

JP 4 資産均等バランス

運用報告書（全体版）

第 4 期（決算日 2021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。
「JP 4 資産均等バランス」は、2021年 7 月15日に第 4 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	追加型投資／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す。 ＜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	J P 4 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-KOKUSA1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-KOKUSA1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。			
	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。			
分 配 方 針				

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

J P 4 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)	61
------------------------------------	----

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)	96
---	----

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)	142
------------------------------------	-----

【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 (分配落)	価 額			参 考 指 数 期 騰 落 中 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額 総 額
		税 込 分	み 金	期 騰 落 中 率			
(設定日)	円	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
4期(2021年7月15日)	12,420	0	17.0	12,296	18.2	99.4	8,850

(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

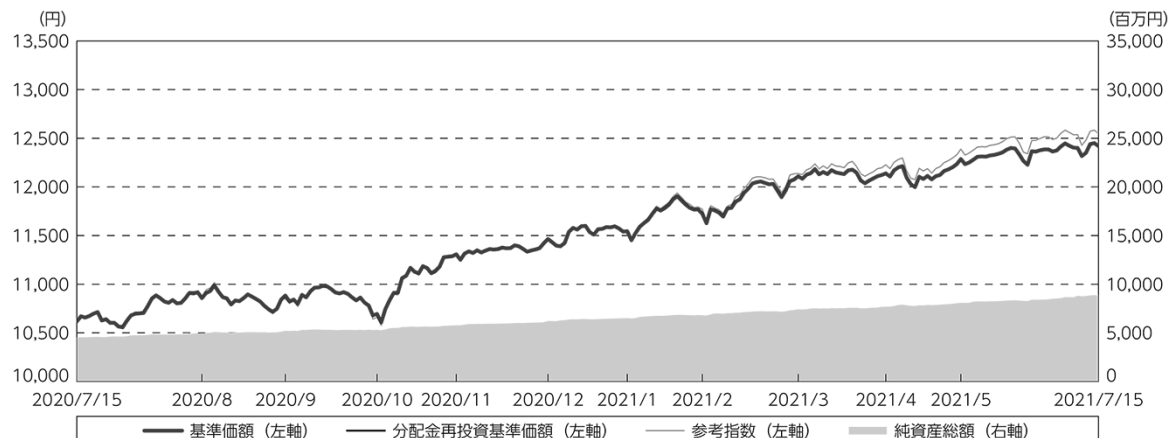
年 月 日	基 準	価 額		参 考 指 数	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首)	円	%	%	%	%
2020年7月15日	10,617	—	10,403	—	99.4
7月末	10,565	△ 0.5	10,356	△ 0.4	99.2
8月末	10,857	2.3	10,655	2.4	99.0
9月末	10,883	2.5	10,633	2.2	97.8
10月末	10,694	0.7	10,444	0.4	99.0
11月末	11,307	6.5	11,063	6.3	99.2
12月末	11,464	8.0	11,227	7.9	97.8
2021年1月末	11,544	8.7	11,318	8.8	99.2
2月末	11,724	10.4	11,534	10.9	99.2
3月末	12,109	14.1	11,892	14.3	98.7
4月末	12,139	14.3	11,980	15.2	99.2
5月末	12,286	15.7	12,138	16.7	99.2
6月末	12,364	16.5	12,235	17.6	98.5
(期 末)					
2021年7月15日	12,420	17.0	12,296	18.2	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2020年7月16日～2021年7月15日)

期中の基準価額等の推移



期 首：10,617円

期 末：12,420円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 17.0% (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(2020年7月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,617円から期末12,420円となり、値上がり額は1,803円となりました。

投資対象とする4本の組入投資信託証券の当期間の値動きは、海外株式、日本株式、海外債券、日本債券とも上昇しました。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低下（価格が上昇）しました。2020年7月中旬から12月中旬にかけては、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展期待などから投資家のリスク選好が強まり、相対的に安全資産とされる国債が売られる局面もあった一方、国内外の新型コロナウイルスの感染再拡大によって経済への悪影響が懸念されたことなどから、国債の買いが優勢となる局面もあり、一進一退の展開となりました。その後2021年2月下旬にかけては、米追加経済対策の成立観測による国債増発懸念やワクチン普及による景気回復期待などから米長期金利が上昇し、日本国債の売りに波及しました。3月上旬から7月中旬にかけては、日銀の黒田総裁が長期金利の変動幅拡大を否定する姿勢を示したことや、4月の国内の感染再拡大を受けて4都府県に緊急事態宣言が発出され、経済活動停滞への警戒感が高まったことなどから国債の買い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。2020年7月中旬から10月下旬にかけては、国内外での経済活動の再開や新型コロナウイルスのワクチン開発の進展報道が好感される一方、企業業績の悪化や国内外での新型コロナウイルスの感染再拡大が嫌気される場面もあり、一進一退の展開となりました。11月上旬から2021年3月中旬にかけては、米大統領選挙を民主党のバイデン氏の勝利で終え米政治の不透明感が後退したことや、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展を受けて世界経済の回復期待が高まったことから、投資家のリスク選好が強まり大きく上昇しました。3月下旬以降は、4月に国内の緊急事態宣言が再び発出されたことを受け経済活動停滞への警戒感が高まったことから下落する局面もあった一方、国内のワクチン接種が加速し経済正常化への期待が高まり上昇する局面もあり、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上昇（価格が低下）しました。2020年7月中旬から2021年1月下旬にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融緩和の長期化観測や新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて国債が買われる場面もあったものの、新型コロナウイルスのワクチン開発が進展し経済正常化期待が高まったことや、米バイデン新大統領による大規模な財政出動観測などを受けて国債の売りが優勢となりました。2月から3月にかけては、米国でワクチン接種が進展し経済正常化期待が高まったことなどから利回りの上昇は加速しました。4月以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）で将来的な金融政策正常化の方針が示され、早期利上げへの警戒感から売られる場面もありましたが、米国のインフレは一時的との見方が優勢となったことや、変異株による感染再拡大によって景気回復が遅れるとの見方が台頭したことなどから国債の買いが優勢となりました。
海外株式市場	期を通じて、海外株式市場は上昇しました。2020年7月中旬から10月下旬にかけては、好決算を発表した大型ハイテク株を中心に買われたことから上昇する一方、欧州を中心に新型コロナウイルスの感染が再拡大し、景気回復の遅れが懸念され下落する場面もあり、一進一退の展開となりました。11月から2021年1月にかけては、米大統領選挙を民主党のバイデン氏の勝利で終え米政治の不透明感が後退したことや、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展によって将来の世界経済に対する正常化期待が高まったことなどを受けて大きく上昇しました。2月以降は、米長期金利の急上昇や、米国でのインフレ懸念の台頭などにより投資家のリスク回避姿勢が強まり下落する局面もありましたが、欧米を中心にワクチン接種が進展し経済活動の正常化が加速したことや、米国で追加経済対策やインフラ投資計画などの大規模な財政政策への期待が高まったことなどから上昇を続けました。

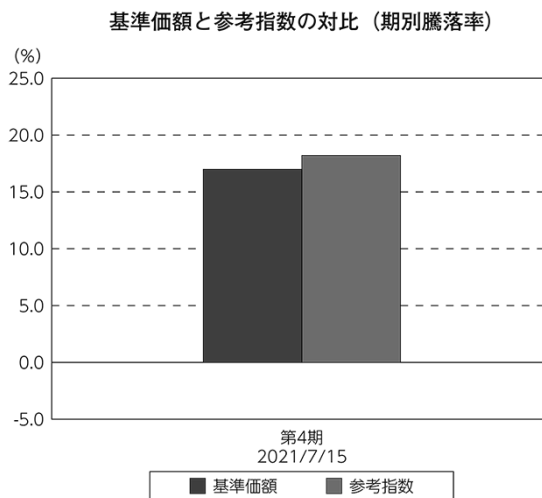
当ファンドのポートフォリオ

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、当ファンドにおける日々の追加設定解約に対応した投資信託証券の売買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。



（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。

〇分配原資の内訳

（単位：円、1 万口当たり・税込み）

項 目	第 4 期
	2020年 7 月 16 日～ 2021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	2,420

（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

(2020年7月16日～2021年7月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 12	% 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)	(5)	(0.043)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.043)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	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	1	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)	(1)	(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	13	0.111	
期中の平均基準価額は、11,494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。

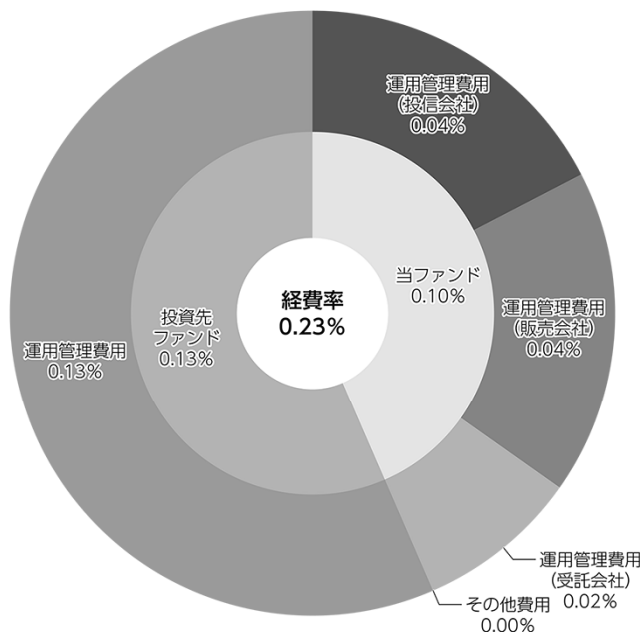
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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

(2020年7月16日～2021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
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)	352, 592, 817	579, 340	41, 182, 095	64, 960
	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)	1, 102, 404, 927	1, 099, 924	6, 130, 471	6, 100
	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)	634, 222, 943	830, 190	66, 398, 032	85, 200
	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)	1, 058, 629, 609	1, 034, 160	1, 914, 165	1, 900
合 計		3, 147, 850, 296	3, 543, 614	115, 624, 763	158, 160

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月16日～2021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 (2020年7月16日～2021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

(2020年7月16日～2021年7月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021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)		789, 767, 760	1, 101, 178, 482	2, 187, 821	24. 7
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)		1, 113, 108, 557	2, 209, 383, 013	2, 207, 394	24. 9
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)		1, 005, 061, 523	1, 572, 886, 434	2, 216, 354	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)		1, 149, 850, 899	2, 206, 566, 343	2, 183, 838	24. 7
合 計		4, 057, 788, 739	7, 090, 014, 272	8, 795, 408	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

(2021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	8,795,408	99.2
コール・ローン等、その他	72,874	0.8
投資信託財産総額	8,868,282	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 (2021年7月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,868,282,118
コール・ローン等	69,773,159
投資信託受益証券(評価額)	8,795,408,959
未収入金	3,100,000
(B) 負債	17,360,266
未払解約金	13,083,294
未払信託報酬	3,994,448
未払利息	191
その他未払費用	282,333
(C) 純資産総額(A－B)	8,850,921,852
元本	7,126,115,753
次期繰越損益金	1,724,806,099
(D) 受益権総口数	7,126,115,753口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,420円

(注) 当ファンドの期首元本額は4,258,642,053円、期中追加設定元本額は3,479,724,208円、期中一部解約元本額は612,250,508円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.2420円です。

○損益の状況 (2020年7月16日～2021年7月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	90,386,898
受取配当金	90,449,171
支払利息	△ 62,273
(B) 有価証券売買損益	872,922,305
売買益	917,497,538
売買損	△ 44,575,233
(C) 信託報酬等	△ 7,166,981
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	956,142,222
(E) 前期繰越損益金	152,753,975
(F) 追加信託差損益金	615,909,902
(配当等相当額)	(418,981,366)
(売買損益相当額)	(196,928,536)
(G) 計(D＋E＋F)	1,724,806,099
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	1,724,806,099
追加信託差損益金	615,909,902
(配当等相当額)	(418,981,366)
(売買損益相当額)	(196,928,536)
分配準備積立金	1,108,896,197

(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(2020年7月16日～2021年7月15日)は以下の通りです。

項 目	2020年7月16日～ 2021年7月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	89,714,635円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	866,427,587円
c. 信託約款に定める収益調整金	615,909,902円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	152,753,975円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,724,806,099円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,420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

2020年7月16日から2021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 J P 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 J P 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29期 (決算日 2021年3月8日)
第30期 (決算日 2021年5月7日)
第31期 (決算日 2021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。)

【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			
第7	第17期(2019年 3月7日)	円 11,492	円 5	% 5.9	11,389	% 5.9	% 98.7	% 1.3	百万円 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
第10	第26期(2020年 9月7日)	11,553	1	2.4	11,447	2.4	99.1	0.8	75,893
	第27期(2020年11月9日)	12,076	97	5.4	11,960	4.5	98.9	1.6	78,219
	第28期(2021年 1月7日)	13,112	17	8.7	12,987	8.6	99.3	0.7	80,449
第11	第29期(2021年 3月8日)	13,592	5	3.7	13,465	3.7	99.4	0.6	77,897
	第30期(2021年 5月7日)	13,876	121	3.0	13,746	2.1	99.2	1.4	78,715
	第31期(2021年 7月7日)	13,908	22	0.4	13,779	0.2	99.3	0.8	79,538

(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		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
			騰落率		騰落率		
第29期	(期 首)2021年1月7日	円 13,112	% —	12,987	% —	% 99.3	% 0.7
	1月末	12,986	△1.0	12,862	△1.0	99.0	0.8
	2月末	13,388	2.1	13,258	2.1	99.4	0.6
	(期 末)2021年3月8日	13,597	3.7	13,465	3.7	99.4	0.6
第30期	(期 首)2021年3月8日	13,592	—	13,465	—	99.4	0.6
	3月末	14,145	4.1	13,895	3.2	98.3	1.6
	4月末	13,744	1.1	13,498	0.2	98.4	1.5
	(期 末)2021年5月7日	13,997	3.0	13,746	2.1	99.2	1.4
第31期	(期 首)2021年5月7日	13,876	—	13,746	—	99.2	1.4
	5月末	13,811	△0.5	13,674	△0.5	98.5	1.5
	6月末	13,973	0.7	13,821	0.5	99.0	0.9
	(期 末)2021年7月7日	13,930	0.4	13,779	0.2	99.3	0.8

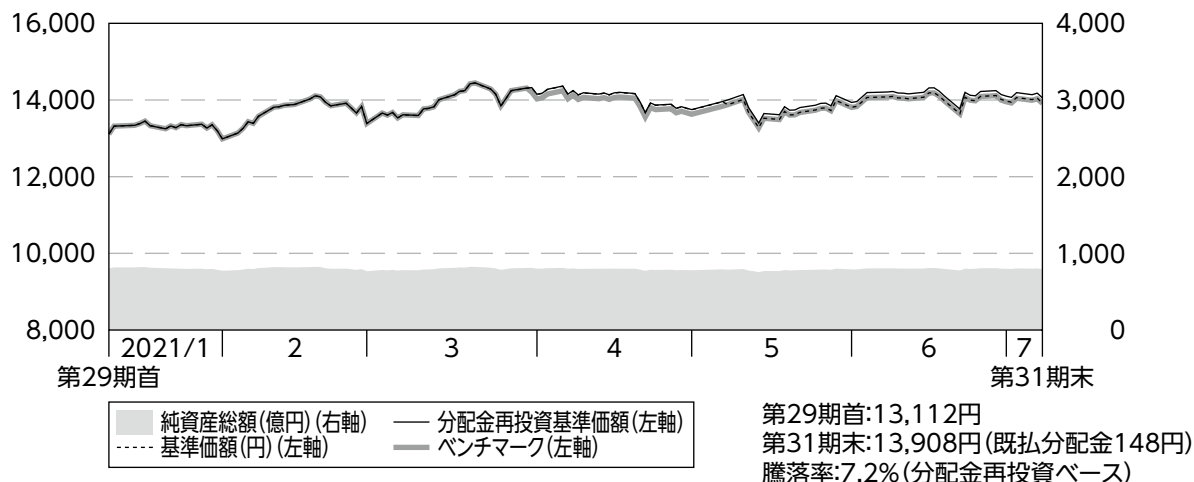
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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



- (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、2021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上昇しました。

投資環境



国内株式市場は、米国における追加経済対策が好感されたこと、国内の企業業績の回復が確認されたこと、新型コロナウイルスワクチン接種開始による経済活動正常化への期待感などから、3月中旬までは上昇基調で推移しました。その後は、新型コロナウイルス新規感染者数の増加による緊急事態宣言の発令や、新型コロナウイルス変異株への警戒感などから下落する場面もありましたが、国内のワクチン接種進展への期待が下支えとなりました。

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。

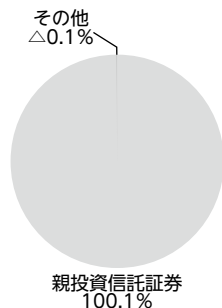
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

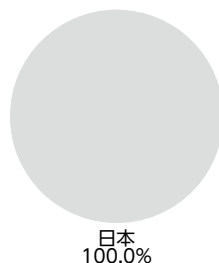
	当作成期末
	2021年7月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

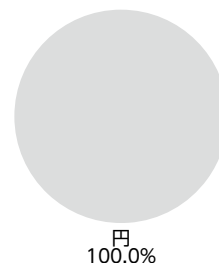
○資産別配分



○国別配分



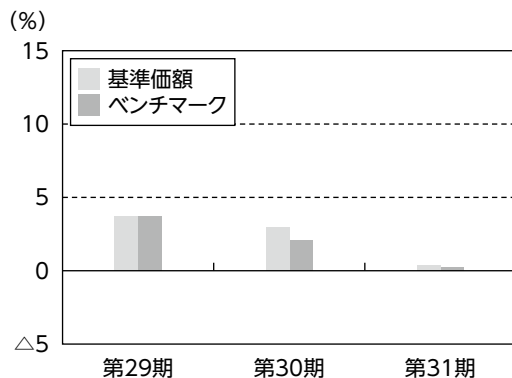
○通貨別配分



(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す。

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29期	第30期	第31期
	2021年1月8日～ 2021年3月8日	2021年3月9日～ 2021年5月7日	2021年5月8日～ 2021年7月7日
当期分配金 (円)	5	121	22
(対基準価額比率) (%)	(0.037)	(0.864)	(0.158)
当期の収益 (円)	5	121	22
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	5,576	5,858	5,891

(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		項目の概要
	(2021年1月8日～2021年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	8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13,674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。 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 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(6)	(0.044)	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.011)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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
(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	－	－	
(株式)	(－)	(－)	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(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	
(保管費用)	(－)	(－)	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(－)	(－)	
合計	8	0.062	

(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
国内株式インデックス マザーファンド	千口 1,030,997	千円 1,898,883	千口 4,636,332	千円 8,496,294

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	146,628,338千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	440,264,539千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.33

(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			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
金 銭 信 託	百万円 0.013142	百万円 0.013142	% 100.0	百万円 0.013142	百万円 0.013142	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	13,925	200	1.4	13,931	200	1.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期			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
金 銭 信 託	百万円 0.159183	百万円 0.159183	% 100.0	百万円 0.159183	百万円 0.159183	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	386,840	3,710	1.0	385,906	3,710	1.0

<平均保有割合 17.5%>

(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	250百万円	77百万円	1,160百万円

(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	46,155,583	42,550,248	79,624,280

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、250,824,891千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式インデックス マザーファンド	千円 79,624,280	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	62,541	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	79,686,821	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 29 期 末 2021年3月8日現在	第 30 期 末 2021年5月7日現在	第 31 期 末 2021年7月7日現在
(A) 資 産	77,988,074,964円	79,417,840,743円	79,686,821,962円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	54,437,980	55,762,405	62,157,455
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	77,886,833,092	79,362,078,338	79,624,280,096
未 収 入 金	46,803,892	—	384,411
(B) 負 債	90,883,230	702,564,516	148,180,102
未 払 収 益 分 配 金	28,655,969	686,383,734	125,815,037
未 払 解 約 金	45,999,999	—	6,000,000
未 払 信 託 報 酬	15,910,833	15,864,562	16,043,910
未 払 利 息	37	39	97
そ の 他 未 払 費 用	316,392	316,181	321,058
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	77,897,191,734	78,715,276,227	79,538,641,860
元 本	57,311,939,422	56,725,928,455	57,188,653,261
次 期 繰 越 損 益 金	20,585,252,312	21,989,347,772	22,349,988,599
(D) 受 益 権 総 口 数	57,311,939,422口	56,725,928,455口	57,188,653,261口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	13,592円	13,876円	13,908円

■損益の状況

項 目	第 29 期 自 2021年1月8日 至 2021年3月8日	第 30 期 自 2021年3月9日 至 2021年5月7日	第 31 期 自 2021年5月8日 至 2021年7月7日
(A) 配 当 等 収 益	△7,059円	△2,919円	△4,456円
受 取 利 息	14	—	—
支 払 利 息	△7,073	△2,919	△4,456
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,788,879,185	2,302,542,101	332,975,844
売 買 益	3,000,558,895	2,375,934,369	346,101,698
売 買 損	△211,679,710	△73,392,268	△13,125,854
(C) 信 託 報 酬 等	△16,227,225	△16,180,743	△16,364,968
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	2,772,644,901	2,286,358,439	316,606,420
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	8,797,275,543	11,334,633,757	12,850,575,132
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,043,987,837	9,054,739,310	9,308,622,084
(配 当 等 相 当 額)	(20,416,772,598)	(20,296,639,150)	(20,652,463,451)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△11,372,784,761)	(△11,241,899,840)	(△11,343,841,367)
(G) 計 (D+E+F)	20,613,908,281	22,675,731,506	22,475,803,636
(H) 収 益 分 配 金	△28,655,969	△686,383,734	△125,815,037
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	20,585,252,312	21,989,347,772	22,349,988,599
追 加 信 託 差 損 益 金	9,043,987,837	9,054,739,310	9,308,622,084
(配 当 等 相 当 額)	(20,416,776,677)	(20,297,359,013)	(20,652,652,774)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△11,372,788,840)	(△11,242,619,703)	(△11,344,030,690)
分 配 準 備 積 立 金	11,541,264,475	12,934,608,462	13,041,366,515

(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29期首元本額は61,355,519,437円、第29～31期中追加設定元本額は1,479,531,761円、第29～31期中一部解約元本額は5,646,397,937円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 29 期	第 30 期	第 31 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	30,758,636円	714,671,893円	126,689,580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)	2,741,886,265円	1,571,686,546円	189,916,840円
(C) 収益調整金額	20,416,776,677円	20,297,359,013円	20,652,652,774円
(D) 分配準備積立金額	8,797,275,543円	11,334,633,757円	12,850,575,132円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	31,986,697,121円	33,918,351,209円	33,819,834,326円
(F) 期末残存口数	57,311,939,422口	56,725,928,455口	57,188,653,261口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	5,581円	5,979円	5,913円
(H) 分配金額(1万口当たり)	5円	121円	22円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	28,655,969円	686,383,734円	125,815,037円

分配金のお知らせ

	第29期	第30期	第31期
1万口当たり分配金	5円	121円	22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21期（決算日 2021年5月31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上げます。

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、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、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 先 物 率 純 資 産 額	株 式 先 物 率 比	株 式 先 物 率 比
	期 騰 落 率	中 騰 落 率	期 騰 落 率	中 騰 落 率			
第17期(2017年5月29日)	円	%		%	%	%	百万円
	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
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	1.5	462,835

(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 先 物 率 比	株 式 先 物 率 比
	騰 落 率	中 騰 落 率	騰 落 率	中 騰 落 率		
(当 期 首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%
	14,762	—	1,563.67	—	97.0	1.7
6月末	14,738	△0.2	1,558.77	△0.3	98.7	1.2
7月末	14,145	△4.2	1,496.06	△4.3	98.8	1.3
8月末	15,300	3.6	1,618.18	3.5	99.0	1.0
9月末	15,498	5.0	1,625.49	4.0	98.2	1.7
10月末	15,059	2.0	1,579.33	1.0	98.4	1.6
11月末	16,740	13.4	1,754.92	12.2	98.1	1.3
12月末	17,238	16.8	1,804.68	15.4	99.2	0.8
2021年 1月末	17,277	17.0	1,808.78	15.7	99.0	0.8
2月末	17,815	20.7	1,864.49	19.2	99.4	0.6
3月末	18,831	27.6	1,954.00	25.0	98.4	1.6
4月末	18,299	24.0	1,898.24	21.4	98.5	1.5
(当 期 末) 2021年 5月31日	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	1.5

(注1)騰落率は期首比です。

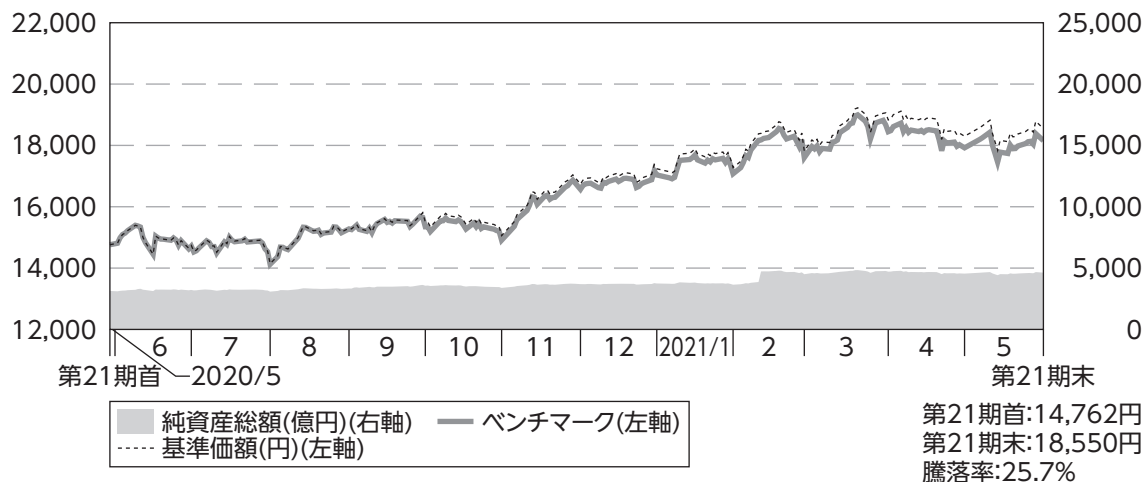
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

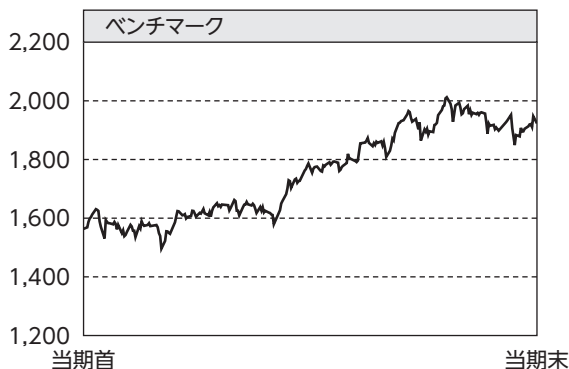


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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



国内株式市場は、世界的な経済活動の再開や新型コロナウイルスワクチンの開発進展が期待される一方、欧米の新型コロナウイルス感染拡大などが重石となり、2020年10月までは一進一退の展開となりました。2020年11月に、米国大統領選挙を通過し米国政治の先行き不透明感が後退したことなどから上昇し、その後も、米国の追加経済対策や各国の新型コロナウイルスワクチンの普及、国内企業業績の回復などが好感され、上昇しました。期末にかけては、国内での新型コロナウイルスワクチンの接種進展が期待されたものの、新型コロナウイルス新規感染者数の増加による緊急事態宣言の発令などが重石となり、上値の重い展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークである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

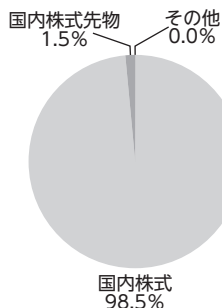
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.4%
2	ソニーグループ	日本	2.5%
3	ソフトバンクグループ	日本	2.4%
4	キーエンス	日本	2.0%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.6%
6	東証株価指数先物 2106	日本	1.5%

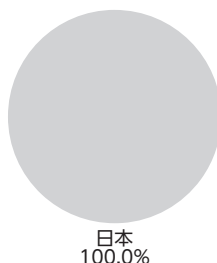
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	任天堂	日本	1.4%
8	リクルートホールディングス	日本	1.4%
9	信越化学工業	日本	1.3%
10	日本電信電話	日本	1.3%
組入銘柄数		2,115	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

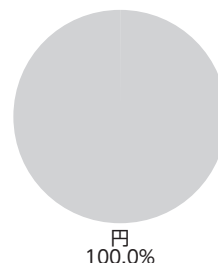
○資産別配分



○国別配分



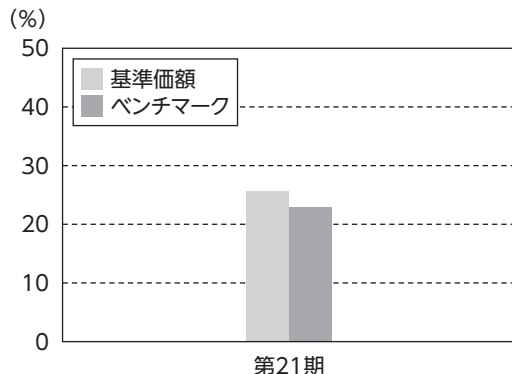
○通貨別配分



(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1.5%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		項目の概要
	(2020年5月30日～2021年5月31日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (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円 (0) (－) (－) (－) (－) (－) (0)	0.002% (0.002) (－) (－) (－) (－) (－) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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
(b) 有価証券取引税 (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)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (－) (－) (0)	0.000 (－) (－) (0.000)	(c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.002	

(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(16,308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
国内	上 場	千株 67,361 (△15,660)	千円 155,537,538 (－)	千株 32,910	千円 77,484,980

(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
国内	内	証券 －	千円 －	証券 － (38,100)	千円 － (－)

(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
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 48,757	百万円 48,214	百万円 －	百万円 －

(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	233, 022, 518千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	378, 599, 957千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 61

(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
金 銭 信 託	百万円 13	百万円 13	% 100. 0	百万円 735	百万円 735	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	833, 187	39, 349	4. 7	831, 052	39, 349	4. 7

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人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	370百万円	153百万円	1, 214百万円

(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	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	6.6	7.6	22,009
日本水産	188	217.9	110,475
マルハニチロ	27.2	36.7	87,896
雪国まいたけ	—	19.3	33,253
カネコ種苗	5.7	7.1	10,479
サカタのタネ	22.4	28	104,020
ホクト	14.3	19.7	38,080
ホクリョウ	2.9	3.6	2,761
鉱業(0.2%)			
住石ホールディングス	38	41.1	5,301
日鉄鉱業	4.3	5.4	33,750
三井松島ホールディングス	7.3	9.8	9,300
I N P E X	754.3	862.8	649,688
石油資源開発	24.6	30.7	60,540
K&Oエナジーグループ	9.1	11.4	15,504
建設業(2.3%)			
ヒノキヤグループ	4.7	5.8	14,494
ショーボンドホールディングス	29.3	33.5	153,262
ミライト・ホールディングス	55.9	81.3	156,909
タマホーム	10.1	14.2	29,876
サンヨーホームズ	1.6	2.7	1,930
日本アクア	7.5	9.3	5,003
ファーストコーポレーション	5.7	7.2	5,407
ベステラ	3.2	4.5	7,110
R o b o t H o m e	38.8	44	11,484
キャンディル	3.1	4	2,168
スペースバリューホールディングス	22.9	28.6	20,963
ダイセキ環境ソリューション	3.6	4.5	4,306
第一カッター興業	2.3	5.8	7,888
明豊ファシリティワークス	6	—	—
安藤・間	112	150.4	123,177
東急建設	55.1	68.7	48,227
コムシスホールディングス	66.7	83.2	257,088
ビーアールホールディングス	20.5	31.4	15,825
高松コンストラクショングループ	11.7	14.6	29,900
東建コーポレーション	5.8	7.2	68,688
ソネック	1.9	2.4	2,188
ヤマウラ	8.2	10.2	9,241
オリエンタル白石	—	78.9	22,013
大成建設	144.8	168.6	644,052

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
大林組	434.2	541.8	499,539
清水建設	440.7	507.5	455,227
飛鳥建設	12.5	15.5	16,430
長谷工コーポレーション	168.1	177.5	272,462
松井建設	17.1	21.3	15,698
銭高組	1.9	2.4	10,512
鹿島建設	340.9	397	601,455
不動テトラ	11.3	13.3	23,846
大末建設	5	6.8	6,738
鉄建建設	9.4	10.9	20,110
西松建設	33.5	38.8	130,368
三井住友建設	104.9	130.9	61,261
大豊建設	9.7	11.9	48,433
前田建設工業	108.8	135.7	129,593
佐田建設	9.3	12.5	5,787
ナカノフドー建設	11.9	13	5,226
奥村組	23.6	29.8	85,287
東鉄工業	18.6	23.2	54,682
イチケン	3.1	3.9	7,101
富士ビー・エス	6.4	7	3,829
浅沼組	4.9	6.5	29,152
戸田建設	180.3	225	174,825
熊谷組	20.1	25.1	74,672
北野建設	2.6	3.3	7,837
植木組	1.9	4.8	7,123
矢作建設工業	19.2	23.9	16,849
ピーエス三菱	14.3	17.8	11,587
日本ハウスホールディングス	29.6	37	12,654
大東建託	47.4	59.1	680,832
新日本建設	18.5	23	19,619
N I P P O	35.9	44.8	127,097
東亜道路工業	2.7	3.4	15,385
前田道路	38.3	33.5	72,058
日本道路	4.2	5.2	39,104
東亜建設工業	13.5	14.5	35,612
日本国土開発	42.2	52.7	29,722
若築建設	7.8	9.7	13,308
東洋建設	48.7	60.7	33,992
五洋建設	172.1	230.1	177,867
世紀東急工業	20.8	26	21,866
福田組	5	6.3	31,563

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
住友林業	110	127.4	282,318	
日本基礎技術	14.6	16.5	8,316	
巴コーポレーション	19.3	24.1	9,399	
大和ハウス工業	429.6	500.3	1,603,961	
ライト工業	24.8	31	56,327	
積水ハウス	470.9	587.6	1,338,552	
日特建設	11.3	14.1	10,701	
北陸電気工事	7.5	9.4	11,223	
ユアテック	24.8	31	22,785	
日本リーテック	9.1	11.3	18,317	
四電工	2.4	2.9	9,845	
中電工	17.5	24.9	57,992	
関電工	61.8	88.1	79,818	
きんでん	103.2	110	202,510	
東京エネシス	14.4	18	17,280	
トーエネック	4.4	5.4	19,953	
住友電設	12.3	15.3	34,914	
日本電設工業	23.8	29.7	53,133	
協和エクシオ	65.8	82.1	220,849	
新日本空調	11.5	14.3	29,086	
九電工	30.5	38	128,630	
三機工業	31.3	38.4	53,145	
日揮ホールディングス	133.7	180.7	188,650	
中外炉工業	4.7	5.9	12,266	
ヤマト	13.9	17.3	13,511	
太平電業	10.5	12	31,860	
高砂熱学工業	37.7	49	88,102	
三晃金属工業	1.9	2.1	5,031	
朝日工業社	2.9	4	11,848	
明星工業	28.1	35	25,935	
大気社	21.1	26.3	82,845	
ダイダン	10.4	12	31,980	
日比谷総合設備	14	17.4	31,581	
フィル・カンパニー	2.5	3.1	9,216	
テスホールディングス	—	9.9	17,295	
OSJBホールディングス	68.5	—	—	
東洋エンジニアリング	18.2	22.8	15,572	
レイズネクスト	23.3	29.1	33,726	
食料品(3.4%)				
ニッポン	40.7	50.7	78,838	
日清製粉グループ本社	157	195.9	322,059	
日東富士製粉	1	1.3	9,334	
昭和産業	12.8	14.6	43,420	
鳥越製粉	12.3	15.4	12,427	
中部飼料	17	21.2	25,122	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
フィード・ワン	93.3	23.3	17,638	
東洋精糖	2.3	2.9	3,445	
日本甜菜製糖	7.2	9	14,544	
DM三井製糖ホールディングス	12.2	13.7	24,906	
塩水港精糖	15	20.7	4,657	
日新製糖	6.6	8.2	14,046	
森永製菓	32.6	40.7	137,566	
中村屋	3.6	4.2	15,918	
江崎グリコ	41.2	47.7	199,386	
名糖産業	6.7	7.6	11,597	
井村屋グループ	7.9	9.8	22,971	
不二家	7.8	11.1	23,343	
山崎製パン	104.2	130	212,940	
第一屋製パン	2.4	3.3	3,138	
モロゾフ	2.4	2.8	14,840	
亀田製菓	7.9	9.9	44,055	
寿スビリッツ	13.4	16.7	116,065	
カルビー	63.3	79	199,475	
森永乳業	25.7	32.1	181,686	
六甲バター	9.2	11.5	17,549	
ヤクルト本社	95.6	119.3	705,063	
明治ホールディングス	91.9	114.7	779,960	
雪印メグミルク	33.5	41.7	87,695	
プリマハム	21.7	24.4	73,322	
日本ハム	53.1	66.3	290,062	
林兼産業	4.6	5.7	3,482	
丸大食品	14.8	17.1	28,591	
S F o o d s	11.1	15.6	50,154	
柿安本店	4.8	6	14,922	
伊藤ハム米久ホールディングス	89.5	111.6	79,124	
サッポロホールディングス	47.4	59.2	127,102	
アサヒグループホールディングス	291	378.8	1,976,957	
キリンホールディングス	589.4	735.4	1,626,337	
宝ホールディングス	103	128.5	186,325	
オエノンホールディングス	36.7	49.3	18,586	
養命酒製造	4.3	5.3	9,439	
コカ・コーラ ボトラーズ	97.5	132.8	239,571	
ジャパンホールディングス	93	116	468,060	
サントリー食品インターナショナル	7.1	9.8	48,412	
ダイドーグループホールディングス	42.2	52.6	318,756	
伊藤園	13.7	17	35,258	
キーコーヒー	3.6	5.2	5,189	
ユニカフェ	2	2.5	3,025	
ジャパンフーズ	17.9	22.2	66,555	
日清オイリオグループ				

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
不二製油グループ本社	33.9	42.3	116,621	
かどや製油	1.5	1.9	7,742	
J-オイルミルズ	7.2	16.2	30,213	
キッコーマン	100	124.8	887,328	
味の素	306.9	412.4	1,037,598	
ブルドックソース	—	7.9	18,004	
キュービー	77.4	96.5	241,732	
ハウス食品グループ本社	52	64.8	207,360	
カゴメ	52.7	70.9	205,964	
焼津水産化学工業	6.7	8.4	8,148	
アリアケジャパン	12.7	15.8	100,804	
ビエトロ	1.8	2.3	3,829	
エバラ食品工業	3.4	3.8	9,458	
やまみ	1.2	1.9	3,876	
ニチレイ	66.2	82.6	232,353	
東洋水産	71.5	89.2	391,588	
イトアンドホールディングス	4.8	6	11,178	
大冷	1.8	1.9	3,705	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7.7	9.7	7,449	
日清食品ホールディングス	59.1	68	539,240	
永谷園ホールディングス	6.8	8.5	18,504	
一正蒲鉾	5.4	6.7	6,338	
フジッコ	15	18.8	35,889	
ロック・フィールド	15	18.7	29,359	
日本たばこ産業	802.4	929.7	2,010,476	
ケンコーマヨネーズ	7.8	10.6	17,702	
わらべや日洋ホールディングス	9.1	11.3	21,549	
なとり	7.8	9.7	18,168	
イフジ産業	2.4	2.7	2,459	
ビックスコーポレーション	3	4.1	12,730	
ファーマフーズ	—	16.4	51,742	
北の達人コーポレーション	48.5	60.5	28,798	
ユウグレナ	59.9	88.3	72,847	
紀文食品	—	10.1	16,442	
ミヨシ油脂	5.3	6.1	7,551	
理研ビタミン	13.1	16.4	23,616	
繊維製品 (0.5%)				
片倉工業	20.1	23	35,167	
グンゼ	10.1	12.5	54,562	
東洋紡	53.9	67.2	90,854	
ユニチカ	41	50.9	18,324	
富士紡ホールディングス	6.7	8.3	33,449	
倉敷紡績	13.7	15.9	28,953	
シキボウ	7.1	9.5	8,844	
日本毛織	45.1	56.2	53,109	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
トーア紡コーポレーション	5.4	6.7	3,061	
帝国繊維	15.5	19.3	39,159	
帝人	110.9	159.5	281,836	
東レ	982.7	1,225.8	871,053	
サカイオーベックス	3.8	4.6	13,606	
住江織物	3	3.7	7,030	
日本フェルト	8.6	10.7	4,825	
イチカワ	2.3	2.6	3,562	
日東製網	1.6	1.8	2,750	
アツギ	11.3	13.3	8,272	
ダイニック	5.1	6.4	5,024	
セーレン	33.7	41.8	84,895	
ソトー	5.5	7	5,579	
東海染工	2	2.3	2,589	
小松マテーレ	22.4	28	25,452	
ワコールホールディングス	35.4	42.3	105,750	
ホギメディカル	15.5	22.9	75,455	
クラウドピアホールディングス	3.6	—	—	
T S I ホールディングス	45.7	52.1	15,734	
マツオカコーポレーション	3.9	5.5	9,564	
ワールド	19.3	22.3	30,818	
三陽商会	7.2	8.8	7,999	
ナイガイ	5.2	6.8	2,216	
オンワードホールディングス	81.7	102.4	30,515	
ルックホールディングス	4.7	5.9	8,643	
ゴールドウイン	24.6	28	169,400	
デサント	26.5	29	55,187	
キング	6.6	9.4	4,784	
ヤマトインターナショナル	12.2	15.5	5,192	
パルプ・紙 (0.2%)				
特種東海製紙	8.6	10.4	45,032	
王子ホールディングス	566.9	761.7	494,343	
日本製紙	60	74.8	96,641	
三菱製紙	15.4	24	8,616	
北越コーポレーション	80.8	121	71,390	
中越パルプ工業	5.7	6.4	7,667	
巴川製紙所	4	5.6	4,457	
大王製紙	59.8	81.6	137,659	
阿波製紙	3.5	4.4	1,874	
レンゴー	128.2	174.5	160,191	
トーモク	8.3	10.4	19,916	
ザ・バック	10.3	12.8	35,136	
化学 (7.4%)				
クラレ	213.6	266.5	302,744	
旭化成	898.8	1,121.5	1,351,407	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
共和レザー	7.4	9.2	6,449	
昭和電工	96.5	128.5	437,542	
住友化学	996.3	1,331.9	799,140	
住友精化	6	8.2	28,905	
日産化学	75.3	93.3	529,011	
ラサ工業	4.8	5.5	10,356	
クレハ	11.6	14.5	92,365	
多木化学	5.3	6.6	35,970	
テイカ	9.9	12.4	15,165	
石原産業	24.3	30.3	28,845	
片倉コープアグリ	3.5	4.4	5,442	
日本曹達	20.1	23.6	79,060	
東ソー	209.6	261.5	500,249	
トクヤマ	39.1	50.3	115,388	
セントラル硝子	27.7	32.3	67,539	
東亜合成	85.1	103.2	122,188	
大阪ソーダ	13.8	17.2	42,380	
関東電化工業	32.2	40.1	38,816	
デンカ	49.5	61.7	250,502	
信越化学工業	232.8	312.9	5,899,729	
日本カーバイド工業	4.6	6.2	7,960	
堺化学工業	8.8	11.9	21,253	
第一稀元素化学工業	14.7	17	25,891	
エア・ウォーター	126.1	172.5	316,020	
日本酸素ホールディングス	130.3	139.4	301,104	
日本化学工業	4.2	4.8	13,147	
東邦アセチレン	2	2.5	3,005	
日本バーカライジング	68.4	85.4	93,256	
高压ガス工業	21.5	26.8	17,607	
チタン工業	1.7	2.1	3,979	
四国化成工業	20.9	22.5	27,652	
戸田工業	3.1	3.6	8,280	
ステラ ケミファ	7.4	9.2	26,716	
保土谷化学工業	5.1	5	19,925	
日本触媒	21	30.6	169,830	
大日精化工業	12	14	32,228	
カネカ	35.1	43.8	195,567	
三菱瓦斯化学	126.2	169.5	432,733	
三井化学	123.1	146.1	536,187	
J S R	126.4	169.8	547,605	
東京応化工業	23.3	29	196,620	
大阪有機化学工業	12.5	15.6	63,492	
三菱ケミカルホールディングス	906.5	1,131.1	990,391	
KHネオケム	23.9	27.9	78,287	
ダイセル	176.6	227.5	198,152	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
住友ベークライト	21.3	26.6	118,237	
積水化学工業	291.6	357.8	667,297	
日本ゼオン	122.3	152.6	245,228	
アイカ工業	40.7	47.1	183,454	
宇部興産	68.5	85.4	196,761	
積水樹脂	24.4	27.9	57,836	
タキロンシーアイ	29.3	36.6	21,557	
旭有機材	7.7	9.6	12,576	
ニチバン	7.1	8.9	15,397	
リケンテクノス	34.1	41.3	23,375	
大倉工業	6.4	8	18,264	
積水化成品工業	18.2	22.7	13,188	
群栄化学工業	3.1	3.9	9,555	
タイガースポリマー	7.1	8.9	3,987	
ミライアル	4.8	5.4	7,295	
ダイキアクシス	4.8	6.5	5,616	
ダイキョーニシカワ	28.6	35.7	27,096	
竹本容器	4.8	6	5,838	
森六ホールディングス	7.3	9.1	20,138	
恵和	—	3.3	10,230	
日本化薬	83.9	104.7	107,003	
カーリットホールディングス	14.5	16.8	11,474	
日本精化	10.9	12.2	17,360	
扶桑化学工業	13.7	13.3	52,269	
トリケミカル研究所	3	15.7	53,929	
ADEKA	62.4	77.9	150,658	
日油	51.1	63.7	361,179	
新日本理化	22.4	28	8,036	
ハリマ化成グループ	11.2	12.6	11,390	
花王	331.5	413.7	2,769,721	
第一工業製薬	5.1	5.7	20,463	
石原ケミカル	3.7	4.3	9,558	
日華化学	4.6	5.7	6,834	
ニイタカ	2.8	3.5	9,275	
三洋化成工業	8.1	10.1	56,156	
有機合成薬品工業	10.4	13	3,861	
大日本塗料	15.3	19.1	16,005	
日本ペイントホールディングス	111.9	698	1,105,632	
関西ペイント	152.4	190.1	561,745	
神東塗料	10.7	13.3	2,566	
中国塗料	38.6	40.8	35,006	
日本特殊塗料	10.1	12.7	12,954	
藤倉化成	18.3	22.8	12,015	
太陽ホールディングス	10	12.4	62,124	
D I C	57.3	71.5	199,842	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
サカタインクス	29.6	36.9	37,601	
東洋インキSCホールディングス	28.7	35.8	72,638	
T&K TOKA	10.5	11.8	9,664	
富士フイルムホールディングス	265.5	303.6	2,315,253	
資生堂	275.1	343.3	2,722,025	
ライオン	180	224.6	430,558	
高砂香料工業	8.7	10.8	29,127	
マンドラム	31.1	36.2	69,540	
ミルボン	18.5	23.1	143,913	
ファンケル	56	62.9	217,005	
コーセー	26	32.5	558,025	
コタ	8	10.9	15,805	
シーボン	1.8	2.2	4,283	
ポーラ・オルビスホールディングス	59.1	73.7	209,897	
ノエビアホールディングス	11.7	14.7	74,235	
アジュバンコスメジヤパン	3.1	3.9	3,978	
新日本製薬	—	4.7	9,667	
エステー	8.9	11.1	19,169	
アグロ カネショウ	5.8	6.5	9,353	
コニシ	22.7	28.4	43,480	
長谷川香料	23.9	29.8	62,788	
星光PMC	7.9	9.9	7,712	
小林製薬	38.8	48.4	470,448	
荒川化学工業	12.4	14.4	17,121	
メック	9.5	11.8	33,382	
日本高純度化学	3.8	4.7	13,484	
タカラバイオ	36.2	45.2	135,012	
JCU	16.8	19.4	69,258	
新田ゼラチン	8.7	10.8	6,955	
OATアグリオ	2.4	3.3	4,847	
デクセリアルズ	35.8	48.3	107,805	
アース製薬	10.4	13	81,900	
北興化学工業	14.2	16.1	14,731	
大成ラミック	4.5	5.3	14,553	
クミアイ化学工業	57.3	71.4	59,190	
日本農薬	24.7	30.8	16,077	
アキレス	9.5	11.9	16,517	
有沢製作所	21.9	24	21,864	
日東電工	95.5	104.4	886,356	
レック	14.8	20.5	22,591	
三光合成	15.8	18.1	7,457	
きもと	23.5	26.4	6,758	
藤森工業	12.4	15.5	63,937	
前澤化成工業	8.8	11	13,574	
未来工業	7.4	6.2	10,719	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ウェーブブロックホールディングス	4.8	6	4,254	
JSP	8.1	10.1	16,816	
エフビコ	15.2	31.8	134,037	
天馬	9.2	12.9	31,101	
信越ポリマー	24.9	26.6	28,142	
東リ	34.5	43	10,664	
ニフコ	50.8	63.4	236,799	
バルカー	11.2	14	29,050	
ユニ・チャーム	266.9	366.3	1,583,514	
ショーエイコーポレーション	2.1	3.8	3,663	
医薬品 (5.1%)				
協和キリン	139.3	173.8	575,278	
武田薬品工業	1,152	1,437.4	5,345,690	
アステラス製薬	1,200.5	1,497.9	2,692,475	
大日本住友製薬	102.6	128.1	267,216	
塩野義製薬	174.1	217.3	1,207,536	
わかもと製薬	16.5	20.6	6,715	
あすか製薬	15.8	—	—	
日本新薬	36.2	49	384,160	
ピオフェルミン製薬	2.4	2.9	8,946	
中外製薬	144.4	540.4	2,268,599	
科研製薬	23.7	29.6	134,088	
エーザイ	165.7	190.9	1,404,642	
ロート製薬	71.1	82.3	222,210	
小野薬品工業	318	396.7	982,625	
久光製薬	36.6	50.2	301,200	
持田製薬	19.2	24	85,680	
参天製薬	257.9	300.6	439,777	
扶桑薬品工業	4.9	5.6	12,342	
日本ケミファ	1.8	2.1	4,886	
ツムラ	42.9	57.6	198,720	
日医工	39.2	48.9	42,689	
キッセイ薬品工業	24.5	30.6	64,780	
生化学工業	26.9	30.5	35,136	
栄研化学	24.3	30.4	65,177	
日水製薬	5.8	6.3	6,054	
鳥居薬品	8.7	10.8	26,254	
JCRファーマ	9.8	48.7	161,927	
東和薬品	17.7	24.9	58,988	
富士製薬工業	9.4	10.6	12,031	
沢井製薬	28.4	—	—	
ゼリア新薬工業	25.1	31.3	65,479	
第一三共	396.2	1,357.7	3,434,981	
キョーリン製薬ホールディングス	30.6	38.1	65,112	
大幸薬品	16.9	21.2	22,323	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ダイト	8.4	11	36,080	
大塚ホールディングス	263.8	359.1	1,621,695	
大正製薬ホールディングス	29.3	41.1	255,642	
ペプチドリーム	70.4	89.1	457,083	
あすか製薬ホールディングス	—	19.7	20,685	
サウイグループホールディングス	—	37.8	180,684	
石油・石炭製品(0.4%)				
日本コークス工業	117	146	15,476	
ニチレキ	16.3	20.4	27,254	
ユシロ化学工業	7.8	9.7	11,290	
ビービー・カストロール	4.9	6.2	8,649	
富士石油	37	41.9	11,313	
MORESCO	5	6.2	6,758	
出光興産	153.7	191.7	495,544	
ENEOSホールディングス	2,082.9	2,599	1,176,047	
コスモエネルギーホールディングス	40.1	54.6	124,542	
ゴム製品(0.7%)				
横浜ゴム	80.2	100	220,600	
TOYO TIRE	79.5	90.9	199,889	
ブリヂストン	398.8	459.4	2,207,876	
住友ゴム工業	124.4	155.2	219,763	
藤倉コンボジット	12.1	15.1	7,519	
オカモト	8.4	10.5	42,787	
フコク	6.1	7.6	7,022	
ニッタ	15.6	17.9	46,217	
住友理工	26.8	33.5	22,445	
三ツ星ベルト	18.2	21	36,834	
パンドー化学	24.4	30.4	25,262	
ガラス・土石製品(0.8%)				
日東紡績	20.6	25.7	88,665	
AGC	136.9	158.6	758,108	
日本板硝子	66.2	87.7	53,233	
石塚硝子	2.5	2.9	5,634	
日本山村硝子	5.8	7.3	6,810	
日本電気硝子	55.6	64.1	168,070	
オハラ	5.5	6.9	10,784	
住友大阪セメント	26.2	31.1	94,233	
太平洋セメント	87.5	102.3	257,898	
日本ヒューム	13.9	15.9	11,607	
日本コンクリート工業	29.9	37.6	12,784	
三谷セキサン	6.5	8.1	32,197	
アジアパイルホールディングス	19.7	26.8	13,105	
東海カーボン	145.1	169	272,766	
日本カーボン	7.1	9.6	41,280	
東洋炭素	8.1	10.2	24,918	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ノリタケカンパニーリミテド	7.7	9.6	40,176	
TOTO	98.9	123.4	728,060	
日本碍子	166.2	190.2	364,803	
日本特殊陶業	105.3	131.5	226,706	
MARUWA	5.3	6	64,560	
品川リフラクトリーズ	3.7	4.1	14,883	
黒崎播磨	2.8	3	13,425	
ヨータイ	11	12.5	14,062	
イソライト工業	7.2	7.8	4,703	
東京窯業	17.7	22.4	7,100	
ニッカトー	6.3	8	5,552	
フジミインコーポレーテッド	12.3	13.9	69,778	
クニミネ工業	5.6	5.5	6,424	
エーアンドエーマテリアル	2.3	3.3	3,366	
ニチアス	37.9	43.7	118,995	
ニチハ	19.3	24.1	69,962	
鉄鋼(0.8%)				
日本製鉄	612.8	815.6	1,676,058	
神戸製鋼所	250.8	312.8	232,097	
中山製鋼所	19.2	23.9	9,894	
合同製鐵	7.4	9.3	15,586	
ジェイ エフ イー ホールディングス	369.9	494.4	720,835	
東京製鐵	66.8	66.6	74,392	
共英製鋼	15.5	19.3	27,348	
大和工業	29.1	36.3	129,954	
東京鐵鋼	5.7	6.6	10,296	
大阪製鐵	7.3	9.1	10,273	
淀川製鋼所	18.5	22.5	52,087	
丸一鋼管	44.5	55.5	153,291	
モリ工業	4.1	5.1	12,280	
大同特殊鋼	22.4	28	151,480	
日本高周波鋼業	5.2	6.5	2,684	
日本冶金工業	11.4	13.3	30,018	
山陽特殊製鋼	9.4	20.5	33,005	
愛知製鋼	7.7	9.6	29,664	
日立金属	147.6	161.1	341,693	
日本金属	3.2	4.3	4,201	
大平洋金属	9.3	11.6	22,527	
新日本電工	88.6	110.5	35,139	
栗本鐵工所	6.8	7.8	13,150	
虹技	2.1	2.4	2,923	
三菱製鋼	10.2	12.7	11,061	
日亜鋼業	20.3	25.3	7,488	
日本精練	2.3	2.5	10,937	
エンビプロ・ホールディングス	5.9	7.4	8,339	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
シンニッタン	21.5	21	5,229	
新家工業	3.2	4.3	6,961	
非鉄金属(0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	22.7	25.9	31,028	
日本軽金属ホールディングス	347.1	46.6	87,328	
三井金属鉱業	37	46.1	149,133	
東邦亜鉛	7.1	9.5	19,275	
三菱マテリアル	90.5	112.9	261,928	
住友金属鉱山	175.1	218.4	1,071,907	
DOWAホールディングス	34.7	43.3	196,365	
古河機械金属	24.4	28.3	35,573	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.3	17.9	14,857	
東邦チタニウム	24.7	30.7	29,072	
UACJ	20.8	26	60,684	
CKサンエツ	2.9	3.6	12,996	
古河電気工業	42.6	53.1	154,680	
住友電気工業	512	596.3	999,696	
フジクラ	165.7	206.3	96,548	
昭和電線ホールディングス	15.9	16.6	28,153	
東京特殊電線	2.1	2.2	5,524	
タツタ電線	27.3	30.4	17,328	
カナレ電気	2.3	2.9	5,260	
平河ヒューテック	6.9	9.6	11,692	
リョービ	16.9	21.1	33,464	
アーレスティ	18.2	21.3	9,009	
アサヒホールディングス	24	64.2	153,373	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	7.7	9.6	14,208	
宮地エンジニアリンググループ	4.2	5.6	12,140	
トーカロ	38	44.1	61,872	
アルファC o	4.8	6	6,708	
SUMCO	162.7	217.9	553,683	
川田テクノロジーズ	2.8	3.5	13,475	
RS Technologies	3.9	5.5	29,315	
ジェイテックコーポレーション	—	1.9	5,795	
信和	7.9	9.1	6,997	
東洋製罐グループホールディングス	87.2	108.8	163,200	
ホッカンホールディングス	7.5	8.7	12,206	
コロナ	7.6	9.4	8,751	
横河ブリッジホールディングス	25.5	29.3	58,600	
駒井ハルテック	2.6	3.5	6,034	
高田機工	1.3	1.6	4,288	
三和ホールディングス	129.1	161.1	213,618	
文化シャッター	40.3	50.3	54,575	
三協立山	17.6	22	17,314	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アルインコ	9.9	11.3	11,254	
東洋シャッター	3.3	3.8	2,523	
LIXIL	202	235.3	676,958	
日本フィルコン	10.5	11.9	5,926	
ノーリツ	28.4	35.4	67,720	
長府製作所	13.9	17.4	35,235	
リンナイ	26.6	33.2	353,912	
ダイニチ工業	7.4	8.2	6,535	
日東精工	18.9	21.4	11,620	
三洋工業	1.8	2.1	3,933	
岡部	27.7	34.6	22,870	
ジーテクト	17	21.2	31,800	
東ブレ	25.5	31.9	52,379	
高周波熱錬	26.4	32.9	18,259	
東京製綱	9.8	12.2	14,737	
サンコール	10.2	14.6	6,643	
モリテック スチール	10.7	13.3	6,836	
パイオラックス	20.2	25.3	36,862	
エイチワン	13.4	16.8	12,969	
日本発條	146.9	170.2	149,095	
中央発條	1.6	8.2	9,889	
アドパネクス	2	2.5	3,360	
立川ブラインド工業	6	7.5	9,855	
三益半導体工業	10.7	13.3	34,074	
機械(5.6%)				
日本ドライケミカル	3.4	4.3	7,331	
日本製鋼所	41.6	51.9	147,499	
三浦工業	59.3	74	372,220	
タクマ	46.5	58	107,880	
ツガミ	28.5	35.5	59,427	
オークマ	16	20	113,200	
芝浦機械	15.5	17.8	44,482	
アマダ	170	250.6	291,698	
アイダエンジニアリング	36	45	39,150	
滝澤鉄工所	4.3	5	5,620	
FUJII	58.9	68.3	185,639	
牧野フライス製作所	16.1	20.1	87,234	
オーエスジー	63.4	84.4	147,784	
ダイジェット工業	1.6	2.1	2,805	
旭ダイヤモンド工業	36.2	45.3	23,329	
DMG森精機	86.7	108.2	204,498	
ソディック	32.3	41.1	46,155	
ディスコ	18.6	23.2	779,520	
日東工器	7.5	8.2	15,325	
日進工具	5.4	13.5	19,588	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
パンチ工業	12.5	14.4	8,280	
富士ダイス	6.2	8.7	5,689	
豊和工業	7.7	9.7	7,847	
OKK	5.9	6.6	2,554	
東洋機械金属	10	12.4	6,485	
津田駒工業	2.8	3.3	2,917	
エンシュウ	3.4	4.4	3,770	
島精機製作所	21.6	25.1	53,161	
オプトラン	15.3	21.5	58,243	
NCホールディングス	4.3	5.3	5,029	
イワキポンプ	8.8	11	10,395	
フリュー	13.5	16.8	19,068	
ヤマシンフィルタ	29.8	34.6	27,749	
日阪製作所	17	21.2	17,129	
やまびこ	26.6	33.2	40,470	
平田機工	6.5	8.1	52,407	
ベガサスミシン製造	14.1	17.5	8,575	
マルマエ	5.1	7.1	13,518	
タツモ	6.4	7.3	11,899	
ナブテスコ	80.7	100.7	505,514	
三井海洋開発	14.6	18.2	38,656	
レオン自動機	13.5	16.8	21,386	
SMC	43.4	50.6	3,315,312	
ホソカワミクロン	4.8	6	36,180	
ユニオンツール	5.1	6.4	23,840	
オイレス工業	17.8	24	37,104	
日精エー・エス・ビー機械	4	5.8	30,682	
サトーホールディングス	19.5	22.5	57,622	
技研製作所	12.1	15.1	67,497	
日本エアーテック	4.8	5.7	7,375	
カワタ	4.1	4.8	4,291	
日精樹脂工業	11.6	13.3	16,452	
オカダアイヨン	4.4	5.5	7,166	
ワイエイシイホールディングス	5.9	6.8	6,895	
小松製作所	627.2	782.8	2,507,308	
住友重機械工業	79.3	99	335,115	
日立建機	55.5	80.8	293,304	
日工	19.1	26.1	18,322	
巴工業	5.9	6.8	14,334	
井関農機	13.9	17.4	23,716	
TOWA	14.1	16.2	32,999	
丸山製作所	2.9	3.6	6,505	
北川鉄工所	6.3	7.9	13,256	
ローツェ	6.1	7.6	75,240	
タカキタ	5	6.2	3,949	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
クボタ	734.7	907.6	2,258,108	
荏原実業	3.5	4.4	28,028	
三菱化工機	4.8	5.6	15,265	
月島機械	25.6	32	37,088	
帝国電機製作所	11.5	12.1	15,173	
新東工業	33	41.3	32,090	
澁谷工業	12.1	15.2	50,084	
アイチ コーポレーション	24.1	29.6	25,781	
小森コーポレーション	35.3	44.1	34,971	
鶴見製作所	10.7	13.4	23,155	
住友精密工業	2.1	2.6	6,385	
日本ギア工業	5.8	7.2	2,354	
酒井重工業	2.7	3.1	6,342	
荏原製作所	57.3	71.7	387,180	
石井鐵工所	1.8	2.5	7,425	
西島製作所	14.1	17.7	15,664	
北越工業	14.3	17.9	20,244	
ダイキン工業	176.4	220.1	4,755,260	
オルガノ	5	5.6	35,840	
トーヨーカネツ	6.1	6.6	15,655	
栗田工業	75	93.5	470,305	
椿本チエイン	19.8	24.7	75,952	
大同工業	6.8	8.4	9,181	
木村化工機	11.8	14.6	13,388	
アネスト岩田	21.6	29.2	29,492	
ダイフク	70.8	95.1	874,920	
サムコ	3.5	4.3	13,674	
加藤製作所	7.7	9.7	9,593	
油研工業	2.4	3	5,202	
タダノ	67	83.6	88,448	
フジテック	50.4	59.5	143,276	
CKD	38	40.1	104,500	
キトー	10.5	14.6	24,747	
平和	38.7	48.2	87,772	
理想科学工業	12.3	12.7	21,958	
SANKYO	30.8	41.1	109,654	
日本金銭機械	15.4	19.3	10,788	
マースグループホールディングス	8.8	11	17,611	
フクシマガリレイ	8.6	11.9	50,218	
オーイズミ	6	7.5	2,902	
ダイコク電機	6.4	8	7,136	
竹内製作所	23.2	28.9	83,752	
アマノ	36.3	45.3	129,784	
JUKI	19.3	24	18,480	
蛇の目ミシン工業	12.8	15.8	12,877	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
マックス	21.2	23.2	38,906	
グローリー	35.6	44.4	99,811	
新晃工業	12.9	16.1	30,654	
大和冷機工業	20.1	27.8	29,301	
セガサミーホールディングス	137.4	157.2	218,979	
日本ビストンリング	5.1	6.4	7,577	
リケン	6.4	8	19,600	
T P R	18.7	23.3	33,924	
ツバキ・ナカシマ	28.3	33.3	58,541	
ホシザキ	40.5	54.4	529,312	
大豊工業	11.4	14.2	12,666	
日本精工	260.8	354.9	368,741	
N T N	320.8	399.8	122,738	
ジェイテクト	132.9	165.8	189,177	
不二越	12.9	16.1	67,056	
日本トムソン	41.3	47.5	29,070	
T H K	80.6	107.7	383,412	
ユーシン精機	10.8	11.6	9,581	
前澤給装工業	5.1	12.1	13,249	
イーグル工業	17.2	21.4	23,989	
前澤工業	9.4	10.5	6,310	
日本ビラー工業	14.1	17.5	33,845	
キッツ	56.2	53.5	40,553	
マキタ	180.6	225.3	1,189,584	
日立造船	110.1	137.3	98,444	
三菱重工業	232.1	271.5	900,022	
I H I	99.8	116.2	309,324	
スター精密	21.4	26.7	48,140	
電気機器 (17.8%)				
日清紡ホールディングス	92.4	105.7	95,552	
イビデン	84.9	83.3	423,164	
コニカミノルタ	303.7	352.2	210,615	
ブラザー工業	169.3	211.4	483,471	
ミネベアミツミ	257.3	298.2	888,636	
日立製作所	665.3	830.7	4,764,895	
東芝	—	341.9	1,571,030	
三菱電機	1,384.6	1,727.6	2,923,099	
富士電機	83.5	104.1	534,033	
東洋電機製造	5.1	7	8,232	
安川電機	149.1	186	987,660	
シンフォニアテクノロジー	18	22.5	28,755	
明電舎	25.5	29.4	66,267	
オリジン	3.8	4.9	6,526	
山洋電気	6.8	8.5	64,940	
デンヨー	11.9	14.8	29,984	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
東芝テック	17.4	18.6	78,771	
芝浦メカトロニクス	2.6	3.2	20,736	
マブチモーター	38.5	48.1	207,551	
日本電産	333.3	415.9	5,211,227	
トレックス・セミコンダクター	8.4	9.8	21,648	
東光高岳	8.2	9.5	13,547	
ダイヘン	15.2	18.9	94,027	
ヤーマン	23.3	28.9	43,118	
J V C ケンウッド	115.7	154.1	35,751	
ミマキエンジニアリング	13.6	17	11,543	
I - P E X	5.8	8.5	20,655	
日新電機	32.6	40.6	52,333	
大崎電気工業	27.8	34.6	20,690	
オムロン	124.1	143.8	1,239,556	
日東工業	20.4	25.4	45,059	
I D E C	20.1	23.2	47,420	
正興電機製作所	3.7	6.1	10,113	
不二電機工業	2.7	3.7	4,754	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46.5	62.4	193,128	
サクサホールディングス	3.3	4.2	5,859	
メルコホールディングス	5	6.2	29,326	
テクノメディカ	3.4	4.5	7,254	
日本電気	168	219.5	1,121,645	
富士通	133.5	155.5	2,765,567	
沖電気工業	56.4	70.3	68,753	
岩崎通信機	6.1	7.6	7,136	
電気興業	6.7	8.4	19,387	
サンケン電気	15.2	20.2	107,868	
ナカヨ	2.8	3.5	5,218	
アイホン	7.9	9.9	20,413	
ルネサスエレクトロニクス	663.2	744.7	829,595	
セイコーエプソン	171.9	214.4	414,864	
ワコム	94.1	126.6	84,315	
アルバック	25.5	31.8	163,770	
アクセル	6.4	8.3	7,486	
E I Z O	10.8	14.7	69,237	
日本信号	35.4	40.4	37,976	
京三製作所	32.7	37.5	15,937	
能美防災	18.6	23.4	48,040	
ホーチキ	10.4	13.4	16,254	
星和電機	7.6	10.4	5,772	
エレコム	15.4	40.1	83,728	
パナソニック	1,582.1	1,842.6	2,297,722	
シャープ	160.3	229.8	459,140	
アンリツ	89.2	103.9	217,254	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
富士通ゼネラル	37.6	52.8	142,084	
ソニーグループ	867.4	1,082.3	11,672,605	
T D K	66.9	83.5	1,163,990	
帝国通信工業	6.5	8.6	10,027	
タムラ製作所	46.5	62.4	34,819	
アルプスアルパイン	122.9	142	167,134	
池上通信機	4.4	5.5	4,510	
鈴木	7.4	8.8	9,380	
日本トリム	2	4	14,240	
ローランド ディー・ジー	8	10.7	22,523	
フォスター電機	14.6	17.6	18,057	
SMK	3.6	4.5	11,668	
ヨコオ	9.1	13.9	31,983	
ホシデン	38.4	48.2	48,730	
ヒロセ電機	21.5	26.6	414,694	
日本航空電子工業	31.8	39.7	76,740	
T O A	15	20.6	18,128	
マクセルホールディングス	30.3	35.2	43,683	
古野電気	18.4	23.2	24,081	
ユニデンホールディングス	3.9	4.5	10,935	
スミダコーポレーション	11.3	15.7	16,202	
アイコム	7.7	7.2	17,424	
リオン	6	7.7	19,550	
本多通信工業	13	15.6	7,488	
横河電機	127.1	173	299,809	
新電元工業	4.9	6.7	25,058	
アズビル	87.4	116.9	512,606	
東亜ディーケーケー	7.4	9.8	8,045	
日本光電工業	57.4	71.7	222,270	
チノー	4.9	5.6	8,198	
共和電業	14.8	18.7	7,554	
日本電子材料	5.6	7.2	14,760	
堀場製作所	27.4	34.2	240,768	
アドバンテスト	103	128.5	1,270,865	
小野測器	6.7	9.2	4,986	
エスベック	12.6	15.8	31,805	
キーエンス	125.5	169.6	9,136,352	
日置電機	7.4	8.5	43,520	
シスメックス	99	134.9	1,505,484	
日本マイクロニクス	24.7	30.7	47,431	
メガチップス	13.1	17.6	57,728	
OBARA GROUP	8.2	8.1	30,861	
澤藤電機	1.9	2.3	5,138	
原田工業	7.1	8.2	7,298	
コーセル	19	22	23,826	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
イリソ電子工業	11.8	14.7	67,987	
オブテックスグループ	23.1	28.9	55,690	
千代田インテグレ	6.7	7.8	14,281	
アイ・オー・データ機器	5	7.3	7,964	
レーザーテック	60.9	75.9	1,563,540	
スタンレー電気	97.5	121.2	395,112	
岩崎電気	5.7	7	12,089	
ウシオ電機	76.8	89.2	140,846	
岡谷電機産業	12.3	15.3	5,416	
ヘリオス テクノ ホールディング	14.2	18.9	6,501	
エノモト	4.6	5.4	9,450	
日本セラミック	14.3	17.9	50,227	
遠藤照明	7.8	10.1	7,867	
古河電池	10.7	13	20,306	
双信電機	8	10.5	6,373	
山一電機	10.3	11.9	19,873	
図研	9.2	11.6	36,540	
日本電子	27.5	31.6	177,592	
カシオ計算機	122.5	139	264,795	
ファナック	131.6	151.6	3,987,080	
日本シイエムケイ	33.8	39.4	18,005	
エンプラス	7.3	8.1	33,250	
大真空	5.3	6.2	21,700	
ローム	61.5	71.9	745,603	
浜松ホトニクス	99.4	124.1	826,506	
三井ハイテック	15.6	17.2	70,864	
新光電気工業	46.8	58.3	208,131	
京セラ	194.9	263.5	1,771,247	
太陽誘電	61.7	77	405,790	
村田製作所	406.8	507.6	4,202,420	
双葉電子工業	22.4	30.8	25,718	
北陸電気工業	6.1	7.6	7,866	
ニチコン	47.6	55.3	63,705	
日本ケミコン	10.5	17.4	44,613	
K O A	21.4	24.6	39,556	
市光工業	21.6	27.3	19,628	
小糸製作所	83.1	103.6	736,596	
ミツバ	26.6	31.8	29,192	
S C R E E Nホールディングス	24	30	312,600	
キヤノン電子	14.8	16.5	28,066	
キヤノン	745.4	858.5	2,197,760	
リコー	352.4	439.6	570,600	
象印マホービン	40.9	47.4	79,158	
M U T O Hホールディングス	2.1	2.9	4,613	
東京エレクトロン	87.9	101.2	4,924,392	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
輸送用機器 (7.6%)			
トヨタ紡織	40.4	50.4	106,495
芦森工業	2.9	3.3	3,432
ユニプレス	26.9	28.4	26,809
豊田自動織機	112.1	139.8	1,305,732
モリタホールディングス	24.2	27.7	42,602
三櫻工業	17.6	24	26,400
デンソー	304.9	380.4	2,854,141
東海理化電機製作所	36.5	45.5	80,034
三井E&Sホールディングス	50	66.9	33,048
川崎重工業	107.7	134.4	353,740
名村造船所	44.6	51.9	8,667
日本車輛製造	5	6.3	13,784
三菱ロジスネクスト	18.3	22.9	23,358
近畿車輛	2.1	3	3,750
日産自動車	1,633	2,037.5	1,098,416
いすゞ自動車	401.2	458.7	661,904
トヨタ自動車	1,544.9	1,750.2	15,953,073
日野自動車	172.9	215.7	219,582
三菱自動車工業	512.5	639.5	194,408
エフテック	9.8	12.2	9,699
レシップホールディングス	5.4	6.8	3,984
GMB	2.6	3.2	2,937
ファルテック	2.5	3.1	2,387
武蔵精密工業	30.9	38.5	84,854
日産車体	27	25.3	17,937
新明和工業	37.3	48.8	47,433
極東開発工業	25.7	29.8	51,554
日信工業	28.2	—	—
トビー工業	11.4	14.3	18,990
ティラド	5.1	5.4	14,504
曙ブレーキ工業	76	94.8	16,495
タチエス	22.8	26.5	33,893
NOK	74.5	83.6	112,442
フタバ産業	38.6	43.4	21,613
KYB	15.5	19.3	73,822
大同金属工業	26.7	35.8	20,549
プレス工業	68.9	85.9	27,745
ミクニ	17.8	22.2	6,304
太平洋工業	29.1	36.3	42,942
ケーヒン	31.8	—	—
河西工業	18.8	23.5	9,282
アイシン	114	126.5	607,200
マツダ	407.4	542.2	506,957
今仙電機製作所	12.9	15.2	10,609

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
本田技研工業	1,090.2	1,360.3	4,561,085
スズキ	274.4	342.4	1,624,003
S U B A R U	429.8	495.1	1,054,810
安永	6.7	8.4	9,618
ヤマハ発動機	180.6	244.1	779,899
ショーワ	32.7	—	—
T B K	16.6	20.7	8,590
エクセディ	18.8	23.5	37,717
豊田合成	44.7	55.8	155,570
愛三工業	21.8	27.2	21,515
盟和産業	2.2	2.7	2,559
日本ブラスト	11	14.7	10,172
ヨロズ	13	14.9	18,148
エフ・シー・シー	22.7	28.3	48,081
シマノ	51.8	64.7	1,604,560
テイ・エス テック	32.2	80.3	125,990
ジャムコ	7	10.1	10,120
精密機器 (2.7%)			
テルモ	391.8	529.6	2,233,323
クリエートメディック	4.6	5.7	5,745
日機装	41.6	55.8	66,681
日本エム・ディ・エム	8	10	20,160
島津製作所	165.5	222.3	852,520
J M S	11.7	14.6	12,687
長野計器	10.1	12.5	14,962
ブイ・テクノロジー	6.5	8.1	42,606
東京計器	8.8	11	11,594
愛知時計電機	1.8	2.3	9,867
インターアクション	7.4	8.7	20,297
オーバル	12.5	15.6	4,446
東京精密	25.1	29.1	158,304
マニー	55.2	68.8	165,739
ニコン	211.5	263.9	296,095
トプコン	69.8	87	149,379
オリンパス	766.1	955.9	2,247,320
理研計器	12.2	15.2	41,876
タムロン	11.2	13.9	33,943
H O Y A	276.5	340	4,879,000
シード	5.9	6.8	5,222
ノーリツ鋼機	9.4	15.5	35,324
エー・アンド・ディ	12.7	14.6	15,140
朝日インテック	156.8	181.9	492,585
シチズン時計	162.3	219.3	94,518
リズム	4.4	5.5	4,532
大研医器	9.6	13.7	7,603

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
メニコン	19.6	26.6	181,944	
シンシア	1.6	1.9	1,231	
松風	6.3	7.9	14,686	
セイコーホールディングス	19.6	24.5	52,405	
ニプロ	95.8	128.8	171,561	
その他製品 (2.6%)				
中本バックス	3.5	4.4	7,040	
スノーピーク	7.4	10.2	35,904	
パラマウントベッドホールディングス	14.6	33.1	66,365	
トランザクション	7.6	9.5	12,967	
粧美堂	4	5	2,110	
ニホンフラッシュ	12.9	14.8	18,633	
前田工織	15.3	19	65,075	
永大産業	18.1	22.6	6,847	
アートネイチャー	14.8	16.6	10,690	
バンダイナムコホールディングス	143.1	142.9	1,120,478	
アイフィスジャパン	3.5	4.4	3,163	
共立印刷	23.1	28.9	4,074	
SHOEI	12.1	16.2	63,747	
フランスベッドホールディングス	19.6	22.2	20,535	
パイロットコーポレーション	22.6	29.2	99,718	
萩原工業	7.7	9.6	13,737	
トップパン・フォームズ	29.7	30.8	33,818	
フジシールインターナショナル	31	35.5	84,099	
タカラトミー	62.1	77.5	73,780	
廣済堂	9.6	12	13,416	
エステールホールディングス	3.7	4.6	2,948	
アーク	52.8	—	—	
タカノ	5.4	5.9	3,681	
プロネクス	11.9	13.9	14,317	
ホクシン	8.5	10.7	1,872	
ウッドワン	4.7	5.8	7,180	
大建工業	9.3	11.6	22,550	
凸版印刷	195.4	262.6	503,666	
大日本印刷	181.2	208.7	492,323	
共同印刷	4.3	5.3	14,871	
NISSHA	28.4	35.5	54,137	
光村印刷	1.2	1.5	2,563	
TAKARA & COMPANY	6.7	8.5	14,586	
アシックス	114.3	152.8	401,100	
ツツミ	4.3	4.3	10,461	
ローランド	—	13.4	85,492	
小松ウオール工業	4.2	5.3	10,197	
ヤマハ	82.3	102.7	674,739	
河合楽器製作所	4.3	4.8	18,168	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
クリナップ	12.9	16.1	8,404	
ビジョン	83.7	110.9	342,126	
オリバー	2.9	3.7	11,673	
兼松サステック	0.9	1.1	1,938	
キングジム	11.5	14.3	13,470	
リンテック	32.9	37	89,466	
イトーキ	29.4	34.3	12,313	
任天堂	84.9	98.9	6,695,530	
三菱鉛筆	22.8	28.4	40,810	
タカラスタンダード	28.6	35.7	57,120	
コクヨ	66.4	82.9	140,515	
ナカバヤシ	13.6	17	10,234	
グローブライド	6.2	8.4	34,776	
オカムラ	48.3	59.4	83,278	
美津濃	12.6	17.1	38,389	
電気・ガス業 (1.2%)				
東京電力ホールディングス	1,105.3	1,465.4	496,770	
中部電力	423.6	528.5	692,863	
関西電力	524.6	654.6	679,474	
中国電力	199.7	249.2	265,148	
北陸電力	126.6	157.9	98,687	
東北電力	345.9	404.6	360,094	
四国電力	124.7	143.6	105,689	
九州電力	285.4	381.5	337,627	
北海道電力	129.6	161.7	80,850	
沖縄電力	26.89	33.6	47,040	
電源開発	110.2	137.5	213,125	
エフオン	7.4	10.4	10,524	
イーレックス	19.7	25.4	46,812	
レノバ	23.1	29.3	106,652	
東京瓦斯	266.3	332.2	719,711	
大阪瓦斯	268.7	312.9	645,199	
東邦瓦斯	68.1	85	510,000	
北海道瓦斯	7.4	9.3	14,294	
広島ガス	28.5	35.6	13,207	
西部ガスホールディングス	15.6	19.4	47,530	
静岡ガス	39.3	49	51,205	
メタウォーター	6.7	19.4	39,110	
陸運業 (3.3%)				
SBSホールディングス	12	12.8	39,680	
東武鉄道	144.3	180.1	501,938	
相鉄ホールディングス	44.3	59.2	125,859	
東急	349.2	435.7	638,736	
京浜急行電鉄	177.8	221.9	313,322	
小田急電鉄	205.9	276.7	782,230	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
京王電鉄	71.8	96.5	656,200	
京成電鉄	96.4	129.5	437,062	
富士急行	18.9	23.6	120,596	
新京成電鉄	3.6	4.4	9,446	
東日本旅客鉄道	243.7	304.1	2,326,365	
西日本旅客鉄道	123.4	153.9	958,797	
東海旅客鉄道	115.1	143.6	2,335,654	
西武ホールディングス	185.8	208.2	263,581	
鴻池運輸	22	27.5	30,992	
西日本鉄道	38.4	47.9	130,479	
ハマキョウレックス	10.6	13.3	40,299	
サカイ引越センター	7.3	7.9	44,082	
近鉄グループホールディングス	131.1	163.6	631,496	
阪急阪神ホールディングス	174.9	218.2	746,244	
南海電気鉄道	62.2	77.6	181,816	
京阪ホールディングス	58.4	72.9	252,598	
神戸電鉄	3.1	3.9	13,533	
名古屋鉄道	107.8	134.5	282,450	
山陽電気鉄道	9.4	11.7	21,996	
アルプス物流	—	11.4	10,659	
日本通運	45.4	56.6	496,382	
ヤマトホールディングス	229.9	229.3	690,193	
山九	36.4	42	199,290	
丸運	7.5	9.3	2,427	
丸全昭和運輸	10.6	13.3	46,882	
センコーグループホールディングス	72.3	90.2	90,831	
トナミホールディングス	3.1	3.9	19,383	
ニッコンホールディングス	46.9	54.9	127,917	
日本石油輸送	1.4	1.8	4,629	
福山通運	16.8	20.9	84,854	
セイノーホールディングス	98.2	122.5	188,650	
エスライン	3.9	4.5	4,023	
神奈川中央交通	3.2	4.1	14,903	
日立物流	24	36	125,640	
丸和運輸機関	13.8	34.5	52,957	
C&F ロジホールディングス	13.3	16.5	27,159	
九州旅客鉄道	115	126.6	316,120	
S Gホールディングス	137.6	309.1	756,058	
海運業(0.3%)				
日本郵船	110.3	137.2	619,458	
商船三井	83.4	97.4	428,073	
川崎汽船	40.4	50.4	148,881	
N S ユナイテッド海運	7.9	8.4	17,740	
飯野海運	64.8	79.4	34,539	
共栄タンカー	3.4	4.7	3,995	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
乾汽船	7.6	11.2	12,476	
空運業(0.5%)				
日本航空	231.9	398.6	996,101	
ANAホールディングス	239.7	441.6	1,172,448	
パスコ	2.5	3.2	4,716	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	3.7	5	42,050	
日新	11.3	13	18,772	
三菱倉庫	41.6	56.6	186,780	
三井倉庫ホールディングス	15	17.4	39,741	
住友倉庫	47.2	57.8	84,908	
澁澤倉庫	7.2	9	18,594	
東陽倉庫	23.7	27.4	8,877	
日本トランスシティ	28.9	36	18,468	
ケイヒン	2.5	3.2	4,361	
中央倉庫	8	10	11,060	
川西倉庫	2.4	3	3,435	
安田倉庫	10.8	13.4	12,529	
ファイズホールディングス	2.8	2.9	2,462	
東洋埠頭	4	5	7,555	
宇徳	11.2	11.7	5,838	
上組	73.2	90	195,120	
サンリツ	3.1	4.2	3,112	
キムラユニティ	3.5	4.4	5,764	
キューソー流通システム	3.3	4.1	6,555	
近鉄エクスプレス	27.9	30.9	76,632	
東海運	7.5	9.3	2,845	
エアイティ	9.3	10.3	10,227	
内外トランスライン	4.6	5.7	10,094	
日本コンセプト	4.2	5.2	8,751	
情報・通信業(9.0%)				
NEC ネットエスアイ	38.7	56.3	98,581	
クロスキャット	3.8	4.8	4,891	
システナ	48.6	60.7	117,090	
デジタルアーツ	6.7	9.9	79,596	
日鉄ソリューションズ	20.5	24.7	78,916	
キューブシステム	7.6	9.4	9,794	
エイジア	2.7	2.8	5,868	
コア	6	7.4	10,626	
ラクーンホールディングス	6.4	12.1	32,512	
ソリトンシステムズ	6.2	8.7	15,051	
ソフトクリエイトホールディングス	6.1	6.8	15,334	
T I S	136	169.7	477,705	
J N Sホールディングス	5.4	8.3	4,482	
電算システム	5.3	6.5	19,025	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
グリー	84	104.6	59,099	
GMOベバボ	—	1.5	7,935	
コーエーテクモホールディングス	27.9	45.1	234,069	
三菱総合研究所	5.9	7.4	28,860	
電算	1.6	2	4,882	
AGS	8	9.1	7,698	
ファインデックス	11.7	14.6	15,417	
ブレインパッド	3.5	4.5	21,690	
KL a b	26.3	31.1	21,179	
ポールトゥウィン・ビット クルーホールディングス	16.7	22.9	24,525	
イーブクイニシアティブジャパン	2.1	2.9	7,540	
ネクソン	379.1	429.1	1,108,794	
アイスタイル	38.9	52.4	27,038	
エムアップホールディングス	4	4.5	12,172	
エイチーム	9.7	11.9	19,801	
エニグモ	13.1	16.3	21,581	
テクノスジャパン	11	13.8	8,293	
コロブラ	44.8	56.2	44,679	
ブロードリーフ	67.8	84.7	44,382	
クロス・マーケティンググループ	6.9	8.2	5,658	
デジタルハーツホールディングス	7.5	8	11,680	
システム情報	10.4	13.1	11,960	
メディアドウ	4.3	6.7	37,453	
じげん	34.4	42.9	17,117	
ブイキューブ	—	9.4	22,682	
エンカレッジ・テクノロジー	3.3	3.6	2,293	
サイバーリンクス	2.3	5.8	9,471	
フィックスターズ	14.7	18.5	15,910	
CARTA HOLDINGS	6.8	7.1	11,402	
オブティム	7.2	12	29,304	
セレス	4.7	5.7	21,204	
SHIFT	5.5	8.5	131,665	
ティーガイア	12.2	18.2	33,961	
セック	2.1	2.6	6,851	
日本アジアグループ	14.3	16.4	15,465	
テクマトリックス	9.7	26.5	46,110	
プロシップ	4.2	5.2	6,812	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	32.9	41	83,804	
GMOペイメントゲートウェイ	28.8	32.5	427,050	
ザッパラス	6.6	7.3	4,022	
システムリサーチ	3.8	5.1	10,485	
インターネットイニシアティブ	20.2	45.3	136,579	
さくらインターネット	15	18.8	11,656	
ヴィンクス	4.1	5.2	5,106	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2.6	3.8	19,304	
SRAホールディングス	7.3	9.1	23,632	
システムインテグレータ	4.6	5.4	3,380	
朝日ネット	9.9	14.3	10,024	
eBASE	16.5	20.7	17,967	
アバント	13.2	18.4	27,618	
アドソル日進	4.9	6.2	14,960	
ODKソリューションズ	—	4	3,476	
フリービット	7.4	10.5	9,408	
コムチュア	15.3	15.7	35,890	
サイバーコム	2.6	3.3	4,953	
アステリア	8.8	12.7	10,452	
アイル	7.7	9.6	14,937	
マークラインズ	6.9	7.2	21,211	
メディカル・データ・ビジョン	10.6	19.5	39,390	
gumi	—	23.8	27,132	
ショーケース	3.6	4.2	3,179	
モバイルファクトリー	3.3	4.1	5,198	
テラスカイ	5	5.6	14,061	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.5	7.7	16,016	
PCIホールディングス	5.4	6.7	8,509	
パイブドHD	1.9	3.7	5,816	
アイビーシー	2.5	3.1	3,093	
ネオジャパン	2.8	3.4	5,671	
PR TIMES	1.3	3.7	12,025	
ラクス	—	51.2	103,731	
ランドコンピュータ	2.3	2.9	3,062	
ダブルスタンダード	1.8	2.3	11,166	
オーブンドア	6.9	10.2	26,866	
マイネット	4.4	5.5	4,053	
アカツキ	4.9	6.9	24,219	
ベネフィットジャパン	1.2	1.5	3,048	
Ubicomホールディングス	3.2	4.6	14,283	
LINE	31.2	—	—	
カナミックネットワーク	12.7	18.7	12,342	
ノムラシステムコーポレーション	3.5	8.7	2,557	
チェンジ	4.8	31.3	92,835	
シンクロ・フード	6.5	11.1	4,218	
オークネット	8.6	9.2	12,622	
キャピタル・アセット・プランニング	—	3.7	3,944	
セグエグループ	3.3	4.7	5,419	
エイトレッド	2.4	3.4	7,612	
AOI TYO Holdings	14.3	17.6	15,804	
マクロミル	28.1	35.1	29,905	
ビーグリー	2.8	3.6	4,640	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
オロ	3.7	5.5	19,607	
ユーザーローカル	1.4	2.6	10,660	
テモナ	3.3	4	4,088	
ニーズウェル	3	4.1	2,521	
サインポスト	3	4.1	3,690	
ソルクシーズ	6.2	6.9	6,775	
フェイス	5.2	5.6	4,737	
プロトコーポレーション	12.4	20.6	23,957	
ハイマックス	1.7	5.2	5,538	
野村総合研究所	192.7	294.6	1,028,154	
サイバネットシステム	10.1	12.5	10,050	
CEホールディングス	7.7	9.7	5,238	
日本システム技術	2.4	3.3	5,078	
インテージホールディングス	17.3	21.4	33,148	
東邦システムサイエンス	3.9	4.9	4,532	
ソースネクスト	65.3	81.7	24,019	
インフォコム	15	15.6	39,639	
HEROZ	2	5	12,210	
ラクスル	11	18.5	87,042	
I P S	—	4.1	11,193	
F I G	15.7	19.7	5,673	
システムサポート	3.2	5.3	7,128	
イーゾル	6.7	9.5	10,839	
アルテリア・ネットワークス	15.2	19	30,134	
E d u L a b	—	1.7	9,452	
東海ソフト	1.2	2.9	3,799	
ウイングアーク1st	—	9	21,573	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.6	4	8,152	
サーバーワークス	—	1.7	6,460	
東名	—	1.9	2,027	
ヴィッツ	—	1.8	3,452	
トピラシステムズ	1.8	2.5	3,255	
S a n s a n	—	15.1	124,726	
L i n k - U	—	3.4	3,757	
ギフティ	—	10.3	35,071	
ベース	—	2	10,660	
フォーカスシステムズ	8.7	11.8	10,407	
クレスコ	8.4	11.3	18,972	
フジ・メディア・ホールディングス	131.1	176.2	218,135	
オービック	47.1	53.4	1,095,768	
ジャストシステム	22.1	24.2	142,780	
TDCソフト	12.2	15.2	15,473	
Zホールディングス	1,866.4	2,329.7	1,198,863	
トレンドマイクロ	60.5	90.6	502,830	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
I Dホールディングス	5.4	6.7	8,951	
日本オラクル	27.6	34.4	342,968	
アルファシステムズ	4.3	4.6	16,560	
フューチャー	16.6	20.6	41,715	
C A C H o l d i n g s	9.1	11.3	16,102	
S Bテクノロジー	5	6.2	18,817	
トーセ	4	5.1	4,176	
オービックビジネスコンサルタント	13.9	17.3	103,627	
伊藤忠テクノソリューションズ	62	77.3	266,685	
アイティフォー	16.8	22.6	17,469	
東計電算	2.1	2.6	11,843	
エックスネット	2.4	3	3,066	
大塚商会	73.6	91.8	537,948	
サイボウズ	16	20	48,640	
ソフトブレーン	8.5	—	—	
電通国際情報サービス	8.5	21.1	80,918	
A C C E S S	13	21.6	18,900	
デジタルガレージ	24.5	28.1	126,028	
EMシステムズ	19.4	28.4	23,515	
ウェザーニューズ	4.7	5.2	27,664	
C I J	9.6	12	10,116	
ビジネスエンジニアリング	1.7	1.8	5,877	
日本エンタープライズ	14.8	19	4,104	
WOWOW	6.6	8.3	19,297	
スカラ	9.4	15.6	12,495	
インテリジェント ウェイブ	8.3	10.5	7,066	
I M A G I C A G R O U P	12.3	15.2	7,767	
ネットワンシステムズ	51.8	69.3	230,422	
システムソフト	32.7	37.5	5,737	
アルゴグラフィックス	11.6	13.3	39,793	
マーベラス	21.1	27.2	22,032	
エイベックス	23.6	29.4	44,305	
日本ユニシス	42.5	58.9	186,713	
兼松エレクトロニクス	7.5	9.3	33,340	
都築電気	—	7.8	14,640	
T B Sホールディングス	82.8	112.7	207,029	
日本テレビホールディングス	113.6	141.8	185,332	
朝日放送グループホールディングス	13.9	17.4	12,336	
テレビ朝日ホールディングス	37.5	52.6	98,625	
スカパーJSATホールディングス	90	112.5	48,712	
テレビ東京ホールディングス	11.3	12.3	26,297	
日本BS放送	4.8	6.1	6,703	
ビジョン	13	21.4	21,464	
スマートバリュー	3.8	4.9	4,008	
ワイヤレスゲート	6.9	7.8	3,315	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
コネクシオ	7.9	9.9	14,513	
クロップス	2.9	3.5	2,947	
日本電信電話	1,816.3	1,983	5,813,164	
KDDI	1,012.6	1,359.6	5,053,633	
ソフトバンク	1,234.9	1,540.9	2,167,275	
光通信	14	20	435,600	
NTTドコモ	971.6	—	—	
エムティーアイ	13.6	17	11,917	
GMOインターネット	53.7	60.1	177,715	
ファイバーゲート	4.6	5.8	7,719	
アイドママーケティングコミュニケーション	4.6	5.3	2,231	
KADOKAWA	36.7	44	191,620	
学研ホールディングス	18.4	24.2	32,234	
ゼンリン	27.3	31.1	36,231	
昭文社ホールディングス	7	7.6	3,610	
インプレスホールディングス	11.2	14	3,024	
アイネット	7.2	9	12,951	
松竹	9	11.2	142,688	
東宝	80.2	100.1	453,953	
東映	5.1	5.6	127,120	
エヌ・ティ・ティ・データ	362	451.6	803,848	
ビー・シー・エー	2.4	2.6	10,933	
ビジネスブレイン太田昭和	2.4	6	10,758	
DTS	30.5	35.3	89,767	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58	72.4	423,540	
シーイーシー	14.7	18.4	25,539	
カブコン	64.1	145.4	523,440	
アイ・エス・ビー	2.8	8.1	10,683	
ジャステック	8.9	11.1	14,463	
SCSK	31.4	39.2	248,920	
日本システムウエア	4.6	5.8	13,206	
アイネス	13.6	17	22,270	
TKC	11.5	28.8	97,920	
富士ソフト	17.4	18.1	99,188	
NSD	43.8	54.7	97,037	
コナミホールディングス	49.4	61.6	432,432	
福井コンピュータホールディングス	5.4	7.9	34,128	
JBCホールディングス	9.3	11.7	15,561	
ミロク情報サービス	12.1	17	27,183	
ソフトバンクグループ	1,078.1	1,345.2	11,105,971	
卸売業(4.7%)				
ハウスイ	1.1	1.4	1,341	
高千穂交易	5.3	6.6	7,583	
オルパヘルスケアホールディングス	1.6	2.8	4,832	
伊藤忠食品	3.4	4.1	20,459	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エレマテック	12.8	13.6	16,700	
JALUX	3.9	4.8	8,280	
あらた	10.9	13.5	57,105	
トーメンデバイス	2.1	2.2	8,690	
東京エレクトロン デバイス	4.9	5.6	34,048	
フィールズ	10.4	14.9	6,943	
双日	753.2	939.8	317,652	
アルフレッサ ホールディングス	151.6	176.5	298,638	
横浜冷凍	35.7	47.7	41,689	
ラサ商事	7.2	9	8,262	
アルコニックス	14.5	18.1	27,711	
神戸物産	47.1	117.4	324,493	
ハイパー	2.1	3.5	1,918	
あい ホールディングス	19.5	24.3	52,682	
ディーブイエックス	4.9	5.2	4,997	
ダイワボウホールディングス	11.6	77.5	132,447	
マクニカ・富士エレホールディングス	32.5	40.6	98,495	
ラクト・ジャパン	5.1	7.4	19,906	
グリムス	—	5.1	9,271	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25.7	29.6	21,104	
八洲電機	10.6	13.2	12,724	
メディアスホールディングス	7.8	9.7	10,660	
レスターホールディングス	14.2	17.7	32,196	
ジューテックホールディングス	3.1	3.9	4,036	
大光	5.8	6.6	4,468	
OCHIホールディングス	4	5	6,425	
TOKAIホールディングス	72.1	82.5	72,600	
黒谷	3.8	4.7	4,638	
Cominix	2.4	3	2,238	
三洋貿易	13.7	17.2	21,826	
ビューティガレージ	2.2	2.7	9,882	
ウイン・パートナーズ	9.9	12.3	12,140	
ミタチ産業	4.1	4.7	3,031	
シッパヘルスケアホールディングス	21.9	60	155,220	
明治電機工業	4.3	5.9	8,130	
デリカフーズホールディングス	4.8	6.7	4,281	
スターティアホールディングス	3.1	3.3	4,818	
コメダホールディングス	29.7	37.1	74,867	
ビーバンドットコム	1.4	2.4	1,982	
アセンテック	1.5	4.4	5,803	
富士興産	4.2	5.2	6,484	
協栄産業	1.5	1.9	2,612	
小野建	12.2	15.3	19,890	
南陽	3	3.5	6,636	
佐島電機	9.3	10.6	8,236	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エコートレーディング	3.2	3.6	2,214	
伯東	8.3	10.4	16,255	
コンドーテック	10.6	13.2	13,226	
中山福	7.9	9.9	4,385	
ナガイレーベン	18.1	22.6	58,172	
三菱食品	15	18.7	53,743	
松田産業	10	12.4	27,776	
第一興商	20.3	33.8	144,495	
メディパルホールディングス	147.2	170.5	357,027	
S P K	5.9	7.3	9,840	
萩原電気ホールディングス	5.1	6.3	15,107	
アズワン	8.9	12.2	152,378	
スズデン	4.7	5.9	8,507	
尾家産業	4	5	5,990	
シモジマ	8.4	10.4	11,242	
ドウシシャ	12.9	16.1	26,774	
小津産業	3	3.8	7,353	
高速	8.1	9	12,780	
たけびし	4.8	6	9,426	
リックス	3.1	3.9	5,967	
丸文	12.1	15.1	8,939	
ハビネット	11.4	14.2	20,391	
橋本総業ホールディングス	2.8	3.4	9,084	
日本ライフライン	40.4	55	76,175	
タカショー	8.9	11.1	8,735	
マルカ	4.8	5.5	12,870	
I D O M	36.8	57.4	34,727	
進和	8.1	10.1	21,250	
エスケイジャパン	3	4.2	1,831	
ダイトロン	5.8	7.2	14,104	
シークス	17.4	21.7	33,895	
田中商事	4.2	5.3	3,460	
オーハシテクニカ	7.7	8.7	13,363	
白銅	4.9	6.1	11,108	
ダイコー通産	—	2	3,108	
伊藤忠商事	953.8	1,190.1	3,866,634	
丸紅	1,419.5	1,678	1,623,129	
高島	2.2	2.7	4,652	
長瀬産業	76.7	93.4	150,093	
蝶理	8.7	10.9	18,704	
豊田通商	152.2	170.9	838,264	
三共生興	20.7	25.8	13,416	
兼松	50.9	68	99,484	
ツカモトコーポレーション	2.4	2.8	3,805	
三井物産	1,180.8	1,357.4	3,276,763	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本紙パルプ商事	7.8	8.9	31,550	
カメイ	17.8	22.2	25,596	
東都水産	1.7	2	8,960	
O U Gホールディングス	2.2	2.7	7,524	
スターゼン	5	12.6	26,384	
山善	53.3	66.5	64,106	
椿本興業	2.5	3.1	10,648	
住友商事	860.4	1,073.8	1,640,766	
内田洋行	5.4	7.3	34,602	
三菱商事	957	1,036	3,091,424	
第一実業	6.7	7.7	32,956	
キャノンマーケティングジャパン	33.8	42.2	107,863	
西華産業	7.7	9	15,957	
佐藤商事	11.3	14.1	15,679	
菱洋エレクトロ	13.8	13	34,710	
東京産業	12.4	15.5	9,377	
ユアサ商事	12.9	17.4	52,287	
神鋼商事	3.4	3.8	8,838	
トルク	8.2	10.3	2,482	
阪和興業	25.5	34.1	105,539	
正栄食品工業	8.8	11	43,615	
カナデン	11.1	13.8	14,904	
菱電商事	9.8	12.3	19,557	
フルサト工業	7.5	8.6	15,497	
岩谷産業	30.3	40.8	263,568	
ナイス	5.8	6.7	13,587	
昭光通商	4.4	—	—	
ニチモウ	2.1	2.7	5,580	
極東貿易	3.9	4.9	10,633	
イワキ	17.9	24.5	17,027	
三愛石油	33.6	41.9	49,442	
稲畑産業	30	40.9	69,939	
G S I クレオス	3.4	8.4	8,559	
明和産業	12.6	15.8	7,394	
クワザワホールディングス	4.9	6.1	3,501	
ヤマエ久野	9.9	12.4	13,999	
ワキタ	29.1	33.5	37,252	
東邦ホールディングス	43.8	54.6	93,639	
サンゲツ	37.2	45.9	70,089	
ミツウロコグループホールディングス	20.1	25.1	30,521	
シナネンホールディングス	5.6	6.3	17,406	
伊藤忠エネクス	30.2	37.7	37,888	
サンリオ	38.3	47.8	86,613	
サンワテクノス	9.7	11.2	13,641	
リョーサン	15.1	18.8	38,051	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
新光商事	21.4	23	16,882	
トーヨー	6.2	7.7	12,943	
三信電気	7.3	9.1	19,428	
東陽テクニカ	14.6	16.8	18,480	
モスフードサービス	17.9	24.1	73,987	
加賀電子	13.6	15.4	45,491	
ソーダニッカ	14.1	16.3	9,454	
立花エレクトック	10.1	12.6	18,459	
フォーバル	6	6	5,322	
PAL TAC	21.9	27.3	157,794	
三谷産業	18	22.5	8,820	
西本Wismettacホールディングス	2.5	3.9	10,881	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.2	1.5	3,010	
コア商事ホールディングス	—	12.8	9,126	
国際紙パルプ商事	32.4	36.4	8,990	
ヤマタネ	6.8	7.3	10,920	
丸紅建材リース	1.3	1.7	3,058	
日鉄物産	9.7	12.1	52,030	
泉州電業	4.2	4.8	16,056	
トラスコ中山	28.4	39	107,406	
オートバックスセブン	50.6	63.1	92,126	
モリト	10	12.5	7,537	
加藤産業	19.7	24.6	80,934	
北恵	3.5	4.3	3,904	
イノテック	7.1	9.6	12,672	
イエローハット	25.8	32.2	62,274	
J Kホールディングス	12.3	15.4	12,119	
日伝	12.3	14.1	28,059	
北沢産業	10.3	11.7	2,913	
杉本商事	7.4	8.6	19,023	
因幡電機産業	38.8	45.4	115,951	
東テク	4.5	5.6	15,545	
ミスミグループ本社	170.9	213.5	751,520	
アルテック	10.9	12.6	4,460	
タキヒヨー	4.1	5.7	10,311	
蔵王産業	2.6	3.3	4,821	
スズケン	57.8	72.1	249,466	
ジェコス	9.4	11.8	10,325	
グローセル	13.7	18.5	7,696	
小売業(4.5%)				
ローソン	34.5	43.1	212,483	
サンエー	11.4	13	55,185	
カワチ薬品	10.6	12	26,640	
エービーシー・マート	21.3	26.6	166,250	
ハードオフコーポレーション	5.7	8	6,080	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アスクル	14.3	27.7	49,444	
ゲオホールディングス	24.7	23.1	25,548	
アダストリア	19	23.8	44,982	
ジーフット	8.2	—	—	
くら寿司	7.2	20.1	77,787	
キャンドウ	6.6	8.3	16,292	
アイケイ	—	5.4	4,131	
パルグループホールディングス	14.1	15.1	23,993	
エディオン	62.8	72.5	78,445	
サーラコーポレーション	28	35.2	20,662	
ワッツ	6.3	8.7	7,899	
ハローズ	5.2	7	19,334	
フジオフードグループ本社	11.6	14.3	18,833	
あみやき亭	3	3.8	10,883	
ひらまつ	25.1	—	—	
大黒天物産	3.3	5.5	41,745	
ハニーズホールディングス	12.2	13.9	13,900	
ファーマライズホールディングス	3.6	4.6	3,565	
アルペン	10.6	13.2	35,455	
ハブ	4.2	6	4,278	
クオールホールディングス	20.2	23.2	34,405	
ジンズホールディングス	7.2	11.6	92,916	
ビックカメラ	81.1	101.3	109,606	
DCMホールディングス	75.7	105.4	107,508	
MonotaRO	97	242.1	615,418	
東京一番フーズ	3.9	5	2,920	
DDホールディングス	5.4	—	—	
きちりホールディングス	3.9	4.5	2,646	
アークランドサービスホールディングス	10.1	14.4	32,731	
J、フロント リテイリング	163.1	203.5	218,966	
ドトール・日レスホールディングス	19.7	27.2	44,363	
マツモトキヨシホールディングス	56.4	70.4	332,640	
ブロンコビリー	7.2	9.1	20,911	
ZOZO	93.9	100.4	371,982	
トレジャー・ファクトリー	4.3	5.4	5,578	
物語コーポレーション	3.7	9.1	60,060	
ココカラファイン	14.3	15.2	120,688	
三越伊勢丹ホールディングス	238.7	298.2	234,087	
Hamee	5	4.6	6,872	
マーケットエンタープライズ	—	1.4	1,516	
ウエルシアホールディングス	40.6	90.1	301,384	
クリエイトSDホールディングス	23	25.2	81,144	
丸善CHIホールディングス	15.9	19.9	7,960	
ミサワ	—	4	2,756	
ティーライフ	2.2	2.6	3,720	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
チムニー	4.3	5.2	6,858	
シュッピン	9.5	12	10,908	
オイシックス・ラ・大地	13.5	22.5	69,750	
ネクステージ	19.8	30.2	48,471	
ジョイフル本田	40.1	50.1	65,480	
鳥貴族ホールディングス	4.1	6.5	11,557	
キリン堂ホールディングス	5.5	—	—	
ホットランド	9.3	13	18,057	
すかいらくホールディングス	152.9	190.9	294,367	
SFPホールディングス	7.9	8.3	10,956	
綿半ホールディングス	5.2	13.1	15,995	
ヨシックス	2.3	3.5	7,273	
ユナイテッド・スーパーマ ケット・ホールディングス	39.8	49.8	53,684	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.6	9.1	12,285	
BEENOS	6.5	8.7	31,624	
あさひ	10.3	12.9	18,085	
日本調剤	8.4	10.6	16,938	
コスモス薬品	12.1	17.2	261,956	
トーエール	6.9	8.8	6,705	
オンリー	2.7	3.8	1,729	
セブン&アイ・ホールディングス	533.5	665.7	3,152,755	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	73.5	91.5	73,383	
ツルハホールディングス	29.7	37.1	493,430	
サンマルクホールディングス	10.9	13.7	21,139	
フェリシモ	3.2	4.1	5,465	
トリドールホールディングス	33.9	42.3	71,910	
TOKYO BASE	12.9	15.9	10,700	
ウイルプラスホールディングス	2	3	3,864	
JMホールディングス	10.4	11.6	23,942	
サツドラホールディングス	2.1	2.7	5,564	
アレンザホールディングス	7.1	13.3	15,999	
串カツ田中ホールディングス	2.9	4.7	8,601	
パロックジャパニミテッド	9.8	12.3	9,618	
クスリのアオキホールディングス	12.2	17	130,560	
力の源ホールディングス	6.5	7.7	4,812	
FOOD & LIFE COMPANIES	74.9	99.7	490,524	
LIXILビバ	13.5	—	—	
メディカルシステムネットワーク	13.6	15.3	11,016	
はるやまホールディングス	6.7	8.5	5,669	
ノジマ	24.3	30.4	91,504	
カップ・クリエイト	19.1	23.9	34,726	
ライトオン	10.2	12.7	8,521	
良品計画	181.2	196	407,484	
三城ホールディングス	15.2	22.5	6,007	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アドヴァン	21	17.7	16,620	
アルビス	5.3	5.6	12,807	
コナカ	16.7	20	6,840	
ハウス オブ ローゼ	1.8	2.3	3,772	
G-7ホールディングス	8.1	8.4	24,948	
イオン北海道	18.2	22.6	23,097	
コジマ	23.9	29.7	23,789	
ヒマラヤ	5	6.3	6,369	
コーナン商事	19.5	24.3	72,778	
エコス	5.1	6.5	12,031	
ワタミ	16.3	22.4	20,406	
マルシェ	3.9	4.5	2,182	
バン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	299.8	340.3	733,686	
西松屋チェーン	30.1	37.6	57,603	
ゼンショーホールディングス	65.4	91.5	249,703	
幸楽苑ホールディングス	8.8	10.8	16,945	
ハークスレイ	3	4	3,696	
サイゼリヤ	20.3	25.4	61,569	
VTホールディングス	57.1	64.9	30,048	
魚力	3.9	5.5	10,774	
フジ・コーポレーション	3.7	9.3	11,476	
ユナイテッドアローズ	14.4	19.7	36,523	
ハイデイ日高	19.8	24.8	42,804	
京都市もの友禅	9.5	12.3	3,247	
コロワイド	45.3	56.5	107,971	
ピーシデポコーポレーション	18.4	20.6	9,064	
壳番屋	9.6	12.1	57,051	
PLANT	3.8	4.9	3,528	
スギホールディングス	27.3	34	293,080	
薬王堂ホールディングス	6	7.6	18,072	
スクロール	21.5	24.7	22,279	
ヨンドシーホールディングス	14	15.9	29,319	
ファミリーマート	109	—	—	
木曽路	17.9	22.4	51,923	
SRSホールディングス	16.3	22.4	18,211	
タカキュー	12	—	—	
リテールパートナーズ	18.2	21	23,877	
ケーヨー	28.3	31.7	23,141	
上新電機	16.1	19.7	52,008	
日本瓦斯	21.6	84.3	142,382	
ロイヤルホールディングス	23.9	29.7	60,469	
いなげや	17	19.1	28,210	
島忠	25.7	—	—	
チヨダ	14.5	18.2	15,888	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ライフコーポレーション	10.4	17.1	57,541	
リンガーハット	16.9	21	46,662	
MrMaxHD	19.2	24	14,784	
テンアライド	12.6	—	—	
AOKIホールディングス	27.6	34.6	22,040	
オークワ	21.5	26.9	29,751	
コメリ	21.1	26.4	68,244	
青山商事	28.4	38.3	32,861	
しまむら	15.9	19.8	206,316	
はせがわ	7.7	10.3	3,028	
高島屋	99.5	124.1	154,380	
松屋	27.7	37.4	34,370	
エイチ・ツー・オー リテイリング	64.8	80.8	70,942	
近鉄百貨店	5.3	6.6	20,361	
丸井グループ	125.1	144	300,240	
アクシアル リテイリング	11.4	14.2	55,380	
イオン	524.8	654.8	1,919,873	
イズミ	27.8	34.6	141,687	
平和堂	27.8	31.5	73,363	
フジ	16.5	20.6	41,982	
ヤオコー	15.5	19.3	121,011	
ゼビオホールディングス	16.7	21	19,761	
ケーズホールディングス	131.7	145.1	188,630	
Olympicグループ	7.3	9.3	7,105	
日産東京販売ホールディングス	21	26.6	6,570	
シルバーライフ	1.9	3.6	8,964	
一家ダイニングプロジェクト	1.4	—	—	
Genky DrugStores	6.1	7.6	25,308	
ナルミヤ・インターナショナル	3.3	3.6	4,082	
ブックオフグループホールディングス	7.9	9.9	9,256	
ギフト	—	2.3	5,278	
アインホールディングス	16.8	24.8	166,656	
元気寿司	3.5	4.9	12,867	
ヤマダホールディングス	415.9	571	303,772	
アークランドサカモト	21.5	26.9	39,435	
ニトリホールディングス	59	67.5	1,280,137	
グルメ杵屋	9.9	12.5	12,087	
愛眼	10.9	13.6	3,114	
ケーユーホールディングス	7.4	9.3	8,807	
吉野家ホールディングス	44.9	56.1	112,592	
松屋フーズホールディングス	6.6	8.3	28,635	
サガミホールディングス	18.4	24.4	25,180	
関西スーパーマーケット	11.5	13.2	12,936	
王将フードサービス	10	11.3	62,715	
ブレナス	15.4	19.3	37,345	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ミニストップ	10.2	12.7	17,119	
アークス	28	32.6	77,848	
パローホールディングス	30.3	34.9	77,582	
ベルク	6.8	8.5	46,835	
大庄	7.4	9.5	9,338	
ファーストリテイリング	18.2	22.8	2,033,076	
サンドラッグ	51.4	64.1	235,247	
サックスパー ホールディングス	11.9	15.1	9,271	
ヤマザワ	3.3	4.2	7,140	
やまや	2.9	3.5	7,973	
ベルーナ	29.7	36.9	40,147	
銀行業(5.2%)				
島根銀行	3.6	5.9	3,817	
じもとホールディングス	92.3	11.5	7,532	
めぶきフィナンシャルグループ	709.6	885.4	205,412	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18.4	21.4	28,954	
九州フィナンシャルグループ	298.8	348	142,680	
ゆうちょ銀行	386.9	482.7	449,393	
富山第一銀行	32.6	40.6	11,124	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	780	1,038.1	416,278	
西日本フィナンシャルホールディングス	90.9	111.3	75,016	
関西みらいフィナンシャルグループ	80.1	—	—	
三十三フィナンシャルグループ	12.7	14.7	19,271	
第四北越フィナンシャルグループ	23.7	27.7	65,621	
ひろぎんホールディングス	—	251.3	147,261	
新生銀行	100.2	138.9	236,130	
あおぞら銀行	81.4	101.5	251,009	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,341.8	11,656.2	7,226,844	
りそなホールディングス	1,498.6	1,966.4	918,702	
三井住友トラスト・ホールディングス	258.1	322.1	1,214,639	
三井住友フィナンシャルグループ	944.5	1,179.2	4,659,019	
千葉銀行	455.7	568.7	395,815	
群馬銀行	262.3	350.7	123,446	
武蔵野銀行	20.3	25.4	43,129	
千葉興業銀行	37.4	43.4	11,414	
筑波銀行	56.8	70.8	12,106	
七十七銀行	46.1	53.5	70,834	
青森銀行	10.6	13.2	28,630	
秋田銀行	8.8	10.2	14,229	
山形銀行	15.3	19.1	16,960	
岩手銀行	8.9	11.2	20,204	
東邦銀行	122.1	152.4	31,242	
東北銀行	6.5	8.2	8,429	
みちのく銀行	8.8	10.9	10,867	
ふくおかフィナンシャルグループ	115	153.8	307,907	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
静岡銀行	338.2	415	359,805	
十六銀行	17.1	21.4	42,372	
スルガ銀行	139.7	149.4	52,887	
八十二銀行	329.6	383.8	142,389	
山梨中央銀行	15.9	19.8	16,117	
大垣共立銀行	27	33.7	62,850	
福井銀行	11.7	14.6	22,016	
北國銀行	13.6	15.8	36,592	
清水銀行	5.6	7	10,969	
富山銀行	2.6	3.3	8,537	
滋賀銀行	27.4	34.2	69,049	
南都銀行	22.7	24.8	46,028	
百五銀行	122.9	153.3	47,829	
京都銀行	48.9	61	328,790	
紀陽銀行	48.4	60.3	87,314	
ほくほくフィナンシャルグループ	90.9	113.4	99,225	
広島銀行	201.6	—	—	
山陰合同銀行	81	107.4	56,277	
中国銀行	117.5	146.6	125,782	
鳥取銀行	4.7	5.4	6,080	
伊予銀行	194.9	225.8	130,286	
百十四銀行	14.5	18.1	26,281	
四国銀行	20.7	24.2	16,649	
阿波銀行	22.3	26.1	53,687	
大分銀行	7.9	9.8	16,699	
宮崎銀行	9.1	10.6	21,443	
佐賀銀行	8.3	9.7	13,434	
沖縄銀行	12.5	15.6	40,388	
琉球銀行	31.5	37	25,937	
セブン銀行	456.2	569.3	129,231	
みずほフィナンシャルグループ	18,556.6	2,315.4	3,873,664	
高知銀行	5	6.2	5,108	
山口フィナンシャルグループ	170.5	212.7	135,915	
長野銀行	4.5	5.6	6,305	
名古屋銀行	10.2	13.7	36,318	
北洋銀行	205.9	256.9	62,683	
愛知銀行	4.9	5.7	15,885	
中京銀行	5.6	6.1	8,985	
大光銀行	4.7	5.8	7,940	
愛媛銀行	19.1	23.8	19,468	
トマト銀行	5.3	6.6	6,903	
京葉銀行	58.2	72.7	29,879	
栃木銀行	66	82.3	14,320	
北日本銀行	4.3	5.3	9,126	
東和銀行	24	29.9	16,474	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
福島銀行	12.9	19.5	4,309	
大東銀行	7.1	8.2	4,969	
トモニホールディングス	105.6	131.7	39,114	
フィデアホールディングス	132.6	165.4	19,848	
池田泉州ホールディングス	157	195.9	31,344	
証券・商品先物取引業(0.8%)				
F P G	42.4	57.6	42,048	
ジャパシンベストメントアドバイザー	—	11.6	16,762	
マーキュリアインベストメント	6.4	6.9	5,112	
S B I ホールディングス	152.6	210	580,230	
ジャフコ グループ	21	26.2	208,028	
大和証券グループ本社	1,096.2	1,276.5	803,939	
野村ホールディングス	2,403.3	2,602	1,563,802	
岡三証券グループ	116.9	145.7	63,379	
丸三証券	41	50.9	33,237	
東洋証券	50.2	57.6	9,446	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	157.5	182.2	74,155	
光世証券	3.6	4.4	2,908	
水戸証券	40.4	46.2	13,906	
いちよし証券	25.9	34.5	20,838	
松井証券	78.2	83.7	69,722	
だいこう証券ビジネス	6.8	—	—	
マネックスグループ	101	153.1	124,929	
極東証券	18.7	23.1	18,849	
岩井コスモホールディングス	13.1	17.6	29,620	
藍澤證券	24.8	30.8	33,572	
マネーパートナーズグループ	15.4	19.1	4,507	
スパークス・グループ	63.9	79.5	22,339	
保険業(2.0%)				
かんぽ生命保険	48.4	211.2	443,520	
SOMPOホールディングス	256.8	300.4	1,322,961	
アニコム ホールディングス	11.3	47.9	46,127	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	357.1	413.8	1,383,333	
ソニーフィナンシャルホールディングス	112.2	—	—	
第一生命ホールディングス	772.8	900.2	2,010,146	
東京海上ホールディングス	482.8	561.2	2,906,454	
T & D ホールディングス	408.2	509.3	758,857	
アドバンスクリエイト	2.8	8.1	7,047	
その他金融業(1.1%)				
全国保証	38.5	44.4	200,022	
ジェイリース	3.8	—	—	
イントラスト	4.8	5.2	3,551	
日本モーゲージサービス	2.8	9	8,613	
C a s a	4.8	5	4,770	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アルヒ	21.7	25.3	39,721	
プレミアグループ	7.4	8	25,920	
クレディセゾン	95.7	99.7	134,495	
芙蓉総合リース	14.3	17.9	129,954	
みずほリース	21.1	26.4	91,344	
東京センチュリー	27.5	39.6	255,024	
日本証券金融	60.2	72.4	64,580	
アイフル	208.3	286.7	103,498	
リコーリース	10.7	13.5	45,697	
イオンフィナンシャルサービス	83.6	104.5	133,028	
アコム	274.5	343	167,727	
ジャックス	15.1	18.9	47,363	
オリエントコーポレーション	369.4	462.7	70,793	
日立キャピタル	32.2	—	—	
アプラスフィナンシャル	65.5	—	—	
オリックス	854.1	1,034.6	1,998,329	
三菱HCキャピタル	346.6	589.8	359,778	
九州リースサービス	6.7	8.8	5,869	
日本取引所グループ	392	460.4	1,164,812	
イー・ギャランティ	14.6	19.7	41,941	
アサックス	7.1	9.2	6,274	
NECキャピタルソリューション	5.6	7.1	14,476	
不動産業(2.0%)				
いちご	180.3	194.1	67,740	
日本駐車場開発	149.1	196.8	29,913	
スター・マイカ・ホールディングス	8.3	10.2	10,689	
SREホールディングス	—	2.8	15,540	
ADワークスグループ	25.3	34.2	5,540	
ヒューリック	293.5	362.7	446,483	
三栄建築設計	7.1	7.6	15,184	
野村不動産ホールディングス	83.9	104.1	292,208	
三重交通グループホールディングス	31.7	37.6	17,897	
サムティ	20.8	25	48,200	
ディア・ライフ	23.6	25.2	11,541	
日本商業開発	10	11.6	20,938	
プレサンスコーポレーション	—	28.9	48,205	
ハウスコム	3.8	4.2	4,981	
日本管理センター	10.7	10.4	12,989	
サンセイランディック	6.4	6.8	5,861	
フージャースホールディングス	27.2	27.8	20,433	
オープンハウス	40.4	54.4	276,896	
東急不動産ホールディングス	375	465.6	302,640	
飯田グループホールディングス	115.2	142.6	415,821	
イーグランド	5.1	4.3	4,188	
ムゲンエステート	13.2	13.5	6,844	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ハウスドゥ	6.7	8.4	8,778	
シーアールイー	4.9	5.5	8,206	
グッドコムアセット	4.5	9.2	12,502	
ジェイ・エス・ビー	3.7	3.6	12,510	
テンポイノベーション	5.6	6.6	5,643	
フェイスネットワーク	—	2.5	3,320	
パーク24	74.3	92.1	210,540	
パラカ	4.7	5.3	8,538	
三井不動産	674.5	777.2	1,981,471	
三菱地所	958	1,120.2	1,986,674	
平和不動産	25.7	29.5	122,277	
東京建物	145.3	169.2	275,457	
ダイビル	37.1	44.4	55,455	
京阪神ビルディング	23.3	30.5	41,358	
住友不動産	307.7	383.4	1,395,192	
テオーシー	29.7	35.5	25,027	
東京楽天地	2.7	3.2	12,816	
スターツコーポレーション	19.5	20.8	56,867	
フジ住宅	19.5	22.2	13,786	
空港施設	18.1	19.5	12,148	
明和地所	11.9	10.5	6,436	
ゴールドクレスト	12	16.2	28,123	
エスリード	6.7	7.6	12,357	
日神グループホールディングス	25	28.4	13,120	
日本エスコン	24.7	30.9	23,638	
タカラレーベン	62.4	71.4	24,490	
AVANTIA	10.3	10.5	9,324	
イオンモール	69.8	86.3	153,527	
毎日コムネット	5.8	8	5,576	
ファースト住建	7.9	8.5	10,599	
カチタス	34.7	42.7	130,448	
トーセイ	20.7	24.9	25,896	
穴吹興産	4.2	4.4	9,561	
サンフロンティア不動産	21.1	22.6	20,837	
エフ・ジェー・ネクスト	14.2	18.2	18,600	
インテリックス	3.8	3.8	2,971	
ランドビジネス	4.6	7.2	2,649	
サンネクスタグループ	6	6.9	6,941	
グランディハウス	15.6	15.1	6,417	
日本空港ビルデング	44	59.5	290,062	
サービス業(5.6%)				
明豊ファシリティワークス	—	7.9	6,572	
日本工営	8.9	10.4	32,812	
LIFULL	46.5	51.2	18,790	
ミクシィ	—	42.1	111,733	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ジェイエイシーリクルートメント	9	11.5	20,585	
日本M&Aセンター	100	270.9	709,758	
メンバーズ	4	5	14,475	
中広	2.1	3	1,068	
U T グループ	20.9	23.9	70,959	
アイティメディア	5.4	5.7	9,929	
タケエイ	12.8	18.6	23,975	
E・Jホールディングス	2.4	8.9	9,496	
夢真ビーネックスグループ	16.7	44.1	56,580	
コシダカホールディングス	32.1	44.6	28,410	
アルトナー	3.4	4.3	3,483	
パソナグループ	14.4	18	34,164	
C D S	3.4	4.3	6,454	
リンクアンドモチベーション	29.5	30.3	16,695	
G C A	16.2	21.9	19,359	
エス・エム・エス	41.2	56.2	164,441	
サニーサイドアップグループ	4.7	6.1	4,739	
パーソルホールディングス	132.4	165.2	342,790	
リニカル	6.5	9.7	7,110	
クックパッド	46.6	52.9	13,542	
エスクリ	4.4	—	—	
アイ・ケイ・ケイ	6.7	8.4	5,678	
学情	4.8	6	8,568	
スタジオアリス	6.7	8.4	18,790	
シミックホールディングス	6.6	9.3	13,987	
エブコ	2.9	4.3	4,097	
N J S	3	4.2	8,790	
総合警備保障	52.7	65.7	329,157	
カカコム	97.8	122	406,870	
アイロムグループ	4.7	5.9	12,201	
セントケア・ホールディング	8.9	12.3	12,336	
サイネックス	2.4	3.2	2,236	
ルネサンス	7.5	10.6	12,847	
ディップ	18.7	25.9	83,786	
デジタルホールディングス	7.3	11.6	26,633	
新日本科学	—	20.5	15,949	
ツクイホールディングス	31.4	—	—	
キャリアデザインセンター	3.2	4.4	4,831	
ベネフィット・ワン	48.2	60.2	187,222	
エムスリー	291.8	291.3	2,157,659	
ツカダ・グローバルホールディング	8.7	13.1	5,069	
プラス	1.9	—	—	
アウトソーシング	75.9	94.7	191,388	
ウェルネット	13.5	17.2	8,789	
ワールドホールディングス	4.6	5.8	15,062	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ディー・エヌ・エー	64.9	70	153,580	
博報堂DYホールディングス	184.1	229.9	416,808	
ぐるなび	23.2	29.2	16,965	
タカミヤ	14.3	20.5	10,475	
ジャパンベストレスキューシステム	10.4	11.2	7,795	
ファンコミュニケーションズ	36.7	46.1	17,702	
ライク	4.4	4.5	9,558	
ビジネス・ブレークスルー	5.9	7.5	3,270	
エスプール	34.1	42.7	36,551	
WDBホールディングス	6.1	7.6	19,380	
手間いらず	0.9	2.1	13,755	
ティア	8	10.2	4,814	
CDG	1.5	1.7	2,696	
アドウェイズ	—	27.1	23,875	
パリュエコマース	7.5	11.2	33,600	
インフォマート	145.1	167.3	153,916	
J Pホールディングス	42	48.1	13,900	
エコナックホールディングス	25.2	32.9	2,928	
E P Sホールディングス	18	25	44,950	
レッグス	3.4	4.2	10,638	
プレステージ・インターナショナル	49.7	62.3	42,737	
アミューズ	7.3	9.1	19,838	
ドリームインキュベータ	4.1	5.3	5,162	
クイック	8.3	10.5	12,873	
T A C	8.7	10.1	2,454	
ケネディクス	123.5	—	—	
電通グループ	136.4	185.7	698,232	
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.2	—	—	
びあ	3.8	—	—	
イオンファンタジー	5.2	6.5	14,144	
シーティーエス	15.1	18.9	16,461	
ネクシーズグループ	4.2	6.1	5,666	
H. U. グループホールディングス	37.1	46.3	136,353	
アルプス技研	11.8	14.7	28,665	
ダイオーズ	2.7	3.5	3,465	
日本空調サービス	14	17.7	12,921	
オリエンタルランド	140.7	175.6	2,864,036	
ダスキン	32.9	38.4	97,958	
明光ネットワークジャパン	16.9	19.9	11,482	
ファルコホールディングス	7.4	8	13,912	
ラウンドワン	37.1	56.5	84,524	
リゾートトラスト	60.7	75.8	131,058	
ビー・エム・エル	17.1	21.3	79,555	
ワタベウエディング	2.5	—	—	
りらいあコミュニケーションズ	24	25.3	30,562	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
リソー教育	60.9	84.7	26,087	
早稲田アカデミー	5.9	7.3	6,577	
ユー・エス・エス	148.2	185	354,090	
東京個別指導学院	4.9	15	8,895	
サイバーエージェント	81.5	407	894,586	
楽天グループ	616.8	770.7	967,228	
クリーク・アンド・リバー社	7	8.8	13,032	
モーニングスター	—	24.7	10,744	
テー・オー・ダブリュー	21.4	29.7	9,949	
山田コンサルティンググループ	8.7	9.8	11,485	
セントラルスポーツ	5	6.3	15,617	
フルキャストホールディングス	13.3	14.2	29,237	
エン・ジャパン	23.6	29.4	112,749	
リソルホールディングス	1.5	1.9	7,714	
テクノプロ・ホールディングス	26.4	33	259,380	
アトラグループ	3.5	3.8	1,284	
インターワークス	2.9	5.4	2,203	
アイ・アールジャパンホールディングス	5.4	6.7	92,460	
KeepPer 技研	5	10.7	24,695	
ファーストロジック	2.8	3.6	2,602	
三機サービス	2.7	3.4	3,631	
Gunosy	8.4	10.6	10,112	
デザインワン・ジャパン	4.4	5.3	1,208	
イー・ガーディアン	5.9	6.8	16,972	
リブセンス	9	10.3	2,296	
ジャパンマテリアル	40.8	51	64,209	
ベクトル	16.6	20.9	19,039	
ウチヤマホールディングス	6.9	8.9	3,284	
チャーム・ケア・コーポレーション	11.4	12.5	14,400	
ライクキッズ	2.4	—	—	
キャリアリンク	4.6	5.5	12,320	
I B J	9.2	13.8	14,434	
アサンテ	5.4	6.1	10,931	
N・フィールド	9.3	—	—	
パリュールHR	5.3	6.7	11,101	
M&Aキャピタルパートナーズ	10.8	13.6	62,900	
ライドオンエクスプレスホールディングス	5.1	6.6	9,609	
ERIホールディングス	3.9	5.1	2,993	
アビスト	2.1	2.7	7,857	
シグマックス	9.1	9.2	18,832	
ウィルグループ	8.8	12.4	11,829	
エスクロー・エージェント・ジャパン	18.9	25.6	6,246	
メドピア	—	12.8	60,096	
レアジョブ	—	3.2	5,868	
リクルートホールディングス	947.9	1,182.6	6,569,343	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エラン	7.9	23	32,085	
土木管理総合試験所	6.1	8.8	3,370	
ネットマーケティング	5.3	8.7	3,523	
日本郵政	1,084.6	1,249.3	1,137,862	
ベルシステム24ホールディングス	22.3	27.8	45,369	
鎌倉新書	10.1	16.9	20,618	
SMN	3	3.9	3,123	
一蔵	1.8	—	—	
LITALICO	4.6	—	—	
グローバルキッズCOMPANY	2.6	3.3	3,296	
エアトリ	6.9	10.3	30,148	
アトラエ	4	11.6	19,290	
ストライク	5	6.3	26,460	
ソラスト	36.6	40.7	53,113	
セラク	4.3	5.3	11,241	
インソース	5.5	16.1	34,518	
ベイカレント・コンサルティング	8	10.8	360,720	
Orchestra Holdings	2.9	3.8	11,084	
アイモバイル	4.9	4.9	6,757	
キャリアインデックス	5.8	7.2	4,946	
MS-Japan	4.4	7	7,518	
船場	2.3	3.6	2,980	
グレイステクノロジー	6.1	16.9	32,988	
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	14	47.7	109,519	
フルテック	2	2.5	3,475	
グリーンズ	3.6	6.2	3,571	
ツナググループ・ホールディングス	2.5	—	—	
GameWith	4.1	5.4	3,294	
ソウルドアウト	2.8	4.1	6,654	
MS&Consulting	2.7	3.1	1,906	
ウェルビー	—	6.3	9,072	
エル・ティー・エス	—	1.7	5,958	
ミダック	1.8	3.6	21,780	
日総工産	9	13.3	10,613	
キュービーネットホールディングス	5.5	7.7	13,860	
RPAホールディングス	10.2	19.6	14,386	
スプリックス	3.9	4.9	6,242	
マネジメントソリューションズ	5.9	8.2	16,564	
プロレド・パートナーズ	1.8	3.1	9,238	
and factory	1.4	—	—	
テノ. ホールディングス	—	2	2,312	
フロンティア・マネジメント	—	3.9	5,070	
ピアラ	—	1.4	1,575	
コプロ・ホールディングス	—	2.4	3,292	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ギークス	1.5	3	5,835
カープスホールディングス	36.5	45.6	38,988
フォーラムエンジニアリング	7	11.7	11,044
ダイレクトマーケティングミックス	—	8.9	32,307
ポピンズホールディングス	—	4.4	19,580
L I T A L I C O	—	6.7	35,778
アドバンテッジリスクマネジメント	6.8	8.7	7,090
リログループ	72.4	90.4	201,140
東祥	8.3	10.4	18,772
エイチ・アイ・エス	20.6	25.8	65,145
ラックランド	3.1	4.8	12,302
共立メンテナンス	22	27.4	100,558
イチネンホールディングス	14.9	17.4	21,106
建設技術研究所	9.2	10.7	26,728
スペース	8.7	11	9,944
長大	5.4	6.7	13,312
燦ホールディングス	5.9	7.4	8,813
スバル興業	0.8	1	8,260
東京テアトル	5.3	6.4	8,064
タナベ経営	2.6	3.4	4,821
ナガワ	4.2	5.3	44,308
よみうりランド	2.9	—	—
東京都競馬	8.7	10.9	58,642
カナモト	21.7	29.2	78,139
東京ドーム	53.7	—	—
西尾レントオール	12.3	15.3	49,342
トランス・コスモス	12.6	15.8	47,210
乃村工藝社	56.8	71.1	62,994
藤田観光	5.8	6.5	14,878
KNT-CTホールディングス	8.2	8.8	11,985
日本管財	14.2	17.8	41,847
トーカイ	12.8	16.1	38,672
白洋舎	1.6	—	—
セコム	140.4	162.7	1,394,339
セントラル警備保障	6.4	8	23,376
丹青社	25.2	31.5	26,932
メイテック	16.2	20	122,200
応用地質	14.3	18.8	23,782
船井総研ホールディングス	27.4	33.9	78,715
進学会ホールディングス	5.4	7.1	2,932
オオバ	9.6	11.9	9,270
いであ	3.3	4.2	7,585
学究社	4	5	6,615
ベネッセホールディングス	44.1	60.6	152,348
イオンディライト	16.3	20.4	67,422

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ナック	7.5	8.1	7,395
ニチイ学館	18.9	—	—
ダイセキ	22.2	27.7	114,816
ステップ	4.9	6.2	9,771
合 計	株 数 ・ 金 額	162,264	181,054
	銘柄数<比率>	2,102	2,114
			455,964,175
			<98.5%>

(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)	当 期 末	
	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	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	—
	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)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	6,749	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	455,964,175	97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,088,751	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	466,052,926	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 2021年5月31日現在
(A)資 産	466,038,871,721円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,303,888,136
株 式(評価額)	455,964,175,980
未 収 入 金	404,451,849
未 収 配 当 金	4,047,569,256
差 入 委 託 証 拠 金	318,786,500
(B)負 債	3,203,165,890
未 払 金	3,103,330,743
未 払 解 約 金	99,825,660
未 払 利 息	9,487
(C)純 資 産 総 額(A-B)	462,835,705,831
元 本	249,503,103,457
次 期 繰 越 損 益 金	213,332,602,374
(D)受 益 権 総 口 数	249,503,103,457口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,550円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A)配 当 等 収 益	8,698,722,260円
受 取 配 当 金	8,698,493,737
受 取 利 息	22,353
そ の 他 収 益 金	1,589,254
支 払 利 息	△1,383,084
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	73,878,008,087
売 買 益	86,318,327,018
売 買 損	△12,440,318,931
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	765,644,250
取 引 益	1,143,466,200
取 引 損	△377,821,950
(D)そ の 他 費 用	△6,565
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	83,342,368,032
(F)前 期 繰 越 損 益 金	101,112,686,657
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	65,108,893,068
(H)解 約 差 損 益 金	△36,231,345,383
(I)計 (E+F+G+H)	213,332,602,374
次 期 繰 越 損 益 金(I)	213,332,602,374

(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212,335,378,830円、期中追加設定元本額は91,146,447,303円、期中一部解約元本額は53,978,722,676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。

SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,538,120,296円
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)	42,587,150,766円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	24,216,585,712円
DCマイセクション50	17,856,939,441円
DCマイセクション75	17,462,256,715円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,403,753,770円
DCマイセクションS50	8,420,319,159円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,493,326,205円
分散投資コア戦略ファンドS	7,197,643,246円
DCマイセクション25	6,050,615,568円
DCマイセクションS75	5,940,925,341円
DC日本株式インデックス・オープン	5,795,526,637円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,195,855,155円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,861,892,511円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,731,672,493円
日本株式インデックス・オープン	3,598,093,148円
DC世界経済インデックスファンド	3,182,301,074円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,102,276,547円
DCマイセクションS25	2,854,636,452円
世界経済インデックスファンド	2,683,336,435円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,637,915,929円
分散投資コア戦略ファンドA	2,047,093,068円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,005,334,416円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,859,449,520円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,525,588,405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)	1,203,380,236円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,174,226,556円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,165,542,032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)	653,344,546円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	649,975,544円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	622,042,108円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	558,309,169円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	484,894,150円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	463,116,992円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	425,421,036円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	403,509,178円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	394,131,292円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	383,058,796円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	318,403,754円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	279,324,640円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	248,443,863円
グローバル経済コア	235,932,236円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	202,558,578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)	198,868,482円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	170,954,225円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	165,260,518円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	127,725,155円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	109,285,845円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	98,131,095円
SMT インデックスバランス・オープン	59,576,799円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	52,924,180円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	52,282,962円

SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	43,456,736円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	41,853,585円
SMT 世界経済インデックス・オープン	33,560,024円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	30,614,108円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	29,119,791円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	26,725,162円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,682,640円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	25,297,047円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	22,433,643円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	19,525,758円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,712,867円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,309,323円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	7,621,865円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	6,195,294円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,778,508円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	3,968,204円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2,713,907円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,358,345円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,143,472円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	801,202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29期 (決算日 2021年3月8日)
第30期 (決算日 2021年5月7日)
第31期 (決算日 2021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。)

【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			
第7		円	円	%		%	%	%	百万円
	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8	第19期(2019年 7月8日)	10,234	11	1.1	10,486	1.2	99.7	—	112,354
	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9	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10	第25期(2020年 7月7日)	9,994	9	△0.7	10,306	△0.7	99.7	0.0	101,147
	第26期(2020年 9月7日)	9,982	9	△0.0	10,305	△0.0	99.7	—	102,869
	第27期(2020年11月9日)	10,008	8	0.3	10,341	0.3	99.7	—	105,244
第11	第28期(2021年 1月7日)	9,986	7	△0.1	10,329	△0.1	99.8	—	106,985
	第29期(2021年 3月8日)	9,927	8	△0.5	10,277	△0.5	99.6	0.0	107,463
	第30期(2021年 5月7日)	9,958	9	0.4	10,321	0.4	99.7	—	108,385
	第31期(2021年 7月7日)	9,978	8	0.3	10,352	0.3	99.8	—	110,092

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

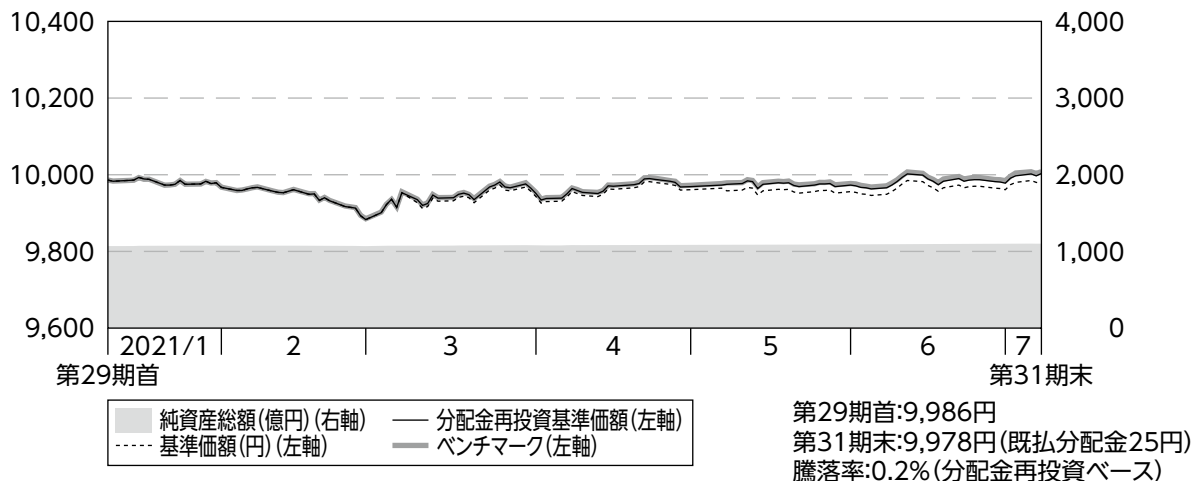
当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組入比率	債券先物 比 率
			騰 落 率		騰 落 率		
第29期	(期 首)2021年1月7日	円 9,986	% —	10,329	% —	% 99.8	% —
	1月末	9,967	△0.2	10,310	△0.2	99.7	—
	2月末	9,883	△1.0	10,225	△1.0	99.6	—
	(期 末)2021年3月8日	9,935	△0.5	10,277	△0.5	99.6	0.0
第30期	(期 首)2021年3月8日	9,927	—	10,277	—	99.6	0.0
	3月末	9,943	0.2	10,296	0.2	99.8	—
	4月末	9,961	0.3	10,315	0.4	99.7	—
	(期 末)2021年5月7日	9,967	0.4	10,321	0.4	99.7	—
第31期	(期 首)2021年5月7日	9,958	—	10,321	—	99.7	—
	5月末	9,956	△0.0	10,320	△0.0	99.7	—
	6月末	9,961	0.0	10,327	0.1	100.0	—
	(期 末)2021年7月7日	9,986	0.3	10,352	0.3	99.8	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

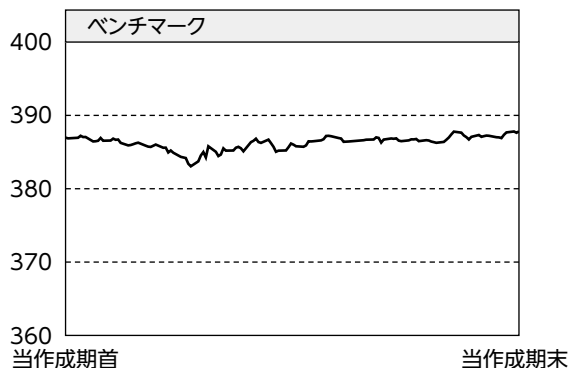


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかにについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2021年1月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2021年2月下旬にかけて、米国で追加経済支援策が早期に成立するとの観測が高まったことや新型コロナウイルスに対するワクチン普及による経済の早期正常化が意識されたことから米長期金利が上昇した影響を受けたことに加え、日銀が3月の金融政策決定会合で予定している「政策点検」に絡んで、超長期国債の買い入れを減額するとの思惑や長期金利操作幅を拡大するとの見方が強まり、国内金利が上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。その後は当作成期末にかけて、上昇が続いていた米長期金利が低下に転じたこと、また新型コロナウイルスの感染拡大を背景に東京や大阪などで3度目の緊急事態宣言が発出されたことやワクチン接種の遅れが懸念されたことから、リスク回避姿勢が高まり国内金利が低下(債券価格は上昇)推移となり、基準価額は上昇しました。

投資環境



2021年2月下旬にかけて、米国で追加経済支援策が早期に成立するとの観測が高まったことや経済の早期正常化が意識されたことから米長期金利が上昇した影響を受けたことに加え、日銀が3月の金融政策決定会合で予定している「政策点検」に絡んで超長期国債の買い入れを減額するとの思惑や長期金利操作幅を拡大するとの見方が強まり、国内金利は上昇しました。その後は当作成期末にかけて、上昇が続いていた米長期金利が低下に転じたこと、また新型コロナウイルスの感染拡大を背景に東京や大阪などで3度目の緊急事態宣言が発出されたことやワクチン接種の遅れが懸念されたことからリスク回避姿勢が高まり、国内金利は低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、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。

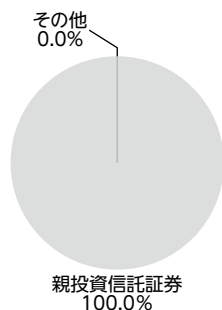
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

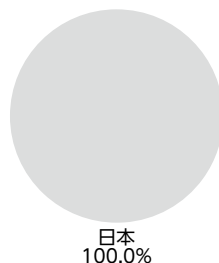
	当作成期末
	2021年7月7日
国内債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

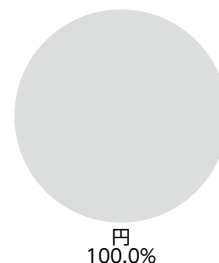
○資産別配分



○国別配分



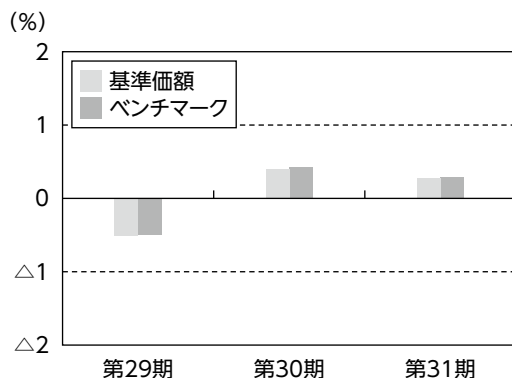
○通貨別配分



(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す。

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29期	第30期	第31期
	2021年1月8日～ 2021年3月8日	2021年3月9日～ 2021年5月7日	2021年5月8日～ 2021年7月7日
当期分配金 (円)	8	9	8
(対基準価額比率) (%)	(0.081)	(0.090)	(0.080)
当期の収益 (円)	8	9	8
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	587	590	593

(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		項目の概要
	(2021年1月8日～2021年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5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9,945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。 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 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(4)	(0.038)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.011)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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)	(－)	(－)	
(d) その他費用	0	0.001	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(－)	(－)	
合計	5	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
国内債券インデックス マザーファンド	千口	千円	千口	千円
	2, 255, 607	3, 175, 244	223, 713	315, 081

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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0. 002957	百万円 0. 002957	% 100. 0	百万円 0. 002957	百万円 0. 002957	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	8, 427	80	0. 9	8, 416	80	1. 0

(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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0. 056937	百万円 0. 056937	% 100. 0	百万円 0. 056937	百万円 0. 056937	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	129, 665	692	0. 5	129, 535	692	0. 5

<平均保有割合 17. 4%>

(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
国内債券インデックス マザーファンド	千口 75,865,204	千口 77,897,098	千円 110,037,440

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、451,427,833千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券インデックス マザーファンド	千円 110,037,440	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	251,737	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	110,289,177	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 29 期 末 2021年3月8日現在	第 30 期 末 2021年5月7日現在	第 31 期 末 2021年7月7日現在
(A) 資 産	107,570,404,493円	108,503,529,155円	110,289,177,548円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	117,854,430	93,824,779	138,157,658
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	107,409,617,771	108,330,881,940	110,037,440,921
未 収 入 金	42,932,292	78,822,436	113,578,969
(B) 負 債	106,959,313	118,462,438	196,721,778
未 払 収 益 分 配 金	86,604,636	97,960,868	88,272,444
未 払 解 約 金	599,999	612,999	88,000,000
未 払 信 託 報 酬	19,413,462	19,546,704	20,100,486
未 払 利 息	81	66	217
そ の 他 未 払 費 用	341,135	341,801	348,631
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	107,463,445,180	108,385,066,717	110,092,455,770
元 本	108,255,795,011	108,845,409,380	110,340,555,854
次 期 繰 越 損 益 金	△792,349,831	△460,342,663	△248,100,084
(D) 受 益 権 総 口 数	108,255,795,011口	108,845,409,380口	110,340,555,854口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,927円	9,958円	9,978円

■損益の状況

項 目	第 29 期 自 2021年1月8日 至 2021年3月8日	第 30 期 自 2021年3月9日 至 2021年5月7日	第 31 期 自 2021年5月8日 至 2021年7月7日
(A) 配 当 等 収 益	△2,586円	△2,385円	△5,192円
受 取 利 息	19	—	—
支 払 利 息	△2,605	△2,385	△5,192
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△534,225,204	453,135,613	326,185,299
売 買 益	55,366	461,720,801	342,785,372
売 買 損	△534,280,570	△8,585,188	△16,600,073
(C) 信 託 報 酬 等	△19,754,597	△19,888,505	△20,449,117
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△553,982,387	433,244,723	305,730,990
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△508,036,003	△1,148,604,740	△811,645,624
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	356,273,195	352,978,222	346,086,994
(配 当 等 相 当 額)	(3,301,872,758)	(3,336,902,375)	(3,431,658,471)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,945,599,563)	(△2,983,924,153)	(△3,085,571,477)
(G) 計 (D+E+F)	△705,745,195	△362,381,795	△159,827,640
(H) 収 益 分 配 金	△86,604,636	△97,960,868	△88,272,444
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△792,349,831	△460,342,663	△248,100,084
追 加 信 託 差 損 益 金	356,273,195	352,978,222	346,086,994
(配 当 等 相 当 額)	(3,302,195,842)	(3,337,082,443)	(3,432,122,756)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,945,922,647)	(△2,984,104,221)	(△3,086,035,762)
分 配 準 備 積 立 金	3,061,053,820	3,085,317,874	3,112,275,988
繰 越 損 益 金	△4,209,676,846	△3,898,638,759	△3,706,463,066

(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29期首元本額は107,133,334,600円、第29～31期中追加設定元本額は3,463,079,091円、第29～31期中一部解約元本額は255,857,837円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 29 期	第 30 期	第 31 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	106,126,023円	122,273,653円	121,585,619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	3,302,195,842円	3,337,082,443円	3,432,122,756円
(D) 分配準備積立金額	3,041,532,433円	3,061,005,089円	3,078,962,813円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	6,449,854,298円	6,520,361,185円	6,632,671,188円
(F) 期末残存口数	108,255,795,011口	108,845,409,380口	110,340,555,854口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	595円	599円	601円
(H) 分配金額(1万口当たり)	8円	9円	8円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	86,604,636円	97,960,868円	88,272,444円

分配金のお知らせ

	第29期	第30期	第31期
1万口当たり分配金	8円	9円	8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21期（決算日 2021年5月31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上げます。

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。
- ・一印は、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 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
第17期(2017年5月29日)	円	%		%	%	%	百万円
	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
第21期(2021年5月31日)	14,082	△0.4	386,621	△0.4	99.8	—	628,366

(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 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 組 入 比 率
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
(当 期 首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%
	14,136	—	388,127	—	100.5	—
6月末	14,080	△0.4	386,558	△0.4	99.9	—
7月末	14,129	△0.0	387,913	△0.1	99.8	—
8月末	14,064	△0.5	386,087	△0.5	99.7	—
9月末	14,105	△0.2	387,219	△0.2	99.9	—
10月末	14,082	△0.4	386,633	△0.4	99.8	—
11月末	14,101	△0.2	387,118	△0.3	99.8	—
12月末	14,103	△0.2	387,203	△0.2	99.8	—
2021年 1月末	14,069	△0.5	386,252	△0.5	99.7	—
2月末	13,952	△1.3	383,056	△1.3	99.7	—
3月末	14,049	△0.6	385,724	△0.6	99.9	—
4月末	14,076	△0.4	386,440	△0.4	99.8	—
(当 期 末) 2021年 5月31日	14,082	△0.4	386,621	△0.4	99.8	—

(注1) 騰落率は期首比です。

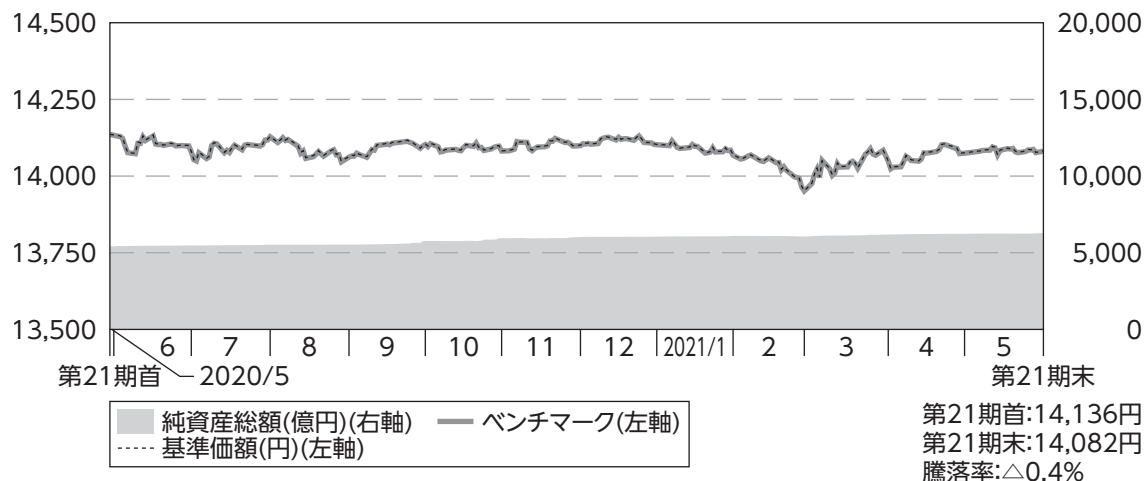
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

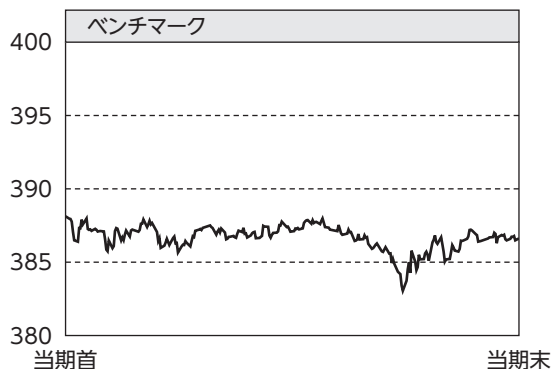


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年12月下旬にかけて、大規模な経済対策に伴う国債増発による需給悪化懸念が続いた一方で、資金運用難と見られる国内投資家の根強い債券需要や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を背景にリスク回避姿勢が強まったことなどから国内金利がレンジ内推移となり、基準価額はもみ合い推移となりました。12月下旬から2021年2月下旬にかけては、国債増発への警戒と新型コロナウイルスに対するワクチン普及による米長期金利上昇の影響や、日銀が長期金利操作幅を拡大するとの見方から国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。その後は期末にかけて、上昇が続いていた米長期金利が低下に転じた影響や、国内では新型コロナウイルスの感染拡大を背景に東京や大阪などで3度目の緊急事態宣言が発出されたことからリスク回避姿勢が高まり、国内金利が低下(債券価格は上昇)推移となったことから、基準価額は上昇しました。

投資環境



2020年12月下旬にかけて、大規模な経済対策に伴う国債増発による需給悪化懸念が続いた一方で、国内投資家の根強い債券需要や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を背景にリスク回避姿勢が強まったことなどから、国内金利はレンジ内推移となりました。12月下旬から2021年2月下旬にかけては、米長期金利上昇の影響や日銀が長期金利操作幅を拡大するとの見方から、国内金利は上昇しました。その後は期末にかけて、上昇が続いていた米長期金利が低下に転じた影響や、国内では新型コロナウイルスの感染拡大を背景に東京や大阪などで3度目の緊急事態宣言が発出されたことからリスク回避姿勢が高まり、国内金利は低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

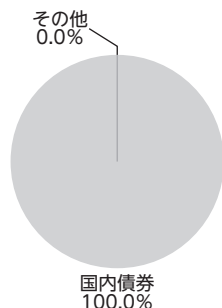
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第145回利付国債(5年)	日本	1.3%
2	第350回利付国債(10年)	日本	1.3%
3	第141回利付国債(5年)	日本	1.2%
4	第138回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第137回利付国債(5年)	日本	1.1%
6	第344回利付国債(10年)	日本	1.1%

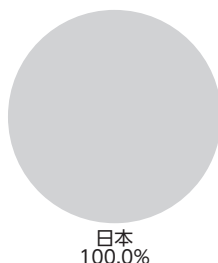
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第340回利付国債(10年)	日本	1.0%
9	第346回利付国債(10年)	日本	1.0%
10	第140回利付国債(5年)	日本	1.0%
組入銘柄数		982	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

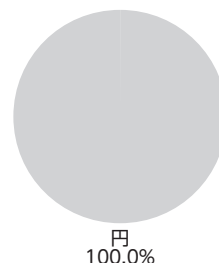
○資産別配分



○国別配分



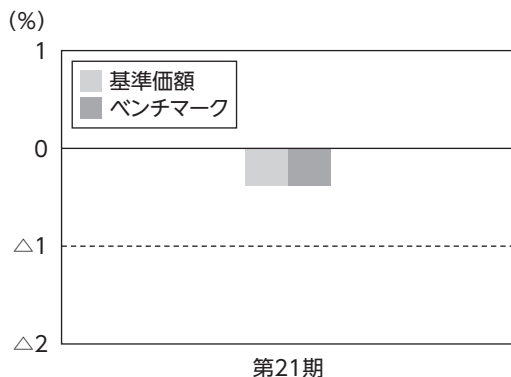
○通貨別配分



(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 (2020年5月30日~2021年5月31日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (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円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(b) 有価証券取引税 (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 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(14,078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	売	付 額
国 内	国 債 証 券	千円		千円	
	地 方 債 証 券	152, 657, 851		75, 390, 085	
	特 殊 債 券	8, 839, 229		3, 485, 669	
	社 債 券(投 資 法 人 債 券 を 含 む)	12, 721, 866		9, 396, 590 (738, 947)	
		11, 819, 019		6, 389, 293	

(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		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 28, 690	百万円 28, 688	百万円 ー	百万円 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	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
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 510	百万円 510	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	294, 472	11, 665	4.0	294, 262	11, 665	4.0

(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 B B 格 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	491,570,000 (4,080,000)	525,432,430 (4,097,299)	83.6 (0.7)	— (—)	55.7 (—)	20.4 (—)	7.4 (0.7)
地 方 債 証 券	32,321,430 (32,321,430)	34,036,521 (34,036,521)	5.4 (5.4)	— (—)	3.5 (3.5)	1.3 (1.3)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	35,448,599 (35,448,599)	36,934,695 (36,934,695)	5.9 (5.9)	— (—)	3.4 (3.4)	1.3 (1.3)	1.2 (1.2)
金 融 債 証 券	2,400,000 (2,400,000)	2,403,743 (2,403,743)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	27,826,000 (27,826,000)	28,160,874 (28,160,874)	4.5 (4.5)	— (—)	2.3 (2.3)	1.9 (1.9)	0.3 (0.3)
合 計	589,566,029 (102,076,029)	626,968,264 (105,633,133)	99.8 (16.8)	— (—)	65.0 (9.2)	25.1 (4.7)	9.7 (2.9)

(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

銘 柄 名	当 期 末			
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
国債証券				
第414回利付国債(2年)	0.1	2,360,000	2,365,994	2022/7/1
第415回利付国債(2年)	0.1	1,060,000	1,062,904	2022/8/1
第416回利付国債(2年)	0.1	4,670,000	4,684,056	2022/9/1
第417回利付国債(2年)	0.1	4,240,000	4,253,568	2022/10/1
第418回利付国債(2年)	0.1	1,040,000	1,043,546	2022/11/1
第419回利付国債(2年)	0.1	660,000	662,382	2022/12/1
第420回利付国債(2年)	0.1	1,250,000	1,254,662	2023/1/1
第421回利付国債(2年)	0.1	590,000	592,318	2023/2/1
第422回利付国債(2年)	0.1	130,000	130,557	2023/3/1
第423回利付国債(2年)	0.005	370,000	370,950	2023/4/1
第424回利付国債(2年)	0.005	570,000	571,527	2023/5/1
第133回利付国債(5年)	0.1	4,380,000	4,392,833	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	5,700,000	5,720,406	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	4,080,000	4,097,299	2023/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	4,400,000	4,421,252	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	6,760,000	6,796,706	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	7,050,000	7,092,441	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	6,070,000	6,110,062	2024/3/20

銘 柄 名	当 期 末			
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第140回利付国債(5年)	0.1	6,300,000	6,344,352	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	7,790,000	7,848,113	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	5,380,000	5,423,201	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	4,800,000	4,841,232	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	6,520,000	6,579,723	2025/6/20
第145回利付国債(5年)	0.1	8,240,000	8,318,362	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	2,460,000	2,483,640	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	1,450,000	1,457,337	2026/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	577,564	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,581,491	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	773,696	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,200,000	1,693,932	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,070,000	1,461,309	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,697,421	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,040,000	1,347,985	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,230,000	1,493,908	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	1,220,000	1,111,359	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,370,000	2,527,391	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,790,000	1,850,484	2058/3/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第12回利付国債(40年)	0.5	1,710,000	1,598,217	2059/3/20
第13回利付国債(40年)	0.5	2,250,000	2,096,685	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	200,000	199,378	2061/3/20
第325回利付国債(10年)	0.8	4,590,000	4,645,447	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	3,120,000	3,160,060	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	3,190,000	3,235,904	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	3,400,000	3,444,778	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	3,210,000	3,271,760	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,900,000	1,941,059	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	915,282	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	4,800,000	4,889,760	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	3,030,000	3,092,569	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	4,900,000	5,009,564	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,370,000	2,419,130	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	1,050,000	1,073,415	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,850,000	2,893,206	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	4,560,000	4,651,382	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	4,850,000	4,953,693	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	6,320,000	6,462,136	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	3,440,000	3,504,534	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	5,380,000	5,431,863	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	4,820,000	4,866,464	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	6,640,000	6,705,404	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	3,340,000	3,373,533	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	6,350,000	6,414,706	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,880,000	3,920,080	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,880,000	4,930,947	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	4,130,000	4,173,447	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	7,960,000	8,044,137	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	4,610,000	4,657,252	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	3,900,000	3,938,532	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,300,000	4,340,635	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	4,690,000	4,732,116	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	4,270,000	4,306,081	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	4,640,000	4,676,563	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,689,384	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	3,790,000	3,814,938	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	4,580,000	4,604,777	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	6,150,000	6,178,474	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	4,740,000	4,755,736	2030/12/20
第362回利付国債(10年)	0.1	3,300,000	3,308,019	2031/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	135,407	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	193,160	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	144,360	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	139,551	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	60,541	2031/5/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第6回利付国債(30年)	2.4	350,000	433,867	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	222,715	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	350,000	416,094	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	274,536	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	177,726	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	260,000	307,704	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	234,617	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	400,000	490,272	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	800,000	1,023,488	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	440,871	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	200,000	260,118	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	950,000	1,226,592	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	345,000	441,996	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	530,000	680,726	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	631,766	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	645,745	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	529,580	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	570,760	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	380,000	505,654	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	456,393	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	1,140,000	1,507,957	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	1,770,000	2,380,827	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	2,140,000	2,890,669	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	2,237,699	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,770,000	2,352,276	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,447,567	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,560,000	2,089,214	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,820,000	2,348,145	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,795,000	2,389,970	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,240,000	2,907,564	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	2,130,000	2,773,749	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,070,000	2,663,841	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,500,000	1,903,890	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,500,000	1,938,270	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,230,000	1,564,990	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	990,000	1,240,836	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,500,000	1,881,870	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,390,000	1,745,589	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,220,000	1,533,564	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,230,000	1,493,896	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,750,000	2,126,722	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,350,000	1,672,420	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,880,000	2,244,231	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,440,000	1,719,648	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	1,840,000	1,942,506	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,810,000	1,699,137	2046/6/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第52回利付国債(30年)	0.5	1,910,000	1,878,351	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	880,000	884,892	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	2,110,000	2,219,150	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,540,000	1,618,509	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,680,000	1,764,336	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,550,000	1,626,585	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	2,600,000	2,726,334	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	620,000	634,427	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	2,700,000	2,893,401	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,660,000	1,693,233	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	20,000	19,339	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,160,000	1,089,901	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	2,550,000	2,389,018	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	860,000	804,340	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	1,030,000	962,854	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,410,000	1,387,679	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,870,000	1,840,173	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	840,000	847,257	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	980,000	987,301	2051/3/20
第58回利付国債(20年)	1.9	300,000	307,935	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	200,000	205,680	2022/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	350,000	358,305	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	240,000	244,891	2023/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	326,121	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	207,942	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	335,011	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	231,411	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	346,272	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	137,395	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	202,410	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	414,378	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	430,940	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	214,246	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	676,393	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	387,234	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	215,844	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	141,016	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	290,819	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	313,466	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	183,982	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	293,306	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	239,885	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	425,677	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	657,486	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	319,255	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	515,265	2025/12/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	320,693	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	210,000	234,250	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,830,000	2,032,507	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	470,941	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	390,677	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	706,696	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	507,181	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	987,008	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	459,556	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	687,287	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	697,864	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,799,689	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	457,348	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	500,297	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,290,000	1,473,321	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	553,876	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	834,805	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,477,942	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	466,356	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	184,278	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,364,481	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	442,190	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	301,810	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	756,142	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	597,760	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,281,676	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,142,281	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	923,952	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	1,720,000	2,019,090	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,744,996	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	830,655	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,774,545	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,276,765	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	777,024	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	614,407	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,791,699	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,757,805	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,092,844	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,870,000	2,232,349	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	722,410	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,820,000	2,197,304	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	867,130	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,201,672	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,146,035	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	890,000	1,042,643	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,285,000	1,509,335	2031/9/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,164,370	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	1,160,000	1,353,824	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,230,000	1,448,361	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	1,130,000	1,333,818	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	1,030,000	1,204,791	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,450,000	1,680,593	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,090,000	1,277,839	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	620,000	713,322	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	730,000	847,836	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	2,200,000	2,586,210	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	1,780,000	2,096,893	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	1,040,000	1,236,986	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,800,000	2,103,840	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,440,000	1,666,368	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	2,595,000	3,071,130	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,730,000	3,237,288	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,490,000	2,927,642	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,230,000	2,599,912	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	2,860,000	3,339,278	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	3,260,000	3,769,407	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,495,000	1,691,158	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	3,290,000	3,724,312	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,570,000	2,946,299	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,700,000	3,060,558	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,800,000	3,097,052	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,600,000	2,649,972	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,780,000	2,747,863	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,430,000	2,506,593	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,930,000	3,065,160	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	2,480,000	2,629,618	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,890,000	1,973,802	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	520,000	542,557	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	2,610,000	2,720,585	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,660,000	1,700,852	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	1,640,000	1,678,228	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	900,000	949,842	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,770,000	2,827,006	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	2,430,000	2,436,050	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	1,690,000	1,661,540	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,360,000	2,315,797	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,290,000	1,263,348	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	2,830,000	2,817,661	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	3,250,000	3,232,807	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	2,420,000	2,404,899	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	1,190,000	1,202,852	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	1,670,000	1,686,700	2041/3/20
小 計		491,570,000	525,432,430	

当 銘 柄 名	期		末	
	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	106,299	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	107,560	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	132,500	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	131,132	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	127,316	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	126,274	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	300,000	343,203	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	115,002	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	116,258	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	99,770	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	233,296	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	232,900	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	200,000	2025/12/19
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	101,183	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,117	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	101,767	2023/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	200,000	203,678	2023/12/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	101,635	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,638	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,896	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,692	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	301,893	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	199,236	2029/12/20
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	101,363	2023/2/28
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,965	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,332	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	101,000	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	201,338	2028/12/28
第29回1号宮城県公募公債(10年)	0.68	100,000	101,610	2023/10/25
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	270,900	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	115,975	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	233,466	2030/11/12
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	116,280	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,412	2034/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	203,132	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,841	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,809	2027/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,692	2027/6/18
第243回神奈川県公募公債	0.075	200,000	199,152	2029/12/20
第6回大阪府公募公債(20年)	1.98	200,000	233,404	2030/9/13
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	233,532	2031/9/26
第10回大阪府公募公債(20年)	1.72	100,000	116,560	2032/9/24
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	100,000	101,066	2023/4/26
第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	101,831	2023/8/29
第377回大阪府公募公債(10年)	0.729	100,000	101,713	2023/10/30

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第389回大阪府公債券(10年)	0.53	100,000	101,740	2024/10/30
第395回大阪府公債券(10年)	0.435	151,000	153,447	2025/4/28
第399回大阪府公債券(10年)	0.529	100,000	102,158	2025/8/28
第402回大阪府公債券(10年)	0.493	100,000	102,123	2025/11/27
第407回大阪府公債券(10年)	0.09	156,000	156,556	2026/4/27
第410回大阪府公債券(10年)	0.001	200,000	199,494	2026/7/28
第439回大阪府公債券(10年)	0.193	500,000	503,270	2028/12/27
第440回大阪府公債券(10年)	0.2	100,000	100,718	2029/1/30
平成21年度第3回京都府公債券(20年)	2.19	100,000	117,170	2029/9/20
平成23年度第5回京都府公債券(20年)	1.79	100,000	116,408	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公債券	0.8	100,000	101,821	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公債券	0.553	100,000	102,199	2025/6/19
平成28年度第5回京都府公債券(20年)	0.327	100,000	99,454	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公債券(20年)	0.63	100,000	103,659	2037/8/14
第1回兵庫県公債券(12年)	1.1	100,000	103,315	2024/6/26
第2回兵庫県公債券(20年)	2.37	100,000	114,420	2027/9/17
第3回兵庫県公債券(12年)	0.56	100,000	102,091	2025/4/16
第6回兵庫県公債券(15年)	1.35	400,000	435,920	2028/7/14
第7回兵庫県公債券(15年)	1.12	100,000	107,655	2028/12/25
第8回兵庫県公債券(15年)	1.09	100,000	107,650	2029/4/16
第9回兵庫県公債券(20年)	2.25	400,000	471,052	2029/11/19
平成24年度第15回兵庫県公債券	0.75	200,000	201,764	2022/8/16
平成25年度第4回兵庫県公債券	0.82	100,000	101,773	2023/8/18
平成26年度第17回兵庫県公債券	0.46	100,000	101,645	2025/2/26
第35回兵庫県公債券(20年)	0.578	100,000	102,260	2038/5/28
令和元年度第17回兵庫県公債券	0.15	300,000	300,384	2030/1/28
第9回静岡県公債券(30年)	1.539	100,000	120,519	2045/6/20
第12回静岡県公債券(30年)	0.822	100,000	103,578	2048/3/19
第15回静岡県公債券(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15
第18回静岡県公債券(20年)	1.473	100,000	115,312	2034/7/10
平成24年度第10回静岡県公債券	0.678	100,000	101,208	2023/3/22
平成29年度第5回静岡県公債券	0.19	100,000	100,753	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公債券	0.21	100,000	100,873	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公債券	0.215	100,000	100,971	2027/9/17
平成29年度第14回静岡県公債券(5年)	0.04	100,000	100,053	2023/3/20
平成21年度第5回愛知県公債券(20年)	2.28	100,000	117,457	2029/6/20
平成24年度第18回愛知県公債券(10年)	0.801	150,000	152,073	2023/2/28
平成24年度第19回愛知県公債券(10年)	0.639	100,000	101,147	2023/3/28
平成25年度第2回愛知県公債券(10年)	0.576	100,000	101,077	2023/4/26
平成26年度第3回愛知県公債券(10年)	0.665	100,000	101,909	2024/4/30
平成26年度第5回愛知県公債券(10年)	0.66	200,000	203,888	2024/5/28
平成27年度第17回愛知県公債券(10年)	0.38	100,000	101,733	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公債券(10年)	0.07	100,000	100,151	2026/6/29
平成29年度第6回愛知県公債券(10年)	0.22	200,000	201,926	2027/7/28

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成29年度第12回愛知県公債券(20年)	0.606	300,000	309,552	2037/11/20
平成30年度第1回愛知県公債券(10年)	0.185	100,000	100,790	2028/4/27
平成30年度第6回愛知県公債券(30年)	0.777	100,000	102,341	2048/6/19
令和元年度第16回愛知県公債券(10年)	0.09	200,000	199,310	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公債券(10年)	0.145	100,000	100,020	2030/7/31
平成20年度第1回広島県公債券(20年)	2.34	100,000	116,466	2028/9/21
平成21年度第1回広島県公債券(20年)	2.21	200,000	233,352	2029/5/28
平成24年度第4回広島県公債券	0.81	100,000	101,197	2022/11/28
平成27年度第4回広島県公債券	0.476	125,230	127,847	2025/11/25
平成29年度第1回広島県公債券	0.175	100,000	100,715	2027/5/25
第3回埼玉県公債券(20年)	2.42	100,000	114,190	2027/6/18
第5回埼玉県公債券(20年)	2.35	100,000	115,494	2028/3/17
第6回埼玉県公債券(20年)	2.26	200,000	231,768	2028/9/21
第6回埼玉県公債券(30年)	0.957	100,000	107,202	2046/12/20
第7回埼玉県公債券(20年)	2.29	200,000	235,098	2029/6/22
第8回埼玉県公債券(15年)	0.367	200,000	200,484	2036/4/18
第10回埼玉県公債券(20年)	1.94	200,000	233,466	2030/11/12
第18回埼玉県公債券(20年)	0.323	200,000	199,094	2036/5/20
平成24年度第9回埼玉県公債券	0.844	100,000	101,394	2023/1/31
平成25年度第11回埼玉県公債券	0.655	100,000	101,818	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公債券	0.469	100,000	102,098	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公債券	0.085	100,000	100,239	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公債券	0.249	100,000	101,109	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公債券	0.19	100,000	100,755	2027/6/22
平成19年度第1回福岡県公債券(20年)	2.38	100,000	114,368	2027/8/20
平成20年度第2回福岡県公債券(20年)	2.05	100,000	114,744	2028/12/20
平成22年度第1回福岡県公債券(15年)	1.67	100,000	107,429	2025/11/21
平成23年度第1回福岡県公債券(20年)	2.008	100,000	118,145	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債券(15年)	1.491	100,000	107,953	2026/11/27
平成24年度第1回福岡県公債券(30年)	2.12	100,000	131,560	2042/9/19
平成26年度第4回福岡県公債券(20年)	1.249	100,000	112,663	2035/2/23
平成27年度第7回福岡県公債券	0.464	100,000	102,075	2025/12/25
平成30年度第1回福岡県公債券(30年)	0.777	100,000	102,341	2048/6/19
平成30年度第1回福岡県公債券(20年)	0.639	100,000	103,435	2038/8/20
令和2年度第1回福岡県公債券	0.155	300,000	300,408	2030/6/24
令和3年度第2回福岡県公債券	0.155	100,000	100,000	2031/5/30
第5回千葉県公債券(20年)	2.26	200,000	231,768	2028/9/21
第6回千葉県公債券(20年)	2.26	100,000	116,901	2029/4/20
第13回千葉県公債券(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15
平成25年度第5回千葉県公債券	0.84	100,000	101,856	2023/8/25
平成26年度第7回千葉県公債券	0.429	100,000	101,566	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公債券	0.549	100,000	102,143	2025/5/23
平成28年度第4回千葉県公債券	0.085	100,000	100,238	2026/9/25
平成28年度第6回千葉県公債券	0.18	120,000	120,844	2027/1/25
令和元年度第7回千葉県公債券	0.08	300,000	298,701	2030/2/25
令和3年度第1回長野県公債券(10年)	0.19	100,000	100,389	2031/4/16

当		期		末	
銘	柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成29年度第1回岐阜県公債(10年)		0.205	100,000	100,926	2027/10/29
第112回共同発行市場公募地方債		0.84	220,000	222,094	2022/7/25
第113回共同発行市場公募地方債		0.77	200,000	201,876	2022/8/25
第116回共同発行市場公募地方債		0.8	100,000	101,175	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債		0.72	200,000	202,218	2022/12/22
第119回共同発行市場公募地方債		0.8	400,000	405,488	2023/2/24
第121回共同発行市場公募地方債		0.57	100,000	101,064	2023/4/25
第125回共同発行市場公募地方債		0.82	200,000	203,622	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	101,610	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,615	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債		0.76	200,000	203,980	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債		0.66	100,000	101,776	2024/2/23
第132回共同発行市場公募地方債		0.66	300,000	305,490	2024/3/25
第134回共同発行市場公募地方債		0.674	112,000	114,216	2024/5/24
第135回共同発行市場公募地方債		0.659	100,000	101,991	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債		0.611	100,000	101,893	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債		0.566	100,000	101,795	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債		0.505	100,000	101,724	2024/11/25
第145回共同発行市場公募地方債		0.406	200,000	203,088	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債		0.553	200,000	204,318	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債		0.553	125,400	128,225	2025/7/25
第152回共同発行市場公募地方債		0.496	100,000	102,180	2025/11/25
第156回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	100,456	2026/3/25
第157回共同発行市場公募地方債		0.08	100,000	100,357	2026/4/24
第159回共同発行市場公募地方債		0.07	200,000	200,302	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債		0.05	200,000	200,102	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債		0.06	400,000	400,416	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債		0.05	100,000	100,054	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債		0.18	100,000	100,704	2027/1/25
第167回共同発行市場公募地方債		0.245	100,000	101,087	2027/2/25
第171回共同発行市場公募地方債		0.185	200,000	201,452	2027/6/25
第174回共同発行市場公募地方債		0.145	194,300	195,337	2027/9/24
第175回共同発行市場公募地方債		0.215	100,000	100,988	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債		0.18	300,000	302,265	2028/4/25
平成24年度第2回熊本県公債(10年)		0.8	200,000	202,222	2022/10/26
平成29年度第1回熊本県公債(5年)		0.01	100,000	99,997	2022/7/28
平成29年度第1回静岡市公債		0.22	100,000	101,033	2027/11/24
第13回大阪市公債(20年)		2.08	200,000	234,944	2030/6/14
第22回大阪市公債(20年)		0.347	300,000	299,661	2036/5/30
第24回大阪市公債(20年)		0.655	100,000	104,121	2037/4/21
令和3年度第2回大阪市公債		0.16	200,000	200,098	2031/5/21
第1回名古屋市公債(30年)		2.53	100,000	129,978	2035/3/20
第5回名古屋市公債(30年)		2.49	100,000	134,601	2039/3/18
第9回名古屋市公債(20年)		2.07	100,000	114,895	2028/12/20
第11回名古屋市公債(30年)		1.774	100,000	125,280	2044/9/20
第481回名古屋市公債(10年)		0.744	100,000	101,142	2022/12/20

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499回名古屋市公債(10年)		0.225	100,000	100,986	2027/3/26
第512回名古屋市公債(10年)		0.15	300,000	300,402	2030/6/20
平成24年度第2回京都市公債		0.849	122,500	123,780	2022/8/29
平成24年度第4回京都市公債		0.801	100,000	101,101	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債		0.854	100,000	101,410	2023/1/31
平成28年度第6回京都市公債		0.18	200,000	201,410	2027/1/27
平成18年度第3回神戸市公債(20年)		2.54	120,000	135,126	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公債(20年)		2.38	200,000	232,114	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公債(20年)		2.233	100,000	118,122	2030/1/29
平成24年度第12回神戸市公債(20年)		1.711	100,000	116,853	2032/12/17
令和2年度第9回神戸市公債(30年)		0.674	100,000	98,421	2050/6/20
第5回横浜市の公債(20年)		2.17	100,000	108,755	2025/6/20
第20回横浜市の公債(20年)		2.1	300,000	349,608	2029/10/19
平成28年度第4回横浜市の公債		0.175	100,000	100,675	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市の公債		0.24	100,000	101,076	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市の公債		0.195	100,000	100,855	2028/4/17
平成30年度第4回横浜市の公債		0.289	200,000	202,988	2028/10/17
第30回横浜市の公債(20年)		1.376	200,000	228,428	2034/10/20
令和2年度第1回横浜市の公債		0.15	300,000	300,399	2030/6/12
令和3年度第2回横浜市の公債		0.16	100,000	100,049	2031/5/23
平成23年度第9回札幌市公債(15年)		1.493	100,000	108,176	2027/2/12
平成24年度第10回札幌市の公債(10年)		0.8	100,000	101,229	2022/12/20
平成26年度第9回札幌市の公債(10年)		0.43	100,000	101,491	2024/12/20
第11回川崎市の公債(20年)		1.84	100,000	115,688	2030/10/18
第89回川崎市の公債		0.16	100,000	100,581	2026/12/18
平成26年度第2回北九州市公債		0.451	100,000	101,534	2024/12/24
平成27年度第2回北九州市公債		0.484	100,000	102,109	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公債		0.08	100,000	100,309	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市の公債(20年)		2.14	100,000	116,747	2029/9/18
平成35年度第6回福岡市の公債(20年)		1.511	100,000	115,548	2034/2/17
平成26年度第5回福岡市の公債		0.539	200,000	203,606	2024/10/28
平成30年度第5回福岡市の公債(5年)		0.03	200,000	200,088	2023/8/17
平成30年度第9回福岡市の公債(10年)		0.289	100,000	101,500	2028/10/30
平成25年度第3回広島市の公債		0.67	150,000	152,706	2024/2/23
平成26年度第2回広島市の公債		0.456	100,000	101,589	2024/12/25
平成28年度第4回広島市の公債		0.165	105,000	105,640	2026/12/25
平成29年度第6回広島市の公債		0.23	170,000	171,881	2028/2/25
令和元年度第6回広島市の公債		0.115	550,000	549,285	2030/2/25
令和2年度第3回広島市の公債(5年)		0.02	200,000	200,086	2025/10/24
令和元年度第5回千葉市の公債		0.08	200,000	199,134	2030/2/25
平成24年度第1回徳島県公債		0.68	100,000	101,215	2023/3/24
平成24年度第2回岡山県公債(10年)		0.68	150,000	151,836	2023/3/29
平成24年度第1回岡山県公債(10年)		0.844	200,000	202,788	2023/1/31
平成26年度第1回岡山県公債(10年)		0.33	200,000	202,344	2025/1/30

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	114,152	2027/12/20
小 計		32,321,430	34,036,521	
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	202,882	2023/2/24
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	126,000	126,086	2026/3/13
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	100,775	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	210,726	2027/9/24
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	189,025	2028/9/15
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	102,000	103,855	2023/6/27
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	410,000	415,006	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	300,000	313,518	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	100,359	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	143,259	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	233,232	2029/9/28
第94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	117,752	2029/11/30
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	131,191	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	118,739	2030/12/27
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	101,021	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	303,543	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	116,320	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	101,419	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	304,350	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	202,450	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	302,000	305,204	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	628,000	635,787	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	203,652	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	150,749	2023/9/29
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.699	100,000	101,679	2023/10/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	265,800	270,214	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	200,000	203,546	2023/12/28
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	422,000	430,359	2024/1/31

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
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	101,809	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	230,482	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	103,974	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	101,950	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	101,871	2024/7/31
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	200,000	229,120	2034/9/29
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	101,807	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	101,628	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	303,408	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	111,573	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	224,768	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	202,914	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	100,658	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	94,500	2046/5/31
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	106,911	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	317,055	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	206,043	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	100,669	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	201,298	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	100,741	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	121,209	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	201,394	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	309,939	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	216,424	2028/10/31
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.834	200,000	202,786	2023/1/20
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	101,425	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	202,450	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	101,051	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	101,214	2023/5/16

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第5 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	101,831	2023/8/14
第5 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	105,000	106,718	2023/11/17
第5 7 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	203,556	2024/2/16
第5 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	101,784	2024/3/15
第7 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	101,672	2025/12/12
第8 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	100,069	2026/3/13
第9 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,359	2026/12/14
第9 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	100,000	100,506	2027/1/19
第9 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,618	2027/4/16
第9 8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,772	2027/7/16
第9 9 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,729	2027/8/13
第1 0 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	111,103	2028/2/15
第1 1 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	157,689	2028/8/15
第1 1 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,128	2028/10/16
第1 1 9 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.001	300,000	299,949	2023/3/20
第1 2 9 回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	95,187	2070/7/16
第1 4 回道路債券	1.91	100,000	102,956	2022/12/20
第1 7 回道路債券	1.54	100,000	102,381	2022/12/20
第2 2 1 回道路債券	2.75	100,000	129,097	2033/6/20
第2 7 回道路債券	2.42	400,000	426,888	2024/3/20
第2 8 回道路債券	2.83	200,000	262,004	2033/12/20
第3 3 回道路債券	2.91	200,000	265,924	2034/6/20
第3 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	115,413	2028/3/17
第3 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	151,178	2048/3/20
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	116,209	2028/6/20
第4 2 回道路債券	2.22	100,000	108,325	2025/3/21
第4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	117,752	2029/4/20
第9 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	116,795	2032/9/17
第1 0 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.666	200,000	202,364	2023/3/20
第1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	900,000	911,430	2023/3/20
第1 0 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	101,853	2023/3/20
第1 1 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.85	300,000	305,115	2023/6/20
第1 1 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	101,656	2023/9/20
第1 3 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	114,323	2034/6/20
第1 4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,600	2024/12/20
第1 5 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	130,540	2055/3/19
第1 5 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	224,070	2035/6/20
第1 8 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	616,824	2037/9/18

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第2 0 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	108,573	2058/3/19
第2 回公営企業債券 (3 0 年)	2.39	300,000	376,761	2033/12/20
第3 回公営企業債券 (2 0 年)	1.03	210,000	213,872	2023/3/22
第3 回地方公共団体金融機構債券 (1 5 年)	1.176	100,000	107,967	2029/1/26
第5 回公営企業債券 (3 0 年)	2.72	300,000	392,910	2034/9/22
第7 回公営企業債券 (2 0 年)	2.2	100,000	106,119	2024/3/22
第7 回公営企業債券 (3 0 年)	2.67	100,000	131,598	2035/6/20
第8 回公営企業債券 (2 0 年)	2.25	40,000	42,503	2024/3/22
第8 回公営企業債券 (3 0 年)	2.5	100,000	129,643	2035/9/21
第8 回地方公共団体金融機構債券 (2 0 年)	2.043	200,000	233,596	2030/6/28
第1 1 回地方公共団体金融機構債券 (3 0 年)	0.633	200,000	194,342	2050/8/26
第1 9 回地方公共団体金融機構債券 (2 0 年)	1.84	200,000	233,480	2031/12/26
第2 4 回地方公共団体金融機構債券 (2 0 年)	1.702	100,000	116,056	2032/9/28
第3 8 回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	504,765	2022/7/28
第4 2 回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,183	2022/11/28
第4 4 回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	202,592	2023/1/27
第5 8 回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,029	2024/3/28
第6 5 回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	305,262	2024/10/28
第6 7 回地方公共団体金融機構債券	0.501	100,000	101,716	2024/12/27
第6 9 回地方公共団体金融機構債券	0.478	100,000	101,714	2025/2/28
第7 6 回地方公共団体金融機構債券	0.505	200,000	204,190	2025/9/26
F 7 7 回地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	107,750	2026/10/20
F 8 8 回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	100,026	2026/9/28
F 9 5 回地方公共団体金融機構債券	1.336	100,000	104,848	2025/2/6
F 1 0 7 回地方公共団体金融機構債券	1.388	100,000	105,195	2025/3/19
第1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,184	2029/1/26
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	104,452	2025/7/30
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	209,818	2025/10/28
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	103,927	2026/2/4
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	104,996	2027/4/28
第7 回阪神高速道路債券	2.18	100,000	108,090	2025/3/21
第2 2 回阪神高速道路株式会社債	0.005	200,000	199,944	2023/3/20
第4 回株式会社日本政策金融公社債	2.2	100,000	116,819	2029/9/20
第1 8 回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	119,185	2031/5/9
第8 5 回株式会社日本政策金融公社債	0.001	300,000	299,961	2022/8/8
第8 7 回株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,894	2024/3/11
第1 1 7 回都市再生債券	0.804	200,000	211,328	2030/11/20
第1 5 9 回都市再生債券	0.43	200,000	170,600	2059/3/19
第1 6 1 回都市再生債券	0.687	100,000	93,465	2059/3/19
第5 回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	107,737	2024/12/20
第3 4 4 回東京交通債券	1.67	100,000	102,842	2023/2/17
第3 4 6 回東京交通債券	1.13	20,000	20,453	2023/6/20
第5 9 回独立行政法人福祉医療機構債券	0.001	100,000	99,985	2022/12/20
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,614	11,884	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	11,973	12,283	2037/11/10

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	12,220	12,575	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	170,388	170,260	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	121,776	121,763	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	12,037	12,336	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	12,964	13,381	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	219,867	219,262	2033/4/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	10,412	10,473	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	21,718	22,034	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	12,853	13,257	2038/11/10
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.06	239,190	238,240	2034/2/10
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.14	85,152	85,070	2034/2/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	11,487	11,732	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	13,445	13,923	2039/5/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	277,119	276,722	2034/6/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	11,519	11,766	2037/5/10
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	191,114	190,974	2034/8/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	13,492	13,988	2039/11/10
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	114,225	2027/12/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	17,727	18,806	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	18,079	19,246	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	20,103	21,519	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	21,975	23,396	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	24,025	25,726	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	24,731	26,435	2044/12/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	53,036	56,620	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	11,727	11,963	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	24,116	25,504	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	11,871	12,125	2041/2/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	11,635	11,931	2041/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	25,284	26,759	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	10,835	10,996	2041/9/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	25,463	27,004	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	24,570	25,986	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,799	13,297	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	52,836	55,660	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	28,334	29,903	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	12,608	13,034	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	38,124	40,247	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	36,086	38,035	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	35,943	37,917	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	78,650	82,793	2047/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	86,012	89,828	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	43,793	45,692	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	44,048	46,334	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	44,455	46,814	2048/2/10

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	38,448	40,330	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	38,348	39,936	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	44,052	46,425	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	177,618	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	117,438	122,828	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	158,420	164,951	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	44,774	46,547	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	46,185	48,049	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	46,920	48,682	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	116,874	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	149,076	154,639	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	50,949	52,672	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	107,012	109,922	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	59,449	61,271	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	63,247	64,993	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	62,965	65,018	2050/6/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	194,613	201,768	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	130,992	135,660	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	63,697	65,844	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	68,722	71,103	2051/1/10
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	74,782	75,068	2051/5/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	79,920	80,417	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	79,777	80,104	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	80,101	80,769	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	80,443	81,468	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	81,184	82,097	2052/2/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	82,887	83,793	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	83,619	84,630	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	83,142	83,924	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	83,565	84,375	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	84,074	84,936	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	169,582	170,960	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	84,134	84,967	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	171,258	173,381	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	85,536	86,393	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	171,114	172,561	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	86,396	87,273	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	174,142	175,507	2053/7/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	174,894	176,251	2053/8/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	129,508	2043/3/20
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	88,538	89,714	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	88,771	90,135	2053/11/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	88,785	89,418	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	181,280	181,811	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	90,679	90,859	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,658	90,969	2054/5/10

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	182,760	183,070	2054/6/10
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	92,456	91,915	2054/7/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	278,994	275,961	2054/9/10
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	187,094	185,024	2054/10/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	94,910	95,269	2055/2/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	95,465	95,524	2055/3/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	195,232	196,362	2055/9/10
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	98,274	98,678	2055/11/10
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	197,188	198,045	2055/12/10
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	197,600	198,103	2056/1/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	99,077	99,581	2056/2/10
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	198,976	200,818	2056/3/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	200,000	201,644	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	100,000	100,641	2056/6/10
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	96,864	2036/7/18
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	0.753	100,000	99,708	2051/3/20
第60回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,978	2022/9/20
第62回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,984	2023/2/20
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	108,140	2025/6/20
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	117,307	2033/9/20
第48回東日本高速道路株式会社債	0.09	600,000	600,648	2022/12/20
第64回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	99,581	2029/11/29
第67回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	200,426	2030/1/31
第73回東日本高速道路株式会社債	0.21	500,000	500,065	2030/7/17
第73回中日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	100,020	2022/7/29
第83回中日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	100,037	2023/4/20
第27回西日本高速道路株式会社債	0.58	100,000	102,229	2025/9/2
第28回東日本高速道路株式会社債	0.566	100,000	102,259	2025/11/5
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	101,534	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	99,947	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	199,204	2034/5/30
第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.001	200,000	199,970	2022/12/20
小 計		35,448,599	36,934,695	
金融債券				
い第823号商工債	0.17	200,000	200,668	2023/12/27
い第829号商工債	0.13	200,000	200,366	2024/6/27
い第832号商工債	0.06	200,000	199,932	2024/9/27
い第833号商工債	0.05	100,000	99,880	2024/10/25
い第843号商工債	0.12	200,000	200,252	2025/8/27
第337回信金中金債（5年）	0.11	100,000	100,125	2022/12/27
第338回信金中金債（5年）	0.11	100,000	100,124	2023/1/27
第339回信金中金債（5年）	0.11	200,000	200,260	2023/2/27
第342回信金中金債（5年）	0.11	100,000	100,148	2023/5/26
第350回信金中金債（5年）	0.08	100,000	100,106	2024/1/26

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第360回信金中金債（5年）	0.01	200,000	199,788	2024/11/27
第236号商工債（3年）	0.02	300,000	299,961	2022/9/27
第254号商工債（3年）	0.05	300,000	300,084	2024/3/27
第2回信金中金債（10年）	0.52	100,000	102,049	2025/9/26
小 計		2,400,000	2,403,743	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	101,878	2025/3/25
第507回中部電力株式会社社債	0.605	100,000	102,251	2026/1/23
第511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	100,306	2026/7/24
第519回中部電力株式会社社債	0.84	100,000	104,330	2037/1/23
第540回中部電力株式会社社債	0.53	100,000	98,234	2040/2/24
第508回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	101,397	2027/4/23
第510回関西電力株式会社社債	0.49	200,000	203,172	2027/7/23
第511回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	101,085	2027/9/17
第524回関西電力株式会社社債	0.514	100,000	101,657	2028/10/25
第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	100,832	2030/12/20
第538回関西電力株式会社社債	0.39	100,000	100,327	2031/1/24
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	102,553	2025/7/25
第398回中国電力株式会社社債	0.425	100,000	101,376	2027/7/23
第400回中国電力株式会社社債	0.34	100,000	100,842	2027/9/24
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,576	2024/10/25
第416回中国電力株式会社社債	0.355	200,000	201,316	2029/5/25
第425回中国電力株式会社社債	0.37	100,000	100,664	2030/6/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	104,578	2026/6/25
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	101,171	2027/6/25
第330回北陸電力株式会社社債	0.34	200,000	201,160	2029/5/25
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	129,548	2023/12/25
第481回東北電力株式会社社債	0.803	100,000	102,863	2025/7/25
第496回東北電力株式会社社債	0.355	100,000	100,967	2027/9/24
第508回東北電力株式会社社債	0.465	100,000	101,544	2029/4/25
第521回東北電力株式会社社債	0.45	200,000	202,446	2030/5/24
第527回東北電力株式会社社債	0.32	100,000	100,000	2031/2/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	101,968	2023/6/23
第309回四国電力株式会社社債	0.4	100,000	100,918	2030/5/24
第314回四国電力株式会社社債	0.29	100,000	99,952	2031/5/23
第449回九州電力株式会社社債	0.43	200,000	202,856	2027/4/23
第465回九州電力株式会社社債	0.38	100,000	100,970	2028/7/25
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	101,324	2028/8/25
第484回九州電力株式会社社債	0.375	200,000	201,240	2029/11/22
第489回九州電力株式会社社債	0.44	100,000	101,047	2030/5/24
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	100,000	102,948	2025/12/25
第340回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	101,542	2027/4/23
第350回北海道電力株式会社社債	0.754	100,000	102,028	2038/3/25
第39回大成建設株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,923	2030/6/14
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	100,134	2027/11/30

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.03	200,000	199,416	2023/11/27
第7回住友林業株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,964	2024/3/6
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	300,000	300,015	2026/6/3
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,251	2024/9/13
第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,768	2023/11/27
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,399	2024/6/13
第13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	0.001	200,000	199,826	2023/10/13
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	101,864	2025/2/28
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.09	200,000	200,010	2026/6/3
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,088	2025/8/29
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	100,280	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	101,973	2024/4/24
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	100,144	2028/10/20
第10回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.47	100,000	100,041	2028/5/26
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	101,906	2024/7/29
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	99,849	2023/8/30
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	100,000	100,476	2030/4/22
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.19	200,000	200,870	2025/12/19
第13回旭化成株式会社無担保社債	0.12	100,000	100,060	2025/6/19
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	100,887	2028/11/29
第9回イビデン株式会社無担保社債	0.03	100,000	99,755	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	100,326	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	100,803	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	200,182	2027/2/26
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.19	200,000	200,770	2025/6/11
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.09	100,000	100,005	2026/6/3
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.74	100,000	100,037	2041/6/3
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	100,610	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	399,756	2022/9/27
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.01	200,000	199,714	2023/11/27
第4回株式会社電通グループ無担保社債	0.22	100,000	100,147	2025/7/8
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	100,000	100,404	2030/7/8
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	99,981	2026/3/6

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第42回D I C株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,043	2023/4/17
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	97,664	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	199,924	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	102,573	2024/10/23
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,014	2024/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	100,326	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	100,000	100,247	2026/4/17
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,806	2026/6/19
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債	0.26	100,000	99,369	2026/5/27
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	300,258	2025/7/14
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.15	100,000	100,030	2024/6/20
第8回株式会社タダノ無担保社債	0.28	100,000	99,963	2025/7/17
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	99,361	2030/3/12
第1回株式会社安川電機無担保社債	0.13	100,000	100,030	2026/5/20
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,168	2025/7/16
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	100,000	99,879	2030/7/16
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,501	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	203,004	2026/9/18
第20回パナソニック株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,980	2023/12/22
第21回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	100,000	100,232	2025/12/24
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	100,000	2028/3/17
第19回株式会社デンソー無担保社債	0.001	300,000	299,637	2023/11/20
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,677	2024/9/3
第35回三菱重工株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,022	2027/8/27
第11回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,198	2023/9/7
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,134	2022/8/4
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,051	2026/2/4
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	200,000	198,440	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	199,818	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	100,156	2023/9/25
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	100,005	2026/3/11
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	101,888	2024/3/14
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	97,080	2040/3/9
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	102,053	2024/5/30
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	100,638	2027/7/12
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	117,546	2033/3/4
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	200,542	2029/7/11
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,461	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	101,007	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	100,091	2029/12/12
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 (劣後特交付)	2.91	100,000	117,956	2029/10/16

銘柄名	当 期		期 末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	112,322	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	101,202	2023/1/23
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	101,395	2024/9/12
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	100,000	101,370	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	304,266	2024/7/16
第3回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,311	2025/7/15
第4回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,242	2025/10/7
第16回N T T ファイナンス株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,872	2025/12/19
第18回N T T ファイナンス株式会社無担保社債	0.38	200,000	202,018	2030/9/20
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	99,706	2026/6/19
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	200,000	199,762	2023/9/19
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.16	100,000	100,133	2025/9/19
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.14	100,000	99,959	2025/12/19
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.11	100,000	100,065	2025/10/21
第37回リコーリース株式会社無担保社債	0.02	300,000	299,751	2022/10/11
第41回リコーリース株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,836	2026/4/17
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.19	200,000	199,832	2023/3/20
第30回株式会社ジャックス無担保社債	0.28	100,000	100,258	2026/1/27
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	104,117	2026/9/18
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,337	2023/12/20
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,906	2024/1/19
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,534	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	100,186	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	201,946	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	101,478	2028/1/18
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.474	100,000	101,412	2028/10/18
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	100,190	2027/8/27
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	200,000	200,304	2023/9/4
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	201,292	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,610	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	97,476	2039/8/5
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,275	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	102,238	2024/9/9
第131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	101,897	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	104,199	2026/6/17

銘柄名	当 期		期 末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,710	2023/11/27
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	99,557	2046/9/26
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	100,627	2040/6/11
第64回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,618	2023/11/27
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	103,568	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	99,438	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	96,257	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	101,134	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	101,044	2028/9/7
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	112,326	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	232,632	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	99,717	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	107,440	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	107,859	2058/9/27
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.265	100,000	100,523	2030/4/22
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.836	100,000	99,557	2050/12/16
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.596	100,000	100,365	2041/4/15
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	115,235	2028/3/17
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	101,830	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	105,371	2047/8/30
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.13	500,000	501,385	2025/5/21
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.582	100,000	100,028	2041/4/22
第74回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	130,484	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	124,111	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	111,957	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	106,659	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	93,198	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	92,630	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	193,404	2049/11/19
第6回株式会社日生物流無担保社債	0.25	100,000	99,878	2025/9/4
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,022	2024/12/6
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,669	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,190	2028/11/22
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.3	400,000	400,020	2026/6/3
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	107,774	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	102,323	2023/12/20
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	101,918	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	101,279	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	100,744	2028/7/20
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	200,000	204,602	2029/10/9

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	400,000	404,336	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	103,005	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.64	300,000	303,633	2026/10/8
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	103,076	2032/10/8
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.4	100,000	100,077	2026/4/22
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	100,000	100,241	2031/4/22
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.805	100,000	98,942	2050/9/9
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.225	200,000	200,262	2030/9/10
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	200,000	200,098	2031/6/3
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	100,019	2041/6/3
第27回株式会社エス・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	101,619	2023/6/20
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,033	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	100,694	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	202,712	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	0.384	100,000	100,324	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行（BFCEM）円貨社債	0.25	300,000	299,619	2024/10/10
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	100,252	2024/6/28

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第2回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	100,000	100,674	2023/7/12
第14回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	100,180	2026/6/17
第15回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	100,264	2024/1/26
第17回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,992	2023/1/25
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	100,177	2024/6/7
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	399,688	2023/7/6
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,905	2023/6/2
小 計		27,826,000	28,160,874	
合 計		589,566,029	626,968,264	

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比	率	
公 社 債	千円 626,968,264		% 97.2	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,254,472		2.8	
投 資 信 託 財 産 総 額	645,222,736		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 2021年5月31日現在
(A)資 産	645,322,783,404円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,444,560,667
公 社 債(評価額)	626,968,264,763
未 収 入 金	14,534,188,600
未 収 利 息	1,253,652,398
前 払 費 用	22,069,976
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B)負 債	16,956,612,883
未 払 金	16,722,426,420
未 払 解 約 金	134,135,091
未 払 利 息	4,372
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純 資 産 総 額(A-B)	628,366,170,521
元 本	446,205,859,601
次 期 繰 越 損 益 金	182,160,310,920
(D)受 益 権 総 口 数	446,205,859,601口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,082円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A)配 当 等 収 益	4,288,930,766円
受 取 利 息	4,289,443,397
支 払 利 息	△512,631
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△6,376,403,467
売 買 益	264,590,045
売 買 損	△6,640,993,512
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,244,740
取 引 益	6,749,940
取 引 損	△8,994,680
(D)そ の 他 費 用	△4,604
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△2,089,722,045
(F)前 期 繰 越 損 益 金	158,033,529,561
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	32,991,162,844
(H)解 約 差 損 益 金	△6,774,659,440
(I) 計 (E+F+G+H)	182,160,310,920
次 期 繰 越 損 益 金(I)	182,160,310,920

(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382,125,773,582円、期中追加設定元本額は80,683,811,289円、期中一部解約元本額は16,603,725,270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 101,057,000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	92,758,841,858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)	77,436,978,713円
DC日本債券インデックス・オープンP	69,290,781,589円
DCマイセクション50	27,468,404,443円
分散投資コア戦略ファンドS	26,474,515,732円
分散投資コア戦略ファンドA	26,190,440,582円
DCマイセクション25	24,259,996,622円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,498,916,841円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,119,889,697円
DCマイセクションS50	12,370,734,258円
DCマイセクションS25	11,081,370,502円
DCマイセクション75	7,952,503,833円
グローバル・バランスファンド・シリーズ3	6,023,231,385円

SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,701,103,587円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,511,595,997円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,494,948,162円
DC世界経済インデックスファンド	2,900,386,752円
DCマイセクションS75	2,628,230,250円
世界経済インデックスファンド	2,422,718,815円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,836,449,848円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,538,051,502円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,264,891,633円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,147,086,631円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,109,102,036円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	968,655,807円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	823,729,199円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	667,635,127円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	438,924,206円
DC日本債券インデックス・オープン	436,898,315円
グローバル経済コア	195,080,047円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	191,715,196円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	146,968,465円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	135,459,099円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	123,749,905円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	83,726,323円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	61,620,608円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	54,145,348円
SMT インデックスバランス・オープン	53,437,052円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	44,597,302円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	40,798,833円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	39,906,749円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	38,416,976円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	35,911,181円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,348,303円
SMT 世界経済インデックス・オープン	23,069,358円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	21,131,825円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	15,062,826円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,063,855円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	11,186,019円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,355,501円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2030	5,983,140円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,191,061円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2040	2,930,513円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,651,160円
エマージング株式オープン	2,227,240円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,015,770円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2050	816,513円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型) 2060	279,511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29期～第31期(2021年1月8日～2021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)	税分	込配	騰落率	騰落率				
	円		金	%	%	%	%	%	百万円
17期(2019年3月7日)	13,555	60		12.9	145.65	96.5	0.8	2.6	43,824
18期(2019年5月7日)	14,075	30		4.1	151.69	96.4	0.9	2.6	44,356
19期(2019年7月8日)	14,032	100		0.4	152.43	95.7	1.6	2.7	47,613
20期(2019年9月9日)	13,654	40	△	2.4	148.99	96.0	1.1	2.8	47,978
21期(2019年11月7日)	14,385	35		5.6	157.38	96.3	1.0	2.7	47,357
22期(2020年1月7日)	15,043	30		4.8	164.96	95.9	1.3	2.7	44,771
23期(2020年3月9日)	12,858	60	△	14.1	141.65	95.3	1.8	2.9	37,378
24期(2020年5月7日)	12,496	25	△	2.6	138.13	96.0	0.9	2.5	41,386
25期(2020年7月7日)	14,264	65		14.7	158.43	96.0	1.5	2.5	46,430
26期(2020年9月7日)	15,021	40		5.6	167.29	96.3	1.2	2.4	46,454
27期(2020年11月9日)	14,979	30	△	0.1	167.40	96.2	1.4	2.3	46,493
28期(2021年1月7日)	16,325	40		9.3	182.84	96.4	1.4	2.1	48,397
29期(2021年3月8日)	17,361	40		6.6	195.08	96.5	1.4	2.1	48,692
30期(2021年5月7日)	19,036	35		9.8	214.58	95.8	1.9	2.2	50,029
31期(2021年7月7日)	19,854	90		4.8	225.08	96.5	1.2	2.3	50,171

* 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、いかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目録見書には、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 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率		騰 落 率			
第29期	(期 首)	円	%		%	%	%	%
	2021年1月7日	16,325	—	182.84	—	96.4	1.4	2.1
	1月末	16,594	1.6	186.17	1.8	96.3	1.5	2.2
	2月末	17,153	5.1	192.86	5.5	96.2	1.1	2.2
	(期 末)							
第30期	2021年3月8日	17,401	6.6	195.08	6.7	96.5	1.4	2.1
	(期 首)							
	2021年3月8日	17,361	—	195.08	—	96.5	1.4	2.1
	3月末	18,256	5.2	205.30	5.2	95.9	1.9	2.2
	4月末	19,111	10.1	215.02	10.2	95.8	2.0	2.2
第31期	(期 末)							
	2021年5月7日	19,071	9.8	214.58	10.0	95.8	1.9	2.2
	(期 首)							
	2021年5月7日	19,036	—	214.58	—	95.8	1.9	2.2
	5月末	19,356	1.7	218.31	1.7	95.9	1.8	2.2
第31期	6月末	19,839	4.2	223.85	4.3	95.8	1.9	2.2
	(期 末)							
	2021年7月7日	19,944	4.8	225.08	4.9	96.5	1.2	2.3

*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+22.7%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの+23.1%を0.4ポイント下回りました。新型コロナウイルスのワクチン普及による経済正常化への期待が高まったことや欧米の企業決算や経済指標が堅調だったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

【運用経過】

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

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】の運用につきましては、株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、当作成期を通じ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、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ない、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ないます。

【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ないます。

※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

(2021年 1 月 8 日～2021年 7 月 7 日)

項 目	第29期～第31期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 16	% 0.087	(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)	(13)	(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)	(2)	(0.011)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.003	(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)	(0.003)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.004	(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)	(0)	(0.002)	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	18	0.095	
作成期間の平均基準価額は、18,384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

(2021年1月8日～2021年7月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第29期～第31期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 29,912	千円 109,995	千口 2,267,616	千円 8,503,693

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2021年1月8日～2021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29期～第31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	85,782,956千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	901,771,417千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09

*(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

(2021年1月8日～2021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

(2021年1月8日～2021年7月7日)

第29期首残高 (元本)	設定元本	解約元本	第31期末残高 (元本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2021年7月7日現在)

親投資信託残高

銘柄	第28期末	第31期末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 14,364,210	千口 12,126,506	千円 50,166,146

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年7月7日現在)

項 目	第31期末	
	評 価 額	比 率
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千円 50,166,146	% 99.5
コール・ローン等、その他	247,440	0.5
投資信託財産総額	50,413,586	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31期末における外貨建て純資産（1,048,930,057千円）の投資信託財産総額（1,056,523,025千円）に対する比率は99.3%です。

*外貨建て資産は、第31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=110.46円、1カナダドル=88.58円、1英ポンド=152.38円、1スイスフラン=119.45円、1スウェーデンクローナ=12.84円、1ノルウェークローネ=12.67円、1デンマーククローネ=17.55円、1ユーロ=130.53円、1香港ドル=14.22円、1シンガポールドル=81.97円、1豪ドル=82.73円、1ニュージーランドドル=77.43円、1新シェケル=33.7168円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第29期末	第30期末	第31期末
	2021年3月8日現在	2021年5月7日現在	2021年7月7日現在
	円	円	円
(A) 資産	49,155,787,161	50,199,686,963	50,413,586,408
コール・ローン等	35,235,075	17,964,854	19,500,286
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	48,687,323,260	50,024,407,507	50,166,146,692
未収入金	433,228,826	157,314,602	227,939,430
(B) 負債	463,673,446	170,295,408	242,368,921
未払収益分配金	112,189,387	91,986,009	227,428,278
未払解約金	336,999,996	63,612,994	—
未払信託報酬	14,217,491	14,425,932	14,665,671
未払利息	13	8	14
その他未払費用	266,559	270,465	274,958
(C) 純資産総額(A-B)	48,692,113,715	50,029,391,555	50,171,217,487
元本	28,047,346,947	26,281,717,023	25,269,808,699
次期繰越損益金	20,644,766,768	23,747,674,532	24,901,408,788
(D) 受益権総口数	28,047,346,947口	26,281,717,023口	25,269,808,699口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,361円	19,036円	19,854円

(注) 第29期首元本額は29,647,226,685円、第29～31期中追加設定元本額は166,776,177円、第29～31期中一部解約元本額は4,544,194,163円、1口当たり純資産額は、第29期1.7361円、第30期1.9036円、第31期1.9854円です。

○損益の状況

項 目	第29期	第30期	第31期
	2021年1月8日～ 2021年3月8日	2021年3月9日～ 2021年5月7日	2021年5月8日～ 2021年7月7日
	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 449	△ 353	△ 717
支払利息	△ 449	△ 353	△ 717
(B) 有価証券売買損益	3,029,824,066	4,508,256,076	2,308,155,432
売買益	3,141,094,177	4,685,318,834	2,348,413,498
売買損	△ 111,270,111	△ 177,062,758	△ 40,258,066
(C) 信託報酬等	△ 14,484,050	△ 14,696,397	△ 14,940,629
(D) 当期損益金 (A + B + C)	3,015,339,567	4,493,559,326	2,293,214,086
(E) 前期繰越損益金	9,419,535,669	11,540,895,616	15,289,731,560
(F) 追加信託差損益金	8,322,080,919	7,805,205,599	7,545,891,420
(配当等相当額)	(10,259,910,140)	(9,620,252,898)	(9,288,857,144)
(売買損益相当額)	(△ 1,937,829,221)	(△ 1,815,047,299)	(△ 1,742,965,724)
(G) 計 (D + E + F)	20,756,956,155	23,839,660,541	25,128,837,066
(H) 収益分配金	△ 112,189,387	△ 91,986,009	△ 227,428,278
次期繰越損益金 (G + H)	20,644,766,768	23,747,674,532	24,901,408,788
追加信託差損益金	8,322,080,919	7,805,205,599	7,545,891,420
(配当等相当額)	(10,260,092,804)	(9,620,347,822)	(9,289,023,597)
(売買損益相当額)	(△ 1,938,011,885)	(△ 1,815,142,223)	(△ 1,743,132,177)
分配準備積立金	12,322,685,849	15,942,468,933	17,355,517,368

* 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19期(計算期間：2020年4月1日～2021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ない、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）は行ないませんでした。
- (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56.9%の上昇となったのに対して、基準価額は56.8%の上昇となりました。

【今後の運用方針】

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

*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

(2020年4月1日～2021年3月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 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)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.006	(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)	(0.005)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	3	0.009	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.008)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	6	0.017	
期中の平均基準価額は、30,149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

(2020年4月1日～2021年3月31日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 79,265 (31,411)	千米ドル 749,342 (18,392)	百株 53,899 (3,468)	千米ドル 399,285 (28,262)
	カナダ	14,061 (△ 950)	千カナダドル 54,569 (ー)	9,065 (439)	千カナダドル 23,633 (978)
	イギリス	58,322 (27,201)	千英ポンド 32,903 (12,718)	47,971 (18,850)	千英ポンド 18,858 (2,488)
	スイス	4,537 (58)	千スイスフラン 32,105 (△ 232)	2,921 (116)	千スイスフラン 16,682 (760)
	スウェーデン	8,077 (390)	千スウェーデンクローナ 140,085 (273)	3,784 (ー)	千スウェーデンクローナ 51,047 (273)
	ノルウェー	1,556	千ノルウェークローネ 25,531	784	千ノルウェークローネ 11,654
	デンマーク	1,328 (2,286)	千デンマーククローネ 62,169 (4,458)	657 (1,960)	千デンマーククローネ 30,755 (1,028)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	5,870 (704)	32,171 (△ 511)	3,151 (99)	12,699 (ー)
	イタリア	13,005 (1,689)	8,944 (1,178)	9,367 (910)	3,674 (ー)
	フランス	5,163 (△ 366)	27,505 (△ 93)	2,870 (397)	14,636 (993)
	イギリス	ー (2,399)	ー (10,629)	ー (2,399)	ー (10,629)
	オランダ	2,542 (230)	15,630 (△ 9,460)	2,283 (1,689)	6,383 (1,178)
	スペイン	9,215 (72,268)	5,679 (1,555)	18,448 (69,600)	5,130 (1,160)
	ベルギー	400 (53)	2,883 (347)	230	1,249
	オーストリア	222	521	289	815
	ルクセンブルグ	294 (194)	382 (ー)	410	186
	フィンランド	2,479	3,627	1,561	2,275
	アイルランド	388 (87)	2,454 (630)	2,738	1,182

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユーロ	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ポルトガル	825 (4,524)	333 (150)	290 (4,170)	126 (33)
	香港	21,168 (△ 2,737)	千香港ドル 84,642 (ー)	16,737 (1,340)	千香港ドル 56,690 (3,681)
	シンガポール	10,124 (4,583)	千シンガポールドル 3,503 (825)	19,153 (1,155)	千シンガポールドル 3,773 (132)
	オーストラリア	20,689 (2,210)	千豪ドル 36,530 (469)	17,558 (932)	千豪ドル 16,453 (52)
	ニュージーランド	1,020	千ニュージーランドドル 1,178	1,580	千ニュージーランドドル 813
	イスラエル	33	千新シェケル 1,999	8	千新シェケル 636

*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。

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	アメリカ	証券 ー (17,750)	千米ドル ー (82)	証券 17,750	千米ドル 77
	スイス	ー (170,600)	千スイスフラン ー (18)	170,600	千スイスフラン 30

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分です。

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口 千米ドル	口 千米ドル	口 千米ドル
	AGNC INVESTMENT CORP	13,000	184	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,500	713	—
	AMERICAN TOWER CORP	7,300	1,731	3,000
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	46,000	300	22,000
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,300	524	2,500
	BOSTON PROPERTIES	2,400	180	2,100
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,500	128	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	10,100	1,630	2,500
	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,200	1,050	2,700
	DUKE REALTY CORP	5,600	228	—
	EQUINIX INC	2,330	1,781	770
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,900	179	—
	EQUITY RESIDENTIAL	5,600	335	3,000
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,430	312	800
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	11,100
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12,300	335	—
	INVITATION HOMES INC	7,000	203	—
	IRON MOUNTAIN INC	5,900	162	—
	KIMCO REALTY CORP	—	—	65,000
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16,000	352	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,700	210	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	—	27,900
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4,300	138	—
	PROLOGIS INC	16,700	1,685	8,500
	PUBLIC STORAGE	4,500	1,014	2,500
	REALTY INCOME CORP	5,700	334	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,400	709	2,070
	SL GREEN REALTY CORP	—	—	12,500
	SIMON PROPERTY GROUP INC	6,900	536	—
	SUN COMMUNITIES INC	3,500	530	—
	UDR INC	4,700	158	4,900
	VENTAS INC	14,900	604	7,800
	VEREIT INC	25,000	165	—
	VEREIT INC	(△185,000)	(△ 962)	—
	VEREIT INC	(37,000)	(962)	—
	VICI PROPERTIES INC	19,000	406	—
	WELLTOWER INC	10,800	631	5,900
	WEYERHAEUSER CO	6,000	180	—
	小 計	280,460 (△148,000)	17,643 (—)	187,540
	カナダ	千カナダドル	千カナダドル	千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	153	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	16,000
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	—	—	20,000
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	11,000
	小 計	3,400	153	47,000
	イギリス	千英ポンド	千英ポンド	千英ポンド
	SEGRO PLC	17,000	162	—
	小 計	17,000	162	—

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	フランス				
	ICADE	—	—	5,200	322
	KLEPIERRE	—	—	—	—
		(—)	(△ 27)	—	—
	COVIVIO	1,900	109	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,800	176	—	—
	小 計	4,700	286	5,200	322
		(—)	(△ 27)		
	ユ ー ロ 計	4,700	286	5,200	322
		(—)	(△ 27)		
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	62,000	3,986	39,000	2,594
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	100,000	746	—	—
	小 計	162,000	4,733	39,000	2,594
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
		(316,779)	(547)	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	139,200	446	60,000	196
		(19,240)	(44)		
	ASCENDAS REAL ESTATE-RTS	—	—	—	—
		(19,240)	(56)	(19,240)	(0.58799)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
				(439,972)	(655)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	420,000	861	—	—
		(7,980)	(12)	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS	—	—	—	—
		(7,980)	(15)	(7,980)	(0.04308)
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
		(—)	(△ 2)	—	—
	小 計	559,200	1,307	60,000	196
		(371,219)	(674)	(467,192)	(656)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	GPT GROUP	45,000	175	—	—
	LENDLEASE GROUP	23,000	297	—	—
	STOCKLAND TRUST GROUP	112,000	393	60,000	236
	GOODMAN GROUP	43,000	729	14,000	180
	SCENTRE GROUP	220,000	566	270,000	762
	VICINITY CENTRES	200,000	283	—	—
	小 計	643,000	2,446	344,000	1,180

*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 128,672	百万円 124,008	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

(2020年4月1日～2021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	169,458,786千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	712,894,879千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23

*(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4月1日～2021年3月31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。

○組入資産の明細

(2021年3月31日現在)

外国株式

銘柄	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		1,147	1,089	5,644	624,879	保険
AES CORP		1,010	1,100	2,956	327,347	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC		11,424	11,810	36,292	4,017,901	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES		2,768	2,937	35,170	3,893,734	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC		2,316	2,926	31,246	3,459,328	バイオテクノロジー
ABIOMED INC		72	72	2,231	247,009	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC		1,208	1,290	11,953	1,323,332	娯楽
ACUITY BRANDS INC		62	—	—	—	電気設備
ADOBE INC		757	794	36,999	4,096,205	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS		109	109	2,028	224,537	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES		1,663	1,993	15,146	1,676,902	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC		490	519	6,479	717,311	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIRBNB INC-CLASS A		—	87	1,592	176,357	ホテル・レストラン・レジャー
AIR PRODUCTS		347	363	10,258	1,135,745	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES		258	274	2,772	306,924	情報技術サービス
ALBEMARLE CORP		167	197	2,864	317,093	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		342	369	5,662	626,873	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC		118	125	6,590	729,670	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP		23	23	1,478	163,693	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		66	—	—	—	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP		376	409	2,215	245,238	電力
ALLSTATE CORP		506	496	5,808	643,076	保険
ALLY FINANCIAL INC		574	630	2,898	320,837	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		175	187	2,526	279,756	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C		483	492	101,132	11,196,386	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL A		468	498	101,955	11,287,453	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALTICE USA INC-A		200	360	1,188	131,523	メディア
ALTRIA GROUP INC		2,931	3,105	15,916	1,762,085	タバコ
AMAZON.COM INC		658	706	215,917	23,904,209	インターネット販売・通信販売
AMERCO		11	17	1,052	116,537	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION		391	415	3,375	373,667	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		146	—	—	—	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER		777	834	7,066	782,330	電力
AMERICAN EXPRESS CO		1,079	1,136	16,300	1,804,624	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		125	125	1,454	161,069	保険
AMERICAN INTL GROUP		1,378	1,450	6,864	759,946	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC		283	306	4,493	497,487	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP		239	257	3,059	338,755	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC		203	192	4,469	494,847	資本市場
AMETEK INC		355	373	4,753	526,261	電気設備
AMGEN INC		930	961	24,000	2,657,147	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A		464	1,004	6,585	729,051	電子装置・機器・部品
ANALOG DEVICES INC		581	618	9,431	1,044,139	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC		134	145	4,812	532,781	ソフトウェア
ANTHEM INC		394	409	14,891	1,648,613	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION		541	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC		—	275	1,296	143,549	資本市場
APPLE INC		6,940	28,174	337,806	37,398,531	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	1,436	1,507	19,102	2,114,863	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	410	390	1,494	165,410	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	884	938	5,431	601,268	食品
ARCONIC INC	570	—	—	—	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC	81	96	2,869	317,633	通信機器
ARROW ELECTRS INC	121	121	1,324	146,604	電子装置・機器・部品
ASSURANT INC	90	102	1,476	163,412	保険
ATMOS ENERGY CORP	184	202	1,997	221,151	ガス
AUTODESK INC.	342	367	9,851	1,090,646	ソフトウェア
AUTOLIV INC	119	140	1,306	144,640	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	679	706	13,265	1,468,571	情報技術サービス
AUTOZONE	36	37	5,373	594,912	専門小売り
AVALARA INC	—	131	1,640	181,592	ソフトウェア
AVANTOR INC	—	840	2,389	264,574	ライフサイエンス・ツール/サービス
AVERY DENNISON CORP	134	134	2,481	274,717	容器・包装
BAKER HUGHES CO	1,010	1,110	2,412	267,035	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	475	551	4,657	515,643	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	13,370	12,900	50,297	5,568,391	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,279	1,343	6,427	711,599	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC.	755	855	7,317	810,075	ヘルスケア機器・用品
BECTON, DICKINSON	420	484	11,867	1,313,817	ヘルスケア機器・用品
BEIGENE, LTD ADR	63	—	—	—	バイオテクノロジー
WR BERKLEY CORP	217	239	1,824	201,940	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	2,055	2,272	58,660	6,494,333	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	363	393	4,547	503,486	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	36	36	2,053	227,343	ライフサイエンス・ツール/サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	280	306	2,293	253,943	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	283	252	6,955	770,038	バイオテクノロジー
BLACK KNIGHT INC	242	270	1,966	217,731	情報技術サービス
BLACKROCK INC	181	254	19,053	2,109,433	資本市場
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	1,040	1,126	8,360	925,596	資本市場
BOEING CO	838	885	22,302	2,469,152	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC	65	67	15,760	1,744,845	インターネット販売・通信販売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	226	226	1,825	202,090	情報技術サービス
BORGWARNER INC	296	404	1,879	208,113	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,193	2,350	9,155	1,013,616	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,670	3,742	23,690	2,622,786	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	179	194	2,967	328,566	情報技術サービス
BROADCOM INC	622	668	30,498	3,376,528	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	388	388	1,785	197,638	保険
BROWN-FORMAN CORP-CL B	478	527	3,689	408,409	飲料
BURLINGTON STORES INC	105	114	3,473	384,572	専門小売り
CBOE GLOBAL MARKETS INC	179	179	1,739	192,622	資本市場
CBRE GROUP INC	483	548	4,335	480,013	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	200	—	—	—	ソフトウェア
CDW CORPORATION	224	239	3,939	436,108	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	353	353	1,603	177,543	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	201	220	2,151	238,227	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	580	595	14,625	1,619,144	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CME GROUP INC	562	600	12,296	1,361,334	資本市場
CMS ENERGY CORP	433	482	2,941	325,616	総合公益事業
CSX CORP	1,162	1,279	12,325	1,364,580	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	2,040	2,184	16,615	1,839,543	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CABLE ONE INC	—	8	1,451	160,727	メディア

銘柄	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	
CABOT OIL & GAS CORP		640	640	1,202	133,135	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC		446	469	6,137	679,516	ソフトウェア
CAMPBELL SOUP CO		248	309	1,587	175,767	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		723	766	9,847	1,090,238	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC		443	472	2,939	325,444	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC		261	279	3,789	419,552	専門小売り
CARLYLE GROUP INC/THE		—	220	816	90,385	資本市場
CARNIVAL CORP		621	1,290	3,437	380,604	ホテル・レストラン・レジャー
CARRIER GLOBAL CORP		—	1,390	5,888	651,864	建設関連製品
CARVANA CO		—	102	2,595	287,392	専門小売り
CATALENT INC		—	280	2,899	321,054	医薬品
CATERPILLAR INC DEL		868	899	20,953	2,319,805	機械
CELANESE CORP-SERIES A		196	195	2,954	327,043	化学
CENTENE CORP		921	975	6,374	705,726	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC		754	940	2,143	237,273	総合公益事業
CENTURYLINK INC		1,480	—	—	—	各種電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC		—	216	1,769	195,874	ソフトウェア
CERNER CORP		499	520	3,725	412,425	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		235	230	14,583	1,614,539	メディア
CHENIERE ENERGY INC		364	364	2,628	290,954	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP		2,960	3,190	33,791	3,741,075	石油・ガス・消耗燃料
CHEWY INC - CLASS A		—	123	988	109,456	インターネット販売・通信販売
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		41	44	6,272	694,398	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC		375	398	3,499	387,398	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP		246	246	2,584	286,181	保険
CISCO SYSTEMS		6,638	7,002	36,249	4,013,165	通信機器
CINTAS CORP		134	143	4,823	534,013	商業サービス・用品
CITIGROUP		3,421	3,457	25,222	2,792,357	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP		700	700	3,134	347,031	銀行
CITRIX SYSTEMS INC		199	198	2,740	303,358	ソフトウェア
CLOROX CO		193	213	4,128	457,098	家庭用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A		—	329	2,164	239,667	ソフトウェア
COCA COLA CO		6,368	6,765	35,955	3,980,685	飲料
COGNEX CORP		278	278	2,273	251,666	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP		866	875	6,874	761,117	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.		1,265	1,363	10,812	1,197,071	家庭用品
COMCAST CORP-CL A		7,104	7,566	41,597	4,605,299	メディア
COMERICA INC		230	—	—	—	銀行
CONAGRA BRANDS INC		769	821	3,146	348,301	食品
CONCHO RESOURCES INC		310	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS		1,710	2,231	11,920	1,319,688	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC		525	570	4,239	469,372	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A		259	283	6,620	732,987	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		139	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.		75	91	3,502	387,761	ヘルスケア機器・用品
COPART INC		319	358	3,803	421,113	商業サービス・用品
CORNING INC		1,190	1,290	5,624	622,677	電子装置・機器・部品
CORTEVA INC		1,150	1,217	5,712	632,441	化学
COSTCO WHOLESALE CORPORATION		691	733	25,640	2,838,623	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC		58	66	5,293	585,990	専門サービス
COTY INC-CL A		490	—	—	—	パーソナル用品
COUPA SOFTWARE INC		—	114	2,720	301,198	ソフトウェア
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A		—	290	5,083	562,752	ソフトウェア
CROWN HOLDINGS INC		212	228	2,212	244,972	容器・包装

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CUMMINS INC	226	249	6,561	726,440	機械
DR HORTON INC	538	561	5,006	554,254	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	305	328	4,379	484,885	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	378	—	—	—	情報技術サービス
DANAHER CORP	981	1,060	23,638	2,616,962	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	198	220	3,191	353,335	ホテル・レストラン・レジャー
DATADOG INC - CLASS A	—	293	2,266	250,973	ソフトウェア
DAVITA INC	148	125	1,368	151,506	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	471	494	18,471	2,044,996	機械
DELL TECHNOLOGIES-C	266	407	3,605	399,177	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC	252	252	1,232	136,425	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	352	352	2,236	247,614	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	624	1,000	2,200	243,562	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	144	161	5,589	618,860	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	231	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO	2,820	3,000	55,659	6,162,007	娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	496	500	4,763	527,311	消費者金融
DISCOVERY INC - A	245	245	1,064	117,826	メディア
DISCOVERY INC - C	570	491	1,817	201,181	メディア
DISH NETWORK CORP-A	371	384	1,377	152,492	メディア
DOCUSIGN INC	166	293	5,770	638,834	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	397	418	8,433	933,634	複合小売り
DOLLAR TREE INC	376	382	4,439	491,550	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	1,278	1,340	10,121	1,120,498	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	59	63	2,322	257,168	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	229	243	3,362	372,277	機械
DOW INC	1,152	1,245	8,043	890,545	化学
DRAFTKINGS INC - CL A	—	277	1,689	187,066	ホテル・レストラン・レジャー
DROPBOX INC-CLASS A	390	510	1,338	148,213	ソフトウェア
DUKE ENERGY CORP	1,138	1,230	11,837	1,310,531	電力
DUPONT DE NEMOURS INC	1,150	877	6,868	760,429	化学
DYNATRACE INC	—	290	1,354	149,998	ソフトウェア
EOG RESOURCES INC	904	981	7,186	795,651	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	350	—	—	—	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	207	—	—	—	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	208	230	2,564	283,941	化学
EATON VANCE CORP	164	—	—	—	資本市場
EBAY INC	1,200	1,128	6,804	753,281	インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC	401	430	9,245	1,023,513	化学
EDISON INTERNATIONAL	555	612	3,637	402,732	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	325	1,042	8,632	955,756	ヘルスケア機器・用品
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	600	740	2,131	235,945	医薬品
ELECTRONIC ARTS	461	485	6,519	721,813	娯楽
EMERSON ELEC	938	982	8,949	990,848	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	—	195	2,936	325,122	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	313	336	3,314	367,000	電力
EPAM SYSTEMS INC	84	95	3,643	403,354	情報技術サービス
EQUIFAX INC	185	197	3,610	399,731	専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	620	690	2,236	247,579	各種金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	37	44	979	108,443	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	349	396	1,748	193,558	水道
ETSY INC	—	209	4,156	460,153	インターネット販売・通信販売
EVERGY INC	359	359	2,131	235,965	電力
EVERSOURCE ENERGY	503	564	4,866	538,798	電力

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
EXACT SCIENCES CORP	226	258	3,190	353,183	バイオテクノロジー
EXELON CORPORATION	1,515	1,637	7,120	788,360	電力
EXPEDIA GROUP INC	207	223	3,921	434,193	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	273	271	2,906	321,745	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	6,621	7,007	39,722	4,397,698	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	207	—	—	—	電子装置・機器・部品
FMC CORP	196	212	2,353	260,569	化学
FACEBOOK INC-A	3,761	3,984	114,739	12,702,776	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	59	64	1,992	220,598	資本市場
FAIR ISAAC CORP	—	46	2,240	248,092	ソフトウェア
FASTENAL CO	874	969	4,905	543,041	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	391	417	11,922	1,319,980	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	93	104	2,159	239,061	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	964	1,035	14,749	1,632,948	情報技術サービス
FNF GROUP	405	454	1,855	205,371	保険
FIFTH THIRD BANCORP	1,120	1,200	4,574	506,431	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	257	290	4,874	539,603	銀行
FISERV INC	908	952	11,496	1,272,761	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	834	866	2,986	330,672	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	138	135	3,734	413,476	情報技術サービス
FLOWSERVE CORP	206	—	—	—	機械
FORD MOTOR COMPANY	6,070	6,560	8,173	904,916	自動車
FORTINET INC	228	224	4,061	449,680	ソフトウェア
FORTIVE CORP	476	518	3,699	409,520	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	216	234	2,246	248,698	建設関連製品
FOX CORP-CLASS A	528	580	2,152	238,289	メディア
FOX CORP-CLASS B	254	254	910	100,783	メディア
FRANKLIN RESOURCES INC	434	510	1,495	165,603	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	2,250	2,390	7,810	864,702	金属・鉱業
ARTHUR J GALLAGHER & CO	297	319	4,007	443,681	保険
GAP INC	315	—	—	—	専門小売り
GARTNER INC	141	141	2,562	283,682	情報技術サービス
GENERAC HOLDINGS INC	—	102	3,241	358,816	電気設備
GENERAL DYNAMICS	383	410	7,466	826,571	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	13,550	14,530	19,324	2,139,459	コングロマリット
GENERAL MILLS	943	1,028	6,352	703,231	食品
GENERAL MOTORS CO	1,990	2,153	12,597	1,394,636	自動車
GENUINE PARTS CO	232	232	2,727	301,975	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,982	2,082	13,637	1,509,763	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	473	492	10,055	1,113,298	情報技術サービス
GLOBE LIFE INC	157	157	1,543	170,894	保険
GODADDY INC - CLASS A	269	269	2,043	226,186	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	501	543	18,028	1,995,895	資本市場
GRAINGER(W.W.) INC	70	74	2,966	328,377	商社・流通業
GRUBHUB INC	145	—	—	—	インターネット販売・通信販売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	121	136	1,367	151,423	ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC	424	454	8,559	947,646	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	268	—	—	—	商社・流通業
HP INC	2,320	2,250	7,101	786,151	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	1,280	1,500	3,225	357,039	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	510	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	224	—	—	—	自動車
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	545	589	3,988	441,524	保険
HASBRO INC	196	214	2,073	229,527	レジャー用品

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
HEICO CORP	63	63	779	86,347	航空宇宙・防衛
HEICO CORP-CLASS A	124	123	1,411	156,231	航空宇宙・防衛
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	117	127	1,948	215,683	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	235	251	3,987	441,443	食品
HESS CORP	432	473	3,360	372,006	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,020	2,200	3,471	384,340	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	416	468	5,712	632,420	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	236	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	433	434	3,205	354,931	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,706	1,784	54,379	6,020,397	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,120	1,165	25,407	2,812,862	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	456	500	2,408	266,589	食品
HOWMET AEROSPACE INC	—	660	2,096	232,065	航空宇宙・防衛
HUBSPOT INC	—	70	3,066	339,529	ソフトウェア
HUMANA INC	204	217	9,237	1,022,728	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	132	132	2,235	247,468	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,540	1,720	2,753	304,864	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	65	65	1,336	148,003	航空宇宙・防衛
IAC/INTERACTIVE CORP	—	136	2,801	310,165	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IAC/INTERACTIVE CORP	126	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IPG PHOTONICS CORP	59	59	1,207	133,642	電子装置・機器・部品
IDEX CORP	123	123	2,588	286,590	機械
IDEXX LABORATORIES INC	136	142	6,801	752,974	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	500	529	11,889	1,316,320	機械
ILLUMINA INC	228	244	9,013	997,905	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	285	312	2,503	277,126	バイオテクノロジー
INGERSOLL-RAND INC	528	580	2,902	321,315	機械
INGREDION INC	96	—	—	—	食品
INSULET CORP	98	106	2,770	306,736	ヘルスケア機器・用品
INTEL CORP	6,802	6,791	43,306	4,794,430	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	876	930	10,344	1,145,227	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,388	1,485	20,005	2,214,855	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	155	371	5,195	575,207	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	598	601	3,305	365,951	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	580	670	1,963	217,408	メディア
INTUIT INC	404	433	16,179	1,791,230	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	181	194	14,115	1,562,749	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	214	214	956	105,926	バイオテクノロジー
IQVIA HOLDINGS INC	252	322	6,143	680,140	ライフサイエンス・ツール/サービス
JPMORGAN CHASE & CO	4,903	5,051	78,027	8,638,463	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	200	213	2,729	302,146	建設・土木
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	430	—	—	—	各種金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	4,114	4,362	71,977	7,968,613	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	76	—	—	—	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	530	530	1,349	149,448	通信機器
KLA CORP	244	255	8,085	895,121	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC-A	784	855	4,205	465,618	資本市場
KANSAS CITY SOUTHERN	151	151	3,920	434,028	陸運・鉄道
KELLOGG CO	400	433	2,760	305,649	食品
KEURIG DR PEPPER INC	—	920	3,211	355,569	飲料
KEYCORP	1,580	1,580	3,174	351,417	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	289	304	4,302	476,364	電子装置・機器・部品
KIMBERLY-CLARK CORP	533	572	7,911	875,863	家庭用品
KINDER MORGAN INC	3,150	3,440	5,717	632,960	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額	業 種 等	
			外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	208	208	1,020	112,996	陸運・鉄道
KOHL'S CORP	253	—	—	—	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	1,041	1,090	4,390	486,074	食品
KROGER CO	1,269	1,260	4,798	531,195	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	450	490	2,100	232,506	販売
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	344	344	6,985	773,414	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	149	158	4,005	443,496	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	224	237	13,586	1,504,200	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	217	239	1,886	208,819	食品
LAS VEGAS SANDS CORP	538	586	3,587	397,171	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	344	378	11,155	1,235,071	パーソナル用品
LEAR CORP	84	97	1,723	190,776	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	189	—	—	—	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	215	215	2,078	230,100	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	430	465	4,732	523,964	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	57	1,802	199,574	建設関連製品
LIBERTY BROADBAND CORP-A	—	40	588	65,159	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C	167	259	3,942	436,473	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	129	129	571	63,253	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	267	299	1,325	146,775	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	293	340	1,478	163,664	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,353	1,427	26,470	2,930,587	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	299	299	1,875	207,584	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	230	266	2,220	245,868	娯楽
LOCKHEED MARTIN	397	420	15,562	1,722,944	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	433	431	2,270	251,320	保険
LOWES COS INC	1,205	1,214	23,068	2,553,905	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	172	208	6,595	730,184	繊維・アパレル・贅沢品
LUMEN TECHNOLOGIES INC	—	1,470	1,944	215,309	各種電気通信サービス
M & T BANK CORP	200	217	3,338	369,658	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	790	800	3,056	338,418	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	131	137	5,728	634,173	資本市場
MANPOWERGROUP INC	96	—	—	—	専門サービス
MARATHON OIL CORP	1,230	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	985	1,060	5,681	629,009	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	21	23	2,693	298,239	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	58	61	3,038	336,441	資本市場
MARSH & MCLENNAN COS	794	848	10,304	1,140,855	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	432	464	6,877	761,449	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	97	105	3,608	399,454	建設資材
MASCO CORP	428	425	2,550	282,357	建設関連製品
MASIMO CORP	—	82	1,854	205,285	ヘルスケア機器・用品
MASTERCARD INC	1,403	1,474	52,798	5,845,341	情報技術サービス
MATCH GROUP INC	84	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MATCH GROUP INC	—	416	5,469	605,535	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	424	452	4,064	449,967	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	189	402	3,613	400,103	食品
MCDONALD'S CORP	1,179	1,236	27,807	3,078,571	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	256	262	5,149	570,055	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	340	340	681	75,433	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	69	74	10,610	1,174,662	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	3,983	4,193	32,269	3,572,537	医薬品
METLIFE INC	1,206	1,254	7,704	852,973	保険
METTLER-TOLEDO INTL	38	38	4,447	492,402	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
MICROSOFT CORP	11,321	11,902	275,947	30,550,188	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	373	427	6,409	709,617	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,740	1,845	15,966	1,767,665	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	87	—	—	—	機械
MODERNA INC	—	463	5,486	607,364	バイオテクノロジー
MOHAWK INDUSTRIES	87	102	1,989	220,236	家庭用耐久財
MOLINA HEALTHCARE INC	—	97	2,281	252,578	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	284	314	1,643	181,949	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,259	2,386	14,024	1,552,697	食品
MONGODB INC	74	88	2,285	253,002	情報技術サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	69	2,363	261,704	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	638	666	6,039	668,683	飲料
MOODYS CORP	268	283	8,420	932,189	資本市場
MORGAN STANLEY	1,910	2,331	18,435	2,041,036	資本市場
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	450	—	—	—	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	560	560	1,755	194,300	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	268	276	5,150	570,204	通信機器
NRG ENERGY INC	405	405	1,502	166,302	電力
NVR INC	5	5	2,630	291,246	家庭用耐久財
NASDAQ INC	184	184	2,713	300,365	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	580	—	—	—	エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	352	352	2,542	281,440	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	685	732	37,585	4,161,066	娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	142	142	1,338	148,184	バイオテクノロジー
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,840	1,840	916	101,445	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	354	354	2,336	258,662	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	333	403	1,331	147,456	コングロマリット
NEWELL BRANDS INC	660	660	1,762	195,093	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	1,276	1,317	7,886	873,080	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	550	670	1,721	190,557	メディア
NEXTERA ENERGY INC	765	3,252	24,136	2,672,134	電力
NIKE INC-B	1,952	2,083	27,693	3,065,945	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	582	650	1,559	172,635	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	710	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NORDSON CORP	—	87	1,775	196,517	機械
NORDSTROM INC	150	—	—	—	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	403	418	11,298	1,250,815	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	321	321	3,435	380,326	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	251	260	8,389	928,821	航空宇宙・防衛
NORTONLIFELOCK INC	980	910	1,920	212,574	ソフトウェア
NUCOR CORP	467	509	4,091	453,008	金属・鉱業
NVIDIA CORP	909	1,025	52,815	5,847,189	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	325	325	1,054	116,757	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	119	118	6,023	666,807	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	1,420	1,580	4,318	478,061	石油・ガス・消耗燃料
OKTA INC	165	203	4,335	479,935	情報技術サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	153	153	3,681	407,560	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	345	345	2,603	288,180	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	590	680	2,711	300,152	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	670	740	3,719	411,757	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,598	3,230	22,787	2,522,820	ソフトウェア
OTIS WORLDWIDE CORP	—	696	4,853	537,375	機械
OWENS CORNING INC	168	168	1,546	171,187	建設関連製品
PG&E CORP	—	2,370	2,723	301,477	電力

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株 数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
PNC FINANCIAL	689	698	12,397	1,372,568	銀行	
PPG INDUSTRIES	368	398	6,081	673,232	化学	
PPL CORPORATION	1,148	1,290	3,750	415,165	電力	
PPD INC	—	200	754	83,497	ライフサイエンス・ツール/サービス	
PVH CORP	116	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
PTC INC	170	187	2,468	273,276	ソフトウェア	
PACCAR	538	583	5,440	602,323	機械	
PACKAGING CORP OF AMERICA	145	161	2,180	241,430	容器・包装	
PALO ALTO NETWORKS INC	152	156	4,960	549,227	ソフトウェア	
PARKER HANNIFIN CORP	201	216	6,854	758,842	機械	
PAYCHEX INC	505	548	5,437	602,019	情報技術サービス	
PAYCOM SOFTWARE INC	75	81	2,917	323,000	ソフトウェア	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,747	1,845	43,641	4,831,564	情報技術サービス	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	402	4,308	476,964	レジャー用品	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	710	—	—	—	銀行	
PEPSICO INC	2,182	2,290	32,641	3,613,758	飲料	
PERKINELMER INC	174	188	2,401	265,850	ライフサイエンス・ツール/サービス	
PFIZER INC	8,658	9,210	33,257	3,681,916	医薬品	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,437	2,586	23,105	2,558,055	タバコ	
PHILLIPS 66	703	711	5,852	647,901	石油・ガス・消耗燃料	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	170	191	1,541	170,687	電力	
PINTEREST INC- CLASS A	460	847	5,870	649,929	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	261	335	5,380	595,705	石油・ガス・消耗燃料	
PLUG POWER INC	—	776	2,641	292,440	電気設備	
POLARIS INC	83	—	—	—	レジャー用品	
POOL CORP	—	65	2,225	246,374	販売	
T ROWE PRICE GROUP INC	366	382	6,578	728,339	資本市場	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	444	444	2,692	298,077	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	3,899	4,109	55,656	6,161,720	家庭用品	
PROGRESSIVE CO	920	961	9,182	1,016,578	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	630	666	6,132	678,932	保険	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	781	858	5,131	568,130	総合公益事業	
PULTEGROUP INC	379	430	2,268	251,117	家庭用耐久財	
QORVO INC	176	194	3,446	381,509	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	1,791	1,868	24,304	2,690,756	半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS INC	205	219	2,813	311,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
RPM INTERNATIONAL INC	211	211	1,976	218,811	化学	
RALPH LAUREN CORPORATION	78	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	196	196	2,406	266,422	資本市場	
RAYTHEON COMPANY	433	—	—	—	航空宇宙・防衛	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	2,506	19,501	2,159,032	航空宇宙・防衛	
REGENERON PHARMACEUTICALS	127	175	8,246	912,929	バイオテクノロジー	
REGIONS FINANCIAL CORP	1,500	1,620	3,387	375,021	銀行	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	90	105	1,347	149,235	保険	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	343	361	3,625	401,381	商業サービス・用品	
RESMED INC	225	245	4,638	513,483	ヘルスケア機器・用品	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	119	125	3,584	396,826	ソフトウェア	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	203	1,574	174,309	専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	178	196	5,245	580,756	電気設備	
ROKU INC	142	175	5,484	607,162	娯楽	
ROLLINS INC	239	358	1,216	134,626	商業サービス・用品	
ROPER TECHNOLOGIES INC	164	175	7,088	784,817	コングロマリット	
ROSS STORES INC	561	598	7,198	796,970	専門小売り	
S&P GLOBAL INC	384	396	13,970	1,546,628	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	
SEI INVESTMENTS COMPANY		191	191	1,171	129,707	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		367	370	2,537	280,881	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP		81	87	4,268	472,592	銀行
SABRE CORP		420	—	—	—	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC		1,304	1,508	31,668	3,505,964	ソフトウェア
SAREPTA THERAPEUTICS INC		112	126	921	101,970	バイオテクノロジー
HENRY SCHEIN INC		231	231	1,593	176,383	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		2,140	2,340	6,369	705,165	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		1,797	2,539	16,442	1,820,356	資本市場
SEAGEN INC		—	207	2,846	315,131	バイオテクノロジー
SEALED AIR CORP		219	265	1,234	136,627	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC		187	—	—	—	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY		436	473	6,223	688,977	総合公益事業
SERVICENOW INC		296	323	15,763	1,745,137	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS		129	134	10,021	1,109,506	化学
SIGNATURE BANK		89	—	—	—	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC		2,290	1,750	1,071	118,570	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC		272	271	4,837	535,573	半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A		—	761	3,082	341,213	ソフトウェア
SMITH (A.O.) CORP		218	218	1,508	166,988	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW		174	186	2,391	264,710	食品
SNAP-ON INC		84	84	1,949	215,788	機械
SNAP INC-A		1,170	1,522	7,550	835,931	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A		—	39	866	95,882	情報技術サービス
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC		—	82	2,223	246,174	半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO.		1,647	1,767	10,874	1,203,873	電力
SOUTHWEST AIRLINES		198	249	1,541	170,665	旅客航空輸送業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		146	—	—	—	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC		237	270	3,562	394,420	ソフトウェア
SPRINT CORP		1,290	—	—	—	無線通信サービス
SQUARE INC - A		531	636	13,535	1,498,569	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		239	259	5,190	574,653	機械
STARBUCKS CORP		1,852	1,949	21,491	2,379,337	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP		559	596	5,144	569,500	資本市場
STEEL DYNAMICS		334	334	1,712	189,618	金属・鉱業
STRYKER CORP		529	565	13,735	1,520,618	ヘルスケア機器・用品
SUNRUN INC		—	185	1,071	118,627	電気設備
SYNOPSYS INC		239	255	6,109	676,415	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL		940	860	3,531	390,934	消費者金融
SYSCO CORP		758	813	6,495	719,067	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP		412	—	—	—	資本市場
TJX COS INC		1,898	2,003	13,323	1,475,095	専門小売り
T-MOBILE US INC		530	931	11,603	1,284,677	無線通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC		181	194	3,435	380,349	娯楽
TAPESTRY INC		450	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP		788	836	16,690	1,847,831	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP		348	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TELADOC HEALTH INC		—	193	3,372	373,367	ヘルスケア・テクノロジー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		57	58	2,349	260,126	航空宇宙・防衛
TELEFLEX INC		71	75	3,135	347,165	ヘルスケア機器・用品
10X GENOMICS INC-CLASS A		—	100	1,682	186,236	ライフサイエンス・ツール/サービス
TERADYNE INC		250	272	3,154	349,191	半導体・半導体製造装置
TESLA INC		212	1,256	79,872	8,842,630	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		1,670	1,730	1,960	217,001	医薬品

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,465	1,521	28,281	3,131,041	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	335	379	2,095	231,991	航空宇宙・防衛
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	68	4,293	475,337	ソフトウェア
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	628	655	29,571	3,273,836	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	902	956	18,607	2,060,045	コングロマリット
TIFFANY & CO	169	—	—	—	専門小売り
TRACTOR SUPPLY COMPANY	178	195	3,452	382,223	専門小売り
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	164	1,201	133,014	資本市場
TRANSDIGM GROUP INC	76	86	5,074	561,807	航空宇宙・防衛
TRUNSONIC	290	311	2,788	308,741	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	408	426	6,561	726,443	保険
TRIMBLE INC	388	422	3,208	355,255	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	146	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRUIST FINANCIAL CORP	2,085	2,253	13,243	1,466,147	銀行
TWILIO INC - A	186	233	7,483	828,549	情報技術サービス
TWITTER INC	1,147	1,328	8,365	926,097	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	61	65	2,700	298,988	ソフトウェア
TYSON FOODS INC-CL A	469	501	3,805	421,262	食品
UGI CORP	309	360	1,495	165,600	ガス
US BANCORP	2,305	2,231	12,464	1,379,955	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	655	1,615	8,633	955,846	陸運・鉄道
ULTA BEAUTY INC	85	86	2,648	293,248	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	240	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	250	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	1,088	1,113	24,611	2,724,768	陸運・鉄道
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	92	—	—	—	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,099	1,174	19,798	2,191,873	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	112	122	4,065	450,054	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	1,286	—	—	—	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,482	1,572	58,723	6,501,293	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	118	130	1,770	196,008	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	312	—	—	—	保険
V F CORP	525	563	4,511	499,448	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	60	67	1,944	215,228	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	628	665	4,773	528,459	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	142	153	2,707	299,695	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	207	227	5,662	626,846	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	162	176	3,429	379,703	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	6,468	6,857	40,175	4,447,792	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	242	260	4,574	506,465	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	404	436	9,286	1,028,093	バイオテクノロジー
VIACOMCBS INC-CLASS B	880	951	4,432	490,734	メディア
VIATRIS INC	—	2,007	2,840	314,441	医薬品
VISA INC-CLASS A SHARES	2,678	2,804	59,416	6,578,029	情報技術サービス
VISTRA CORP	590	700	1,246	138,022	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A	130	142	2,132	236,110	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	217	217	1,381	152,913	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	208	223	3,840	425,207	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	81	—	—	—	機械
WEC ENERGY GROUP INC	498	536	5,005	554,181	総合公益事業
WABTEC CORP	288	288	2,295	254,183	機械
WALMART INC	2,225	2,348	31,871	3,528,521	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,182	1,203	6,373	705,609	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	403	445	4,794	530,791	商業サービス・用品

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		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	
WASTE MANAGEMENT INC	668	693	8,959	991,862	商業サービス・用品
WATERS CORP	103	105	2,966	328,405	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A	86	115	3,645	403,618	インターネット販売・通信販売
WELLS FARGO CO	6,291	6,500	25,603	2,834,563	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	118	124	3,451	382,106	ヘルスケア機器・用品
WESTERN DIGITAL CORP	476	516	3,377	373,949	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	660	660	1,639	181,502	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	50	—	—	—	化学
WESTROCK CO	387	432	2,299	254,533	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	94	103	2,268	251,142	家庭用耐久財
WILLIAMS COS	1,910	1,980	4,688	519,079	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	254	291	7,077	783,604	ソフトウェア
WYNN RESORTS LTD	155	171	2,145	237,494	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC	143	143	1,774	196,405	航空貨物・物流サービス
XCEL ENERGY INC	812	885	5,841	646,755	電力
XILINX INC	399	412	4,956	548,718	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	278	303	3,177	351,821	機械
XEROX HOLDINGS CORP	289	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
YUM BRANDS INC	471	508	5,576	617,353	ホテル・レストラン・レジャー
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	84	89	4,225	467,859	電子装置・機器・部品
ZENDESK INC	—	188	2,399	265,663	ソフトウェア
ZILLOW GROUP INC - A	—	98	1,240	137,312	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZILLOW GROUP INC - C	202	246	3,044	337,056	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	319	349	5,626	622,918	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORP NA	275	—	—	—	銀行
ZOETIS INC	740	794	12,468	1,380,440	医薬品
ZSCALER INC	—	119	1,972	218,419	ソフトウェア
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	323	10,116	1,119,946	ソフトウェア
ALLEGION PLC	148	148	1,854	205,288	建設関連製品
ALLERGAN PLC	510	—	—	—	医薬品
AMCOR PLC	2,500	2,680	3,146	348,329	容器・包装
AON PLC	—	375	8,703	963,550	保険
AON PLC	369	—	—	—	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	639	650	2,545	281,801	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	212	212	1,066	118,033	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	292	360	1,064	117,853	化学
ACCENTURE PLC-CL A	995	1,050	29,247	3,238,018	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	220	220	1,755	194,386	食品
CAPRI HOLDINGS LTD	199	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	351	326	1,681	186,123	飲料
EATON CORP PLC	645	654	9,133	1,011,199	電気設備
EVEREST RE GROUP LTD	62	62	1,576	174,545	保険
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	359	3,127	346,297	医薬品
IHS MARKIT LTD	593	638	6,182	684,504	専門サービス
INVESCO LTD	580	680	1,692	187,378	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	90	90	1,498	165,888	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,200	1,185	7,196	796,725	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	609	67,435	各種電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	640	640	1,616	178,978	各種電気通信サービス
LINDE PLC	842	872	24,351	2,695,951	化学
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	990	1,128	5,338	591,061	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	2,099	2,230	26,499	2,933,714	ヘルスケア機器・用品
APTIV PLC	392	454	6,232	690,051	自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	540	—	—	—	専門サービス

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	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		330	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
NOVOCURE LTD		—	140	1,753	194,129	ヘルスケア機器・用品
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		67	78	1,284	142,181	保険
ROYALTY PHARMA PLC-CL A		—	289	1,260	139,595	医薬品
SEAGATE TECHNOLOGY		373	373	2,823	312,601	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC		232	275	1,707	189,004	機械
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		245	245	1,419	157,101	電気設備
STERIS PLC		129	138	2,622	290,327	ヘルスケア機器・用品
TECHNIPFMC PLC		610	—	—	—	エネルギー設備・サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC		376	403	6,728	744,866	建設関連製品
WILLIS TOWERS WATSON PLC		202	218	5,064	560,675	保険
PERRIGO CO PLC		196	—	—	—	医薬品
CHUBB LTD		712	743	12,000	1,328,541	保険
GARMIN LTD		205	242	3,163	350,249	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD		524	554	7,062	781,877	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.		189	187	2,139	236,901	ソフトウェア
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		55	71	904	100,102	ソフトウェア
WIX.COM LTD		77	94	2,509	277,849	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV		170	—	—	—	商社・流通業
LYONDELLBASELL INDU-CL A		421	452	4,747	525,579	化学
MYLAN NV		770	—	—	—	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV		432	468	9,255	1,024,691	半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		266	386	3,294	364,735	ホテル・レストラン・レジャー
FLEX LTD		760	—	—	—	電子装置・機器・部品
小 計	株 数 ・ 金 額	465,696	519,005	5,756,681	637,322,181	
	銘 柄 数 < 比 率 >	608	593	—	<68.7%>	
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD		377	410	2,938	257,938	金属・鉱業
AIR CANADA		204	320	853	74,943	旅客航空輸送業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		850	970	1,918	168,419	総合公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B		1,342	1,450	5,955	522,743	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		420	420	878	77,127	ガス
ATCO LTD CL1		130	130	545	47,848	総合公益事業
AURORA CANNABIS INC		2,000	—	—	—	医薬品
BCE INC		227	256	1,474	129,436	各種電気通信サービス
BALLARD POWER SYSTEMS INC		—	370	1,064	93,408	電気設備
BANK OF MONTREAL		990	1,056	11,950	1,049,037	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX		1,893	1,994	15,862	1,392,390	銀行
BARRICK GOLD		2,770	2,990	7,367	646,706	金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC		510	510	2,000	175,624	医薬品
BLACKBERRY LTD		710	940	1,107	97,200	ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS		2,800	—	—	—	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		1,402	2,108	12,076	1,060,095	資本市場
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		—	187	1,094	96,069	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
B2GOLD CORP		—	1,750	931	81,723	金属・鉱業
CAE INC		410	500	1,791	157,213	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B		247	247	1,721	151,077	容器・包装
CGI INC		384	372	3,869	339,701	情報技術サービス
CI FINANCIAL CORP		336	—	—	—	資本市場
CAMECO CORP		560	720	1,460	128,172	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		696	750	9,312	817,407	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		1,124	1,186	17,378	1,525,481	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		1,870	1,990	7,709	676,718	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		213	221	10,326	906,474	陸運・鉄道

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	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	86	102	1,811	158,970	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	203	203	689	60,514	総合公益事業
CANOPY GROWTH CORP	330	350	1,406	123,445	医薬品
CENOVUS ENERGY INC	1,560	2,160	2,075	182,210	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	32	34	5,956	522,896	ソフトウェア
CRONOS GROUP INC	250	—	—	—	医薬品
DOLLARAMA INC	466	466	2,434	213,690	複合小売り
EMERA INC	379	425	2,374	208,431	電力
EMPIRE CO LTD A	260	260	1,027	90,150	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	3,178	3,330	15,397	1,351,629	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	41	41	2,301	202,055	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	990	930	2,250	197,557	金属・鉱業
FIRSTSERVICE CORP	—	60	1,106	97,151	不動産管理・開発
FORTIS INC	682	—	—	—	電力
FORTIS INC	—	753	4,109	360,764	電力
FRANCO-NEVADA CORP	293	323	5,048	443,184	金属・鉱業
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	—	300	1,294	113,631	商業サービス・用品
GILDAN ACTIVEWEAR INC	318	318	1,227	107,748	繊維・アパレル・贅沢品
GREAT-WEST LIFE CO INC	420	420	1,411	123,875	保険
HUSKY ENERGY INC	520	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	490	550	1,625	142,664	電力
IGM FINANCIAL INC	150	150	575	50,548	資本市場
IA FINANCIAL CORP INC	183	183	1,267	111,241	保険
IMPERIAL OIL	375	375	1,164	102,241	石油・ガス・消耗燃料
INTACT FINANCIAL CORP	215	245	3,773	331,258	保険
INTER PIPELINE LTD	600	750	1,356	119,095	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	340	340	889	78,075	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,980	2,170	1,768	155,243	金属・鉱業
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	441	427	1,720	151,052	金属・鉱業
LOBLAW COMPANIES	285	285	2,000	175,621	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	950	1,180	1,522	133,618	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC	451	482	5,398	473,913	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	3,030	3,260	8,883	779,793	保険
METHANEX CORP	86	—	—	—	化学
METRO INC	396	435	2,522	221,430	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	523	550	4,716	414,040	銀行
NORTHLAND POWER INC	—	300	1,344	118,055	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NUTRIEN LTD	900	961	6,617	580,879	化学
ONEX CORPORATION	132	132	1,037	91,085	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	417	470	2,812	246,879	ソフトウェア
OVINTIV INC	410	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	353	1,307	114,773	金属・鉱業
PARKLAND FUEL CORP	217	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	—	217	832	73,088	石油・ガス・消耗燃料
PEMBINA PIPELINE CORP	880	880	3,173	278,550	石油・ガス・消耗燃料
POWER CORPORATION OF CANADA	869	970	3,218	282,516	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	310	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
QUEBECOR INC-CL B	270	270	935	82,075	メディア
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	433	494	4,096	359,612	ホテル・レストラン・レジャー
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	—	183	1,344	117,988	商業サービス・用品
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	555	582	3,471	304,688	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	2,248	2,348	27,504	2,414,342	銀行
SSR MINING INC	—	340	592	52,050	金属・鉱業
SAPUTO INC	366	410	1,545	135,681	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
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		770	770	2,562	224,941	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A		163	182	24,159	2,120,762	情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE		380	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC		923	988	6,332	555,831	保険
SUNCOR ENERGY INC		2,440	2,490	6,635	582,494	石油・ガス・消耗燃料
TMX GROUP LTD		—	95	1,228	107,874	資本市場
TC ENERGY CORP		1,470	1,580	9,222	809,547	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B		820	790	1,926	169,135	金属・鉱業
TELUS CORP		586	586	1,481	130,037	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP		317	278	3,076	270,066	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		—	128	1,220	107,111	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK		2,841	3,007	24,846	2,181,055	銀行
WSP GLOBAL INC		157	198	2,356	206,896	建設・土木
WEST FRASER TIMBER		84	140	1,169	102,651	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD		123	123	1,376	120,871	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		716	761	3,622	317,970	金属・鉱業
YAMANA GOLD INC		—	1,640	877	77,018	金属・鉱業
小 計		株 数 ・ 金 額	62,765	66,371	364,630	32,007,240
銘 柄 数 < 比 率 >		84	87	—	<3.5%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC		590	620	1,048	159,600	金属・鉱業
ASHTREAD GROUP PLC		687	735	3,174	483,248	商社・流通業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		1,590	1,590	1,203	183,277	家庭用耐久財
AVIVA PLC		6,040	6,700	2,761	420,419	保険
DIAGEO PLC		3,681	3,901	11,820	1,799,363	飲料
SCHRODERS PLC		197	197	678	103,313	資本市場
DCC PLC		160	160	1,009	153,691	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC		5,020	5,470	2,806	427,174	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		3,597	3,830	10,609	1,615,023	タバコ
HALMA PLC		590	650	1,532	233,223	電子装置・機器・部品
STANDARD CHARTERED PLC		4,140	4,430	2,275	346,361	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		1,490	1,610	2,409	366,777	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		31,810	33,620	14,478	2,204,054	銀行
LEGAL & GENERAL		9,400	10,100	2,884	439,116	保険
MEGGITT PLC		1,110	—	—	—	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS		3,700	3,700	673	102,539	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		541	620	1,501	228,500	食品
PEARSON		1,260	1,260	976	148,652	メディア
PERSIMMON PLC		480	526	1,565	238,297	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC		4,100	4,280	6,751	1,027,811	保険
RIO TINTO PLC-REG		1,749	1,850	10,319	1,570,907	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC		810	950	1,214	184,894	資本市場
SSE PLC		1,650	1,770	2,539	386,521	電力
BP PLC		31,780	33,390	10,067	1,532,512	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC		110,500	115,900	4,995	760,432	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		5,000	6,200	1,134	172,767	家庭用耐久財
TESCO PLC		15,300	—	—	—	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		1,370	1,500	2,064	314,316	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC		7,820	8,270	10,808	1,645,437	医薬品
WEIR GROUP PLC		380	—	—	—	機械
ASTRAZENECA PLC		2,055	2,179	15,882	2,417,828	医薬品
BT GROUP PLC		12,900	15,300	2,351	357,985	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC		229	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC		3,100	—	—	—	複合小売り

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額	業 種 等	
			外貨建金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
BARCLAYS PLC	27,400	29,200	5,522	840,749	銀行
INTERTEK GROUP PLC	256	256	1,433	218,236	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	660	660	1,277	194,513	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	198	219	1,758	267,640	複合小売り
KINGFISHER PLC	3,080	3,490	1,140	173,623	専門小売り
ITV PLC	5,000	—	—	—	メディア
SAINSBURY	2,550	2,990	730	111,242	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	2,190	—	—	—	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	308	308	936	142,489	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	195	195	872	132,750	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	9,200	—	—	—	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	6,560	6,760	9,774	1,488,042	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	5,860	6,100	8,348	1,270,886	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	500	550	1,266	192,738	商社・流通業
RENTOKIL INTIAL PLC	2,850	3,180	1,544	235,123	商業サービス・用品
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	296	651	99,132	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	492	532	3,678	559,939	資本市場
UNILEVER PLC	1,742	4,342	17,637	2,684,911	パーソナル用品
TUI AG-DI	700	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
EXPERIAN PLC	1,411	1,529	3,837	584,226	専門サービス
MONDI PLC	750	840	1,606	244,621	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	370	370	848	129,209	水道
WHITBREAD PLC	211	316	1,090	166,079	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	520	520	808	123,093	資本市場
SMITHS GROUP PLC	610	610	937	142,679	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,600	2,060	5,911	899,857	金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,550	1,670	1,949	296,806	資本市場
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,102	1,190	7,725	1,176,049	家庭用品
RELX PLC	3,000	3,240	5,900	898,163	専門サービス
FRESNILLO PLC	—	300	257	39,156	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,060	1,060	972	148,099	水道
OCADO GROUP PLC	720	830	1,684	256,492	インターネット販売・通信販売
GLENCORE PLC	17,000	16,800	4,805	731,562	金属・鉱業
ENTAIN PLC	870	1,020	1,562	237,880	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,770	13,800	1,497	228,039	航空宇宙・防衛
EVRAZ PLC	760	760	435	66,339	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	133	133	3	485	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EASYJET PLC	210	—	—	—	旅客航空輸送業
NATWEST GROUP PLC	7,700	7,700	1,519	231,269	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,750	1,750	1,060	161,493	ソフトウェア
WPP PLC	2,000	2,000	1,894	288,445	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	290	340	796	121,269	飲料
AVEVA GROUP PLC	112	199	669	101,843	ソフトウェア
COMPASS GROUP PLC	2,510	2,920	4,311	656,321	ホテル・レストラン・レジャー
NATIONAL GRID PLC	5,480	5,910	5,064	771,025	総合公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,660	3,660	1,063	161,911	資本市場
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	890	658	100,258	保険
BHP GROUP PLC	3,290	3,470	7,306	1,112,205	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	42,100	45,000	6,033	918,494	無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	258	288	1,442	219,649	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	481	—	—	—	ソフトウェア
CRODA INTERNATIONAL PLC	193	223	1,419	216,108	化学
FERGUSON PLC	346	366	3,218	489,968	商社・流通業
M&G PLC	3,780	4,400	921	140,258	各種金融サービス

銘柄		期首(前期末)	当		期		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					
RSA INSURANCE GROUP PLC		1,620	1,620	1,103	167,992	保険				
TESCO PLC		—	13,026	2,994	455,890	食品・生活必需品小売り				
INFORMA PLC		1,860	2,480	1,410	214,663	メディア				
AUTO TRADER GROUP PLC		1,410	1,710	950	144,734	インタラクティブ・メディアおよびサービス				
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		116	116	1,333	202,986	機械				
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		2,190	2,190	690	105,082	保険				
JD SPORTS FASHION PLC		760	930	776	118,214	専門小売り				
MELROSE INDUSTRIES PLC		7,300	8,500	1,459	222,236	コングロマリット				
JOHNSON MATTHEY PLC		302	302	933	142,149	化学				
小	計	株 数 ・ 金 額	468,722	487,424	278,981	42,469,387				
	銘柄 数 < 比 率 >		93	86	—	<4.6%>				
(スイス)					千スイスフラン					
SGS SA-REG		9	9	2,665	313,074	専門サービス				
BARRY CALLEBAUT AG		4	4	984	115,617	食品				
SWISSCOM AG-REG		40	44	2,258	265,298	各種電気通信サービス				
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		1	1	1,470	172,753	食品				
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.17	0.16	1,406	165,181	食品				
GIVAUDAN-REG		14	15	5,607	658,647	化学				
ZURICH INSURANCE GROUP AG		235	251	10,322	1,212,344	保険				
NOVARTIS AG-REG		3,361	3,670	30,042	3,528,505	医薬品				
ABB LTD		2,850	3,030	8,641	1,014,951	電気設備				
ROCHE HOLDINGS AG-BEARER		—	53	1,691	198,697	医薬品				
ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)		1,098	1,164	35,368	4,153,988	医薬品				
ADECCO GROUP AG-REG		249	249	1,609	189,040	専門サービス				
LAFARGEHOLCIM LTD		774	884	4,955	582,047	建設資材				
CLARIANT AG-REG		320	320	618	72,668	化学				
NESTLE SA-REG		4,652	4,774	50,575	5,940,122	食品				
BALOISE HOLDING AG		74	74	1,209	142,102	保険				
TEMENOS AG-REG		104	104	1,417	166,426	ソフトウェア				
SONOVA HOLDING AG-REG		88	88	2,231	262,069	ヘルスケア機器・用品				
STRAUMANN HOLDING AG-REG		16	17	2,063	242,401	ヘルスケア機器・用品				
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		3,960	4,120	4,290	503,975	資本市場				
THE SWATCH GROUP AG-B		47	47	1,306	153,460	繊維・アパレル・贅沢品				
THE SWATCH GROUP AG-REG		74	74	398	46,846	繊維・アパレル・贅沢品				
LONZA AG-REG		115	121	6,438	756,183	ライフサイエンス・ツール/サービス				
SWISS LIFE HOLDING AG		51	52	2,454	288,274	保険				
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		12	14	1,215	142,744	化学				
SWISS PRIME SITE-REG		114	135	1,190	139,847	不動産管理・開発				
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		58	—	—	—	各種金融サービス				
DUFREY AG-REG		65	—	—	—	専門小売り				
PARTNERS GROUP HOLDING AG		29	31	3,868	454,412	資本市場				
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		61	67	1,881	220,965	機械				
SCHINDLER HOLDING AG-REG		30	30	823	96,684	機械				
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		84	84	2,283	268,251	海運業				
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		—	270	2,614	307,094	コンピュータ・周辺機器				
GEBERIT AG-REG		56	62	3,799	446,239	建設関連製品				
JULIUS BAER GROUP LTD		358	358	2,195	257,832	資本市場				
SWISS RE LTD		462	483	4,567	536,423	保険				
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		815	857	7,934	931,860	繊維・アパレル・贅沢品				
SIKA AG-REG		199	238	6,392	750,820	化学				
ALCON INC		659	827	5,507	646,893	ヘルスケア機器・用品				
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		—	54	505	59,427	銀行				
UBS GROUP AG		6,010	6,020	8,843	1,038,654	資本市場				

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	評価額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
VIFOR PHARMA AG	67	76	983	115,460	医薬品
小計	株数・金額	27,221	28,779	234,638	27,558,293
	銘柄数<比率>	39	40	—	<3.0%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	126	126	6,002	76,173	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	2,510	2,670	29,757	377,618	銀行
SWEDBANK AB	1,370	1,480	22,999	291,859	銀行
SWEDISH MATCH AB	260	260	17,643	223,897	タバコ
SECURITAS AB-B SHS	450	540	8,059	102,275	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	715	767	53,429	678,016	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	1,270	1,300	26,442	335,548	専門小売り
ERICSSON LM-B	4,740	4,910	56,956	722,771	通信機器
TELIA CO AB	4,300	4,280	16,169	205,195	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	510	600	13,830	175,502	建設・土木
LUNDIN ENERGY AB	288	288	8,127	103,136	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	510	510	13,739	174,352	機械
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	158	—	—	—	無線通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	151	6,570	83,373	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	138	171	7,281	92,398	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	550	730	9,011	114,360	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	340	340	8,136	103,248	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	580	600	14,844	188,370	機械
VOLVO AB-B SHS	2,340	2,330	51,819	657,585	機械
SANDVIK AB	1,780	1,840	44,086	559,456	機械
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	150	4,872	61,825	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	250	250	7,735	98,157	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B	—	1,000	16,190	205,451	紙製品・林産品
HEXAGON AB-B SHS	423	456	36,270	460,269	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	780	780	9,090	115,363	無線通信サービス
ATLAS COPCO AB-A	1,045	1,129	60,266	764,775	機械
ATLAS COPCO AB-B	627	627	28,653	363,617	機械
EPIROC AB - A	1,030	1,130	22,068	280,054	機械
EPIROC AB - B	580	690	12,361	156,865	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B	925	1,030	28,160	357,352	家庭用品
EQT AB	—	420	11,915	151,206	資本市場
BOLIDEN AB	440	440	14,449	183,365	金属・鉱業
EVOLUTION GAMING GROUP	—	273	34,520	438,069	ホテル・レストラン・レジャー
KINNEVIK AB - B	390	—	—	—	各種金融サービス
KINNEVIK AB - B	—	390	16,440	208,629	各種金融サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	2,430	2,670	25,583	324,660	銀行
ASSA ABLOY AB-B	1,590	1,700	42,534	539,756	建設関連製品
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	510	13,708	173,964	建設関連製品
NORDEA BANK ABP	5,150	5,480	47,599	604,034	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	260	5,876	74,566	コングロマリット
小計	株数・金額	38,595	43,278	853,201	10,827,128
	銘柄数<比率>	32	38	—	<1.2%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	1,450	1,550	28,287	366,606	銀行
TELENOR ASA	1,160	1,160	17,469	226,406	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA-CL A	—	106	3,826	49,592	メディア
EQUINOR ASA	1,580	1,600	26,976	349,608	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	262	296	13,237	171,553	化学
MOWI ASA	690	700	14,756	191,237	食品
NORSK HYDRO	2,180	2,180	11,645	150,926	金属・鉱業

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
AKER AB ASA		180	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA		1,150	1,330	11,278	146,168	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		310	310	6,212	80,512	保険
ADEVINTA ASA		—	450	5,710	74,008	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SCHIBSTED ASA-B SHS		129	181	5,654	73,281	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	9,091	9,863	145,054	1,879,901	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	11	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG B		162	168	16,574	289,231	飲料
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		10	10	15,262	266,321	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A		6	5	7,683	134,071	海運業
GN STORE NORD A/S		—	212	10,472	182,750	ヘルスケア機器・用品
DANSKE BANK AS		970	1,090	13,134	229,197	銀行
GENMAB A/S		100	110	22,330	389,660	バイオテクノロジー
ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS		—	11	2,947	51,439	建設関連製品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		298	332	41,334	721,278	電気設備
H LUNDBECK A/S		105	105	2,283	39,851	医薬品
DSV PANALPINA A S		325	338	41,016	715,734	航空貨物・物流サービス
PANDORA A/S		160	160	10,854	189,409	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S		167	182	10,326	180,200	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		337	337	13,530	236,108	化学
COLOPLAST-B		185	194	18,433	321,671	ヘルスケア機器・用品
AMBU A/S-B		—	290	8,146	142,149	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		2,772	2,842	122,404	2,135,966	医薬品
ISS A/S		218	—	—	—	商業サービス・用品
TRYG A/S-NEW		—	326	4,893	85,389	保険
TRYG A/S		199	280	4,194	73,192	保険
ORSTED A/S		300	318	31,761	554,244	電力
DEMANT A/S		160	160	4,248	74,127	ヘルスケア機器・用品
小 計	株 数 ・ 金 額	6,474	7,472	401,833	7,011,995	
	銘 柄 数 < 比 率 >	17	20	—	<0.8%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		281	313	8,294	1,076,626	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		642	673	2,563	332,736	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	563	73,160	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		105	105	437	56,805	化学
HANNOVER RUECK SE		96	96	1,509	195,883	保険
GEA GROUP AG		242	242	848	110,097	機械
CONTINENTAL AG		175	189	2,144	278,317	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		1,534	1,659	7,730	1,003,476	航空貨物・物流サービス
MERCK KGAA		199	211	3,079	399,724	医薬品
RWE AG		931	1,085	3,515	456,298	総合公益事業
SAP SE		1,539	1,724	17,853	2,317,415	ソフトウェア
E.ON SE		3,550	3,800	3,708	481,303	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		163	180	1,518	197,075	家庭用品
PUMA SE		126	163	1,341	174,167	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG		1,543	1,616	8,686	1,127,442	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		277	289	2,779	360,792	家庭用品
BASF SE		1,445	1,512	10,868	1,410,699	化学
BEIERSDORF AG		160	160	1,440	186,995	パーソナル用品
HOCHTIEF AG		38	38	286	37,140	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG		226	249	1,951	253,261	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE		333	366	2,307	299,482	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG		654	680	14,895	1,933,422	保険

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	420	560	640	83,191	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	228	229	6,068	787,691	保険
VOLKSWAGEN AG	51	51	1,608	208,788	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	289	312	7,505	974,169	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,403	1,431	10,867	1,410,538	自動車
NEMETSCHKE SE	—	92	496	64,484	ソフトウェア
THYSSENKRUPP AG	620	—	—	—	金属・鉱業
SIEMENS AG	1,201	1,263	17,818	2,312,828	コングロマリット
DEUTSCHE BANK AG-REG	3,140	3,340	3,440	446,537	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	521	559	4,963	644,316	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	78	102	691	89,698	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	5,180	5,580	9,550	1,239,612	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	53	57	2,426	314,896	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,990	2,188	7,775	1,009,202	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	—	8	568	73,743	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	60	72	920	119,436	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	—	44	696	90,465	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	295	320	4,528	587,734	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	227	254	2,342	304,041	自動車
FRAPORT AG	63	—	—	—	運送インフラ
WIRECARD AG	180	—	—	—	情報技術サービス
LANXESS	120	127	813	105,567	化学
MTU AERO ENGINES AG	84	92	1,851	240,384	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE	562	555	2,200	285,562	不動産管理・開発
SYMRISE AG	198	209	2,146	278,606	化学
BRENNTAG SE	238	268	1,972	256,027	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	330	330	1,005	130,558	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,500	1,500	374	48,558	各種電気通信サービス
COMMERZBANK AG	1,580	1,580	838	108,899	銀行
LEG IMMOBILIEN SE	—	125	1,408	182,855	不動産管理・開発
KION GROUP AG	99	110	918	119,221	機械
VONOVIA SE	795	878	4,883	633,869	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	71	127	1,348	175,066	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	239	460	2,096	272,149	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	250	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	252	898	116,577	ソフトウェア
SIEMENS ENERGY AG	—	660	2,002	259,916	電気設備
ZALANDO SE	215	249	2,059	267,288	インターネット販売・通信販売
SCOUT24 AG	—	171	1,102	143,162	インタラクティブ・メディアおよびサービス
COVESTRO AG	269	305	1,775	230,407	化学
HELLOFRESH SE	—	240	1,466	190,338	インターネット販売・通信販売
QIAGEN N.V.	354	394	1,609	208,962	ライフサイエンス・ツール/サービス
UNIPER SE	311	311	965	125,301	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	179	221	2,418	313,966	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 ・ 金 額	37,820	41,145	217,387	28,216,956
	銘柄 数 < 比 率 >	58	62	—	<3.0%>
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,750	1,880	3,222	418,257	保険
INTESA SANPAOLO	23,300	27,800	6,459	838,421	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.	880	1,070	1,032	133,997	銀行
ENEL SPA	12,630	13,580	11,452	1,486,471	電力
ENI SPA	4,030	4,110	4,279	555,457	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA	3,200	3,500	1,653	214,565	ガス
TENARIS SA	710	710	685	89,006	エネルギー設備・サービス

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
TELECOM ITALIA SPA		15,500	11,700	538	69,934	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		8,800	8,800	431	55,992	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		790	790	1,262	163,862	運送インフラ
TERNA SPA		2,220	2,220	1,434	186,148	電力
RECORDATI SPA		168	168	764	99,175	医薬品
LEONARDO SPA		640	—	—	—	航空宇宙・防衛
AMPLIFON SPA		—	203	649	84,265	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRYSMIAN SPA		370	430	1,168	151,646	電気設備
DIASORIN SPA		—	40	550	71,493	ヘルスケア機器・用品
FERRARI NV		189	213	3,731	484,382	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		1,540	1,700	2,289	297,118	機械
MONCLER SPA		281	321	1,579	205,037	繊維・アパレル・贅沢品
NEXI SPA		—	740	1,082	140,572	情報技術サービス
STELLANTIS NV		—	3,340	5,044	654,778	自動車
FINECOBANK BANCA FINECO SPA		910	1,010	1,414	183,537	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		1,700	—	—	—	自動車
UNICREDIT SPA		3,130	3,610	3,299	428,327	銀行
EXOR NV		172	172	1,228	159,404	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		770	880	955	123,990	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		—	550	516	66,999	各種電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		910	—	—	—	飲料
PIRELLI & C. SPA		530	—	—	—	自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	85,120	89,537	56,724	7,362,843	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	25	—	<0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		348	400	1,377	178,812	建設・土木
AIRBUS SE		918	968	9,457	1,227,565	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT		820	870	1,875	243,468	総合公益事業
LOREAL-ORD		394	420	13,767	1,787,034	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		435	460	26,381	3,424,253	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA		3	3	311	40,371	航空宇宙・防衛
THALES SA		163	186	1,584	205,696	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA		245	273	3,958	513,813	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA		83	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP		95	—	—	—	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE		321	380	2,020	262,305	メディア
FAURECIA		105	150	673	87,400	自動車部品
BOLLORE		1,380	1,380	563	73,082	娯楽
MICHELIN (CGDE)		267	287	3,709	481,489	自動車部品
PERNOD RICARD SA		335	343	5,530	717,907	飲料
RENAULT SA		281	337	1,268	164,669	自動車
REMY COINTREAU		40	39	622	80,742	飲料
SEB SA		38	41	630	81,872	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE		869	887	11,375	1,476,575	電気設備
VIVENDI SA		1,300	1,400	3,907	507,180	娯楽
ORANGE SA		3,120	3,250	3,432	445,473	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		50	53	5,049	655,443	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA		209	223	4,032	523,477	ソフトウェア
KERING SA		117	127	7,498	973,250	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES		280	280	461	59,894	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE		950	950	1,457	189,219	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		153	153	1,009	131,072	情報技術サービス
SANOFI		1,767	1,869	15,673	2,034,411	医薬品
ACCOR SA		262	320	1,041	135,241	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
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS NV		1,050	1,078	3,439	446,498	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE		1,270	1,290	2,910	377,832	銀行
TELEPERFORMANCE		90	96	2,966	385,038	専門サービス
EURAZEO SE		59	59	389	50,495	各種金融サービス
SODEXO		132	138	1,139	147,884	ホテル・レストラン・レジャー
AXA SA		3,010	3,170	7,338	952,543	保険
PEUGEOT CITROEN		880	—	—	—	自動車
JC DECAUX SA		150	—	—	—	メディア
ESSILORLUXOTTICA		439	478	6,596	856,212	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA		1,840	1,840	2,296	298,062	銀行
BNP PARIBAS		1,739	1,850	9,734	1,263,564	銀行
ORPEA		—	93	925	120,158	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)		790	828	4,250	551,773	建設関連製品
WENDEL		43	43	455	59,162	各種金融サービス
ILIAD SA		24	24	387	50,279	各種電気通信サービス
SES FDR		560	560	381	49,515	メディア
SAFRAN SA		508	538	6,270	813,896	航空宇宙・防衛
ENGIE		2,900	3,080	3,706	481,140	総合公益事業
ALSTOM		303	433	1,849	240,044	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS		241	—	—	—	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE		940	1,090	1,235	160,369	電力
IPSEN		55	55	385	49,973	医薬品
ARKEMA		99	116	1,205	156,515	化学
LEGRAND SA		410	452	3,570	463,489	電気設備
EIFFAGE SA		121	141	1,225	159,115	建設・土木
TOTAL SE		3,762	4,159	16,739	2,172,848	石油・ガス・消耗燃料
ADP		47	47	479	62,226	運送インフラ
NATIXIS		1,580	1,580	640	83,100	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT		144	144	921	119,586	娯楽
SCOR SE		232	232	689	89,497	保険
VINCI		810	873	7,717	1,001,708	建設・土木
DANONE		972	1,038	6,103	792,226	食品
AIR LIQUIDE SA		734	791	10,998	1,427,651	化学
BUREAU VERITAS SA		470	470	1,136	147,573	専門サービス
GETLINK		720	720	952	123,642	運送インフラ
SUEZ		520	520	936	121,492	総合公益事業
EDENRED		382	424	1,892	245,622	情報技術サービス
VALEO SA		373	373	1,094	142,099	自動車部品
BIOMERIEUX		69	69	735	95,473	ヘルスケア機器・用品
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM		—	154	599	77,877	ホテル・レストラン・レジャー
FAURECIA		—	56	253	32,854	自動車部品
WORLDLINE SA		198	386	2,738	355,436	情報技術サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		41	45	1,564	203,070	ライフサイエンス・ツール/サービス
AMUNDI SA		100	100	702	91,184	資本市場
小 計	株 数 ・ 金 額	44,157	45,686	248,231	32,220,466	
	銘柄 数 < 比 率 >	70	68	—	<3.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
ASM INTERNATIONAL NV		—	78	1,866	242,276	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV		184	184	1,116	144,875	専門サービス
WOLTERS KLUWER		418	444	3,270	424,511	専門サービス
VOPAK		114	114	483	62,784	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		2,930	2,930	1,214	157,602	保険
KONINKLIJKE KPN NV		5,600	5,600	1,624	210,795	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		1,426	1,527	7,384	958,517	ヘルスケア機器・用品

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
HEINEKEN NV		400	438	3,880	503,712	飲料	
HEINEKEN HOLDING NV		172	200	1,536	199,372	飲料	
KONINKLIJKE DSM NV		285	291	4,300	558,267	化学	
UNILEVER NV		2,276	—	—	—	パーソナル用品	
ASML HOLDING NV		666	703	36,342	4,717,237	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,706	1,860	4,454	578,220	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL		324	312	2,984	387,400	化学	
PROSUS NV		768	816	7,747	1,005,574	インターネット販売・通信販売	
JDE PEET'S BV		—	110	347	45,047	食品	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV		—	910	881	114,361	飲料	
NN GROUP NV		470	470	1,988	258,116	保険	
ARGENX SE		—	76	1,779	231,033	バイオテクノロジー	
ARCELORMITTAL		990	1,190	2,905	377,118	金属・鉱業	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV		175	206	1,596	207,225	インターネット販売・通信販売	
ABN AMRO BANK NV-CVA		700	700	726	94,267	銀行	
ALTICE EUROPE N.V.		990	—	—	—	各種電気通信サービス	
ADYEN NV		16	30	5,726	743,283	情報技術サービス	
ING GROEP NV		6,170	6,390	6,694	868,902	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	26,781	25,580	100,851	13,090,504		
	銘柄 数 < 比 率 >	21	23	—	<1.4%>		
(ユーロ…スペイン)							
ENDESA S. A.		500	500	1,142	148,296	電力	
BANKINTER S. A.		910	—	—	—	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.		10,560	10,900	4,903	636,527	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA		490	500	1,045	135,705	ガス	
REPSOL SA		2,204	2,448	2,613	339,172	石油・ガス・消耗燃料	
BANCO SANTANDER SA		26,140	28,500	8,383	1,088,149	銀行	
TELEFONICA SA		7,320	8,200	3,147	408,501	各種電気通信サービス	
ENAGAS SA		390	390	720	93,549	ガス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		380	380	1,188	154,285	電気設備	
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		403	370	1,026	133,291	建設・土木	
FERROVIAL SA		770	797	1,771	229,919	建設・土木	
MAPFRE SA		1,630	—	—	—	保険	
BANCO DE SABADELL SA		8,019	—	—	—	銀行	
CAIXABANK		5,300	6,000	1,611	209,185	銀行	
IBERDROLA SA		9,660	10,220	11,134	1,445,282	電力	
AMADEUS IT GROUP SA		667	760	4,604	597,609	情報技術サービス	
RED ELECTRICA CORPORACION SA		700	700	1,045	135,653	電力	
INDITEX SA		1,680	1,840	5,216	677,088	専門小売り	
AENA SME SA		107	117	1,609	208,967	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SA		386	539	2,538	329,521	各種電気通信サービス	
GRIFOLS SA		468	468	1,051	136,497	バイオテクノロジー	
BANKIA SA		1,510	—	—	—	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	80,196	73,631	54,755	7,107,206		
	銘柄 数 < 比 率 >	22	18	—	<0.8%>		
(ユーロ…ベルギー)							
KBC GROEP NV		382	409	2,596	337,003	銀行	
SOFINA SA		—	23	664	86,278	各種金融サービス	
SOLVAY SA		114	116	1,260	163,667	化学	
UCB SA		195	206	1,674	217,386	医薬品	
COLRUYT SA		87	87	441	57,253	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAM		124	195	1,733	225,065	各種金融サービス	
PROXIMUS		260	260	487	63,260	各種電気通信サービス	
GALAPAGOS NV		70	70	452	58,713	バイオテクノロジー	

銘柄		期首(前期末)	当		期		業	種	等
		株	株	評					
				価	額				
		数	数	外貨建金額	邦貨換算金額				
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円				
ELIA GROUP SA/NV		—	48	444	57,631	電力			
TELENET GROUP HOLDING NV		67	—	—	—	メディア			
AGEAS		289	289	1,502	194,988	保険			
UMICORE		310	343	1,550	201,236	化学			
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		1,201	1,277	7,004	909,163	飲料			
小	計	株数・金額	3,099	3,323	19,812	2,571,649			
銘柄数<比率>		11	12	—	<0.3%>				
(ユーロ…オーストリア)									
OMV AG		210	250	1,091	141,676	石油・ガス・消耗燃料			
VERBUND AG		110	110	666	86,524	電力			
VOESTALPINE AG		200	200	710	92,261	金属・鉱業			
ERSTE GROUP BANK AG		480	490	1,433	186,035	銀行			
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		201	201	378	49,074	銀行			
ANDRITZ AG		117	—	—	—	機械			
小	計	株数・金額	1,318	1,251	4,280	555,573			
銘柄数<比率>		6	5	—	<0.1%>				
(ユーロ…ルクセンブルグ)									
EUROFINS SCIENTIFIC SE		17	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス			
AROUNDTOWN SA		1,850	1,730	1,057	137,292	不動産管理・開発			
EUROFINS SCIENTIFIC SE		—	216	1,752	227,518	ライフサイエンス・ツール/サービス			
小	計	株数・金額	1,867	1,946	2,810	364,810			
銘柄数<比率>		2	2	—	<0.0%>				
(ユーロ…フィンランド)									
KESKO OYJ-B SHS		—	440	1,134	147,234	食品・生活必需品小売り			
WARTSILA OYJ		630	660	592	76,964	機械			
UPM-KYMMENE OYJ		832	910	2,987	387,781	紙製品・林産品			
STORA ENSO OYJ-R		850	960	1,612	209,341	紙製品・林産品			
SAMPO OYJ-A SHS		682	804	3,118	404,809	保険			
FORTUM OYJ		720	720	1,648	213,920	電力			
ELISA OYJ		221	221	1,141	148,190	各種電気通信サービス			
METSO OYJ		162	—	—	—	機械			
NOKIA OYJ		8,800	9,230	3,150	408,955	通信機器			
NESTE OYJ		668	714	3,295	427,797	石油・ガス・消耗燃料			
NOKIAN RENKAAT OYJ		210	—	—	—	自動車部品			
KONE OYJ		540	574	4,006	520,046	機械			
ORION OYJ		165	165	561	72,924	医薬品			
小	計	株数・金額	14,480	15,398	23,250	3,017,967			
銘柄数<比率>		12	11	—	<0.3%>				
(ユーロ…アイルランド)									
CRH PLC		1,253	1,322	5,233	679,346	建設資材			
KINGSPAN GROUP PLC		245	264	1,842	239,185	建設関連製品			
KERRY GROUP PLC-A		244	259	2,807	364,421	食品			
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	—	—	銀行			
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		353	423	1,710	222,037	容器・包装			
BANK OF IRELAND GROUP PLC		1,330	—	—	—	銀行			
AIB GROUP PLC		1,250	—	—	—	銀行			
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		121	266	4,931	640,126	ホテル・レストラン・レジャー			
小	計	株数・金額	6,194	3,932	16,526	2,145,117			
銘柄数<比率>		8	6	—	<0.2%>				
(ユーロ…ポルトガル)									
ENERGIAS DE PORTUGAL		3,870	4,760	2,280	296,010	電力			
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		810	810	805	104,507	石油・ガス・消耗燃料			

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…ポルトガル)		千ユーロ	千円			
JERONIMO MARTINS		380	380	523	67,968	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	5,060	5,950	3,609	468,486	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	306,092	307,381	748,240	97,121,583	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	235	—	<10.5%>	
(香港)		千香港ドル				
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		480	480	4,800	68,352	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		3,100	3,600	7,326	104,322	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		2,200	2,200	3,679	52,394	銀行
CLP HLDGS		2,530	2,810	21,327	303,709	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,887	1,983	91,931	1,309,109	資本市場
MTR CORP		2,430	2,720	12,131	172,748	陸運・鉄道
HANG SENG BANK		1,190	1,310	19,715	280,748	銀行
HENDERSON LAND		2,294	2,294	8,248	117,458	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		2,250	2,250	10,316	146,903	電力
HONG KONG & CHINA GAS		15,603	17,403	21,545	306,811	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		3,350	3,560	25,667	365,506	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		1,140	—	—	—	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		5,690	6,100	17,354	247,128	銀行
NWS HOLDINGS LTD		2,205	—	—	—	コングロマリット
PCCW LTD		7,500	7,500	3,360	47,846	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		970	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		9,396	—	—	—	不動産管理・開発
SINO LAND CO.LTD		4,800	4,800	5,328	75,870	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		2,480	2,220	27,084	385,676	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		750	750	4,380	62,371	不動産管理・開発
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED		1,300	—	—	—	食品
WHEELOCK & COMPANY LTD		1,340	—	—	—	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED		2,120	2,330	30,453	433,652	機械
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD		—	2,800	7,224	102,869	建設関連製品
SJM HOLDINGS LIMITED		2,700	2,700	2,770	39,447	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		2,280	2,280	3,451	49,155	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		18,930	19,980	191,907	2,732,768	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		5,996	5,996	6,823	97,165	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		3,840	3,840	14,822	211,070	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,730	1,730	4,221	60,109	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,830	2,790	12,680	180,571	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD		—	2,600	6,565	93,485	不動産管理・開発
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		2,160	2,900	6,800	96,839	飲料
WH GROUP LIMITED		14,600	16,100	11,624	165,528	食品
NEW WORLD DEVELOPMENT		—	2,689	10,931	155,663	不動産管理・開発
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		4,250	4,600	28,637	407,797	コングロマリット
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		1,070	1,070	5,007	71,308	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD		4,090	4,450	21,317	303,560	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	140,483	140,837	649,434	9,247,951	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	32	—	<1.0%>	
(シンガポール)		千シンガポールドル				
SINGAPORE TECH ENGINEERING		2,490	2,490	971	79,892	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HLDGS		2,840	3,020	8,758	720,520	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		700	700	558	45,956	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		140	—	—	—	販売
SATS LTD		1,150	—	—	—	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		1,290	1,290	1,283	105,597	資本市場
CAPITALAND LIMITED		3,800	4,300	1,621	133,367	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
COMFORTDELGRO CORP LTD		3,100	—	—	—	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD		770	2,400	1,346	110,768	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK		2,000	1,900	4,926	405,319	銀行
UOL GROUP LIMITED		650	870	695	57,188	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD		450	450	908	74,746	電子装置・機器・部品
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		2,400	—	—	—	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		12,900	14,000	3,444	283,337	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		1,400	—	—	—	総合公益事業
OCBC-ORD		5,240	5,590	6,635	545,888	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		2,890	3,400	1,866	153,565	食品
KEPPEL CORP.		2,320	2,320	1,238	101,922	コングロマリット
YANGZIJANG SHIPBUILDING		4,400	—	—	—	機械
GENTING SINGAPORE LTD		8,700	11,300	1,056	86,922	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	59,630	54,030	35,310	2,904,994	
		20	14	—	<0.3%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		250	295	1,946	164,224	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		4,390	4,750	13,347	1,125,995	銀行
WESTPAC BANKING CORP		5,630	5,940	14,469	1,220,675	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		2,190	2,760	5,547	467,995	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD		6,500	7,300	2,503	211,229	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD		920	—	—	—	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		770	770	1,034	87,302	飲料
ASX LTD		307	307	2,164	182,636	資本市場
BHP GROUP LIMITED		4,580	4,860	21,826	1,841,263	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		400	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		971	—	—	—	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD		760	760	1,127	95,144	情報技術サービス
COMPUTERSHARE LTD-RIGHTS		—	86	11	928	情報技術サービス
CSL LIMITED		712	758	19,909	1,679,576	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD		88	88	1,225	103,352	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP		4,340	4,620	5,996	505,886	運送インフラ
COCHLEAR LTD		89	103	2,152	181,601	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		2,650	2,650	1,221	103,058	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		2,778	2,951	25,201	2,126,001	銀行
BORAL LTD		2,000	—	—	—	建設資材
RIO TINTO LTD		575	607	6,652	561,223	金属・鉱業
APA GROUP		1,800	2,050	2,045	172,592	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		880	990	3,327	280,698	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		3,610	4,300	1,990	167,952	保険
TPG TELECOM LTD		520	—	—	—	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		73	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD		590	590	823	69,482	化学
BLUESCOPE STEEL LTD		880	900	1,730	146,001	金属・鉱業
WORLEY LTD		470	—	—	—	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD		1,903	2,220	2,164	182,597	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		4,560	5,410	14,017	1,182,500	銀行
NEWCREST MINING		1,170	1,320	3,252	274,379	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		2,040	3,500	1,442	121,647	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD		2,330	—	—	—	化学
AMP LIMITED		5,300	5,300	681	57,453	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED		1,080	1,700	850	71,706	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE		1,950	2,440	2,308	194,723	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		—	1,940	1,891	159,566	金属・鉱業

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	千豪ドル	千円	
CHALLENGER LIMITED		800	—	—	—	各種金融サービス
SANTOS LTD.		2,610	3,100	2,210	186,460	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD		690	780	2,746	231,684	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	527	44,457	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS		3,400	3,709	1,713	144,559	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED		1,750	1,902	9,936	838,205	複合小売り
ALUMINA LTD		3,500	—	—	—	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM		1,520	1,630	3,925	331,116	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,970	2,120	8,533	719,843	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		192	192	864	72,887	資本市場
SEEK LTD		480	600	1,677	141,522	インタラクティブ・メディアおよびサービス
BRAMBLES LTD		2,510	2,470	2,573	217,120	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED		530	568	8,551	721,430	資本市場
CROWN RESORTS LTD		550	550	646	54,564	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD		—	2,720	1,136	95,913	金属・鉱業
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		670	730	2,860	241,342	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD		1,110	1,110	1,148	96,916	飲料
SYDNEY AIRPORT		1,680	2,006	1,195	100,869	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD		3,050	3,050	1,174	99,059	陸運・鉄道
XERO LIMITED		—	198	2,487	209,826	ソフトウェア
AFTERPAY LTD		—	348	3,515	296,596	情報技術サービス
AMPOL LTD		—	400	986	83,178	石油・ガス・消耗燃料
TPG TELECOM LTD		—	520	327	27,636	各種電気通信サービス
AUSNET SERVICES		3,300	3,300	598	50,527	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD		4,500	4,500	1,264	106,673	保険
AGL ENERGY LTD		1,050	1,050	1,030	86,895	総合公益事業
SOUTH32 LTD		7,800	7,800	2,184	184,242	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD		180	180	313	26,421	建設・土木
COLES GROUP LTD		1,760	2,270	3,570	301,225	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		210	210	591	49,869	ソフトウェア
小 計	株 数 ・ 金 額	116,038	120,448	231,157	19,500,444	
	銘 柄 数 < 比 率 >	61	58	—	<2.1%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD		580	740	1,115	86,349	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD		1,170	1,170	999	77,316	食品
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L		860	930	2,982	230,786	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD		1,500	—	—	—	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD		3,070	3,070	1,399	108,325	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		1,000	1,000	620	47,975	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,520	2,230	1,710	132,351	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD		2,010	2,010	1,074	83,132	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	11,710	11,150	9,902	766,238	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<0.1%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
BANK HAPOALIM BM		1,830	1,830	4,758	157,918	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		2,380	2,380	5,236	173,782	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		36	50	2,328	77,282	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		1,720	1,720	2,385	79,179	銀行
ICL GROUP LTD		1,250	1,250	2,475	82,145	化学
NICE LTD		95	106	7,689	255,205	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		230	230	2,004	66,520	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
				千新シェケル	千円
(イスラエル)		百株	百株		
AZRIELI GROUP		65	65	1,356	45,023
小 計	株 数 ・ 金 額	7,606	7,631	28,233	937,058
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>
合 計	株 数 ・ 金 額	1,720,128	1,803,673	—	889,554,397
	銘柄 数 < 比 率 >	1,252	1,229	—	<95.9%>

* 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	80,000	93,000	1,570	173,899	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,900	22,400	3,724	412,333	0.0
AMERICAN TOWER CORP	69,400	73,700	17,477	1,934,984	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	214,000	238,000	2,075	229,763	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	22,700	4,253	470,882	0.0
BOSTON PROPERTIES	24,700	25,000	2,575	285,105	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,500	16,000	1,777	196,762	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	64,500	72,100	12,328	1,364,874	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	40,700	45,200	6,384	706,777	0.1
DUKE REALTY CORP	56,600	62,200	2,642	292,524	0.0
EQUINIX INC	13,250	14,810	9,994	1,106,477	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	29,400	1,902	210,655	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	57,700	60,300	4,391	486,199	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,070	10,700	2,975	329,460	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	20,700	2,753	304,795	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	75,700	88,000	2,814	311,564	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	109,000	1,885	208,765	0.0
INVITATION HOMES INC	85,000	92,000	2,967	328,476	0.0
IRON MOUNTAIN INC	43,100	49,000	1,820	201,585	0.0
KIMCO REALTY CORP	65,000	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	99,000	2,101	232,686	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	19,300	2,843	314,821	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	—	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,200	36,500	1,355	150,079	0.0
PROLOGIS INC	114,500	122,700	13,099	1,450,240	0.2
PUBLIC STORAGE	24,500	26,500	6,546	724,740	0.1
REALTY INCOME CORP	49,900	55,600	3,565	394,689	0.0
REGENCY CENTERS CORP	26,200	26,200	1,495	165,537	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	18,100	4,999	553,543	0.1
SL GREEN REALTY CORP	12,500	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	54,800	6,323	700,060	0.1
SUN COMMUNITIES INC	14,300	17,800	2,666	295,240	0.0
UDR INC	46,300	46,100	2,046	226,605	0.0
VENTAS INC	56,800	63,900	3,496	387,109	0.0
VEREIT INC	160,000	—	—	—	—
VEREIT INC	—	37,000	1,433	158,648	0.0
VICI PROPERTIES INC	68,000	87,000	2,454	271,712	0.0
VORNADO REALTY TRUST	27,000	27,000	1,257	139,205	0.0
WP CAREY INC	27,400	27,400	1,936	214,434	0.0
WELLTOWER INC	63,100	68,000	4,959	549,037	0.1
WEYERHAEUSER CO	115,000	121,000	4,289	474,885	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	2,153,190	2,098,110	153,185	16,959,169
	銘 柄 数 < 比 率 >	41	37	—	<1.8%>
(カナダ)			千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	14,900	803	70,549	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	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT		16,000	—	—	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		20,000	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		22,000	22,000	428	37,638	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		11,000	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	80,500	36,900	1,232	108,187	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	2	—	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		128,000	128,000	668	101,713	0.0
SEGRO PLC		176,000	193,000	1,821	277,350	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		111,000	111,000	781	118,958	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	415,000	432,000	3,271	498,023	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		5,200	—	—	—	—
KLEPIERRE		32,300	32,300	655	85,066	0.0
GECINA SA		7,100	7,100	836	108,562	0.0
COVIVIO		6,600	8,500	621	80,651	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		21,400	24,200	1,675	217,431	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	72,600	72,100	3,788	491,711	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		330,000	353,000	25,627	364,939	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		370,000	470,000	3,647	51,936	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	700,000	823,000	29,275	416,876	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		390,000	706,779	1,540	126,759	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		440,800	539,240	1,655	136,195	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		439,972	—	—	—	—
SUNTEC REIT		300,000	300,000	474	38,995	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—	427,980	834	68,659	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		370,000	370,000	795	65,445	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,940,772	2,343,999	5,300	436,056	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		660,000	660,000	1,597	134,739	0.0
GPT GROUP		285,000	330,000	1,488	125,552	0.0
LENDLEASE GROUP		88,000	111,000	1,428	120,514	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		348,000	400,000	1,720	145,099	0.0
DEXUS		171,000	171,000	1,633	137,764	0.0
GOODMAN GROUP		254,000	283,000	5,105	430,684	0.0
SCENTRE GROUP		870,000	820,000	2,304	194,382	0.0
VICINITY CENTRES		470,000	670,000	1,092	92,129	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3,146,000	3,445,000	16,368	1,380,866	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	8,508,062	9,251,109	—	20,290,891	
	銘 柄 数 < 比 率 >	69	61	—	<2.2%>	

* 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
外 国	株式先物取引	CAN60	百万円 625	百万円 —
		EUR050	1,924	—
		FT100	850	—
		SPI200	410	—
		SPEMINI	12,893	—
		SWISSMKT	542	—

*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

(2021年3月31日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	889,554,397	95.9
投資証券	20,290,891	2.2
コール・ローン等、その他	18,223,764	1.9
投資信託財産総額	928,069,052	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（924,695,878千円）の投資信託財産総額（928,069,052千円）に対する比率は99.6%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=110.71円、1カナダドル=87.78円、1英ポンド=152.23円、1スイスフラン=117.45円、1スウェーデンクローナ=12.69円、1ノルウェークローネ=12.96円、1デンマーククローネ=17.45円、1ユーロ=129.80円、1香港ドル=14.24円、1シンガポールドル=82.27円、1豪ドル=84.36円、1ニュージーランドドル=77.38円、1新シェケル=33.19円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年3月31日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	930,897,307,010
コール・ローン等	11,360,420,610
株式(評価額)	889,554,397,361
投資証券(評価額)	20,290,891,015
未収入金	2,928,620,789
未収配当金	1,068,206,289
差入委託証拠金	5,694,770,946
(B) 負債	3,249,055,909
未払金	2,860,485,021
未払解約金	385,126,122
未払利息	3,166
その他未払費用	3,441,600
(C) 純資産総額(A-B)	927,648,251,101
元本	245,531,591,330
次期繰越損益金	682,116,659,771
(D) 受益権総口数	245,531,591,330口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,781円

(注) 期首元本額は230,777,414,749円、期中追加設定元本額は55,380,942,946円、期中一部解約元本額は40,626,766,365円、1口当たり純資産額は3.7781円です。

○損益の状況（2020年4月1日～2021年3月31日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	13,052,106,182
受取配当金	13,036,907,012
受取利息	680,215
その他収益金	20,299,141
支払利息	△ 5,780,186
(B) 有価証券売買損益	309,639,022,800
売買益	315,409,403,936
売買損	△ 5,770,381,136
(C) 先物取引等取引損益	4,156,399,219
取引益	4,706,021,361
取引損	△ 549,622,142
(D) 保管費用等	△ 64,488,873
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	326,783,039,328
(F) 前期繰越損益金	325,246,401,340
(G) 追加信託差損益金	115,522,734,190
(H) 解約差損益金	△ 85,435,515,087
(I) 計(E+F+G+H)	682,116,659,771
次期繰越損益金(I)	682,116,659,771

* 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)	74,442,669,963
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)	45,981,765,212
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	26,522,667,082
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	13,216,423,125
マイバランス50(確定拠出年金向け)	8,813,350,365
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,195,934,986
のむらップ・ファンド(普通型)	7,413,821,765
野村つみたて外国株投信	7,140,146,927
のむらップ・ファンド(積極型)	5,874,675,457
野村インデックスファンド・外国株式	5,178,091,514
野村世界6資産分散投信(分配コース)	4,908,070,670
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)	4,311,126,171
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,032,789,678
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,834,191,486
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)	2,627,138,869
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,466,653,600
NET FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	2,021,283,487
野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)	1,908,713,316

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイバランスDC50	1,903,591,578
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,857,341,281
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)	1,678,880,730
マイバランスDC70	1,540,701,049
マイ・ロード	1,087,359,782
野村6資産均等バランス	983,476,455
マイバランスDC30	858,222,247
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)	842,367,196
のむらップ・ファンド(保守型)	819,498,259
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	676,118,737
のむらップ・ファンド(やや積極型)	487,897,427
野村外国株式インデックスファンド	477,100,665
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	350,614,763
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	289,956,615
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	260,136,200
野村DC運用戦略ファンド	253,010,969
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)	196,334,939
野村スリーゼロ先進国株式投信	178,508,014

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25VA（適格機関投資家専用）	176,662,260
のむらッ・ファンド（やや保守型）	174,692,702
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	139,042,389
バランスセレクト70	134,470,714
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	129,529,492
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）	120,394,293
バランスセレクト50	115,756,756
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	102,922,540
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）	81,695,228
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	71,722,146
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	57,114,645
野村資産設計ファンド2040	50,195,153
世界6資産分散ファンド	43,897,531
バランスセレクト30	39,135,026
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）	34,314,793
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	34,161,289
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	32,976,146
野村資産設計ファンド2030	31,475,054
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）	30,559,867
インデックス・ブレンド（タイプV）	29,572,851
野村資産設計ファンド2035	25,928,039
野村資産設計ファンド2025	23,182,058
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	20,090,323
インデックス・ブレンド（タイプIII）	19,291,406
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	13,989,553
ネクストコア	13,056,429
野村資産設計ファンド2015	12,330,327
野村資産設計ファンド2020	12,272,666

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村資産設計ファンド2050	12,050,256
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）	10,025,453
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	9,925,325
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	9,896,292
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	9,541,976
野村資産設計ファンド2045	7,896,295
インデックス・ブレンド（タイプIV）	7,664,466
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	6,945,648
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	6,582,277
野村資産設計ファンド2060	5,888,132
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）	5,574,893
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	5,432,214
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,681,040
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,139,055
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	3,987,021
インデックス・ブレンド（タイプII）	3,031,339
インデックス・ブレンド（タイプI）	2,325,239
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	2,237,410
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,097,616
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）	1,908,206
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）	1,868,065
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	1,615,748
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,598,417
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）	1,285,977
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,270,861
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）	1,019,172
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	40,682

○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29期（決算日 2021年3月8日）
第30期（決算日 2021年5月7日）
第31期（決算日 2021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。)

【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		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率					
第7	第17期(2019年 3月7日)	円 9,234	円 28	% 3.5	9,753	% 3.9	% 98.6	% 0.4			百万円 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
第10	第26期(2020年 9月7日)	9,802	28	1.9	10,638	1.5	98.4	0.8			30,965
	第27期(2020年11月9日)	9,577	24	△2.1	10,433	△1.9	98.3	0.9			30,480
	第28期(2021年 1月7日)	9,686	24	1.4	10,609	1.7	97.9	1.2			31,003
第11	第29期(2021年 3月8日)	9,737	23	0.8	10,648	0.4	98.2	1.0			31,452
	第30期(2021年 5月7日)	9,822	21	1.1	10,793	1.4	98.1	1.2			31,903
	第31期(2021年 7月7日)	9,919	25	1.2	10,947	1.4	98.2	1.1			32,471

(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 率	債 券 先 物 比 率
			騰落率		騰落率		
第29期	(期 首)2021年1月7日	円 9,686	% —	10,609	% —	% 97.9	% 1.2
	1月末	9,720	0.4	10,626	0.2	97.9	1.2
	2月末	9,626	△0.6	10,581	△0.3	97.8	1.3
	(期 末)2021年3月8日	9,760	0.8	10,648	0.4	98.2	1.0
第30期	(期 首)2021年3月8日	9,737	—	10,648	—	98.2	1.0
	3月末	9,829	0.9	10,731	0.8	97.6	1.5
	4月末	9,819	0.8	10,769	1.1	97.9	1.2
	(期 末)2021年5月7日	9,843	1.1	10,793	1.4	98.1	1.2
第31期	(期 首)2021年5月7日	9,822	—	10,793	—	98.1	1.2
	5月末	9,928	1.1	10,930	1.3	98.0	1.1
	6月末	9,909	0.9	10,892	0.9	96.8	2.3
	(期 末)2021年7月7日	9,944	1.2	10,947	1.4	98.2	1.1

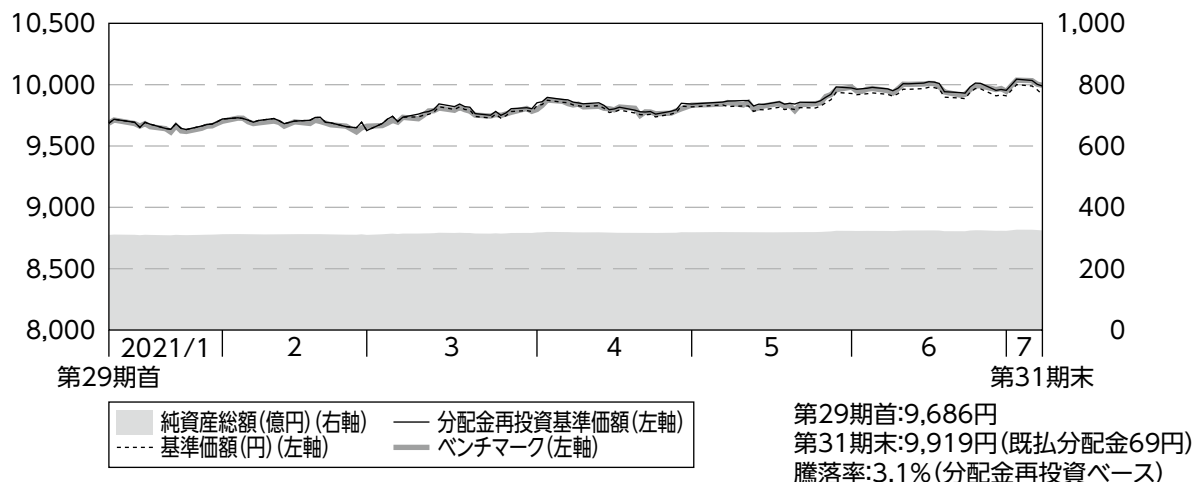
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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

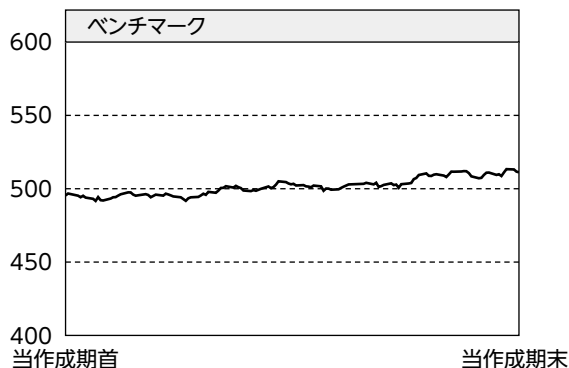


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2021年1月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当作成期初から2021年5月下旬にかけて、商品市況の高騰などを背景に世界的にインフレ懸念が高まる中、米国の消費者物価が予想以上の伸びとなったことや欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)推移となったものの、外国為替市場で、日米金利差の拡大が意識され円売り米ドル買いの動きが強まったこと、世界的な株高を受けたリスク選好姿勢の高まりから米ドル売りユーロ買いの動きが加速した影響や日欧の新型コロナウイルスのワクチン接種ペースの差異などを背景に円安・ユーロ高が進行したことなど、主要国の通貨が円安推移となったことから、基準価額(分配金再投資ベース)は緩やかな上昇が続きました。6月以降は、インフレに対する過度な警戒感が薄れ、主要国の長期金利が上昇一服から低下(債券価格は上昇)推移となり、一方でリスク選好姿勢の一服感からの主要通貨に対する米ドル買い戻しの流れによりユーロや英ポンドが対円で下落したことから、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、2021年5月中旬にかけて、商品市況の高騰などを背景に世界的にインフレ懸念が高まる中、米消費者物価が予想以上の伸びとなったことや欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから、上昇推移となりました。5月下旬以降は、上昇一服から低下推移となりました。

外国為替市場では、米ドルは、米長期金利の上昇による日米金利差の拡大を材料に、対円で上昇しました。ユーロや英ポンドは、2021年5月末にかけて、欧州での景気回復期待の高まりなどを背景に対円で上昇した後、6月以降は、米ドル買い戻しの流れの影響から、それまでの上昇幅を縮小しました。

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。

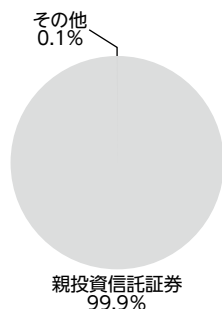
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

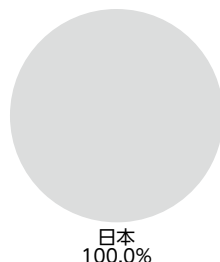
	当作成期末
	2021年7月7日
外国債券インデックス マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

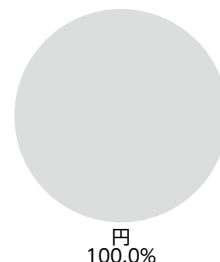
○資産別配分



○国別配分



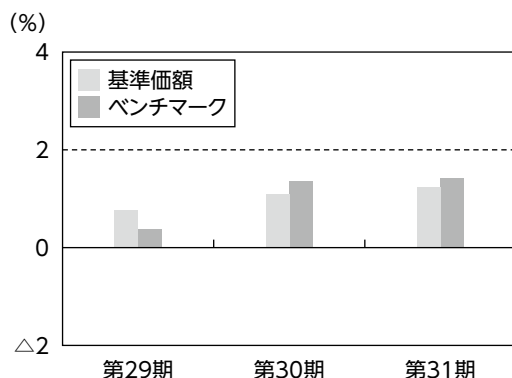
○通貨別配分



(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す。

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29期	第30期	第31期
	2021年1月8日～ 2021年3月8日	2021年3月9日～ 2021年5月7日	2021年5月8日～ 2021年7月7日
当期分配金 (円)	23	21	25
(対基準価額比率) (%)	(0.236)	(0.213)	(0.251)
当期の収益 (円)	23	21	25
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	941	949	1,045

(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		項目の概要
	(2021年1月8日～2021年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.065%	(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9,805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。 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 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(5)	(0.049)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.011)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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)	(－)	(－)	
(d) その他費用	1	0.014	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(1)	(0.011)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.079	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 242, 635	千円 734, 260	千口 88, 925	千円 271, 726

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
金 銭 信 託	百万円 0. 000860	百万円 0. 000860	% 100. 0	百万円 0. 000860	百万円 0. 000860	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2, 481	23	0. 9	2, 481	23	0. 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。

<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
為 替 直 物 取 引	百万円 24, 555	百万円 161	% 0. 7	百万円 5, 068	百万円 66	% 1. 3
金 銭 信 託	0. 155211	0. 155211	100. 0	0. 155211	0. 155211	100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	469, 049	3, 483	0. 7	469, 319	3, 483	0. 7

<平均保有割合 10. 7%>

(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	10,393,153	10,546,864	32,454,810

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、100,627,769千口です。

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	32,454,810	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	105,485	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	32,560,295	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(306,420,568千円)の投資信託財産総額(309,849,221千円)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=110.46円	1カナダドル=88.58円	1メキシコペソ=5.5211円
1ユーロ=130.53円	1イギリスポンド=152.38円	1スウェーデンクローナ=12.84円
1ノルウェークローネ=12.67円	1デンマーククローネ=17.55円	1ポーランドズロチ=28.9115円
1オーストラリアドル=82.73円	1シンガポールドル=81.97円	1マレーシアリングgit=26.5468円
1イスラエルシェケル=33.7168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 29 期 末 2021年3月8日現在	第 30 期 末 2021年5月7日現在	第 31 期 末 2021年7月7日現在
(A) 資 産	31,533,399,871円	31,978,461,810円	32,560,295,929円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	53,278,258	39,265,626	23,512,639
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	31,436,388,693	31,887,155,401	32,454,810,094
未 収 入 金	43,732,920	52,040,783	81,973,196
(B) 負 債	81,325,403	75,367,473	89,227,677
未 払 収 益 分 配 金	74,293,721	68,211,430	81,837,048
未 払 信 託 報 酬	6,759,413	6,883,269	7,112,821
未 払 利 息	36	28	36
そ の 他 未 払 費 用	272,233	272,746	277,772
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	31,452,074,468	31,903,094,337	32,471,068,252
元 本	32,301,617,845	32,481,633,461	32,734,819,325
次 期 繰 越 損 益 金	△849,543,377	△578,539,124	△263,751,073
(D) 受 益 権 総 口 数	32,301,617,845口	32,481,633,461口	32,734,819,325口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,737円	9,822円	9,919円

■損益の状況

項 目	第 29 期 自 2021年1月8日 至 2021年3月8日	第 30 期 自 2021年3月9日 至 2021年5月7日	第 31 期 自 2021年5月8日 至 2021年7月7日
(A) 配 当 等 収 益	△784円	△693円	△1,510円
受 取 利 息	5	—	—
支 払 利 息	△789	△693	△1,510
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	246,924,857	350,143,092	405,778,418
売 買 益	252,180,133	352,008,706	410,265,074
売 買 損	△5,255,276	△1,865,614	△4,486,656
(C) 信 託 報 酬 等	△7,031,646	△7,156,015	△7,390,593
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	239,892,427	342,986,384	398,386,315
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,296,710,647	1,462,284,260	1,731,805,485
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,311,852,730	△2,315,598,338	△2,312,105,825
(配 当 等 相 当 額)	(1,327,921,639)	(1,345,015,756)	(1,374,368,564)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,639,774,369)	(△3,660,614,094)	(△3,686,474,389)
(G) 計 (D+E+F)	△775,249,656	△510,327,694	△181,914,025
(H) 収 益 分 配 金	△74,293,721	△68,211,430	△81,837,048
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△849,543,377	△578,539,124	△263,751,073
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,311,852,730	△2,315,598,338	△2,312,105,825
(配 当 等 相 当 額)	(1,328,040,436)	(1,345,085,205)	(1,374,483,956)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,639,893,166)	(△3,660,683,543)	(△3,686,589,781)
分 配 準 備 積 立 金	1,712,693,295	1,737,524,787	2,048,354,752
繰 越 損 益 金	△250,383,942	△465,573	—

(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29期首元本額は32,009,729,298円、第29～31期中追加設定元本額は827,451,836円、第29～31期中一部解約元本額は102,361,809円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 29 期	第 30 期	第 31 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	91,198,879円	93,072,311円	93,793,277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	304,128,873円
(C) 収益調整金額	1,328,040,436円	1,345,085,205円	1,374,483,956円
(D) 分配準備積立金額	1,695,788,137円	1,712,663,906円	1,732,269,650円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	3,115,027,452円	3,150,821,422円	3,504,675,756円
(F) 期末残存口数	32,301,617,845口	32,481,633,461口	32,734,819,325口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	964円	970円	1,070円
(H) 分配金額(1万口当たり)	23円	21円	25円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	74,293,721円	68,211,430円	81,837,048円

分配金のお知らせ

	第29期	第30期	第31期
1万口当たり分配金	23円	21円	25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21期（決算日 2021年5月31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上げます。

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。
- ・一印は、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 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1	304,255

(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 率 比
	騰 落 率	中 率	騰 落 率	中 率		
(当 期 首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%
	29,017	—	481,049	—	97.3	2.1
6月末	29,466	1.5	488,814	1.6	96.8	2.3
7月末	29,761	2.6	494,135	2.7	97.5	1.5
8月末	29,723	2.4	492,649	2.4	97.8	1.4
9月末	29,856	2.9	494,877	2.9	97.9	1.2
10月末	29,425	1.4	488,038	1.5	98.0	1.1
11月末	29,723	2.4	493,201	2.5	97.9	1.4
12月末	29,967	3.3	497,331	3.4	98.4	1.0
2021年 1月末	29,924	3.1	496,213	3.2	97.9	1.2
2月末	29,638	2.1	494,148	2.7	97.8	1.3
3月末	30,338	4.6	501,120	4.2	97.6	1.5
4月末	30,310	4.5	502,927	4.5	98.0	1.2
(当 期 末) 2021年 5月31日	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1

(注1) 騰落率は期首比です。

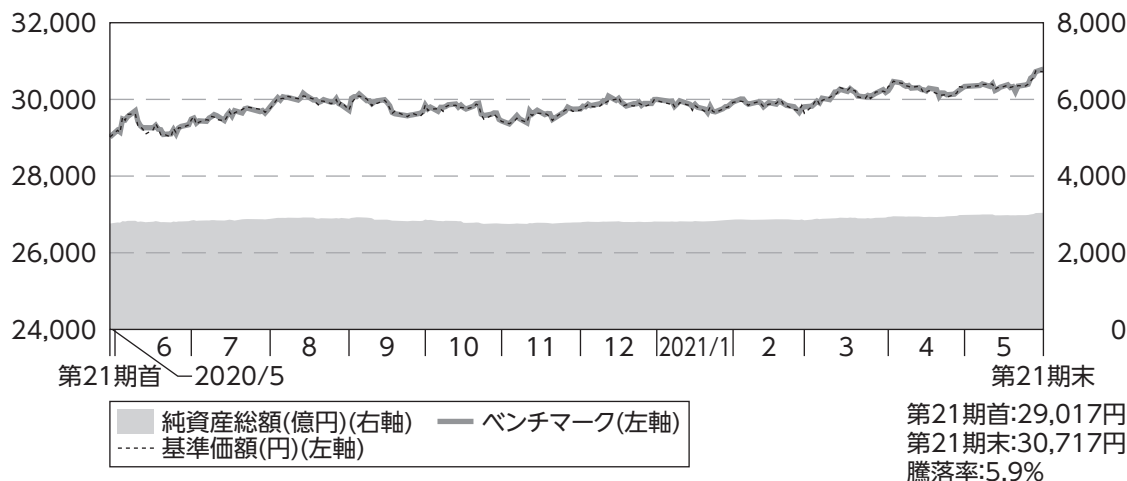
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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



(注)ベンチマークは、2020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8月中旬にかけて、ユーロ圏の景気回復期待が高まったことから外国為替市場でユーロが対円で上昇し、基準価額は上昇しました。その後11月上旬にかけては、主要国の長期金利がレンジ内で上下動を繰り返す中、主要通貨に対しては円高推移となり、基準価額は緩やかに低下しました。11月中旬以降期末にかけては、基準価額は緩やかに上昇しました。米国の景気やインフレの上振れ可能性が意識されたことや欧米での新型コロナウイルスに対するワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから、主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)したことが基準価額の下落要因となったものの、日米金利差の拡大が意識され円売り米ドル買いの動きが強まったこと、世界的な株高を受けたリスク選好姿勢の高まりから米ドル売りユーロ買いの動きが加速した影響や日欧のワクチン接種ペースの差異などを背景に円安・ユーロ高が進行したことなど、外国為替市場での上昇要因が債券市場での下落要因を上回り、基準価額は緩やかな上昇となりました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、大型の追加経済支援策の成立を受けて米国の景気やインフレの上振れ可能性が意識されたことや欧米でのワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから、上昇しました。

外国為替市場では、欧州での景気回復期待の高まりや新型コロナウイルスに対するワクチン接種ペースの差異などを背景に、ユーロやイギリスポンドは期を通じて対円で上昇が続きました。米ドルは、2021年に入ってから、米長期金利の上昇による日米金利差の拡大を材料に、対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

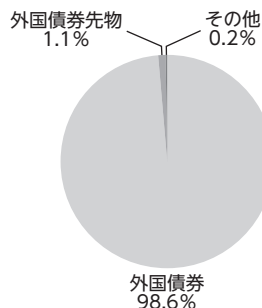
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.5%
2	T 1.125% 02/15/31	アメリカ	0.5%
3	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
4	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
5	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.4%
6	T 0.5% 02/28/26	アメリカ	0.4%

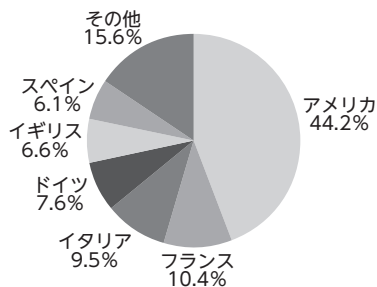
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 1.375% 11/15/40	アメリカ	0.4%
8	T 0.75% 03/31/26	アメリカ	0.4%
9	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.4%
10	T 2% 11/15/26	アメリカ	0.4%
組入銘柄数			779

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

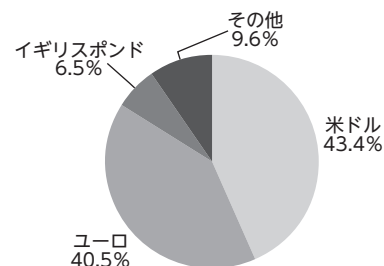
○資産別配分



○国別配分



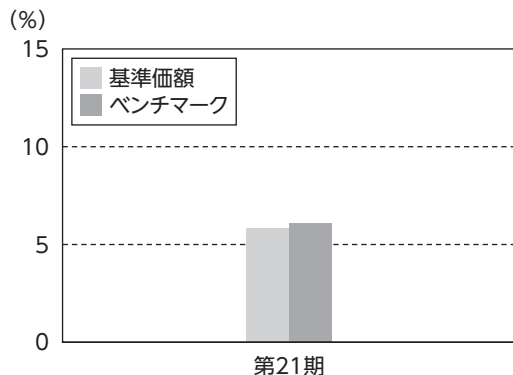
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.1%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※(マイナス要因)です。

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

今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年5月30日～2021年5月31日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (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円 (－) (－) (－) (－) (－) (－) (0)	0.001% (－) (－) (－) (－) (－) (－) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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
(b) 有価証券取引税 (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)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	7 (6) (－) (0)	0.022 (0.022) (－) (0.001)	(c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	7	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(29,762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	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 457,488	千米ドル 342,694
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 34,089	千カナダドル 29,278
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 96,120	千メキシコペソ 92,129
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 49,238	千ユーロ 40,717
	イ タ リ ア	国 債 証 券	44,645	41,154
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	46,062	31,928
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	9,672	7,928
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	25,164	20,917
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	7,389	8,218
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,215	5,428
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,868	1,632
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	4,146	2,260
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 35,739	千イギリスポンド 29,642
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 19,122	千スウェーデンクローナ 2,802
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 11,757	千ノルウェークローネ 13,795
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 19,833	千デンマーククローネ 16,230
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 23,002	千ポーランドズロチ 18,494
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 33,163	千オーストラリアドル 28,254
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,115	千シンガポールドル 3,776
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 13,174	千マレーシアリンギット 11,432
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 13,044	千イスラエルシェケル 4,940

(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 43,703	百万円 46,247	百万円 ー	百万円 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	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	
		B A			D C	
為 替 直 物 取 引	百万円 34,594	百万円 398	% 1.2	百万円 21,411	百万円 131	% 0.6
金 銭 信 託	8	8	100.0	878	878	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	848,778	49,277	5.8	848,144	49,277	5.8

(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B B 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
ア メ リ カ	千米ドル 1,162,010	千米ドル 1,203,672	千円 132,115,094	% 43.4	% —	% 19.1	% 16.7	% 7.6
カ ナ ダ	千カナダドル 65,030	千カナダドル 68,165	6,190,083	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 409,160	千メキシコペソ 435,502	2,399,051	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 145,240	千ユーロ 168,508	22,536,372	7.4	—	4.4	1.9	1.0
イ タ リ ア	181,970	212,485	28,417,855	9.3	—	5.9	2.4	1.0
フ ラ ン ス	199,590	231,573	30,970,696	10.2	—	6.3	2.8	1.0
オ ラ ン ダ	37,250	43,515	5,819,811	1.9	—	1.4	0.4	0.2
ス ペ イ ン	116,300	136,105	18,202,803	6.0	—	3.9	1.6	0.4
ベ ル ギ ー	44,900	54,084	7,233,204	2.4	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	28,760	33,538	4,485,399	1.5	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	12,840	13,804	1,846,189	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	16,880	18,705	2,501,713	0.8	—	0.6	0.2	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 106,280	千イギリスポンド 127,155	19,785,369	6.5	—	4.9	1.1	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 76,250	千スウェーデンクローナ 82,687	1,091,472	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 55,570	千ノルウェークローネ 57,183	750,250	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 71,160	千デンマーククローネ 85,326	1,534,167	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 60,380	千ポーランドズロチ 63,817	1,904,317	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 73,260	千オーストラリアドル 77,669	6,569,251	2.2	—	1.5	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 14,300	千シンガポールドル 15,576	1,291,459	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 51,060	千マレーシアリンギット 53,817	1,425,343	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 35,400	千イスラエルシェケル 40,142	1,356,443	0.4	—	0.3	0.1	0.1
合 計	—	—	298,426,352	98.1	—	54.0	30.4	13.6

(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		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 0.125%	01/15/24	0.125	10,000	9,973	1,094,727	2024/1/15
T 0.125%	02/15/24	0.125	4,710	4,696	515,515	2024/2/15
T 0.125%	05/15/23	0.125	7,500	7,498	823,071	2023/5/15
T 0.125%	09/15/23	0.125	8,060	8,050	883,628	2023/9/15
T 0.125%	10/15/23	0.125	8,000	7,989	876,913	2023/10/15
T 0.125%	12/15/23	0.125	3,250	3,243	355,995	2023/12/15
T 0.125%	12/31/22	0.125	6,400	6,401	702,642	2022/12/31
T 0.25%	03/15/24	0.25	13,000	13,002	1,427,102	2024/3/15
T 0.25%	04/15/23	0.25	10,150	10,173	1,116,631	2023/4/15
T 0.25%	06/15/23	0.25	8,000	8,016	879,863	2023/6/15
T 0.25%	06/30/25	0.25	1,000	987	108,362	2025/6/30
T 0.25%	07/31/25	0.25	10,000	9,860	1,082,293	2025/7/31
T 0.25%	09/30/25	0.25	7,500	7,378	809,855	2025/9/30
T 0.25%	10/31/25	0.25	3,600	3,536	388,143	2025/10/31
T 0.375%	01/31/26	0.375	8,000	7,873	864,188	2026/1/31
T 0.375%	04/15/24	0.375	7,000	7,019	770,510	2024/4/15
T 0.375%	04/30/25	0.375	8,000	7,954	873,072	2025/4/30
T 0.375%	07/31/27	0.375	9,500	9,107	999,626	2027/7/31
T 0.375%	09/30/27	0.375	8,000	7,641	838,703	2027/9/30
T 0.375%	11/30/25	0.375	3,000	2,959	324,881	2025/11/30
T 0.375%	12/31/25	0.375	4,000	3,941	432,660	2025/12/31
T 0.5%	02/28/26	0.5	11,500	11,374	1,248,434	2026/2/28
T 0.5%	03/15/23	0.5	7,770	7,822	858,598	2023/3/15
T 0.5%	03/31/25	0.5	7,220	7,219	792,374	2025/3/31
T 0.5%	04/30/27	0.5	2,940	2,853	313,202	2027/4/30
T 0.5%	05/31/27	0.5	3,500	3,391	372,245	2027/5/31
T 0.5%	06/30/27	0.5	7,100	6,870	754,090	2027/6/30
T 0.5%	08/31/27	0.5	4,660	4,493	493,260	2027/8/31
T 0.5%	10/31/27	0.5	7,500	7,207	791,140	2027/10/31
T 0.625%	05/15/30	0.625	14,100	13,054	1,432,874	2030/5/15
T 0.625%	08/15/30	0.625	15,950	14,707	1,614,311	2030/8/15
T 0.625%	11/30/27	0.625	2,500	2,418	265,460	2027/11/30
T 0.625%	12/31/27	0.625	10,000	9,659	1,060,213	2027/12/31
T 0.75%	01/31/28	0.75	8,500	8,265	907,230	2028/1/31
T 0.75%	03/31/26	0.75	11,000	10,997	1,207,124	2026/3/31
T 0.875%	11/15/30	0.875	11,150	10,492	1,151,637	2030/11/15
T 1.125%	02/15/31	1.125	15,050	14,445	1,585,554	2031/2/15
T 1.125%	02/29/28	1.125	2,000	1,991	218,611	2028/2/29
T 1.125%	05/15/40	1.125	8,060	6,743	740,216	2040/5/15
T 1.125%	08/15/40	1.125	9,300	7,752	850,905	2040/8/15
T 1.25%	03/31/28	1.25	5,150	5,163	566,721	2028/3/31
T 1.25%	05/15/50	1.25	10,650	8,307	911,867	2050/5/15
T 1.25%	07/31/23	1.25	4,550	4,657	511,229	2023/7/31
T 1.375%	01/31/25	1.375	9,000	9,298	1,020,639	2025/1/31
T 1.375%	06/30/23	1.375	5,000	5,127	562,798	2023/6/30
T 1.375%	08/15/50	1.375	9,900	7,979	875,835	2050/8/15
T 1.375%	08/31/23	1.375	2,500	2,567	281,828	2023/8/31
T 1.375%	09/30/23	1.375	4,000	4,111	451,285	2023/9/30
T 1.375%	10/15/22	1.375	5,000	5,087	558,425	2022/10/15
T 1.375%	11/15/40	1.375	13,000	11,320	1,242,500	2040/11/15
T 1.5%	01/15/23	1.5	6,200	6,339	695,850	2023/1/15
T 1.5%	01/31/27	1.5	6,000	6,184	678,805	2027/1/31
T 1.5%	02/15/30	1.5	6,470	6,484	711,700	2030/2/15
T 1.5%	02/28/23	1.5	7,800	7,987	876,695	2023/2/28
T 1.5%	03/31/23	1.5	4,000	4,100	450,093	2023/3/31
T 1.5%	08/15/22	1.5	10,000	10,172	1,116,507	2022/8/15
T 1.5%	08/15/26	1.5	8,400	8,682	952,956	2026/8/15
T 1.5%	09/15/22	1.5	9,500	9,673	1,061,721	2022/9/15
T 1.5%	09/30/24	1.5	8,500	8,816	967,654	2024/9/30

銘柄	利 率 (%)	期		末	
		額面金額	評 価		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	8,438	926,215	2026/2/15
T 1.625% 04/30/23	1.625	3,500	3,599	395,092	2023/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,363	259,403	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	1,029	113,007	2023/5/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,546	279,534	2022/8/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,863	753,382	2029/8/15
T 1.625% 08/31/22	1.625	5,000	5,096	559,379	2022/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,586	283,896	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	7,300	7,584	832,515	2026/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	8,080	8,259	906,572	2022/11/15
T 1.625% 11/15/50	1.625	8,050	6,922	759,799	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	8,780	9,121	1,001,148	2026/11/30
T 1.625% 12/15/22	1.625	3,600	3,684	404,404	2022/12/15
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,755	851,266	2023/1/31
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,805	417,742	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,710	1,065,773	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	7,126	782,185	2022/6/30
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,505	275,031	2024/6/30
T 1.75% 07/15/22	1.75	8,320	8,476	930,414	2022/7/15
T 1.75% 09/30/22	1.75	5,150	5,263	577,750	2022/9/30
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	3,077	337,769	2029/11/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	3,000	2,851	312,996	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	9,900	9,054	993,836	2051/2/15
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	9,189	1,008,619	2022/7/31
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,466	600,028	2026/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,089	448,858	2022/8/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	6,293	690,767	2024/8/31
T 1.875% 09/30/22	1.875	2,660	2,723	298,901	2022/9/30
T 1.875% 10/31/22	1.875	7,450	7,637	838,266	2022/10/31
T 2% 02/15/23	2.0	5,000	5,160	566,400	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,937	980,946	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,711	517,158	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,540	717,888	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,477	381,740	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,784	634,854	2024/6/30
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,067	336,688	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	7,295	800,734	2025/8/15
T 2% 10/31/22	2.0	10,000	10,268	1,127,119	2022/10/31
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	10,818	1,187,474	2026/11/15
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,056	225,775	2022/11/30
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,362	588,617	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,789	855,024	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,550	279,929	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,836	421,097	2026/5/31
T 2.125% 06/30/22	2.125	6,000	6,132	673,146	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	5,070	556,483	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,463	928,912	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,808	308,278	2023/11/30
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,489	602,501	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,214	462,604	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	9,594	1,053,073	2027/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	8,036	882,405	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	7,400	812,228	2024/4/30
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	9,157	1,005,092	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	7,290	7,278	798,837	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	5,476	601,133	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,695	734,895	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,792	1,184,606	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,709	516,882	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	8,189	898,866	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,735	519,773	2023/12/31

銘柄	当 期	利 率 (%)	額面金額	未 評 価 額			償還年月日
				外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)	
T 2.25%	12/31/24	2.25	8,400	8,941	981,408	2024/12/31	
T 2.375%	01/31/23	2.375	5,000	5,188	569,455	2023/1/31	
T 2.375%	02/29/24	2.375	5,760	6,095	669,088	2024/2/29	
T 2.375%	04/30/26	2.375	2,600	2,802	307,604	2026/4/30	
T 2.375%	05/15/27	2.375	10,750	11,598	1,273,023	2027/5/15	
T 2.375%	05/15/29	2.375	8,010	8,610	945,115	2029/5/15	
T 2.375%	08/15/24	2.375	5,000	5,324	584,407	2024/8/15	
T 2.375%	11/15/49	2.375	7,500	7,674	842,300	2049/11/15	
T 2.5%	01/31/24	2.5	3,470	3,679	403,882	2024/1/31	
T 2.5%	01/31/25	2.5	5,000	5,371	589,617	2025/1/31	
T 2.5%	02/15/45	2.5	3,210	3,362	369,065	2045/2/15	
T 2.5%	02/15/46	2.5	4,000	4,188	459,688	2046/2/15	
T 2.5%	03/31/23	2.5	4,050	4,225	463,819	2023/3/31	
T 2.5%	05/15/24	2.5	7,900	8,418	923,973	2024/5/15	
T 2.5%	05/15/46	2.5	5,050	5,288	580,443	2046/5/15	
T 2.5%	08/15/23	2.5	4,550	4,783	525,080	2023/8/15	
T 2.625%	01/31/26	2.625	4,690	5,103	560,179	2026/1/31	
T 2.625%	02/15/29	2.625	9,990	10,928	1,199,470	2029/2/15	
T 2.625%	02/28/23	2.625	1,400	1,461	160,383	2023/2/28	
T 2.625%	03/31/25	2.625	7,250	7,835	860,011	2025/3/31	
T 2.625%	06/30/23	2.625	4,900	5,152	565,555	2023/6/30	
T 2.625%	12/31/23	2.625	3,500	3,716	407,959	2023/12/31	
T 2.625%	12/31/25	2.625	5,820	6,329	694,773	2025/12/31	
T 2.75%	02/15/24	2.75	3,000	3,203	351,660	2024/2/15	
T 2.75%	02/15/28	2.75	6,550	7,218	792,281	2028/2/15	
T 2.75%	04/30/23	2.75	3,600	3,780	414,915	2023/4/30	
T 2.75%	05/31/23	2.75	3,880	4,082	448,052	2023/5/31	
T 2.75%	06/30/25	2.75	5,500	5,987	657,209	2025/6/30	
T 2.75%	07/31/23	2.75	1,000	1,056	115,912	2023/7/31	
T 2.75%	08/15/42	2.75	1,300	1,425	156,432	2042/8/15	
T 2.75%	08/15/47	2.75	4,950	5,436	596,666	2047/8/15	
T 2.75%	08/31/23	2.75	7,500	7,934	870,855	2023/8/31	
T 2.75%	08/31/25	2.75	6,900	7,521	825,504	2025/8/31	
T 2.75%	11/15/23	2.75	6,120	6,502	713,766	2023/11/15	
T 2.75%	11/15/42	2.75	2,820	3,088	338,976	2042/11/15	
T 2.75%	11/15/47	2.75	3,050	3,349	367,617	2047/11/15	
T 2.875%	04/30/25	2.875	4,000	4,366	479,308	2025/4/30	
T 2.875%	05/15/28	2.875	7,260	8,060	884,698	2028/5/15	
T 2.875%	05/15/43	2.875	4,150	4,637	509,061	2043/5/15	
T 2.875%	05/15/49	2.875	5,570	6,287	690,076	2049/5/15	
T 2.875%	05/31/25	2.875	3,820	4,173	458,116	2025/5/31	
T 2.875%	07/31/25	2.875	5,460	5,975	655,894	2025/7/31	
T 2.875%	08/15/28	2.875	8,920	9,910	1,087,826	2028/8/15	
T 2.875%	08/15/45	2.875	4,300	4,814	528,419	2045/8/15	
T 2.875%	09/30/23	2.875	4,750	5,047	554,067	2023/9/30	
T 2.875%	10/31/23	2.875	2,500	2,661	292,171	2023/10/31	
T 2.875%	11/30/23	2.875	4,020	4,288	470,656	2023/11/30	
T 2.875%	11/30/25	2.875	7,500	8,234	903,783	2025/11/30	
T 3%	02/15/47	3.0	2,800	3,216	352,995	2047/2/15	
T 3%	02/15/48	3.0	4,450	5,119	561,925	2048/2/15	
T 3%	02/15/49	3.0	7,000	8,080	886,929	2049/2/15	
T 3%	05/15/42	3.0	1,620	1,846	202,621	2042/5/15	
T 3%	05/15/45	3.0	3,500	3,999	438,962	2045/5/15	
T 3%	05/15/47	3.0	5,710	6,561	720,200	2047/5/15	
T 3%	08/15/48	3.0	5,450	6,278	689,135	2048/8/15	
T 3%	09/30/25	3.0	4,200	4,626	507,847	2025/9/30	
T 3%	10/31/25	3.0	5,000	5,512	605,052	2025/10/31	
T 3%	11/15/44	3.0	4,050	4,624	507,595	2044/11/15	
T 3.125%	02/15/42	3.125	1,050	1,220	133,957	2042/2/15	
T 3.125%	02/15/43	3.125	3,500	4,067	446,465	2043/2/15	
T 3.125%	05/15/48	3.125	5,930	6,981	766,305	2048/5/15	
T 3.125%	08/15/44	3.125	4,140	4,825	529,631	2044/8/15	
T 3.125%	11/15/28	3.125	8,400	9,486	1,041,265	2028/11/15	

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 3.125%	11/15/41	3.125	1,750	2,031	222,947	2041/11/15
T 3.375%	05/15/44	3.375	3,010	3,645	400,169	2044/5/15
T 3.375%	11/15/48	3.375	5,300	6,534	717,252	2048/11/15
T 3.5%	02/15/39	3.5	770	940	103,187	2039/2/15
T 3.625%	02/15/44	3.625	2,400	3,015	331,008	2044/2/15
T 3.625%	08/15/43	3.625	2,000	2,506	275,154	2043/8/15
T 3.75%	08/15/41	3.75	2,000	2,532	277,950	2041/8/15
T 3.75%	11/15/43	3.75	4,500	5,749	631,059	2043/11/15
T 3.875%	08/15/40	3.875	1,450	1,859	204,075	2040/8/15
T 4.25%	05/15/39	4.25	900	1,202	132,023	2039/5/15
T 4.25%	11/15/40	4.25	2,350	3,162	347,085	2040/11/15
T 4.375%	02/15/38	4.375	1,000	1,346	147,781	2038/2/15
T 4.375%	05/15/40	4.375	1,900	2,591	284,483	2040/5/15
T 4.375%	05/15/41	4.375	1,950	2,671	293,257	2041/5/15
T 4.375%	11/15/39	4.375	1,260	1,712	187,922	2039/11/15
T 4.5%	02/15/36	4.5	1,590	2,138	234,713	2036/2/15
T 4.5%	05/15/38	4.5	550	751	82,468	2038/5/15
T 4.5%	08/15/39	4.5	1,700	2,341	257,015	2039/8/15
T 4.625%	02/15/40	4.625	2,380	3,336	366,230	2040/2/15
T 4.75%	02/15/41	4.75	750	1,073	117,807	2041/2/15
T 5.0%	05/15/37	5.0	1,100	1,570	172,416	2037/5/15
T 5.25%	11/15/28	5.25	1,300	1,668	183,142	2028/11/15
T 5.375%	02/15/31	5.375	1,950	2,632	288,909	2031/2/15
T 5.5%	08/15/28	5.5	1,200	1,553	170,556	2028/8/15
T 6.0%	02/15/26	6.0	1,700	2,116	232,307	2026/2/15
T 6.125%	11/15/27	6.125	1,450	1,905	209,172	2027/11/15
T 6.25%	05/15/30	6.25	1,050	1,476	162,058	2030/5/15
T 6.25%	08/15/23	6.25	1,650	1,871	205,432	2023/8/15
小 計					132,115,094	
(カナダ) 国債証券			千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25%	02/01/23	0.25	3,060	3,059	277,806	2023/2/1
CAN 0.25%	03/01/26	0.25	2,280	2,211	200,789	2026/3/1
CAN 0.25%	04/01/24	0.25	700	694	63,111	2024/4/1
CAN 0.25%	05/01/23	0.25	2,600	2,596	235,803	2023/5/1
CAN 0.25%	08/01/22	0.25	910	910	82,680	2022/8/1
CAN 0.25%	11/01/22	0.25	1,770	1,770	160,744	2022/11/1
CAN 0.5%	09/01/25	0.5	3,990	3,941	357,929	2025/9/1
CAN 0.5%	12/01/30	0.5	2,420	2,212	200,893	2030/12/1
CAN 1%	06/01/27	1.0	1,730	1,724	156,640	2027/6/1
CAN 1%	09/01/22	1.0	2,500	2,524	229,236	2022/9/1
CAN 1.25%	03/01/25	1.25	2,400	2,451	222,651	2025/3/1
CAN 1.25%	06/01/30	1.25	5,620	5,543	503,380	2030/6/1
CAN 1.5%	06/01/23	1.5	1,070	1,095	99,462	2023/6/1
CAN 1.5%	06/01/26	1.5	1,360	1,398	127,036	2026/6/1
CAN 1.5%	09/01/24	1.5	600	618	56,137	2024/9/1
CAN 1.75%	03/01/23	1.75	3,620	3,712	337,128	2023/3/1
CAN 2%	06/01/28	2.0	1,310	1,383	125,594	2028/6/1
CAN 2%	09/01/23	2.0	4,310	4,467	405,692	2023/9/1
CAN 2%	12/01/51	2.0	4,080	4,060	368,711	2051/12/1
CAN 2.25%	03/01/24	2.25	2,300	2,413	219,145	2024/3/1
CAN 2.25%	06/01/25	2.25	1,800	1,910	173,468	2025/6/1
CAN 2.25%	06/01/29	2.25	1,260	1,352	122,857	2029/6/1
CAN 2.5%	06/01/24	2.5	1,300	1,377	125,098	2024/6/1
CAN 2.75%	06/01/22	2.75	3,670	3,764	341,871	2022/6/1
CAN 2.75%	12/01/48	2.75	1,880	2,174	197,487	2048/12/1
CAN 2.75%	12/01/64	2.75	560	667	60,581	2046/12/1
CAN 3.5%	12/01/45	3.5	1,480	1,916	174,042	2045/12/1
CAN 4.0%	06/01/41	4.0	1,050	1,417	128,731	2041/6/1
CAN 5.0%	06/01/37	5.0	820	1,189	108,057	2037/6/1
CAN 5.75%	06/01/29	5.75	1,170	1,565	142,145	2029/6/1
CAN 5.75%	06/01/33	5.75	1,410	2,039	185,162	2033/6/1
小 計					6,190,083	

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)	
(メキシコ)						
国債証券			千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	10,842	59,728	2036/11/20
	MBONO 10% 12/05/24	10.0	29,660	33,631	185,265	2024/12/5
	MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	45,980	45,304	249,566	2026/3/5
	MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	33,080	33,671	185,486	2022/6/9
	MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	33,850	34,890	192,201	2023/3/9
	MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	41,258	227,281	2027/6/3
	MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	24,180	26,059	143,554	2031/5/29
	MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,190	24,838	136,828	2042/11/13
	MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	14,100	15,123	83,309	2034/11/23
	MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	36,777	202,593	2024/9/5
	MBONO 8% 11/07/47	8.0	23,430	24,542	135,199	2047/11/7
	MBONO 8% 12/07/23	8.0	34,870	37,086	204,299	2023/12/7
	MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	37,670	42,350	233,296	2029/5/31
	MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	26,220	29,125	160,441	2038/11/18
小 計					2,399,051	
(ドイツ)						
国債証券			千ユーロ	千ユーロ		
	BKO 0% 06/10/22	—	900	906	121,182	2022/6/10
	BKO 0% 12/15/22	—	4,950	5,001	668,931	2022/12/15
	DBR 0% 02/15/30	—	3,570	3,657	489,178	2030/2/15
	DBR 0% 02/15/31	—	800	814	108,919	2031/2/15
	DBR 0% 05/15/35	—	2,820	2,796	373,941	2035/5/15
	DBR 0% 05/15/36	—	620	608	81,405	2036/5/15
	DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,478	598,971	2026/8/15
	DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,592	480,503	2029/8/15
	DBR 0% 08/15/30	—	5,380	5,496	735,084	2030/8/15
	DBR 0% 08/15/30	—	670	687	92,006	2030/8/15
	DBR 0% 08/15/50	—	2,720	2,432	325,300	2050/8/15
	DBR 0% 11/15/27	—	2,160	2,223	297,411	2027/11/15
	DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	4,064	543,628	2027/2/15
	DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,890	4,078	545,407	2029/2/15
	DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,180	2,285	305,626	2028/8/15
	DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,000	3,130	418,737	2025/2/15
	DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,158	422,360	2026/2/15
	DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,390	2,544	340,347	2028/2/15
	DBR 0.5% 08/15/27	0.5	5,690	6,045	808,481	2027/8/15
	DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,109	282,073	2024/8/15
	DBR 1% 08/15/25	1.0	2,720	2,909	389,138	2025/8/15
	DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	4,419	591,122	2048/8/15
	DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,960	3,071	410,842	2023/2/15
	DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,150	421,363	2023/5/15
	DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,439	326,306	2024/5/15
	DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,800	2,877	384,878	2022/9/4
	DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,760	235,460	2024/2/15
	DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,090	2,145	286,957	2022/7/4
	DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	3,032	405,564	2023/8/15
	DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,540	5,344	714,780	2044/7/4
	DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,800	5,842	781,375	2046/8/15
	DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,580	4,217	564,086	2042/7/4
	DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,731	632,815	2037/1/4
	DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,720	4,742	634,325	2039/7/4
	DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	5,510	469,512	2028/7/4
	DBR 4.75% 07/04/34	4.75	3,390	5,548	742,081	2034/7/4
	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,830	5,301	709,040	2040/7/4
	DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	4,441	594,059	2031/1/4
	DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,332	445,664	2028/1/4
	DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,819	510,881	2024/1/4
	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,972	263,785	2030/1/4
	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,407	188,286	2027/7/4
	OBL 0% 04/05/24	—	4,250	4,333	579,518	2024/4/5
	OBL 0% 04/10/26	—	4,070	4,184	559,666	2026/4/10

銘柄	利 率 (%)	期 末		償還年月日	
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額 (千円)		
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,843	514,083	2025/4/11
OBL 0% 04/14/23	—	2,220	2,249	300,789	2023/4/14
OBL 0% 10/07/22	—	4,160	4,198	561,493	2022/10/7
OBL 0% 10/10/25	—	4,340	4,458	596,271	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,535	205,358	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	3,490	3,569	477,361	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	1,005	134,480	2024/1/15
BTPS 0% 04/15/24	—	500	502	67,184	2024/4/15
BTPS 0.05% 01/15/23	0.05	2,030	2,043	273,322	2023/1/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,654	221,220	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	1,850	1,873	250,576	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	588	78,734	2025/2/1
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	3,710	3,776	505,032	2026/2/1
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,131	151,260	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	1,850	1,794	239,984	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	2,170	2,217	296,626	2023/10/15
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,320	310,357	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,500	2,508	335,530	2031/4/1
BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	3,180	3,228	431,825	2022/8/1
BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	2,000	2,045	273,498	2023/3/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	961	128,539	2037/3/1
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	2,580	2,638	352,926	2023/3/15
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	2,261	302,445	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,462	329,311	2027/9/15
BTPS 1% 07/15/22	1.0	2,160	2,194	293,538	2022/7/15
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	2,056	275,053	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	2,040	272,864	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,450	1,481	198,086	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,432	325,366	2025/5/15
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,990	2,037	272,463	2022/9/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,528	338,125	2024/11/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,555	341,748	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	3,030	405,352	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	3,220	430,712	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,729	364,997	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,120	1,076	143,914	2051/9/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	3,200	3,387	453,072	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	1,810	1,871	250,282	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,000	2,120	283,531	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,901	387,988	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,690	2,963	396,344	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,271	303,725	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	3,020	403,920	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,511	469,579	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	710	95,082	2072/3/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,532	338,639	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	2,077	277,904	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	3,045	407,341	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,470	1,665	222,804	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	910	968	129,460	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,268	437,146	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,216	430,210	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,510	2,979	398,424	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,320	1,558	208,467	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,890	2,200	294,255	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,519	336,981	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,987	533,290	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,780	238,169	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	2,536	339,270	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	2,220	2,814	376,362	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,856	381,975	2048/3/1

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 3.5%	03/01/30	3.5	3,960	4,890	654,010	2030/3/1
BTPS 3.75%	09/01/24	3.75	2,150	2,421	323,900	2024/9/1
BTPS 3.85%	09/01/49	3.85	2,160	3,119	417,154	2049/9/1
BTPS 4%	02/01/37	4.0	3,550	4,861	650,188	2037/2/1
BTPS 4.5%	03/01/24	4.5	2,750	3,105	415,317	2024/3/1
BTPS 4.5%	03/01/26	4.5	2,080	2,511	335,920	2026/3/1
BTPS 4.5%	05/01/23	4.5	3,580	3,912	523,254	2023/5/1
BTPS 4.75%	08/01/23	4.75	4,950	5,495	734,973	2023/8/1
BTPS 4.75%	09/01/28	4.75	3,630	4,714	630,536	2028/9/1
BTPS 4.75%	09/01/44	4.75	3,050	4,836	646,899	2044/9/1
BTPS 5%	03/01/25	5.0	3,660	4,354	582,314	2025/3/1
BTPS 5%	08/01/34	5.0	2,970	4,354	582,306	2034/8/1
BTPS 5%	09/01/40	5.0	3,190	5,021	671,597	2040/9/1
BTPS 5.0%	08/01/39	5.0	3,300	5,151	688,956	2039/8/1
BTPS 5.25%	11/01/29	5.25	3,560	4,895	654,738	2029/11/1
BTPS 5.5%	09/01/22	5.5	1,400	1,503	201,052	2022/9/1
BTPS 5.5%	11/01/22	5.5	3,450	3,736	499,782	2022/11/1
BTPS 5.75%	02/01/33	5.75	3,080	4,671	624,803	2033/2/1
BTPS 6%	05/01/31	6.0	3,940	5,868	784,833	2031/5/1
BTPS 6.5%	11/01/27	6.5	3,600	4,987	666,991	2027/11/1
BTPS 7.25%	11/01/26	7.25	1,400	1,929	258,033	2026/11/1
BTPS 9%	11/01/23	9.0	800	979	130,977	2023/11/1
(フランス)						
国債証券						
FRTR 0%	02/25/23	—	2,050	2,073	277,303	2023/2/25
FRTR 0%	02/25/24	—	3,500	3,556	475,673	2024/2/25
FRTR 0%	02/25/26	—	5,210	5,314	710,721	2026/2/25
FRTR 0%	02/25/27	—	950	966	129,201	2027/2/25
FRTR 0%	03/25/23	—	5,290	5,353	716,009	2023/3/25
FRTR 0%	03/25/24	—	5,950	6,051	809,280	2024/3/25
FRTR 0%	03/25/25	—	8,090	8,250	1,103,368	2025/3/25
FRTR 0%	05/25/22	—	2,800	2,817	376,868	2022/5/25
FRTR 0%	11/25/29	—	5,260	5,270	704,837	2029/11/25
FRTR 0%	11/25/30	—	6,040	5,995	801,884	2030/11/25
FRTR 0%	11/25/31	—	670	658	88,009	2031/11/25
FRTR 0.25%	11/25/26	0.25	4,680	4,836	646,895	2026/11/25
FRTR 0.5%	05/25/25	0.5	5,590	5,816	777,959	2025/5/25
FRTR 0.5%	05/25/26	0.5	5,090	5,324	712,077	2026/5/25
FRTR 0.5%	05/25/29	0.5	5,350	5,598	748,751	2029/5/25
FRTR 0.5%	05/25/40	0.5	2,150	2,089	279,501	2040/5/25
FRTR 0.5%	05/25/72	0.5	990	751	100,467	2072/5/25
FRTR 0.5%	06/25/44	0.5	910	861	115,232	2044/6/25
FRTR 0.75%	05/25/28	0.75	6,870	7,327	979,930	2028/5/25
FRTR 0.75%	05/25/52	0.75	3,580	3,370	450,799	2052/5/25
FRTR 0.75%	11/25/28	0.75	4,500	4,801	642,176	2028/11/25
FRTR 1%	05/25/27	1.0	4,650	5,015	670,746	2027/5/25
FRTR 1%	11/25/25	1.0	5,280	5,630	753,077	2025/11/25
FRTR 1.25%	05/25/34	1.25	5,110	5,698	762,133	2034/5/25
FRTR 1.25%	05/25/36	1.25	4,830	5,380	719,623	2036/5/25
FRTR 1.5%	05/25/31	1.5	5,890	6,707	897,033	2031/5/25
FRTR 1.5%	05/25/50	1.5	4,090	4,694	627,870	2050/5/25
FRTR 1.75%	05/25/23	1.75	5,380	5,638	754,036	2023/5/25
FRTR 1.75%	05/25/66	1.75	1,630	2,022	270,533	2066/5/25
FRTR 1.75%	06/25/39	1.75	3,820	4,604	615,863	2039/6/25
FRTR 1.75%	11/25/24	1.75	4,160	4,497	601,540	2024/11/25
FRTR 2%	05/25/48	2.0	3,560	4,535	606,541	2048/5/25
FRTR 2.25%	05/25/24	2.25	4,100	4,452	595,430	2024/5/25
FRTR 2.25%	10/25/22	2.25	5,740	5,976	799,264	2022/10/25
FRTR 2.5%	05/25/30	2.5	6,380	7,813	1,045,006	2030/5/25
FRTR 2.75%	10/25/27	2.75	5,970	7,139	954,847	2027/10/25
FRTR 3.25%	05/25/45	3.25	3,350	5,178	692,572	2045/5/25
FRTR 3.5%	04/25/26	3.5	6,350	7,588	1,014,886	2026/4/25
FRTR 4%	04/25/55	4.0	2,400	4,495	601,165	2055/4/25

当		期		末	
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
FRTR 4%	04/25/60	4.0	2,180	4,263	570,141
FRTR 4%	10/25/38	4.0	3,370	5,322	711,850
FRTR 4.25%	10/25/23	4.25	5,020	5,615	751,066
FRTR 4.5%	04/25/41	4.5	4,720	8,145	1,089,409
FRTR 4.75%	04/25/35	4.75	3,680	5,885	787,151
FRTR 5.5%	04/25/29	5.5	5,170	7,481	1,000,638
FRTR 5.75%	10/25/32	5.75	4,340	7,076	946,434
FRTR 6.0%	10/25/25	6.0	1,900	2,449	327,659
FRTR 8.5%	04/25/23	8.5	1,000	1,175	157,220
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0%	01/15/24	—	1,850	1,883	251,961
NETHER 0%	01/15/27	—	1,840	1,885	252,181
NETHER 0%	01/15/38	—	700	669	89,485
NETHER 0%	01/15/52	—	980	850	113,743
NETHER 0%	07/15/30	—	1,920	1,942	259,808
NETHER 0%	07/15/31	—	830	833	111,438
NETHER 0.25%	07/15/25	0.25	2,310	2,390	319,653
NETHER 0.25%	07/15/29	0.25	1,710	1,775	237,470
NETHER 0.5%	01/15/40	0.5	1,290	1,341	179,347
NETHER 0.5%	07/15/26	0.5	2,320	2,441	326,463
NETHER 0.75%	07/15/27	0.75	2,110	2,263	302,686
NETHER 0.75%	07/15/28	0.75	1,620	1,745	233,406
NETHER 1.75%	07/15/23	1.75	1,940	2,042	273,118
NETHER 2%	07/15/24	2.0	1,990	2,157	288,559
NETHER 2.25%	07/15/22	2.25	1,220	1,260	168,552
NETHER 2.5%	01/15/33	2.5	2,020	2,605	348,507
NETHER 2.75%	01/15/47	2.75	2,100	3,321	444,184
NETHER 3.75%	01/15/23	3.75	2,330	2,500	334,427
NETHER 3.75%	01/15/42	3.75	2,060	3,492	467,026
NETHER 4%	01/15/37	4.0	2,180	3,474	464,622
NETHER 5.5%	01/15/28	5.5	1,730	2,413	322,805
NETHER 7.5%	01/15/23	7.5	200	226	30,357
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0%	01/31/25	—	2,350	2,380	318,311
SPGB 0%	01/31/26	—	1,410	1,424	190,559
SPGB 0%	01/31/28	—	780	777	103,929
SPGB 0%	04/30/23	—	2,380	2,403	321,417
SPGB 0%	05/31/24	—	1,260	1,275	170,563
SPGB 0.1%	04/30/31	0.1	1,850	1,783	238,551
SPGB 0.25%	07/30/24	0.25	2,290	2,338	312,739
SPGB 0.35%	07/30/23	0.35	3,590	3,656	489,032
SPGB 0.4%	04/30/22	0.4	2,390	2,411	322,483
SPGB 0.45%	10/31/22	0.45	3,060	3,104	415,190
SPGB 0.5%	04/30/30	0.5	2,900	2,942	393,558
SPGB 0.6%	10/31/29	0.6	3,400	3,493	467,266
SPGB 0.8%	07/30/27	0.8	2,000	2,102	281,142
SPGB 0.85%	07/30/37	0.85	960	937	125,391
SPGB 1%	10/31/50	1.0	2,160	1,929	258,003
SPGB 1.2%	10/31/40	1.2	1,810	1,819	243,391
SPGB 1.25%	10/31/30	1.25	3,050	3,289	439,997
SPGB 1.3%	10/31/26	1.3	3,450	3,723	497,973
SPGB 1.4%	04/30/28	1.4	2,120	2,314	309,500
SPGB 1.4%	07/30/28	1.4	3,300	3,607	482,417
SPGB 1.45%	04/30/29	1.45	2,690	2,952	394,894
SPGB 1.45%	10/31/27	1.45	3,040	3,322	444,409
SPGB 1.45%	10/31/71	1.45	560	488	65,282
SPGB 1.5%	04/30/27	1.5	2,650	2,899	387,814
SPGB 1.6%	04/30/25	1.6	3,050	3,284	439,226
SPGB 1.85%	07/30/35	1.85	2,750	3,123	417,689
SPGB 1.95%	04/30/26	1.95	2,810	3,110	416,062
SPGB 1.95%	07/30/30	1.95	2,940	3,363	449,811

銘柄	当 期	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 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	3,115	416,629	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,920	390,536	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	2,404	321,572	2048/10/31	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,600	3,991	533,808	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,250	3,011	402,753	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,940	2,963	396,375	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,832	378,879	2024/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,751	501,696	2037/1/31	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	3,010	402,611	2023/10/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,433	459,139	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,640	4,332	579,460	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,739	366,326	2024/1/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,550	4,242	567,427	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,290	5,882	786,707	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	2,100	3,766	503,784	2044/10/31	
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,100	2,309	308,888	2023/1/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	3,220	5,038	673,809	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,581	612,723	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,518	203,058	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0% 10/22/27	—	430	438	58,583	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	630	620	83,024	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,383	185,032	2030/6/22	
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	980	1,000	133,779	2023/10/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	710	676	90,534	2040/6/22	
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,680	224,805	2024/10/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	521	69,736	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,420	2,553	341,506	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,807	241,679	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	2,090	2,242	299,890	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	2,360	2,552	341,381	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,447	327,360	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,980	2,162	289,212	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,683	225,086	2033/4/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	720	823	110,187	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,380	1,612	215,648	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,000	1,195	159,914	2050/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,280	171,217	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	870	1,199	160,416	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,850	1,962	262,420	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	1,059	141,763	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,353	314,755	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,384	185,217	2034/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,975	264,163	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/42	4.0	1,080	1,530	204,705	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,400	4,003	535,381	2041/3/28	
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,100	2,238	299,359	2022/9/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,417	189,617	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,690	4,384	586,442	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,890	520,382	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,130	1,135	151,850	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	590	587	78,591	2031/2/20	
RAGB 0% 04/20/25	—	930	949	126,981	2025/4/20	
RAGB 0% 07/15/23	—	1,500	1,520	203,376	2023/7/15	
RAGB 0% 07/15/24	—	1,350	1,374	183,883	2024/7/15	
RAGB 0% 09/20/22	—	320	322	43,159	2022/9/20	
RAGB 0% 10/20/40	—	420	380	50,942	2040/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,860	248,816	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	890	936	125,203	2027/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,620	1,731	231,575	2028/2/20	

銘柄	利 率 (%)	期		末	
		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 0.75% 03/20/51	0.75	790	803	107,460	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,212	295,846	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	350	310	41,561	2120/6/30
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,430	1,538	205,777	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	930	1,126	150,635	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	330	422	56,445	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,066	142,633	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,406	188,100	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	780	1,253	167,653	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,260	1,614	215,887	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,306	174,685	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	2,360	2,502	334,636	2022/11/22
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	470	964	129,007	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,898	387,603	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,310	1,649	220,619	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,663	222,462	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/23	—	540	548	73,322	2023/9/15
RFGB 0% 09/15/24	—	420	428	57,312	2024/9/15
RFGB 0% 09/15/30	—	630	631	84,467	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	540	523	70,066	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	490	419	56,139	2052/4/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	400	383	51,342	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	650	86,966	2026/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	916	122,595	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	1,030	1,085	145,143	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	799	106,942	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	500	536	71,744	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	732	97,957	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	710	792	105,932	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	588	78,678	2047/4/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	676	90,496	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	930	957	128,061	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	786	105,156	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	590	848	113,431	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	420	511	68,367	2028/7/4
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	987	132,066	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/22	—	530	534	71,481	2022/10/18
IRISH 0% 10/18/31	—	580	567	75,959	2031/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	956	127,916	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,030	1,039	138,982	2030/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	760	757	101,322	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	490	476	63,770	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	1,070	1,149	153,682	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,420	1,518	203,075	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,309	175,074	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	749	100,226	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	860	964	128,933	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	730	839	112,310	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	970	129,751	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,090	1,386	185,484	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,466	196,145	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,077	144,160	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	1,010	1,092	146,111	2023/3/20
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,510	1,849	247,322	2025/3/13
ユ ー ロ 計				122,014,046	
(イギリス)					
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	3,000	2,970	462,220	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/23	0.125	4,510	4,515	702,577	2023/1/31

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	2,970	2,967	461,817	2024/1/31	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,195	341,549	2028/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	2,110	1,974	307,241	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,321	361,162	2030/10/22	
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	3,150	3,166	492,781	2022/7/22	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	1,038	161,561	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,727	268,773	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,950	2,748	427,705	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	2,550	2,130	331,434	2050/10/22	
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,910	2,953	459,524	2023/7/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,260	1,142	177,697	2046/1/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,720	267,720	2029/10/22	
UKT 1% 04/22/24	1.0	1,600	1,640	255,191	2024/4/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	2,990	3,130	487,068	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	180	177	27,587	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,785	433,366	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,000	2,115	329,106	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,550	2,661	414,202	2047/7/22	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	2,200	2,364	367,874	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	2,031	316,134	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	900	1,074	167,157	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,436	223,559	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,530	2,897	450,844	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	3,120	3,187	495,992	2022/9/7	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,930	3,172	493,679	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,912	297,635	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,623	408,228	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,920	2,776	432,007	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,620	1,756	273,304	2024/9/7	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,810	3,894	606,057	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,550	3,700	575,807	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	3,552	552,815	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,613	406,688	2052/7/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,858	444,727	2060/1/22	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,390	3,415	531,381	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,831	440,554	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,820	2,729	424,711	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,699	264,371	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,070	3,153	490,755	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,180	3,576	556,579	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,577	400,982	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,210	4,062	632,092	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,770	2,528	393,434	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,340	3,767	586,171	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,780	2,424	377,316	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,586	402,491	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,800	2,124	330,581	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,742	271,140	2028/12/7	
小 計				19,785,369		
(スウェーデン)		千スウェーデン クロナ	千スウェーデン クロナ			
国債証券						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	5,270	5,113	67,495	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	8,380	8,718	115,081	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,430	7,709	101,760	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	9,010	9,498	125,378	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	13,050	172,268	2023/11/13	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	3,750	4,455	58,814	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	10,050	11,109	146,645	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,860	8,492	112,094	2039/3/30	
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	14,000	14,540	191,933	2022/6/1	
小 計				1,091,472		
(ノルウェー)		千ノルウェー クロネ	千ノルウェー クロネ			
国債証券						
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,000	2,928	38,419	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	4,340	4,313	56,591	2030/8/19	

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	5,740	5,853	76,799	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	5,360	5,526	72,506	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	4,770	4,915	64,488	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	7,640	7,853	103,041	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	6,100	6,386	83,788	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,587	152,031	2023/5/24	
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,360	7,818	102,583	2024/3/14	
小 計				750,250		
(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% 11/15/31	—	3,110	3,069	55,191	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/22	0.25	8,020	8,114	145,898	2022/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	3,340	3,022	54,337	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	10,420	10,917	196,295	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	14,260	14,915	268,176	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,420	7,796	140,174	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	8,330	9,145	164,437	2025/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,260	28,345	509,656	2039/11/15	
小 計				1,534,167		
(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 0% 04/25/23	—	1,230	1,223	36,522	2023/4/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	1,500	1,415	42,245	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,541	105,666	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	2,160	2,045	61,042	2030/10/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	4,137	123,465	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,860	6,068	181,074	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	6,050	6,387	190,609	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,060	6,430	191,881	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	4,015	119,812	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	6,030	6,520	194,566	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,520	7,034	209,099	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	6,260	6,828	203,773	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	4,330	3,724	111,148	2023/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	783	23,376	2029/4/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	3,410	3,660	109,221	2022/9/23	
小 計				1,904,317		
(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	2,930	2,926	247,556	2024/11/21	
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,303	194,871	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	3,640	3,580	302,855	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,750	3,508	296,739	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	4,320	4,101	346,937	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,613	221,016	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	3,155	266,917	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	2,090	1,722	145,654	2051/6/21	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	1,610	1,607	135,992	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,560	2,751	232,753	2028/5/21	
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	3,160	3,263	275,993	2022/11/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,790	4,120	348,504	2030/5/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,486	125,746	2024/4/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,728	146,175	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,230	1,346	113,917	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	3,330	3,688	311,931	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,842	155,821	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	3,150	3,493	295,451	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,830	154,836	2047/3/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	3,480	3,857	326,259	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	4,100	4,704	397,906	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	980	1,123	95,022	2039/6/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,979	167,398	2037/4/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	2,820	3,303	279,416	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,910	2,474	209,322	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,831	239,495	2027/4/21	

当		期		末		
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
					償還年月日	
ACGB 5.5%	04/21/23	5.5	2,500	2,756	233,170	2023/4/21
ACGB 5.75%	07/15/22	5.75	3,350	3,565	301,584	2022/7/15
小 計					6,569,251	
(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 0.5%	11/01/25	0.5	390	386	32,043	2025/11/1
SIGB 1.75%	02/01/23	1.75	800	818	67,881	2023/2/1
SIGB 1.875%	03/01/50	1.875	420	422	35,041	2050/3/1
SIGB 2%	02/01/24	2.0	410	426	35,394	2024/2/1
SIGB 2.125%	06/01/26	2.125	740	785	65,140	2026/6/1
SIGB 2.25%	08/01/36	2.25	730	773	64,117	2036/8/1
SIGB 2.375%	06/01/25	2.375	490	524	43,446	2025/6/1
SIGB 2.375%	07/01/39	2.375	430	466	38,649	2039/7/1
SIGB 2.625%	05/01/28	2.625	1,050	1,145	94,954	2028/5/1
SIGB 2.75%	03/01/46	2.75	1,240	1,460	121,102	2046/3/1
SIGB 2.75%	04/01/42	2.75	900	1,040	86,240	2042/4/1
SIGB 2.75%	07/01/23	2.75	1,070	1,122	93,074	2023/7/1
SIGB 2.875%	07/01/29	2.875	590	657	54,517	2029/7/1
SIGB 2.875%	09/01/30	2.875	760	850	70,552	2030/9/1
SIGB 3%	09/01/24	3.0	1,220	1,317	109,240	2024/9/1
SIGB 3.125%	09/01/22	3.125	1,350	1,397	115,882	2022/9/1
SIGB 3.375%	09/01/33	3.375	830	981	81,388	2033/9/1
SIGB 3.5%	03/01/27	3.5	880	998	82,790	2027/3/1
小 計					1,291,459	
(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	1,528	40,469	2022/8/15
MGS 3.478%	06/14/24	3.478	700	724	19,177	2024/6/14
MGS 3.48%	03/15/23	3.48	2,330	2,392	63,353	2023/3/15
MGS 3.502%	05/31/27	3.502	1,510	1,563	41,399	2027/5/31
MGS 3.733%	06/15/28	3.733	3,430	3,594	95,198	2028/6/15
MGS 3.757%	04/20/23	3.757	1,090	1,125	29,820	2023/4/20
MGS 3.757%	05/22/40	3.757	550	524	13,882	2040/5/22
MGS 3.795%	09/30/22	3.795	1,500	1,537	40,726	2022/9/30
MGS 3.8%	08/17/23	3.8	930	964	25,551	2023/8/17
MGS 3.844%	04/15/33	3.844	2,350	2,364	62,624	2033/4/15
MGS 3.882%	03/14/25	3.882	1,030	1,082	28,658	2025/3/14
MGS 3.885%	08/15/29	3.885	1,500	1,580	41,866	2029/8/15
MGS 3.892%	03/15/27	3.892	1,130	1,193	31,619	2027/3/15
MGS 3.899%	11/16/27	3.899	1,970	2,092	55,408	2027/11/16
MGS 3.9%	11/30/26	3.9	1,440	1,533	40,619	2026/11/30
MGS 3.906%	07/15/26	3.906	600	633	16,791	2026/7/15
MGS 3.955%	09/15/25	3.955	2,380	2,513	66,570	2025/9/15
MGS 4.059%	09/30/24	4.059	1,900	2,003	53,054	2024/9/30
MGS 4.065%	06/15/50	4.065	760	721	19,097	2050/6/15
MGS 4.181%	07/15/24	4.181	1,280	1,351	35,781	2024/7/15
MGS 4.232%	06/30/31	4.232	2,000	2,145	56,812	2031/6/30
MGS 4.254%	05/31/35	4.254	2,030	2,105	55,773	2035/5/31
MGS 4.392%	04/15/26	4.392	2,910	3,141	83,211	2026/4/15
MGS 4.498%	04/15/30	4.498	2,380	2,603	68,964	2030/4/15
MGS 4.642%	11/07/33	4.642	2,830	3,065	81,188	2033/11/7
MGS 4.736%	03/15/46	4.736	1,480	1,562	41,388	2046/3/15
MGS 4.762%	04/07/37	4.762	2,280	2,458	65,120	2037/4/7
MGS 4.893%	06/08/38	4.893	2,310	2,508	66,436	2038/6/8
MGS 4.921%	07/06/48	4.921	1,400	1,507	39,919	2048/7/6
MGS 4.935%	09/30/43	4.935	1,560	1,693	44,856	2043/9/30
小 計					1,425,343	
(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 0.15%	07/31/23	0.15	700	699	23,629	2023/7/31
ILGOV 0.5%	04/30/25	0.5	2,420	2,426	81,980	2025/4/30

当		期		末		
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
ILGOV 0.75%	07/31/22	0.75	6,750	6,803	229,891	2022/7/31
ILGOV 1%	03/31/30	1.0	2,220	2,186	73,885	2030/3/31
ILGOV 1.5%	05/31/37	1.5	2,190	2,077	70,202	2037/5/31
ILGOV 1.5%	11/30/23	1.5	1,750	1,807	61,089	2023/11/30
ILGOV 1.75%	08/31/25	1.75	1,080	1,145	38,693	2025/8/31
ILGOV 2.25%	09/28/28	2.25	2,880	3,144	106,243	2028/9/28
ILGOV 3.75%	03/31/24	3.75	4,080	4,480	151,396	2024/3/31
ILGOV 3.75%	03/31/47	3.75	3,130	3,983	134,621	2047/3/31
ILGOV 5.5%	01/31/42	5.5	2,580	4,095	138,374	2042/1/31
ILGOV 6.25%	10/30/26	6.25	5,620	7,292	246,435	2026/10/30
小	計				1,356,443	
合	計				298,426,352	

(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	299	—
	US 5YR NOTE	543	—
	EURO-BOBL FU	468	—
	EURO-BUND	1,181	—
	US 10YR NOTE	405	—
	US LONG BOND	481	—

(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	比 率
公 社 債	千円 298,426,352	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,553,071	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	307,979,423	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(299,804,535千円)の投資信託財産総額(307,979,423千円)に対する比率は97.3%です。

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

1米ドル=109.76円

1ユーロ=133.74円

1ノルウェークローネ=13.12円

1オーストラリアドル=84.58円

1イスラエルシェケル=33.7909円

1カナダドル=90.81円

1イギリスポンド=155.60円

1デンマーククローネ=17.98円

1シンガポールドル=82.91円

1メキシコペソ=5.5087円

1スウェーデンクローナ=13.20円

1ポーランドズロチ=29.8401円

1マレーシアリンギット=26.4846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 2021年5月31日現在
(A) 資 産	312,618,086,199円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,072,407,298
公 社 債(評価額)	298,426,352,392
未 収 入 金	6,999,392,733
未 収 利 息	1,649,307,557
前 払 費 用	43,884,777
差 入 委 託 証 拠 金	426,741,442
(B) 負 債	8,362,493,178
未 払 金	8,334,333,255
未 払 解 約 金	28,151,963
未 払 利 息	7,960
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	304,255,593,021
元 本	99,051,563,319
次 期 繰 越 損 益 金	205,204,029,702
(D) 受 益 権 総 口 数	99,051,563,319口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,717円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A) 配 当 等 収 益	5,713,635,462円
受 取 利 息	5,715,827,826
支 払 利 息	△2,192,364
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	10,891,260,404
売 買 益	24,337,060,926
売 買 損	△13,445,800,522
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△69,652,431
取 引 益	116,270,477
取 引 損	△185,922,908
(D) そ の 他 費 用	△65,457,017
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	16,469,786,418
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	180,994,431,935
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	33,935,793,069
(H) 解 約 差 損 益 金	△26,195,981,720
(I) 計 (E+F+G+H)	205,204,029,702
次 期 繰 越 損 益 金(I)	205,204,029,702

(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95,174,617,742円、期中追加設定元本額は17,074,979,800円、期中一部解約元本額は13,198,034,223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セクション(SMA専用)	20,979,445,503円
DC世界経済インデックスファンド	11,110,673,327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)	10,520,507,421円
世界経済インデックスファンド	9,273,410,629円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,206,279,137円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,609,406,493円
分散投資コア戦略ファンドS	2,414,637,030円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,337,888,027円
DC外国債券インデックス・オープン	2,138,424,220円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,058,100,464円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,926,802,599円
DCマイセクション25	1,894,927,066円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,610,092,405円
DCマイセクション50	1,595,744,544円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,439,704,781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)	1,416,182,704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)	1,204,191,321円
分散投資コア戦略ファンドA	1,164,439,715円
DCマイセクション75	1,080,738,576円
コア投資戦略ファンド(安定型)	879,380,958円
コア投資戦略ファンド(切替型)	865,632,366円
DCマイセクションS25	861,221,177円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	803,666,732円
グローバル経済コア	768,433,368円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	765,529,114円
DCマイセクションS50	683,537,640円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	667,628,956円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,582,390円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	613,865,226円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	504,898,724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)	503,626,441円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	483,597,824円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	443,659,637円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	424,303,980円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	420,469,762円
DCマイセクションS75	358,771,668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)	343,393,793円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	337,359,693円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	293,965,946円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	245,707,323円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	233,178,587円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	224,203,433円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	190,814,607円
SMT インデックスバランス・オープン	189,240,480円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	187,453,352円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	186,896,260円
SMT 世界経済インデックス・オープン	175,139,323円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	106,862,002円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	100,449,368円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	95,223,196円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	89,122,379円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	81,147,485円

バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	71,223,680円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	61,809,375円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	41,051,209円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	38,009,124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)	32,074,390円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	27,480,170円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,843,552円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,391,523円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	4,316,242円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	3,970,959円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	3,363,735円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,260,367円
マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	2,388,520円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,589,596円
マイセクション75VA1 (適格機関投資家専用)	1,529,048円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	1,178,678円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	523,999円

お知らせ

該当事項はありません。