ＪＰ４資産均等バランス

運用報告書（全体版）

第３期（決算日　2020年７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資産均等バランス」は、2020年７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10月18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	
	25%	25%	25%	25%	
主な投資対象	ＪＰ４資産均等バランス	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75%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資産均等バランス…………………………………… 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）‥‥ 59

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）‥‥ 93

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）‥‥138

【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10月18日	10,000	－	－	10,000	－	－	1
1期(2018年7月17日)	10,263	0	2.6	10,228	2.3	98.8	478
2期(2019年7月16日)	10,226	0	△0.4	10,149	△0.8	99.0	2,156
3期(2020年7月15日)	10,617	0	3.8	10,403	2.5	99.4	4,521

(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

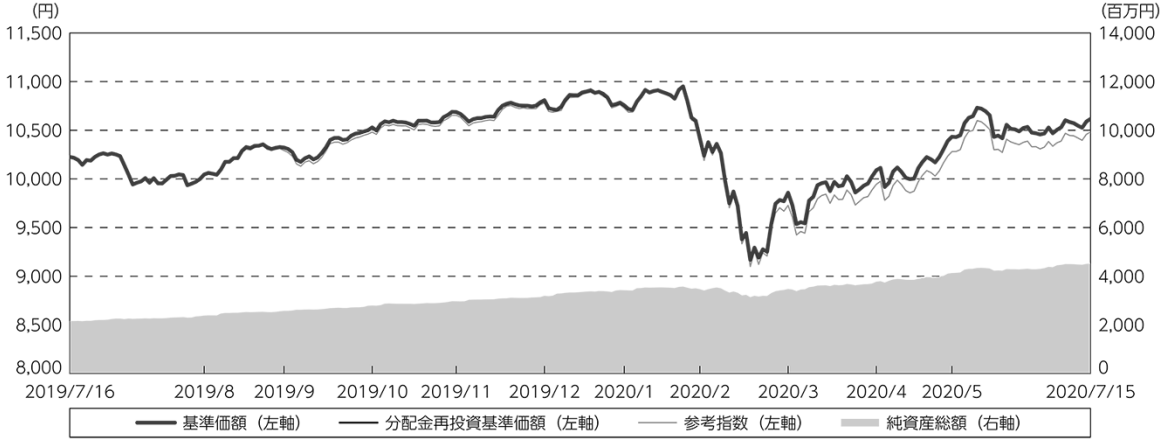
年月日	基準価額		参考指数		投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率	
(期　首)	円	%		%	%
2019年7月16日	10,226	－	10,149	－	99.0
7月末	10,251	0.2	10,172	0.2	97.9
8月末	10,045	△1.8	9,970	△1.8	98.9
9月末	10,322	0.9	10,215	0.6	98.2
10月末	10,529	3.0	10,402	2.5	98.7
11月末	10,687	4.5	10,574	4.2	99.1
12月末	10,809	5.7	10,698	5.4	97.9
2020年1月末	10,756	5.2	10,646	4.9	99.3
2月末	10,417	1.9	10,312	1.6	98.4
3月末	9,858	△3.6	9,654	△4.9	99.0
4月末	10,089	△1.3	9,870	△2.8	98.1
5月末	10,433	2.0	10,203	0.5	98.7
6月末	10,467	2.4	10,249	1.0	98.7
(期　末)					
2020年7月15日	10,617	3.8	10,403	2.5	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2019年７月17日～2020年７月15日）

期中の基準価額等の推移



期　首：10,226円
期　末：10,617円（既払分配金(税込み)：０円）
騰落率：　3.8%（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７月16日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
（注）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10,226円から期末10,617円となり、値上がり額は391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、海外債券、海外株式、日本株式が上昇した一方で、日本債券が下落しました。海外債券、海外株式、日本株式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、日本債券市場は利回りが上昇（価格が下落）しました。2019年7月中旬から8月下旬は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。1月下旬から3月上旬は新型コロナウイルスの感染拡大への警戒感からリスク回避の動きが優勢となったことなどを受けて債券が買われ、10年国債利回りは一時△0.19％まで低下しました。3月中旬は新型コロナウイルスの感染拡大によって世界的に財政拡張的な景気対策が実施されるとの見方などから債券が売られ、10年国債利回りは一時0.12％まで上昇しましたが、4月下旬にかけて新型コロナウイルスの感染拡大による経済への悪影響が懸念されるなどして債券が買われました。5月上旬から7月中旬は欧米の経済活動の再開や国債増発に伴う需給悪化懸念などを受けて債券の売りが優勢となりました。
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。1月下旬から3月中旬は新型コロナウイルスの感染拡大によって世界景気や企業業績が悪化するとの懸念が強まったことなどを嫌気して大幅に下落し、日経平均株価は16,000円台まで下落しました。3月下旬から6月上旬は日銀による金融緩和の強化や欧米の経済活動の再開、日本で緊急事態宣言が全面的に解除されたことなどを好感して大幅に上昇し、日経平均株価は23,000円台を回復しました。6月中旬から7月中旬は新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒感や米雇用統計が改善したことなどを受けて一進一退の展開となりました。
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7月中旬から8月下旬は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12月下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1.9％台まで上昇しました。2020年1月上旬から3月上旬は新型コロナウイルスの感染拡大への警戒感からリスク回避の動きが優勢となったことなどを受けて債券が買われ、米国10年国債利回りは一時0.3％台まで低下しました。3月中旬は世界の中央銀行による相次ぐ金融緩和策による景気回復期待から債券が売られ、米国10年国債利回りは一時1.2％台まで上昇しましたが、下旬には新型コロナウイルスの感染拡大で外出を制限する動きが世界的に広がり景気減速懸念が高まるなどし、債券が買い戻されました。4月上旬から7月中旬は欧米の経済活動の再開やFRB（米連邦準備制度理事会）のゼロ金利政策が長期化するとの見方などから一進一退の展開となりました。

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7月中旬から8月下旬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（欧州中央銀行）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2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。2月下旬から3月中旬は新型コロナウイルスの感染拡大によって世界景気や企業業績が悪化するとの懸念が強まったことなどを嫌気して大幅に下落しました。3月下旬にNYダウは18,000ドル台まで下落する場面がありましたが、6月上旬にかけてFRBの経済支援策や欧米の経済活動の再開などを好感して大幅に上昇し、NYダウは27,000ドル台まで上昇する場面がありました。6月中旬にはFRBが慎重な景気見通しを示したことなどから下落しましたが、7月中旬にかけて米雇用統計が改善したことなどを受けて株式の買いが優勢となりました。ナスダック総合指数は一時10,800ポイント台まで上昇し過去最高値を更新しました。

当ファンドのポートフォリオ

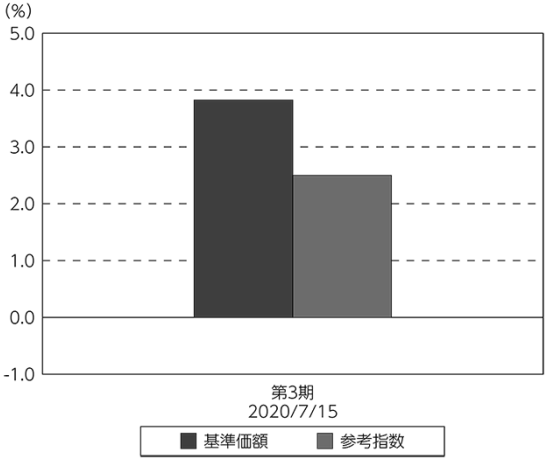
組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、当ファンドの追加解約に伴う売買に対応した日々のリバランスや、乖離が大きくなった際には臨時のリバランスを行うことなどにより、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

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７月17日～ 2020年７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	771

（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７月17日～2020年７月15日）

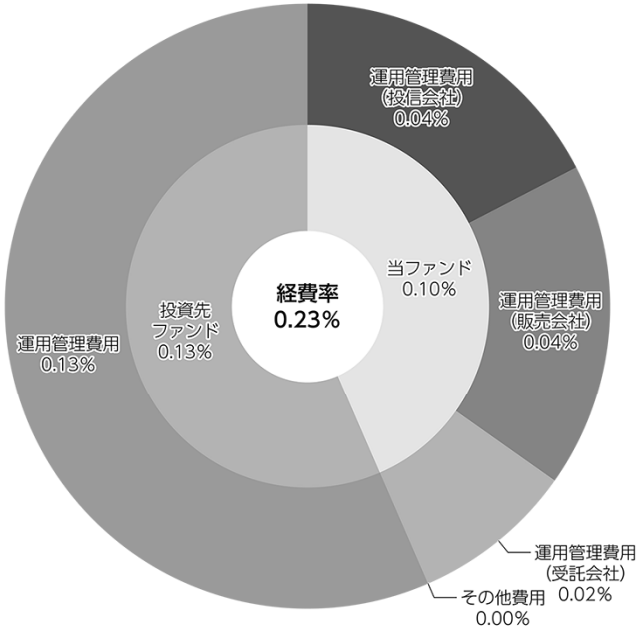
項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	11	0.107	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(4)	(0.043)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(4)	(0.042)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	0	0.004	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.004)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合計	11	0.111	
期中の平均基準価額は、10,388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0.23％です。



（単位：％）

経費率(①＋②)	**0.23**
①当ファンドの費用の比率	0.10
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７月17日～2020年７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)	440,730,437	576,827	32,644,939	46,160
	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)	671,019,110	679,935	80,414,852	81,310
	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)	560,092,000	622,760	28,201,992	32,880
	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)	636,606,470	601,166	60,927,997	57,120
合計		2,308,448,017	2,480,688	202,189,780	217,470

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2019年７月17日～2020年７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７月17日～2020年７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７月17日～2020年７月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年７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)	381,682,262	789,767,760	1,131,105	25.0
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)	522,504,299	1,113,108,557	1,114,110	24.6
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)	473,171,515	1,005,061,523	1,129,287	25.0
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)	574,172,426	1,149,850,899	1,117,885	24.7
合計	1,951,530,502	4,057,788,739	4,492,387	99.4

(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７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	4,492,387	99.2
コール・ローン等、その他	36,334	0.8
投資信託財産総額	4,528,721	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７月15日現在)

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,528,721,381
コール・ローン等	36,333,471
投資信託受益証券(評価額)	4,492,387,910
(B) 負債	7,291,061
未払解約金	5,160,490
未払信託報酬	1,989,567
未払利息	99
その他未払費用	140,905
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	4,521,430,320
元本	4,258,642,053
次期繰越損益金	262,788,267
(D) 受益権総口数	4,258,642,053口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,617円

(注) 当ファンドの期首元本額は2,108,850,979円、期中追加設定元本額は2,588,358,820円、期中一部解約元本額は438,567,746円です。

(注) １口当たり純資産額は1.0617円です。

○損益の状況 (2019年７月17日～2020年７月15日)

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	53,037,783
受取配当金	53,074,341
支払利息	△ 36,558
(B) 有価証券売買損益	91,038,420
売買益	117,468,655
売買損	△ 26,430,235
(C) 信託報酬等	△ 3,568,851
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	140,507,352
(E) 前期繰越損益金	30,339,055
(F) 追加信託差損益金	91,941,860
(配当等相当額)	(157,731,055)
(売買損益相当額)	(△ 65,789,195)
(G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ)	262,788,267
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ)	262,788,267
追加信託差損益金	91,941,860
(配当等相当額)	(157,731,055)
(売買損益相当額)	(△ 65,789,195)
分配準備積立金	170,846,407

(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７月17日～2020年７月15日) は以下の通りです。

項　　目	2019年７月17日～ 2020年７月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	51,724,089円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	88,783,263円
c. 信託約款に定める収益調整金	157,731,055円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	30,339,055円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	328,577,462円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	771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７月17日から2020年７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）	25%
日本債券	NOMURA-BPI総合	25%
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）	25%
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）	25%

＊「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23期(決算日　2020年3月9日)
第24期(決算日　2020年5月7日)
第25期(決算日　2020年7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。

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

ホームページ　https://www.smtam.jp/

■口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
■当運用報告書についてのお問い合わせ
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。)

＜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
第9	第23期(2020年 3月9日)	9,973	2	△19.4	9,877	△19.5	98.7	1.3	62,196
	第24期(2020年 5月7日)	10,244	125	4.0	10,145	2.7	98.6	2.2	69,182
	第25期(2020年 7月7日)	11,283	15	10.3	11,176	10.2	98.6	0.9	74,337

(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。

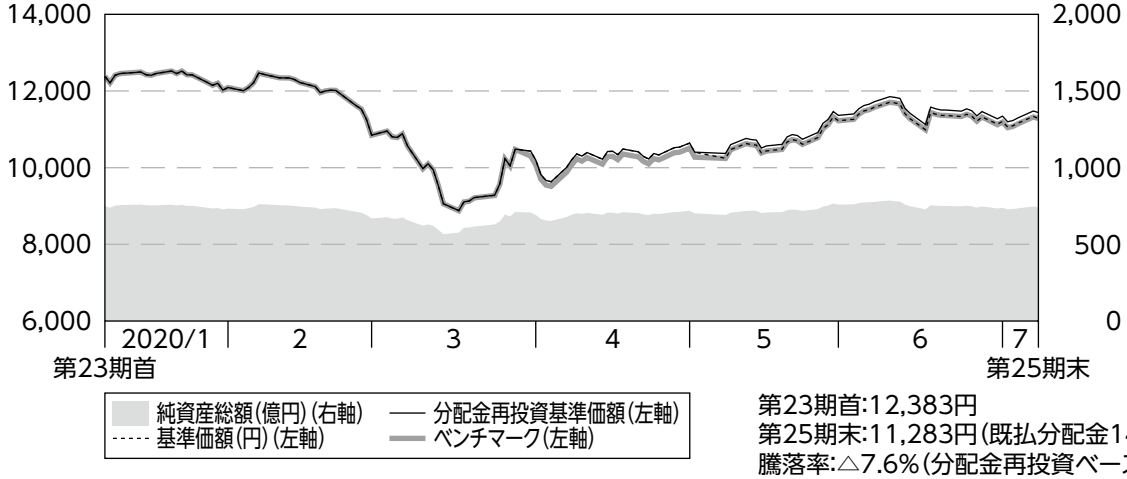
当作成期中の基準価額と市況の推移

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23期	(期　首)2020年1月7日	12,383	－	12,267	－	99.0	1.0
	1月末	12,091	△2.4	11,978	△2.4	98.7	1.3
	2月末	10,848	△12.4	10,744	△12.4	98.5	1.5
	(期　末)2020年3月9日	9,975	△19.4	9,877	△19.5	98.7	1.3
第24期	(期　首)2020年3月9日	9,973	－	9,877	－	98.7	1.3
	3月末	10,199	2.3	9,977	1.0	97.3	2.6
	4月末	10,640	6.7	10,411	5.4	97.8	2.1
	(期　末)2020年5月7日	10,369	4.0	10,145	2.7	98.6	2.2
第25期	(期　首)2020年5月7日	10,244	－	10,145	－	98.6	2.2
	5月末	11,225	9.6	11,119	9.6	96.9	1.7
	6月末	11,205	9.4	11,084	9.3	98.7	1.2
	(期　末)2020年7月7日	11,298	10.3	11,176	10.2	98.6	0.9

(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



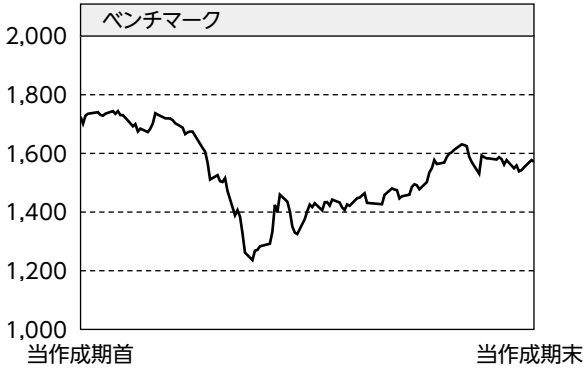
第23期首:12,383円
第25期末:11,283円(既払分配金142円)
騰落率:△7.6%(分配金再投資ベース)

(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、2020年1月7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下落しました。

投資環境



国内株式市場は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による景気や企業業績の減速懸念、原油価格の急落、東京五輪の開催にかかる先行き不透明感などから、2月下旬から大幅に下落しました。その後は、各国の大型経済対策や金融緩和策が好感されたこと、経済活動再開への期待感などから下落幅を縮小しました。5月下旬に、国内で緊急事態宣言が全面解除になったことなどが好感され上昇しましたが、新型コロナウイルス感染第2波への警戒感から、上値の重い展開が続きました。

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。

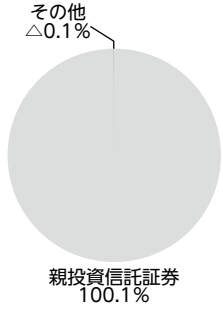
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

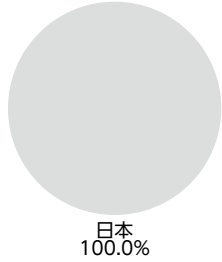
	当作成期末
	2020年7月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

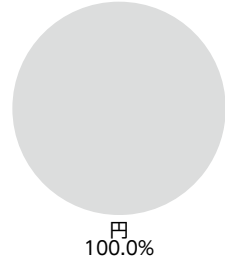
○資産別配分



○国別配分



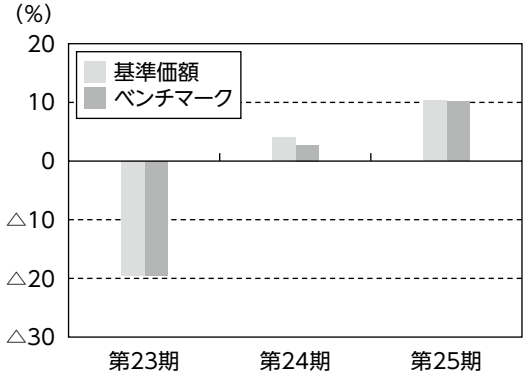
○通貨別配分



(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23期 2020年1月8日～ 2020年3月9日	第24期 2020年3月10日～ 2020年5月7日	第25期 2020年5月8日～ 2020年7月7日
当期分配金	（円）	2	125	15
（対基準価額比率）	（％）	(0.020)	(1.206)	(0.133)
当期の収益	（円）	2	123	15
当期の収益以外	（円）	－	1	－
翌期繰越分配対象額	（円）	4,054	4,055	4,055

（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 (2020年1月8日~2020年7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11,034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)	(−)	(−)	
(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	6,568,628	8,469,953	3,139,288	4,614,090

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	63,713,330千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	297,795,811千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.21

(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	8	8	100.0	8	8	100.0
コール・ローン	9,133	1,585	17.4	9,180	1,571	17.1

(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。

＜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	735	735	100.0	735	735	100.0
コール・ローン	451,255	73,094	16.2	456,291	72,542	15.9

〈平均保有割合　23.6%〉
(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	119百万円	52百万円	815百万円

(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	46,636,985	50,066,325	74,398,559

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、218,567,352千口です。

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	74,398,559	99.9
コール・ローン等、その他	57,652	0.1
投資信託財産総額	74,456,211	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 23 期 末 2020年3月9日現在	第 24 期 末 2020年5月7日現在	第 25 期 末 2020年7月7日現在
(A)資産	**62,224,162,217円**	**70,058,260,631円**	**74,456,211,340円**
コール・ローン等	48,269,064	47,360,030	57,651,496
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	62,175,893,153	69,991,685,459	74,398,559,844
未収入金	—	19,215,123	—
未収利息	—	19	—
(B)負債	**27,792,571**	**875,602,295**	**119,133,170**
未払収益分配金	12,473,135	844,149,081	98,827,311
未払解約金	—	18,000,000	4,999,999
未払信託報酬	14,999,630	13,153,423	14,989,476
未払利息	104	—	50
その他未払費用	319,702	299,791	316,334
(C)純資産総額(A-B)	**62,196,369,646**	**69,182,658,336**	**74,337,078,170**
元本	62,365,679,565	67,531,926,553	65,884,874,187
次期繰越損益金	△169,309,919	1,650,731,783	8,452,203,983
(D)受益権総口数	**62,365,679,565口**	**67,531,926,553口**	**65,884,874,187口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**9,973円**	**10,244円**	**11,283円**

■損益の状況

項目	第 23 期 自 2020年1月8日 至 2020年3月9日	第 24 期 自 2020年3月10日 至 2020年5月 7日	第 25 期 自 2020年5月8日 至 2020年7月7日
(A)配当等収益	**△3,685円**	**△4,526円**	**△9,185円**
受取利息	34	60	74
支払利息	△3,719	△4,586	△9,259
(B)有価証券売買損益	**△14,818,052,809**	**3,198,985,443**	**6,931,021,192**
売買益	4,282,318	3,230,461,329	7,161,189,980
売買損	△14,822,335,127	△31,475,886	△230,168,788
(C)信託報酬等	**△15,319,332**	**△13,453,214**	**△15,305,810**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△14,833,375,826**	**3,185,527,703**	**6,915,706,197**
(E)前期繰越損益金	**3,447,336,639**	**△11,330,950,021**	**△8,710,730,729**
(F)追加信託差損益金	**11,229,202,403**	**10,640,303,182**	**10,346,055,826**
(配当等相当額)	(21,831,902,332)	(23,947,520,726)	(23,398,637,559)
(売買損益相当額)	(△10,602,699,929)	(△13,307,217,544)	(△13,052,581,733)
(G)計(D+E+F)	**△156,836,784**	**2,494,880,864**	**8,551,031,294**
(H)収益分配金	**△12,473,135**	**△844,149,081**	**△98,827,311**
次期繰越損益金(G+H)	**△169,309,919**	**1,650,731,783**	**8,452,203,983**
追加信託差損益金	11,229,202,403	10,640,303,182	10,346,055,826
(配当等相当額)	(21,832,221,467)	(23,960,297,168)	(23,398,634,325)
(売買損益相当額)	(△10,603,019,064)	(△13,319,993,986)	(△13,052,578,499)
分配準備積立金	3,456,382,222	3,426,643,229	3,322,759,848
繰越損益金	△14,854,894,544	△12,416,214,628	△5,216,611,691

(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23期首元本額は60,497,097,818円、第23～25期中追加設定元本額は8,623,404,711円、第23～25期中一部解約元本額は3,235,628,342円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　23　期	第　24　期	第　25　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	21,518,718円	834,897,070円	101,232,372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	21,832,221,467円	23,960,297,168円	23,398,634,325円
(D) 分配準備積立金額	3,447,336,639円	3,435,895,240円	3,320,354,787円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	25,301,076,824円	28,231,089,478円	26,820,221,484円
(F) 期末残存口数	62,365,679,565口	67,531,926,553口	65,884,874,187口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	4,056円	4,180円	4,070円
(H) 分配金額(1万口当たり)	2円	125円	15円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	12,473,135円	844,149,081円	98,827,311円

分配金のお知らせ

	第23期	第24期	第25期
1万口当たり分配金	2円	125円	15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20期（決算日　2020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
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7	313,448

(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

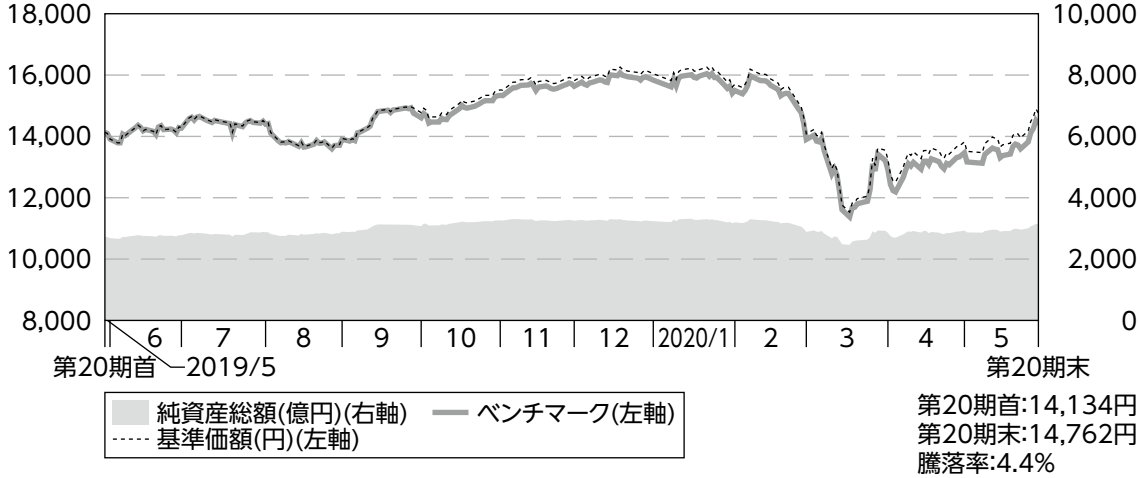
年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(当期首) 2019年 5月29日	14,134	－	1,536.41	－	97.8	2.2
5月末	13,912	△1.6	1,512.28	△1.6	98.0	2.1
6月末	14,292	1.1	1,551.14	1.0	98.7	1.5
7月末	14,422	2.0	1,565.14	1.9	99.0	1.0
8月末	13,935	△1.4	1,511.86	△1.6	98.9	1.1
9月末	14,775	4.5	1,587.80	3.3	98.2	1.9
10月末	15,514	9.8	1,667.01	8.5	97.9	1.9
11月末	15,816	11.9	1,699.36	10.6	98.2	1.8
12月末	16,044	13.5	1,721.36	12.0	98.9	1.1
2020年 1月末	15,701	11.1	1,684.44	9.6	98.7	1.3
2月末	14,087	△0.3	1,510.87	△1.7	98.5	1.5
3月末	13,248	△6.3	1,403.04	△8.7	97.3	2.6
4月末	13,822	△2.2	1,464.03	△4.7	97.9	2.1
(当期末) 2020年 5月29日	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7

(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



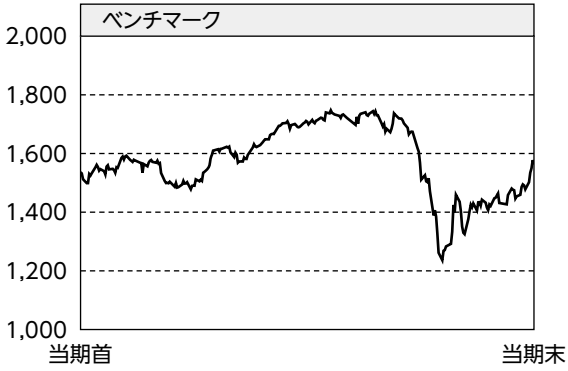
第20期首:14,134円
第20期末:14,762円
騰落率:4.4%

(注)ベンチマークは、2019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、期首と比べて上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。
期初から年末までは、米中通商協議の進展や企業業績の改善期待などから、国内株式市場は上昇しました。年明け以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、経済活動の停滞による企業業績への影響が懸念されたこと、原油価格が急落したことなどから3月中旬にかけて大きく下落しました。4月は各国の金融緩和政策や大規模な経済対策が打ち出されたこと、欧米での経済活動再開の動きなどを背景に反発し、期末にかけては国内で緊急事態宣言が全面解除になったことなどから、上昇しました。

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。

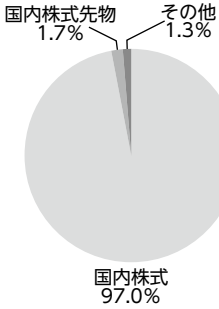
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

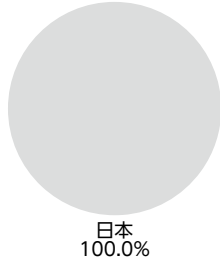
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.3%
2	ソニー	日本	1.9%
3	キーエンス	日本	1.8%
4	東証株価指数先物　2006	日本	1.7%
5	ソフトバンクグループ	日本	1.7%
6	武田薬品工業	日本	1.5%
7	日本電信電話	日本	1.4%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	第一三共	日本	1.3%
10	任天堂	日本	1.2%
組入銘柄数		2,104	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

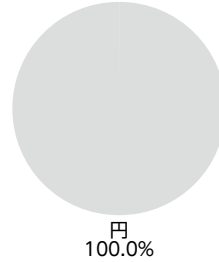
○資産別配分



○国別配分



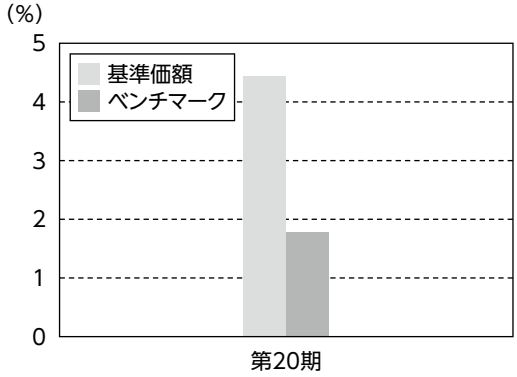
○通貨別配分



（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1.7%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（2019年5月30日～2020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）	(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)	
(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（14,630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	44,017 (2,402)	77,573,825 (－)	24,490	48,238,316

(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	－ (225,900)	－ (－)	187,800	562

(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	48,977	49,910	－	－

(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	125,812,141千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	295,160,588千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.42

(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	998	998	100.0	276	276	100.0
コール・ローン	867,507	151,128	17.4	868,693	152,069	17.5

(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	221百万円	144百万円	818百万円

(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	5.3	6.6	17,787
日本水産	164	188	93,812
マルハニチロ	23.7	27.2	63,403
カネコ種苗	5	5.7	8,128
サカタのタネ	20	22.4	82,880
ホクト	13.8	14.3	28,700
ホクリョウ	2.2	2.9	1,899
鉱業(0.2%)			
住石ホールディングス	35.2	38	4,332
日鉄鉱業	3.8	4.3	19,694
三井松島ホールディングス	6.9	7.3	6,336
国際石油開発帝石	658	754.3	566,403
石油資源開発	23.6	24.6	49,790
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	8	9.1	14,177
建設業(2.6%)			
ヒノキヤグループ	4.6	4.7	7,755
ショーボンドホールディングス	11.7	29.3	146,060
ミライト・ホールディングス	46.1	55.9	86,030
タマホーム	7.9	10.1	13,170
サンヨーホームズ	2.4	1.6	1,016
日本アクア	5.2	7.5	4,567
ファーストコーポレーション	5	5.7	3,060
ベステラ	3.1	3.2	3,260
ＴＡＴＥＲＵ	14.2	38.8	6,440
キャンディル	－	3.1	1,692
スペースバリューホールディングス	19.9	22.9	8,106
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.6	3,589
第一カッター興業	2	2.3	4,261
明豊ファシリティワークス	－	6	3,426
安藤・間	105.9	112	78,064
東急建設	48.6	55.1	32,398
コムシスホールディングス	58.2	66.7	200,100
ミサワホーム	13.6	－	－
ビーアールホールディングス	17.8	20.5	11,890
高松コンストラクショングループ	10.4	11.7	29,987
東建コーポレーション	5.1	5.8	42,862
ソネック	1.7	1.9	1,548
ヤマウラ	7	8.2	6,674
大成建設	134.8	144.8	541,552
大林組	406.3	434.2	432,897
清水建設	414.5	440.7	401,918
飛島建設	12	12.5	13,937
長谷工コーポレーション	169.7	168.1	220,715
松井建設	15.7	17.1	10,602
錢高組	1.7	1.9	6,916
鹿島建設	317.5	340.9	416,579
不動テトラ	9.7	11.3	16,012
大末建設	5.4	5	3,900
鉄建建設	8.4	9.4	20,896
西松建設	29.4	33.5	70,618
三井住友建設	95.8	104.9	47,519
大豊建設	9.4	9.7	24,298
前田建設工業	97.1	108.8	91,936
佐田建設	10.2	9.3	3,822
ナカノフドー建設	11.5	11.9	4,605
奥村組	22.4	23.6	61,360
東鉄工業	16.2	18.6	53,512
イチケン	2.8	3.1	4,665
富士ピー・エス	5.6	6.4	3,628
淺沼組	5	4.9	20,727
戸田建設	158.2	180.3	119,719
熊谷組	19.5	20.1	52,923
青木あすなろ建設	7.3	－	－
北野建設	3	2.6	6,845
植木組	1.9	1.9	4,683
矢作建設工業	18.3	19.2	14,803
ピーエス三菱	15	14.3	7,907
日本ハウスホールディングス	25.7	29.6	9,324
大東建託	48.2	47.4	539,649
新日本建設	16.7	18.5	13,949
ＮＩＰＰＯ	35.8	35.9	96,032
東亜道路工業	2.5	2.7	8,788
前田道路	42.4	38.3	76,944
日本道路	3.7	4.2	29,820
東亜建設工業	9.7	13.5	22,207
日本国土開発	22	42.2	23,252
若築建設	6.8	7.8	9,016
東洋建設	49.3	48.7	20,892
五洋建設	160.9	172.1	96,720
世紀東急工業	19.6	20.8	16,681
福田組	4.5	5	24,425
住友林業	96.3	110	150,810
日本基礎技術	13.8	14.6	6,161
巴コーポレーション	18.5	19.3	7,102
大和ハウス工業	374.9	429.6	1,148,965

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)
ライト工業	26	24.8	36,257
積水ハウス	414.7	470.9	966,522
日特建設	11.5	11.3	8,203
北陸電気工事	6.5	7.5	7,020
ユアテック	21.6	24.8	15,648
日本リーテック	－	9.1	18,891
四電工	2.1	2.4	5,616
中電工	17.4	17.5	40,512
関電工	61.6	61.8	60,811
きんでん	90	103.2	186,069
東京エネシス	14	14.4	10,742
トーエネック	3.8	4.4	17,160
住友電設	9.4	12.3	30,786
日本電設工業	23.1	23.8	56,715
協和エクシオ	53	65.8	162,789
新日本空調	11.7	11.5	29,175
九電工	26.7	30.5	91,286
三機工業	31	31.3	42,974
日揮ホールディングス	117	133.7	154,958
中外炉工業	4.1	4.7	7,477
ヤマト	13.3	13.9	9,201
太平電業	9.2	10.5	24,874
高砂熱学工業	33.2	37.7	68,991
三晃金属工業	1.9	1.9	3,912
朝日工業社	3	2.9	8,990
明星工業	24.4	28.1	21,243
大氣社	18.6	21.1	71,001
ダイダン	9.3	10.4	30,108
日比谷総合設備	12.2	14	27,468
東芝プラントシステム	29.6	－	－
フィル・カンパニー	－	2.5	7,762
ＯＳＪＢホールディングス	59.7	68.5	16,988
東洋エンジニアリング	10.1	18.2	7,352
レイズネクスト	24.3	23.3	29,870
食料品(4.0%)			
日本製粉	38.4	40.7	66,422
日清製粉グループ本社	136.9	157	263,603
日東富士製粉	0.9	1	6,130
昭和産業	11.1	12.8	42,176
鳥越製粉	10.7	12.3	11,033
中部飼料	14.8	17	28,339
フィード・ワン	81	93.3	17,353
東洋精糖	1.8	2.3	2,877
日本甜菜製糖	6.9	7.2	12,175
三井製糖	9.6	12.2	25,412
塩水港精糖	13.1	15	3,150
日新製糖	5.7	6.6	12,889
森永製菓	30.5	32.6	150,775

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)
中村屋	3.1	3.6	14,634
江崎グリコ	36.4	41.2	214,652
名糖産業	5.8	6.7	8,723
井村屋グループ	5.2	7.9	16,163
不二家	6.8	7.8	16,941
山崎製パン	99.1	104.2	201,210
第一屋製パン	2.1	2.4	2,287
モロゾフ	2.1	2.4	14,304
亀田製菓	7.5	7.9	42,818
寿スピリッツ	12.8	13.4	70,350
カルビー	55.2	63.3	197,179
森永乳業	24.3	25.7	116,421
六甲バター	8.8	9.2	14,646
ヤクルト本社	89.8	95.6	630,960
明治ホールディングス	85.9	91.9	745,309
雪印メグミルク	29.2	33.5	88,607
プリマハム	17	21.7	57,266
日本ハム	50.2	53.1	211,338
林兼産業	4	4.6	2,658
丸大食品	12.9	14.8	28,786
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	10.9	11.1	28,338
柿安本店	－	4.8	12,566
伊藤ハム米久ホールディングス	78	89.5	59,965
サッポロホールディングス	44.3	47.4	102,147
アサヒグループホールディングス	253.8	291	1,180,878
キリンホールディングス	548.3	589.4	1,301,100
宝ホールディングス	90.8	103	89,507
オエノンホールディングス	34.3	36.7	14,496
養命酒製造	3.7	4.3	8,105
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	92.8	97.5	208,650
サントリー食品インターナショナル	81.1	93	409,200
ダイドーグループホールディングス	6.8	7.1	37,488
伊藤園	36.8	42.2	260,796
キーコーヒー	11.9	13.7	32,208
ユニカフェ	3.3	3.6	3,470
ジャパンフーズ	1.7	2	2,376
日清オイリオグループ	15.6	17.9	61,576
不二製油グループ本社	29.6	33.9	98,004
かどや製油	1.3	1.5	5,572
Ｊ－オイルミルズ	6.3	7.2	31,140
キッコーマン	80	100	542,000
味の素	267.7	306.9	563,775
キユーピー	67.5	77.4	163,236
ハウス食品グループ本社	45.3	52	189,540
カゴメ	48.6	52.7	159,944
焼津水産化学工業	5.9	6.7	6,204
アリアケジャパン	11.1	12.7	94,996
ピエトロ	1.6	1.8	2,901

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)
エバラ食品工業	2.9	3.4	7,490
やまみ	－	1.2	2,766
ニチレイ	63	66.2	200,917
東洋水産	62.4	71.5	402,545
イートアンド	4.2	4.8	8,587
大冷	1.4	1.8	3,520
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3.3	7.7	8,993
日清食品ホールディングス	51.5	59.1	531,900
永谷園ホールディングス	6.5	6.8	14,980
一正蒲鉾	4.7	5.4	5,340
フジッコ	13.1	15	29,865
ロック・フィールド	13.1	15	20,910
日本たばこ産業	699.9	802.4	1,715,130
ケンコーマヨネーズ	6.8	7.8	16,723
わらべや日洋ホールディングス	7.9	9.1	15,970
なとり	6.8	7.8	13,657
イフジ産業	2.1	2.4	1,924
ピックルスコーポレーション	2.9	3	6,897
北の達人コーポレーション	47.6	48.5	25,268
ユーグレナ	51.7	59.9	44,565
ミヨシ油脂	4.6	5.3	6,163
理研ビタミン	5.7	13.1	29,606
繊維製品(0.5%)			
片倉工業	14.6	20.1	24,321
グンゼ	8	10.1	38,733
東洋紡	50.2	53.9	81,335
ユニチカ	34.7	41	14,514
富士紡ホールディングス	6.2	6.7	21,607
倉敷紡績	11.3	13.7	33,236
シキボウ	6.2	7.1	7,518
日本毛織	39	45.1	45,370
トーア紡コーポレーション	5	5.4	2,770
ダイドーリミテッド	14.4	－	－
帝国繊維	13.3	15.5	35,495
帝人	96.5	110.9	195,627
東レ	917.7	982.7	514,836
サカイオーベックス	3	3.8	8,230
住江織物	3.5	3	5,790
日本フエルト	6.9	8.6	4,110
イチカワ	1.8	2.3	3,153
日東製網	1.4	1.6	2,289
アツギ	9.9	11.3	6,983
ダイニック	4.8	5.1	3,937
セーレン	29.2	33.7	45,023
ソトー	4.8	5.5	5,274
東海染工	1.7	2	2,234
小松マテーレ	19.6	22.4	16,598
ワコールホールディングス	34.5	35.4	78,977

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)
ホギメディカル	14.7	15.5	54,715
レナウン	34	－	－
クラウディアホールディングス	3.1	3.6	1,551
ＴＳＩホールディングス	43.8	45.7	21,113
マツオカコーポレーション	3.8	3.9	9,426
ワールド	15.5	19.3	30,243
三陽商会	7.2	7.2	6,523
ナイガイ	4.5	5.2	1,872
オンワードホールディングス	71.3	81.7	30,229
ルックホールディングス	4.4	4.7	4,037
ゴールドウイン	10.7	24.6	169,494
デサント	28.9	26.5	42,479
キング	6.4	6.6	3,399
ヤマトインターナショナル	7.8	12.2	4,318
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	7.5	8.6	37,238
王子ホールディングス	532.5	566.9	306,692
日本製紙	56.7	60	95,460
三菱製紙	19.2	15.4	5,852
北越コーポレーション	78.5	80.8	32,804
中越パルプ工業	5	5.7	8,396
巴川製紙所	3.9	4	3,528
大王製紙	57.6	59.8	87,128
阿波製紙	3	3.5	1,928
レンゴー	122	128.2	109,226
トーモク	7.3	8.3	14,292
ザ・パック	9	10.3	32,136
化学(7.2%)			
クラレ	199.6	213.6	241,795
旭化成	841.5	898.8	763,980
共和レザー	7.4	7.4	4,995
昭和電工	78.6	96.5	248,487
住友化学	931.1	996.3	332,764
住友精化	5.8	6	18,240
日産化学	72.6	75.3	358,051
ラサ工業	4.2	4.8	7,123
クレハ	10.9	11.6	55,042
多木化学	3.5	5.3	38,160
テイカ	9.6	9.9	15,592
石原産業	22.7	24.3	18,516
片倉コープアグリ	3.4	3.5	4,189
日東エフシー	7.4	－	－
日本曹達	18.7	20.1	60,119
東ソー	182.8	209.6	313,980
トクヤマ	34.1	39.1	100,721
セントラル硝子	25.8	27.7	54,402
東亜合成	74.2	85.1	87,738
大阪ソーダ	12.7	13.8	36,156

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)
関東電化工業	27.9	32.2	29,913
デンカ	46.5	49.5	130,630
信越化学工業	208.4	232.8	2,937,936
日本カーバイド工業	4	4.6	6,536
堺化学工業	7.9	8.8	17,512
第一稀元素化学工業	12.8	14.7	11,598
エア・ウォーター	96.9	126.1	197,346
大陽日酸	97.4	130.3	236,103
日本化学工業	4	4.2	9,979
東邦アセチレン	1.8	2	2,564
日本パーカライジング	64.6	68.4	78,523
高圧ガス工業	18.7	21.5	16,598
チタン工業	1.5	1.7	3,197
四国化成工業	19.9	20.9	23,951
戸田工業	2.5	3.1	5,270
ステラ　ケミファ	6.9	7.4	19,617
保土谷化学工業	4.1	5.1	21,394
日本触媒	19.9	21	126,630
大日精化工業	9.8	12	29,940
カネカ	30.6	35.1	100,842
三菱瓦斯化学	121.6	126.2	202,424
三井化学	107.4	123.1	275,744
ＪＳＲ	118.7	126.4	266,956
東京応化工業	20.3	23.3	116,267
大阪有機化学工業	11	12.5	23,437
三菱ケミカルホールディングス	790.8	906.5	574,992
ＫＨネオケム	18	23.9	50,668
ダイセル	174.2	176.6	161,059
住友ベークライト	20.5	21.3	64,539
積水化学工業	258.5	291.6	438,858
日本ゼオン	106.7	122.3	126,825
アイカ工業	35.5	40.7	130,647
宇部興産	59.7	68.5	131,862
積水樹脂	19.5	24.4	57,803
タキロンシーアイ	25.5	29.3	21,564
旭有機材	8.2	7.7	11,719
日立化成	54.7	－	－
ニチバン	6.2	7.1	10,848
リケンテクノス	32.1	34.1	14,799
大倉工業	6.1	6.4	10,534
積水化成品工業	17.5	18.2	11,011
群栄化学工業	3	3.1	8,487
タイガースポリマー	6.3	7.1	3,315
ミライアル	3.5	4.8	6,196
ダイキアクシス	4.3	4.8	3,796
ダイキョーニシカワ	25	28.6	17,388
竹本容器	4.3	4.8	3,561
森六ホールディングス	6.4	7.3	11,680

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)
日本化薬	75.3	83.9	90,779
カーリットホールディングス	12.7	14.5	8,018
日本精化	9.5	10.9	16,088
扶桑化学工業	12	13.7	55,005
トリケミカル研究所	2.6	3	32,070
ＡＤＥＫＡ	58.3	62.4	93,537
日油	44.6	51.1	195,713
新日本理化	－	22.4	4,032
ハリマ化成グループ	9.8	11.2	11,144
花王	293.2	331.5	2,866,480
第一工業製薬	4.4	5.1	24,046
石原ケミカル	3	3.7	7,211
日華化学	4.1	4.6	4,324
ニイタカ	1.9	2.8	10,262
三洋化成工業	8	8.1	40,014
有機合成薬品工業	9.3	10.4	3,983
大日本塗料	13.4	15.3	15,055
日本ペイントホールディングス	97.6	111.9	840,369
関西ペイント	132.9	152.4	340,156
神東塗料	9.6	10.7	1,926
中国塗料	38.8	38.6	31,574
日本特殊塗料	8.9	10.1	9,120
藤倉化成	15.9	18.3	9,150
太陽ホールディングス	9.7	10	50,600
ＤＩＣ	53.5	57.3	161,070
サカタインクス	25.8	29.6	31,760
東洋インキＳＣホールディングス	25	28.7	59,724
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	9.2	10.5	8,379
富士フイルムホールディングス	250.9	265.5	1,322,455
資生堂	240	275.1	1,807,407
ライオン	168.3	180	443,700
高砂香料工業	8.3	8.7	21,523
マンダム	27.2	31.1	67,704
ミルボン	14.9	18.5	98,235
ファンケル	53.8	56	171,360
コーセー	20.5	26	350,740
コタ	6.4	8	9,632
シーボン	1.5	1.8	3,855
ポーラ・オルビスホールディングス	51.6	59.1	123,873
ノエビアホールディングス	11.5	11.7	56,394
アジュバンコスメジャパン	2.8	3.1	2,945
エステー	8.7	8.9	14,747
アグロ　カネショウ	4.9	5.8	8,497
コニシ	21.4	22.7	34,662
長谷川香料	16	23.9	56,977
星光ＰＭＣ	8.1	7.9	5,688
小林製薬	33.8	38.8	372,480
荒川化学工業	10.8	12.4	16,132

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)
メック	8.3	9.5	19,826
日本高純度化学	3.3	3.8	10,199
タカラバイオ	31.6	36.2	104,038
ＪＣＵ	15.7	16.8	54,600
新田ゼラチン	7.6	8.7	6,298
ＯＡＴアグリオ	1.7	2.4	2,733
デクセリアルズ	31.2	35.8	30,716
アース製薬	9.1	10.4	74,048
北興化学工業	12.3	14.2	8,676
大成ラミック	4	4.5	12,078
クミアイ化学工業	49.9	57.3	49,851
日本農薬	21.4	24.7	12,177
アキレス	8.8	9.5	16,102
有沢製作所	18.9	21.9	17,760
日東電工	83.3	95.5	556,765
レック	12.9	14.8	23,650
三光合成	13.9	15.8	5,024
きもと	20.9	23.5	3,689
藤森工業	10.9	12.4	43,586
前澤化成工業	8.3	8.8	9,160
未来工業	6.5	7.4	14,481
ウェーブロックホールディングス	3.4	4.8	3,758
ＪＳＰ	7.1	8.1	11,979
エフピコ	13.3	15.2	120,232
天馬	8.4	9.2	16,790
信越ポリマー	21.6	24.9	23,655
東リ	30.2	34.5	9,004
ニフコ	48.4	50.8	119,786
バルカー	9.8	11.2	23,307
ユニ・チャーム	256.1	266.9	1,070,269
ショーエイコーポレーション	1	2.1	1,852
医薬品(7.2%)			
協和キリン	141.7	139.3	407,034
武田薬品工業	1,054.4	1,152	4,828,032
アステラス製薬	1,113.5	1,200.5	2,298,357
大日本住友製薬	89.5	102.6	156,259
塩野義製薬	154.4	174.1	1,107,450
田辺三菱製薬	126.3	―	―
わかもと製薬	14.3	16.5	4,158
あすか製薬	14.9	15.8	18,644
日本新薬	31.6	36.2	335,936
ビオフェルミン製薬	2.1	2.4	5,481
中外製薬	125.9	144.4	2,294,516
科研製薬	21.8	23.7	140,304
エーザイ	144.6	165.7	1,398,176
ロート製薬	61.9	71.1	235,341
小野薬品工業	285.2	318	978,486
久光製薬	35.7	36.6	198,738
持田製薬	18.3	19.2	80,160
参天製薬	224.8	257.9	513,221
扶桑薬品工業	4.3	4.9	12,524
日本ケミファ	1.6	1.8	4,939
ツムラ	37.4	42.9	128,528
日医工	31.8	39.2	51,352
キッセイ薬品工業	21.4	24.5	66,885
生化学工業	23.4	26.9	30,854
栄研化学	21.2	24.3	44,833
日水製薬	5.1	5.8	7,302
鳥居薬品	6.5	8.7	28,231
ＪＣＲファーマ	8.5	9.8	121,226
東和薬品	17.4	17.7	40,125
富士製薬工業	8.2	9.4	11,674
沢井製薬	24.8	28.4	168,696
ゼリア新薬工業	23.9	25.1	53,337
第一三共	345.6	396.2	3,995,677
キョーリン製薬ホールディングス	26.6	30.6	71,328
大幸薬品	5.4	16.9	37,974
ダイト	7	8.4	36,624
大塚ホールディングス	230.1	263.8	1,283,123
大正製薬ホールディングス	27	29.3	200,412
ペプチドリーム	60.5	70.4	340,384
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	101.5	117	7,371
ニチレキ	15.4	16.3	27,139
ユシロ化学工業	6.3	7.8	9,633
ビーピー・カストロール	4.3	4.9	6,384
富士石油	29.2	37	6,845
ＭＯＲＥＳＣＯ	4.4	5	5,270
出光興産	139.4	153.7	367,343
ＪＸＴＧホールディングス	2,031.3	2,082.9	862,945
コスモエネルギーホールディングス	35	40.1	68,370
ゴム製品(0.6%)			
横浜ゴム	69.9	80.2	130,485
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	62	79.5	121,555
ブリヂストン	371.2	398.8	1,426,507
住友ゴム工業	108.5	124.4	136,342
藤倉コンポジット	10.5	12.1	4,634
オカモト	8.4	8.4	32,130
フコク	5.3	6.1	4,202
ニッタ	13.6	15.6	34,850
住友理工	23.3	26.8	16,991
三ツ星ベルト	15.9	18.2	29,793
バンドー化学	23	24.4	15,298
ガラス・土石製品(0.8%)			
日東紡績	18	20.6	121,540
ＡＧＣ	119.4	136.9	417,545

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)
日本板硝子	53	66.2	27,075
石塚硝子	2	2.5	5,387
日本山村硝子	5	5.8	4,912
日本電気硝子	52.3	55.6	94,964
オハラ	4.8	5.5	5,340
住友大阪セメント	24.4	26.2	99,298
太平洋セメント	76.3	87.5	222,862
日本ヒューム	12.1	13.9	10,355
日本コンクリート工業	26	29.9	8,162
三谷セキサン	5.6	6.5	33,540
アジアパイルホールディングス	17.1	19.7	9,101
東海カーボン	109.7	145.1	142,052
日本カーボン	5.8	7.1	24,282
東洋炭素	7.1	8.1	13,170
ノリタケカンパニーリミテド	7.2	7.7	28,259
ＴＯＴＯ	92.9	98.9	422,303
日本碍子	147.4	166.2	262,429
日本特殊陶業	101.9	105.3	182,906
ＭＡＲＵＷＡ	4.2	5.3	43,566
品川リフラクトリーズ	3.2	3.7	9,120
黒崎播磨	2.4	2.8	11,046
ヨータイ	10.6	11	7,667
イソライト工業	6.2	7.2	3,722
東京窯業	15.4	17.7	5,451
ニッカトー	5.5	6.3	4,271
フジミインコーポレーテッド	10.8	12.3	38,191
クニミネ工業	5.4	5.6	5,588
エーアンドエーマテリアル	2.3	2.3	2,785
ニチアス	33.1	37.9	94,181
ニチハ	16.8	19.3	45,046
鉄鋼(0.6%)			
日本製鉄	554.9	612.8	608,265
神戸製鋼所	218.6	250.8	100,570
中山製鋼所	16.5	19.2	6,796
合同製鐵	5.8	7.4	15,769
ジェイ エフ イー ホールディングス	322.6	369.9	292,960
東京製鐵	64	66.8	46,626
共英製鋼	13.5	15.5	22,072
大和工業	25.4	29.1	64,747
東京鐵鋼	4.9	5.7	7,780
大阪製鐵	7.9	7.3	9,475
淀川製鋼所	16.1	18.5	31,820
丸一鋼管	42.3	44.5	122,775
モリ工業	3.6	4.1	9,840
大同特殊鋼	19.6	22.4	82,768
日本高周波鋼業	4.4	5.2	2,033
日本冶金工業	98.9	11.4	19,619
山陽特殊製鋼	15.1	9.4	9,240

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)
愛知製鋼	6.7	7.7	23,331
日立金属	128.7	147.6	183,319
日本金属	2.8	3.2	2,256
大平洋金属	8.1	9.3	15,717
新日本電工	71.3	88.6	13,821
栗本鐵工所	6	6.8	12,709
虹技	1.8	2.1	2,522
三菱製鋼	8.9	10.2	7,282
日亜鋼業	17.5	20.3	5,582
日本精線	1.7	2.3	7,498
エンビプロ・ホールディングス	4.5	5.9	3,953
シンニッタン	18.5	21.5	6,106
新家工業	2.7	3.2	3,660
非鉄金属(0.7%)			
大紀アルミニウム工業所	19.8	22.7	13,847
日本軽金属ホールディングス	326	347.1	64,213
三井金属鉱業	32.3	37	85,914
東邦亜鉛	6.7	7.1	10,635
三菱マテリアル	78.9	90.5	221,996
住友金属鉱山	163.6	175.1	525,475
ＤＯＷＡホールディングス	27.9	34.7	120,062
古河機械金属	19.8	24.4	27,230
大阪チタニウムテクノロジーズ	13.9	14.3	14,800
東邦チタニウム	21.5	24.7	16,598
ＵＡＣＪ	18.2	20.8	41,392
ＣＫサンエツ	2.3	2.9	9,352
古河電気工業	34.5	42.6	112,123
住友電気工業	446.6	512	642,304
フジクラ	144.6	165.7	52,526
昭和電線ホールディングス	13.8	15.9	18,412
東京特殊電線	1.6	2.1	4,886
タツタ電線	23.9	27.3	17,144
カナレ電気	2.1	2.3	4,034
平河ヒューテック	5.1	6.9	7,824
リョービ	14.8	16.9	23,676
アーレスティ	14.9	18.2	6,715
アサヒホールディングス	22.5	24	66,480
金属製品(0.6%)			
稲葉製作所	6.7	7.7	10,710
宮地エンジニアリンググループ	3.6	4.2	7,035
トーカロ	30.7	38	40,128
アルファＣｏ	4.2	4.8	4,560
ＳＵＭＣＯ	132	162.7	268,617
川田テクノロジーズ	2.7	2.8	14,280
ＲＳ Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2.4	3.9	13,435
信和	6.3	7.9	5,545
東洋製罐グループホールディングス	76.1	87.2	99,931
ホッカンホールディングス	6.1	7.5	12,870

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)
コロナ	6.6	7.6	7,113
横河ブリッジホールディングス	22.2	25.5	55,590
駒井ハルテック	2.3	2.6	3,915
高田機工	1.1	1.3	3,010
三和ホールディングス	123.4	129.1	119,288
文化シヤッター	35.2	40.3	32,481
三協立山	16.6	17.6	16,931
アルインコ	9.5	9.9	9,444
東洋シヤッター	2.9	3.3	2,286
ＬＩＸＩＬグループ	176.2	202	303,808
日本フイルコン	9.1	10.5	5,691
ノーリツ	26.7	28.4	35,812
長府製作所	12.2	13.9	32,331
リンナイ	21.3	26.6	241,262
ダイニチ工業	6.4	7.4	5,172
日東精工	16.5	18.9	9,317
三洋工業	1.6	1.8	3,261
岡部	24.2	27.7	22,658
ジーテクト	13.2	17	19,278
東プレ	22.3	25.5	33,022
高周波熱錬	23	26.4	14,731
東京製綱	7.3	9.8	5,684
サンコール	6.7	10.2	4,202
モリテック　スチール	9.3	10.7	3,349
パイオラックス	19.1	20.2	34,622
エイチワン	11.7	13.4	7,343
日本発條	119	146.9	108,852
中央発條	1.4	1.6	4,555
アドバネクス	1.6	2	2,686
立川ブラインド工業	5.3	6	7,104
三益半導体工業	10.7	10.7	23,946
機械(5.1%)			
日本ドライケミカル	3.3	3.4	5,440
日本製鋼所	36.3	41.6	66,144
三浦工業	51.7	59.3	272,780
タクマ	43.7	46.5	65,332
ツガミ	27	28.5	28,585
オークマ	15.2	16	71,840
芝浦機械	13.6	15.5	36,781
アマダ	179.6	170	163,370
アイダエンジニアリング	32.5	36	26,460
滝澤鉄工所	3.8	4.3	4,497
ＦＵＪＩ	47.8	58.9	117,034
牧野フライス製作所	14.1	16.1	53,693
オーエスジー	58.9	63.4	96,811
ダイジェット工業	1.5	1.6	2,153
旭ダイヤモンド工業	31.5	36.2	18,498
ＤＭＧ森精機	75.7	86.7	113,490

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)
ソディック	26.2	32.3	26,744
ディスコ	16.2	18.6	447,516
日東工器	6.6	7.5	14,842
日進工具	3.6	5.4	15,233
パンチ工業	8.4	12.5	5,600
冨士ダイス	5.4	6.2	3,918
豊和工業	6.8	7.7	6,491
ＯＫＫ	5.1	5.9	2,596
東洋機械金属	8.7	10	4,250
津田駒工業	2.7	2.8	2,399
エンシュウ	－	3.4	3,270
島精機製作所	16.5	21.6	35,251
オプトラン	11.7	15.3	43,268
ＮＣホールディングス	4	4.3	2,420
イワキポンプ	5.2	8.8	8,976
フリュー	9.6	13.5	12,406
ヤマシンフィルタ	20.8	29.8	29,680
日阪製作所	14.8	17	12,852
やまびこ	23.3	26.6	26,094
平田機工	5.7	6.5	40,235
ペガサスミシン製造	11.3	14.1	4,723
マルマエ	5	5.1	4,493
タツモ	5.1	6.4	9,913
ナブテスコ	65.8	80.7	269,941
三井海洋開発	12.7	14.6	23,710
レオン自動機	11.8	13.5	17,631
ＳＭＣ	35.4	43.4	2,359,658
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	5.9	－	－
ホソカワミクロン	4.2	4.8	29,232
ユニオンツール	5.2	5.1	14,331
オイレス工業	16.8	17.8	25,276
日精エー・エス・ビー機械	4.1	4	13,740
サトーホールディングス	14.4	19.5	48,457
技研製作所	10.5	12.1	59,290
日本エアーテック	3.9	4.8	5,155
カワタ	3.3	4.1	3,161
日精樹脂工業	10.2	11.6	10,498
オカダアイヨン	4.2	4.4	4,272
ワイエイシイホールディングス	4.7	5.9	2,849
小松製作所	546.9	627.2	1,367,296
住友重機械工業	69.2	79.3	195,078
日立建機	48.5	55.5	157,065
日工	3.4	19.1	12,567
巴工業	5.2	5.9	10,667
井関農機	12.2	13.9	17,124
ＴＯＷＡ	10.4	14.1	15,777
丸山製作所	2.8	2.9	3,654
北川鉄工所	5.5	6.3	10,867

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)
ローツェ	5.3	6.1	29,737
タカキタ	4.4	5	2,915
クボタ	647.1	734.7	1,064,947
荏原実業	3.6	3.5	9,170
三菱化工機	4.3	4.8	8,587
月島機械	24.1	25.6	32,947
帝国電機製作所	8.5	11.5	15,065
新東工業	28.8	33	26,037
澁谷工業	10.6	12.1	37,268
アイチ　コーポレーション	21	24.1	18,050
小森コーポレーション	32.9	35.3	27,534
鶴見製作所	9.5	10.7	20,993
住友精密工業	2	2.1	4,932
日本ギア工業	－	5.8	1,716
酒井重工業	2.3	2.7	6,048
荏原製作所	53.6	57.3	148,808
石井鐵工所	1.9	1.8	4,681
西島製作所	12.5	14.1	11,801
北越工業	12.5	14.3	14,657
ダイキン工業	164.9	176.4	2,795,940
オルガノ	4.4	5	30,300
トーヨーカネツ	4.6	6.1	12,980
栗田工業	65.4	75	224,025
椿本チエイン	15.8	19.8	55,143
大同工業	5.9	6.8	4,420
木村化工機	10.6	11.8	5,723
アネスト岩田	18.9	21.6	18,640
ダイフク	66.5	70.8	593,304
サムコ	3.4	3.5	6,730
加藤製作所	6.3	7.7	9,432
油研工業	2.1	2.4	3,602
タダノ	58.4	67	57,352
フジテック	44	50.4	81,244
ＣＫＤ	33.7	38	70,604
キトー	9.2	10.5	12,421
平和	33.7	38.7	70,782
理想科学工業	10.7	12.3	16,236
ＳＡＮＫＹＯ	30.3	30.8	85,470
日本金銭機械	13.4	15.4	8,747
マースグループホールディングス	7.7	8.8	14,379
フクシマガリレイ	7.5	8.6	28,509
オーイズミ	5.3	6	2,640
ダイコク電機	5.6	6.4	8,076
竹内製作所	20.3	23.2	41,272
アマノ	34.5	36.3	84,542
ＪＵＫＩ	16.8	19.3	12,043
蛇の目ミシン工業	11.1	12.8	5,900
マックス	18.5	21.2	35,149
グローリー	33.5	35.6	91,064
新晃工業	11.3	12.9	19,775
大和冷機工業	17.5	20.1	19,677
セガサミーホールディングス	119.9	137.4	192,909
日本ピストンリング	4.5	5.1	6,278
リケン	5.6	6.4	18,099
ＴＰＲ	16.3	18.7	27,470
ツバキ・ナカシマ	18.4	28.3	26,885
ホシザキ	35.3	40.5	352,350
大豊工業	10	11.4	6,053
日本精工	248.1	260.8	205,510
ＮＴＮ	259.9	320.8	72,500
ジェイテクト	115.9	132.9	115,490
不二越	11.2	12.9	44,827
日本トムソン	35.9	41.3	16,809
ＴＨＫ	75.3	80.6	225,680
ユーシン精機	9.4	10.8	7,527
前澤給装工業	4.8	5.1	10,342
イーグル工業	15	17.2	13,037
前澤工業	8.3	9.4	3,318
日本ピラー工業	12.3	14.1	20,233
キッツ	49.1	56.2	40,351
マキタ	147	180.6	659,190
日立造船	96.2	110.1	45,141
三菱重工業	202.4	232.1	646,978
ＩＨＩ	92.9	99.8	154,590
スター精密	20.7	21.4	27,563
電気機器(14.5%)			
日清紡ホールディングス	67.2	92.4	74,012
イビデン	74.1	84.9	242,134
コニカミノルタ	264.2	303.7	121,176
ブラザー工業	157.5	169.3	343,509
ミネベアミツミ	224.4	257.3	486,554
日立製作所	543.7	665.3	2,298,611
三菱電機	1,207.7	1,384.6	1,964,055
富士電機	78.4	83.5	240,396
東洋電機製造	4.9	5.1	6,456
安川電機	140	149.1	577,017
シンフォニアテクノロジー	16.9	18	19,638
明電舎	24	25.5	46,461
オリジン	3.4	3.8	5,700
山洋電気	5.9	6.8	33,320
デンヨー	11.2	11.9	22,848
東芝テック	15.2	17.4	65,163
芝浦メカトロニクス	2.2	2.6	7,077
マブチモーター	33.5	38.5	137,060
日本電産	145.3	333.3	2,207,112
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.8	－	－

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)
トレックス・セミコンダクター	5.7	8.4	9,811
東光高岳	6.4	8.2	8,634
ダブル・スコープ	17.8	－	－
ダイヘン	13.3	15.2	54,948
ヤーマン	17.8	23.3	17,195
ＪＶＣケンウッド	93.2	115.7	20,363
ミマキエンジニアリング	11.3	13.6	5,548
第一精工	5.3	5.8	14,964
日新電機	28.4	32.6	36,577
大崎電気工業	24.1	27.8	14,400
オムロン	128.4	124.1	886,074
日東工業	19.4	20.4	38,984
ＩＤＥＣ	16.3	20.1	35,798
正興電機製作所	2.6	3.7	4,354
不二電機工業	1.6	2.7	3,466
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	43.6	46.5	88,629
サクサホールディングス	3.1	3.3	5,765
メルコホールディングス	5.1	5	13,485
テクノメディカ	1.8	3.4	6,160
日本電気	156.3	168	812,280
富士通	116.4	133.5	1,481,850
沖電気工業	52.4	56.4	60,122
岩崎通信機	5.6	6.1	5,203
電気興業	6.4	6.7	17,728
サンケン電気	14.2	15.2	37,878
ナカヨ	2.5	2.8	3,928
アイホン	6.9	7.9	12,521
ルネサスエレクトロニクス	125.7	663.2	370,728
セイコーエプソン	149.9	171.9	208,686
ワコム	88.3	94.1	45,732
アルバック	24.1	25.5	82,492
アクセル	5.6	6.4	5,408
ＥＩＺＯ	11.1	10.8	43,416
日本信号	30.9	35.4	42,940
京三製作所	26.2	32.7	17,363
能美防災	16.1	18.6	37,460
ホーチキ	7.9	10.4	14,206
星和電機	7.1	7.6	5,479
エレコム	11.5	15.4	78,694
パナソニック	1,379.8	1,582.1	1,523,562
シャープ	119.9	160.3	187,070
アンリツ	77.8	89.2	189,371
富士通ゼネラル	37	37.6	79,148
ソニー	810.3	867.4	5,962,507
ＴＤＫ	63.2	66.9	674,352
帝国通信工業	5.6	6.5	7,741
タムラ製作所	46.8	46.5	21,111
アルプスアルパイン	125.9	122.9	160,015

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)
池上通信機	3.8	4.4	3,951
鈴木	7	7.4	5,875
日本トリム	2.3	2	6,470
ローランド　ディー．ジー．	6.3	8	10,056
フォスター電機	13.7	14.6	17,885
ＳＭＫ	3.4	3.6	9,216
ヨコオ	8.8	9.1	25,789
ホシデン	35.8	38.4	36,096
ヒロセ電機	17.3	21.5	276,705
日本航空電子工業	27.8	31.8	47,477
ＴＯＡ	13.1	15	11,430
マクセルホールディングス	26.2	30.3	32,633
古野電気	15.9	18.4	16,596
ユニデンホールディングス	3.6	3.9	7,768
スミダコーポレーション	10.5	11.3	8,316
アイコム	6.7	7.7	22,915
リオン	5.7	6	14,478
本多通信工業	10.9	13	5,681
横河電機	120.9	127.1	197,259
新電元工業	4.3	4.9	13,024
アズビル	78	87.4	240,262
東亜ディーケーケー	6.4	7.4	6,726
日本光電工業	53.3	57.4	206,353
チノー	4.3	4.9	7,080
共和電業	12.9	14.8	6,038
日本電子材料	5	5.6	5,756
堀場製作所	24	27.4	155,358
アドバンテスト	82.4	103	547,960
小野測器	6.1	6.7	3,638
エスペック	10.8	12.6	22,201
キーエンス	59.3	125.5	5,565,925
日置電機	6.4	7.4	25,604
シスメックス	94.1	99	852,390
日本マイクロニクス	21.3	24.7	25,515
メガチップス	9.7	13.1	25,112
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6.2	8.2	26,240
澤藤電機	1.7	1.9	3,009
原田工業	5.3	7.1	5,878
コーセル	15.6	19	17,746
イリソ電子工業	11.1	11.8	40,533
オプテックスグループ	21.4	23.1	33,610
千代田インテグレ	5.2	6.7	11,838
アイ・オー・データ機器	4.7	5	4,855
レーザーテック	24.8	60.9	538,965
スタンレー電気	85.5	97.5	255,352
岩崎電気	4.9	5.7	10,368
ウシオ電機	70.4	76.8	98,380
岡谷電機産業	9.5	12.3	3,997

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)
ヘリオス テクノ ホールディング	11.6	14.2	5,140
エノモト	3.7	4.6	5,027
日本セラミック	12.4	14.3	29,543
遠藤照明	6.5	7.8	4,414
古河電池	9.1	10.7	6,430
双信電機	6.7	8	3,176
山一電機	9.1	10.3	16,902
図研	8.1	9.2	23,938
日本電子	23.9	27.5	88,550
カシオ計算機	106.9	122.5	232,382
ファナック	114.8	131.6	2,528,694
日本シイエムケイ	27	33.8	13,790
エンプラス	5.6	7.3	16,797
大真空	4.7	5.3	10,573
ローム	57.8	61.5	445,875
浜松ホトニクス	86.7	99.4	485,072
三井ハイテック	13.6	15.6	21,824
新光電気工業	40.9	46.8	64,022
京セラ	184.1	194.9	1,136,461
太陽誘電	53.9	61.7	185,100
村田製作所	380.2	406.8	2,446,902
双葉電子工業	19.9	22.4	22,310
北陸電気工業	4.8	6.1	5,776
ニチコン	38.4	47.6	36,985
日本ケミコン	8.6	10.5	16,285
ＫＯＡ	18.5	21.4	21,164
市光工業	18.5	21.6	11,685
小糸製作所	72.4	83.1	379,351
ミツバ	22.6	26.6	11,650
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	21	24	115,800
キヤノン電子	11.2	14.8	25,456
キヤノン	650.2	745.4	1,654,042
リコー	363.2	352.4	280,510
象印マホービン	30.2	40.9	69,325
ＭＵＴＯＨホールディングス	1.8	2.1	3,328
東京エレクトロン	80.5	87.9	1,889,850
輸送用機器(7.3%)			
トヨタ紡織	42.3	40.4	61,327
芦森工業	2.6	2.9	2,650
ユニプレス	23.4	26.9	28,083
豊田自動織機	97.8	112.1	617,671
モリタホールディングス	21.2	24.2	43,874
三櫻工業	15.4	17.6	14,326
デンソー	265.9	304.9	1,259,541
東海理化電機製作所	31.8	36.5	57,560
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	41.9	50	28,250
川崎重工業	94	107.7	183,736
名村造船所	36.1	44.6	7,760

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)
日本車輌製造	4.4	5	13,945
三菱ロジスネクスト	14.4	18.3	19,196
近畿車輛	1.1	2.1	2,652
日産自動車	1,424.3	1,633	654,669
いすゞ自動車	381.7	401.2	405,011
トヨタ自動車	1,345.8	1,544.9	10,435,799
日野自動車	150.8	172.9	126,044
三菱自動車工業	447	512.5	155,800
エフテック	8.5	9.8	5,145
レシップホールディングス	4.3	5.4	3,202
ＧＭＢ	2.4	2.6	1,781
ファルテック	2.2	2.5	1,825
武蔵精密工業	29.4	30.9	30,003
日産車体	23.6	27	27,378
新明和工業	50.6	37.3	39,799
極東開発工業	24	25.7	35,388
日信工業	22.1	28.2	62,322
トピー工業	10	11.4	15,162
ティラド	4.4	5.1	7,206
曙ブレーキ工業	65.1	76	14,516
タチエス	19.9	22.8	20,383
ＮＯＫ	65	74.5	102,735
フタバ産業	33.6	38.6	20,187
ＫＹＢ	12.1	15.5	33,092
大同メタル工業	19.6	26.7	15,219
プレス工業	60	68.9	18,327
ミクニ	15.5	17.8	5,251
太平洋工業	25.3	29.1	28,721
ケーヒン	27.8	31.8	80,899
河西工業	14.8	18.8	9,719
アイシン精機	99.5	114	387,030
マツダ	379	407.4	280,698
今仙電機製作所	11.3	12.9	9,636
本田技研工業	1,018.8	1,090.2	3,035,116
スズキ	220.9	274.4	1,027,902
ＳＵＢＡＲＵ	374.9	429.8	1,022,279
安永	5.9	6.7	6,827
ヤマハ発動機	170.6	180.6	280,833
ショーワ	28.6	32.7	73,542
ＴＢＫ	14.5	16.6	7,719
エクセディ	16.4	18.8	32,580
豊田合成	39	44.7	102,944
愛三工業	18.9	21.8	12,644
盟和産業	1.9	2.2	2,127
日本プラスト	9.5	11	5,159
ヨロズ	11.3	13	15,080
エフ・シー・シー	21.7	22.7	41,541
シマノ	48.7	51.8	1,026,158

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)
テイ・エス　テック	28.1	32.2	97,566
ジャムコ	6.1	7	5,544
精密機器(2.6%)			
テルモ	341.7	391.8	1,657,314
クリエートメディック	4	4.6	4,517
日機装	39	41.6	41,516
日本エム・ディ・エム	－	8	13,832
島津製作所	155.4	165.5	482,432
ＪＭＳ	11.1	11.7	9,851
長野計器	9.5	10.1	10,584
ブイ・テクノロジー	5.6	6.5	26,617
東京計器	7.7	8.8	8,509
愛知時計電機	1.6	1.8	7,875
インターアクション	6.1	7.4	16,346
オーバル	11.8	12.5	2,862
東京精密	21.8	25.1	87,473
マニー	16	55.2	156,768
ニコン	210.5	211.5	209,385
トプコン	64.9	69.8	65,961
オリンパス	719.6	766.1	1,433,756
理研計器	10.7	12.2	29,597
タムロン	10.7	11.2	22,747
ＨＯＹＡ	243.1	276.5	2,795,415
シード	5.2	5.9	4,690
ノーリツ鋼機	9.5	9.4	13,583
エー・アンド・デイ	11	12.7	9,575
朝日インテック	51.2	156.8	517,440
シチズン時計	132.2	162.3	62,485
リズム時計工業	4.1	4.4	2,675
大研医器	9.6	9.6	6,096
メニコン	16.6	19.6	107,408
シンシア	1.8	1.6	721
松風	5.9	6.3	10,313
セイコーホールディングス	18.6	19.6	35,750
ニプロ	83.6	95.8	120,708
その他製品(2.4%)			
中本パックス	3.4	3.5	5,582
スノーピーク	4.6	7.4	7,407
パラマウントベッドホールディングス	13.9	14.6	61,101
トランザクション	7.6	7.6	7,820
粧美堂	3.5	4	1,444
ニホンフラッシュ	5.2	12.9	18,098
前田工繊	13.3	15.3	35,725
永大産業	15.7	18.1	5,448
アートネイチャー	12.8	14.8	9,442
バンダイナムコホールディングス	124.9	143.1	858,027
アイフィスジャパン	2.7	3.5	2,387
共立印刷	20	23.1	3,303
ＳＨＯＥＩ	5.8	12.1	29,850
フランスベッドホールディングス	17.1	19.6	16,503
パイロットコーポレーション	21.1	22.6	83,281
萩原工業	6.7	7.7	10,795
トッパン・フォームズ	25.9	29.7	33,293
フジシールインターナショナル	27.1	31	68,944
タカラトミー	50.5	62.1	57,194
廣済堂	11.2	9.6	8,131
エステールホールディングス	3.2	3.7	2,223
アーク	45.9	52.8	5,966
タカノ	4.7	5.4	3,817
プロネクサス	10.4	11.9	13,030
ホクシン	7.4	8.5	1,062
ウッドワン	4.1	4.7	5,292
大建工業	9.1	9.3	16,070
凸版印刷	170.5	195.4	360,122
大日本印刷	170.2	181.2	443,758
図書印刷	11.3	－	－
共同印刷	3.7	4.3	12,882
ＮＩＳＳＨＡ	24.8	28.4	27,065
光村印刷	1	1.2	1,814
TAKARA & COMPANY	5.8	6.7	12,642
アシックス	113.9	114.3	130,873
ツツミ	3.8	4.3	7,417
小松ウオール工業	3.7	4.2	8,127
ヤマハ	71.8	82.3	431,252
河合楽器製作所	3.7	4.3	12,603
クリナップ	11.2	12.9	6,708
ピジョン	73	83.7	351,540
オリバー	－	2.9	7,612
兼松サステック	0.8	0.9	1,295
キングジム	10	11.5	10,856
リンテック	28.7	32.9	84,388
イトーキ	22.1	29.4	12,024
任天堂	69.1	84.9	3,696,546
三菱鉛筆	19.9	22.8	33,607
タカラスタンダード	25	28.6	45,016
コクヨ	57.9	66.4	93,092
ナカバヤシ	11.8	13.6	8,731
グローブライド	5.8	6.2	14,390
オカムラ	42.1	48.3	42,600
美津濃	12	12.6	25,741
電気・ガス業(1.6%)			
東京電力ホールディングス	964.1	1,105.3	401,223
中部電力	369.5	423.6	614,643
関西電力	492.8	524.6	563,158
中国電力	167	199.7	295,556
北陸電力	118.3	126.6	89,379

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)
東北電力	282.8	345.9	386,024
四国電力	108.7	124.7	100,757
九州電力	248.9	285.4	255,718
北海道電力	113	129.6	56,376
沖縄電力	22.4	26.89	54,264
電源開発	96.1	110.2	224,036
エフオン	5.6	7.4	4,610
イーレックス	21	19.7	28,998
レノバ	19.8	23.1	21,760
東京瓦斯	236.9	266.3	684,524
大阪瓦斯	234.4	268.7	578,511
東邦瓦斯	59.8	68.1	361,611
北海道瓦斯	6.5	7.4	11,566
広島ガス	24.7	28.5	10,260
西部瓦斯	13.6	15.6	40,981
静岡ガス	37.1	39.3	38,907
メタウォーター	5.8	6.7	32,193
陸運業(4.3%)			
ＳＢＳホールディングス	11.9	12	28,836
東武鉄道	127.4	144.3	551,226
相鉄ホールディングス	41.4	44.3	137,108
東急	328	349.2	596,433
京浜急行電鉄	165.4	177.8	320,217
小田急電鉄	193.4	205.9	553,665
京王電鉄	67.5	71.8	459,520
京成電鉄	90.5	96.4	340,774
富士急行	16.5	18.9	66,055
新京成電鉄	3.1	3.6	7,704
東日本旅客鉄道	214.7	243.7	2,059,265
西日本旅客鉄道	108.3	123.4	857,753
東海旅客鉄道	108.1	115.1	2,121,868
西武ホールディングス	149.6	185.8	261,606
鴻池運輸	19.2	22	27,280
西日本鉄道	33.5	38.4	111,590
ハマキョウレックス	9.3	10.6	34,450
サカイ引越センター	6.3	7.3	44,603
近鉄グループホールディングス	114.4	131.1	693,519
阪急阪神ホールディングス	152.5	174.9	696,102
南海電気鉄道	51	62.2	162,404
京阪ホールディングス	50.9	58.4	299,008
神戸電鉄	2.9	3.1	11,687
名古屋鉄道	93.8	107.8	350,350
山陽電気鉄道	8.8	9.4	21,056
日本通運	44.1	45.4	251,516
ヤマトホールディングス	200.5	229.9	548,081
山九	31.8	36.4	159,978
丸運	6.5	7.5	1,792
丸全昭和運輸	9.3	10.6	30,464

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)
センコーグループホールディングス	63	72.3	62,178
トナミホールディングス	2.7	3.1	18,724
ニッコンホールディングス	43.5	46.9	102,335
日本石油輸送	1.4	1.4	4,445
福山通運	14.6	16.8	59,472
セイノーホールディングス	85.7	98.2	144,746
エスライン	3.4	3.9	3,919
神奈川中央交通	2.8	3.2	13,216
日立物流	25.1	24	71,112
丸和運輸機関	6	13.8	40,751
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	11.6	13.3	20,282
九州旅客鉄道	96	115	351,325
ＳＧホールディングス	108.1	137.6	483,664
海運業(0.1%)			
日本郵船	96.1	110.3	171,295
商船三井	68.2	83.4	159,210
川崎汽船	34.7	40.4	44,884
ＮＳユナイテッド海運	6.6	7.9	11,218
飯野海運	56.3	64.8	22,161
共栄タンカー	1.5	3.4	3,012
乾汽船	10.2	7.6	8,838
空運業(0.4%)			
日本航空	209.4	231.9	490,932
ＡＮＡホールディングス	209.1	239.7	622,980
パスコ	2.2	2.5	3,632
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	3.2	3.7	24,901
日新	9.9	11.3	18,023
三菱倉庫	39.6	41.6	115,148
三井倉庫ホールディングス	14	15	24,045
住友倉庫	42.1	47.2	63,248
澁澤倉庫	6.3	7.2	15,292
東陽倉庫	20.5	23.7	8,058
日本トランスシティ	25.1	28.9	14,970
ケイヒン	2.2	2.5	3,275
中央倉庫	7	8	8,144
川西倉庫	2.3	2.4	2,438
安田倉庫	9.4	10.8	9,622
ファイズホールディングス	2	2.8	3,094
東洋埠頭	3.5	4	5,396
宇徳	9.7	11.2	5,140
上組	70.5	73.2	154,086
サンリツ	2.7	3.1	1,863
キムラユニティー	3.1	3.5	3,636
キユーソー流通システム	2.9	3.3	5,778
近鉄エクスプレス	21.6	27.9	48,462
東海運	6.5	7.5	1,995
エーアイテイー	7.4	9.3	7,337

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)
内外トランスライン	3.6	4.6	4,765
日本コンセプト	4.2	4.2	6,304
情報・通信業(9.5%)			
ＮＥＣネッツエスアイ	13.1	38.7	78,367
クロスキャット	3.3	3.8	3,936
システナ	42.4	48.6	74,844
デジタルアーツ	6.4	6.7	57,553
日鉄ソリューションズ	17.8	20.5	60,516
キューブシステム	6.5	7.6	5,867
エイジア	2.5	2.7	3,677
コア	5.1	6	7,398
ラクーンホールディングス	－	6.4	4,992
ソリトンシステムズ	6.9	6.2	8,332
ソフトクリエイトホールディングス	5.3	6.1	13,542
ＴＩＳ	39.5	136	312,392
ネオス	2.6	5.4	3,866
電算システム	4.6	5.3	18,603
グリー	82.1	84	37,128
コーエーテクモホールディングス	24.3	27.9	86,769
三菱総合研究所	5.1	5.9	24,455
電算	1.4	1.6	3,476
ＡＧＳ	6.9	8	6,808
ファインデックス	10.2	11.7	11,384
ブレインパッド	2.3	3.5	17,307
ＫＬａｂ	21.2	26.3	20,487
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	15.9	16.7	16,032
イーブックイニシアティブジャパン	2	2.1	5,260
ネクソン	302.4	379.1	851,458
アイスタイル	30.6	38.9	11,981
エムアップホールディングス	4.2	4	10,556
エイチーム	8.3	9.7	7,449
エニグモ	－	13.1	13,231
テクノスジャパン	10.2	11	6,644
コロプラ	39.1	44.8	48,249
ブロードリーフ	59.1	67.8	37,900
クロス・マーケティンググループ	4.9	6.9	2,297
デジタルハーツホールディングス	5.6	7.5	6,577
システム情報	6.2	10.4	11,980
メディアドゥホールディングス	3.7	4.3	18,511
じげん	16.9	34.4	13,037
エンカレッジ・テクノロジ	1.8	3.3	2,808
サイバーリンクス	2	2.3	4,130
フィックスターズ	12.7	14.7	19,359
CARTA HOLDINGS	5.8	6.8	7,296
オプティム	5.3	7.2	19,980
セレス	4	4.7	5,860
ＳＨＩＦＴ	－	5.5	55,990
ティーガイア	12	12.2	27,938
セック	2	2.1	7,570
日本アジアグループ	12.4	14.3	4,533
豆蔵ホールディングス	8.2	－	－
テクマトリックス	8.4	9.7	31,767
プロシップ	3.6	4.2	5,472
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	286.1	32.9	57,673
GMOペイメントゲートウェイ	19.5	28.8	349,344
ザッパラス	6.6	6.6	2,534
システムリサーチ	1.6	3.8	7,193
インターネットイニシアティブ	19.4	20.2	76,861
さくらインターネット	14.4	15	9,735
ヴィンクス	4.1	4.1	4,460
GMOクラウド	2.7	2.6	14,482
ＳＲＡホールディングス	6.4	7.3	18,155
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	2.4	－	－
システムインテグレータ	－	4.6	4,140
朝日ネット	9.9	9.9	10,662
ｅＢＡＳＥ	7.2	16.5	21,450
アバント	4.3	13.2	14,876
アドソル日進	4.3	4.9	12,705
フリービット	7.2	7.4	6,482
コムチュア	6.7	15.3	45,395
サイバーコム	2.2	2.6	4,924
アステリア	8.1	8.8	4,488
アイル	－	7.7	13,675
マークラインズ	5.5	6.9	14,013
メディカル・データ・ビジョン	10.6	10.6	11,363
ショーケース	2.9	3.6	2,282
モバイルファクトリー	3.4	3.3	3,927
テラスカイ	2	5	14,205
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.3	5.5	8,217
ＰＣＩホールディングス	2.5	5.4	5,205
パイプドHD	2	1.9	3,013
アイビーシー	2.3	2.5	2,557
ネオジャパン	2.4	2.8	3,841
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	1.1	1.3	3,139
ランドコンピュータ	2	2.3	2,573
ダブルスタンダード	1.1	1.8	8,793
オープンドア	5.9	6.9	8,666
マイネット	4	4.4	5,341
アカツキ	4.2	4.9	19,967
ベネフィットジャパン	1.1	1.2	1,874
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2.3	3.2	5,273
ＬＩＮＥ	36.2	31.2	168,168
カナミックネットワーク	2.5	12.7	11,379
ノムラシステムコーポレーション	1.5	3.5	1,799
チェンジ	2.2	4.8	25,344
シンクロ・フード	5.3	6.5	2,379

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)
オークネット	6.4	8.6	9,718
セグエグループ	－	3.3	2,986
エイトレッド	1.4	2.4	4,754
AOI TYO Holdings	13.1	14.3	7,221
マクロミル	21.1	28.1	20,541
ビーグリー	3.2	2.8	4,379
オロ	3.2	3.7	10,881
ユーザーローカル	－	1.4	4,508
テモナ	－	3.3	2,554
ニーズウェル	－	3	2,115
サインポスト	－	3	5,133
ソルクシーズ	5.2	6.2	4,451
フェイス	4.9	5.2	3,452
プロトコーポレーション	5.4	12.4	14,309
ハイマックス	1.5	1.7	3,371
野村総合研究所	75.4	192.7	548,809
サイバネットシステム	10	10.1	6,827
ＣＥホールディングス	3.6	7.7	3,826
日本システム技術	2	2.4	3,187
インテージホールディングス	15.3	17.3	15,051
東邦システムサイエンス	3.7	3.9	3,494
ソースネクスト	46.4	65.3	21,418
インフォコム	13	15	42,105
ＨＥＲＯＺ	－	2	7,890
ラクスル	－	11	31,966
ＦＩＧ	11	15.7	4,286
システムサポート	－	3.2	6,304
イーソル	－	6.7	9,849
アルテリア・ネットワークス	13.3	15.2	30,141
東海ソフト	－	1.2	1,632
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.8	2.6	2,875
トビラシステムズ	－	1.8	3,214
フォーカスシステムズ	8.1	8.7	8,021
クレスコ	3.7	8.4	13,112
フジ・メディア・ホールディングス	123.1	131.1	141,850
オービック	41.1	47.1	879,828
ジャストシステム	16.9	22.1	163,540
ＴＤＣソフト	10.5	12.2	11,565
Ｚホールディングス	773.3	1,866.4	821,216
トレンドマイクロ	63.2	60.5	358,160
ＩＤホールディングス	4.7	5.4	8,218
日本オラクル	24	27.6	347,208
アルファシステムズ	3.8	4.3	17,028
フューチャー	16.2	16.6	29,697
ＣＡＣ Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8.6	9.1	11,811
ＳＢテクノロジー	5.1	5	13,965
トーセ	3.4	4	3,444
オービックビジネスコンサルタント	12.1	13.9	77,840

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)
伊藤忠テクノソリューションズ	54.1	62	225,680
アイティフォー	14.6	16.8	12,180
東計電算	1.8	2.1	8,505
エックスネット	2.4	2.4	2,284
大塚商会	64.2	73.6	382,720
サイボウズ	14	16	44,384
ソフトブレーン	9.7	8.5	4,496
電通国際情報サービス	7.4	8.5	42,755
ＡＣＣＥＳＳ	－	13	12,454
デジタルガレージ	23.1	24.5	93,712
ＥＭシステムズ	9.7	19.4	16,296
ウェザーニューズ	4.1	4.7	17,742
ＣＩＪ	9.4	9.6	9,081
ビジネスエンジニアリング	1.3	1.7	4,576
日本エンタープライズ	13.3	14.8	4,114
WOWOW	5.8	6.6	16,896
スカラ	8.4	9.4	6,645
インテリジェント　ウェイブ	4.7	8.3	6,415
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	10.3	12.3	5,190
ネットワンシステムズ	42	51.8	168,868
システムソフト	29.8	32.7	2,746
アルゴグラフィックス	10.1	11.6	43,094
マーベラス	18.3	21.1	16,458
エイベックス	20.5	23.6	22,490
日本ユニシス	37.1	42.5	141,525
兼松エレクトロニクス	6.5	7.5	29,775
東京放送ホールディングス	78.7	82.8	140,180
日本テレビホールディングス	108.9	113.6	141,318
朝日放送グループホールディングス	12	13.9	10,216
テレビ朝日ホールディングス	32.7	37.5	63,450
スカパーＪＳＡＴホールディングス	90.9	90	39,510
テレビ東京ホールディングス	9.8	11.3	27,707
日本ＢＳ放送	4.2	4.8	5,414
ビジョン	3.7	13	11,063
スマートバリュー	3.7	3.8	4,503
ワイヤレスゲート	5.6	6.9	3,891
コネクシオ	8.5	7.9	11,707
クロップス	2.4	2.9	2,061
日本電信電話	810.6	1,816.3	4,439,037
ＫＤＤＩ	1,044.4	1,012.6	3,175,513
ソフトバンク	1,256.6	1,234.9	1,686,873
光通信	14	14	330,540
ＮＴＴドコモ	750.4	971.6	2,867,677
エムティーアイ	11.7	13.6	8,173
GMOインターネット	43.3	53.7	146,493
ファイバーゲート	－	4.6	6,375
アイドママーケティングコミュニケーション	2.9	4.6	2,249
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	34.7	36.7	65,032

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)
学研ホールディングス	4	18.4	30,562
ゼンリン	23.7	27.3	37,237
昭文社ホールディングス	5.9	7	2,828
インプレスホールディングス	9.8	11.2	1,702
アイネット	6.9	7.2	11,066
松竹	7.9	9	126,900
東宝	78	80.2	317,592
東映	5	5.1	74,919
エヌ・ティ・ティ・データ	315.7	362	450,690
ピー・シー・エー	1.6	2.4	10,080
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	2.4	6,376
ＤＴＳ	13.3	30.5	69,997
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55.2	58	303,340
シーイーシー	12.8	14.7	27,489
カプコン	50.9	64.1	243,900
アイ・エス・ビー	2.4	2.8	5,966
ジャステック	7.1	8.9	10,101
ＳＣＳＫ	31.3	31.4	165,478
日本システムウエア	4	4.6	10,842
アイネス	15.2	13.6	19,067
ＴＫＣ	10.1	11.5	64,860
富士ソフト	17.7	17.4	78,996
ＮＳＤ	19.5	43.8	73,759
コナミホールディングス	48.5	49.4	186,979
福井コンピュータホールディングス	4	5.4	16,956
ＪＢＣＣホールディングス	9.5	9.3	15,205
ミロク情報サービス	11.8	12.1	30,322
ソフトバンクグループ	495.2	1,078.1	5,209,379
卸売業(4.7%)			
ホウスイ	1	1.1	1,013
高千穂交易	4.6	5.3	5,199
カワニシホールディングス	－	1.6	2,142
伊藤忠食品	2.9	3.4	15,946
エレマテック	11.2	12.8	11,392
ＪＡＬＵＸ	3.4	3.9	7,070
あらた	8.8	10.9	49,649
トーメンデバイス	1.8	2.1	7,434
東京エレクトロン　デバイス	4.3	4.9	13,837
フィールズ	10.4	10.4	3,993
双日	656.9	753.2	189,053
アルフレッサ　ホールディングス	132.2	151.6	329,426
横浜冷凍	33.4	35.7	32,772
神栄	1.6	－	－
ラサ商事	6.3	7.2	6,501
ラクーンホールディングス	5.7	－	－
アルコニックス	12.6	14.5	18,429
神戸物産	18	47.1	262,818
ハイパー	－	2.1	1,220

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)
あい　ホールディングス	17	19.5	28,158
ディーブイエックス	4.7	4.9	4,581
ダイワボウホールディングス	10.8	11.6	83,868
マクニカ・富士エレホールディングス	33	32.5	56,322
ラクト・ジャパン	5	5.1	19,584
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22.4	25.7	27,396
八洲電機	9.2	10.6	9,550
メディアスホールディングス	6.7	7.8	7,651
レスターホールディングス	13	14.2	29,507
ジューテックホールディングス	2.7	3.1	3,038
大光	5	5.8	3,967
ＯＣＨＩホールディングス	3.5	4	5,804
ＴＯＫＡＩホールディングス	62.9	72.1	72,532
黒谷	2.7	3.8	1,869
Ｃｏｍｉｎｉｘ	2.1	2.4	1,804
三洋貿易	6	13.7	13,152
ビューティガレージ	1.9	2.2	3,832
ウイン・パートナーズ	7.7	9.9	10,107
ミタチ産業	3.6	4.1	2,492
シップヘルスケアホールディングス	24.8	21.9	102,054
明治電機工業	3.7	4.3	5,912
デリカフーズホールディングス	2.1	4.8	3,120
スターティアホールディングス	2.3	3.1	2,263
コメダホールディングス	27.5	29.7	55,390
ピーバンドットコム	－	1.4	1,400
アセンテック	－	1.5	4,680
富士興産	4.6	4.2	2,150
協栄産業	1.4	1.5	1,852
小野建	10.7	12.2	15,786
南陽	2.4	3	4,440
佐鳥電機	8.8	9.3	7,812
エコートレーディング	2.7	3.2	1,667
伯東	8.2	8.3	8,183
コンドーテック	9.2	10.6	11,267
中山福	6.8	7.9	3,531
ナガイレーベン	17.2	18.1	48,327
三菱食品	13.1	15	40,875
松田産業	8.7	10	14,450
第一興商	17.7	20.3	76,937
メディパルホールディングス	128.4	147.2	314,566
ＳＰＫ	2.6	5.9	8,324
萩原電気ホールディングス	4.4	5.1	11,332
アズワン	8.5	8.9	105,821
スズデン	4.1	4.7	5,649
尾家産業	3.8	4	5,960
シモジマ	7.3	8.4	10,575
ドウシシャ	11.2	12.9	20,201
小津産業	2.6	3	5,412

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)
高速	7.1	8.1	11,939
たけびし	4.2	4.8	7,041
リックス	2.7	3.1	4,727
丸文	10.5	12.1	5,844
ハピネット	9.9	11.4	12,209
橋本総業ホールディングス	2.4	2.8	5,213
日本ライフライン	37.3	40.4	58,660
タカショー	5.8	8.9	4,191
エクセル	2.9	－	－
マルカ	3.9	4.8	8,856
ＩＤＯＭ	40	36.8	19,062
日本エム・ディ・エム	7	－	－
進和	7	8.1	15,624
エスケイジャパン	2.9	3	939
ダイトロン	5.5	5.8	9,831
シークス	15.1	17.4	18,444
田中商事	4	4.2	2,910
オーハシテクニカ	6.7	7.7	12,520
白銅	3.8	4.9	6,928
伊藤忠商事	832	953.8	2,203,278
丸紅	1,172.9	1,419.5	742,824
高島	1.9	2.2	3,707
長瀬産業	66.9	76.7	102,624
蝶理	7.6	8.7	15,842
豊田通商	132.8	152.2	415,506
三共生興	20.2	20.7	9,294
兼松	47.5	50.9	68,053
ツカモトコーポレーション	2.1	2.4	2,673
三井物産	979.9	1,180.8	1,931,198
日本紙パルプ商事	6.8	7.8	30,381
日立ハイテク	36.2	－	－
カメイ	15.5	17.8	19,152
東都水産	1.7	1.7	5,499
ＯＵＧホールディングス	1.9	2.2	5,904
スターゼン	4.4	5	23,150
山善	46.5	53.3	49,888
椿本興業	2.7	2.5	8,162
住友商事	703.5	860.4	1,116,799
内田洋行	5.1	5.4	30,456
三菱商事	834.7	957	2,406,855
第一実業	5.4	6.7	25,292
キヤノンマーケティングジャパン	34	33.8	74,224
西華産業	6.7	7.7	9,301
佐藤商事	10.6	11.3	10,203
菱洋エレクトロ	12.1	13.8	36,873
東京産業	11.8	12.4	6,931
ユアサ商事	12.2	12.9	40,699
神鋼商事	2.7	3.4	6,630

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)
トルク	7.1	8.2	2,476
阪和興業	20.6	25.5	50,643
正栄食品工業	8.3	8.8	38,720
カナデン	10.7	11.1	14,152
菱電商事	9.4	9.8	13,847
フルサト工業	6.6	7.5	10,837
岩谷産業	26.4	30.3	115,140
ナイス	5	5.8	4,825
昭光通商	4.2	4.4	2,688
ニチモウ	1.9	2.1	3,815
極東貿易	3.7	3.9	5,772
イワキ	14.2	17.9	8,771
三愛石油	32	33.6	37,094
稲畑産業	28.6	30	39,570
ＧＳＩクレオス	3.2	3.4	3,937
明和産業	11	12.6	6,186
クワザワ	4.2	4.9	2,572
ヤマエ久野	－	9.9	12,513
ワキタ	25.4	29.1	30,031
東邦ホールディングス	35.2	43.8	94,213
サンゲツ	35.4	37.2	59,334
ミツウロコグループホールディングス	15.7	20.1	24,200
シナネンホールディングス	4.9	5.6	15,288
伊藤忠エネクス	26.3	30.2	26,032
サンリオ	36.7	38.3	69,169
サンワテクノス	7.2	9.7	8,633
リョーサン	13.1	15.1	36,844
新光商事	11.2	21.4	19,388
トーホー	5.4	6.2	11,742
三信電気	8.2	7.3	12,074
東陽テクニカ	13.7	14.6	15,271
モスフードサービス	15.6	17.9	53,700
加賀電子	11.8	13.6	31,756
ソーダニッカ	12.2	14.1	7,402
立花エレテック	8.8	10.1	17,856
フォーバル	5.2	6	7,002
ＰＡＬＴＡＣ	21.4	21.9	115,632
三谷産業	13.9	18	7,038
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	2.7	2.5	4,797
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1	1.2	2,326
国際紙パルプ商事	27.7	32.4	9,201
ヤマタネ	6	6.8	8,384
丸紅建材リース	1.2	1.3	2,024
日鉄物産	8.5	9.7	36,181
泉州電業	4	4.2	11,310
トラスコ中山	24.8	28.4	70,545
オートバックスセブン	47.3	50.6	66,893
モリト	8.6	10	6,810

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)
加藤産業	18.6	19.7	74,269
北恵	2.3	3.5	3,192
イノテック	7.1	7.1	7,902
イエローハット	22.5	25.8	39,628
ＪＫホールディングス	10.7	12.3	10,553
日伝	9.9	12.3	28,154
北沢産業	9	10.3	2,853
杉本商事	6.4	7.4	13,712
因幡電機産業	16.9	38.8	95,409
東テク	3.9	4.5	10,053
ミスミグループ本社	149	170.9	489,115
アルテック	8.8	10.9	2,572
タキヒヨー	3.6	4.1	7,027
蔵王産業	2	2.6	3,775
スズケン	54.3	57.8	226,287
ジェコス	8.2	9.4	9,353
グローセル	10.9	13.7	5,959
小売業(4.9%)			
ローソン	30.1	34.5	205,620
サンエー	9	11.4	48,963
カワチ薬品	9.3	10.6	27,899
エービーシー・マート	18.6	21.3	139,515
ハードオフコーポレーション	4.9	5.7	4,172
アスクル	12.5	14.3	46,475
ゲオホールディングス	18.2	24.7	33,295
アダストリア	16.5	19	33,326
ジーフット	7.3	8.2	3,927
くら寿司	7	7.2	35,424
キャンドゥ	5.7	6.6	12,421
パルグループホールディングス	6.1	14.1	19,542
エディオン	50.5	62.8	62,800
サーラコーポレーション	24.4	28	16,016
ワッツ	5.4	6.3	4,788
ハローズ	4.5	5.2	16,120
フジオフードシステム	5	11.6	19,360
あみやき亭	2.6	3	9,510
ひらまつ	23.9	25.1	5,095
大黒天物産	2.9	3.3	13,299
ハニーズホールディングス	10.6	12.2	15,103
ファーマライズホールディングス	3	3.6	2,386
アルペン	9.2	10.6	18,687
ハブ	3.9	4.2	3,095
クオールホールディングス	17.6	20.2	26,037
ジンズホールディングス	6.3	7.2	49,176
ビックカメラ	70.7	81.1	92,048
ＤＣＭホールディングス	64.3	75.7	84,784
ペッパーフードサービス	9.5	－	－
ＭｏｎｏｔａＲＯ	75.2	97	379,755
東京一番フーズ	3.2	3.9	2,024
ＤＤホールディングス	2.6	5.4	5,589
きちりホールディングス	3.3	3.9	2,613
アークランドサービスホールディングス	8.8	10.1	19,321
Ｊ．フロント　リテイリング	152.3	163.1	149,236
ドトール・日レスホールディングス	20.9	19.7	36,208
マツモトキヨシホールディングス	49.2	56.4	227,574
ブロンコビリー	6.3	7.2	17,496
ＺＯＺＯ	128.6	93.9	186,297
トレジャー・ファクトリー	3.6	4.3	3,160
物語コーポレーション	2.9	3.7	29,045
ココカラファイン	13.4	14.3	77,792
三越伊勢丹ホールディングス	222.7	238.7	172,102
Ｈａｍｅｅ	3.8	5	6,420
ウエルシアホールディングス	31.5	40.6	367,430
クリエイトＳＤホールディングス	17.6	23	78,430
丸善ＣＨＩホールディングス	13.8	15.9	6,105
ティーライフ	1.7	2.2	2,552
エー・ピーカンパニー	2.5	－	－
チムニー	3.7	4.3	7,761
シュッピン	8.2	9.5	7,818
オイシックス・ラ・大地	－	13.5	31,104
ネクステージ	18.6	19.8	17,701
ジョイフル本田	34.9	40.1	53,934
鳥貴族	4	4.1	7,683
キリン堂ホールディングス	4.8	5.5	12,078
ホットランド	6.3	9.3	11,559
すかいらーくホールディングス	110.9	152.9	267,116
ＳＦＰホールディングス	5.1	7.9	13,335
綿半ホールディングス	4.5	5.2	9,770
ヨシックス	2	2.3	5,694
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	34.7	39.8	44,894
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	6.6	3,907
ＢＥＥＮＯＳ	4.2	6.5	7,013
あさひ	9.9	10.3	15,965
日本調剤	4.2	8.4	14,523
コスモス薬品	5.3	12.1	187,187
トーエル	5.9	6.9	4,954
オンリー	2.2	2.7	1,630
セブン＆アイ・ホールディングス	498.6	533.5	1,967,014
薬王堂	5.2	－	－
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32.1	73.5	61,152
ツルハホールディングス	25.9	29.7	472,824
サンマルクホールディングス	9.4	10.9	20,383
フェリシモ	2.8	3.2	3,376
トリドールホールディングス	14.7	33.9	41,391
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	10.8	12.9	4,579
ウイルプラスホールディングス	2	2	1,494

国内株式インデックス マザーファンド　－第20期－

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)
ＪＭホールディングス	6.1	10.4	28,558
サツドラホールディングス	1.8	2.1	4,244
デファクトスタンダード	0.9	－	－
アレンザホールディングス	6.6	7.1	6,184
串カツ田中ホールディングス	－	2.9	5,109
パロックジャパンリミテッド	9.8	9.8	6,370
クスリのアオキホールディングス	11.8	12.2	108,580
力の源ホールディングス	4.6	6.5	5,044
スシローグローバルホールディングス	13.1	74.9	170,772
ＬＩＸＩＬビバ	10.2	13.5	32,575
メディカルシステムネットワーク	12.8	13.6	6,405
はるやまホールディングス	5.7	6.7	4,991
ノジマ	21.2	24.3	60,968
カッパ・クリエイト	16.7	19.1	28,917
ライトオン	9	10.2	5,610
良品計画	16.9	181.2	295,174
三城ホールディングス	15	15.2	4,620
アドヴァン	18.3	21	25,410
アルビス	4.6	5.3	11,267
コナカ	14.2	16.7	5,494
ハウス　オブ　ローゼ	1.5	1.8	2,896
Ｇ－７ホールディングス	3.5	8.1	19,083
イオン北海道	12.1	18.2	14,232
コジマ	20.6	23.9	11,878
ヒマラヤ	4.3	5	4,105
コーナン商事	15.7	19.5	61,327
エコス	4.5	5.1	9,715
ワタミ	15.7	16.3	17,147
マルシェ	3.3	3.9	2,519
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	71.2	299.8	650,865
西松屋チェーン	26.2	30.1	27,812
ゼンショーホールディングス	56.2	65.4	150,093
幸楽苑ホールディングス	7.6	8.8	15,716
ハークスレイ	2.6	3	3,000
サイゼリヤ	19.7	20.3	46,568
ＶＴホールディングス	54	57.1	21,812
魚力	3.4	3.9	6,165
フジ・コーポレーション	3.2	3.7	7,429
ユナイテッドアローズ	13.6	14.4	26,654
ハイデイ日高	17.2	19.8	37,818
京都きもの友禅	7.9	9.5	2,251
コロワイド	39.6	45.3	73,023
ピーシーデポコーポレーション	16	18.4	11,592
壱番屋	8.4	9.6	53,568
ＰＬＡＮＴ	3.2	3.8	2,276
スギホールディングス	26.1	27.3	190,008
薬王堂ホールディングス	－	6	16,152
スクロール	18.6	21.5	8,019
ヨンドシーホールディングス	13.3	14	27,510
ファミリーマート	133.1	109	220,071
木曽路	14.6	17.9	45,466
ＳＲＳホールディングス	14.1	16.3	15,028
タカキュー	9.8	12	1,692
リテールパートナーズ	－	18.2	28,901
ケーヨー	22.2	28.3	18,310
上新電機	14.1	16.1	35,919
日本瓦斯	19.4	21.6	92,340
ロイヤルホールディングス	20.8	23.9	47,226
いなげや	13.4	17	28,696
島忠	25.2	25.7	75,223
チヨダ	12.6	14.5	15,283
ライフコーポレーション	9.1	10.4	35,100
リンガーハット	14.7	16.9	41,252
ＭｒＭａｘＨＤ	16.5	19.2	8,467
テンアライド	10.9	12.6	4,901
ＡＯＫＩホールディングス	23.9	27.6	18,988
オークワ	17.1	21.5	32,766
コメリ	18.4	21.1	56,083
青山商事	20.8	28.4	23,316
しまむら	13.9	15.9	120,522
はせがわ	6.6	7.7	2,664
高島屋	93.4	99.5	102,982
松屋	24.1	27.7	18,946
エイチ・ツー・オー　リテイリング	61.2	64.8	54,691
近鉄百貨店	4.6	5.3	17,092
パルコ	11.5	－	－
丸井グループ	100.7	125.1	243,069
アクシアル　リテイリング	9.9	11.4	47,025
イオン	457.8	524.8	1,250,860
イズミ	24.2	27.8	94,103
平和堂	24.2	27.8	53,820
フジ	14.4	16.5	31,069
ヤオコー	13.5	15.5	109,275
ゼビオホールディングス	14.5	16.7	15,581
ケーズホールディングス	123.7	131.7	181,746
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	7.2	7.3	5,015
日産東京販売ホールディングス	17.9	21	4,893
シルバーライフ	－	1.9	4,516
一家ダイニングプロジェクト	－	1.4	931
Genky DrugStores	5.9	6.1	17,330
ナルミヤ・インターナショナル	－	3.3	2,590
総合メディカルホールディングス	10.4	－	－
ブックオフグループホールディングス	6.2	7.9	6,888
アインホールディングス	16	16.8	116,928
元気寿司	3.4	3.5	8,459
ヤマダ電機	362.6	415.9	217,931

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)
アークランドサカモト	20.3	21.5	25,585
ニトリホールディングス	51.5	59	1,152,565
グルメ杵屋	8.6	9.9	10,226
愛眼	9.4	10.9	2,376
ケーユーホールディングス	6.3	7.4	6,208
吉野家ホールディングス	41.6	44.9	110,947
松屋フーズホールディングス	5.8	6.6	26,103
サガミホールディングス	16	18.4	23,809
関西スーパーマーケット	9.1	11.5	12,949
王将フードサービス	8.7	10	62,800
プレナス	13.4	15.4	28,875
ミニストップ	8.9	10.2	15,453
アークス	22.4	28	61,040
バローホールディングス	25.7	30.3	64,084
ベルク	5.9	6.8	45,152
大庄	6.4	7.4	10,434
ファーストリテイリング	15.9	18.2	1,101,646
サンドラッグ	44.8	51.4	186,582
サックスバー　ホールディングス	10.2	11.9	6,592
ヤマザワ	2.5	3.3	5,662
やまや	2.1	2.9	6,498
ベルーナ	29.2	29.7	16,067
銀行業(5.1%)			
島根銀行	3.8	3.6	1,868
じもとホールディングス	80.1	92.3	8,860
めぶきフィナンシャルグループ	622	709.6	173,142
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16.6	18.4	19,908
九州フィナンシャルグループ	197.4	298.8	136,850
ゆうちょ銀行	338.2	386.9	344,341
富山第一銀行	30.8	32.6	8,704
コンコルディア・フィナンシャルグループ	749.2	780	274,560
西日本フィナンシャルホールディングス	76	90.9	67,447
関西みらいフィナンシャルグループ	57.1	80.1	31,239
三十三フィナンシャルグループ	10.9	12.7	19,583
第四北越フィナンシャルグループ	21	23.7	53,609
新生銀行	87.4	100.2	137,775
あおぞら銀行	66.5	81.4	162,962
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	8,199.5	9,341.8	4,149,627
りそなホールディングス	1,307.1	1,498.6	581,157
三井住友トラスト・ホールディングス	234.1	258.1	818,435
三井住友フィナンシャルグループ	839.5	944.5	2,945,895
千葉銀行	411.3	455.7	233,318
群馬銀行	240.4	262.3	88,395
武蔵野銀行	18.1	20.3	30,795
千葉興業銀行	36.4	37.4	9,387
筑波銀行	49.3	56.8	10,508
七十七銀行	37.9	46.1	70,855
青森銀行	9.5	10.6	23,139

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)
秋田銀行	8	8.8	13,666
山形銀行	13.9	15.3	20,578
岩手銀行	8.6	8.9	22,107
東邦銀行	106.5	122.1	28,815
東北銀行	6.1	6.5	6,136
みちのく銀行	7.6	8.8	10,630
ふくおかフィナンシャルグループ	105.3	115	201,595
静岡銀行	300.8	338.2	232,005
十六銀行	16.4	17.1	35,892
スルガ銀行	―	139.7	54,622
八十二銀行	289.3	329.6	131,180
山梨中央銀行	15	15.9	14,771
大垣共立銀行	25.4	27	61,398
福井銀行	10.7	11.7	19,351
北國銀行	12.5	13.6	37,576
清水銀行	5.4	5.6	10,371
富山銀行	2.6	2.6	5,917
滋賀銀行	24.2	27.4	68,691
南都銀行	19	22.7	51,097
百五銀行	109.7	122.9	39,205
京都銀行	42.9	48.9	189,243
紀陽銀行	42.7	48.4	80,924
ほくほくフィナンシャルグループ	80	90.9	82,537
広島銀行	177.3	201.6	101,808
山陰合同銀行	71.8	81	43,011
中国銀行	103.3	117.5	113,740
鳥取銀行	4.7	4.7	5,851
伊予銀行	159.3	194.9	118,694
百十四銀行	13	14.5	28,492
四国銀行	17.8	20.7	17,139
阿波銀行	18.5	22.3	55,170
大分銀行	7.6	7.9	19,947
宮崎銀行	8.3	9.1	21,284
佐賀銀行	7.7	8.3	9,254
沖縄銀行	11.1	12.5	41,375
琉球銀行	28.2	31.5	30,555
セブン銀行	405.3	456.2	140,053
みずほフィナンシャルグループ	16,185.5	18,556.6	2,495,862
高知銀行	4.3	5	3,635
山口フィナンシャルグループ	149.7	170.5	109,802
長野銀行	4.5	4.5	5,197
名古屋銀行	9.9	10.2	24,072
北洋銀行	182.9	205.9	41,797
愛知銀行	4.5	4.9	14,798
中京銀行	5.3	5.6	11,978
大光銀行	4.6	4.7	7,214
愛媛銀行	17.4	19.1	22,767
トマト銀行	5.5	5.3	5,543

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)
京葉銀行	54	58.2	30,147
栃木銀行	66.3	66	10,956
北日本銀行	4.2	4.3	8,496
東和銀行	20.8	24	16,992
福島銀行	7.3	12.9	2,347
大東銀行	5.7	7.1	4,842
トモニホールディングス	94.4	105.6	36,643
フィデアホールディングス	115.1	132.6	14,188
池田泉州ホールディングス	130.4	157	26,533
証券、商品先物取引業(0.8%)			
ＦＰＧ	37.5	42.4	25,779
マーキュリアインベストメント	4.7	6.4	3,596
ＳＢＩホールディングス	142	152.6	352,353
ジャフコ	19.6	21	76,020
大和証券グループ本社	956	1,096.2	489,672
野村ホールディングス	2,096.2	2,403.3	1,112,487
岡三証券グループ	101.8	116.9	40,915
丸三証券	35.6	41	18,655
東洋証券	43.3	50.2	6,726
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142.4	157.5	39,690
光世証券	3	3.6	1,879
水戸証券	34.9	40.4	8,322
いちよし証券	25	25.9	11,888
松井証券	58.4	78.2	66,235
だいこう証券ビジネス	5.1	6.8	6,242
マネックスグループ	110.2	101	24,240
カブドットコム証券	86.9	－	－
極東証券	16.1	18.7	9,854
岩井コスモホールディングス	12.3	13.1	12,903
藍澤證券	21.6	24.8	17,211
マネーパートナーズグループ	14.3	15.4	3,280
スパークス・グループ	47.4	63.9	14,185
保険業(2.1%)			
かんぽ生命保険	45	48.4	66,211
ＳＯＭＰＯホールディングス	210	256.8	984,057
アニコム　ホールディングス	9.8	11.3	60,116
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	311.4	357.1	1,130,221
ソニーフィナンシャルホールディングス	97.9	112.2	291,271
第一生命ホールディングス	673.9	772.8	1,084,238
東京海上ホールディングス	425.9	482.8	2,253,710
Ｔ＆Ｄホールディングス	368.4	408.2	397,178
アドバンスクリエイト	2.8	2.8	6,412
その他金融業(1.1%)			
全国保証	33.6	38.5	159,582
ジェイリース	3.3	3.8	1,554
イントラスト	3.3	4.8	3,571
日本モーゲージサービス	2.1	2.8	5,602
Ｃａｓａ	5.4	4.8	6,000

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)
アルヒ	10.8	21.7	32,419
プレミアグループ	6.8	7.4	14,467
クレディセゾン	83.4	95.7	122,783
芙蓉総合リース	13.6	14.3	88,374
みずほリース	22.4	21.1	50,133
東京センチュリー	24	27.5	128,837
日本証券金融	52.5	60.2	30,401
アイフル	181.7	208.3	55,616
リコーリース	9.4	10.7	33,544
イオンフィナンシャルサービス	76.1	83.6	101,406
アコム	239.4	274.5	120,505
ジャックス	13.2	15.1	28,508
オリエントコーポレーション	322.2	369.4	47,283
日立キャピタル	28.1	32.2	73,222
アプラスフィナンシャル	56.9	65.5	4,519
オリックス	794.7	854.1	1,220,508
三菱ＵＦＪリース	268.7	346.6	182,311
九州リースサービス	5.8	6.7	3,283
日本取引所グループ	321.8	392	908,264
イー・ギャランティ	11.2	14.6	31,886
アサックス	4.9	7.1	4,529
ＮＥＣキャピタルソリューション	4.8	5.6	11,379
不動産業(2.1%)			
いちご	155.2	180.3	55,352
日本駐車場開発	138	149.1	21,023
スター・マイカ・ホールディングス	－	8.3	12,433
ＡＤワークスグループ	－	25.3	4,705
ヒューリック	250	293.5	319,915
三栄建築設計	5.6	7.1	8,548
スター・マイカ	6.4	－	－
野村不動産ホールディングス	79.9	83.9	167,296
三重交通グループホールディングス	26.2	31.7	15,120
サムティ	17.4	20.8	30,534
ディア・ライフ	18.3	23.6	11,210
コーセーアールイー	5.2	－	－
エー・ディー・ワークス	115	－	－
日本商業開発	8.3	10	15,280
プレサンスコーポレーション	19.8	－	－
ユニゾホールディングス	18.7	－	－
ハウスコム	－	3.8	5,099
日本管理センター	9	10.7	12,936
サンセイランディック	4.9	6.4	5,574
エストラスト	1.2	－	－
フージャースホールディングス	21.2	27.2	16,755
オープンハウス	17.5	40.4	120,311
東急不動産ホールディングス	322.4	375	204,750
飯田グループホールディングス	100.1	115.2	184,320
イーグランド	3.6	5.1	3,386

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)
ムゲンエステート	10.5	13.2	7,048
ファーストブラザーズ	4.4	－	－
ハウスドゥ	6.6	6.7	6,880
シーアールイー	4.2	4.9	5,782
ケイアイスター不動産	4.1	－	－
グッドコムアセット	3.6	4.5	7,429
ジェイ・エス・ビー	0.9	3.7	8,757
テンポイノベーション	2.2	5.6	4,060
パーク２４	70.2	74.3	155,361
パラカ	3.7	4.7	8,460
三井不動産	632.4	674.5	1,398,575
三菱地所	835.1	958	1,641,054
平和不動産	23.1	25.7	75,686
東京建物	131.2	145.3	201,821
ダイビル	36.4	37.1	38,955
京阪神ビルディング	22.4	23.3	34,833
住友不動産	268.1	307.7	918,330
テーオーシー	29.2	29.7	20,790
東京楽天地	2	2.7	12,258
スターツコーポレーション	16.7	19.5	42,724
フジ住宅	16.8	19.5	10,276
空港施設	16.4	18.1	7,927
明和地所	8.9	11.9	5,081
ゴールドクレスト	10.1	12	18,936
エスリード	5.5	6.7	10,150
日神グループホールディングス	20.4	25	10,275
日本エスコン	23.4	24.7	19,932
タカラレーベン	57.8	62.4	23,400
ＡＶＡＮＴＩＡ	8.1	10.3	8,075
イオンモール	60.5	69.8	105,747
毎日コムネット	4.2	5.8	4,843
ファースト住建	5.5	7.9	7,260
カチタス	13.6	34.7	83,453
トーセイ	17.8	20.7	22,169
穴吹興産	1.7	4.2	7,303
サンフロンティア不動産	17.7	21.1	19,876
エフ・ジェー・ネクスト	11.7	14.2	12,538
インテリックス	5.1	3.8	1,987
ランドビジネス	5	4.6	1,614
日本社宅サービス	－	6	6,636
グランディハウス	13.2	15.6	6,162
日本空港ビルデング	38.3	44	208,560
サービス業(5.4%)			
日本工営	7.8	8.9	29,325
ＬＩＦＵＬＬ	40.5	46.5	19,762
ジェイエイシーリクルートメント	9.3	9	12,429
日本M＆Aセンター	86.1	100	433,000
メンバーズ	3.9	4	7,320

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)
中広	1.5	2.1	1,117
ＵＴグループ	－	20.9	42,218
アイティメディア	2.6	5.4	5,740
タケエイ	12.1	12.8	12,377
Ｅ・Ｊホールディングス	1.6	2.4	3,748
ビーネックスグループ	6.4	16.7	13,677
コシダカホールディングス	27.9	32.1	17,237
アルトナー	3	3.4	2,611
パソナグループ	14.2	14.4	18,432
ＣＤＳ	3	3.4	4,508
リンクアンドモチベーション	21.4	29.5	13,393
ＧＣＡ	11.8	16.2	10,627
エス・エム・エス	42.5	41.2	110,292
サニーサイドアップグループ	1.3	4.7	3,896
パーソルホールディングス	115.4	132.4	188,670
リニカル	6.6	6.5	6,175
クックパッド	36.5	46.6	14,632
エスクリ	3.3	4.4	1,971
アイ・ケイ・ケイ	5.8	6.7	4,073
学情	4.8	4.8	6,393
スタジオアリス	5.9	6.7	10,974
シミックホールディングス	6.5	6.6	10,071
エプコ	－	2.9	3,352
ＮＪＳ	2.6	3	5,364
綜合警備保障	45.9	52.7	279,310
カカクコム	86.5	97.8	254,866
アイロムグループ	4.4	4.7	10,753
セントケア・ホールディング	8.7	8.9	3,835
サイネックス	2.2	2.4	1,596
ルネサンス	6.5	7.5	8,820
ディップ	18.7	18.7	47,591
オプトホールディング	7.2	7.3	11,161
ツクイ	27.5	31.4	15,794
キャリアデザインセンター	3	3.2	3,145
ベネフィット・ワン	32	48.2	113,462
エムスリー	243	291.8	1,266,412
ツカダ・グローバルホールディング	7.6	8.7	3,654
ブラス	1.5	1.9	1,069
アウトソーシング	61	75.9	48,044
ウェルネット	11.1	13.5	9,639
ワールドホールディングス	3.3	4.6	8,303
ディー・エヌ・エー	62.3	64.9	96,052
博報堂ＤＹホールディングス	160.5	184.1	246,509
ぐるなび	16.6	23.2	15,288
タカミヤ	12.1	14.3	7,150
ジャパンベストレスキューシステム	7.8	10.4	9,120
ファンコミュニケーションズ	31.9	36.7	17,469
ライク	4.7	4.4	7,066

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)
ビジネス・ブレークスルー	5.2	5.9	2,236
エスプール	－	34.1	25,745
ＷＤＢホールディングス	5.3	6.1	16,463
手間いらず	－	0.9	4,279
ティア	6.9	8	4,296
ＣＤＧ	1.2	1.5	2,320
バリューコマース	7.8	7.5	20,205
インフォマート	63.3	145.1	131,170
ＪＰホールディングス	33.3	42	11,886
エコナックホールディングス	21.9	25.2	2,520
ＥＰＳホールディングス	17.4	18	19,944
レッグス	3	3.4	3,532
プレステージ・インターナショナル	21.7	49.7	47,314
アミューズ	7	7.3	17,541
ドリームインキュベータ	3.6	4.1	6,338
クイック	7.2	8.3	10,391
ＴＡＣ	7	8.7	1,609
ケネディクス	101.6	123.5	72,371
電通グループ	140.6	136.4	393,514
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.5	5.2	3,536
ぴあ	3.3	3.8	14,421
イオンファンタジー	3.8	5.2	9,906
シーティーエス	13.2	15.1	10,690
ネクシィーズグループ	4.1	4.2	4,548
みらかホールディングス	32.3	37.1	92,972
アルプス技研	10.2	11.8	22,939
ダイオーズ	2.8	2.7	3,061
日本空調サービス	13.2	14	10,164
オリエンタルランド	136.4	140.7	2,197,030
ダスキン	29.7	32.9	97,055
明光ネットワークジャパン	13.7	16.9	14,534
ファルコホールディングス	6.4	7.4	12,321
ラウンドワン	35.9	37.1	34,020
リゾートトラスト	48.9	60.7	82,066
ビー・エム・エル	14.9	17.1	51,898
ワタベウェディング	2.1	2.5	1,070
りらいあコミュニケーションズ	21	24	29,400
リソー教育	58.9	60.9	18,574
早稲田アカデミー	3.5	5.9	5,782
ユー・エス・エス	141	148.2	278,319
東京個別指導学院	4.2	4.9	2,979
サイバーエージェント	66.4	81.5	442,545
楽天	538	616.8	601,996
クリーク・アンド・リバー社	6.9	7	7,420
テー・オー・ダブリュー	10.2	21.4	7,597
山田コンサルティンググループ	5.7	8.7	11,449
セントラルスポーツ	4.3	5	13,000
フルキャストホールディングス	11.6	13.3	21,027

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)
エン・ジャパン	16.8	23.6	68,581
リソルホールディングス	1.3	1.5	5,385
テクノプロ・ホールディングス	23.2	26.4	170,280
アトラ	2.8	3.5	941
インターワークス	2.4	2.9	1,142
アイ・アールジャパンホールディングス	4.7	5.4	51,570
ＫｅｅＰｅｒ技研	4.3	5	8,205
ファーストロジック	2.9	2.8	1,713
三機サービス	2.5	2.7	2,986
Ｇｕｎｏｓｙ	8.1	8.4	7,778
デザインワン・ジャパン	2.7	4.4	1,174
イー・ガーディアン	5.9	5.9	15,015
リブセンス	6.9	9	2,529
ジャパンマテリアル	31.7	40.8	71,563
ベクトル	14.2	16.6	14,159
ウチヤマホールディングス	5.9	6.9	2,608
チャーム・ケア・コーポレーション	3.8	11.4	10,225
ライクキッズ	2.9	2.4	1,773
キャリアリンク	4.6	4.6	2,640
ＩＢＪ	7.9	9.2	7,746
アサンテ	4.7	5.4	8,310
Ｎ・フィールド	7.6	9.3	4,975
バリューＨＲ	2.5	5.3	7,753
M&Aキャピタルパートナーズ	4.1	10.8	43,254
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.9	5.1	8,670
ＥＲＩホールディングス	3.4	3.9	2,624
アビスト	1.8	2.1	5,142
シグマクシス	5.6	9.1	17,371
ウィルグループ	7.7	8.8	6,406
エスクロー・エージェント・ジャパン	16.3	18.9	3,855
日本ビューホテル	3.8	－	－
リクルートホールディングス	826.7	947.9	3,516,709
エラン	8	7.9	14,212
土木管理総合試験所	5.3	6.1	2,360
ネットマーケティング	－	5.3	3,614
日本郵政	946	1,084.6	850,434
ベルシステム24ホールディングス	19.4	22.3	30,261
鎌倉新書	8.5	10.1	12,089
ＳＭＮ	1.6	3	2,739
一蔵	1.5	1.8	770
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2.7	4.6	12,939
グローバルキッズCOMPANY	1.9	2.6	1,622
エアトリ	5	6.9	8,659
アトラエ	3	4	12,860
ストライク	4.4	5	24,000
ソラスト	28.4	36.6	45,676
セラク	3.8	4.3	4,205
インソース	4.5	5.5	15,994

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)
ベイカレント・コンサルティング	8.2	8	60,560
Orchestra Holdings	2.1	2.9	3,735
アイモバイル	3.8	4.9	3,660
キャリアインデックス	4.1	5.8	1,943
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	4.8	4.4	3,964
船場	2	2.3	2,219
グレイステクノロジー	4.2	6.1	26,443
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	9.1	14	46,550
フルテック	1.7	2	2,612
グリーンズ	4.4	3.6	1,983
ツナググループ・ホールディングス	1.6	2.5	1,190
ＧａｍｅＷｉｔｈ	－	4.1	2,730
ソウルドアウト	1.2	2.8	6,210
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	2	2.7	1,746
ミダック	－	1.8	2,959
日総工産	7.7	9	6,345
キュービーネットホールディングス	7	5.5	11,792
ＲＰＡホールディングス	2.3	10.2	9,353
スプリックス	3.9	3.9	3,494
マネジメントソリューションズ	－	5.9	6,372
プロレド・パートナーズ	－	1.8	9,432
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	－	1.4	1,759
ギークス	－	1.5	2,040
カーブスホールディングス	－	36.5	24,126
フォーラムエンジニアリング	－	7	6,426
アドバンテッジリスクマネジメント	4.7	6.8	6,140
リログループ	63.1	72.4	178,176
東祥	7.2	8.3	11,769
エイチ・アイ・エス	20.6	20.6	40,726
ラックランド	2.4	3.1	6,513
共立メンテナンス	17.7	22	75,680
イチネンホールディングス	12.1	14.9	18,222
建設技術研究所	8.1	9.2	16,173
スペース	7.6	8.7	8,813
長大	4.8	5.4	5,562
燦ホールディングス	2.6	5.9	6,962
スバル興業	0.8	0.8	6,296
東京テアトル	4.6	5.3	6,752
タナベ経営	2.3	2.6	3,335
ナガワ	3.2	4.2	33,600
よみうりランド	2.5	2.9	10,875
東京都競馬	7.6	8.7	30,841
カナモト	17.3	21.7	50,387
東京ドーム	43.3	53.7	48,330
西尾レントオール	11.8	12.3	29,151
トランス・コスモス	12.9	12.6	31,941
乃村工藝社	54	56.8	55,436
藤田観光	4.6	5.8	10,950
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	6.1	8.2	9,913
日本管財	12.4	14.2	26,341
トーカイ	11.2	12.8	35,212
白洋舎	1.4	1.6	4,608
セコム	122.5	140.4	1,310,493
セントラル警備保障	5.6	6.4	29,024
丹青社	21.9	25.2	18,975
メイテック	14.3	16.2	84,240
応用地質	12.5	14.3	19,204
船井総研ホールディングス	23.9	27.4	69,459
進学会ホールディングス	5.5	5.4	2,786
オオバ	9.2	9.6	6,297
いであ	2.4	3.3	5,857
学究社	3.9	4	4,520
ベネッセホールディングス	42.3	44.1	128,639
イオンディライト	14.3	16.3	50,285
ナック	7.4	7.5	6,945
ニチイ学館	16.5	18.9	30,901
ダイセキ	19.4	22.2	62,359
ステップ	4.3	4.9	7,154
合計 株数・金額	140,334	162,264	304,033,610
合計 銘柄数＜比率＞	2,078	2,102	＜97.0%＞

(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。

＜国内新株予約権証券＞

銘柄	当期首(前期末) 証券数(証券)	当期末 証券数(証券)	当期末 評価額(千円)
千葉興業銀行第７回新株予約権	－	38,100	－
合計 証券数・金額	－	38,100	－
合計 銘柄数＜比率＞	－	1	＜－%＞

(注)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	5,440	－

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	304,033,610	96.9
コール・ローン等、その他	9,854,107	3.1
投資信託財産総額	313,887,717	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 2020年5月29日現在
(A)資産	**314,236,713,295円**
コール・ローン等	3,890,233,378
株式(評価額)	304,033,610,080
未収入金	3,121,635,512
未収配当金	3,191,234,325
(B)負債	**788,647,808**
前受金	362,427,200
未払金	72,987,000
未払解約金	353,225,006
未払利息	8,602
(C)純資産総額(A-B)	**313,448,065,487**
元本	212,335,378,830
次期繰越損益金	101,112,686,657
(D)受益権総口数	**212,335,378,830口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**14,762円**

■損益の状況

項目	当期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配当等収益	**7,604,285,657円**
受取配当金	7,602,413,988
受取利息	9,261
その他収益金	3,857,899
支払利息	△1,995,491
(B)有価証券売買損益	**8,380,434,231**
売買益	32,786,368,842
売買損	△24,405,934,611
(C)先物取引等取引損益	**494,851,340**
取引益	1,325,902,390
取引損	△831,051,050
(D)その他費用	**△2,167**
(E)当期損益金(A+B+C+D)	**16,479,569,061**
(F)前期繰越損益金	**79,635,221,720**
(G)追加信託差損益金	**22,559,756,391**
(H)解約差損益金	**△17,561,860,515**
(I)計 (E+F+G+H)	**101,112,686,657**
次期繰越損益金(I)	**101,112,686,657**

(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192,648,275,463円、期中追加設定元本額は57,404,489,163円、期中一部解約元本額は37,717,385,796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)	51,398,165,781円
DCマイセレクション50	20,076,868,336円
DCマイセレクション75	18,038,129,668円
分散投資コア戦略ファンドS	15,498,874,548円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	13,556,829,429円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,597,759,896円
DCマイセレクションS50	8,608,682,819円
DCマイセレクション25	7,529,986,081円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,030,044,149円
DC日本株式インデックス・オープン	5,859,526,247円
分散投資コア戦略ファンドA	5,599,750,637円
DCマイセレクションS75	5,385,777,867円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,930,460,291円
日本株式インデックス・オープン	4,272,449,559円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,086,047,882円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,052,532,100円
DCマイセレクションS25	3,227,803,983円
DC世界経済インデックスファンド	2,894,315,806円
世界経済インデックスファンド	2,238,030,171円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,083,123,000円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,672,213,786円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,064,693,052円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632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)	856,763,230円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	774,615,025円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,749,358円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	685,206,125円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	631,511,562円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	584,094,810円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	573,894,818円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405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)	557,996,502円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	468,469,284円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	449,394,641円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	345,589,296円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	342,138,642円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	322,645,065円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	295,806,428円
グローバル経済コア	269,825,330円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	262,532,624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)	262,426,915円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	239,188,128円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,812,783円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	76,211,965円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	74,781,332円
SMT インデックスバランス・オープン	67,960,476円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	55,956,109円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,628,155円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	49,383,233円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,561,470円

世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	40,131,391円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	36,718,016円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,958,991円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,642,992円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	30,632,949円
SMT 世界経済インデックス・オープン	22,297,368円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	18,089,720円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	16,669,302円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,227,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	13,088,994円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	11,959,698円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,032,673円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,775,748円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,529,303円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,628,611円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	192,405円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	123,495円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	76,163円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	63,745円

お知らせ

該当事項はありません。

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23期（決算日　2020年3月9日）
第24期（決算日　2020年5月7日）
第25期（決算日　2020年7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。

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

ホームページ　https://www.smtam.jp/

■口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
■当運用報告書についてのお問い合わせ
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。）

＜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 (分配落)	税込分配金	期中騰落率	ベンチマーク	期中騰落率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		円	円	%		%	%	%	百万円
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
第9	第23期(2020年 3月9日)	10,256	11	1.5	10,555	1.5	99.2	－	109,693
	第24期(2020年 5月7日)	10,072	7	△1.7	10,375	△1.7	99.7	－	99,971
	第25期(2020年 7月7日)	9,994	9	△0.7	10,306	△0.7	99.7	0.0	101,147

(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。

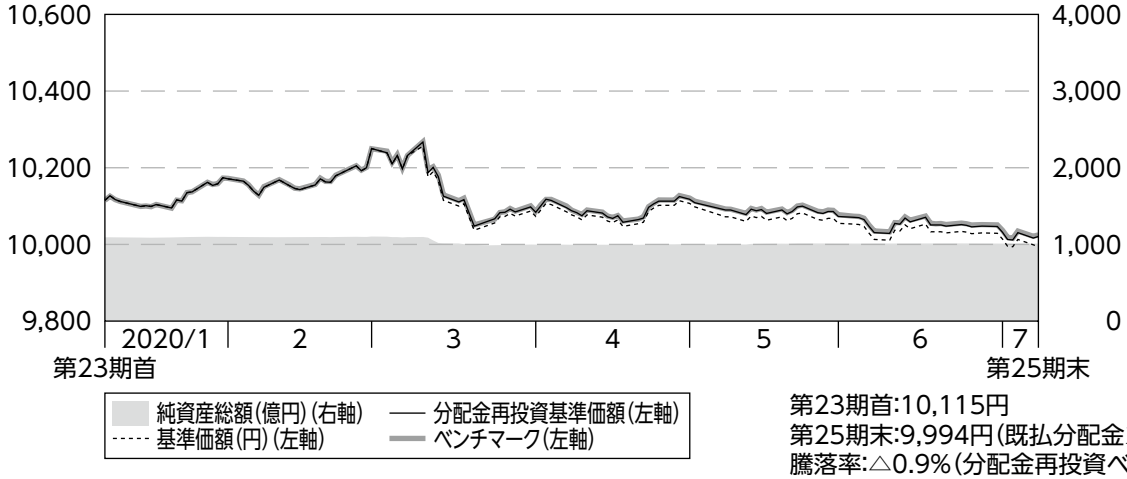
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年　月　日	基準価額	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23期	(期　首)2020年1月7日	10,115	－	10,398	－	99.7	0.0
	1月末	10,171	0.6	10,457	0.6	99.7	－
	2月末	10,250	1.3	10,537	1.3	99.7	－
	(期　末)2020年3月9日	10,267	1.5	10,555	1.5	99.2	－
第24期	(期　首)2020年3月9日	10,256	－	10,555	－	99.2	－
	3月末	10,073	△1.8	10,368	△1.8	99.8	－
	4月末	10,107	△1.5	10,404	△1.4	99.8	－
	(期　末)2020年5月7日	10,079	△1.7	10,375	△1.7	99.7	－
第25期	(期　首)2020年5月7日	10,072	－	10,375	－	99.7	－
	5月末	10,055	△0.2	10,360	△0.1	100.4	－
	6月末	10,014	△0.6	10,318	△0.5	99.8	－
	(期　末)2020年7月7日	10,003	△0.7	10,306	△0.7	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



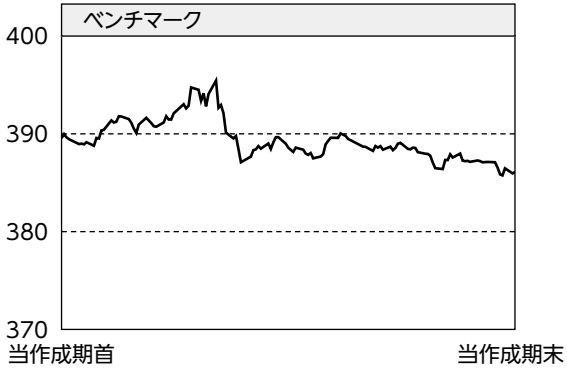
第23期首:10,115円
第25期末:9,994円(既払分配金27円)
騰落率:△0.9%(分配金再投資ベース)

(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、2020年1月7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、2020年2月中旬にかけて、米中通商協議の動向等により、国内金利が一進一退の動きとなったことから、もみ合い推移が続きました。2月下旬から3月上旬にかけて、中国で新型コロナウイルスの感染が拡大し、中国向け輸出やインバウンド需要の減少による国内景気の減速懸念、さらにグローバルなリスク回避姿勢の高まりなどから、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。3月中旬に、新型コロナウイルス感染の世界的な拡大を受けた財政出動への期待の高まりによる国債の増発懸念から、国内金利が急上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しましたが、3月下旬には主要中央銀行による金融緩和の強化を背景に市場の不安心理が和らぎ金利上昇幅が縮小し、基準価額は下げ止まりました。4月以降は、原油先物価格の急落や日銀による金融緩和の強化表明により低金利環境のさらなる長期化が意識された一方で、国債の増発懸念から国内金利のレンジ内推移が続き、基準価額はもみ合い推移となりました。

投資環境



国内金利は、2020年2月中旬にかけて、一進一退の動きとなりました。2月下旬から3月上旬にかけて、中国での新型コロナウイルスの感染が拡大し、中国向け輸出やインバウンド需要の減少による国内景気の減速懸念などから、国内金利は低下しました。3月中旬に、新型コロナウイルス感染の世界的な拡大を受けた財政出動への期待の高まりによる国債の増発懸念から、国内金利が急上昇しましたが、3月下旬には、主要中央銀行による金融緩和の強化を背景に市場の不安心理が和らぎ、金利上昇幅は縮小しました。4月以降は、低金利環境のさらなる長期化が意識された一方で、国債の増発懸念などから、国内金利はレンジ内推移が続きました。

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。

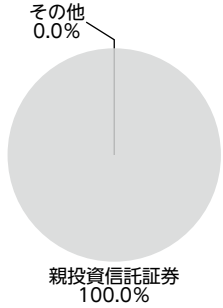
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

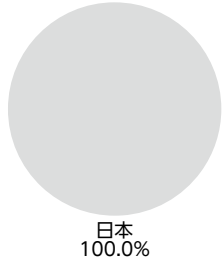
	当作成期末
	2020年7月7日
国内債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

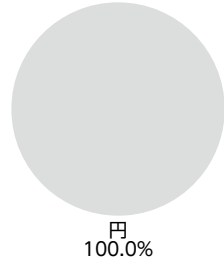
○資産別配分



○国別配分



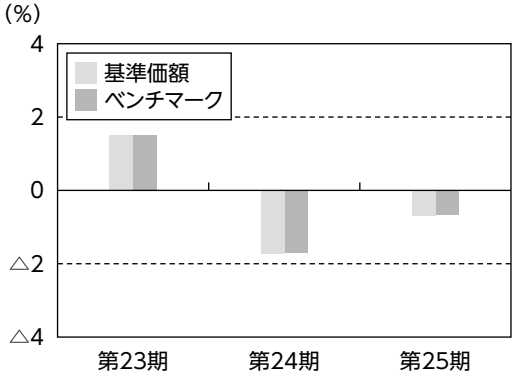
○通貨別配分



(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23期 2020年1月8日～2020年3月9日	第24期 2020年3月10日～2020年5月7日	第25期 2020年5月8日～2020年7月7日
当期分配金	（円）	11	7	9
（対基準価額比率）	（％）	(0.107)	(0.069)	(0.090)
当期の収益	（円）	11	7	9
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	572	576	577

（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 (2020年1月8日~2020年7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10,111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)	(0.038)	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	2,261,664	3,201,133	7,312,523	10,440,037

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	10	10	100.0	10	10	100.0
コール・ローン	7,557	1,223	16.2	7,538	1,200	15.9

(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	510	510	100.0	510	510	100.0
コール・ローン	169,406	23,109	13.6	172,195	22,973	13.3

〈平均保有割合　18.8%〉
(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	76,934,333	71,883,475	101,096,919

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、389,520,493千口です。

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	101,096,919	99.8
コール・ローン等、その他	160,562	0.2
投資信託財産総額	101,257,481	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 23 期 末 2020年3月9日現在	第 24 期 末 2020年5月7日現在	第 25 期 末 2020年7月7日現在
(A)資産	**109,922,408,707円**	**100,059,497,754円**	**101,257,481,334円**
コール・ローン等	73,737,281	78,022,046	93,782,733
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	109,639,149,714	99,911,864,065	101,096,919,623
未収入金	209,521,712	69,611,612	66,778,978
未収利息	－	31	－
(B)負債	**228,598,685**	**87,635,526**	**110,009,624**
未払収益分配金	117,649,568	69,478,126	91,088,724
未払解約金	90,184,999	－	－
未払信託報酬	20,410,379	17,828,258	18,579,697
未払利息	159	－	81
その他未払費用	353,580	329,142	341,122
(C)純資産総額(A-B)	**109,693,810,022**	**99,971,862,228**	**101,147,471,710**
元本	106,954,153,442	99,254,466,570	101,209,694,297
次期繰越損益金	2,739,656,580	717,395,658	△62,222,587
(D)受益権総口数	**106,954,153,442口**	**99,254,466,570口**	**101,209,694,297口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**10,256円**	**10,072円**	**9,994円**

■損益の状況

項目	第 23 期 自 2020年1月8日 至 2020年3月9日	第 24 期 自 2020年3月10日 至 2020年5月 7日	第 25 期 自 2020年5月8日 至 2020年7月7日
(A)配当等収益	**△3,589円**	**△5,381円**	**△5,653円**
受取利息	52	91	78
支払利息	△3,641	△5,472	△5,731
(B)有価証券売買損益	**1,644,971,782**	**△1,724,416,303**	**△680,325,073**
売買益	1,672,381,592	75,949,638	4,584
売買損	△27,409,810	△1,800,365,941	△680,329,657
(C)信託報酬等	**△20,763,959**	**△18,157,400**	**△18,920,819**
(D)当期損益金(A+B+C)	**1,624,204,234**	**△1,742,579,084**	**△699,251,545**
(E)前期繰越損益金	**863,772,130**	**2,183,129,816**	**371,067,770**
(F)追加信託差損益金	**369,329,784**	**346,323,052**	**357,049,912**
(配当等相当額)	(2,962,360,664)	(2,771,300,003)	(2,884,204,638)
(売買損益相当額)	(△2,593,030,880)	(△2,424,976,951)	(△2,527,154,726)
(G)計(D+E+F)	**2,857,306,148**	**786,873,784**	**28,866,137**
(H)収益分配金	**△117,649,568**	**△69,478,126**	**△91,088,724**
次期繰越損益金(G+H)	**2,739,656,580**	**717,395,658**	**△62,222,587**
追加信託差損益金	369,329,784	346,323,052	357,049,912
(配当等相当額)	(2,962,488,350)	(2,771,525,085)	(2,884,713,173)
(売買損益相当額)	(△2,593,158,566)	(△2,425,202,033)	(△2,527,663,261)
分配準備積立金	3,162,527,201	2,946,546,033	2,962,731,572
繰越損益金	△792,200,405	△2,575,473,427	△3,382,004,071

(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23期首元本額は107,972,714,448円、第23～25期中追加設定元本額は3,249,409,773円、第23～25期中一部解約元本額は10,012,429,924円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　23　期	第　24　期	第　25　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	135,495,995円	103,258,106円	107,312,657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	2,962,488,350円	2,771,525,085円	2,884,713,173円
(D) 分配準備積立金額	3,144,680,774円	2,912,766,053円	2,946,507,639円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	6,242,665,119円	5,787,549,244円	5,938,533,469円
(F) 期末残存口数	106,954,153,442口	99,254,466,570口	101,209,694,297口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	583円	583円	586円
(H) 分配金額(1万口当たり)	11円	7円	9円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	117,649,568円	69,478,126円	91,088,724円

分配金のお知らせ

	第23期	第24期	第25期
1万口当たり分配金	11円	7円	9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20期（決算日　2020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
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388.127	△0.5	100.5	－	540,159

(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) 2019年 5月29日	14,211	－	390.052	－	99.7	0.0
5月末	14,221	0.1	390.322	0.1	99.7	－
6月末	14,306	0.7	392.695	0.7	99.8	－
7月末	14,322	0.8	393.155	0.8	99.7	－
8月末	14,514	2.1	398.496	2.2	99.7	－
9月末	14,359	1.0	394.271	1.1	99.8	0.0
10月末	14,301	0.6	392.608	0.7	99.7	－
11月末	14,251	0.3	391.325	0.3	99.7	0.0
12月末	14,208	△0.0	390.136	0.0	100.1	－
2020年 1月末	14,268	0.4	391.771	0.4	99.7	－
2月末	14,380	1.2	394.745	1.2	99.7	－
3月末	14,149	△0.4	388.450	△0.4	99.9	－
4月末	14,197	△0.1	389.790	△0.1	99.9	－
(当期末) 2020年 5月29日	14,136	△0.5	388.127	△0.5	100.5	－

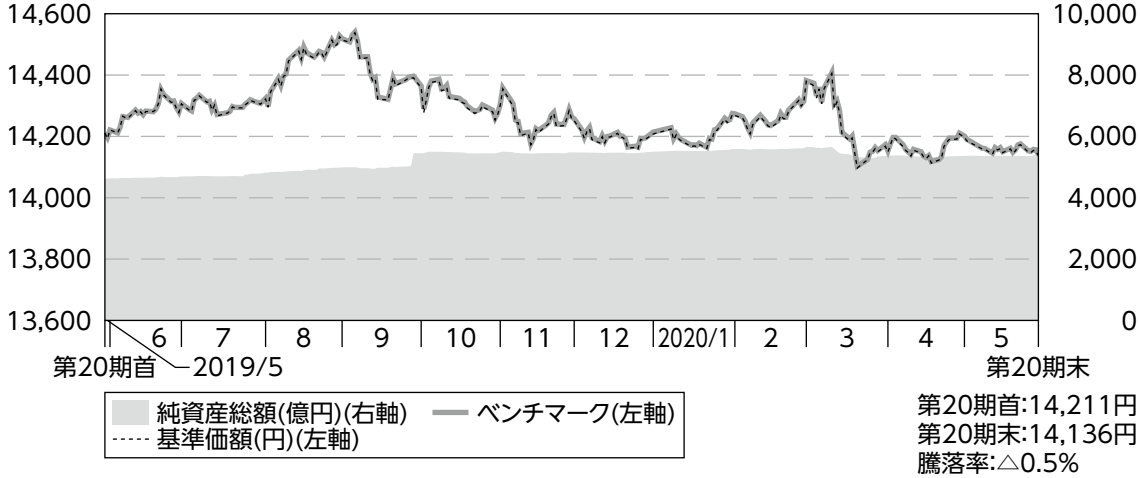
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2019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

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2020年1月中旬にかけて、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、米金利上昇に影響を受けて国内金利が上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額は下落しました。1月下旬から3月上旬にかけて、中国で新型コロナウイルスの感染が拡大し、インバウンド需要の減少による国内景気の減速懸念、さらにグローバルなリスク回避姿勢の高まりなどから、国内金利が低下し、基準価額は上昇しました。3月中旬に、新型コロナウイルス感染拡大を受けた財政出動による国債増発への懸念から国内金利が一旦急上昇し、基準価額は下落しましたが、3月下旬には、日銀の大規模な国債買い入れオペ実施により国内金利が低下に転じ、基準価額の下落は収まりました。4月以降は、基準価額はレンジ内推移となりました。

投資環境

国内金利は、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、低下しました。9月中旬以降2020年1月中旬にかけて、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たことから国内金利は上昇しましたが、1月下旬から3月上旬にかけては、中国で新型コロナウイルスの感染が拡大しインバウンド需要の減少による国内景気の減速懸念などから、低下しました。3月中旬に、新型コロナウイルス感染拡大を受けた財政出動による国債増発への懸念から国内金利は一旦急上昇しましたが、3月下旬には日銀の大規模な国債買い入れオペ実施により低下に転じ、4月以降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、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。

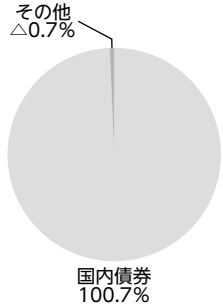
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

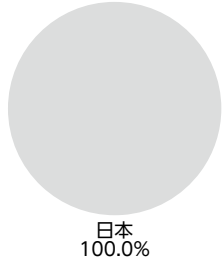
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第138回利付国債(5年)	日本	1.8%
2	第140回利付国債(5年)	日本	1.4%
3	第344回利付国債(10年)	日本	1.3%
4	第137回利付国債(5年)	日本	1.3%
5	第340回利付国債(10年)	日本	1.2%
6	第342回利付国債(10年)	日本	1.2%
7	第142回利付国債(5年)	日本	1.1%
8	第134回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第141回利付国債(5年)	日本	1.1%
10	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%
組入銘柄数		924	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

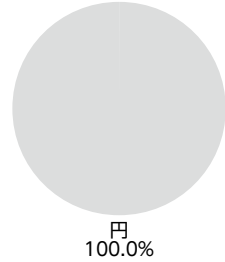
○資産別配分



○国別配分



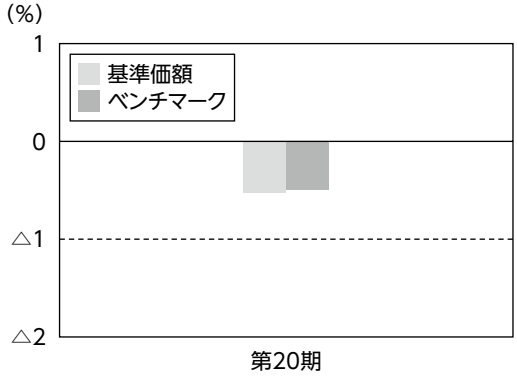
○通貨別配分



(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 (2019年5月30日~2020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(14,289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	179,904,416	104,571,764
	地方債証券	8,327,272	4,426,367
	特殊債券	13,007,698	6,598,900 (560,845)
	社債券(投資法人債券を含む)	7,754,408	3,325,991 (100,000)

(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	37,124	37,274	ー	ー

(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	693	693	100.0	184	184	100.0
コール・ローン	421,215	73,246	17.4	422,632	74,036	17.5

(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	418,120,000 (4,080,000)	454,188,617 (4,110,967)	84.1 (0.8)	－ (－)	56.7 (－)	20.8 (0.8)	6.6 (－)
地方債証券	27,459,430 (27,459,430)	28,860,716 (28,860,716)	5.3 (5.3)	－ (－)	3.5 (3.5)	1.3 (1.3)	0.6 (0.6)
特殊債券 (除く金融債)	33,023,820 (33,023,820)	34,708,788 (34,708,788)	6.4 (6.4)	－ (－)	4.1 (4.1)	1.6 (1.6)	0.7 (0.7)
金融債券	2,300,000 (2,300,000)	2,301,003 (2,301,003)	0.4 (0.4)	－ (－)	0.0 (0.0)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	22,366,000 (22,366,000)	22,648,161 (22,648,161)	4.2 (4.2)	－ (－)	1.9 (1.9)	1.7 (1.7)	0.6 (0.6)
合計	503,269,250 (89,229,250)	542,707,286 (92,629,636)	100.5 (17.1)	－ (－)	66.1 (9.4)	25.7 (5.6)	8.7 (2.1)

(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４０２回利付国債（２年）	0.1	500,000	501,435	2021/7/1
第４０３回利付国債（２年）	0.1	3,690,000	3,701,402	2021/8/1
第４０４回利付国債（２年）	0.1	460,000	461,527	2021/9/1
第４０５回利付国債（２年）	0.1	470,000	471,696	2021/10/1
第４０６回利付国債（２年）	0.1	780,000	782,995	2021/11/1
第４０７回利付国債（２年）	0.1	360,000	361,432	2021/12/1
第４０８回利付国債（２年）	0.1	690,000	692,904	2022/1/1
第４０９回利付国債（２年）	0.1	2,670,000	2,681,854	2022/2/1
第４１０回利付国債（２年）	0.1	390,000	391,809	2022/3/1
第４１２回利付国債（２年）	0.1	780,000	784,040	2022/5/1
第１２９回利付国債（５年）	0.1	3,340,000	3,351,322	2021/9/20
第１３０回利付国債（５年）	0.1	3,160,000	3,172,766	2021/12/20
第１３１回利付国債（５年）	0.1	4,990,000	5,013,403	2022/3/20
第１３２回利付国債（５年）	0.1	4,770,000	4,795,996	2022/6/20
第１３３回利付国債（５年）	0.1	4,380,000	4,406,805	2022/9/20
第１３４回利付国債（５年）	0.1	6,050,000	6,091,079	2022/12/20
第１３５回利付国債（５年）	0.1	4,080,000	4,110,967	2023/3/20
第１３６回利付国債（５年）	0.1	4,140,000	4,174,279	2023/6/20

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１３７回利付国債（５年）	0.1	6,900,000	6,959,547	2023/9/20
第１３８回利付国債（５年）	0.1	9,420,000	9,505,816	2023/12/20
第１３９回利付国債（５年）	0.1	4,380,000	4,421,829	2024/3/20
第１４０回利付国債（５年）	0.1	7,300,000	7,372,854	2024/6/20
第１４１回利付国債（５年）	0.1	6,020,000	6,082,547	2024/9/20
第１４２回利付国債（５年）	0.1	6,050,000	6,115,098	2024/12/20
第１４３回利付国債（５年）	0.1	2,000,000	2,022,200	2025/3/20
第１回利付国債（４０年）	2.4	400,000	600,140	2048/3/20
第２回利付国債（４０年）	2.2	1,130,000	1,648,884	2049/3/20
第３回利付国債（４０年）	2.2	550,000	809,286	2050/3/20
第４回利付国債（４０年）	2.2	1,000,000	1,485,440	2051/3/20
第５回利付国債（４０年）	2.0	920,000	1,324,064	2052/3/20
第６回利付国債（４０年）	1.9	1,260,000	1,789,855	2053/3/20
第７回利付国債（４０年）	1.7	830,000	1,136,037	2054/3/20
第８回利付国債（４０年）	1.4	800,000	1,025,584	2055/3/20
第９回利付国債（４０年）	0.4	930,000	894,966	2056/3/20
第１０回利付国債（４０年）	0.9	1,990,000	2,244,361	2057/3/20
第１１回利付国債（４０年）	0.8	1,790,000	1,960,712	2058/3/20
第１２回利付国債（４０年）	0.5	1,650,000	1,636,701	2059/3/20

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１３回利付国債（４０年）	0.5	340,000	336,644	2060/3/20
第３１７回利付国債（１０年）	1.1	890,000	904,649	2021/9/20
第３１８回利付国債（１０年）	1.0	2,260,000	2,294,239	2021/9/20
第３１９回利付国債（１０年）	1.1	1,710,000	1,743,687	2021/12/20
第３２０回利付国債（１０年）	1.0	4,570,000	4,652,899	2021/12/20
第３２１回利付国債（１０年）	1.0	2,470,000	2,521,721	2022/3/20
第３２２回利付国債（１０年）	0.9	750,000	764,347	2022/3/20
第３２３回利付国債（１０年）	0.9	1,930,000	1,972,305	2022/6/20
第３２４回利付国債（１０年）	0.8	2,740,000	2,794,416	2022/6/20
第３２５回利付国債（１０年）	0.8	2,920,000	2,985,145	2022/9/20
第３２６回利付国債（１０年）	0.7	3,120,000	3,188,764	2022/12/20
第３２７回利付国債（１０年）	0.8	3,190,000	3,268,505	2022/12/20
第３２８回利付国債（１０年）	0.6	3,400,000	3,473,134	2023/3/20
第３２９回利付国債（１０年）	0.8	2,250,000	2,316,600	2023/6/20
第３３０回利付国債（１０年）	0.8	1,690,000	1,743,877	2023/9/20
第３３１回利付国債（１０年）	0.6	900,000	922,716	2023/9/20
第３３２回利付国債（１０年）	0.6	3,110,000	3,193,876	2023/12/20
第３３３回利付国債（１０年）	0.6	2,330,000	2,396,777	2024/3/20
第３３４回利付国債（１０年）	0.6	1,790,000	1,844,344	2024/6/20
第３３５回利付国債（１０年）	0.5	2,450,000	2,518,428	2024/9/20
第３３６回利付国債（１０年）	0.5	510,000	524,953	2024/12/20
第３３７回利付国債（１０年）	0.3	3,330,000	3,396,333	2024/12/20
第３３８回利付国債（１０年）	0.4	3,060,000	3,139,070	2025/3/20
第３３９回利付国債（１０年）	0.4	5,230,000	5,372,308	2025/6/20
第３４０回利付国債（１０年）	0.4	6,320,000	6,498,856	2025/9/20
第３４１回利付国債（１０年）	0.3	2,160,000	2,211,948	2025/12/20
第３４２回利付国債（１０年）	0.1	6,380,000	6,463,833	2026/3/20
第３４３回利付国債（１０年）	0.1	3,250,000	3,294,590	2026/6/20
第３４４回利付国債（１０年）	0.1	6,940,000	7,039,172	2026/9/20
第３４５回利付国債（１０年）	0.1	2,290,000	2,323,273	2026/12/20
第３４６回利付国債（１０年）	0.1	5,200,000	5,276,596	2027/3/20
第３４７回利付国債（１０年）	0.1	2,000,000	2,029,840	2027/6/20
第３４８回利付国債（１０年）	0.1	4,840,000	4,912,987	2027/9/20
第３４９回利付国債（１０年）	0.1	3,130,000	3,177,638	2027/12/20
第３５０回利付国債（１０年）	0.1	5,790,000	5,878,702	2028/3/20
第３５１回利付国債（１０年）	0.1	3,590,000	3,643,814	2028/6/20
第３５２回利付国債（１０年）	0.1	4,190,000	4,251,257	2028/9/20
第３５３回利付国債（１０年）	0.1	4,470,000	4,531,462	2028/12/20
第３５４回利付国債（１０年）	0.1	3,780,000	3,828,421	2029/3/20
第３５５回利付国債（１０年）	0.1	4,940,000	5,000,515	2029/6/20
第３５６回利付国債（１０年）	0.1	2,420,000	2,447,055	2029/9/20
第３５７回利付国債（１０年）	0.1	2,670,000	2,698,061	2029/12/20
第３５８回利付国債（１０年）	0.1	3,680,000	3,716,064	2030/3/20
第１回利付国債（３０年）	2.8	110,000	138,784	2029/9/20
第２回利付国債（３０年）	2.4	160,000	197,432	2030/2/20
第３回利付国債（３０年）	2.3	120,000	147,361	2030/5/20

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４回利付国債（３０年）	2.9	110,000	142,953	2030/11/20
第５回利付国債（３０年）	2.2	50,000	61,691	2031/5/20
第６回利付国債（３０年）	2.4	190,000	240,241	2031/11/20
第７回利付国債（３０年）	2.3	180,000	226,962	2032/5/20
第８回利付国債（３０年）	1.8	100,000	120,725	2032/11/22
第９回利付国債（３０年）	1.4	240,000	277,989	2032/12/20
第１０回利付国債（３０年）	1.1	160,000	179,427	2033/3/20
第１１回利付国債（３０年）	1.7	90,000	107,995	2033/6/20
第１２回利付国債（３０年）	2.1	190,000	238,482	2033/9/20
第１３回利付国債（３０年）	2.0	290,000	361,023	2033/12/20
第１４回利付国債（３０年）	2.4	300,000	390,468	2034/3/20
第１５回利付国債（３０年）	2.5	340,000	448,412	2034/6/20
第１６回利付国債（３０年）	2.5	370,000	489,702	2034/9/20
第１７回利付国債（３０年）	2.4	570,000	748,392	2034/12/20
第１８回利付国債（３０年）	2.3	345,000	449,141	2035/3/20
第１９回利付国債（３０年）	2.3	380,000	496,242	2035/6/20
第２０回利付国債（３０年）	2.5	480,000	642,984	2035/9/20
第２１回利付国債（３０年）	2.3	500,000	656,400	2035/12/20
第２２回利付国債（３０年）	2.5	400,000	538,844	2036/3/20
第２３回利付国債（３０年）	2.5	430,000	581,102	2036/6/20
第２４回利付国債（３０年）	2.5	380,000	514,744	2036/9/20
第２５回利付国債（３０年）	2.3	350,000	464,047	2036/12/20
第２６回利付国債（３０年）	2.4	530,000	713,141	2037/3/20
第２７回利付国債（３０年）	2.5	1,010,000	1,383,477	2037/9/20
第２８回利付国債（３０年）	2.5	1,640,000	2,259,198	2038/3/20
第２９回利付国債（３０年）	2.4	1,400,000	1,913,436	2038/9/20
第３０回利付国債（３０年）	2.3	1,770,000	2,399,978	2039/3/20
第３１回利付国債（３０年）	2.2	1,100,000	1,480,017	2039/9/20
第３２回利付国債（３０年）	2.3	1,560,000	2,141,115	2040/3/20
第３３回利付国債（３０年）	2.0	1,770,000	2,339,143	2040/9/20
第３４回利付国債（３０年）	2.2	1,615,000	2,207,107	2041/3/20
第３５回利付国債（３０年）	2.0	1,940,000	2,584,856	2041/9/20
第３６回利付国債（３０年）	2.0	1,880,000	2,513,372	2042/3/20
第３７回利付国債（３０年）	1.9	1,910,000	2,525,096	2042/9/20
第３８回利付国債（３０年）	1.8	1,230,000	1,604,891	2043/3/20
第３９回利付国債（３０年）	1.9	1,200,000	1,595,052	2043/6/20
第４０回利付国債（３０年）	1.8	1,170,000	1,532,232	2043/9/20
第４１回利付国債（３０年）	1.7	780,000	1,005,841	2043/12/20
第４２回利付国債（３０年）	1.7	1,350,000	1,742,742	2044/3/20
第４３回利付国債（３０年）	1.7	1,500,000	1,938,480	2044/6/20
第４４回利付国債（３０年）	1.7	1,220,000	1,578,301	2044/9/20
第４５回利付国債（３０年）	1.5	990,000	1,236,232	2044/12/20
第４６回利付国債（３０年）	1.5	1,590,000	1,986,848	2045/3/20
第４７回利付国債（３０年）	1.6	1,350,000	1,720,831	2045/6/20
第４８回利付国債（３０年）	1.4	1,820,000	2,235,633	2045/9/20
第４９回利付国債（３０年）	1.4	1,440,000	1,769,731	2045/12/20

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５０回利付国債（３０年）	0.8	1,110,000	1,203,972	2046/3/20
第５１回利付国債（３０年）	0.3	1,840,000	1,769,436	2046/6/20
第５２回利付国債（３０年）	0.5	1,600,000	1,615,008	2046/9/20
第５３回利付国債（３０年）	0.6	690,000	713,701	2046/12/20
第５４回利付国債（３０年）	0.8	2,110,000	2,286,607	2047/3/20
第５５回利付国債（３０年）	0.8	1,040,000	1,126,424	2047/6/20
第５６回利付国債（３０年）	0.8	1,870,000	2,026,668	2047/9/20
第５７回利付国債（３０年）	0.8	1,550,000	1,678,867	2047/12/20
第５８回利付国債（３０年）	0.8	1,620,000	1,755,756	2048/3/20
第５９回利付国債（３０年）	0.7	120,000	126,997	2048/6/20
第６０回利付国債（３０年）	0.9	2,530,000	2,808,780	2048/9/20
第６１回利付国債（３０年）	0.7	1,330,000	1,405,238	2048/12/20
第６２回利付国債（３０年）	0.5	170,000	170,644	2049/3/20
第６３回利付国債（３０年）	0.4	980,000	956,352	2049/6/20
第６４回利付国債（３０年）	0.4	1,700,000	1,656,548	2049/9/20
第６５回利付国債（３０年）	0.4	860,000	837,855	2049/12/20
第６６回利付国債（３０年）	0.4	720,000	701,323	2050/3/20
第５２回利付国債（２０年）	2.1	110,000	113,262	2021/9/21
第５３回利付国債（２０年）	2.1	80,000	82,815	2021/12/20
第５４回利付国債（２０年）	2.2	200,000	207,350	2021/12/20
第５５回利付国債（２０年）	2.0	140,000	145,467	2022/3/21
第５６回利付国債（２０年）	2.0	150,000	156,685	2022/6/20
第５７回利付国債（２０年）	1.9	240,000	250,202	2022/6/20
第５８回利付国債（２０年）	1.9	300,000	314,328	2022/9/20
第５９回利付国債（２０年）	1.7	200,000	209,564	2022/12/20
第６０回利付国債（２０年）	1.4	350,000	364,045	2022/12/20
第６１回利付国債（２０年）	1.0	240,000	247,864	2023/3/20
第６２回利付国債（２０年）	0.8	320,000	329,472	2023/6/20
第６３回利付国債（２０年）	1.8	200,000	212,054	2023/6/20
第６４回利付国債（２０年）	1.9	320,000	341,836	2023/9/20
第６５回利付国債（２０年）	1.9	220,000	236,110	2023/12/20
第６６回利付国債（２０年）	1.8	330,000	352,987	2023/12/20
第６７回利付国債（２０年）	1.9	130,000	140,158	2024/3/20
第６８回利付国債（２０年）	2.2	190,000	207,024	2024/3/20
第６９回利付国債（２０年）	2.1	390,000	423,454	2024/3/20
第７０回利付国債（２０年）	2.4	400,000	441,400	2024/6/20
第７１回利付国債（２０年）	2.2	200,000	219,070	2024/6/20
第７２回利付国債（２０年）	2.1	630,000	691,103	2024/9/20
第７３回利付国債（２０年）	2.0	360,000	395,211	2024/12/20
第７４回利付国債（２０年）	2.1	200,000	220,478	2024/12/20
第７５回利付国債（２０年）	2.1	130,000	144,002	2025/3/20
第７６回利付国債（２０年）	1.9	270,000	296,473	2025/3/20
第７７回利付国債（２０年）	2.0	290,000	319,835	2025/3/20
第７８回利付国債（２０年）	1.9	170,000	187,549	2025/6/20
第７９回利付国債（２０年）	2.0	270,000	299,246	2025/6/20
第８０回利付国債（２０年）	2.1	220,000	244,948	2025/6/20

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８１回利付国債（２０年）	2.0	390,000	434,249	2025/9/20
第８２回利付国債（２０年）	2.1	600,000	671,280	2025/9/20
第８３回利付国債（２０年）	2.1	290,000	326,081	2025/12/20
第８４回利付国債（２０年）	2.0	470,000	525,850	2025/12/20
第８５回利付国債（２０年）	2.1	290,000	327,697	2026/3/20
第８６回利付国債（２０年）	2.3	210,000	239,750	2026/3/20
第８７回利付国債（２０年）	2.2	550,000	624,706	2026/3/20
第８８回利付国債（２０年）	2.3	420,000	481,962	2026/6/20
第８９回利付国債（２０年）	2.2	350,000	399,500	2026/6/20
第９０回利付国債（２０年）	2.2	630,000	722,843	2026/9/20
第９１回利付国債（２０年）	2.3	450,000	519,174	2026/9/20
第９２回利付国債（２０年）	2.1	880,000	1,008,708	2026/12/20
第９３回利付国債（２０年）	2.0	410,000	469,269	2027/3/20
第９４回利付国債（２０年）	2.1	610,000	702,360	2027/3/20
第９５回利付国債（２０年）	2.3	610,000	714,224	2027/6/20
第９６回利付国債（２０年）	2.1	1,590,000	1,839,073	2027/6/20
第９７回利付国債（２０年）	2.2	400,000	467,692	2027/9/20
第９８回利付国債（２０年）	2.1	440,000	511,222	2027/9/20
第９９回利付国債（２０年）	2.1	1,150,000	1,342,038	2027/12/20
第１００回利付国債（２０年）	2.2	480,000	566,342	2028/3/20
第１０１回利付国債（２０年）	2.4	715,000	854,846	2028/3/20
第１０２回利付国債（２０年）	2.4	1,260,000	1,513,234	2028/6/20
第１０３回利付国債（２０年）	2.3	400,000	477,152	2028/6/20
第１０４回利付国債（２０年）	2.1	360,000	423,601	2028/6/20
第１０５回利付国債（２０年）	2.1	1,180,000	1,393,875	2028/9/20
第１０６回利付国債（２０年）	2.2	380,000	452,048	2028/9/20
第１０７回利付国債（２０年）	2.1	260,000	308,149	2028/12/20
第１０８回利付国債（２０年）	1.9	660,000	770,880	2028/12/20
第１０９回利付国債（２０年）	1.9	520,000	609,086	2029/3/20
第１１０回利付国債（２０年）	2.1	950,000	1,129,531	2029/3/20
第１１１回利付国債（２０年）	2.2	970,000	1,166,337	2029/6/20
第１１２回利付国債（２０年）	2.1	790,000	942,730	2029/6/20
第１１３回利付国債（２０年）	2.1	1,450,000	1,736,534	2029/9/20
第１１４回利付国債（２０年）	2.1	2,330,000	2,800,124	2029/12/20
第１１５回利付国債（２０年）	2.2	700,000	847,931	2029/12/20
第１１６回利付国債（２０年）	2.2	1,490,000	1,811,244	2030/3/20
第１１７回利付国債（２０年）	2.1	1,080,000	1,302,264	2030/3/20
第１１８回利付国債（２０年）	2.0	660,000	791,887	2030/6/20
第１１９回利付国債（２０年）	1.8	530,000	625,267	2030/6/20
第１２０回利付国債（２０年）	1.6	1,570,000	1,820,666	2030/6/20
第１２１回利付国債（２０年）	1.9	1,500,000	1,789,050	2030/9/20
第１２２回利付国債（２０年）	1.8	940,000	1,111,474	2030/9/20
第１２３回利付国債（２０年）	2.1	830,000	1,010,209	2030/12/20
第１２４回利付国債（２０年）	2.0	610,000	736,032	2030/12/20
第１２５回利付国債（２０年）	2.2	820,000	1,009,920	2031/3/20
第１２６回利付国債（２０年）	2.0	730,000	883,380	2031/3/20

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１２７回利付国債（２０年）	1.9	1,020,000	1,223,357	2031/3/20
第１２８回利付国債（２０年）	1.9	970,000	1,165,949	2031/6/20
第１２９回利付国債（２０年）	1.8	890,000	1,060,016	2031/6/20
第１３０回利付国債（２０年）	1.8	1,245,000	1,486,554	2031/9/20
第１３１回利付国債（２０年）	1.7	1,000,000	1,182,810	2031/9/20
第１３２回利付国債（２０年）	1.7	840,000	995,778	2031/12/20
第１３３回利付国債（２０年）	1.8	1,190,000	1,424,299	2031/12/20
第１３４回利付国債（２０年）	1.8	1,130,000	1,355,604	2032/3/20
第１３５回利付国債（２０年）	1.7	30,000	35,639	2032/3/20
第１３６回利付国債（２０年）	1.6	1,470,000	1,729,161	2032/3/20
第１３７回利付国債（２０年）	1.7	1,120,000	1,333,393	2032/6/20
第１３８回利付国債（２０年）	1.5	620,000	723,360	2032/6/20
第１３９回利付国債（２０年）	1.6	580,000	683,599	2032/6/20
第１４０回利付国債（２０年）	1.7	1,840,000	2,195,156	2032/9/20
第１４１回利付国債（２０年）	1.7	2,110,000	2,522,294	2032/12/20
第１４２回利付国債（２０年）	1.8	580,000	700,500	2032/12/20
第１４３回利付国債（２０年）	1.6	1,130,000	1,339,140	2033/3/20
第１４４回利付国債（２０年）	1.5	1,740,000	2,040,115	2033/3/20
第１４５回利付国債（２０年）	1.7	2,515,000	3,017,874	2033/6/20
第１４６回利付国債（２０年）	1.7	2,440,000	2,933,294	2033/9/20
第１４７回利付国債（２０年）	1.6	2,100,000	2,501,142	2033/12/20
第１４８回利付国債（２０年）	1.5	2,280,000	2,688,872	2034/3/20
第１４９回利付国債（２０年）	1.5	3,040,000	3,589,966	2034/6/20
第１５０回利付国債（２０年）	1.4	3,630,000	4,241,655	2034/9/20
第１５１回利付国債（２０年）	1.2	1,255,000	1,432,469	2034/12/20
第１５２回利付国債（２０年）	1.2	2,420,000	2,763,882	2035/3/20
第１５３回利付国債（２０年）	1.3	2,230,000	2,582,763	2035/6/20
第１５４回利付国債（２０年）	1.2	2,950,000	3,375,508	2035/9/20
第１５５回利付国債（２０年）	1.0	2,050,000	2,285,299	2035/12/20
第１５６回利付国債（２０年）	0.4	1,960,000	2,003,159	2036/3/20
第１５７回利付国債（２０年）	0.2	2,820,000	2,791,771	2036/6/20
第１５８回利付国債（２０年）	0.5	2,320,000	2,403,311	2036/9/20
第１５９回利付国債（２０年）	0.6	2,760,000	2,902,002	2036/12/20
第１６０回利付国債（２０年）	0.7	2,420,000	2,583,059	2037/3/20
第１６１回利付国債（２０年）	0.6	1,750,000	1,838,147	2037/6/20
第１６２回利付国債（２０年）	0.6	580,000	609,121	2037/9/20
第１６３回利付国債（２０年）	0.6	2,610,000	2,740,552	2037/12/20
第１６４回利付国債（２０年）	0.5	1,720,000	1,775,126	2038/3/20
第１６５回利付国債（２０年）	0.5	1,640,000	1,690,364	2038/6/20
第１６６回利付国債（２０年）	0.7	900,000	959,130	2038/9/20
第１６７回利付国債（２０年）	0.5	2,540,000	2,613,202	2038/12/20
第１６８回利付国債（２０年）	0.4	1,390,000	1,404,734	2039/3/20
第１６９回利付国債（２０年）	0.3	760,000	753,882	2039/6/20
第１７０回利付国債（２０年）	0.3	2,410,000	2,390,358	2039/9/20
第１７１回利付国債（２０年）	0.3	1,350,000	1,338,862	2039/12/20
第１７２回利付国債（２０年）	0.4	1,180,000	1,190,915	2040/3/20
小　計		418,120,000	454,188,617	

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
地方債証券				
第３回東京都公募公債（２０年）	2.26	100,000	108,478	2024/3/19
第６回東京都公募公債（２０年）	2.0	100,000	109,481	2025/3/19
第９回東京都公募公債（３０年）	2.37	100,000	134,753	2039/3/18
第１１回東京都公募公債（３０年）	2.19	100,000	134,260	2040/9/20
第１３回東京都公募公債（３０年）	1.93	100,000	129,250	2042/3/19
第１５回東京都公募公債（３０年）	1.827	100,000	128,361	2044/6/20
第１７回東京都公募公債（２０年）	2.09	100,000	116,797	2028/12/20
第１９回東京都公募公債（２０年）	2.13	100,000	117,966	2029/6/20
第２６回東京都公募公債（２０年）	1.74	200,000	235,146	2032/6/18
第２７回東京都公募公債（２０年）	1.68	200,000	234,406	2032/12/20
第７００回東京都公募公債	1.02	100,000	101,290	2021/9/17
第７０２回東京都公募公債	1.04	100,000	101,577	2021/12/20
第７１６回東京都公募公債	0.77	100,000	101,894	2022/12/20
第７１７回東京都公募公債	0.63	100,000	101,683	2023/3/20
第７２０回東京都公募公債	0.87	100,000	102,568	2023/6/20
第７２８回東京都公募公債	0.65	100,000	102,206	2023/12/20
第７５１回東京都公募公債	0.37	100,000	101,661	2025/12/19
第７６５回東京都公募公債	0.21	100,000	100,811	2027/3/19
第７７０回東京都公募公債	0.18	100,000	100,560	2027/6/18
第７８１回東京都公募公債	0.16	300,000	301,197	2028/6/20
第８００回東京都公募公債	0.08	200,000	198,940	2029/12/20
平成２３年度第６回北海道公募公債	1.11	200,000	202,638	2021/8/31
平成２４年度第１４回北海道公募公債	0.8	100,000	102,034	2023/2/28
平成２７年度第１５回北海道公募公債	0.22	100,000	100,714	2026/2/26
平成２８年度第１回北海道公募公債	0.085	100,000	99,941	2026/4/28
平成２８年度第１４回北海道公募公債	0.24	100,000	100,836	2027/2/24
第４回神奈川県公募公債（３０年）	2.62	100,000	137,508	2038/3/19
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	1.706	100,000	117,174	2032/6/18
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	1.398	100,000	114,666	2034/9/20
第２１０回神奈川県公募公債	0.451	200,000	203,876	2024/12/20
第２１８回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,692	2025/12/19
第２２６回神奈川県公募公債	0.195	200,000	201,420	2027/3/19
第２２７回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,560	2027/6/18
第２４３回神奈川県公募公債	0.075	200,000	198,846	2029/12/20
第７回大阪府公募公債（２０年）	1.84	200,000	235,426	2031/9/26
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	0.92	100,000	101,807	2022/6/28
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	0.58	100,000	101,540	2023/4/26
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	0.835	100,000	102,547	2023/8/29
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	0.53	100,000	102,139	2024/10/30
第３９５回大阪府公募公債（１０年）	0.435	151,000	153,887	2025/4/28
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	0.529	100,000	102,327	2025/8/28
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	0.493	100,000	102,233	2025/11/27
第４０７回大阪府公募公債（１０年）	0.09	156,000	156,045	2026/4/27
第４１０回大阪府公募公債（１０年）	0.001	200,000	198,724	2026/7/28

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２１年度第３回京都府公募公債（２０年）	2.19	100,000	119,012	2029/9/20
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	1.79	100,000	117,376	2031/10/17
平成２５年度第７回京都府公募公債	0.8	100,000	102,544	2023/9/19
平成２７年度第４回京都府公募公債	0.553	100,000	102,460	2025/6/19
平成２８年度第５回京都府公募公債（２０年）	0.327	100,000	98,986	2036/8/15
平成２９年度第５回京都府公募公債（２０年）	0.63	100,000	103,616	2037/8/14
第１回兵庫県公募公債（１２年）	1.1	100,000	104,274	2024/6/26
第２回兵庫県公募公債（２０年）	2.37	100,000	116,338	2027/9/17
第３回兵庫県公募公債（１２年）	0.56	100,000	102,509	2025/4/16
第６回兵庫県公募公債（１５年）	1.35	400,000	439,420	2028/7/14
第７回兵庫県公募公債（１５年）	1.12	100,000	108,443	2028/12/25
平成２４年度第１５回兵庫県公募公債	0.75	200,000	203,098	2022/8/16
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	0.82	100,000	102,476	2023/8/18
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,965	2025/2/26
第３５回兵庫県公募公債（２０年）	0.578	100,000	102,486	2038/5/28
令和元年度第１７回兵庫県公募公債	0.15	300,000	300,138	2030/1/28
第９回静岡県公募公債（３０年）	1.539	100,000	122,040	2045/6/20
第１２回静岡県公募公債（３０年）	0.822	100,000	106,055	2048/3/19
平成２３年度第８回静岡県公募公債	1.025	100,000	101,401	2021/10/25
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	0.678	100,000	101,821	2023/3/22
平成２９年度第５回静岡県公募公債	0.19	100,000	100,630	2027/6/18
平成２９年度第８回静岡県公募公債	0.21	100,000	100,770	2027/6/18
平成２９年度第１１回静岡県公募公債	0.215	100,000	100,833	2027/9/17
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	2.28	100,000	119,310	2029/6/20
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	1.006	100,000	101,470	2021/11/30
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	0.639	100,000	101,722	2023/3/28
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	0.665	100,000	102,487	2024/4/30
平成２７年度第１７回愛知県公募公債（１０年）	0.38	100,000	101,749	2026/1/27
平成２８年度第５回愛知県公募公債（１０年）	0.07	100,000	99,878	2026/6/29
平成２９年度第６回愛知県公募公債（１０年）	0.22	200,000	201,706	2027/7/28
平成２９年度第１２回愛知県公募公債（２０年）	0.606	300,000	309,576	2037/11/20
平成３０年度第１回愛知県公募公債（１０年）	0.185	100,000	100,706	2028/4/27
平成３０年度第６回愛知県公募公債（３０年）	0.777	100,000	105,012	2048/6/19
令和元年度第１６回愛知県公募公債（１０年）	0.09	200,000	199,044	2030/2/15
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	2.34	100,000	118,378	2028/9/21
平成２４年度第４回広島県公募公債	0.81	100,000	101,950	2022/11/28
平成２７年度第４回広島県公募公債	0.476	125,230	128,012	2025/11/25
平成２９年度第１回広島県公募公債	0.175	200,000	201,180	2027/5/25
第３回埼玉県公募公債（２０年）	2.42	100,000	116,257	2027/6/18
第５回埼玉県公募公債（２０年）	2.35	100,000	117,461	2028/3/17
第６回埼玉県公募公債（２０年）	2.26	200,000	235,436	2028/9/21
第６回埼玉県公募公債（３０年）	0.957	100,000	109,195	2046/12/20
第１０回埼玉県公募公債（２０年）	1.94	200,000	236,068	2030/11/12
第１８回埼玉県公募公債（２０年）	0.323	200,000	198,124	2036/5/20

当	期		末	
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	1.05	100,000	101,946	2022/4/26
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	0.844	100,000	102,177	2023/1/31
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	0.655	100,000	102,388	2024/3/26
平成２７年度第７回埼玉県公募公債	0.469	100,000	102,216	2025/12/25
平成２８年度第６回埼玉県公募公債	0.085	100,000	99,968	2026/9/29
平成２８年度第９回埼玉県公募公債	0.249	100,000	101,065	2027/2/24
平成２９年度第４回埼玉県公募公債	0.19	100,000	100,631	2027/6/22
平成１９年度第１回福岡県公募公債（２０年）	2.38	100,000	116,365	2027/8/20
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	2.05	100,000	116,457	2028/12/20
平成２２年度第１回福岡県公募公債（１５年）	1.67	100,000	108,740	2025/11/21
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	2.008	100,000	119,383	2031/5/23
平成２３年度第１回福岡県公募公債（１５年）	1.491	100,000	109,054	2026/11/27
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	2.12	100,000	133,596	2042/9/19
平成２６年度第４回福岡県公募公債（２０年）	1.249	100,000	112,674	2035/2/23
平成２７年度第７回福岡県公募公債	0.464	100,000	102,188	2025/12/25
平成３０年度第１回福岡県公募公債（３０年）	0.777	100,000	105,012	2048/6/19
平成３０年度第１回福岡県公募公債（２０年）	0.639	100,000	103,673	2038/8/20
第５回千葉県公募公債（２０年）	2.26	200,000	235,436	2028/9/21
第６回千葉県公募公債（２０年）	2.26	100,000	118,938	2029/4/20
第１３回千葉県公募公債（２０年）	1.701	100,000	117,351	2032/10/15
平成２５年度第５回千葉県公募公債	0.84	100,000	102,622	2023/8/25
平成２６年度第７回千葉県公募公債	0.429	100,000	101,914	2025/2/25
平成２７年度第１回千葉県公募公債	0.549	100,000	102,608	2025/5/23
平成２８年度第４回千葉県公募公債	0.085	100,000	99,968	2026/9/25
平成２８年度第６回千葉県公募公債	0.18	120,000	120,714	2027/1/25
令和元年度第７回千葉県公募公債	0.08	300,000	298,281	2030/2/25
平成２９年度第１回岐阜県公募公債（１０年）	0.205	100,000	100,773	2027/10/29
第１０２回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	151,984	2021/9/24
第１０５回共同発行市場公募地方債	1.07	100,000	101,635	2021/12/24
第１０７回共同発行市場公募地方債	1.01	800,000	813,672	2022/2/25
第１０８回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	101,784	2022/3/25
第１０９回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	101,943	2022/4/25
第１１０回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,708	2022/5/25
第１１２回共同発行市場公募地方債	0.84	220,000	223,836	2022/7/25
第１１３回共同発行市場公募地方債	0.77	200,000	203,312	2022/8/25
第１１７回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	101,770	2022/12/22
第１１９回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	204,220	2023/2/24
第１２５回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	102,557	2023/8/25
第１２７回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,212	2023/10/25
第１２８回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,196	2023/11/24
第１３０回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	205,338	2024/1/25
第１３２回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	307,215	2024/3/25
第１３６回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	102,420	2024/7/25
第１３７回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	102,282	2024/8/23
第１４０回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,152	2024/11/25
第１４５回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	203,734	2025/4/25

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１４６回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	205,256	2025/5/23
第１４８回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	128,532	2025/7/25
第１５２回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	102,331	2025/11/25
第１５６回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,173	2026/3/25
第１５７回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,058	2026/4/24
第１５９回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	199,756	2026/6/25
第１６０回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	199,508	2026/7/24
第１６１回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	399,252	2026/8/25
第１６４回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	99,741	2026/11/25
第１６６回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,595	2027/1/25
第１６７回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	101,039	2027/2/25
第１７１回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	201,194	2027/6/25
第１７４回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	194,933	2027/9/24
第１７５回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	100,845	2027/10/25
第１８１回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	302,001	2028/4/25
平成２３年度第２回熊本県公募公債（１０年）	1.0	100,000	101,373	2021/10/28
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	0.8	200,000	203,710	2022/10/26
平成２９年度第１回熊本県公募公債（５年）	0.01	100,000	99,955	2022/7/28
平成２３年度第１回浜松市公募公債	1.045	100,000	101,515	2021/11/25
平成２３年度第１回静岡市公募公債	1.045	100,000	101,515	2021/11/25
平成２９年度第１回静岡市公募公債	0.22	100,000	100,892	2027/11/24
第１３回大阪市公募公債（２０年）	2.08	200,000	237,968	2030/6/14
第２２回大阪市公募公債（２０年）	0.347	300,000	298,266	2036/5/30
第２４回大阪市公募公債（２０年）	0.655	100,000	103,950	2037/4/21
平成２９年度第１回大阪市公募公債（５年）	0.01	100,000	99,958	2022/5/25
第１回名古屋市公募公債（３０年）	2.53	100,000	131,154	2035/3/20
第５回名古屋市公募公債（３０年）	2.49	100,000	136,859	2039/3/18
第９回名古屋市公募公債（２０年）	2.07	100,000	116,627	2028/12/20
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	1.774	100,000	127,339	2044/9/20
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	0.744	100,000	101,827	2022/12/20
第４９９回名古屋市公募公債（１０年）	0.225	100,000	100,915	2027/3/26
平成２３年度第４回京都市公募公債	1.067	100,000	101,625	2021/12/22
平成２４年度第２回京都市公募公債	0.849	122,500	124,756	2022/8/29
平成２４年度第４回京都市公募公債	0.801	100,000	101,847	2022/10/21
平成２４年度第５回京都市公募公債	0.854	100,000	102,204	2023/1/31
平成２８年度第６回京都市公募公債	0.18	200,000	201,192	2027/1/27
平成１８年度第３回神戸市公募公債（２０年）	2.54	120,000	137,716	2026/6/19
平成２０年度第１回神戸市公募公債（２０年）	2.38	200,000	236,254	2028/5/26
平成２１年度第１１回神戸市公募公債（２０年）	2.233	100,000	120,146	2030/1/29
第５回横浜市公募公債（２０年）	2.17	100,000	110,618	2025/6/20
第２０回横浜市公募公債（２０年）	2.1	100,000	118,334	2029/10/19
平成２３年度第５回横浜市公募公債	1.011	100,000	101,636	2022/1/28
平成２８年度第４回横浜市公募公債	0.175	100,000	100,562	2027/1/22
平成２９年度第２回横浜市公募公債	0.24	200,000	201,982	2027/7/16
平成３０年度第１回横浜市公募公債	0.195	100,000	100,782	2028/4/17

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３０年度第４回横浜市公募公債	0.289	200,000	202,974	2028/10/17
平成２３年度第９回札幌市公募公債（１５年）	1.493	100,000	109,359	2027/2/12
平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	0.8	100,000	101,971	2022/12/20
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	0.43	100,000	101,843	2024/12/20
第１１回川崎市公募公債（２０年）	1.84	100,000	116,883	2030/10/18
第８９回川崎市公募公債	0.16	100,000	100,456	2026/12/18
平成２６年度第２回北九州市公募公債	0.451	100,000	101,804	2024/12/24
平成２７年度第２回北九州市公募公債	0.484	100,000	102,150	2025/12/18
平成２８年度第１回北九州市公募公債	0.08	100,000	99,912	2026/4/15
平成２１年度第３回福岡市公募公債（２０年）	2.14	100,000	118,541	2029/9/18
平成２３年度第６回福岡市公募公債	1.0	100,000	101,373	2021/10/28
平成２６年度第５回福岡市公募公債	0.539	200,000	204,532	2024/10/28
平成２８年度第１０回福岡市公募公債（５年）	0.02	100,000	99,981	2022/3/31
平成３０年度第９回福岡市公募公債（１０年）	0.289	100,000	101,493	2028/10/30
平成２５年度第３回広島市公募公債	0.67	150,000	153,586	2024/2/23
平成２６年度第２回広島市公募公債	0.456	100,000	101,967	2024/12/25
平成２８年度第４回広島市公募公債	0.165	105,000	105,514	2026/12/25
平成２９年度第６回広島市公募公債	0.23	170,000	171,747	2028/2/25
令和元年度第６回広島市公募公債	0.115	550,000	548,696	2030/2/25
平成２３年度第２回千葉市公募公債	1.06	200,000	203,076	2021/11/25
令和元年度第５回千葉市公募公債	0.08	200,000	198,854	2030/2/25
平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	0.33	200,000	202,844	2025/1/30
第１１３回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	116,078	2027/12/20
小　計		27,459,430	28,860,716	
特殊債券（除く金融債）				
第２５回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	200,000	204,694	2023/2/24
第４０回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	126,000	125,926	2026/3/13
第４６回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	100,783	2027/7/20
第４７回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	210,611	2027/9/24
第５３回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	189,378	2028/9/15
第２回政府保証新関西国際空港債券	0.882	102,000	104,722	2023/6/27
第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	102,768	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	310,000	316,138	2023/3/15
第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	106,679	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	100,228	2026/12/14
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	148,559	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	237,656	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	134,131	2040/5/31
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	120,681	2030/12/27
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	101,334	2021/7/30

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	304,428	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	305,746	2022/1/31
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	200,000	203,298	2022/2/28
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	203,774	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	101,951	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	101,899	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	306,003	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	117,778	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	102,342	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	307,068	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	203,968	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	203,390	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	428,000	436,303	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	205,352	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	151,877	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	102,413	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	232,602	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	104,614	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	102,568	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	102,453	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	102,339	2024/10/31
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	102,086	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	304,344	2025/1/31
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	112,302	2035/2/28
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.216	200,000	226,322	2035/3/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	200,000	203,286	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	100,660	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	96,464	2046/5/31

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	106,686	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	316,723	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	205,885	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	100,647	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	200,000	201,240	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	100,759	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	120,000	121,380	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	201,594	2028/5/31
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	300,000	312,294	2038/9/30
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	216,942	2028/10/31
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	0.576	110,000	110,896	2021/9/24
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	0.502	100,000	100,853	2021/12/24
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券（8年）	0.46	100,000	100,873	2022/2/25
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,445	2021/10/18
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	300,000	304,686	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	102,331	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	200,000	203,968	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	101,684	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	101,914	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	102,631	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	204,798	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	101,930	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	99,942	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	100,228	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	100,430	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	252,548	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	100,781	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	100,754	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	111,252	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	157,964	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	101,368	2028/10/16
第59回政府保証関西国際空港債券	0.9	500,000	508,565	2022/3/25
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	100,526	2027/1/18
第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.001	300,000	299,754	2023/3/20
第14回道路債券	1.91	100,000	104,813	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	103,865	2022/12/20
第21回道路債券	2.75	100,000	131,371	2033/6/20

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２８回道路債券	2.83	200,000	266,118	2033/12/20
第３３回道路債券	2.91	200,000	269,884	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	117,498	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	156,495	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	118,269	2028/6/20
第４２回道路債券	2.22	100,000	110,442	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	119,996	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	101,578	2021/12/20
第８２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	100,000	101,892	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	118,246	2032/9/17
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	500,000	509,610	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	102,828	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	102,324	2023/9/20
第１３１回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	115,129	2034/6/20
第１４４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,959	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	136,918	2055/3/19
第１５８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	225,692	2035/6/20
第１８８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	619,752	2037/9/18
第２０８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	113,801	2058/3/19
第２回公営企業債券（３０年）	2.39	300,000	381,705	2033/12/20
第３回公営企業債券（２０年）	1.03	110,000	113,092	2023/3/22
第３回地方公共団体金融機構債券（１５年）	1.176	100,000	108,868	2029/1/26
第５回公営企業債券（３０年）	2.72	300,000	399,126	2034/9/22
第７回公営企業債券（２０年）	2.2	100,000	108,247	2024/3/22
第７回公営企業債券（３０年）	2.67	100,000	133,671	2035/6/20
第８回公営企業債券（２０年）	2.25	40,000	43,375	2024/3/22
第８回公営企業債券（３０年）	2.5	100,000	131,557	2035/9/21
第８回地方公共団体金融機構債券（２０年）	2.043	200,000	237,244	2030/6/28
第１９回地方公共団体金融機構債券（２０年）	1.84	200,000	236,584	2031/12/26
第２１回地方公共団体金融機構債券（５年）	0.01	400,000	399,920	2022/4/28
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	1.702	100,000	117,369	2032/9/28
第３８回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	508,700	2022/7/28
第４２回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,927	2022/11/28
第４４回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	204,054	2023/1/27
第５８回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,673	2024/3/28
第６５回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	306,612	2024/10/28
Ｆ７７回地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	108,949	2026/10/20
第８８回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,748	2026/9/28
Ｆ１１６回地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	109,318	2027/4/23
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	105,216	2025/7/30
Ｆ１４６回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	211,256	2025/10/28

当期末			
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
Ｆ２０８回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	104,341	2026/2/4
Ｆ２１４回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	105,625	2027/4/28
第７回阪神高速道路債券	2.18	100,000	110,144	2025/3/21
第１９回阪神高速道路株式会社社債	0.02	100,000	100,000	2021/12/20
第２２回阪神高速道路株式会社社債	0.005	200,000	199,802	2023/3/20
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	121,117	2031/5/9
第８１回株式会社日本政策金融公庫社債	0.001	100,000	99,972	2021/11/8
第１１７回都市再生債券	0.804	200,000	212,890	2030/11/20
第１５９回都市再生債券	0.43	200,000	178,806	2059/3/19
第１６１回都市再生債券	0.687	100,000	98,098	2059/3/19
第５回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	109,845	2024/12/20
第３４４回東京交通債券	1.67	100,000	104,378	2023/2/17
第３４６回東京交通債券	1.13	20,000	20,653	2023/6/20
第５９回独立行政法人福祉医療機構債券	0.001	100,000	99,925	2022/12/20
第１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	12,945	13,340	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	13,434	13,977	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	13,750	14,363	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	216,330	216,433	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	152,482	152,661	2033/1/10
第４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	13,623	14,167	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	14,591	15,258	2038/5/10
第４回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.08	276,201	275,742	2033/4/10
第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	1.76	11,864	12,077	2036/11/10
第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.26	24,558	25,299	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	14,300	14,860	2038/11/10
第６回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	116,374	2027/6/18
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	0.06	291,057	290,003	2034/2/10
第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.15	12,971	13,417	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	15,129	15,913	2039/5/10
第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	2.19	12,925	13,388	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	15,110	15,894	2039/11/10
第１２回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	116,179	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	12,106	12,242	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	12,445	12,582	2032/5/10
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	19,874	21,275	2044/4/10
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	20,435	21,948	2044/5/10
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	23,104	25,000	2044/6/10
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	24,793	26,547	2044/9/10
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	27,175	29,252	2044/11/10
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	28,216	30,288	2044/12/10
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	59,974	64,403	2045/3/10
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	13,179	13,634	2040/11/10
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	28,700	30,426	2045/5/10
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	13,240	13,690	2041/2/10
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,044	13,621	2041/5/10

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45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	31,426	33,443	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,243	12,640	2041/9/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	31,749	33,835	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	29,745	31,648	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,331	15,088	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	60,800	64,381	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,824	34,769	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	13,802	14,410	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	43,219	45,705	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	40,990	43,334	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	41,066	43,459	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	87,658	92,452	2047/5/10
第64回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	109,670	2025/12/19
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	94,810	99,200	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	48,286	50,467	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	48,406	51,005	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,907	51,595	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	42,874	45,045	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	42,877	44,729	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	48,352	51,043	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	180,336	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	130,533	136,161	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	176,092	183,672	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	49,443	51,508	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	51,116	53,288	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	51,976	54,036	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,456	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	164,916	171,420	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,382	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	116,858	120,211	2050/1/10
第92回一般担保住宅金融支援機構債券	1.06	100,000	101,624	2021/12/20
第93回一般担保住宅金融支援機構債券	1.557	100,000	109,350	2026/12/18
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	65,841	67,949	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	69,531	71,547	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	68,891	71,233	2050/6/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	213,495	221,635	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	142,638	147,931	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	70,047	72,523	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	74,650	77,370	2051/1/10
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	80,329	80,761	2051/5/10
第111回一般担保住宅金融支援機構債券	1.404	100,000	108,985	2027/6/18
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	84,682	85,350	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	84,789	85,277	2051/11/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	109,799	2027/9/17
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	84,869	85,727	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	85,432	86,710	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,903	87,060	2052/2/10

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117回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	109,546	2027/9/17
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	87,888	88,967	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	88,681	89,878	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,436	89,385	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,850	89,800	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	89,394	90,405	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	179,914	181,562	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	89,468	90,416	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	180,984	183,383	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	90,657	91,637	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	182,278	183,958	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	91,473	92,446	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,300	186,836	2053/7/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,552	187,079	2053/8/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	132,731	2043/3/20
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	93,640	94,950	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	94,239	95,761	2053/11/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	94,225	94,910	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	191,012	191,514	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	95,611	95,771	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	95,873	96,175	2054/5/10
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	192,842	193,113	2054/6/10
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	97,147	96,525	2054/7/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	292,560	289,172	2054/9/10
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	195,718	193,420	2054/10/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	99,211	99,506	2055/2/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	99,521	99,486	2055/3/10
第161回一般担保住宅金融支援機構債券	0.713	100,000	104,149	2027/6/18
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	0.495	100,000	102,194	2025/9/19
第169回一般担保住宅金融支援機構債券	0.617	200,000	207,198	2027/9/17
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	96,561	2036/7/18
第194回一般担保住宅金融支援機構債券	0.075	100,000	99,745	2026/10/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	114,315	2027/3/19
第57回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,972	2021/11/19
第58回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,967	2022/2/18
第59回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,958	2022/6/20
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	109,907	2025/6/20
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	118,503	2033/9/20
第38回東日本高速道路株式会社社債	0.03	100,000	100,012	2021/9/17
第39回東日本高速道路株式会社社債	0.03	200,000	200,032	2021/12/20
第64回東日本高速道路株式会社社債	0.14	100,000	99,247	2029/11/29
第67回東日本高速道路株式会社社債	0.22	200,000	200,092	2030/1/31
第33回中日本高速道路株式会社社債	1.084	100,000	101,387	2021/9/17
第42回中日本高速道路株式会社社債	0.942	100,000	101,661	2022/3/18
第59回中日本高速道路株式会社社債	0.309	100,000	100,451	2021/12/20
第83回中日本高速道路株式会社社債	0.04	100,000	99,971	2023/4/20
第27回西日本高速道路株式会社社債	0.58	100,000	102,357	2025/9/2

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３２回西日本高速道路株式会社社債	0.2	100,000	100,252	2026/10/19
第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	102,149	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	99,690	2026/8/19
第１２７回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	198,682	2034/5/30
小　計		33,023,820	34,708,788	
金融債券				
い第７９５号商工債	0.03	200,000	199,924	2021/8/27
い第８００号商工債	0.05	200,000	199,950	2022/1/27
い第８０２号商工債	0.06	100,000	99,990	2022/3/25
い第８０４号商工債	0.06	300,000	299,964	2022/5/27
い第８３２号商工債	0.06	200,000	199,352	2024/9/27
い第７９５号農林債	0.03	100,000	99,975	2021/8/27
い第７９６号農林債	0.03	200,000	199,946	2021/9/27
第３３７回信金中金債（５年）	0.11	100,000	100,102	2022/12/27
第３３８回信金中金債（５年）	0.11	100,000	100,106	2023/1/27
第３３９回信金中金債（５年）	0.11	200,000	200,218	2023/2/27
第３４２回信金中金債（５年）	0.11	100,000	100,119	2023/5/26
第３５０回信金中金債（５年）	0.08	100,000	99,890	2024/1/26
第２３６号商工債（３年）	0.02	300,000	299,511	2022/9/27
第２回信金中金債（１０年）	0.52	100,000	101,956	2025/9/26
小　計		2,300,000	2,301,003	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第４９９回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	103,331	2023/6/23
第５０３回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	101,907	2025/3/25
第５０７回中部電力株式会社社債	0.605	100,000	102,093	2026/1/23
第５１１回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	99,696	2026/7/24
第５１９回中部電力株式会社社債	0.84	100,000	103,236	2037/1/23
第５４０回中部電力株式会社社債	0.53	100,000	97,212	2040/2/24
第５０５回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	100,289	2023/8/25
第５０８回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	100,469	2027/4/23
第５１０回関西電力株式会社社債	0.49	200,000	201,248	2027/7/23
第５１１回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	100,034	2027/9/17
第３８５回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	102,580	2025/7/25
第３９８回中国電力株式会社社債	0.425	100,000	100,663	2027/7/23
第４００回中国電力株式会社社債	0.34	100,000	100,034	2027/9/24
第４０２回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,327	2024/10/25
第３０７回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	104,598	2026/6/25
第３２２回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	100,345	2027/6/25
第３３０回北陸電力株式会社社債	0.34	100,000	99,608	2029/5/25
第４７１回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	130,585	2023/12/25
第４８１回東北電力株式会社社債	0.803	100,000	102,883	2025/7/25
第４８７回東北電力株式会社社債	0.17	100,000	100,097	2023/9/25
第４９６回東北電力株式会社社債	0.355	100,000	100,070	2027/9/24
第５２１回東北電力株式会社社債	0.45	100,000	100,337	2030/5/24
第２５３回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	102,737	2023/6/23
第４２６回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	103,361	2024/2/23

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４４９回九州電力株式会社社債	0.43	200,000	201,144	2027/4/23
第４６５回九州電力株式会社社債	0.38	100,000	99,920	2028/7/25
第４６８回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	100,318	2028/8/25
第４８４回九州電力株式会社社債	0.375	200,000	199,164	2029/11/22
第３１７回北海道電力株式会社社債	1.139	200,000	206,616	2023/11/24
第３２０回北海道電力株式会社社債	0.585	201,000	202,435	2021/12/24
第３２６回北海道電力株式会社社債	0.789	100,000	102,625	2025/12/25
第３４０回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	100,638	2027/4/23
第３４４回北海道電力株式会社社債	0.18	200,000	200,138	2022/9/22
第３５１回北海道電力株式会社社債	0.18	200,000	200,060	2023/7/25
第２１回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,374	2021/12/3
第２４回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,747	2027/11/30
第７回住友林業株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,757	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	99,892	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	99,839	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	101,583	2025/2/28
第２４回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	99,811	2025/8/29
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	100,439	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	102,603	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	99,907	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	99,138	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	102,161	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	99,912	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	99,631	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	100,282	2028/11/29
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	102,541	2024/6/19
第５７回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,784	2024/9/13
第９回イビデン株式会社無担保社債	0.03	100,000	99,580	2022/9/12
第４回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	99,797	2028/8/31
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	99,850	2028/2/25
第３２回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	200,000	198,238	2027/2/26
第４回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	99,508	2028/3/23
第５回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.005	400,000	398,244	2022/9/27
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	99,760	2026/3/6
第４２回ＤＩＣ株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,887	2023/4/17
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	96,749	2029/7/31
第１４回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,454	2023/3/3
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	102,781	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	102,205	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	99,502	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	99,552	2026/4/17
第２回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	98,571	2026/6/19
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	101,346	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	98,473	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	100,505	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	99,657	2024/6/20
第２０回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	98,738	2030/3/12
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	200,000	201,490	2022/3/18
第１５回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	200,000	200,164	2021/9/17
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,314	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	200,638	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	99,694	2028/3/17
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,584	2024/9/3
第３５回三菱重工業株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,400	2027/8/27
第１１回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,532	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	99,711	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	99,452	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	197,976	2026/9/25
第１２回本田技研工業株式会社無担保社債	0.05	200,000	199,400	2023/3/3
第１回明治安田生命２０１８基金特定目的会社特定社債	0.315	100,000	98,895	2023/9/25
第２１回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	102,364	2024/3/14
第６回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	96,335	2040/3/9
第１４回株式会社岡村製作所無担保社債	0.18	200,000	199,870	2022/4/25
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	101,817	2024/5/30
第１０８回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	98,603	2027/7/12
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	99,686	2024/2/22
第７０回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	116,777	2033/3/4
第５３回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,276	2027/7/26
第５６回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	99,478	2028/9/14
第２２回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債（劣後特	0.61	100,000	97,092	2029/12/12
第１１回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.05	700,000	698,894	2021/7/27
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	118,468	2029/10/16
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	2.34	100,000	114,321	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	101,852	2023/1/23

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	100,892	2024/9/12
第１１回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	100,000	101,401	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	302,340	2024/7/16
第５７回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,152	2026/6/19
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	100,127	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	99,806	2021/9/24
第３７回リコーリース株式会社無担保社債	0.02	300,000	298,416	2022/10/11
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	103,254	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	99,719	2023/12/20
第１９３回オリックス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,723	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	199,586	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	99,765	2023/10/25
第５２回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	199,456	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	100,224	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	99,062	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	199,454	2023/9/4
第６６回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	199,406	2026/3/13
第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	198,292	2027/6/18
第１３１回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	96,927	2039/8/5
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,473	2024/4/26
第１００回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	102,237	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	102,570	2023/6/26
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	104,131	2026/6/17
第８６回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	100,877	2046/9/26
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	103,343	2025/12/12
第８４回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	97,408	2039/6/20
第８６回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	97,535	2049/12/3
第４２回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	99,841	2040/5/25
第５１回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,876	2028/9/7
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.36	100,000	104,028	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	114,222	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	235,460	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	99,298	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	109,489	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	112,454	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	19,771	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	116,836	2028/3/17

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46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	106,198	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	107,437	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	20,836	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	130,999	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	126,557	2044/10/28
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	100,000	111,881	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	111,128	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	96,839	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	98,522	2070/1/31
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.878	200,000	196,448	2049/11/19
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,244	2025/9/4
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,640	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	202,708	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,989	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,831	2028/11/22
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	101,729	2023/9/20
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	108,967	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	102,935	2023/12/20
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	99,799	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,283	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,525	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	101,958	2023/6/20
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,692	2022/7/21
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	100,702	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	199,300	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	99,346	2021/10/14

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24回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.384	100,000	98,562	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.25	300,000	294,594	2024/10/10
第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.64	100,000	99,934	2022/1/27
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	99,294	2024/6/28
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	100,000	99,471	2023/7/12
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,258	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	99,529	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	99,478	2023/1/25
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	400,000	399,620	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	199,688	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	99,535	2024/6/7
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	99,821	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	200,000	204,640	2021/12/28
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	400,000	398,256	2023/7/6
第8回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,607	2023/6/2
小計		22,366,000	22,648,161	
合計		503,269,250	542,707,286	

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	542,707,286	97.6
コール・ローン等、その他	13,366,250	2.4
投資信託財産総額	556,073,536	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 2020年5月29日現在
(A)資産	**556,173,583,556円**
コール・ローン等	2,743,391,241
公社債(評価額)	542,707,286,724
未収入金	9,459,139,400
未収利息	1,143,782,560
前払費用	19,936,631
差入委託証拠金	100,047,000
(B)負債	**16,014,280,413**
未払金	15,848,798,730
未払解約金	65,428,617
未払利息	6,066
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純資産総額(A-B)	**540,159,303,143**
元本	382,125,773,582
次期繰越損益金	158,033,529,561
(D)受益権総口数	**382,125,773,582口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**14,136円**

■損益の状況

項目	当期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配当等収益	**3,993,324,195円**
受取利息	3,994,494,011
支払利息	△1,169,816
(B)有価証券売買損益	**△7,739,893,112**
売買益	221,216,098
売買損	△7,961,109,210
(C)先物取引等取引損益	**△3,408,610**
取引益	17,620,912
取引損	△21,029,522
(D)その他費用	**△1,950**
(E)当期損益金(A+B+C+D)	**△3,749,979,477**
(F)前期繰越損益金	**136,990,780,662**
(G)追加信託差損益金	**41,595,030,113**
(H)解約差損益金	**△16,802,301,737**
(I)計(E+F+G+H)	**158,033,529,561**
次期繰越損益金(I)	**158,033,529,561**

(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325,310,168,792円、期中追加設定元本額は96,281,195,630円、期中一部解約元本額は39,465,590,840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　101,532,000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	89,987,093,499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)	71,630,702,303円
DC日本債券インデックス・オープンP	68,684,918,633円
DCマイセレクション50	21,921,808,610円
DCマイセレクション25	20,736,719,257円
SMT 国内債券インデックス・オープン	18,108,334,758円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,702,516,558円
分散投資コア戦略ファンドA	11,300,905,890円
分散投資コア戦略ファンドS	9,428,922,910円
DCマイセレクションS50	9,381,437,203円
DCマイセレクションS25	8,976,050,867円
DCマイセレクション75	5,935,137,366円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,920,306,932円

バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,791,610,521円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,647,643,993円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,257,553,120円
DC世界経済インデックスファンド	2,586,812,801円
世界経済インデックスファンド	1,985,776,641円
DCマイセレクションS75	1,770,336,308円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,621,456,887円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,416,155,589円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,286,276,502円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,098,470,542円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,086,514,202円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	920,502,175円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	843,330,859円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	730,622,594円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	465,060,158円
DC日本債券インデックス・オープン	456,085,316円
グローバル経済コア	223,606,650円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	211,159,302円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	149,555,063円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	142,110,136円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	88,530,300円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	84,956,371円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	79,661,373円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	66,153,693円
SMT インデックスバランス・オープン	56,783,488円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	51,743,667円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	46,158,857円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	40,367,643円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	38,376,812円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	31,793,697円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	26,527,460円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	25,765,905円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,705,048円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	14,563,891円
SMT 世界経済インデックス・オープン	13,937,840円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	13,051,579円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,235,535円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	5,739,340円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,170,615円
エマージング株式オープン	2,227,240円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,558,964円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	894,939円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	172,959円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	140,445円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	44,295円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	17,481円

お知らせ

該当事項はありません。

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23期～第25期(2020年１月８日～2020年７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
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
23期(2020年3月9日)	12,858	60	△14.1	141.65	△14.1	95.3	1.8	2.9	37,378
24期(2020年5月7日)	12,496	25	△ 2.6	138.13	△ 2.5	96.0	0.9	2.5	41,386
25期(2020年7月7日)	14,264	65	14.7	158.43	14.7	96.0	1.5	2.5	46,430

＊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		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
			騰落率		騰落率			
		円	%		%	%	%	%
第23期	(期　首) 2020年１月７日	15,043	－	164.96	－	95.9	1.3	2.7
	１月末	15,206	1.1	166.79	1.1	95.5	1.7	2.7
	２月末	14,011	△ 6.9	153.73	△ 6.8	95.7	1.3	2.8
	(期　末) 2020年３月９日	12,918	△14.1	141.65	△14.1	95.3	1.8	2.9
第24期	(期　首) 2020年３月９日	12,858	－	141.65	－	95.3	1.8	2.9
	３月末	11,852	△ 7.8	130.85	△ 7.6	95.8	1.5	2.7
	４月末	13,014	1.2	143.50	1.3	96.0	1.3	2.6
	(期　末) 2020年５月７日	12,521	△ 2.6	138.13	△ 2.5	96.0	0.9	2.5
第25期	(期　首) 2020年５月７日	12,496	－	138.13	－	96.0	0.9	2.5
	５月末	13,546	8.4	149.70	8.4	94.9	2.5	2.5
	６月末	13,805	10.5	152.64	10.5	95.9	1.6	2.5
	(期　末) 2020年７月７日	14,329	14.7	158.43	14.7	96.0	1.5	2.5

＊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]

当作成期の基準価額の騰落率は-4.1%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの-4.0%を0.1%下回りました。新型コロナウイルスの世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて、基準価額は下落しました。

[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]

収益分配金は、経費控除後の配当等収益の水準等を勘案して決定さ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、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

（2020年１月８日～2020年７月７日）

項目	第23期～第25期 金額	第23期～第25期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	12	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)	(0.071)	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）	(1)	(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)	(0.001)	
(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	0.006	(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)	(0.004)	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	14	0.099	
作成期間の平均基準価額は、13,572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

（2020年１月８日～2020年７月７日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第23期～第25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	2,385,916	5,667,797	1,196,750	3,571,041

＊単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

（2020年１月８日～2020年７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23期～第25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	71,793,667千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	601,334,965千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.11

＊(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2020年１月８日～2020年７月７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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

（2020年１月８日～2020年７月７日）

第23期首残高（元本）	設定元本	解約元本	第25期末残高（元本）	取引の理由
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７月７日現在）

親投資信託残高

銘柄	第22期末	第25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	14,708,966	15,898,131	46,425,724

＊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７月７日現在）

項　　目	第25期末	
	評　価　額	比　率
	千円	%
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	46,425,724	99.4
コール・ローン等、その他	258,507	0.6
投資信託財産総額	46,684,231	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25期末における外貨建て純資産（681,197,465千円）の投資信託財産総額（681,704,463千円）に対する比率は99.9%です。
＊外貨建て資産は、第25期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。１米ドル＝107.30円、１カナダドル＝79.32円、１英ポンド＝134.26円、１スイスフラン＝113.99円、１スウェーデンクローナ＝11.64円、１ノルウェークローネ＝11.46円、１デンマーククローネ＝16.31円、１ユーロ＝121.54円、１香港ドル＝13.85円、１シンガポールドル＝77.18円、１豪ドル＝74.99円、１ニュージーランドドル＝70.59円、１新シェケル＝31.07円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項　　目	第23期末	第24期末	第25期末
	2020年３月９日現在	2020年５月７日現在	2020年７月７日現在
	円	円	円
(A) 資産	**37,566,703,470**	**41,487,189,736**	**46,684,231,544**
コール・ローン等	17,491,386	14,500,670	16,986,698
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	37,374,793,304	41,381,875,085	46,425,724,275
未収入金	174,418,780	90,813,981	241,520,571
(B) 負債	**187,928,909**	**101,054,810**	**253,909,588**
未払収益分配金	174,418,779	82,798,875	211,580,902
未払解約金	－	7,000,000	28,999,999
未払信託報酬	13,261,469	11,048,777	13,083,383
未払利息	29	13	13
その他未払費用	248,632	207,145	245,291
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	**37,378,774,561**	**41,386,134,926**	**46,430,321,956**
元本	29,069,796,630	33,119,550,242	32,550,908,094
次期繰越損益金	8,308,977,931	8,266,584,684	13,879,413,862
(D) 受益権総口数	**29,069,796,630口**	**33,119,550,242口**	**32,550,908,094口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**12,858円**	**12,496円**	**14,264円**

(注) 第23期首元本額は29,762,583,938円、第23～25期中追加設定元本額は4,884,406,932円、第23～25期中一部解約元本額は2,096,082,776円、１口当たり純資産額は、第23期1.2858円、第24期1.2496円、第25期1.4264円です。

○損益の状況

項　　目	第23期 2020年１月８日～ 2020年３月９日	第24期 2020年３月10日～ 2020年５月７日	第25期 2020年５月８日～ 2020年７月７日
	円	円	円
(A) 配当等収益	**△ 483**	**△ 573**	**△ 820**
支払利息	△ 483	△ 573	△ 820
(B) 有価証券売買損益	**△6,137,504,312**	**△ 445,987,913**	**5,965,211,098**
売買益	67,655,815	2,433,151	6,077,851,483
売買損	△6,205,160,127	△ 448,421,064	△ 112,640,385
(C) 信託報酬等	**△ 13,510,101**	**△ 11,255,922**	**△ 13,328,674**
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**△6,151,014,896**	**△ 457,244,408**	**5,951,881,604**
(E) 前期繰越損益金	**5,487,318,045**	**△ 835,861,526**	**△ 1,343,577,270**
(F) 追加信託差損益金	**9,147,093,561**	**9,642,489,493**	**9,482,690,430**
（配当等相当額）	(9,732,921,538)	(11,861,679,514)	(11,704,281,703)
（売買損益相当額）	(△ 585,827,977)	(△ 2,219,190,021)	(△ 2,221,591,273)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**8,483,396,710**	**8,349,383,559**	**14,090,994,764**
(H) 収益分配金	**△ 174,418,779**	**△ 82,798,875**	**△ 211,580,902**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**8,308,977,931**	**8,266,584,684**	**13,879,413,862**
追加信託差損益金	9,147,093,561	9,642,489,493	9,482,690,430
（配当等相当額）	(9,733,434,567)	(11,873,496,797)	(11,704,841,087)
（売買損益相当額）	(△ 586,341,006)	(△ 2,231,007,304)	(△ 2,222,150,657)
分配準備積立金	5,438,699,879	5,476,788,990	5,302,864,821
繰越損益金	△6,276,815,509	△ 6,852,693,799	△ 906,141,389

＊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18期(計算期間：2019年４月２日～2020年３月31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）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11.3%の下落となったのに対して、基準価額は11.6%の下落となりました。

[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

（2019年４月２日～2020年３月31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	0.002	(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	0.008	(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	3	0.010	(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）	(3)	(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）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	6	0.020	
期中の平均基準価額は、28,483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

（2019年４月２日～2020年３月31日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
外国	アメリカ	百株 79,777 (9,263)	千米ドル 641,771 (35,140)	百株 27,997 (8,405)	千米ドル 198,584 (47,724)
	カナダ	12,595 (109)	千カナダドル 52,239 (3,059)	5,978 (2,246)	千カナダドル 14,214 (5,445)
	イギリス	76,298 (289,640)	千英ポンド 46,418 (551)	21,076 (286,677)	千英ポンド 12,519 (1,427)
	スイス	4,433 (592)	千スイスフラン 31,526 (△ 793)	1,247	千スイスフラン 9,128
	スウェーデン	5,916 (1,740)	千スウェーデンクローナ 83,865 (17,719)	2,310 (700)	千スウェーデンクローナ 23,975 (17,719)
	ノルウェー	1,289 (129)	千ノルウェークローネ 17,555 (－)	669	千ノルウェークローネ 10,486
	デンマーク	962 (28)	千デンマーククローネ 46,598 (－)	364	千デンマーククローネ 15,937
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	6,566 (95)	26,839 (△ 333)	1,927 (59)	8,324 (271)
	イタリア	13,204	7,480	5,178	2,028
	フランス	7,145 (120)	32,504 (△ 20)	2,040	9,026
	オランダ	5,950	17,633	534	3,393
	スペイン	11,899 (24,179)	9,106 (854)	3,328 (23,448)	2,614 (622)
	ベルギー	512	3,812	81	648
	オーストリア	218 (－)	673 (△ 56)	58	223
	ルクセンブルグ	782	742	54	228
	フィンランド	2,142 (413)	3,096 (－)	467	735
	アイルランド	300	1,311	102	521
	ポルトガル	620	540	150	217
	香港	24,871 (1,426)	千香港ドル 91,240 (－)	11,229	千香港ドル 31,614

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	シンガポール	百株 8,940	千シンガポールドル 5,481	百株 11,890	千シンガポールドル 1,646
	オーストラリア	20,306 (1,903)	千豪ドル 34,833 (2,517)	5,798 (1,903)	千豪ドル 10,804 (2,622)
	ニュージーランド	2,713	千ニュージーランドドル 1,553	－	千ニュージーランドドル －
	イスラエル	2,988 (82)	千新シェケル 6,260 (－)	3,081	千新シェケル 1,711

＊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		売付	
		口数	金額	口数	金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	AGNC INVESTMENT CORP	9,000	140	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,500	503	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	12,600	2,768	3,400	760
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	18,000	158	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,100	804	1,400	288
	BOSTON PROPERTIES	5,200	639	1,200	167
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	—	—	15,000	292
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,400	153	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	10,000	1,414	2,300	326
	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,900	1,680	—	—
	DUKE REALTY CORP	8,800	288	—	—
	EQUINIX INC	2,320	1,297	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,400 (12,100)	1,617 (—)	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	10,300	783	3,900	310
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,040	319	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	300	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,300	168	—	—
	HCP INC	4,400 (△ 70,500)	157 (△ 2,226)	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,200 (70,500)	167 (2,226)	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	9,000	142	—	—
	INVITATION HOMES INC	40,000	1,052	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	4,800	156	—	—
	KIMCO REALTY CORP	7,000	146	—	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,600 (△ 22,400)	137 (△ 1,096)	—	—
	MACERICH CO /THE	4,300	139	18,500	494
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,670	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	327	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,900	236	—	—
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,200	1,354	—	—
	PROLOGIS INC	16,780 (15,120)	1,374 (1,096)	3,700	320
	PUBLIC STORAGE	3,000	687	—	—
	REALTY INCOME CORP	10,600	780	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	5,200	320	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,570	649	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,800	944	2,200	329
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	1,861	—	—
	UDR INC	9,600	396	—	—
	VENTAS INC	7,600	502	—	—
	VEREIT INC	35,000	330	—	—
	VICI PROPERTIES INC	68,000	1,672	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	2,800	135	—	—
	WP CAREY INC	5,900	424	—	—
	WELLTOWER INC	13,500	1,073	2,100	173

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	WEYERHAEUSER CO	20,000	511	5,500	165
	小計	541,310 (4,820)	30,390 (－)	59,200	3,630
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	629	－	－
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	－ (25,000)	－ (535)	9,000	188
	小計	11,500 (25,000)	629 (535)	9,000	188
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	HAMMERSON PLC	－	－	108,000	300
	SEGRO PLC	31,000	238	－	－
	LAND SECURITIES GROUP PLC	12,000	91	－	－
	小計	43,000	329	108,000	300
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	ICADE	1,400	98	1,300	121
	KLEPIERRE	4,300	88	－	－
	GECINA SA	700	121	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,300	243	－	－
	小計	8,700	551	1,300	121
	ユーロ計	8,700	551	1,300	121
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	55,000	4,384	13,000	1,056
	小計	55,000	4,384	13,000	1,056
	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	178	60,000	146
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	－ (60,800)	－ (170)	－	－
	ASCENDAS REAL ESTATE-RTS	－ (60,800)	－ (159)	－ (60,800)	－ (20)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,000	138	－	－
	SUNTEC REIT	－ (－)	－ (△ 2)	－	－
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000 (－)	845 (△ 0.09)	－	－
	小計	510,000 (121,600)	1,162 (327)	60,000 (60,800)	146 (20)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	170,000	433	－	－
	GPT GROUP	29,000	178	－	－
	LENDLEASE GROUP	11,000	195	－	－
	DEXUS	31,000	390	－	－
	GOODMAN GROUP	27,000	378	－	－
	SCENTRE GROUP	147,000	330	－	－
	VICINITY CENTRES	60,000	159	70,000	171
	小計	475,000	2,067	70,000	171

＊金額は受け渡し代金。
＊金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。
＊（ ）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 104,098	百万円 105,073	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

（2019年４月２日～2020年３月31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	133,290,598千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	580,156,228千円
(c) 売買高比率（a）／（b）	0.22

＊(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４月２日～2020年３月31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	112,554	－	－	54,520	743	1.4

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

（2020年３月31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	1,053	1,147	4,159	452,626	保険
AES CORP	910	1,010	1,379	150,148	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC	9,938	11,424	34,534	3,758,417	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	2,396	2,768	21,961	2,390,049	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	2,059	2,316	17,425	1,896,426	バイオテクノロジー
ABIOMED INC	58	72	1,072	116,744	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,004	1,208	7,063	768,685	娯楽
ACUITY BRANDS INC	50	62	531	57,866	電気設備
ADOBE INC	665	757	24,121	2,625,113	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	99	109	1,051	114,472	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES	1,260	1,663	7,959	866,190	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	75	—	—	—	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC	444	490	3,560	387,525	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS	304	347	7,166	779,940	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	225	258	2,430	264,468	情報技術サービス
ALBEMARLE CORP	148	167	928	101,050	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	307	342	2,984	324,780	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC	102	118	2,123	231,052	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP	21	23	1,300	141,574	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	66	66	226	24,636	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP	310	376	1,901	206,932	電力
ALLSTATE CORP	466	506	4,788	521,163	保険
ALLY FINANCIAL INC	574	574	879	95,701	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	127	175	1,904	207,269	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C	429	483	55,425	6,031,990	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL A	408	468	53,693	5,843,426	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALTICE USA INC-A	470	200	458	49,865	メディア
ALTRIA GROUP INC	2,561	2,931	10,935	1,190,117	タバコ
AMAZON.COM INC	568	658	129,306	14,072,422	インターネット販売・通信販売
AMERCO	11	11	346	37,687	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	328	391	3,056	332,633	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	146	146	178	19,464	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER	683	777	6,504	707,859	電力
AMERICAN EXPRESS CO	999	1,079	9,740	1,060,018	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	108	125	894	97,348	保険
AMERICAN INTL GROUP	1,198	1,378	3,542	385,567	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	247	283	3,586	390,283	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	220	239	2,105	229,151	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	192	203	2,215	241,139	資本市場
AMETEK INC	318	355	2,617	284,814	電気設備
AMGEN INC	872	930	19,388	2,110,065	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	413	464	3,518	382,919	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE	678	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC	510	581	5,285	575,205	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	115	134	3,150	342,895	ソフトウェア
ANTHEM INC	354	394	9,084	988,704	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION	541	541	222	24,198	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	6,488	6,940	176,855	19,247,235	コンピュータ・周辺機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
APPLIED MATERIALS	1,363	1,436	6,792	739,203	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	354	410	864	94,104	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	755	884	3,167	344,705	食品
ARCONIC INC	570	570	934	101,734	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC	74	81	1,666	181,355	通信機器
ARROW ELECTRS INC	121	121	650	70,740	電子装置・機器・部品
ASSURANT INC	76	90	965	105,126	保険
ATMOS ENERGY CORP	156	184	1,891	205,894	ガス
AUTODESK INC.	300	342	5,332	580,294	ソフトウェア
AUTOLIV INC	119	119	555	60,505	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	595	679	9,357	1,018,428	情報技術サービス
AUTOZONE	34	36	3,216	350,028	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	122	134	1,403	152,788	容器・包装
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	310	—	—	—	各種金融サービス
BB&T CORPORATION	1,049	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES CO	681	1,010	1,106	120,470	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	454	475	3,134	341,130	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	12,735	13,370	29,467	3,206,945	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,368	1,279	4,348	473,258	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC.	696	755	6,205	675,327	ヘルスケア機器・用品
BECTON,DICKINSON	369	420	9,360	1,018,707	ヘルスケア機器・用品
BEIGENE, LTD ADR	46	63	789	85,971	バイオテクノロジー
WR BERKLEY CORP	130	217	1,182	128,731	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,768	2,055	37,643	4,096,741	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	338	363	2,168	236,044	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	36	1,270	138,296	ライフサイエンス・ツール/サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	241	280	2,309	251,366	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	275	283	8,959	975,021	バイオテクノロジー
BLACK KNIGHT INC	—	242	1,426	155,255	情報技術サービス
BLACKROCK INC	161	181	8,282	901,418	資本市場
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	1,040	4,917	535,130	資本市場
H & R BLOCK INC	279	—	—	—	各種消費者サービス
BOEING CO	739	838	12,761	1,388,786	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC	63	65	8,503	925,435	インターネット販売・通信販売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	226	1,610	175,317	情報技術サービス
BORGWARNER INC	296	296	727	79,181	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,891	2,193	6,938	755,133	ヘルスケア機器・用品
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	139	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,222	3,670	19,961	2,172,369	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	163	179	1,735	188,844	情報技術サービス
BROADCOM INC	565	622	14,934	1,625,358	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	—	388	1,447	157,503	保険
BROWN-FORMAN CORP-CL B	356	478	2,706	294,593	飲料
BURLINGTON STORES INC	89	105	1,706	185,725	専門小売り
CBS CORP-CL B	470	—	—	—	メディア
CBOE GLOBAL MARKETS INC	150	179	1,665	181,227	資本市場
CBRE GROUP INC	455	483	1,981	215,673	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	167	200	683	74,330	ソフトウェア
CDW CORPORATION	211	224	2,170	236,246	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	314	353	939	102,266	化学
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	183	201	1,310	142,602	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	519	580	10,339	1,125,202	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC	134	—	—	—	銀行
CME GROUP INC	488	562	9,778	1,064,165	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	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
CMS ENERGY CORP	378	433	2,682	291,882	総合公益事業
CSX CORP	1,090	1,162	6,741	733,723	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,781	2,040	12,174	1,324,974	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
CABOT OIL & GAS CORP	585	640	1,120	121,959	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	378	446	2,984	324,768	ソフトウェア
CAMPBELL SOUP CO	248	248	1,153	125,583	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	656	723	3,894	423,871	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	410	443	2,145	233,537	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	239	261	1,455	158,355	専門小売り
CARNIVAL CORP	586	621	794	86,506	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	811	868	9,696	1,055,262	機械
CELANESE CORP-SERIES A	180	196	1,452	158,060	化学
CELGENE CORP	962	—	—	—	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	558	921	5,315	578,441	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	704	754	1,223	133,179	総合公益事業
CENTURYLINK INC	1,360	1,480	1,456	158,491	各種電気通信サービス
CERNER CORP	406	499	3,205	348,862	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	217	235	10,633	1,157,287	メディア
CHEMOURS CO/THE	234	—	—	—	化学
CHENIERE ENERGY INC	286	364	1,184	128,904	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	2,619	2,960	21,297	2,317,774	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	33	41	2,636	286,949	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	329	375	2,430	264,497	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	138	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	216	246	1,961	213,481	保険
CISCO SYSTEMS	6,163	6,638	26,764	2,912,771	通信機器
CINTAS CORP	127	134	2,418	263,154	商業サービス・用品
CITIGROUP	3,345	3,421	15,079	1,641,131	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	639	700	1,375	149,695	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	185	199	2,903	315,999	ソフトウェア
CLOROX CO	177	193	3,367	366,481	家庭用品
COCA COLA CO	5,520	6,368	28,656	3,118,632	飲料
COGNEX CORP	248	278	1,263	137,538	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	804	866	4,103	446,541	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,127	1,265	8,422	916,606	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	6,220	7,104	25,212	2,743,832	メディア
COMERICA INC	230	230	713	77,670	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	228	—	—	—	通信機器
CONAGRA BRANDS INC	667	769	2,170	236,257	食品
CONCHO RESOURCES INC	276	310	1,273	138,592	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,586	1,710	5,008	545,084	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	423	525	4,238	461,256	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	228	259	3,792	412,769	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	139	139	107	11,663	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	65	75	2,123	231,104	ヘルスケア機器・用品
COPART INC	279	319	2,291	249,405	商業サービス・用品
CORNING INC	1,080	1,190	2,532	275,592	電子装置・機器・部品
CORTEVA INC	—	1,150	2,770	301,497	化学
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	597	691	20,133	2,191,167	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	51	58	3,485	379,375	専門サービス
COTY INC-CL A	650	490	265	28,849	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	191	212	1,240	135,017	容器・包装
CUMMINS INC	205	226	3,039	330,761	機械
DR HORTON INC	480	538	1,981	215,700	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	
DTE ENERGY COMPANY	251	305	3,032	330,039	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	378	378	545	59,402	情報技術サービス
DANAHER CORP	860	981	13,814	1,503,425	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	166	198	1,125	122,502	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	175	148	1,130	123,072	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	422	471	6,651	723,929	機械
DELL TECHNOLOGIES-C	207	266	1,058	115,216	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC	224	252	722	78,627	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	303	352	1,379	150,167	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	624	624	396	43,122	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	116	144	4,025	438,088	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	216	231	544	59,304	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO	2,459	2,820	28,143	3,062,867	娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	463	496	1,864	202,909	消費者金融
DISCOVERY INC - A	193	245	490	53,353	メディア
DISCOVERY INC - C	398	570	1,023	111,349	メディア
DISH NETWORK CORP-A	319	371	769	83,699	メディア
DOCUSIGN INC	—	166	1,463	159,231	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	361	397	5,826	634,127	複合小売り
DOLLAR TREE INC	324	376	3,002	326,746	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	1,024	1,278	9,816	1,068,309	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	52	59	2,045	222,647	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	197	229	1,961	213,432	機械
DOW INC	—	1,152	3,300	359,191	化学
DOWDUPONT INC	3,141	—	—	—	化学
DROPBOX INC-CLASS A	—	390	707	77,035	ソフトウェア
DUKE ENERGY CORP	973	1,138	9,497	1,033,639	電力
DUPONT DE NEMOURS INC	—	1,150	3,866	420,769	化学
EOG RESOURCES INC	800	904	3,162	344,141	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	350	350	1,235	134,497	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	207	207	556	60,577	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	186	208	990	107,773	化学
EATON VANCE CORP	164	164	553	60,290	資本市場
EBAY INC	1,237	1,200	3,742	407,328	インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC	360	401	6,472	704,362	化学
EDISON INTERNATIONAL	450	555	3,125	340,116	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	284	325	6,371	693,459	ヘルスケア機器・用品
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	361	600	1,355	147,508	医薬品
ELECTRONIC ARTS	408	461	4,503	490,116	娯楽
EMERSON ELEC	861	938	4,373	476,010	電気設備
ENTERGY CORP	254	313	3,132	340,876	電力
EPAM SYSTEMS INC	—	84	1,581	172,065	情報技術サービス
EQUIFAX INC	161	185	2,258	245,830	専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	620	958	104,315	各種金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	37	645	70,201	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	349	1,502	163,511	水道
EVERGY INC	372	359	2,122	230,942	電力
EVERSOURCE ENERGY	442	503	4,207	457,912	電力
EXACT SCIENCES CORP	—	226	1,320	143,711	バイオテクノロジー
EXELON CORPORATION	1,322	1,515	5,640	613,838	電力
EXPEDIA GROUP INC	173	207	1,167	127,034	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	230	273	1,828	198,971	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	5,784	6,621	24,828	2,702,112	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	178	207	665	72,404	電子装置・機器・部品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
FMC CORP	180	196	1,619	176,276	化学
FACEBOOK INC-A	3,283	3,761	62,413	6,792,493	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ・ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	59	1,586	172,710	資本市場
FASTENAL CO	387	874	2,779	302,473	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	344	391	4,860	528,970	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	81	93	1,021	111,140	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	451	964	12,077	1,314,443	情報技術サービス
FNF GROUP	372	405	1,069	116,361	保険
FIFTH THIRD BANCORP	1,063	1,120	1,776	193,377	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	740	—	—	—	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	226	257	2,220	241,654	銀行
FISERV INC	541	908	8,928	971,673	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	714	834	3,376	367,504	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	121	138	2,677	291,389	情報技術サービス
FLUOR CORP	184	—	—	—	建設・土木
FLOWSERVE CORP	172	206	463	50,420	機械
FORD MOTOR COMPANY	5,160	6,070	3,053	332,280	自動車
FORTINET INC	199	228	2,301	250,489	ソフトウェア
FORTIVE CORP	406	476	2,479	269,894	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	194	216	961	104,630	建設関連製品
FOX CORP-CLASS A	480	528	1,283	139,690	メディア
FOX CORP-CLASS B	198	254	603	65,706	メディア
FRANKLIN RESOURCES INC	434	434	770	83,884	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,870	2,250	1,404	152,797	金属・鉱業
ARTHUR J GALLAGHER & CO	249	297	2,471	268,987	保険
GAP INC	315	315	233	25,436	専門小売り
GARTNER INC	127	141	1,520	165,434	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	345	383	5,116	556,870	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	11,980	13,550	10,690	1,163,496	コングロマリット
GENERAL MILLS	805	943	5,101	555,210	食品
GENERAL MOTORS CO	1,757	1,990	4,242	461,730	自動車
GENUINE PARTS CO	196	232	1,533	166,842	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,762	1,982	15,049	1,637,818	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	212	473	7,153	778,480	情報技術サービス
GLOBE LIFE INC	—	157	1,165	126,814	保険
GODADDY INC - CLASS A	227	269	1,591	173,192	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	457	501	7,996	870,309	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	340	—	—	—	自動車部品
GRAINGER(W.W.) INC	64	70	1,785	194,368	商社・流通業
GRUBHUB INC	119	145	573	62,411	インターネット販売・通信販売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	121	1,005	109,403	ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC	375	424	3,856	419,725	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	268	740	80,616	商社・流通業
HP INC	2,190	2,320	4,138	450,434	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	1,196	1,280	815	88,735	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	510	510	411	44,735	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	224	224	401	43,685	自動車
HARRIS CORP	160	—	—	—	航空宇宙・防衛
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	482	545	1,953	212,575	保険
HASBRO INC	158	196	1,401	152,471	レジャー用品
HEICO CORP	—	63	484	52,718	航空宇宙・防衛
HEICO CORP-CLASS A	—	124	818	89,079	航空宇宙・防衛
HELMERICH & PAYNE	146	—	—	—	エネルギー設備・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	106	117	1,825	198,700	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HERSHEY CO/THE	190	235	3,237	352,373	食品
HESS CORP	366	432	1,379	150,117	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,000	2,020	2,030	220,935	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	395	416	2,857	310,936	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	236	236	614	66,829	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	408	433	1,515	164,931	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,548	1,706	33,454	3,640,870	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,009	1,120	14,756	1,605,895	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	391	456	2,133	232,152	食品
HUMANA INC	185	204	6,377	694,020	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	118	132	1,234	134,404	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,410	1,540	1,289	140,363	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	56	65	1,232	134,079	航空宇宙・防衛
IAC/INTERACTIVE CORP	104	126	2,268	246,840	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ・ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ
IPG PHOTONICS CORP	47	59	644	70,116	電子装置・機器・部品
IDEX CORP	103	123	1,683	183,228	機械
IDEXX LABORATORIES INC	121	136	3,277	356,730	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	405	500	7,117	774,597	機械
ILLUMINA INC	201	228	6,320	687,821	ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ
INCYTE CORP	249	285	2,056	223,846	バイオテクノロジー
INGERSOLL-RAND INC	—	528	1,254	136,581	機械
INGREDION INC	96	96	741	80,739	食品
INSULET CORP	—	98	1,710	186,195	ヘルスケア機器・用品
INTEL CORP	6,256	6,802	37,744	4,107,711	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	785	876	7,341	799,003	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,244	1,388	15,674	1,705,875	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	115	155	1,674	182,198	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	523	598	1,873	203,896	容器・包装
INTERPUBRIC GROUP	500	580	939	102,256	メディア
INTUIT INC	337	404	9,617	1,046,642	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	155	181	9,151	995,967	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	214	1,031	112,279	バイオテクノロジー
IQVIA HOLDINGS INC	224	252	2,847	309,849	ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ
JPMORGAN CHASE & CO	4,544	4,903	45,843	4,989,099	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	179	200	1,559	169,753	建設・土木
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	420	430	602	65,515	各種金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	3,665	4,114	54,720	5,955,211	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	63	76	816	88,864	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	467	530	1,073	116,801	通信機器
KLA CORP	219	244	3,648	397,043	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC-A	680	784	1,922	209,211	資本市場
KANSAS CITY SOUTHERN	142	151	1,953	212,614	陸運・鉄道
KELLOGG CO	356	400	2,436	265,153	食品
KEYCORP	1,460	1,580	1,704	185,535	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	252	289	2,475	269,416	電子装置・機器・部品
KIMBERLY-CLARK CORP	469	533	7,058	768,178	家庭用品
KINDER MORGAN INC	2,730	3,150	4,180	454,914	石油・ガス・消耗燃料
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	167	208	692	75,357	陸運・鉄道
KOHLS CORP	225	253	405	44,136	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	847	1,041	2,620	285,156	食品
KROGER CO	1,076	1,269	3,762	409,482	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	303	—	—	—	専門小売り
LKQ CORP	450	450	945	102,844	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	109	—	—	—	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	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	344	6,259	681,213	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	142	149	1,966	213,965	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
LAM RESEARCH	212	224	5,718	622,368	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	193	217	1,250	136,123	食品
LAS VEGAS SANDS CORP	549	538	2,339	254,636	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	299	344	5,683	618,580	パーソナル用品
LEAR CORP	93	84	743	80,949	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	189	189	530	57,736	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	200	215	2,008	218,611	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	407	430	1,718	187,000	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	51	954	103,891	建設関連製品
LIBERTY BROADBAND CORP-C	139	167	1,904	207,263	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	129	129	390	42,482	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	224	267	815	88,800	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	293	293	778	84,756	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,224	1,353	18,730	2,038,487	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	299	299	815	88,769	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	208	230	1,040	113,214	娯楽
LOCKHEED MARTIN	349	397	13,880	1,510,641	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	361	433	1,534	166,958	保険
LOWES COS INC	1,098	1,205	10,689	1,163,344	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	138	172	3,335	363,031	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	179	200	2,138	232,678	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	700	790	910	99,129	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	120	131	3,865	420,666	資本市場
MACYS INC	437	—	—	—	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	80	96	529	57,650	専門サービス
MARATHON OIL CORP	1,110	1,230	398	43,370	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	946	985	2,396	260,811	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	18	21	2,017	219,519	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	58	2,051	223,287	資本市場
MARSH & MCLENNAN COS	691	794	7,110	773,810	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	394	432	3,290	358,062	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	89	97	1,741	189,510	建設資材
MASCO CORP	428	428	1,509	164,284	建設関連製品
MASTERCARD INC	1,259	1,403	35,553	3,869,316	情報技術サービス
MATCH GROUP INC	—	84	560	60,947	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ・ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ
MATTEL INC	480	—	—	—	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	374	424	2,116	230,304	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	168	189	2,705	294,443	食品
MCDONALD'S CORP	1,056	1,179	19,822	2,157,285	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	270	256	3,533	384,530	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	340	340	423	46,141	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	57	69	3,270	355,921	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	3,564	3,983	30,649	3,335,550	医薬品
METLIFE INC	1,159	1,206	3,862	420,390	保険
METTLER-TOLEDO INTL	34	38	2,659	289,417	ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ
MICROSOFT CORP	9,970	11,321	181,396	19,741,368	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	330	373	2,573	280,055	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,545	1,740	7,746	843,049	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	75	87	495	53,968	機械
MOHAWK INDUSTRIES	87	87	697	75,887	家庭用耐久財
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	256	284	1,144	124,558	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,985	2,259	11,550	1,257,015	食品

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	
MONGODB INC	—	74	1,009	109,872	情報技術サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	559	638	3,700	402,714	飲料
MOODYS CORP	235	268	5,955	648,136	資本市場
MORGAN STANLEY	1,753	1,910	6,654	724,202	資本市場
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	450	450	199	21,744	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	488	560	560	60,944	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	221	268	3,574	388,992	通信機器
NRG ENERGY INC	400	405	1,152	125,396	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NVR INC	4	5	1,517	165,127	家庭用耐久財
NASDAQ INC	154	184	1,829	199,125	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	506	580	545	59,334	エネルギー設備・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	250	—	—	—	医薬品
NETAPP INC	352	352	1,433	155,990	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	595	685	25,440	2,768,682	娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	142	1,300	141,541	バイオテクノロジー
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,610	1,840	697	75,893	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	307	354	1,663	181,071	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	300	333	690	75,198	コングロマリット
NEWELL BRANDS INC	670	660	900	97,973	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	717	1,276	5,915	643,787	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	550	550	485	52,793	メディア
NEXTERA ENERGY INC	651	765	18,819	2,048,155	電力
NIKE INC-B	1,742	1,952	16,666	1,813,779	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	476	582	1,517	165,188	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	644	710	377	41,029	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	150	150	236	25,760	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	371	403	5,976	650,377	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	284	321	2,432	264,768	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	223	251	7,893	859,016	航空宇宙・防衛
NORTONLIFELOCK INC	—	980	1,871	203,707	ソフトウェア
NUCOR CORP	427	467	1,630	177,476	金属・鉱業
NVIDIA CORP	796	909	24,166	2,629,989	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	286	325	1,036	112,829	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	110	119	3,808	414,504	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	1,029	1,420	1,563	170,146	石油・ガス・消耗燃料
OKTA INC	—	165	2,061	224,354	情報技術サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	86	153	2,060	224,238	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	303	345	1,894	206,204	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	590	590	765	83,279	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	560	670	1,342	146,123	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,631	3,598	18,119	1,971,948	ソフトウェア
OWENS CORNING INC	142	168	669	72,914	建設関連製品
PNC FINANCIAL	627	689	6,956	757,112	銀行
PPG INDUSTRIES	326	368	3,161	344,104	化学
PPL CORPORATION	976	1,148	2,965	322,711	電力
PVH CORP	99	116	443	48,249	繊維・アパレル・贅沢品
PTC INC	147	170	1,007	109,656	ソフトウェア
PACCAR	478	538	3,350	364,594	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	132	145	1,316	143,222	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	126	152	2,530	275,377	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP	181	201	2,620	285,138	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	370	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PAYCHEX INC	450	505	3,253	354,046	情報技術サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	75	1,606	174,881	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	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,526	1,747	16,951	1,844,792	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	500	710	817	88,936	銀行
PEPSICO INC	1,926	2,182	27,379	2,979,736	飲料
PERKINELMER INC	—	174	1,331	144,882	ライフサイエンス・ツール/サービス
PFIZER INC	7,924	8,658	28,285	3,078,331	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,121	2,437	17,680	1,924,161	タバコ
PHILLIPS 66	594	703	3,807	414,364	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	154	170	1,332	144,974	電力
PINTEREST INC- CLASS A	—	460	709	77,195	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	232	261	1,735	188,862	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	190	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INC	83	83	391	42,608	レジャー用品
T ROWE PRICE GROUP INC	324	366	3,617	393,657	資本市場
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	380	444	1,474	160,472	保険
PROCTER & GAMBLE CO	3,403	3,899	44,838	4,879,773	家庭用品
PROGRESSIVE CO	808	920	7,008	762,741	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	572	630	3,386	368,525	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	695	781	3,476	378,318	総合公益事業
PULTEGROUP INC	379	379	900	98,001	家庭用耐久財
QORVO INC	176	176	1,434	156,067	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,655	1,791	12,363	1,345,495	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	191	205	1,702	185,308	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QURATE RETAIL INC - A	580	—	—	—	インターネット販売・通信販売
RPM INTERNATIONAL INC	—	211	1,289	140,304	化学
RALPH LAUREN CORPORATION	78	78	555	60,490	繊維・アパレル・贅沢品
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	177	196	1,262	137,369	資本市場
RAYTHEON COMPANY	394	433	6,114	665,429	航空宇宙・防衛
RED HAT INC	243	—	—	—	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	110	127	6,030	656,326	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,390	1,500	1,425	155,082	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	90	90	782	85,135	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	308	343	2,629	286,124	商業サービス・用品
RESMED INC	192	225	3,469	377,610	ヘルスケア機器・用品
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	119	2,713	295,316	ソフトウェア
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	171	689	75,016	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	168	178	2,710	294,954	電気設備
ROKU INC	—	142	1,272	138,482	娯楽
ROLLINS INC	210	239	856	93,221	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	143	164	5,209	566,951	コングロマリット
ROSS STORES INC	505	561	4,761	518,162	専門小売り
S&P GLOBAL INC	344	384	9,484	1,032,188	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	191	191	887	96,532	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	306	367	1,604	174,660	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	74	81	1,261	137,323	銀行
SABRE CORP	360	420	261	28,476	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC	1,043	1,304	19,540	2,126,586	ソフトウェア
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	112	1,103	120,085	バイオテクノロジー
HENRY SCHEIN INC	205	231	1,203	130,952	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,911	2,140	2,841	309,286	エネルギー設備・サービス
SCHWAB(CHARLES)CORP	1,662	1,797	6,169	671,383	資本市場
SEALED AIR CORP	219	219	563	61,324	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	154	187	2,155	234,629	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	371	436	5,231	569,351	総合公益事業
SERVICENOW INC	248	296	8,485	923,502	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	
SHERWIN-WILLIAMS	116	129	6,230	678,017	化学
SIGNATURE BANK	76	89	738	80,412	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,290	2,290	1,101	119,875	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	238	272	2,450	266,741	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	186	218	841	91,578	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	159	174	1,924	209,493	食品
SNAP-ON INC	74	84	949	103,328	機械
SNAP INC-A	—	1,170	1,386	150,887	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SOUTHERN CO.	1,402	1,647	9,550	1,039,430	電力
SOUTHWEST AIRLINES	198	198	694	75,634	旅客航空輸送業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	146	146	354	38,531	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	197	237	3,015	328,134	ソフトウェア
SPRINT CORP	1,090	1,290	1,088	118,489	無線通信サービス
SQUARE INC - A	418	531	2,920	317,838	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	211	239	2,399	261,092	機械
STARBUCKS CORP	1,696	1,852	12,567	1,367,739	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	522	559	2,893	314,947	資本市場
STEEL DYNAMICS	334	334	729	79,350	金属・鉱業
STRYKER CORP	465	529	8,620	938,178	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	607	—	—	—	銀行
SYMANTEC CORP	830	—	—	—	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	207	239	3,090	336,340	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	872	940	1,576	171,557	消費者金融
SYSCO CORP	678	758	3,513	382,355	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	379	412	1,460	158,905	資本市場
TJX COS INC	1,696	1,898	9,024	982,189	専門小売り
T-MOBILE US INC	472	530	4,405	479,435	無線通信サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	102	—	—	—	ソフトウェア
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	157	181	2,145	233,443	娯楽
TAPESTRY INC	383	450	594	64,693	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	686	788	7,565	823,362	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	299	348	225	24,541	石油・ガス・消耗燃料
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	57	1,704	185,483	航空宇宙・防衛
TELEFLEX INC	63	71	2,058	224,053	ヘルスケア機器・用品
TERADYNE INC	—	250	1,381	150,294	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	175	212	10,650	1,159,058	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,330	1,670	1,421	154,665	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,314	1,465	14,945	1,626,565	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	335	335	926	100,879	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	548	628	17,895	1,947,565	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	797	902	12,424	1,352,120	コングロマリット
TIFFANY & CO	144	169	2,171	236,322	専門小売り
TORCHMARK CORP	140	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	222	—	—	—	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	163	178	1,522	165,725	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	63	76	2,625	285,729	航空宇宙・防衛
TRUNSUNION	253	290	1,977	215,180	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	367	408	4,185	455,526	保険
TRIMBLE INC	349	388	1,203	131,027	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	146	146	260	28,393	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRUIST FINANCIAL CORP	—	2,085	6,788	738,820	銀行
TWILIO INC - A	—	186	1,804	196,351	情報技術サービス
TWITTER INC	942	1,147	2,935	319,434	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	61	1,834	199,696	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	
TYSON FOODS INC-CL A	410	469	2,774	301,909	食品
UGI CORP	227	309	831	90,494	ガス
US BANCORP	2,112	2,305	8,268	899,810	銀行
UBER TECHOLOGIES INC	—	655	1,822	198,382	陸運・鉄道
ULTA BEAUTY INC	78	85	1,527	166,241	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	240	240	229	24,996	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	250	250	210	22,881	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	1,005	1,088	15,253	1,660,066	陸運・鉄道
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	92	92	277	30,197	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	946	1,099	10,752	1,170,207	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	112	112	1,065	115,990	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	1,128	1,286	12,665	1,378,420	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	63	—	—	—	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,313	1,482	37,239	4,052,796	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	118	118	1,181	128,586	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
UNUM GROUP	312	312	497	54,124	保険
V F CORP	454	525	3,136	341,386	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	54	60	893	97,267	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	580	628	2,963	322,521	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	129	142	1,472	160,287	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	167	207	3,269	355,804	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	147	162	3,054	332,422	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	5,643	6,468	35,425	3,855,328	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	219	242	3,554	386,809	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	350	404	9,369	1,019,690	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	502	—	—	—	娯楽
VIACOMCBS INC-CLASS B	—	880	1,239	134,892	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	2,404	2,678	44,339	4,825,483	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP	482	590	947	103,120	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A	116	130	1,566	170,510	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	217	217	899	97,936	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	186	208	2,118	230,576	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	70	81	1,094	119,111	機械
WEC ENERGY GROUP INC	435	498	4,576	498,019	総合公益事業
WABTEC CORP	179	288	1,417	154,270	機械
WALMART INC	1,989	2,225	25,629	2,789,288	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,101	1,182	5,337	580,924	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	368	403	3,118	339,420	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	578	668	6,319	687,727	商業サービス・用品
WATERS CORP	106	103	1,937	210,895	ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ
WAYFAIR INC - CLASS A	75	86	447	48,678	インターネット販売・通信販売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	70	—	—	—	ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ
WELLS FARGO CO	6,129	6,291	18,822	2,048,471	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	118	1,791	194,953	ヘルスケア機器・用品
WESTERN DIGITAL CORP	383	476	2,071	225,395	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	590	660	1,248	135,826	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	50	50	189	20,606	化学
WESTROCK CO	342	387	1,122	122,139	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	93	94	824	89,727	家庭用耐久財
WILLIAMS COS	1,681	1,910	2,639	287,269	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	207	254	3,487	379,535	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A	407	—	—	—	情報技術サービス
WYNN RESORTS LTD	138	155	947	103,067	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC	180	143	735	80,038	航空貨物・物流サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
XCEL ENERGY INC	708	812	5,079	552,842	電力
XILINX INC	349	399	3,166	344,562	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	289	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC	239	278	1,841	200,407	機械
XEROX HOLDINGS CORP	—	289	518	56,456	コンピュータ・周辺機器
YUM BRANDS INC	422	471	3,328	362,246	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	264	—	—	—	各種電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	84	1,582	172,184	電子装置・機器・部品
ZILLOW GROUP INC - C	160	202	748	81,471	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ･ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	284	319	3,135	341,196	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORP NA	275	275	756	82,362	銀行
ZOETIS INC	660	740	8,634	939,673	医薬品
ALKERMES PLC	201	—	—	—	バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	136	148	1,406	153,031	建設関連製品
ALLERGAN PLC	464	510	8,991	978,578	医薬品
AMCOR PLC	—	2,500	2,070	225,278	容器・包装
AON PLC	329	369	6,311	686,826	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	560	639	1,951	212,382	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	214	212	557	60,702	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	292	292	527	57,423	化学
ACCENTURE PLC-CL A	870	995	16,897	1,838,910	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	191	220	870	94,788	食品
CAPRI HOLDINGS LTD	199	199	223	24,364	繊維・アパレル・贅沢品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	292	351	1,291	140,573	飲料
EATON CORP PLC	601	645	5,051	549,769	電気設備
EVEREST RE GROUP LTD	56	62	1,230	133,930	保険
IHS MARKIT LTD	547	593	3,668	399,220	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	334	—	—	—	機械
INVESCO LTD	580	580	554	60,344	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	78	90	896	97,555	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,271	1,200	3,178	345,948	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	400	43,592	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	695	640	1,004	109,352	メディア
LINDE PLC	751	842	14,886	1,620,104	化学
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	860	990	2,247	244,573	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,838	2,099	19,321	2,102,736	ヘルスケア機器・用品
APTIV PLC	367	392	1,956	212,965	自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	472	540	706	76,927	専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	302	330	352	38,356	ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	59	67	1,019	110,912	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	378	373	1,860	202,440	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	232	232	687	74,811	機械
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	214	245	719	78,283	電気設備
STERIS PLC	—	129	1,805	196,532	ヘルスケア機器・用品
TECHNIPFMC PLC	610	610	430	46,802	エネルギー設備・サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	376	3,169	344,956	機械
WILLIS TOWERS WATSON PLC	178	202	3,493	380,207	保険
PERRIGO CO PLC	165	196	956	104,115	医薬品
CHUBB LTD	633	712	8,119	883,661	保険
GARMIN LTD	152	205	1,572	171,096	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	479	524	3,338	363,375	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	172	189	1,874	204,022	ソフトウェア
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	55	477	51,931	ソフトウェア
WIX.COM LTD	57	77	804	87,553	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	百株	百株	千米ドル	千円	
AERCAP HOLDINGS NV	169	170	387	42,145	商社・流通業
LYONDELLBASELL INDU-CL A	455	421	2,087	227,162	化学
MYLAN NV	693	770	1,160	126,285	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV	468	432	3,668	399,294	半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	227	266	791	86,180	ホテル・レストラン・レジャー
FLEX LTD	760	760	638	69,477	電子装置・機器・部品
小計 株数・金額	413,057	465,696	3,471,191	377,769,781	
小計 銘柄数＜比率＞	596	608	—	＜67.9%＞	
（カナダ）			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	500	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD	331	377	2,134	163,537	金属・鉱業
AIR CANADA	—	204	328	25,127	旅客航空輸送業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	850	1,518	116,351	総合公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	596	1,342	4,412	337,997	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	338	420	494	37,866	ガス
ATCO LTD CL1	96	130	487	37,352	総合公益事業
AURORA CANNABIS INC	970	2,000	258	19,762	医薬品
BCE INC	198	227	1,251	95,895	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	876	990	6,713	514,230	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,682	1,893	10,375	794,765	銀行
BARRICK GOLD	2,366	2,770	7,559	579,044	金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC	425	510	1,101	84,382	医薬品
BLACKBERRY LTD	710	710	393	30,129	ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS	2,620	2,800	119	9,115	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,168	1,402	8,759	670,992	資本市場
CAE INC	360	410	741	56,782	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	212	247	976	74,810	容器・包装
CGI INC	338	384	2,848	218,225	情報技術サービス
CI FINANCIAL CORP	336	336	442	33,922	資本市場
CAMECO CORP	560	560	584	44,783	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	600	696	5,498	421,177	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,001	1,124	12,176	932,703	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,631	1,870	2,939	225,176	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	198	213	6,558	502,379	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	86	86	738	56,567	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	157	203	675	51,765	総合公益事業
CANOPY GROWTH CORP	275	330	677	51,895	医薬品
CENOVUS ENERGY INC	1,400	1,560	375	28,798	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	27	32	4,082	312,748	ソフトウェア
CRONOS GROUP INC	250	250	225	17,273	医薬品
DOLLARAMA INC	418	466	1,900	145,566	複合小売り
EMERA INC	76	379	2,046	156,769	電力
EMPIRE CO LTD A	260	260	711	54,470	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	2,060	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	2,759	3,178	12,696	972,522	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	38	41	1,695	129,884	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	240	—	—	—	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	250	—	—	—	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	990	990	692	53,007	金属・鉱業
FORTIS INC	583	682	3,579	274,214	電力
FRANCO-NEVADA CORP	254	293	4,057	310,801	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	278	318	572	43,870	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	1,210	—	—	—	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFECO INC	420	—	—	—	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
GREAT-WEST LIFECO INC	—	420	987	75,604	保険
HUSKY ENERGY INC	520	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HUSKY ENERGY INC	—	520	166	12,786	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	420	490	1,236	94,735	電力
IGM FINANCIAL INC	103	150	350	26,875	資本市場
IA FINANCIAL CORP INC	147	183	780	59,757	保険
IMPERIAL OIL	375	375	557	42,685	石油・ガス・消耗燃料
INTACT FINANCIAL CORP	189	215	2,483	190,249	保険
INTER PIPELINE LTD	520	600	470	36,032	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	285	340	398	30,523	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,740	1,980	1,140	87,360	金属・鉱業
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	441	1,908	146,202	金属・鉱業
LOBLAW COMPANIES	261	285	1,970	150,939	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	950	950	477	36,603	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC	445	451	2,028	155,390	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,750	3,030	5,151	394,566	保険
METHANEX CORP	86	86	147	11,310	化学
METRO INC	334	396	2,250	172,385	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	460	523	2,721	208,441	銀行
NUTRIEN LTD	831	900	4,134	316,710	化学
ONEX CORPORATION	109	132	673	51,567	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	354	417	2,023	155,015	ソフトウェア
OVINTIV INC	—	410	141	10,803	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND FUEL CORP	—	217	543	41,638	石油・ガス・消耗燃料
PEMBINA PIPELINE CORP	706	880	2,081	159,419	石油・ガス・消耗燃料
POWER CORPORATION OF CANADA	460	869	1,868	143,131	保険
POWER FINANCIAL CORP	325	—	—	—	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	310	310	218	16,764	石油・ガス・消耗燃料
QUEBECOR INC-CL B	—	270	844	64,713	メディア
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	320	433	2,468	189,122	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	502	555	3,174	243,174	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,962	2,248	19,063	1,460,228	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	252	—	—	—	建設・土木
SAPUTO INC	321	366	1,218	93,330	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	370	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	630	770	1,711	131,116	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	122	163	9,967	763,531	情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE	230	380	978	74,953	ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC	838	923	4,079	312,501	保険
SUNCOR ENERGY INC	2,180	2,440	4,628	354,556	石油・ガス・消耗燃料
TC ENERGY CORP	—	1,470	8,565	656,131	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B	680	820	801	61,430	金属・鉱業
TELUS CORP	293	586	1,257	96,328	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	282	317	2,987	228,859	専門サービス
TORONTO DOMINION BANK	2,495	2,841	16,608	1,272,210	銀行
TOURMALINE OIL CORP	330	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP	1,257	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,260	—	—	—	金属・鉱業
VERMILION ENERGY INC	185	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WSP GLOBAL INC	132	157	1,186	90,906	建設・土木
WEST FRASER TIMBER	84	84	224	17,186	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD	107	123	1,216	93,191	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	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	630	716	2,826	216,475	金属・鉱業
小計 株数・金額	58,286	62,765	234,126	17,934,123	
銘柄数＜比率＞	89	84	—	＜3.2%＞	
（イギリス）			千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	590	590	431	57,562	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP PLC	680	687	1,121	149,567	商社・流通業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,450	1,590	708	94,436	家庭用耐久財
AVIVA PLC	5,420	6,040	1,617	215,646	保険
DIAGEO PLC	3,319	3,681	9,476	1,263,438	飲料
SCHRODERS PLC	158	197	496	66,185	資本市場
DCC PLC	128	160	828	110,495	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	4,410	5,020	2,552	340,255	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,125	3,597	9,478	1,263,619	タバコ
HALMA PLC	—	590	1,103	147,091	電子装置・機器・部品
STANDARD CHARTERED PLC	3,830	4,140	1,885	251,410	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	1,295	1,490	1,986	264,796	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	27,340	31,810	14,716	1,962,056	銀行
LEGAL & GENERAL	8,080	9,400	1,807	240,929	保険
MEGGITT PLC	1,110	1,110	298	39,808	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	3,150	3,700	674	89,975	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	494	541	942	125,715	食品
PEARSON	1,090	1,260	706	94,204	メディア
PERSIMMON PLC	426	480	875	116,756	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	3,550	4,100	4,110	547,978	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,578	1,749	6,425	856,691	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	700	810	610	81,445	資本市場
SSE PLC	1,370	1,650	2,085	278,052	電力
BP PLC	27,490	31,780	10,284	1,371,063	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	97,300	110,500	3,701	493,517	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	4,500	5,000	586	78,192	家庭用耐久財
TESCO PLC	13,620	15,300	3,566	475,476	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	1,230	1,370	1,972	262,922	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	6,760	7,820	11,589	1,545,077	医薬品
WEIR GROUP PLC	370	380	253	33,750	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	390	—	—	—	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,727	2,055	14,596	1,946,027	医薬品
BT GROUP PLC	11,450	12,900	1,540	205,381	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	229	229	208	27,758	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	2,080	3,100	306	40,899	複合小売り
BARCLAYS PLC	23,700	27,400	2,575	343,378	銀行
INTERTEK GROUP PLC	216	256	1,186	158,123	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	550	660	864	115,268	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	198	198	784	104,639	複合小売り
KINGFISHER PLC	3,080	3,080	439	58,534	専門小売り
ITV PLC	5,000	5,000	311	41,582	メディア
SAINSBURY	2,550	2,550	536	71,460	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	2,190	2,190	191	25,529	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	270	308	677	90,378	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	171	195	702	93,590	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	7,800	9,200	353	47,074	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	6,170	6,560	8,693	1,158,992	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	5,107	5,860	7,395	985,944	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	444	500	777	103,622	商社・流通業
RENTOKIL INTIAL PLC	—	2,850	1,100	146,665	商業サービス・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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	426	492	3,602	480,275	資本市場
UNILEVER PLC	1,509	1,742	6,995	932,689	パーソナル用品
TUI AG-DI	600	700	256	34,137	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	920	—	—	—	資本市場
EXPERIAN PLC	1,262	1,411	3,313	441,692	専門サービス
MONDI PLC	494	750	1,003	133,836	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	324	370	862	114,984	水道
WHITBREAD PLC	245	211	626	83,491	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	401	520	708	94,491	資本市場
SMITHS GROUP PLC	540	610	680	90,718	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,433	1,600	2,140	285,368	金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,320	1,550	1,183	157,836	資本市場
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	913	1,102	6,832	910,895	家庭用品
RELX PLC	2,710	3,000	5,181	690,730	専門サービス
FRESNILLO PLC	260	—	—	—	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	960	1,060	1,004	133,885	水道
OCADO GROUP PLC	—	720	889	118,644	インターネット販売・通信販売
GLENCORE PLC	15,330	17,000	2,023	269,706	金属・鉱業
WOOD GROUP (JOHN) PLC	860	—	—	—	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC	710	870	435	57,994	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,370	2,770	890	118,654	航空宇宙・防衛
EVRAZ PLC	—	760	172	22,969	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	133	133	31	4,159	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	210	210	115	15,454	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	6,500	7,700	903	120,518	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,430	1,750	1,050	139,986	ソフトウェア
WPP PLC	1,690	2,000	1,031	137,532	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	290	290	477	63,638	飲料
AVEVA GROUP PLC	—	112	387	51,664	ソフトウェア
CONVATEC GROUP PLC-WI	2,100	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	2,150	2,510	2,988	398,380	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	580	—	—	—	ソフトウェア
NATIONAL GRID PLC	4,610	5,480	5,228	697,059	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	1,360	—	—	—	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	890	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,590	3,660	815	108,715	資本市場
FERGUSON PLC	325	—	—	—	商社・流通業
BHP GROUP PLC	2,890	3,290	4,007	534,330	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	36,500	42,100	4,813	641,764	無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	237	258	875	116,741	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	—	481	192	25,659	ソフトウェア
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	193	812	108,275	化学
FERGUSON PLC	—	346	1,705	227,414	商社・流通業
M&G PLC	—	3,780	444	59,214	各種金融サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,400	1,620	677	90,365	保険
INFORMA PLC	1,730	1,860	786	104,893	メディア
AUTO TRADER GROUP PLC	1,380	1,410	625	83,332	ｲﾝﾀﾗｸﾃｨﾌﾞ・ﾒﾃﾞｨｱおよびｻｰﾋﾞｽ
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	116	948	126,504	機械
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,830	2,190	606	80,875	保険
JD SPORTS FASHION PLC	—	760	348	46,497	専門小売り
CRODA INTERNATIONAL PLC	172	—	—	—	化学
MELROSE INDUSTRIES PLC	6,800	7,300	638	85,158	電気設備

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	
JOHNSON MATTHEY PLC		267	302	539	71,949	化学
小計	株数・金額	410,536	468,722	209,991	27,996,065	
	銘柄数＜比率＞	92	93	－	＜5.0%＞	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA-REG		7	9	2,070	234,344	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		3	4	896	101,497	食品
SWISSCOM AG-REG		35	40	2,160	244,542	各種電気通信サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		1	1	1,221	138,250	食品
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.15	0.17	1,390	157,429	食品
GIVAUDAN-REG		12	14	4,337	491,054	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		207	235	7,814	884,704	保険
NOVARTIS AG-REG		2,960	3,361	26,148	2,960,280	医薬品
ABB LTD		2,500	2,850	4,742	536,887	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		959	1,098	33,927	3,840,972	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		215	249	915	103,680	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		670	774	2,650	300,114	建設資材
CLARIANT AG-REG		259	320	508	57,546	化学
NESTLE SA-REG		4,184	4,652	46,426	5,255,996	食品
BALOISE HOLDING AG		66	74	922	104,467	保険
TEMENOS AG-REG		84	104	1,284	145,406	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG-REG		76	88	1,518	171,852	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG		14	16	1,130	128,026	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		3,470	3,960	3,167	358,559	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		41	47	886	100,378	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		74	74	274	31,047	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		103	115	4,544	514,477	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		45	51	1,678	190,016	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		12	12	725	82,110	化学
SWISS PRIME SITE-REG		101	114	1,070	121,186	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		58	58	370	41,957	各種金融サービス
DUFRY AG-REG		44	65	194	22,024	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		24	29	1,990	225,371	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		55	61	1,266	143,433	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		30	30	589	66,771	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		73	84	1,108	125,479	海運業
GEBERIT AG-REG		50	56	2,396	271,269	建設関連製品
JULIUS BAER GROUP LTD		310	358	1,181	133,786	資本市場
SWISS RE LTD		414	462	3,247	367,690	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		716	815	4,246	480,706	繊維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG		180	199	3,143	355,842	化学
ALCON INC		－	659	3,211	363,589	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG		5,330	6,010	5,447	616,707	資本市場
VIFOR PHARMA AG		57	67	853	96,595	医薬品
小計	株数・金額	23,443	27,221	181,662	20,566,059	
	銘柄数＜比率＞	38	39	－	＜3.7%＞	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		92	126	5,057	54,673	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		2,210	2,510	16,586	179,295	銀行
SWEDBANK AB		1,260	1,370	14,782	159,796	銀行
SWEDISH MATCH AB		234	260	13,951	150,816	タバコ
SECURITAS AB-B SHS		450	450	4,736	51,198	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		617	715	32,053	346,497	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B		1,180	1,270	15,527	167,847	専門小売り
ERICSSON LM-B		4,170	4,740	37,294	403,151	通信機器

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（スウェーデン）	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
TELIA CO AB	3,960	4,300	15,265	165,014	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	450	510	7,494	81,015	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB	248	288	4,968	53,704	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	389	510	8,774	94,852	機械
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	97	158	4,392	47,481	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	105	138	5,662	61,207	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	550	550	2,698	29,174	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	340	340	4,125	44,600	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	550	580	7,682	83,043	機械
VOLVO AB-B SHS	2,140	2,340	26,617	287,735	機械
SANDVIK AB	1,510	1,780	25,026	270,539	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	250	250	4,817	52,077	各種金融サービス
HEXAGON AB-B SHS	361	423	17,359	187,660	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	690	780	10,327	111,637	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B	337	—	—	—	各種金融サービス
ATLAS COPCO AB-A	940	1,045	34,589	373,912	機械
ATLAS COPCO AB-B	529	627	18,139	196,083	機械
BOLIDEN AB	363	—	—	—	金属・鉱業
EPIROC AB - A	920	1,030	10,164	109,873	機械
EPIROC AB - B	580	580	5,738	62,033	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B	817	925	28,203	304,877	家庭用品
BOLIDEN AB	—	440	7,508	81,167	金属・鉱業
KINNEVIK AB - B	—	390	6,312	68,234	各種金融サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	2,120	2,430	19,371	209,410	銀行
ASSA ABLOY AB-B	1,360	1,590	28,866	312,046	建設関連製品
NORDEA BANK ABP	4,130	5,150	28,041	303,131	銀行
小計 株数・金額	33,949	38,595	472,136	5,103,793	
小計 銘柄数＜比率＞	32	32	—	＜0.9%＞	
（ノルウェー）			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	1,350	1,450	16,363	167,886	銀行
TELENOR ASA	1,020	1,160	17,649	181,082	各種電気通信サービス
EQUINOR ASA	1,610	1,580	18,999	194,934	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	232	262	8,499	87,202	化学
MOWI ASA	620	690	10,746	110,261	食品
NORSK HYDRO	1,840	2,180	4,843	49,699	金属・鉱業
AKER AB ASA	141	180	2,151	22,069	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA	1,150	1,150	10,589	108,645	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	250	310	5,380	55,199	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	129	129	2,394	24,564	メディア
小計 株数・金額	8,342	9,091	97,616	1,001,546	
小計 銘柄数＜比率＞	10	10	—	＜0.2%＞	
（デンマーク）			千デンマーククローネ		
CARLSBERG B	145	162	12,198	195,299	飲料
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	8	10	6,050	96,872	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	5	6	3,468	55,535	海運業
DANSKE BANK AS	970	970	7,119	113,987	銀行
GENMAB A/S	84	100	13,505	216,215	バイオテクノロジー
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	268	298	16,229	259,827	電気設備
H LUNDBECK A/S	105	105	2,025	32,427	医薬品
DSV PANALPINA A S	251	325	19,805	317,086	航空貨物・物流サービス
PANDORA A/S	162	160	3,433	54,971	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S	137	167	8,348	133,656	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES	311	337	10,312	165,098	化学
COLOPLAST-B	164	185	17,793	284,870	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	
（デンマーク）	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B	2,475	2,772	112,224	1,796,712	医薬品
ISS A/S	218	218	1,973	31,600	商業サービス・用品
TRYG A/S	160	199	3,275	52,441	保険
ORSTED A/S	254	300	20,250	324,202	電力
DEMANT A/S	130	160	2,342	37,501	ヘルスケア機器・用品
小計 株数・金額	5,848	6,474	260,356	4,168,307	
小計 銘柄数＜比率＞	17	17	－	＜0.7%＞	
（ユーロ…ドイツ）			千ユーロ		
ADIDAS AG	246	281	5,811	694,714	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA	576	642	2,175	260,071	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	168	168	438	52,460	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD	105	105	336	40,168	化学
HANNOVER RUECK SE	79	96	1,237	147,935	保険
GEA GROUP AG	242	242	442	52,871	機械
CONTINENTAL AG	154	175	1,120	133,958	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	1,371	1,534	3,767	450,405	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	59	－	－	－	メディア
MERCK KGAA	173	199	1,781	212,924	医薬品
RWE AG	720	931	2,149	256,994	総合公益事業
SAP SE	1,340	1,539	15,725	1,879,983	ソフトウェア
E.ON SE	3,070	3,550	3,389	405,177	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	144	163	1,052	125,883	家庭用品
PUMA SE	10	126	682	81,567	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG	1,273	1,543	8,128	971,765	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	246	277	1,974	236,046	家庭用品
BASF SE	1,254	1,445	6,134	733,409	化学
BEIERSDORF AG	137	160	1,497	179,076	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	26	38	218	26,167	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	203	226	834	99,778	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	294	333	1,950	233,207	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	580	654	9,995	1,194,990	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	310	420	364	43,593	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	207	228	4,135	494,449	保険
VOLKSWAGEN AG	45	51	605	72,371	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	252	289	3,035	362,843	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,257	1,403	3,816	456,305	自動車
THYSSENKRUPP AG	620	620	287	34,355	金属・鉱業
SIEMENS AG	1,042	1,201	9,038	1,080,579	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG	80	－	－	－	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,750	3,140	1,828	218,625	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	449	521	2,382	284,831	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	78	78	291	34,800	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	4,600	5,180	6,208	742,255	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	45	53	1,166	139,395	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,550	1,990	2,693	322,027	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	－	60	533	63,767	ヘルスケア機器・用品
DEUTSCHE BOERSE AG	256	295	3,702	442,603	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	203	227	852	101,929	自動車
FRAPORT AG	63	63	232	27,799	運送インフラ
WIRECARD AG	159	180	1,798	215,060	情報技術サービス
LANXESS	120	120	436	52,190	化学
MTU AERO ENGINES AG	69	84	1,132	135,419	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE	484	562	1,924	230,115	不動産管理・開発
SYMRISE AG	163	198	1,626	194,480	化学

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	
BRENNTAG AG	206	238	773	92,443	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	227	330	613	73,340	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	970	1,500	329	39,361	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG	93	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG	1,350	1,580	527	63,051	銀行
OSRAM LICHT AG	143	—	—	—	電気設備
KION GROUP AG	99	99	389	46,548	機械
VONOVIA SE	664	795	3,578	427,785	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	340	—	—	—	メディア
KNORR-BREMSE AG	—	71	541	64,763	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	199	239	851	101,817	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	250	250	178	21,393	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	195	—	—	—	総合公益事業
ZALANDO SE	171	215	709	84,872	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	270	269	736	88,019	化学
QIAGEN NV	314	354	1,295	154,851	ライフサイエンス・ツール/サービス
UNIPER SE	262	311	713	85,253	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	119	179	1,193	142,734	インターネット販売・通信販売
小計 株数・金額	33,144	37,820	131,372	15,705,597	
小計 銘柄数＜比率＞	62	58	—	＜2.8%＞	
（ユーロ…イタリア）					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,620	1,750	2,163	258,691	保険
INTESA SANPAOLO	20,620	23,300	3,426	409,693	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.	880	880	437	52,338	銀行
ENEL SPA	11,040	12,630	8,065	964,232	電力
ENI SPA	3,450	4,030	3,462	413,999	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA	2,980	3,200	1,323	158,226	ガス
TENARIS SA	600	710	393	47,006	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA	15,300	15,500	558	66,727	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	8,800	8,800	315	37,747	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	700	790	841	100,630	運送インフラ
TERNA SPA	1,850	2,220	1,281	153,242	電力
RECORDATI SPA	141	168	657	78,590	医薬品
LEONARDO SPA	550	640	381	45,631	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA	309	370	566	67,743	電気設備
FERRARI NV	171	189	2,629	314,408	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	1,410	1,540	790	94,520	機械
MONCLER SPA	252	281	955	114,218	繊維・アパレル・贅沢品
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	—	910	766	91,623	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,500	1,700	1,072	128,241	自動車
UNICREDIT SPA	2,710	3,130	2,276	272,186	銀行
EXOR NV	151	172	803	96,089	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	770	770	609	72,869	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	760	910	605	72,345	飲料
PIRELLI & C. SPA	530	530	177	21,169	自動車部品
小計 株数・金額	77,094	85,120	34,564	4,132,174	
小計 銘柄数＜比率＞	23	24	—	＜0.7%＞	
（ユーロ…フランス）					
BOUYGUES	314	348	958	114,534	建設・土木
AIRBUS SE	793	918	5,593	668,687	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	710	820	1,617	193,366	総合公益事業
LOREAL-ORD	344	394	9,704	1,160,139	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	378	435	15,239	1,821,822	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	3	3	232	27,813	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	
（ユーロ…フランス）	百株	百株	千ユーロ	千円	
THALES SA	141	163	1,189	142,252	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	219	245	1,911	228,460	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	83	83	289	34,580	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	81	95	902	107,939	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	292	321	748	89,530	メディア
FAURECIA	105	105	281	33,628	自動車部品
BOLLORE	1,060	1,380	332	39,759	娯楽
MICHELIN (CGDE)	238	267	2,042	244,123	自動車部品
PERNOD RICARD SA	291	335	4,380	523,643	飲料
RENAULT SA	255	281	483	57,807	自動車
REMY COINTREAU	30	40	408	48,776	飲料
SEB SA	30	38	405	48,518	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	754	869	6,884	823,008	電気設備
VIVENDI SA	1,437	1,300	2,363	282,544	娯楽
ORANGE SA	2,770	3,120	3,497	418,128	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	44	50	3,205	383,205	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	38	—	—	—	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	178	209	2,777	332,063	ソフトウェア
KERING SA	105	117	5,676	678,671	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	212	280	244	29,189	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	800	950	1,349	161,386	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	136	153	918	109,783	情報技術サービス
SANOFI	1,536	1,767	14,226	1,700,732	医薬品
ACCOR SA	262	262	653	78,179	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	970	1,050	2,037	243,523	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	1,043	1,270	1,960	234,362	銀行
TELEPERFORMANCE	77	90	1,618	193,455	専門サービス
EURAZEO SE	56	59	244	29,264	各種金融サービス
SODEXO	121	132	785	93,863	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	2,650	3,010	4,619	552,218	保険
PEUGEOT CITROEN	820	880	1,035	123,825	自動車
JC DECAUX SA	93	150	235	28,100	メディア
ESSILORLUXOTTICA	399	439	4,364	521,780	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	1,540	1,840	1,232	147,337	銀行
BNP PARIBAS	1,529	1,739	4,912	587,310	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	669	790	1,694	202,536	建設関連製品
WENDEL	34	43	316	37,886	各種金融サービス
ILIAD SA	39	24	305	36,481	各種電気通信サービス
SES FDR	480	560	294	35,201	メディア
IMERYS	38	—	—	—	建設資材
SAFRAN SA	457	508	4,312	515,609	航空宇宙・防衛
ENGIE	2,510	2,900	2,740	327,626	総合公益事業
ALSTOM	205	303	1,129	135,077	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	241	241	218	26,120	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	820	940	653	78,169	電力
IPSEN	55	55	259	31,048	医薬品
ARKEMA	99	99	596	71,320	化学
LEGRAND SA	370	410	2,360	282,231	電気設備
EIFFAGE SA	108	121	798	95,472	建設・土木
TOTAL SA	3,294	3,762	12,629	1,509,801	石油・ガス・消耗燃料
ADP	39	47	416	49,783	運送インフラ
NATIXIS	1,280	1,580	492	58,914	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT	111	144	985	117,786	娯楽
SCOR SE	232	232	465	55,637	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（ユーロ…フランス）	百株	百株	千ユーロ	千円	
REXEL SA	450	—	—	—	商社・流通業
VINCI	702	810	5,913	706,899	建設・土木
DANONE	844	972	5,552	663,749	食品
AIR LIQUIDE SA	592	734	8,264	988,061	化学
BUREAU VERITAS SA	342	470	799	95,520	専門サービス
GETLINK	620	720	770	92,101	運送インフラ
SUEZ	520	520	493	59,032	総合公益事業
EDENRED	328	382	1,452	173,630	情報技術サービス
VALEO SA	331	373	540	64,658	自動車部品
BIOMERIEUX	59	69	691	82,654	ヘルスケア機器・用品
WORLDLINE SA	—	198	1,070	127,941	情報技術サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	41	41	732	87,541	ライフサイエンス・ツール/サービス
AMUNDI SA	82	100	529	63,301	資本市場
小計 株数・金額	38,931	44,157	169,043	20,209,116	
小計 銘柄数＜比率＞	72	70	—	＜3.6%＞	
（ユーロ…オランダ）					
RANDSTAD NV	174	184	571	68,367	専門サービス
WOLTERS KLUWER	390	418	2,606	311,624	専門サービス
VOPAK	90	114	533	63,727	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV	2,460	2,930	684	81,825	保険
KONINKLIJKE KPN NV	4,460	5,600	1,201	143,603	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,259	1,426	5,233	625,655	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV	357	400	2,920	349,181	飲料
HEINEKEN HOLDING NV	160	172	1,158	138,489	飲料
KONINKLIJKE DSM NV	247	285	2,958	353,664	化学
UNILEVER NV-CVA	2,102	—	—	—	パーソナル用品
UNILEVER NV	—	2,276	9,957	1,190,419	パーソナル用品
ASML HOLDING NV	560	666	16,317	1,950,755	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,606	1,706	3,665	438,191	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	310	324	2,002	239,377	化学
PROSUS NV	—	768	4,798	573,656	インターネット販売・通信販売
NN GROUP NV	429	470	1,148	137,268	保険
ARCELORMITTAL	885	990	789	94,387	金属・鉱業
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	—	175	1,193	142,682	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV-CVA	581	700	513	61,424	銀行
ALTICE EUROPE N.V.	—	990	340	40,666	メディア
ADYEN NV	14	16	1,293	154,610	情報技術サービス
ING GROEP NV	5,280	6,170	3,080	368,258	銀行
小計 株数・金額	21,365	26,781	62,968	7,527,838	
小計 銘柄数＜比率＞	18	21	—	＜1.4%＞	
（ユーロ…スペイン）					
ENDESA S.A.	444	500	969	115,903	電力
BANKINTER S.A.	880	910	286	34,279	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	9,230	10,560	3,083	368,634	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	493	490	773	92,467	ガス
REPSOL SA	1,882	2,204	1,673	200,116	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA	22,110	26,140	5,788	692,039	銀行
TELEFONICA SA	6,400	7,320	3,029	362,118	各種電気通信サービス
ENAGAS SA	304	390	697	83,411	ガス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	300	380	513	61,329	電気設備
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	350	403	658	78,666	建設・土木
FERROVIAL SA	665	770	1,650	197,362	建設・土木
MAPFRE SA	1,630	1,630	254	30,389	保険
BANCO DE SABADELL SA	7,900	8,019	365	43,707	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	
（ユーロ…スペイン）		百株	百株	千ユーロ	千円	
CAIXABANK		5,050	5,300	885	105,908	銀行
IBERDROLA SA		8,586	9,660	8,413	1,005,876	電力
AMADEUS IT GROUP SA		595	667	2,910	347,904	情報技術サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		590	700	1,184	141,636	電力
INDITEX SA		1,480	1,680	3,815	456,116	専門小売り
AENA SME SA		93	107	1,073	128,302	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SA		—	386	1,638	195,844	各種電気通信サービス
GRIFOLS SA		401	468	1,452	173,610	バイオテクノロジー
BANKIA SA		1,510	1,510	157	18,864	銀行
小計	株数・金額	70,894	80,196	41,275	4,934,493	
	銘柄数＜比率＞	21	22	—	＜0.9%＞	
（ユーロ…ベルギー）						
KBC GROEP NV		346	382	1,542	184,362	銀行
SOLVAY SA		103	114	745	89,077	化学
UCB SA		165	195	1,472	176,054	医薬品
COLRUYT SA		87	87	427	51,068	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		110	124	871	104,184	各種金融サービス
PROXIMUS		216	260	562	67,263	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV		—	70	1,221	145,988	バイオテクノロジー
TELENET GROUP HOLDING NV		67	67	190	22,828	メディア
AGEAS		258	289	1,013	121,166	保険
UMICORE		280	310	952	113,812	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		1,036	1,201	4,672	558,596	飲料
小計	株数・金額	2,668	3,099	13,671	1,634,401	
	銘柄数＜比率＞	10	11	—	＜0.3%＞	
（ユーロ…オーストリア）						
OMV AG		210	210	527	63,090	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		90	110	357	42,712	電力
VOESTALPINE AG		165	200	360	43,038	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		400	480	819	97,954	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		201	201	276	33,028	銀行
ANDRITZ AG		92	117	320	38,353	機械
小計	株数・金額	1,158	1,318	2,661	318,177	
	銘柄数＜比率＞	6	6	—	＜0.1%＞	
（ユーロ…ルクセンブルグ）						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		14	17	719	85,968	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		54	—	—	—	メディア
AROUNDTOWN SA		1,070	1,850	798	95,433	不動産管理・開発
小計	株数・金額	1,138	1,867	1,517	181,402	
	銘柄数＜比率＞	3	2	—	＜0.0%＞	
（ユーロ…フィンランド）						
WARTSILA OYJ		630	630	406	48,594	機械
UPM-KYMMENE OYJ		733	832	1,941	232,152	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		730	850	747	89,342	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		612	682	1,756	209,947	保険
FORTUM OYJ		600	720	943	112,845	電力
ELISA OYJ		195	221	1,217	145,524	各種電気通信サービス
METSO OYJ		162	162	334	39,934	機械
NOKIA OYJ		7,810	8,800	2,409	287,995	通信機器
NESTE OYJ		176	668	1,881	224,963	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		158	210	393	47,047	自動車部品
KONE OYJ		456	540	2,732	326,658	機械

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…フィンランド）		百株	百株	千ユーロ	千円	
ORION OYJ		130	165	603	72,117	医薬品
小計	株数・金額	12,392	14,480	15,367	1,837,125	
	銘柄数＜比率＞	12	12	－	＜0.3%＞	
（ユーロ…アイルランド）						
CRH PLC		1,136	1,253	2,927	349,923	建設資材
KINGSPAN GROUP PLC		222	245	1,127	134,732	建設関連製品
KERRY GROUP PLC-A		221	244	2,508	299,869	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	－	－	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		320	353	869	103,899	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC		1,330	1,330	238	28,508	銀行
AIB GROUP PLC		1,250	1,250	126	15,108	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		119	121	891	106,611	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額	5,996	6,194	8,688	1,038,653	
	銘柄数＜比率＞	8	8	－	＜0.2%＞	
（ユーロ…ポルトガル）						
ENERGIAS DE PORTUGAL		3,610	3,870	1,371	163,966	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		670	810	808	96,641	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS		310	380	608	72,686	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	4,590	5,060	2,787	333,294	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.1%＞	
ユーロ計	株数・金額	269,371	306,092	483,916	57,852,275	
	銘柄数＜比率＞	238	237	－	＜10.4%＞	
（香港）				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		380	480	3,288	46,163	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,510	3,100	4,588	64,415	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,670	2,200	3,573	50,175	銀行
CLP HLDGS		2,270	2,530	17,760	249,358	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,624	1,887	43,778	614,648	資本市場
MTR CORP		2,010	2,430	9,598	134,762	陸運・鉄道
HANG LUNG GROUP LTD		1,030	－	－	－	不動産管理・開発
HANG SENG BANK		1,058	1,190	15,589	218,869	銀行
HENDERSON LAND		1,858	2,294	6,607	92,775	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,910	2,250	10,260	144,050	電力
WHARF(HOLDING)		1,740	－	－	－	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS		12,403	15,603	18,911	265,516	ガス
HYSAN DEVELOPMENT		830	－	－	－	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		3,330	3,350	13,601	190,958	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		790	1,140	2,184	30,666	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		4,950	5,690	12,005	168,562	銀行
NWS HOLDINGS LTD		2,205	2,205	1,664	23,373	コングロマリット
PCCW LTD		5,500	7,500	3,135	44,015	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		970	970	1,138	15,988	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		8,396	9,396	7,658	107,522	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,603	－	－	－	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		4,800	4,800	4,396	61,731	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		2,170	2,480	24,552	344,710	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		640	750	3,648	51,228	不動産管理・開発
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED		－	1,300	3,016	42,344	食品
WHEELOCK & COMPANY LTD		1,170	1,340	6,934	97,360	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED		1,950	2,120	10,366	145,549	機械
MINTH GROUP LTD		1,120	－	－	－	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED		2,700	2,700	1,741	24,450	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		2,280	2,280	2,708	38,029	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		1,240	－	－	－	ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
AIA GROUP LTD	16,470	18,930	129,007	1,811,271	保険
HKT TRUST AND HKT LTD	5,196	5,996	6,259	87,887	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	3,360	3,840	10,752	150,958	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,730	1,730	3,607	50,642	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,640	1,830	5,572	78,235	不動産管理・開発
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	2,160	4,315	60,592	飲料
WH GROUP LIMITED	11,700	14,600	10,278	144,308	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,710	4,250	21,868	307,031	コングロマリット
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	890	1,070	4,242	59,565	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD	3,610	4,090	16,647	233,736	不動産管理・開発
小計 株数・金額	125,416	140,483	445,260	6,251,459	
小計 銘柄数＜比率＞	39	35	—	＜1.1％＞	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,980	2,490	739	56,477	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,400	—	—	—	食品
DBS GROUP HLDGS	2,430	2,840	5,197	396,910	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	510	700	490	37,421	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	140	140	265	20,282	販売
SATS LTD	770	1,150	368	28,104	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,110	1,290	1,150	87,877	資本市場
CAPITALAND LIMITED	3,300	3,800	1,048	80,096	不動産管理・開発
COMFORTDELGRO CORP LTD	3,100	3,100	458	35,038	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD	770	770	446	34,124	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK	1,850	2,000	3,842	293,413	銀行
UOL GROUP LIMITED	650	650	416	31,819	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	350	450	594	45,363	電子装置・機器・部品
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	2,400	2,400	424	32,441	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	11,100	12,900	3,121	238,411	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES	1,400	1,400	219	16,790	コングロマリット
OCBC-ORD	4,330	5,240	4,464	340,952	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,470	2,890	887	67,757	食品
KEPPEL CORP.	2,020	2,320	1,215	92,841	コングロマリット
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	3,800	4,400	365	27,890	機械
GENTING SINGAPORE LTD	8,700	8,700	556	42,522	ホテル・レストラン・レジャー
小計 株数・金額	62,581	59,630	26,273	2,006,539	
小計 銘柄数＜比率＞	21	20	—	＜0.4％＞	
(オーストラリア)			千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	205	250	1,458	96,375	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	3,930	4,390	7,366	486,846	銀行
AMCOR PLC-CDI	1,550	—	—	—	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP	4,690	5,630	9,098	601,292	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	560	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,230	2,190	2,211	146,184	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	5,900	6,500	2,112	139,615	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	670	920	592	39,157	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	770	770	668	44,171	飲料
ASX LTD	263	307	2,379	157,244	資本市場
BHP GROUP LIMITED	4,010	4,580	13,831	914,130	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	333	400	892	58,952	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	971	971	295	19,512	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	630	760	737	48,771	情報技術サービス
CSL LIMITED	618	712	22,262	1,471,349	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	69	88	714	47,225	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	3,720	4,340	5,273	348,499	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	
（オーストラリア）	百株	百株	千豪ドル	千円	
COCHLEAR LTD	81	89	1,627	107,529	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,390	2,650	1,173	77,586	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,424	2,778	17,765	1,174,109	銀行
BORAL LTD	1,530	2,000	404	26,700	建設資材
RIO TINTO LTD	512	575	5,033	332,667	金属・鉱業
APA GROUP	1,590	1,800	1,873	123,839	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	760	880	1,899	125,565	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	3,080	3,610	2,310	152,694	保険
TPG TELECOM LTD	520	520	369	24,400	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	73	73	72	4,781	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD	500	590	962	63,597	化学
BLUESCOPE STEEL LTD	680	880	806	53,273	金属・鉱業
WORLEY LTD	470	470	280	18,513	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,810	1,903	1,731	114,459	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	3,710	4,560	7,437	491,535	銀行
NEWCREST MINING	1,030	1,170	2,867	189,524	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,790	2,040	475	31,413	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	2,330	2,330	456	30,181	化学
AMP LIMITED	3,900	5,300	707	46,761	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	1,080	345	22,840	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE	1,790	1,950	1,677	110,832	保険
CHALLENGER LIMITED	800	800	321	21,254	各種金融サービス
SANTOS LTD.	2,320	2,610	882	58,303	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD	620	690	1,689	111,633	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	170	299	19,774	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS	2,470	3,400	833	55,052	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED	1,540	1,750	6,280	415,094	複合小売り
ALUMINA LTD	3,500	3,500	549	36,316	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM	1,270	1,520	2,731	180,520	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,810	1,970	7,513	496,572	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	192	810	53,574	資本市場
SEEK LTD	480	480	717	47,394	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	85	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD	2,180	2,510	2,663	176,004	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED	439	530	4,539	300,012	資本市場
CROWN RESORTS LTD	550	550	396	26,171	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	580	670	1,255	82,981	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,000	1,110	1,091	72,112	飲料
SYDNEY AIRPORT	1,440	1,680	999	66,063	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD	2,730	3,050	1,473	97,360	陸運・鉄道
AUSNET SERVICES	2,300	3,300	572	37,839	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,500	4,500	1,269	83,868	保険
AGL ENERGY LTD	930	1,050	1,782	117,831	総合公益事業
SOUTH32 LTD	7,000	7,800	1,450	95,883	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD	117	180	411	27,182	建設・土木
COLES GROUP LTD	1,610	1,760	2,960	195,647	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	—	210	332	21,998	ソフトウェア
小計 株数・金額	101,530	116,038	163,997	10,838,587	
小計 銘柄数＜比率＞	61	61	—	＜1.9%＞	
（ニュージーランド）			千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	580	580	593	38,424	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	1,170	1,979	128,201	食品
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	740	860	2,610	169,030	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	1,126	1,500	480	31,084	建設資材

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
（ニュージーランド）		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円	
SPARK NEW ZEALAND LTD		2,600	3,070	1,252	81,115	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		—	1,000	424	27,458	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,300	1,520	796	51,580	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD		1,590	2,010	810	52,457	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額	8,996	11,710	8,946	579,352	
	銘柄数＜比率＞	7	8	—	＜0.1％＞	
（イスラエル）				千新シェケル		
BANK HAPOALIM BM		1,410	1,830	3,806	115,942	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		2,140	2,380	4,522	137,740	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		2,800	—	—	—	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		36	36	1,641	50,003	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		—	1,720	1,752	53,386	銀行
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		910	1,250	1,368	41,692	化学
NICE LTD		86	95	5,147	156,780	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		170	230	1,499	45,677	銀行
AZRIELI GROUP		65	65	1,300	39,598	不動産管理・開発
小計	株数・金額	7,617	7,606	21,038	640,821	
	銘柄数＜比率＞	8	8	—	＜0.1％＞	
合計	株数・金額	1,528,975	1,720,128	—	532,708,715	
	銘柄数＜比率＞	1,248	1,252	—	＜95.8％＞	

＊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	71,000	80,000	934	101,690	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	17,900	2,589	281,786	0.1
AMERICAN TOWER CORP	60,200	69,400	16,002	1,741,525	0.3
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	214,000	1,213	132,052	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,200	21,900	3,330	362,511	0.1
BOSTON PROPERTIES	20,700	24,700	2,296	249,885	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	15,000	—	—	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	14,500	1,208	131,513	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	64,500	9,549	1,039,312	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	40,700	5,690	619,271	0.1
DUKE REALTY CORP	47,800	56,600	1,870	203,580	0.0
EQUINIX INC	10,930	13,250	8,544	929,900	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	26,500	1,499	163,234	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	51,300	57,700	3,610	392,970	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	10,070	2,270	247,140	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	20,700	2,002	217,956	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	11,100	832	90,600	0.0
HCP INC	66,100	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	75,700	1,843	200,605	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	109,000	1,244	135,469	0.0
INVITATION HOMES INC	45,000	85,000	1,801	196,019	0.0
IRON MOUNTAIN INC	38,300	43,100	1,071	116,560	0.0
KIMCO REALTY CORP	58,000	65,000	656	71,446	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	—	—	—	—
MACERICH CO /THE	14,200	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	83,000	1,459	158,888	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	17,600	1,885	205,197	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	27,900	919	100,017	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	32,200	856	93,180	0.0
PROLOGIS INC	86,300	114,500	9,489	1,032,770	0.2
PUBLIC STORAGE	21,500	24,500	4,939	537,613	0.1
REALTY INCOME CORP	39,300	49,900	2,651	288,528	0.1
REGENCY CENTERS CORP	21,000	26,200	1,046	113,911	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	15,200	17,770	4,951	538,903	0.1
SL GREEN REALTY CORP	12,500	12,500	576	62,686	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	47,900	2,695	293,333	0.1
SUN COMMUNITIES INC	—	14,300	1,749	190,362	0.0
UDR INC	36,700	46,300	1,746	190,064	0.0
VENTAS INC	49,200	56,800	1,635	177,966	0.0
VEREIT INC	125,000	160,000	796	86,715	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	68,000	1,090	118,703	0.0
VORNADO REALTY TRUST	24,200	27,000	1,015	110,484	0.0
WP CAREY INC	21,500	27,400	1,625	176,858	0.0
WELLTOWER INC	51,700	63,100	2,977	323,993	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
WEYERHAEUSER CO		100,500	115,000	1,949	212,136	0.0
小計	口数・金額	1,666,260	2,153,190	116,120	12,637,351	
	銘柄数<比率>	39	41	－	<2.3%>	
(カナダ)				千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		－	11,500	481	36,909	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT		－	16,000	216	16,570	0.0
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		20,000	20,000	171	13,113	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		22,000	22,000	357	27,350	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		11,000	11,000	204	15,647	0.0
小計	口数・金額	53,000	80,500	1,430	109,591	
	銘柄数<比率>	3	5	－	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		128,000	128,000	416	55,495	0.0
HAMMERSON PLC		108,000	－	－	－	－
SEGRO PLC		145,000	176,000	1,319	175,935	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		99,000	111,000	607	80,947	0.0
小計	口数・金額	480,000	415,000	2,343	312,378	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		5,100	5,200	378	45,256	0.0
KLEPIERRE		28,000	32,300	590	70,587	0.0
GECINA SA		6,400	7,100	864	103,299	0.0
COVIVIO		6,600	6,600	346	41,384	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		19,100	21,400	1,049	125,513	0.0
ユーロ計	口数・金額	65,200	72,600	3,229	386,042	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		288,000	330,000	21,285	298,841	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		370,000	370,000	2,797	39,272	0.0
小計	口数・金額	658,000	700,000	24,082	338,114	
	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		380,000	390,000	682	52,122	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		380,000	440,800	1,194	91,229	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		369,972	439,972	655	50,064	0.0
SUNTEC REIT		300,000	300,000	372	28,409	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		－	370,000	673	51,427	0.0
小計	口数・金額	1,429,972	1,940,772	3,578	273,253	
	銘柄数<比率>	4	5	－	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		490,000	660,000	1,320	87,238	0.0
GPT GROUP		256,000	285,000	1,014	67,054	0.0
LENDLEASE GROUP		77,000	88,000	902	59,671	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		348,000	348,000	803	53,128	0.0
DEXUS		140,000	171,000	1,539	101,712	0.0
GOODMAN GROUP		227,000	254,000	3,030	200,267	0.0
SCENTRE GROUP		723,000	870,000	1,283	84,809	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千豪ドル	千円	%
VICINITY CENTRES		480,000	470,000	458	30,285	0.0
小計	口数・金額	2,741,000	3,146,000	10,352	684,168	
	銘柄数＜比率＞	8	8	－	＜0.1%＞	
合計	口数・金額	7,093,432	8,508,062	－	14,740,901	
	銘柄数＜比率＞	65	69	－	＜2.7%＞	

＊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	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	CAN60	279	－
		EURO50	905	－
		FT100	436	－
		SPI200	180	－
		SPEMINI	5,996	－
		SWISSMKT	314	－

＊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

（2020年３月31日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	532,708,715	94.0
投資証券	14,740,901	2.6
コール・ローン等、その他	19,044,821	3.4
投資信託財産総額	566,494,437	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（549,961,136千円）の投資信託財産総額（566,494,437千円）に対する比率は97.1%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＝108.83円、１カナダドル＝76.60円、１英ポンド＝133.32円、１スイスフラン＝113.21円、１スウェーデンクローナ＝10.81円、１ノルウェークローネ＝10.26円、１デンマーククローネ＝16.01円、１ユーロ＝119.55円、１香港ドル＝14.04円、１シンガポールドル＝76.37円、１豪ドル＝66.09円、１ニュージーランドドル＝64.76円、１新シェケル＝30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 （2020年３月31日現在）

項　　目	当 期 末
	円
(A) 資産	572,404,457,892
コール・ローン等	15,096,264,525
株式(評価額)	532,708,715,674
投資証券(評価額)	14,740,901,142
未収入金	6,512,762,172
未収配当金	962,507,146
差入委託証拠金	2,383,307,233
(B) 負債	16,380,641,803
未払金	16,130,112,047
未払解約金	245,599,738
未払利息	11,518
その他未払費用	4,918,500
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	556,023,816,089
元本	230,777,414,749
次期繰越損益金	325,246,401,340
(D) 受益権総口数	230,777,414,749口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	24,094円

(注) 期首元本額は207,721,483,594円、期中追加設定元本額は56,924,689,531円、期中一部解約元本額は33,868,758,376円、１口当たり純資産額は2.4094円です。

○損益の状況 （2019年４月２日～2020年３月31日）

項　　目	当　　期
	円
(A) 配当等収益	12,940,662,190
受取配当金	12,855,664,954
受取利息	42,925,608
その他収益金	45,462,550
支払利息	△ 3,390,922
(B) 有価証券売買損益	△ 80,856,550,657
売買益	31,778,609,458
売買損	△112,635,160,115
(C) 先物取引等取引損益	△ 563,715,596
取引益	2,176,335,441
取引損	△ 2,740,051,037
(D) 保管費用等	△ 60,024,967
(E) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ＋Ｄ)	△ 68,539,629,030
(F) 前期繰越損益金	358,713,626,420
(G) 追加信託差損益金	97,476,543,113
(H) 解約差損益金	△ 62,404,139,163
(I) 計(Ｅ＋Ｆ＋Ｇ＋Ｈ)	325,246,401,340
次期繰越損益金(Ｉ)	325,246,401,340

＊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)	67,352,314,919
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)	36,321,368,128
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	22,255,621,713
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)	16,200,200,467
マイバランス50（確定拠出年金向け）	10,232,027,680
マイバランス70（確定拠出年金向け）	8,902,069,455
のむラップ・ファンド（普通型）	8,834,948,702
野村世界６資産分散投信（分配コース）	6,135,950,276
のむラップ・ファンド（積極型）	5,764,474,434
野村インデックスファンド・外国株式	5,085,341,526
野村世界６資産分散投信（安定コース）	4,660,174,843
野村世界６資産分散投信（成長コース）	4,420,419,039
野村つみたて外国株投信	4,278,259,185
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)	3,653,207,390
マイバランス30（確定拠出年金向け）	3,019,550,038
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)	2,961,246,485
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)	2,177,660,268
マイバランスDC50	2,046,408,931

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイ・ロード	1,600,015,897
マイバランスDC70	1,584,081,235
野村外国株インデックス　Bコース(野村SMA・EW向け)	1,570,017,565
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	1,246,658,042
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)	1,240,519,467
のむラップ・ファンド（保守型）	1,222,162,509
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)	1,151,069,845
マイバランスDC30	1,099,765,570
野村６資産均等バランス	643,512,929
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	607,510,683
野村外国株式インデックスファンド	518,274,940
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	485,371,313
のむラップ・ファンド（やや積極型）	440,681,091
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	275,786,534
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)	246,564,408
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	228,702,850
のむラップ・ファンド（やや保守型）	223,325,959
野村DC運用戦略ファンド	216,326,337

ファンド名	当期末 元本額
	円
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）	180,296,083
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	174,633,368
バランスセレクト70	155,428,916
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）	153,679,384
バランスセレクト50	144,817,704
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	129,365,827
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	93,721,552
世界6資産分散ファンド	67,538,180
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	62,582,474
野村資産設計ファンド2040	60,883,618
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）	49,066,901
バランスセレクト30	45,606,729
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	44,016,998
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）	41,225,030
野村資産設計ファンド2030	37,195,280
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	30,720,896
野村資産設計ファンド2025	30,275,301
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	30,055,352
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	29,087,179
野村資産設計ファンド2035	28,812,214
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	26,822,093
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	23,250,293
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	22,713,083
野村資産設計ファンド2020	18,389,209
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）	16,933,862
野村資産設計ファンド2015	16,224,931
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	15,363,144

ファンド名	当期末 元本額
	円
ネクストコア	15,297,514
野村資産設計ファンド2050	14,984,107
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	14,057,350
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	12,569,368
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	11,389,463
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	10,685,299
野村資産設計ファンド2045	9,067,287
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	7,480,531
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）	6,606,701
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	5,768,243
野村資産設計ファンド2060	4,928,471
野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型	4,900,497
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	3,672,056
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）	3,286,325
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	2,914,635
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2030	2,756,083
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）	2,662,077
野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型	2,203,199
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2050	2,110,719
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2040	2,088,740
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	1,982,969
野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型	1,775,244
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）	1,595,704
野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型	1,124,486
野村資産設計ファンド（ＤＣ・つみたてＮＩＳＡ）2060	667,236
野村スリーゼロ先進国株式投信	415,117
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	129,074

○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23期（決算日　2020年3月9日）
第24期（決算日　2020年5月7日）
第25期（決算日　2020年7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。

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

ホームページ　https://www.smtam.jp/

■口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
■当運用報告書についてのお問い合わせ
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。）

＜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
第9	第23期(2020年 3月9日)	9,286	30	△0.7	10,329	2.8	98.4	0.8	30,384
	第24期(2020年 5月7日)	9,265	26	0.1	9,989	△3.3	97.9	1.2	29,172
	第25期(2020年 7月7日)	9,651	28	4.5	10,477	4.9	98.0	1.1	30,347

(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。

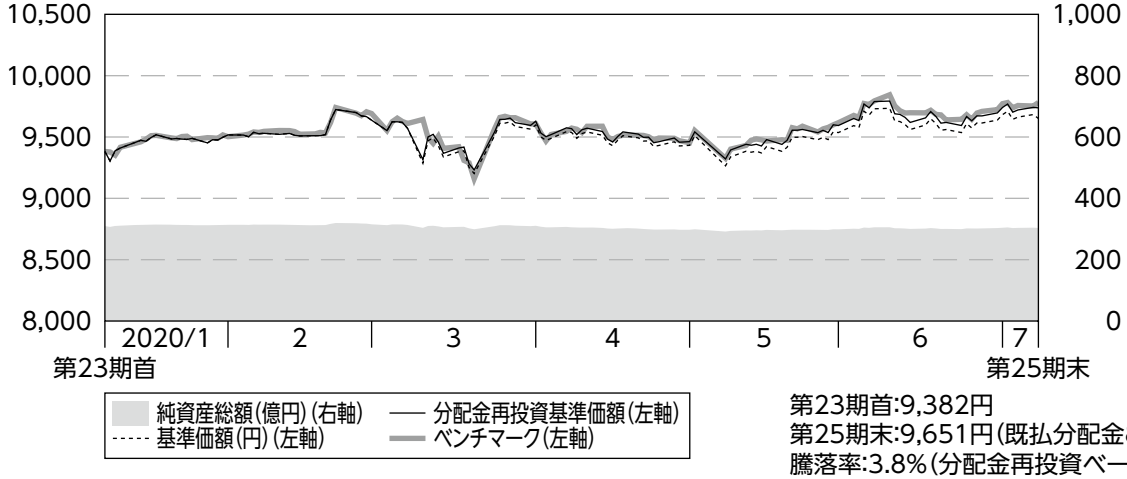
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年　月　日	基準価額		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23期	(期　首)2020年1月7日	9,382	－	10,050	－	98.1	0.8
	1月末	9,517	1.4	10,179	1.3	97.5	1.0
	2月末	9,637	2.7	10,381	3.3	98.2	0.7
	(期　末)2020年3月9日	9,316	△0.7	10,329	2.8	98.4	0.8
第24期	(期　首)2020年3月9日	9,286	－	10,329	－	98.4	0.8
	3月末	9,598	3.4	10,291	△0.4	98.4	0.7
	4月末	9,432	1.6	10,126	△2.0	97.0	1.6
	(期　末)2020年5月7日	9,291	0.1	9,989	△3.3	97.9	1.2
第25期	(期　首)2020年5月7日	9,265	－	9,989	－	97.9	1.2
	5月末	9,536	2.9	10,301	3.1	97.2	2.1
	6月末	9,682	4.5	10,467	4.8	96.7	2.3
	(期　末)2020年7月7日	9,679	4.5	10,477	4.9	98.0	1.1

(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



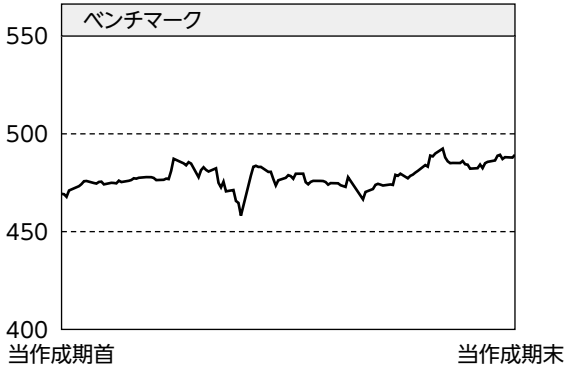
第23期首:9,382円
第25期末:9,651円(既払分配金84円)
騰落率:3.8%(分配金再投資ベース)

(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、2020年1月7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

2020年2月下旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に主要国の長期金利が大幅に低下(債券価格は上昇)したことや外国為替市場で米国の経済指標改善などにより円安・米ドル高が進行したことから、基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。3月上旬から中旬にかけては、主要国の財政出動機運の急速な高まりから長期金利が上昇(債券価格は下落)したことやリスク回避姿勢の強まりにより主要通貨に対して円高となったことから、基準価額は下落しましたが、3月下旬には、市場の不安心理が和らいだことから、下落幅を縮小しました。4月以降5月上旬にかけては、ユーロ圏の経済指標の悪化や域内の経済対策を巡るEU(欧州連合)の協議難航などから円高・ユーロ安となり、基準価額は緩やかに下落しました。5月中旬以降6月上旬にかけては、EUによる大規模な復興基金の設立期待やECB(欧州中央銀行)の量的金融緩和策拡大を背景とした景気回復期待から円安・ユーロ高となり、基準価額は上昇しました。6月中旬以降は、基準価額はもみ合い推移となりました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2020年1月下旬から3月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に低下しました。3月中旬に、主要国の財政出動機運が急速に高まったことから大幅に上昇しましたが、下旬には市場の不安心理が和らぎ、上昇幅は縮小しました。4月以降は、レンジ内推移となりました。外国為替市場では、2020年2月下旬にかけて、米経済指標の改善から対円で米ドルが上昇しました。3月上旬にリスク回避の動きから主要通貨は急激に円高となりましたが、下旬にかけては反転して円安となりました。5月上旬にかけて経済指標の悪化からユーロが対円で下落しましたが、中旬以降は政策期待から上昇しました。

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。

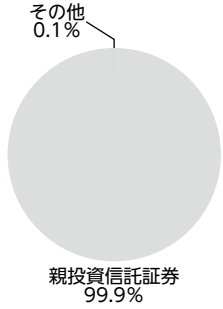
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

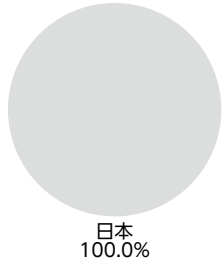
	当作成期末
	2020年7月7日
外国債券インデックス マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

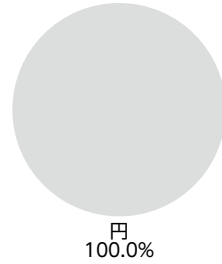
○資産別配分



○国別配分



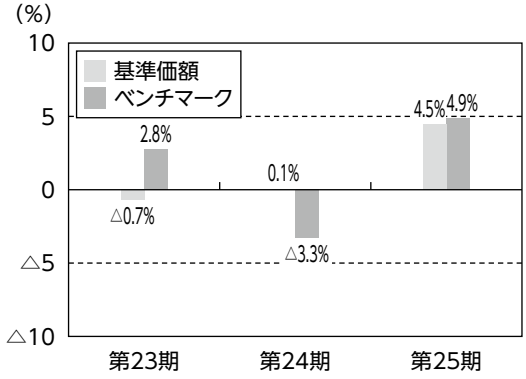
○通貨別配分



(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23期 2020年1月8日～ 2020年3月9日	第24期 2020年3月10日～ 2020年5月7日	第25期 2020年5月8日～ 2020年7月7日
当期分配金	（円）	30	26	28
（対基準価額比率）	（％）	（0.322）	（0.280）	（0.289）
当期の収益	（円）	30	26	28
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	529	535	775

（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 (2020年1月8日~2020年7月7日) 金額	比率	項目の概要
(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9,567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)	(0.049)	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	0.001	(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)	(0.001)	
(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	0.015	(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)	(0.012)	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	0.082	

(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	122,334	351,564	732,937	2,109,780

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	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	2,433	402	16.5	2,424	395	16.3

(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。

＜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	24,687	1,269	5.1	152,937	75	0.0
金銭信託	878	878	100.0	878	878	100.0
コール・ローン	646,303	108,568	16.8	654,224	107,816	16.5

〈平均保有割合　9.2%〉
(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	10,908,187	10,297,584	30,332,566

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、96,481,483千口です。

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	30,332,566	99.6
コール・ローン等、その他	116,126	0.4
投資信託財産総額	30,448,692	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(281,190,036千円)の投資信託財産総額(284,345,435千円)に対する比率は98.9%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＝107.30円
1ユーロ＝121.54円
1ノルウェークローネ＝11.46円
1オーストラリアドル＝74.99円
1イスラエルシェケル＝31.07円
1カナダドル＝79.32円
1イギリスポンド＝134.26円
1デンマーククローネ＝16.31円
1シンガポールドル＝77.18円
1メキシコペソ＝4.82円
1スウェーデンクローナ＝11.64円
1ポーランドズロチ＝27.23円
1マレーシアリンギット＝25.12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 23 期 末 2020年3月9日現在	第 24 期 末 2020年5月7日現在	第 25 期 末 2020年7月7日現在
(A)資産	**30,490,689,296円**	**29,348,413,732円**	**30,448,692,335円**
コール・ローン等	22,575,396	23,314,704	30,338,336
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	30,369,251,882	29,154,719,208	30,332,566,049
未収入金	98,862,018	170,379,811	85,787,950
未収利息	—	9	—
(B)負債	**105,827,329**	**175,615,022**	**100,945,221**
未払収益分配金	98,167,172	81,867,255	88,051,007
未払解約金	359,999	86,999,999	6,000,000
未払信託報酬	7,019,340	6,481,099	6,619,588
未払利息	48	—	26
その他未払費用	280,770	266,669	274,600
(C)純資産総額(A-B)	**30,384,861,967**	**29,172,798,710**	**30,347,747,114**
元本	32,722,390,834	31,487,405,941	31,446,788,396
次期繰越損益金	△2,337,528,867	△2,314,607,231	△1,099,041,282
(D)受益権総口数	**32,722,390,834口**	**31,487,405,941口**	**31,446,788,396口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**9,286円**	**9,265円**	**9,651円**

■損益の状況

項目	第 23 期 自 2020年1月8日 至 2020年3月9日	第 24 期 自 2020年3月10日 至 2020年5月 7日	第 25 期 自 2020年5月8日 至 2020年7月7日
(A)配当等収益	**△1,047円**	**△1,832円**	**△1,753円**
受取利息	16	33	24
支払利息	△1,063	△1,865	△1,777
(B)有価証券売買損益	**△210,400,117**	**20,968,169**	**1,302,674,956**
売買益	10,013,010	46,906,754	1,308,549,539
売買損	△220,413,127	△25,938,585	△5,874,583
(C)信託報酬等	**△7,300,110**	**△6,747,768**	**△6,894,188**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△217,701,274**	**14,218,569**	**1,295,779,015**
(E)前期繰越損益金	**369,671,643**	**51,592,852**	**△15,935,689**
(F)追加信託差損益金	**△2,391,332,064**	**△2,298,551,397**	**△2,290,833,601**
(配当等相当額)	(1,291,700,525)	(1,244,473,280)	(1,245,649,399)
(売買損益相当額)	(△3,683,032,589)	(△3,543,024,677)	(△3,536,483,000)
(G)計(D+E+F)	**△2,239,361,695**	**△2,232,739,976**	**△1,010,990,275**
(H)収益分配金	**△98,167,172**	**△81,867,255**	**△88,051,007**
次期繰越損益金(G+H)	**△2,337,528,867**	**△2,314,607,231**	**△1,099,041,282**
追加信託差損益金	△2,391,332,064	△2,298,551,397	△2,290,833,601
(配当等相当額)	(1,291,747,338)	(1,244,517,307)	(1,245,718,926)
(売買損益相当額)	(△3,683,079,402)	(△3,543,068,704)	(△3,536,552,527)
分配準備積立金	442,572,236	442,109,130	1,191,792,319
繰越損益金	△388,769,039	△458,164,964	—

(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23期首元本額は32,996,830,007円、第23～25期中追加設定元本額は470,568,051円、第23～25期中一部解約元本額は2,020,609,662円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　23　期	第　24　期	第　25　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	106,343,768円	99,585,925円	101,223,666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	739,818,849円
(C) 収益調整金額	1,291,747,338円	1,244,517,307円	1,245,718,926円
(D) 分配準備積立金額	434,395,640円	424,390,460円	438,800,811円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	1,832,486,746円	1,768,493,692円	2,525,562,252円
(F) 期末残存口数	32,722,390,834口	31,487,405,941口	31,446,788,396口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	560円	561円	803円
(H) 分配金額(1万口当たり)	30円	26円	28円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	98,167,172円	81,867,255円	88,051,007円

分配金のお知らせ

	第23期	第24期	第25期
1万口当たり分配金	30円	26円	28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20期（決算日　2020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
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481.049	5.9	97.3	2.1	276,169

(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

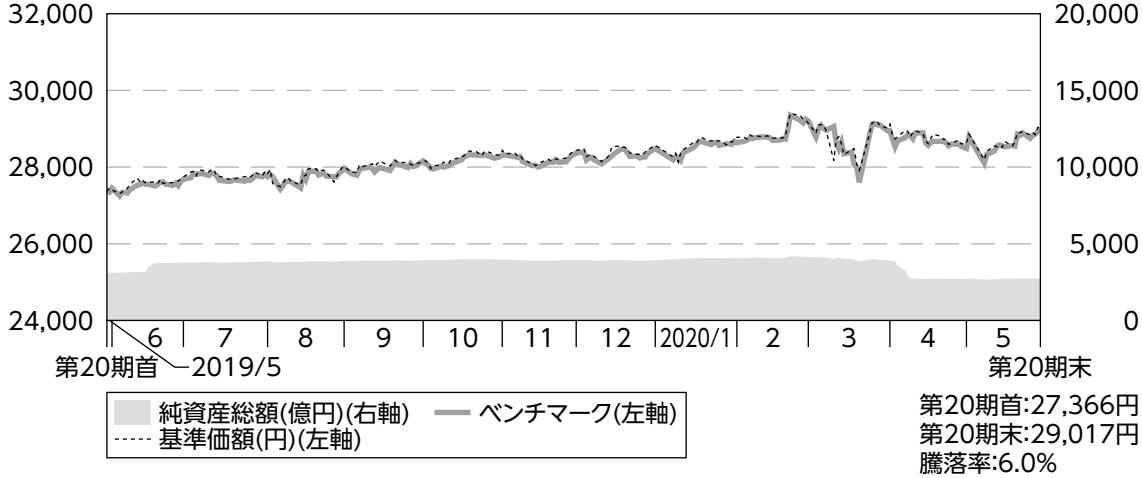
年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
	円	%		%	%	%
(当期首) 2019年 5月29日	27,366	－	454.282	－	97.3	1.4
5月末	27,402	0.1	455.639	0.3	97.1	1.4
6月末	27,746	1.4	459.552	1.2	98.4	0.6
7月末	27,832	1.7	460.690	1.4	98.0	0.9
8月末	28,013	2.4	464.284	2.2	97.9	0.9
9月末	28,139	2.8	467.478	2.9	97.9	1.7
10月末	28,439	3.9	470.059	3.5	98.4	0.5
11月末	28,435	3.9	470.899	3.7	98.4	0.5
12月末	28,569	4.4	472.814	4.1	99.1	1.7
2020年 1月末	28,778	5.2	475.349	4.6	97.6	1.0
2月末	29,142	6.5	484.794	6.7	98.3	0.7
3月末	29,120	6.4	480.583	5.8	98.4	0.7
4月末	28,619	4.6	472.875	4.1	97.0	1.6
(当期末) 2020年 5月29日	29,017	6.0	481.049	5.9	97.3	2.1

(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



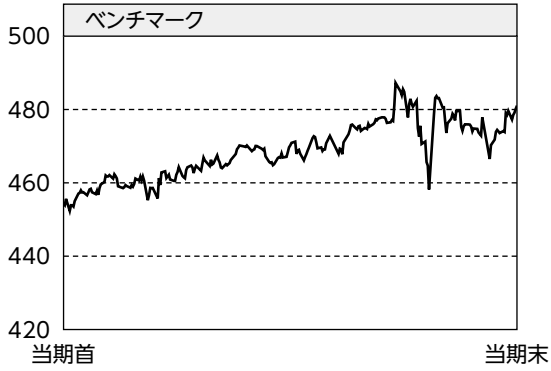
第20期首:27,366円
第20期末:29,017円
騰落率:6.0%

(注)ベンチマークは、2019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

2020年2月下旬にかけて、外国為替市場で主要通貨が英国の合意なきEU(欧州連合)離脱への警戒感などから対円で下落する局面もありましたが、米中通商協議の進展期待などを背景に上昇したことに加えて、主要国の長期金利が主要中央銀行による金融緩和観測を背景に低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は上昇しました。3月中旬にかけては、主要国の財政出動への期待を背景に欧州を中心に長期金利が上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額は下落しました。3月下旬には、主要中央銀行による大規模金融緩和を背景に主要国の長期金利が低下したことから、基準価額は上昇しました。4月上旬から5月上旬にかけては、FRB(米連邦準備理事会)の大規模な緊急資金供給策を受けて米ドルの需給ひっ迫が和らぐとの見方が強まったことやEUで経済対策を巡る協議が難航したことなどを受けて、主要通貨が対円で下落したことから、基準価額は下落しました。その後は、欧米の経済活動再開への期待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、主要中央銀行の金融緩和観測などを受けて低下しましたが、2020年1月上旬にかけては、米中通商協議の進展期待などから上昇しました。その後は、主要国による財政出動への期待から長期金利が上昇する局面がありましたが、主要中央銀行の金融緩和などを背景に低下しました。
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離脱への警戒感などから、主要通貨は対円で下落しました。2020年2月中旬にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景に主要通貨は対円で上昇しましたが、その後は新型コロナウイルスの感染拡大を背景に、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。

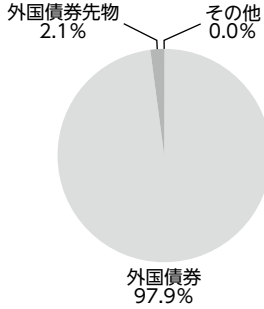
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

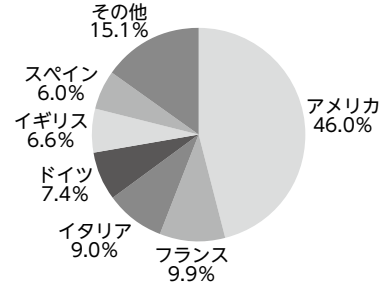
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	EURO-BUND 2006	ドイツ	0.7%
2	T 2.375% 05/15/29	アメリカ	0.7%
3	T 1.625% 08/15/29	アメリカ	0.6%
4	T 2.375% 08/15/24	アメリカ	0.5%
5	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	0.5%
6	T 1.625% 11/15/22	アメリカ	0.5%
7	T 2.75% 09/15/21	アメリカ	0.5%
8	T 2.5% 05/15/46	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.5%
10	T 2.25% 08/15/49	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		718	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

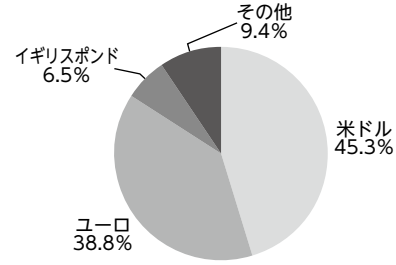
○資産別配分



○国別配分



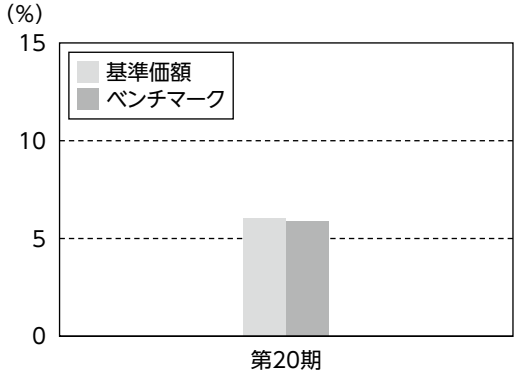
○通貨別配分



（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2.1%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※（プラス要因）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 (2019年5月30日~2020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	6	0.022	(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)	(6)	(0.021)	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	6	0.023	

(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(28,352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 713,642	千米ドル 1,036,192
	カナダ	国債証券	千カナダドル 35,839	千カナダドル 46,078
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 233,036	千メキシコペソ 264,389
	ドイツ	国債証券	千ユーロ 106,346	千ユーロ 104,068
	イタリア	国債証券	97,486	123,245
	フランス	国債証券	111,478	135,468
	オランダ	国債証券	19,409	25,545
	スペイン	国債証券	66,198	77,411
	ベルギー	国債証券	25,072	31,306
	オーストリア	国債証券	17,446	20,370
	フィンランド	国債証券	7,251	9,108
	アイルランド	国債証券	8,829	9,543
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 63,239	千イギリスポンド 89,009
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 33,847	千スウェーデンクローナ 56,129
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 29,265	千ノルウェークローネ 29,767
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 43,596	千デンマーククローネ 51,922
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 31,983	千ポーランドズロチ 37,841
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 37,801	千オーストラリアドル 43,626
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 8,923	千シンガポールドル 9,887
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 25,938	千マレーシアリンギット 28,174
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 33,969	千イスラエルシェケル －
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 96,190	千南アフリカランド 280,720

(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 55,242	百万円 54,007	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	106,567	1,239	1.2	162,547	675	0.4
金銭信託	1,095	1,095	100.0	225	225	100.0
コール・ローン	1,101,321	199,145	18.1	1,102,823	200,295	18.2

(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	1,029,250	1,151,242	123,793,130	44.8	－	19.8	16.3	8.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	58,080	67,421	5,259,580	1.9	－	0.9	0.6	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	408,420	445,600	2,156,705	0.8	－	0.4	0.2	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	135,890	165,647	19,733,645	7.1	－	4.2	2.0	0.9
イタリア	177,870	202,782	24,157,538	8.7	－	5.1	2.5	1.1
フランス	187,210	224,321	26,723,420	9.7	－	6.3	2.2	1.1
オランダ	35,710	43,203	5,146,805	1.9	－	1.2	0.5	0.2
スペイン	112,110	133,586	15,914,219	5.8	－	3.8	1.3	0.6
ベルギー	45,730	56,383	6,716,910	2.4	－	1.9	0.4	0.2
オーストリア	28,080	34,170	4,070,753	1.5	－	1.0	0.4	0.1
フィンランド	11,650	12,896	1,536,409	0.6	－	0.4	0.2	0.0
アイルランド	15,080	17,098	2,036,942	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	96,200	134,378	17,809,166	6.4	－	5.2	1.0	0.3
	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	61,110	68,936	778,291	0.3	－	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	57,620	61,814	679,335	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	67,500	85,645	1,368,613	0.5	－	0.4	0.1	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	56,380	61,735	1,650,199	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	67,390	77,797	5,550,816	2.0	－	1.3	0.6	0.1
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	14,210	16,152	1,225,821	0.4	－	0.3	0.1	0.1
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	49,750	54,058	1,336,319	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	27,680	33,945	1,039,070	0.4	－	0.2	0.1	0.0
合計	－	－	268,683,695	97.3	－	53.7	29.3	14.3

(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% 06/30/21	1.125	9,800	9,899	1,064,537	2021/6/30
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	5,055	543,604	2021/7/31
T 1.125% 09/30/21	1.125	2,800	2,835	304,876	2021/9/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,697	505,086	2023/7/31
T 1.25% 10/31/21	1.25	10,000	10,151	1,091,618	2021/10/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	5,177	556,761	2023/6/30
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,592	278,779	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	4,151	446,434	2023/9/30
T 1.375% 10/15/22	1.375	5,000	5,140	552,771	2022/10/15
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,599	494,555	2022/1/31
T 1.5% 02/28/23	1.5	7,800	8,077	868,581	2023/2/28
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	4,146	445,913	2023/3/31
T 1.5% 08/15/22	1.5	10,000	10,291	1,106,592	2022/8/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	8,400	8,927	960,022	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,939	961,276	2024/9/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	8,648	929,989	2026/2/15
T 1.625% 04/30/23	1.625	3,500	3,643	391,835	2023/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	8,841	950,723	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	1,042	112,053	2023/5/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,579	277,414	2022/8/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	14,650	15,929	1,712,908	2029/8/15
T 1.625% 08/31/22	1.625	5,000	5,161	555,039	2022/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	5,000	5,236	563,083	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	7,300	7,824	841,419	2026/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	12,150	12,576	1,352,369	2022/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	8,780	9,416	1,012,561	2026/11/30
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,861	845,340	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,568	276,212	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,825	1,056,495	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,500	5,666	609,319	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,916	421,175	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,856	414,718	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,849	1,059,162	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	7,228	777,290	2022/6/30
T 1.75% 06/30/24	1.75	7,600	8,053	866,038	2024/6/30
T 1.75% 07/15/22	1.75	8,320	8,596	924,389	2022/7/15
T 1.75% 07/31/21	1.75	6,700	6,822	733,663	2021/7/31
T 1.75% 09/30/22	1.75	5,150	5,337	573,940	2022/9/30
T 1.75% 11/30/21	1.75	6,050	6,192	665,930	2021/11/30
T 1.875% 01/31/22	1.875	7,000	7,197	773,997	2022/1/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,574	276,800	2022/2/28
T 1.875% 03/31/22	1.875	5,500	5,670	609,792	2022/3/31
T 1.875% 04/30/22	1.875	4,450	4,594	494,041	2022/4/30
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	9,329	1,003,191	2022/7/31
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,634	605,888	2026/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,152	446,467	2022/8/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	6,399	688,149	2024/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	7,450	7,752	833,674	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,538	595,507	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,578	277,220	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	5,000	5,242	563,755	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	9,120	980,738	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	5,669	609,602	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,649	715,052	2024/4/30
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,868	416,012	2021/5/31
T 2% 05/31/24	2.0	8,000	8,549	919,280	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,883	632,698	2024/6/30
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,118	335,317	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	7,467	802,959	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	3,740	3,824	411,297	2021/8/31
T 2% 10/31/21	2.0	5,650	5,796	623,278	2021/10/31
T 2% 10/31/22	2.0	10,000	10,436	1,122,260	2022/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,464	264,987	2021/11/15
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	11,200	1,204,430	2026/11/15
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,090	224,754	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,263	243,404	2021/12/31
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,454	586,512	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,924	852,168	2024/3/31
T 2.125% 05/15/22	2.125	3,790	3,934	423,044	2022/5/15
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,608	280,542	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	8,600	9,452	1,016,475	2026/5/31
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,657	823,455	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	6,000	6,243	671,390	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	5,165	555,439	2024/7/31
T 2.125% 08/15/21	2.125	5,370	5,496	591,037	2021/8/15
T 2.125% 09/30/21	2.125	10,300	10,567	1,136,329	2021/9/30
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,627	927,715	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	5,680	6,052	650,828	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	3,500	3,607	387,961	2021/12/31
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,584	600,528	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,291	461,488	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	9,982	1,073,444	2027/2/15
T 2.25% 04/15/22	2.25	4,000	4,155	446,795	2022/4/15
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	7,540	810,780	2024/4/30
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	3,072	330,396	2021/7/31
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	9,590	1,031,287	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	10,790	12,684	1,363,926	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	10,200	12,139	1,305,370	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,836	735,127	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	11,021	1,185,096	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,839	520,371	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	8,603	925,108	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,821	518,418	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	8,400	9,136	982,462	2024/12/31
T 2.375% 01/31/23	2.375	5,000	5,289	568,795	2023/1/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	6,214	668,245	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	7,600	8,458	909,549	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	10,750	12,116	1,302,879	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	15,010	17,276	1,857,768	2029/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	12,500	13,589	1,461,315	2024/8/15
T 2.5% 01/15/22	2.5	6,500	6,745	725,305	2022/1/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	6,300	6,816	732,983	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	5,503	591,835	2025/1/31
T 2.5% 02/15/22	2.5	7,800	8,109	871,972	2022/2/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	4,410	5,394	580,088	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	8,500	10,439	1,122,512	2046/2/15
T 2.5% 03/31/23	2.5	4,050	4,312	463,718	2023/3/31
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	8,592	923,916	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	10,050	12,357	1,328,809	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,881	524,866	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	5,270	566,705	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	9,990	11,682	1,256,171	2029/2/15
T 2.625% 02/28/23	2.625	1,400	1,493	160,550	2023/2/28
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	8,044	865,012	2025/3/31
T 2.625% 06/15/21	2.625	10,000	10,254	1,102,686	2021/6/15
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	5,262	565,837	2023/6/30
T 2.625% 07/15/21	2.625	3,350	3,442	370,124	2021/7/15
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,797	408,301	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	6,531	702,316	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,275	352,227	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,000	4,660	501,157	2028/2/15
T 2.75% 04/30/23	2.75	3,600	3,865	415,657	2023/4/30
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	4,173	448,784	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	6,161	662,523	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,079	116,107	2023/7/31
T 2.75% 08/15/21	2.75	11,000	11,342	1,219,631	2021/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	3,807	409,412	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,950	6,409	689,211	2047/8/15

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 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	7,751	833,513	2025/8/31
T 2.75% 09/15/21	2.75	12,000	12,398	1,333,254	2021/9/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,120	6,649	715,048	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	5,329	573,071	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	4,550	5,900	634,434	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,493	483,145	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	8,557	920,212	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	5,150	6,672	717,533	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	7,461	802,301	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	4,296	462,045	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	6,160	662,452	2025/7/31
T 2.875% 08/15/28	2.875	8,920	10,549	1,134,365	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	9,300	12,156	1,307,147	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	5,166	555,599	2023/9/30
T 2.875% 10/15/21	2.875	7,250	7,519	808,598	2021/10/15
T 2.875% 10/31/23	2.875	5,500	5,993	644,503	2023/10/31
T 2.875% 11/15/21	2.875	8,350	8,678	933,246	2021/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,388	471,934	2023/11/30
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	6,039	649,388	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	7,000	9,569	1,029,036	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	2,138	229,969	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	4,661	501,287	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	5,710	7,715	829,662	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	7,425	798,477	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,780	514,024	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,698	612,731	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	6,050	8,037	864,223	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	2,350	3,160	339,816	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,500	4,706	506,079	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,700	6,528	702,059	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	2,490	3,369	362,340	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	10,140	1,090,394	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	2,349	252,628	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	4,510	6,328	680,535	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	7,300	10,628	1,142,865	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	1,084	116,564	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	3,487	375,010	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,898	311,685	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,922	314,239	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	5,500	8,127	874,000	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	2,145	230,735	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,384	148,885	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	3,648	392,368	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,546	166,285	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,987	321,192	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	3,079	331,119	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	1,260	1,971	211,985	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,590	2,423	260,613	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,600	2,510	269,940	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,692	289,525	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	2,380	3,839	412,893	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	1,234	132,784	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,797	193,272	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	1,250	1,743	187,473	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,800	193,618	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,896	311,511	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,674	180,005	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,236	240,447	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	2,045	219,991	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,617	173,946	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,969	211,793	2023/8/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	1,894	203,765	2021/11/15
小計				123,793,130	
(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	4,030	4,046	315,653	2022/3/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	700	703	54,843	2025/9/1
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	2,700	2,717	211,971	2021/9/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	500	518	40,469	2027/6/1
CAN 1% 09/01/22	1.0	1,500	1,524	118,894	2022/9/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,730	1,846	144,015	2030/6/1
CAN 1.25% 11/01/21	1.25	1,880	1,906	148,709	2021/11/1
CAN 1.5% 02/01/22	1.5	1,210	1,234	96,313	2022/2/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,109	86,532	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,447	112,913	2026/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	600	628	48,993	2024/9/1
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	3,620	3,765	293,717	2023/3/1
CAN 1.75% 05/01/21	1.75	2,700	2,737	213,541	2021/5/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,465	114,360	2028/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	2,110	2,223	173,489	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	1,970	2,418	188,632	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,461	192,059	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,966	153,424	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	2,190	2,525	197,007	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	4,560	4,950	386,161	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	3,670	3,853	300,621	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,980	2,756	215,048	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	560	877	68,416	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,840	1,895	147,857	2021/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,140	3,266	254,844	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,850	2,874	224,208	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,580	2,590	202,074	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,706	133,133	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,600	2,597	202,630	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	1,850	2,807	219,040	2027/6/1
小計				5,259,580	
(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	8,550	11,303	54,709	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	25,860	30,593	148,073	2024/12/5
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	25,630	25,781	124,780	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	26,230	26,923	130,309	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	39,660	40,226	194,696	2021/6/10
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	10,400	10,813	52,335	2023/3/9
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	30,180	31,112	150,584	2021/12/9
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	41,630	45,458	220,021	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	16,780	18,574	89,901	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,190	25,966	125,676	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	15,580	17,256	83,522	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	37,957	183,712	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	18,770	20,739	100,377	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	30,620	33,286	161,104	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	37,670	43,717	211,591	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	22,200	25,889	125,306	2038/11/18
小計				2,156,705	
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BKO 0% 03/11/22	－	3,100	3,135	373,549	2022/3/11
BKO 0% 06/11/21	－	2,640	2,656	316,457	2021/6/11
DBR 0% 02/15/30	－	3,570	3,719	443,103	2030/2/15
DBR 0% 08/15/26	－	4,470	4,639	552,648	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	－	2,510	2,617	311,824	2029/8/15
DBR 0% 08/15/50	－	860	853	101,630	2050/8/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	4,140	4,375	521,224	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,890	4,145	493,822	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,180	2,318	276,255	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,000	3,163	376,848	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,194	380,550	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,390	2,584	307,841	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	3,160	3,405	405,738	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,139	254,907	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	4,120	4,474	533,042	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,050	4,122	491,064	2048/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,960	3,133	373,346	2023/2/15

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% 05/15/23	1.5	2,180	2,319	276,307	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,486	296,269	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,800	2,936	349,866	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,798	214,288	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,090	2,194	261,469	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,300	3,440	409,809	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	3,106	370,031	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,020	240,674	2021/9/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,320	5,394	642,649	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	4,020	6,693	797,360	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	4,100	4,272	508,986	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,940	5,143	612,753	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	5,005	596,339	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	3,010	5,574	664,092	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,650	434,898	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	3,720	6,413	763,998	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,830	5,651	673,269	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,140	3,503	417,382	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	4,360	6,429	765,984	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	5,440	6,801	810,288	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	2,069	246,546	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,478	176,102	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	2,900	2,973	354,177	2024/4/5
OBL 0% 04/08/22	—	2,650	2,680	319,334	2022/4/8
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,864	460,405	2025/4/11
OBL 0% 04/14/23	—	2,220	2,261	269,435	2023/4/14
OBL 0% 10/07/22	—	4,160	4,223	503,123	2022/10/7
OBL 0% 10/08/21	—	2,600	2,621	312,253	2021/10/8
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,543	183,899	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,350	2,415	287,788	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0.05% 01/15/23	0.05	2,030	2,011	239,633	2023/1/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	566	67,543	2025/2/1
BTPS 0.35% 11/01/21	0.35	2,580	2,584	307,897	2021/11/1
BTPS 0.45% 06/01/21	0.45	1,400	1,404	167,291	2021/6/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	2,170	2,177	259,418	2023/10/15
BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	3,180	3,218	383,477	2022/8/1
BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	2,000	2,027	241,477	2023/3/1
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	2,580	2,615	311,626	2023/3/15
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	650	619	73,767	2030/8/1
BTPS 1% 07/15/22	1.0	2,160	2,191	261,015	2022/7/15
BTPS 1.2% 04/01/22	1.2	2,010	2,042	243,323	2022/4/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,967	234,341	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,000	993	118,390	2030/4/1
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	2,900	2,955	352,063	2022/4/15
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	550	521	62,149	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,359	281,122	2025/5/15
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,050	1,076	128,213	2022/9/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,467	293,964	2024/11/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,478	295,239	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	3,180	3,282	391,007	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	3,036	361,702	2032/3/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,600	1,663	198,186	2024/7/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,000	2,087	248,714	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,817	335,604	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	1,650	1,739	207,191	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,203	262,507	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,740	1,838	219,042	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,388	403,614	2026/7/15
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,573	306,546	2021/12/15
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	3,680	3,927	467,891	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,390	1,459	173,903	2036/9/1
BTPS 2.3% 10/15/21	2.3	2,700	2,776	330,787	2021/10/15
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,500	2,717	323,787	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	870	888	105,870	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,960	3,143	374,468	2023/10/1

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 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,184	379,407	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,165	377,130	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,510	2,713	323,302	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,320	1,421	169,358	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,890	2,113	251,753	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,750	3,126	372,429	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	4,960	5,648	672,855	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,644	195,906	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	2,306	274,723	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,210	1,443	171,924	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,592	308,864	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,694	559,305	2030/3/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	3,220	3,353	399,473	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,413	287,560	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	2,590	3,387	403,577	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	4,210	5,401	643,449	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	3,135	373,554	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,480	295,473	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,994	475,876	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	5,790	6,555	781,004	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,950	4,173	497,227	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	3,630	4,597	547,707	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,200	3,192	380,263	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/22	5.0	3,250	3,516	418,957	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,400	5,241	624,474	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,420	4,760	567,151	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,190	4,663	555,571	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,800	4,078	485,825	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,759	566,987	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,250	1,393	166,031	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,450	3,871	461,175	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,080	4,486	534,481	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,940	5,678	676,529	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,520	4,811	573,152	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,929	229,896	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,027	122,385	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/22	—	2,000	2,018	240,512	2022/2/25
FRTR 0% 03/25/23	—	5,290	5,370	639,776	2023/3/25
FRTR 0% 03/25/24	—	5,950	6,065	722,574	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	5,090	5,196	619,053	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/21	—	4,100	4,120	490,894	2021/5/25
FRTR 0% 05/25/22	—	4,050	4,094	487,781	2022/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	5,290	630,295	2029/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,530	4,687	558,457	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,980	6,259	745,709	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	5,090	5,347	637,090	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	4,000	4,219	502,635	2029/5/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,640	6,060	721,949	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,550	1,568	186,809	2052/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	4,570	4,918	585,909	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	5,056	602,408	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,480	5,897	702,604	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	5,110	5,843	696,134	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,430	5,081	605,313	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,420	6,301	750,643	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,330	4,065	484,360	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	4,590	4,906	584,550	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	2,459	292,979	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,460	4,311	513,598	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	5,810	6,394	761,788	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,460	4,651	554,086	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,554	542,585	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	5,740	6,129	730,154	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,160	6,475	771,412	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,700	5,749	684,986	2027/10/25

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 3% 04/25/22	3.0	8,490	9,065	1,079,952	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,190	5,165	615,387	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,650	5,950	708,875	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	6,350	7,804	929,757	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,050	4,126	491,558	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,850	3,915	466,471	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	5,539	659,905	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,020	5,849	696,794	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,830	8,708	1,037,465	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,680	6,123	729,540	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	7,778	926,661	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	7,371	878,144	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,562	305,215	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,264	150,628	2023/4/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/22	—	980	988	117,819	2022/1/15
NETHER 0% 01/15/24	—	1,850	1,888	225,022	2024/1/15
NETHER 0% 07/15/30	—	1,610	1,646	196,135	2030/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,400	2,495	297,251	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,600	1,678	199,966	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	760	831	99,034	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,860	1,969	234,621	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	2,110	2,284	272,208	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,620	1,765	210,345	2028/7/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	3,060	3,284	391,282	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,202	262,379	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	660	700	83,412	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,650	2,205	262,792	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,130	3,629	432,328	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,740	2,857	340,399	2021/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	2,940	3,278	390,563	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,060	3,712	442,251	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,110	3,534	421,054	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,380	2,006	238,993	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	242	28,941	2023/1/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/25	—	870	872	103,947	2025/1/31
SPGB 0% 04/30/23	—	2,380	2,396	285,541	2023/4/30
SPGB 0.05% 10/31/21	0.05	1,930	1,940	231,224	2021/10/31
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,328	277,423	2024/7/30
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	1,440	1,466	174,707	2023/7/30
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	2,390	2,424	288,823	2022/4/30
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	2,210	2,251	268,233	2022/10/31
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	2,150	2,149	256,057	2030/4/30
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,780	2,816	335,544	2029/10/31
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	2,200	2,229	265,611	2021/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	1,180	1,077	128,326	2050/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	3,256	387,983	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	3,450	3,705	441,467	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	4,430	4,804	572,401	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,300	3,581	426,631	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,860	3,116	371,214	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,600	2,824	336,485	2027/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	3,050	3,322	395,867	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,299	393,021	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,820	2,068	246,455	2035/7/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	3,122	371,936	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,510	2,863	341,104	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,360	2,633	313,696	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,925	348,468	2033/7/30
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,780	2,364	281,629	2048/10/31
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,600	4,057	483,392	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,170	2,954	352,001	2046/10/31
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,500	2,424	288,866	2066/7/30
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,914	347,172	2024/4/30

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)	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,720	4,094	487,818	2037/1/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	3,490	4,045	481,996	2023/10/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,526	420,145	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,640	4,410	525,374	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,843	338,699	2024/1/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,590	4,374	521,177	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,630	6,462	769,864	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,850	3,372	401,731	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,900	3,341	398,122	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,390	3,572	425,559	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,730	4,358	519,179	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	4,280	4,724	562,839	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,715	561,755	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,550	184,717	2029/1/31
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	—	2,310	2,338	278,529	2027/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,060	1,071	127,595	2030/6/22
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,510	1,546	184,225	2023/10/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	690	670	79,915	2040/6/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	970	1,009	120,293	2024/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,180	2,310	275,201	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,810	215,642	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,560	1,679	200,069	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,550	1,686	200,932	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,380	2,565	305,677	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,490	1,642	195,706	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	850	969	115,452	2033/4/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	530	620	73,952	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,480	1,819	216,760	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	630	798	95,127	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,280	1,602	190,943	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	940	1,424	169,705	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,450	1,574	187,518	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	680	1,005	119,733	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,440	2,747	327,251	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,424	169,684	2034/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,300	2,241	267,032	2045/6/22
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,220	1,322	157,496	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,573	187,429	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,140	3,688	439,420	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,350	2,499	297,722	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,100	2,336	278,375	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,462	174,248	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,920	4,919	586,026	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	4,022	479,239	2028/3/28
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	—	470	475	56,591	2030/2/20
RAGB 0% 07/15/23	—	1,500	1,524	181,657	2023/7/15
RAGB 0% 07/15/24	—	920	938	111,760	2024/7/15
RAGB 0% 09/20/22	—	320	324	38,625	2022/9/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,170	1,237	147,436	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	890	939	111,921	2027/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,620	1,742	207,547	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	560	619	73,857	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,140	2,288	272,618	2026/10/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,660	1,803	214,855	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	830	1,079	128,626	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	450	657	78,315	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,083	129,076	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,433	170,766	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	760	1,452	173,049	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,030	1,362	162,345	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,391	165,826	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	2,990	3,286	391,565	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,730	1,820	216,914	2021/9/15

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 3.65% 04/20/22	3.65	1,160	1,252	149,266	2022/4/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	470	1,066	127,066	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,770	2,947	351,127	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,310	1,709	203,671	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,731	206,260	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 04/15/22	—	390	394	46,968	2022/4/15
RFGB 0% 09/15/23	—	540	549	65,469	2023/9/15
RFGB 0% 09/15/24	—	420	428	51,056	2024/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	510	509	60,731	2036/4/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	652	77,723	2026/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	1,310	1,384	164,934	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	670	709	84,569	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	650	689	82,138	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	500	545	64,958	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	737	87,874	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	640	732	87,314	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	450	579	69,028	2047/4/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	688	82,022	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	1,250	1,313	156,464	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	802	95,575	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	570	870	103,658	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	420	522	62,199	2028/7/4
RFGB 4% 07/04/25	4.0	640	786	93,723	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/22	—	530	535	63,739	2022/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	1,270	1,291	153,802	2027/5/15
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	480	476	56,758	2035/5/15
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	820	838	99,859	2022/3/15
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	1,070	1,145	136,434	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,420	1,516	180,693	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	920	1,002	119,450	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	630	706	84,193	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	390	436	52,050	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	630	746	88,885	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	750	892	106,276	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,090	1,426	169,892	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,400	1,709	203,705	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	1,160	1,324	157,801	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	1,010	1,131	134,802	2023/3/20
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,510	1,918	228,596	2025/3/13
ユーロ計				106,036,644	
(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 0.125% 01/31/23	0.125	1,090	1,092	144,854	2023/1/31
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	3,540	3,580	474,528	2022/7/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	3,400	3,505	464,559	2025/6/7
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,910	2,980	394,968	2023/7/22
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	2,760	2,946	390,520	2029/10/22
UKT 1% 04/22/24	1.0	3,100	3,224	427,301	2024/4/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	2,990	3,247	430,444	2027/7/22
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	650	734	97,340	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,000	2,185	289,583	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,980	3,635	481,845	2047/7/22
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	4,040	4,566	605,151	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,100	1,456	192,970	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,530	2,362	313,107	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	2,120	2,748	364,283	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,030	2,856	378,518	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,470	2,569	340,542	2022/9/7
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	3,530	4,240	561,984	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,972	261,463	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,686	355,995	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	2,350	4,233	561,028	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,620	1,812	240,195	2024/9/7

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 3.25% 01/22/44	3.25	2,820	4,442	588,772	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,030	5,013	664,426	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,140	4,883	647,220	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,090	4,027	533,810	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,820	2,953	391,367	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,920	4,310	571,290	2060/1/22
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,950	2,089	276,890	2022/3/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,790	4,395	582,480	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,950	2,854	378,257	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,880	3,151	417,640	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	670	880	116,670	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,270	3,880	514,304	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,180	4,101	543,585	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,890	3,738	495,496	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,310	5,048	669,046	2055/12/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,770	2,775	367,851	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,460	4,481	593,920	2042/12/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,900	4,270	565,917	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	3,317	439,621	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,980	2,452	324,984	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,873	248,352	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	740	800	106,068	2021/6/7
小計				17,809,166	
(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	6,150	6,575	74,241	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,700	7,197	81,264	2029/11/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,640	9,304	105,047	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	13,277	149,897	2023/11/13
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	8,370	9,517	107,456	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,900	9,231	104,228	2039/3/30
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	12,850	13,831	156,155	2022/6/1
小計				778,291	
(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 1.375% 08/19/30	1.375	3,610	3,880	42,643	2030/8/19
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,910	5,233	57,513	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,120	4,484	49,280	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,190	5,554	61,039	2025/3/13
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	5,420	5,998	65,919	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	4,900	5,473	60,154	2028/4/26
NGB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,866	130,414	2023/5/24
NGB 3% 03/14/24	3.0	6,830	7,542	82,887	2024/3/14
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	11,380	11,781	129,481	2021/5/25
小計				679,335	
(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% 11/15/22	0.25	3,140	3,199	51,123	2022/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	10,730	11,425	182,576	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,460	13,360	213,501	2029/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,380	7,893	126,139	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	8,930	10,013	160,016	2025/11/15
DGB 3% 11/15/21	3.0	8,330	8,759	139,970	2021/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,530	30,994	495,285	2039/11/15
小計				1,368,613	
(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	4,550	4,636	123,934	2021/7/25
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	4,710	4,895	130,866	2022/4/25
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	4,218	112,757	2024/10/25
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,860	6,209	165,968	2023/1/25
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,760	4,055	108,392	2024/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,750	5,226	139,711	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,200	3,543	94,718	2027/7/25

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 2.75% 04/25/28	2.75	6,030	6,808	181,988	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	4,060	4,654	124,420	2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	3,480	3,925	104,929	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	4,900	5,504	147,131	2023/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	838	22,411	2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	3,150	3,551	94,944	2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	3,400	3,667	98,023	2021/10/25
小計				1,650,199	
(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 0.25% 11/21/24	0.25	1,800	1,790	127,757	2024/11/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	1,940	1,993	142,247	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	2,060	2,175	155,214	2031/6/21
ACGB 2% 12/21/21	2.0	1,930	1,981	141,406	2021/12/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	3,570	3,987	284,498	2028/5/21
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	4,050	4,249	303,199	2022/11/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,790	4,374	312,112	2030/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	4,200	4,595	327,888	2024/4/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	800	963	68,732	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	730	882	62,936	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	3,330	3,831	273,357	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	2,960	3,435	245,116	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	4,650	5,445	388,539	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	2,147	153,191	2047/3/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	3,480	3,960	282,569	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	4,100	4,950	353,219	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,320	1,699	121,283	2039/6/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	2,198	156,829	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	3,700	4,504	321,403	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,910	2,708	193,244	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	4,150	5,308	378,795	2027/4/21
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	2,820	3,245	231,541	2023/4/21
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	3,450	3,630	259,010	2021/5/15
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	3,350	3,738	266,721	2022/7/15
小計				5,550,816	
(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	1,440	1,459	110,766	2021/10/1
SIGB 1.75% 02/01/23	1.75	800	830	63,055	2023/2/1
SIGB 1.75% 04/01/22	1.75	290	297	22,614	2022/4/1
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	434	32,956	2024/2/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	740	808	61,362	2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	1,080	1,102	83,650	2021/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	510	592	44,994	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	320	349	26,547	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	260	312	23,727	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	1,050	1,204	91,390	2028/5/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	1,240	1,664	126,298	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	610	794	60,287	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	1,070	1,149	87,223	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	840	990	75,187	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	350	418	31,769	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	840	930	70,640	2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	640	680	51,674	2022/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	840	1,085	82,379	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	1,044	79,294	2027/3/1
小計				1,225,821	
(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	1,500	1,539	38,050	2022/8/15
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	700	728	18,002	2024/6/14
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	2,840	2,934	72,543	2023/3/15

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)	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,596	39,455	2027/5/31
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	1,240	1,268	31,364	2021/11/30
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,930	2,058	50,882	2028/6/15
MGS 3.757% 04/20/23	3.757	350	364	8,999	2023/4/20
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	1,500	1,554	38,415	2022/9/30
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	1,660	1,735	42,904	2023/8/17
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	2,350	2,505	61,944	2033/4/15
MGS 3.882% 03/10/22	3.882	750	772	19,106	2022/3/10
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,093	27,023	2025/3/14
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	730	794	19,638	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,216	30,072	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	2,127	52,580	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,440	1,546	38,240	2026/11/30
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,630	1,751	43,293	2025/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	2,050	2,102	51,985	2021/9/30
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,900	2,024	50,045	2024/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	430	469	11,606	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,030	2,077	51,353	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,280	1,366	33,770	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,000	2,224	54,983	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	810	892	22,052	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,440	2,676	66,170	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,410	1,598	39,524	2030/4/15
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,500	1,726	42,667	2033/11/7
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,480	1,696	41,937	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,280	2,667	65,932	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	800	952	23,535	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,050	1,253	30,987	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	2,550	3,004	74,273	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	1,480	1,738	42,972	2028/9/15
小計				1,336,319	
(イスラエル)		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
国債証券					
ILGOV 0.75% 07/31/22	0.75	6,750	6,841	209,430	2022/7/31
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	830	851	26,054	2030/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,160	2,437	74,622	2028/9/28
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	4,080	4,618	141,365	2024/3/31
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,100	3,028	92,701	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/22	5.5	3,160	3,446	105,492	2022/1/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	2,580	4,520	138,387	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	6,020	8,200	251,016	2026/10/30
小計				1,039,070	
合計				268,683,695	

(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	480	—
	US 5YR NOTE	970	—
	EURO-BOBL FU	723	—
	EURO-BUND	1,926	—
	US 10YR NOTE	685	—
	US LONG BOND	913	—

(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	268,683,695	97.3
コール・ローン等、その他	7,533,784	2.7
投資信託財産総額	276,217,479	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(271,471,612千円)の投資信託財産総額(276,217,479千円)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＝107.53円　1カナダドル＝78.01円　1メキシコペソ＝4.84円
1ユーロ＝119.13円　1イギリスポンド＝132.53円　1スウェーデンクローナ＝11.29円
1ノルウェークローネ＝10.99円　1デンマーククローネ＝15.98円　1ポーランドズロチ＝26.73円
1オーストラリアドル＝71.35円　1シンガポールドル＝75.89円　1マレーシアリンギット＝24.72円
1イスラエルシェケル＝30.61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 2020年5月29日現在
(A)資産	**282,057,087,912円**
コール・ローン等	5,286,374,371
公社債(評価額)	268,683,695,354
未収入金	5,895,453,132
未収利息	1,601,557,980
前払費用	116,375,539
差入委託証拠金	473,631,536
(B)負債	**5,888,038,235**
未払金	5,850,176,156
未払解約金	37,851,717
未払利息	10,362
(C)純資産総額(A-B)	**276,169,049,677**
元本	95,174,617,742
次期繰越損益金	180,994,431,935
(D)受益権総口数	**95,174,617,742口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**29,017円**

■損益の状況

項目	当期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配当等収益	**8,041,707,766円**
受取利息	8,044,189,823
その他収益金	887,085
支払利息	△3,369,142
(B)有価証券売買損益	**13,280,421,919**
売買益	25,274,222,739
売買損	△11,993,800,820
(C)先物取引等取引損益	**263,017,893**
取引益	423,218,651
取引損	△160,200,758
(D)その他費用	**△81,577,091**
(E)当期損益金(A+B+C+D)	**21,503,570,487**
(F)前期繰越損益金	**197,353,550,378**
(G)追加信託差損益金	**75,605,124,172**
(H)解約差損益金	**△113,467,813,102**
(I)計(E+F+G+H)	**180,994,431,935**
次期繰越損益金(I)	**180,994,431,935**

(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113,640,718,674円、期中追加設定元本額は42,174,376,204円、期中一部解約元本額は60,640,477,136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)	19,873,572,626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)	10,295,903,503円
DC世界経済インデックスファンド	8,528,398,689円
世界経済インデックスファンド	6,556,013,261円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	6,526,303,180円
分散投資コア戦略ファンドS	5,878,180,799円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,839,990,318円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,644,409,609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)	2,035,430,269円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,032,323,941円
DC外国債券インデックス・オープン	1,981,303,588円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,899,334,301円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,838,012,886円
DCマイセレクション25	1,746,900,933円
分散投資コア戦略ファンドA	1,682,389,528円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,628,152,766円
DCマイセレクション50	1,309,791,351円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,079,149,805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)	1,078,588,109円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	880,880,976円
DCマイセレクション75	856,087,937円
グローバル経済コア	829,346,492円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	793,356,695円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	757,156,667円
DCマイセレクションS25	753,679,277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)	629,005,017円
グローバル・インカム＆プラス(毎月決算型)	621,963,595円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	603,891,884円
外国債券ファンド・シリーズ1	595,715,463円
コア投資戦略ファンド(切替型)	563,477,235円
DCマイセレクションS50	562,810,231円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	528,598,205円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	516,019,773円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	427,119,141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)	371,138,216円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	343,917,935円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	310,526,987円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	269,285,780円
DCマイセレクションS75	246,010,270円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	226,064,461円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	218,715,325円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	215,169,333円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	196,839,948円
SMT インデックスバランス・オープン	176,493,195円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	174,087,573円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	128,500,127円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	123,269,428円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	104,319,529円
SMT 世界経済インデックス・オープン	94,303,097円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	94,170,491円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	80,388,850円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	68,835,591円

世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	67,132,176円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	64,952,663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)	45,851,842円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	43,994,786円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	33,385,290円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	31,538,927円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	30,899,426円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	19,162,672円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,826,090円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,920,823円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,454,903円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,876,546円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,681,478円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	204,525円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	178,101円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	102,047円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	83,321円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	77,940円

お知らせ

該当事項はありません。