	△0.5	97.7	1.1
6月末	26,916	1.1	444.974	0.8	97.9	0.9
7月末	27,116	1.9	448.912	1.7	97.4	1.2
8月末	27,096	1.8	449.733	1.9	97.2	1.2
9月末	27,552	3.5	455.629	3.3	97.8	1.0
10月末	27,051	1.6	446.445	1.2	97.9	0.7
11月末	27,292	2.5	451.152	2.2	97.7	1.0
12月末	27,092	1.8	447.211	1.4	98.2	0.5
2019年 1月末	26,959	1.3	447.557	1.4	97.7	1.0
2月末	27,340	2.7	452.775	2.6	98.1	0.8
3月末	27,696	4.0	456.981	3.6	98.1	0.8
4月末	27,615	3.7	456.104	3.4	98.1	0.7
(当期末) 2019年 5月29日	27,366	2.8	454.282	3.0	97.3	1.4

(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。
FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

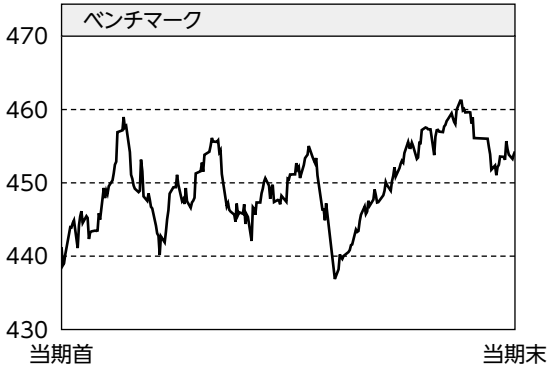


(注)ベンチマークは、2018年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2018年9月下旬にかけては、堅調な米国の経済指標などを背景に主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)基調で推移した一方で、外国為替市場で円安が進んだことから、基準価額は上昇しました。10月上旬から12月中旬にかけては、英国のEU(欧州連合)離脱を巡る政治的混乱やイタリア財政懸念から長期金利が低下(債券価格は上昇)した一方で、ユーロや英ポンドに対して円高が進んだことから、基準価額はもみ合い推移となりました。12月下旬から2019年1月上旬にかけては、株式市場の下落などを背景に投資家のリスク回避姿勢が強まり、円高となったことから、基準価額は下落しました。1月中旬から4月上旬にかけては、株式市場の回復を受けて円安推移となったことに加え、FRB(米連邦準備理事会)やECB(欧州中央銀行)が当面の利上げ見送りを示唆したことなどから長期金利が低下基調で推移し、基準価額は上昇しました。4月中旬以降期末にかけては、米中貿易摩擦の長期化への懸念などを背景に円高となったことから、基準価額は下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2018年11月上旬にかけて、米国を中心に堅調な経済指標が続いたことなどから、上昇しました。その後期末にかけては、FRBやECBの利上げ見通しが引き下げられたことなどから、長期金利は低下推移となりました。
外国為替市場では、2018年9月下旬にかけて、米国の利上げなどを材料に、対米ドルを中心に円安推移となりました。2019年1月上旬にかけて、世界的な株式市場の下落などを受け、主要通貨に対して円高が進みましたが、その後4月中旬にかけては、株式市場の回復などから円安推移となりました。4月下旬以降期末にかけては、世界経済の減速懸念などから、再び円高となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

（2）ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

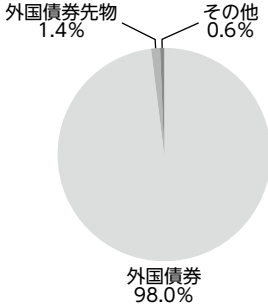
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

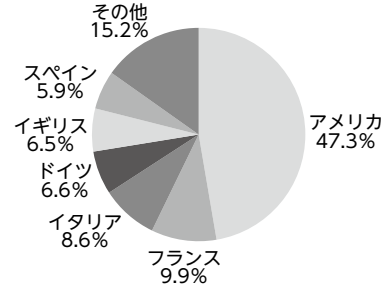
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 2.625% 12/31/25	アメリカ	0.6%
2	T 1.75% 05/15/23	アメリカ	0.6%
3	T 2.875% 08/15/28	アメリカ	0.6%
4	T 2.5% 02/15/46	アメリカ	0.6%
5	T 3% 09/30/25	アメリカ	0.6%
6	T 3.125% 11/15/28	アメリカ	0.5%
7	T 2.5% 05/15/46	アメリカ	0.5%
8	T 2.5% 01/15/22	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 05/15/28	アメリカ	0.5%
10	T 2.25% 11/15/27	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		701	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

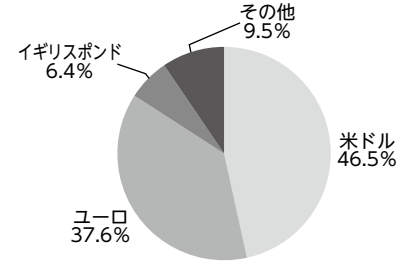
○資産別配分



○国別配分



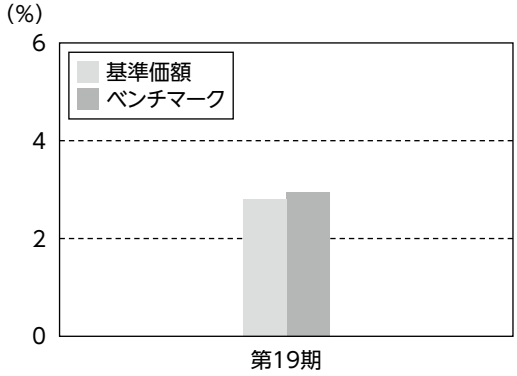
○通貨別配分



（注1）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
（注2）国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.4%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※（マイナス要因）です。

※当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、そ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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2018年5月30日~2019年5月29日) 金額	比率	項目の概要
(a) 売買委託手数料	0円	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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	−	−	(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〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(c) その他費用	7	0.024	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(7)	(0.024)	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)	(−)	(−)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	7	0.025	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(27,188円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当期 買付額	当期 売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 565,809	千米ドル 251,725
	カナダ	国債証券	千カナダドル 30,125	千カナダドル 20,745
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 173,569	千メキシコペソ 73,021
	ドイツ	国債証券	千ユーロ 62,063	千ユーロ 35,227
	イタリア	国債証券	78,243	40,189
	フランス	国債証券	93,102	43,955
	オランダ	国債証券	13,542	6,455
	スペイン	国債証券	54,447	26,911
	ベルギー	国債証券	18,395	5,686
	オーストリア	国債証券	10,858	4,954
	フィンランド	国債証券	5,176	2,658
	アイルランド	国債証券	6,395	5,200
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 46,728	千イギリスポンド 23,475
	スイス	国債証券	千スイスフラン 112	千スイスフラン 3,715
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 24,557	千スウェーデンクローナ 7,428
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 20,945	千ノルウェークローネ 15,657
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 29,810	千デンマーククローネ 21,948
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 27,117	千ポーランドズロチ 14,937
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 23,294	千オーストラリアドル 9,885
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 6,181	千シンガポールドル 3,130
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 16,811	千マレーシアリンギット 8,302
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 69,383	千南アフリカランド 16,870

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分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		当期			
		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	債券先物取引	百万円 34,498	百万円 32,366	百万円 －	百万円 －

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	81,996	58	0.1	23,742	275	1.2
金銭信託	27,742	27,742	100.0	27,742	27,742	100.0
コール・ローン	787,557	118,717	15.1	788,060	119,031	15.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A)債券種類別開示

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	1,289,070	1,313,254	143,512,411	46.1	－	19.6	16.8	9.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	66,930	73,096	5,920,060	1.9	－	0.9	0.5	0.5
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	440,380	438,374	2,498,732	0.8	－	0.5	0.3	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	135,980	162,928	19,882,129	6.4	－	3.6	2.1	0.7
イタリア	200,790	214,280	26,148,634	8.4	－	4.8	2.7	0.9
フランス	209,770	245,773	29,991,727	9.6	－	6.2	2.5	1.0
オランダ	40,960	49,021	5,982,099	1.9	－	1.2	0.6	0.1
スペイン	122,420	144,653	17,652,058	5.7	－	3.7	1.3	0.7
ベルギー	50,840	61,206	7,469,005	2.4	－	1.8	0.5	0.1
オーストリア	30,940	36,356	4,436,524	1.4	－	1.0	0.3	0.1
フィンランド	13,290	14,729	1,797,420	0.6	－	0.3	0.2	0.1
アイルランド	15,530	17,566	2,143,653	0.7	－	0.5	0.2	0.0
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	113,040	142,269	19,671,606	6.3	－	4.7	1.1	0.5
	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	81,810	93,109	1,061,451	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	57,560	59,466	745,120	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	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	73,660	95,018	1,551,644	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	61,950	63,736	1,810,747	0.6	－	0.2	0.2	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	71,700	80,820	6,118,882	2.0	－	1.3	0.4	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	14,970	15,469	1,225,630	0.4	－	0.2	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	52,220	53,025	1,381,833	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	242,710	224,989	1,673,924	0.5	－	0.5	0.0	0.0
合計	－	－	302,675,300	97.3	－	51.8	30.5	15.1

(注1)邦貨換算金額は、当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2)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)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。

(B)個別銘柄開示

当期末					
銘柄	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(千円)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 1.125% 02/28/21	1.125	6,500	6,384	697,667	2021/2/28
T 1.125% 04/30/20	1.125	4,000	3,955	432,304	2020/4/30
T 1.125% 06/30/21	1.125	9,800	9,608	1,050,027	2021/6/30
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	4,896	535,087	2021/7/31
T 1.125% 09/30/21	1.125	2,800	2,740	299,469	2021/9/30
T 1.25% 03/31/21	1.25	3,500	3,443	376,339	2021/3/31
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,402	481,064	2023/7/31
T 1.25% 10/31/21	1.25	10,000	9,803	1,071,328	2021/10/31
T 1.375% 01/31/21	1.375	11,000	10,855	1,186,279	2021/1/31
T 1.375% 04/30/20	1.375	1,000	991	108,310	2020/4/30
T 1.375% 04/30/21	1.375	9,500	9,365	1,023,439	2021/4/30
T 1.375% 05/31/20	1.375	1,550	1,535	167,805	2020/5/31
T 1.375% 05/31/21	1.375	7,700	7,586	829,097	2021/5/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,865	531,694	2023/6/30
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,429	265,548	2023/8/31
T 1.375% 09/30/20	1.375	4,000	3,954	432,193	2020/9/30
T 1.375% 09/30/23	1.375	8,000	7,770	849,173	2023/9/30
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	5,929	647,957	2020/10/31
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,433	484,537	2022/1/31
T 1.5% 02/28/23	1.5	7,800	7,643	835,303	2023/2/28
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,918	428,189	2023/3/31
T 1.5% 07/15/20	1.5	7,200	7,137	779,977	2020/7/15
T 1.5% 08/15/20	1.5	10,000	9,908	1,082,747	2020/8/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	13,200	12,607	1,377,696	2026/8/15
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,832	855,915	2026/2/15
T 1.625% 04/30/23	1.625	3,500	3,442	376,249	2023/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	7,982	872,326	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	5,000	4,916	537,264	2023/5/31
T 1.625% 06/30/20	1.625	3,000	2,978	325,490	2020/6/30
T 1.625% 07/31/20	1.625	5,000	4,962	542,259	2020/7/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,466	269,528	2022/8/15
T 1.625% 10/15/20	1.625	7,500	7,439	813,036	2020/10/15
T 1.625% 10/31/23	1.625	9,000	8,831	965,079	2023/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	12,150	11,976	1,308,821	2022/11/15
T 1.625% 11/30/20	1.625	3,050	3,023	330,446	2020/11/30
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,468	816,201	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,479	270,916	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,470	1,034,940	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	11,200	11,102	1,213,226	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,766	411,565	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	17,500	17,292	1,889,764	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,462	1,034,084	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	6,939	758,356	2022/6/30
T 1.75% 09/30/22	1.75	10,150	10,050	1,098,360	2022/9/30
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	3,974	434,294	2020/10/31
T 1.75% 12/31/20	1.75	8,200	8,143	889,952	2020/12/31
T 1.875% 01/31/22	1.875	12,000	11,938	1,304,649	2022/1/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,487	271,780	2022/2/28
T 1.875% 06/30/20	1.875	3,750	3,733	407,951	2020/6/30
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	8,949	978,026	2022/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	3,977	434,661	2022/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	14,650	14,564	1,591,633	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,373	587,230	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,495	272,762	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	12,000	11,975	1,308,696	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,400	8,350	912,573	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	3,988	435,907	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,790	414,258	2021/5/31
T 2% 05/31/24	2.0	8,000	7,978	871,849	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	10,500	10,461	1,143,226	2024/6/30
T 2% 07/31/20	2.0	5,200	5,183	566,424	2020/7/31
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	2,994	327,289	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	12,300	12,201	1,333,432	2025/8/15

当期末					
銘柄	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(千円)	
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,785	741,507	2021/8/31
T 2% 09/30/20	2.0	5,000	4,984	544,745	2020/9/30
T 2% 10/31/21	2.0	5,650	5,639	616,274	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,395	261,821	2021/11/15
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	10,089	1,102,619	2026/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,483	599,255	2020/11/30
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	1,996	218,133	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,197	240,115	2021/12/31
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	2,997	327,577	2021/1/31
T 2.125% 02/29/24	2.125	9,100	9,120	996,739	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,417	810,630	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	12,000	11,999	1,311,308	2025/5/15
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,503	819,952	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	2,100	2,104	229,998	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,810	525,670	2024/7/31
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,102	666,894	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,490	709,321	2020/8/31
T 2.125% 09/30/21	2.125	10,300	10,309	1,126,595	2021/9/30
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,014	875,810	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	12,680	12,712	1,389,188	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	4,500	4,506	492,451	2021/12/31
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,332	582,777	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,031	440,535	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,985	981,952	2027/2/15
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,050	3,055	333,928	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,508	383,368	2021/4/30
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	3,009	328,851	2021/7/31
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	8,572	936,752	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	6,700	6,112	667,996	2046/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,350	694,003	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,226	1,117,597	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,427	483,818	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	14,650	14,676	1,603,828	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	11,500	11,588	1,266,390	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	8,400	8,465	925,123	2024/12/31
T 2.375% 04/15/21	2.375	11,500	11,549	1,262,095	2021/4/15
T 2.375% 04/30/20	2.375	3,960	3,960	432,833	2020/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	6,950	7,038	769,167	2027/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	12,500	12,674	1,385,102	2024/8/15
T 2.375% 12/31/20	2.375	11,000	11,031	1,205,507	2020/12/31
T 2.5% 01/15/22	2.5	15,000	15,161	1,656,872	2022/1/15
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	5,106	558,011	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	6,300	6,072	663,614	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	16,500	15,868	1,734,094	2046/2/15
T 2.5% 03/31/23	2.5	4,050	4,116	449,845	2023/3/31
T 2.5% 05/15/24	2.5	2,900	2,957	323,225	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	16,000	15,377	1,680,453	2046/5/15
T 2.5% 05/31/20	2.5	13,950	13,975	1,527,195	2020/5/31
T 2.5% 06/30/20	2.5	6,500	6,513	711,846	2020/6/30
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,630	505,983	2023/8/15
T 2.5% 12/31/20	2.5	10,000	10,047	1,098,007	2020/12/31
T 2.625% 02/28/23	2.625	1,400	1,428	156,099	2023/2/28
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,453	814,531	2025/3/31
T 2.625% 05/15/21	2.625	10,580	10,680	1,167,134	2021/5/15
T 2.625% 06/30/23	2.625	6,200	6,336	692,489	2023/6/30
T 2.625% 07/15/21	2.625	3,350	3,385	370,020	2021/7/15
T 2.625% 07/31/20	2.625	12,700	12,750	1,393,385	2020/7/31
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,500	5,523	603,657	2020/8/15
T 2.625% 11/15/20	2.625	11,000	11,065	1,209,287	2020/11/15
T 2.625% 12/31/23	2.625	11,500	11,779	1,287,254	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	16,700	17,186	1,878,156	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,091	337,828	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	10,400	10,821	1,182,594	2028/2/15
T 2.75% 04/30/23	2.75	7,600	7,795	851,940	2023/4/30
T 2.75% 06/30/25	2.75	10,500	10,872	1,188,093	2025/6/30

当期末					
銘柄	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(千円)	
T 2.75% 07/31/23	2.75	6,000	6,164	673,608	2023/7/31
T 2.75% 08/15/21	2.75	11,000	11,152	1,218,796	2021/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	3,048	333,141	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	9,950	10,030	1,096,085	2047/8/15
T 2.75% 09/30/20	2.75	11,100	11,174	1,221,181	2020/9/30
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	7,098	775,710	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	4,263	465,896	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	9,050	9,120	996,710	2047/11/15
T 2.875% 05/15/28	2.875	14,260	14,989	1,638,075	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	11,500	11,911	1,301,687	2043/5/15
T 2.875% 07/31/25	2.875	9,460	9,864	1,078,007	2025/7/31
T 2.875% 08/15/28	2.875	15,920	16,739	1,829,306	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	10,900	11,276	1,232,283	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	4,908	536,396	2023/9/30
T 2.875% 10/15/21	2.875	12,250	12,472	1,362,995	2021/10/15
T 2.875% 10/31/20	2.875	13,000	13,117	1,433,486	2020/10/31
T 2.875% 10/31/23	2.875	11,000	11,373	1,242,931	2023/10/31
T 2.875% 11/15/21	2.875	8,350	8,508	929,846	2021/11/15
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	4,707	514,409	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	4,650	4,929	538,680	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,950	2,069	226,148	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,705	404,980	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	7,750	8,207	896,941	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	6,350	6,721	734,533	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	15,000	15,761	1,722,376	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	10,000	10,510	1,148,592	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	6,050	6,400	699,469	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	2,350	2,546	278,315	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	5,000	5,402	590,410	2043/2/15
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,400	590,190	2021/5/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,700	5,092	556,551	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,000	6,483	708,544	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	14,400	15,456	1,689,072	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	3,250	3,525	385,293	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	5,610	6,316	690,316	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	8,300	9,438	1,031,385	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	2,200	2,535	277,098	2039/2/15
T 3.5% 05/15/20	3.5	5,650	5,712	624,305	2020/5/15
T 3.625% 02/15/21	3.625	11,100	11,371	1,242,646	2021/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	7,500	8,784	960,020	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,340	255,817	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,383	260,427	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	6,000	7,161	782,615	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	3,150	3,819	417,435	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,144	125,037	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	4,350	5,546	606,131	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,285	140,484	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,459	268,737	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	2,650	3,438	375,813	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,491	381,567	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,364	258,413	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,306	142,747	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,231	243,889	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,700	2,269	247,967	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	2,950	4,012	438,481	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,509	164,957	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	1,250	1,574	172,030	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,630	178,146	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,102	229,733	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,522	166,430	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,105	230,115	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,883	205,869	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,900	2,626	287,067	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,927	210,605	2023/8/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	1,939	211,908	2021/11/15
小計				143,512,411	

当期末					
銘柄	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(千円)	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	3,100	3,016	244,297	2022/3/1
CAN 0.75% 03/01/21	0.75	4,590	4,526	366,612	2021/3/1
CAN 0.75% 09/01/20	0.75	4,200	4,153	336,404	2020/9/1
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	1,630	1,602	129,801	2021/9/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	1,970	1,890	153,125	2027/6/1
CAN 1% 09/01/22	1.0	1,500	1,476	119,557	2022/9/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	2,400	2,401	194,493	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	2,300	2,297	186,076	2026/6/1
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	1,900	1,918	155,357	2023/3/1
CAN 1.75% 05/01/21	1.75	2,700	2,711	219,569	2021/5/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	2,140	2,220	179,835	2028/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	2,110	2,155	174,580	2023/9/1
CAN 2% 11/01/20	2.0	2,110	2,121	171,839	2020/11/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	400	417	33,809	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,382	192,955	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	2,850	2,973	240,821	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,120	1,190	96,387	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	3,060	3,211	260,079	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	2,210	2,290	185,529	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	2,870	3,472	281,229	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	620	805	65,266	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	2,130	2,202	178,356	2021/6/1
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	5,210	5,304	429,614	2020/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,490	3,355	271,780	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	2,330	3,239	262,392	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	2,010	2,999	242,915	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	2,170	2,999	242,922	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,600	2,407	194,993	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	910	1,351	109,453	2027/6/1
小計				5,920,060	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	16,950	19,698	112,282	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	38,840	42,741	243,626	2024/12/5
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	25,070	22,324	127,247	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	46,700	45,105	257,102	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	55,880	54,546	310,913	2021/6/10
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	25,330	25,011	142,564	2021/12/9
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	42,070	41,093	234,230	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	22,000	21,517	122,648	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	32,690	30,732	175,177	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	8,630	8,325	47,454	2034/11/23
MBONO 8% 06/11/20	8.0	33,750	33,792	192,618	2020/6/11
MBONO 8% 11/07/47	8.0	13,560	13,013	74,177	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	33,800	34,136	194,578	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	21,000	21,773	124,109	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	24,110	24,561	140,001	2038/11/18
小計				2,498,732	
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BKO 0% 03/12/21	－	2,960	2,994	365,451	2021/3/12
DBR 0% 08/15/26	－	3,160	3,251	396,789	2026/8/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	4,190	4,388	535,531	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	910	946	115,530	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	4,160	4,339	529,542	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,790	4,013	489,766	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,400	3,617	441,488	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	3,270	3,491	426,122	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	4,650	4,966	606,011	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	3,200	3,462	422,503	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,910	4,275	521,725	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	2,120	2,560	312,510	2048/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	920	994	121,330	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,950	3,202	390,785	2023/5/15

当期末					
銘柄	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(千円)	
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,528	308,495	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,800	3,000	366,122	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,834	223,868	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	3,650	3,926	479,167	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,300	3,532	431,016	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	3,850	4,280	522,371	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,500	2,591	316,248	2020/9/4
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,080	253,835	2021/9/4
DBR 2.5% 01/04/21	2.5	2,900	3,050	372,207	2021/1/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	4,430	6,631	809,224	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	4,190	6,388	779,529	2046/8/15
DBR 3% 07/04/20	3.0	7,190	7,476	912,408	2020/7/4
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	10,190	11,032	1,346,266	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,600	4,271	521,300	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	3,360	5,571	679,871	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,850	3,286	401,081	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,729	455,078	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	3,380	5,748	701,454	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,510	4,801	585,893	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,930	4,851	592,081	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,460	3,735	455,835	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	2,000	2,637	321,912	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	2,111	257,666	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	650	1,015	123,972	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	－	2,900	2,979	363,544	2024/4/5
OBL 0% 04/14/23	－	1,790	1,834	223,853	2023/4/14
OBL 0% 10/07/22	－	3,490	3,567	435,398	2022/10/7
OBL 0% 10/08/21	－	2,600	2,641	322,316	2021/10/8
OBL 0% 10/13/23	－	2,930	3,008	367,089	2023/10/13
OBL 0.25% 10/16/20	0.25	2,250	2,277	277,926	2020/10/16
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0.05% 04/15/21	0.05	2,190	2,165	264,281	2021/4/15
BTPS 0.2% 10/15/20	0.2	1,390	1,387	169,294	2020/10/15
BTPS 0.35% 06/15/20	0.35	3,480	3,486	425,505	2020/6/15
BTPS 0.35% 11/01/21	0.35	2,580	2,547	310,892	2021/11/1
BTPS 0.45% 06/01/21	0.45	1,400	1,393	170,052	2021/6/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	1,300	1,249	152,444	2023/10/15
BTPS 0.65% 11/01/20	0.65	1,550	1,555	189,852	2020/11/1
BTPS 0.7% 05/01/20	0.7	2,000	2,010	245,286	2020/5/1
BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	3,180	3,141	383,365	2022/8/1
BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	3,500	3,432	418,825	2023/3/1
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	2,000	1,960	239,263	2023/3/15
BTPS 1% 07/15/22	1.0	3,600	3,566	435,187	2022/7/15
BTPS 1.2% 04/01/22	1.2	1,450	1,451	177,127	2022/4/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	4,200	3,943	481,251	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	2,900	2,912	355,380	2022/4/15
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,225	271,586	2025/5/15
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,050	1,054	128,658	2022/9/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	1,300	1,267	154,710	2024/11/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,910	2,826	344,908	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	3,600	3,476	424,213	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,100	2,733	333,516	2032/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,000	2,004	244,604	2024/5/15
BTPS 2% 02/01/28	2.0	1,650	1,605	195,878	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	3,150	3,132	382,278	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	3,200	3,133	382,332	2027/8/1
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,570	313,705	2021/12/15
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	3,700	3,672	448,111	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	2,650	2,384	290,999	2036/9/1
BTPS 2.3% 10/15/21	2.3	2,700	2,785	339,917	2021/10/15
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,500	2,369	289,099	2033/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	3,000	3,096	377,843	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,015	368,016	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	6,400	6,585	803,578	2024/12/1

当期末					
銘柄	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(千円)	
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	3,000	2,661	324,738	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	920	779	95,132	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	2,950	3,018	368,300	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,540	2,442	298,115	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	1,620	1,668	203,583	2029/8/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	2,400	2,348	286,636	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,890	1,953	238,408	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,530	2,531	308,968	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,930	4,206	513,352	2030/3/1
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	3,800	4,009	489,271	2021/3/1
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	3,100	3,279	400,237	2021/5/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	2,790	2,964	361,797	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,343	286,015	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,320	1,386	169,165	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	4,200	4,684	571,612	2037/2/1
BTPS 4% 09/01/20	4.0	4,400	4,601	561,515	2020/9/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	3,450	3,872	472,509	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	3,600	4,124	503,370	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,900	4,335	529,110	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	4,200	4,732	577,468	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,950	4,287	523,250	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	3,490	4,160	507,731	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,400	2,905	354,537	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/22	5.0	6,600	7,289	889,501	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	2,650	3,076	375,399	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,690	4,557	556,109	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,520	4,346	530,409	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,400	4,224	515,565	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,650	4,495	548,544	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	3,400	3,847	469,463	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,450	3,917	477,998	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,350	4,381	534,633	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	4,800	6,322	771,547	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	4,170	5,458	666,091	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,873	228,613	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,048	127,955	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/21	－	3,500	3,536	431,525	2021/2/25
FRTR 0% 03/25/23	－	3,900	3,969	484,369	2023/3/25
FRTR 0% 03/25/24	－	8,040	8,174	997,554	2024/3/25
FRTR 0% 05/25/21	－	4,100	4,148	506,229	2021/5/25
FRTR 0% 05/25/22	－	5,550	5,639	688,217	2022/5/25
FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	5,000	5,063	617,850	2020/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,850	4,960	605,389	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	6,890	7,190	877,503	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	6,280	6,549	799,213	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	2,600	2,664	325,125	2029/5/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,000	5,278	644,095	2028/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	6,510	6,852	836,265	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	6,650	7,177	875,814	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	6,930	7,464	910,936	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	3,950	4,276	521,804	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,820	5,160	629,760	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,520	7,331	894,640	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	1,200	1,256	153,308	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	4,590	4,997	609,898	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,860	2,011	245,447	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	2,420	2,779	339,169	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	8,710	9,697	1,183,396	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	4,040	4,774	582,581	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	3,100	3,506	427,930	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	5,740	6,284	766,925	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,460	6,736	822,054	2030/5/25
FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	5,450	5,687	693,987	2020/10/25

当期末					
銘柄	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(千円)	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,000	6,149	750,399	2027/10/25
FRTR 3% 04/25/22	3.0	8,520	9,408	1,148,094	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	4,170	6,148	750,280	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	10,850	11,860	1,447,325	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	5,670	7,115	868,284	2026/4/25
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	6,470	7,009	855,361	2021/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,300	4,018	490,352	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,850	3,328	406,199	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,980	6,220	759,048	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	6,250	7,556	922,085	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	5,690	9,656	1,178,375	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,000	4,851	592,016	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	4,050	6,163	752,165	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	5,410	9,104	1,111,060	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,658	324,409	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,354	165,270	2023/4/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/22	－	3,500	3,556	434,034	2022/1/15
NETHER 0% 01/15/24	－	2,650	2,707	330,398	2024/1/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,880	1,950	237,975	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	950	971	118,502	2029/7/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,620	2,762	337,162	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	3,630	3,898	475,697	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,490	1,601	195,465	2028/7/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,950	2,135	260,562	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	2,750	3,097	378,038	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,660	1,810	220,913	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,010	2,629	320,818	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,230	3,499	427,013	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,050	2,221	271,056	2021/7/15
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	2,060	2,155	263,040	2020/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	3,170	3,677	448,748	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,550	4,365	532,703	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,470	4,021	490,754	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,140	1,700	207,543	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	259	31,669	2023/1/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0.05% 01/31/21	0.05	3,600	3,622	442,040	2021/1/31
SPGB 0.05% 10/31/21	0.05	1,700	1,713	209,143	2021/10/31
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	2,280	2,322	283,414	2023/7/30
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	3,280	3,343	408,063	2022/4/30
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	2,850	2,915	355,761	2022/10/31
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	2,200	2,251	274,734	2021/7/30
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	3,000	3,054	372,679	2020/7/30
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	5,090	5,425	662,040	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	6,230	6,657	812,415	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,100	3,299	402,670	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,660	2,828	345,148	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,600	2,792	340,780	2027/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	3,050	3,288	401,291	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,210	3,485	425,339	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,210	1,287	157,148	2035/7/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,950	3,276	399,817	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	3,270	3,629	442,914	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	3,370	3,779	461,173	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,750	3,148	384,201	2033/7/30
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,670	1,940	236,748	2048/10/31
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	4,400	5,038	614,838	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,550	3,087	376,728	2046/10/31
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,560	2,059	251,369	2066/7/30
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	3,310	3,928	479,409	2024/4/30
SPGB 4% 04/30/20	4.0	3,000	3,121	380,900	2020/4/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,900	4,164	508,227	2037/1/31

当期末					
銘柄	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(千円)	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	4,250	5,090	621,165	2023/10/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	3,550	4,521	551,777	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	3,430	5,344	652,160	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,739	456,312	2024/1/31
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	3,950	4,243	517,875	2020/10/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,700	4,279	522,179	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,240	4,559	556,404	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	2,100	3,520	429,559	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,800	3,375	411,862	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,480	3,870	472,262	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	3,500	5,517	673,298	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	4,050	4,715	575,451	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,842	590,892	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,572	191,851	2029/1/31
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	2,000	2,050	250,246	2023/10/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,570	1,632	199,175	2024/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,100	2,222	271,176	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	2,110	2,227	271,841	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	3,160	3,323	405,531	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	950	1,002	122,325	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,730	1,854	226,313	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,490	1,570	191,640	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	850	913	111,445	2033/4/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	860	104,976	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,750	1,860	227,036	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	670	716	87,437	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,100	1,263	154,234	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	570	660	80,627	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,760	1,955	238,586	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	800	952	116,211	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,455	299,672	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,450	1,911	233,299	2034/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,600	2,491	304,075	2045/6/22
BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,750	2,908	354,912	2020/9/28
BGB 4% 03/28/22	4.0	3,100	3,501	427,306	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,580	2,250	274,593	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,730	4,374	533,851	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,350	2,616	319,261	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,270	2,633	321,418	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	2,420	3,178	387,924	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,780	4,503	549,574	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,260	3,313	404,310	2028/3/28
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 07/15/23	－	910	926	113,074	2023/7/15
RAGB 0% 09/20/22	－	1,100	1,118	136,497	2022/9/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	780	805	98,339	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	2,100	2,192	267,541	2027/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,430	1,518	185,286	2028/2/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	3,310	3,520	429,667	2026/10/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,710	1,868	228,034	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	970	1,101	134,392	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	640	702	85,757	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	1,090	1,207	147,312	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,400	1,535	187,399	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	500	692	84,521	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,320	1,673	204,166	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	980	1,490	181,875	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,500	1,706	208,195	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	2,170	2,375	289,866	2021/9/15
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,234	150,641	2022/4/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	640	1,232	150,440	2062/1/26
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	3,000	3,151	384,546	2020/7/15

当期末					
銘柄	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(千円)	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	2,040	3,250	396,665	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	2,120	2,853	348,257	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	130	197	24,044	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 04/15/22	－	850	863	105,348	2022/4/15
RFGB 0% 09/15/23	－	760	774	94,465	2023/9/15
RFGB 0.375% 09/15/20	0.375	1,330	1,346	164,295	2020/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	950	994	121,371	2026/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	1,050	1,095	133,733	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	350	363	44,412	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	430	444	54,226	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	760	800	97,727	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	300	321	39,208	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	570	624	76,183	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	350	402	49,171	2047/4/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	700	85,447	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	770	824	100,636	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	600	670	81,855	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	920	1,312	160,142	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	720	898	109,627	2028/7/4
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	800	861	105,154	2021/4/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	1,130	1,429	174,413	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/22	－	630	637	77,800	2022/10/18
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	1,570	1,623	198,060	2022/3/15
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	1,060	1,113	135,921	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,880	2,000	244,165	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	490	520	63,467	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	520	549	67,058	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	730	787	96,040	2031/3/18
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	940	1,032	126,015	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,260	1,453	177,381	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,480	1,768	215,750	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	1,470	1,726	210,721	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	1,290	1,499	182,932	2023/3/20
IRISH 5% 10/18/20	5.0	230	247	30,214	2020/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,980	2,606	318,122	2025/3/13
ユーロ計				115,503,254	
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	5,100	5,085	703,131	2022/7/22
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	3,930	3,949	546,036	2023/7/22
UKT 1% 04/22/24	1.0	2,820	2,865	396,171	2024/4/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	4,900	5,066	700,562	2027/7/22
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	3,120	3,166	437,793	2021/1/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,600	2,737	378,492	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	3,070	3,068	424,276	2047/7/22
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	4,650	4,942	683,387	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,200	1,306	180,655	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	910	964	133,324	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,530	2,776	383,904	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	3,400	3,527	487,702	2022/9/7
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	3,720	3,928	543,155	2037/9/7
UKT 2% 07/22/20	2.0	4,360	4,427	612,228	2020/7/22
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,170	1,264	174,849	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,670	369,267	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	2,650	3,640	503,344	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,200	2,437	337,069	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	3,520	4,780	661,015	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,360	4,780	660,951	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,610	4,549	629,003	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	3,280	5,259	727,255	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	3,470	3,606	498,715	2020/9/7

当期末					
銘柄	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(千円)	
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	3,770	4,040	558,617	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	2,950	5,310	734,291	2060/1/22
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,950	2,134	295,083	2022/3/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	3,180	4,577	632,908	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,500	3,439	475,527	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	2,190	3,278	453,320	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	670	859	118,891	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	3,050	4,630	640,222	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,470	3,994	552,387	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	2,170	3,640	503,381	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,740	4,935	682,411	2055/12/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,930	4,248	587,456	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,800	4,486	620,371	2042/12/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,210	3,106	429,572	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,992	413,719	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,500	3,110	430,142	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,832	253,340	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	740	850	117,663	2021/6/7
小計				19,671,606	
(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					
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,490	7,986	91,049	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	4,940	5,246	59,807	2029/11/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,660	9,378	106,915	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,450	13,521	154,148	2023/11/13
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	9,430	10,986	125,243	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	7,150	10,983	125,212	2039/3/30
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	17,590	19,717	224,774	2022/6/1
SGB 5% 12/01/20	5.0	14,100	15,289	174,300	2020/12/1
小計				1,061,451	
(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					
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	5,260	5,279	66,151	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	5,460	5,557	69,630	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,800	5,917	74,141	2025/3/13
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	3,170	3,206	40,172	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	5,730	5,937	74,391	2028/4/26
NGB 2% 05/24/23	2.0	13,440	13,781	172,681	2023/5/24
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,000	7,527	94,324	2024/3/14
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	11,700	12,260	153,627	2021/5/25
小計				745,120	
(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					
DGB 0.25% 11/15/20	0.25	9,400	9,527	155,581	2020/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	14,090	15,001	244,974	2027/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	9,700	10,601	173,117	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	9,410	10,743	175,444	2025/11/15
DGB 3% 11/15/21	3.0	10,700	11,671	190,598	2021/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	20,360	37,472	611,928	2039/11/15
小計				1,551,644	
(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					
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	5,100	5,106	145,075	2021/7/25
POLGB 2% 04/25/21	2.0	6,560	6,603	187,602	2021/4/25
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	4,710	4,766	135,422	2022/4/25
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,680	5,788	164,440	2023/1/25
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	1,890	1,920	54,550	2024/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,450	6,440	182,960	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	4,340	4,294	122,019	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	4,800	4,821	136,978	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	1,940	1,936	55,015	2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	6,230	6,541	185,850	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,380	3,651	103,731	2023/10/25

当期末					
銘柄	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(千円)	
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	5,520	5,803	164,879	2020/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	760	21,603	2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	3,600	4,041	114,824	2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	1,150	1,259	35,790	2021/10/25
小計				1,810,747	
(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					
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	5,100	5,144	389,480	2020/11/21
ACGB 2% 12/21/21	2.0	2,720	2,781	210,595	2021/12/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	5,790	6,159	466,369	2028/5/21
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	770	799	60,545	2022/11/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,250	3,560	269,527	2030/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	3,510	3,770	285,446	2024/4/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	800	893	67,672	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,030	1,165	88,226	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	5,750	6,343	480,260	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	3,050	3,383	256,144	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	2,570	2,870	217,350	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	2,130	2,490	188,577	2047/3/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	4,560	5,071	383,957	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	4,090	4,739	358,857	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,220	1,472	111,520	2039/6/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,920	2,460	186,295	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	4,230	5,036	381,309	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,100	2,832	214,450	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	3,850	4,807	364,010	2027/4/21
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	4,000	4,664	353,179	2023/4/21
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	3,930	4,281	324,159	2021/5/15
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	5,330	6,088	460,943	2022/7/15
小計				6,118,882	
(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					
SIGB 1.25% 10/01/21	1.25	250	246	19,499	2021/10/1
SIGB 1.75% 04/01/22	1.75	780	776	61,499	2022/4/1
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	411	32,588	2024/2/1
SIGB 2% 07/01/20	2.0	320	320	25,373	2020/7/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	850	856	67,889	2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	1,590	1,599	126,766	2021/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	700	686	54,401	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	630	644	51,074	2025/6/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	590	614	48,719	2028/5/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	1,010	1,044	82,783	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	620	647	51,294	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	1,540	1,590	125,981	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	280	298	23,643	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	670	715	56,682	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,050	1,104	87,524	2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	1,100	1,141	90,443	2022/9/1
SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	1,070	1,087	86,174	2020/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	730	821	65,070	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	780	861	68,217	2027/3/1
小計				1,225,630	
(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					
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	2,500	2,496	65,049	2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	2,700	2,692	70,176	2023/3/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	2,400	2,344	61,091	2027/5/31
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	2,690	2,706	70,519	2021/11/30
MGS 3.659% 10/15/20	3.659	1,150	1,156	30,135	2020/10/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,300	1,287	33,544	2028/6/15
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	1,100	1,110	28,952	2022/9/30
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	3,160	3,184	82,996	2023/8/17
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	2,990	2,904	75,698	2033/4/15
MGS 3.882% 03/10/22	3.882	750	759	19,801	2022/3/10
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,500	1,510	39,373	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,132	29,524	2027/3/15
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,080	1,086	28,322	2026/11/30
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	2,700	2,729	71,123	2025/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	2,050	2,081	54,240	2021/9/30
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,900	1,939	50,536	2024/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,000	1,000	26,062	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,030	2,063	53,782	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,550	1,590	41,438	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,000	2,033	53,005	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,400	1,400	36,485	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	3,160	3,268	85,183	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	2,390	2,504	65,276	2030/4/15
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,340	1,377	35,900	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,860	1,968	51,295	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	800	863	22,494	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,550	1,643	42,834	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,440	1,525	39,741	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	600	661	17,242	2028/9/15
小計				1,381,833	
(南アフリカ)		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券					
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	31,700	35,314	262,739	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	11,020	7,984	59,406	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	8,200	5,778	42,993	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	10,700	10,727	79,812	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	16,330	13,759	102,372	2031/2/28
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	14,100	14,191	105,582	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	17,400	16,135	120,050	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	18,470	16,973	126,281	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	24,700	22,188	165,086	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	27,140	24,400	181,540	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	35,250	31,689	235,770	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	13,050	12,254	91,171	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	14,650	13,590	101,116	2040/1/31
小計				1,673,924	
合計				302,675,300	

(注)邦貨換算金額は、当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。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
外国	EURO-SCHATZ	478	―
	US 5YR NOTE	867	―
	EURO-BOBL FU	587	―
	EURO-BUND	1,249	―
	US 10YR NOTE	535	―
	US LONG BOND	496	―

(注)外貨建資産は、当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

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	302,675,300	97.3
コール・ローン等、その他	8,442,501	2.7
投資信託財産総額	311,117,801	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(305,799,128千円)の投資信託財産総額(311,117,801千円)に対する比率は98.3%です。
(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル＝109.28円　1カナダドル＝80.99円　1メキシコペソ＝5.70円
1ユーロ＝122.03円　1イギリスポンド＝138.27円　1スウェーデンクローナ＝11.40円
1ノルウェークローネ＝12.53円　1デンマーククローネ＝16.33円　1ポーランドズロチ＝28.41円
1オーストラリアドル＝75.71円　1シンガポールドル＝79.23円　1マレーシアリンギット＝26.06円
1南アフリカランド＝7.44円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2019年5月29日現在
(A) 資産	**316,768,166,700円**
コール・ローン等	6,062,803,652
公社債(評価額)	302,675,300,831
未収入金	5,671,836,995
未収利息	1,887,631,380
前払費用	280,809,660
差入委託証拠金	189,784,182
(B) 負債	**5,773,897,648**
未払金	5,691,533,265
未払解約金	82,355,849
未払利息	8,534
(C) 純資産総額(A-B)	**310,994,269,052**
元本	113,640,718,674
次期繰越損益金	197,353,550,378
(D) 受益権総口数	**113,640,718,674口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**27,366円**

■損益の状況

項目	当期 自 2018年5月30日 至 2019年5月29日
(A) 配当等収益	**6,083,065,264円**
受取利息	6,085,923,267
その他収益金	514,575
支払利息	△3,372,578
(B) 有価証券売買損益	**375,300,152**
売買益	9,444,360,929
売買損	△9,069,060,777
(C) 先物取引等取引損益	**90,492,939**
取引益	150,061,034
取引損	△59,568,095
(D) その他費用	**△62,888,251**
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	**6,485,970,104**
(F) 前期繰越損益金	**152,184,417,773**
(G) 追加信託差損益金	**68,122,226,392**
(H) 解約差損益金	**△29,439,063,891**
(I) 計(E+F+G+H)	**197,353,550,378**
次期繰越損益金(I)	**197,353,550,378**

(注1)(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2)(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3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は91,572,244,683円、期中追加設定元本額は39,298,782,952円、期中一部解約元本額は17,230,308,961円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	24,338,072,816円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	18,268,179,033円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,195,408,600円
世界経済インデックスファンド	6,438,759,500円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,171,800,625円
DC世界経済インデックスファンド	5,544,537,866円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,735,282,821円
分散投資コア戦略ファンドS	3,000,534,200円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,521,152,643円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,248,451,046円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,217,320,594円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,982,891,197円
DC外国債券インデックス・オープン	1,836,436,970円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,815,828,601円
DCマイセレクション25	1,644,361,599円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,410,439,035円
DCマイセレクション50	1,254,443,351円
分散投資コア戦略ファンドA	1,207,277,596円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,058,693,302円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,016,863,803円
グローバル経済コア	1,002,336,893円
コア投資戦略ファンド(切替型)	996,068,803円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	893,136,284円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	892,100,259円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	843,186,808円
DCマイセレクション75	803,453,814円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	783,998,368円
グローバル・インカム＆プラス(毎月決算型)	738,750,016円
DCマイセレクションS25	666,161,818円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	644,047,764円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	623,067,125円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	608,566,203円
DCマイセレクションS50	516,809,351円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	502,191,647円
外国債券ファンド・シリーズ1	471,416,612円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	465,091,641円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	351,315,026円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	301,305,087円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	243,325,679円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	240,483,525円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	236,312,844円
SMT インデックスバランス・オープン	235,004,251円
DCマイセレクションS75	231,429,235円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	195,292,469円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	176,065,033円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	160,503,540円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	128,309,009円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	119,562,491円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	110,361,602円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	90,733,582円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	86,840,942円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	64,546,300円

外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	60,194,673円
SMT 世界経済インデックス・オープン	56,921,557円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	50,078,318円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	43,217,177円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	38,253,498円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	30,773,520円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	13,763,872円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,899,457円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	5,068,451円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,882,570円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,887,912円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,118,137円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	51,141円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	32,515円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,638円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	22,219円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	16,800円

お知らせ

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。
なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。
このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。