

JP 4 資産バランスファンド 安定コース

＜愛称：ゆうバランス＞

運用報告書（全体版）

第26期（決算日 2020年9月15日）第27期（決算日 2020年11月16日）第28期（決算日 2021年1月15日）

受 益 者 の み な さ ま へ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
「JP 4 資産バランスファンド 安定コース」は、2021年1月15日に第28期の決算を行いましたので、第26期から第28期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合			
信 託 期 間	無期限（2016年2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
	20%	55%	10%	15%
主 な 投 資 対 象	J P 4 資 産 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 安 定 コ ー ス	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）、FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	日本株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	日本債券を主要投資対象とします。		
	野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）	海外株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	海外債券を主要投資対象とします。		
主 な 投 資 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 デリバティブの直接利用は行いません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。			
分 配 方 針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。			

JP投信株式会社

東京都中央区日本橋本町一丁目5番11号

<照会先>

ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp

サポートダイヤル：0120-104-017

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

目 次

J P 4 資産バランスファンド 安定コース	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）	13
-----------------------------------	----

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）	60
-----------------------------------	----

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）	94
--	----

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）	139
-----------------------------------	-----

【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。

○最近15期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			参 考 指 数	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 込 分	み 金	期 騰 落 中 率			
	円	円	円	%	%	%	百万円
14期(2018年9月18日)	10,939	10	△0.6	11,252	△0.4	99.4	65,861
15期(2018年11月15日)	10,779	10	△1.4	11,037	△1.9	98.9	75,530
16期(2019年1月15日)	10,577	10	△1.8	10,790	△2.2	99.7	82,526
17期(2019年3月15日)	10,865	10	2.8	11,138	3.2	99.6	89,514
18期(2019年5月15日)	10,777	10	△0.7	11,033	△0.9	99.4	91,217
19期(2019年7月16日)	10,939	10	1.6	11,234	1.8	99.7	95,537
20期(2019年9月17日)	11,008	10	0.7	11,317	0.7	99.8	96,543
21期(2019年11月15日)	11,115	10	1.1	11,455	1.2	99.8	94,136
22期(2020年1月15日)	11,254	10	1.3	11,665	1.8	99.9	93,863
23期(2020年3月16日)	10,361	10	△7.8	10,546	△9.6	96.4	85,635
24期(2020年5月15日)	10,709	10	3.5	10,908	3.4	99.9	87,238
25期(2020年7月15日)	11,043	10	3.2	11,320	3.8	99.8	89,200
26期(2020年9月15日)	11,213	10	1.6	11,542	2.0	99.8	90,575
27期(2020年11月16日)	11,320	10	1.0	11,681	1.2	99.8	91,306
28期(2021年1月15日)	11,626	10	2.8	12,084	3.4	99.8	93,296

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 参考指数は合成指数です。計算方法は12ページをご参照ください。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

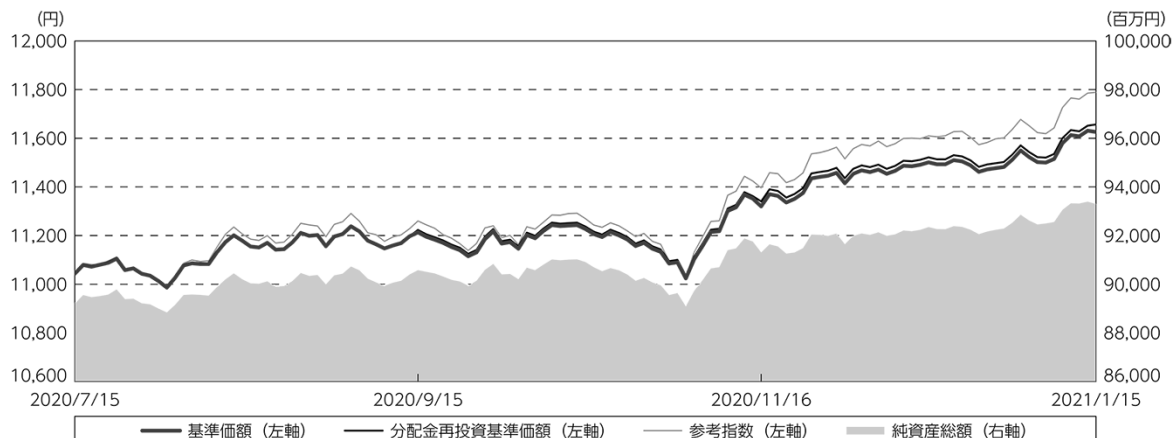
決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	参 考 指 数	騰 落 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
第26期	(期 首) 2020年 7 月15日	円 11,043	% —	11,320	% —	% 99.8
	7 月末	11,013	△0.3	11,286	△0.3	99.7
	8 月末	11,156	1.0	11,476	1.4	99.7
	(期 末) 2020年 9 月15日	11,223	1.6	11,542	2.0	99.8
第27期	(期 首) 2020年 9 月15日	11,213	—	11,542	—	99.8
	9 月末	11,217	0.0	11,522	△0.2	99.6
	10月末	11,090	△1.1	11,380	△1.4	99.7
	(期 末) 2020年11月16日	11,330	1.0	11,681	1.2	99.8
第28期	(期 首) 2020年11月16日	11,320	—	11,681	—	99.8
	11月末	11,458	1.2	11,853	1.5	99.7
	12月末	11,550	2.0	11,970	2.5	99.7
	(期 末) 2021年 1 月15日	11,636	2.8	12,084	3.4	99.8

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

○運用経過

(2020年7月16日～2021年1月15日)

作成期間中の基準価額等の推移



第26期首：11,043円

第28期末：11,626円 (既払分配金(税込み)：30円)

騰落率： 5.6% (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、作成期首(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12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、第26期首11,043円から第28期末11,626円となりました。この間、分配金として1万口当たり合計30円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は613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作成期間の値動きは、日本株式、海外株式、海外債券、日本債券ともに上昇しました。日本株式、海外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	作成期を通じて、日本債券市場は利回りが上昇（価格が下落）しました。2020年7月中旬から8月下旬は、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債券は売られました。9月上旬から12月中旬にかけては、米長期金利の上昇につられて債券が売られる場面もあったものの、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、債券の買いが優勢となりました。その後2021年1月中旬にかけては、米国での大規模な財政出動観測を受けた米長期金利の上昇が波及し、債券は売られました。
日本株式市場	作成期を通じて、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1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、投資家のリスク選好が強まったことで大きく上昇しました。日経平均株価は約30年5ヵ月ぶりの高値となる28,000円台を回復しました。
海外債券市場	作成期を通じて、海外債券市場は利回りが上昇（価格が下落）しました。2020年7月中旬から8月上旬は、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融緩和の長期化観測などから債券が買われ、米国10年国債利回りは一時0.5%台まで低下しました。その後期末にかけては、新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて債券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の進展による経済正常化期待の高まりや、米大統領選挙でバイデン氏が勝利したことによる大規模な財政出動観測を受けて債券の売りが優勢となりました。米国10年国債利回りは一時1.1%台まで上昇しました。
海外株式市場	作成期を通じて、海外株式市場は上昇しました。2020年7月中旬から8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で上昇しました。9月から10月にかけては、欧米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たことなどから下落しました。11月上旬から2021年1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によって将来の経済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。NYダウは過去最高値を更新し、31,000ドル台まで上昇しました。

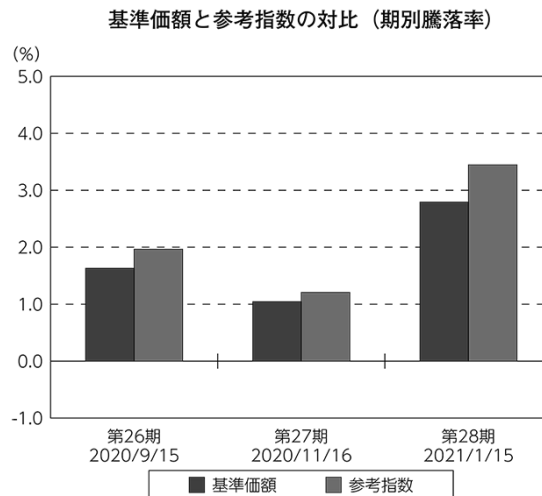
当ファンドのポートフォリオ

組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、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以下のとおりといたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

項 目	第26期	第27期	第28期
	2020年7月16日～ 2020年9月15日	2020年9月16日～ 2020年11月16日	2020年11月17日～ 2021年1月15日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.089%	10 0.088%	10 0.086%
当期の収益	10	10	10
当期の収益以外	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,294	1,346	1,648

（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 1 月15日)

項 目	第26期～第28期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 29	% 0.255	(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)	(11)	(0.100)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(16)	(0.139)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.017)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) 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
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	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	29	0.256	
作成期間の平均基準価額は、11,247円です。			

(注) 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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

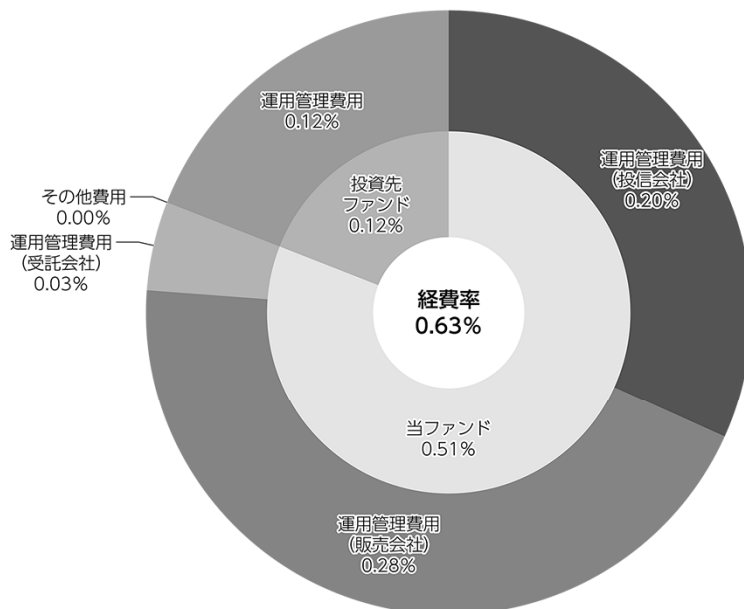
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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。

(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。）

作成期間中の運用・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。）を作成期間中の平均受益権口数に作成期間中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は0.63%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	0.63
①当ファンドの費用の比率	0.51
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.12

(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1月15日)

投資信託証券

銘 柄		第26期～第28期			
		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)	口 —	千円 —	口 670,812,841	千円 1,009,000
	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)	2,026,706,236	2,027,500	—	—
	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)	—	—	1,352,274,536	1,664,000
	合 計	2,026,706,236	2,027,500	2,023,087,377	2,673,000

(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1月15日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年7月16日～2021年1月15日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年7月16日～2021年1月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年1月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘 柄		第25期末	第28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)		6,715,659,882	6,044,847,041	10,064,065	10.8
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)		47,840,409,670	49,867,115,906	49,812,262	53.4
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)		16,086,291,160	14,734,016,624	19,815,778	21.2
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)		13,853,822,861	13,853,822,861	13,407,729	14.4
合 計		84,496,183,573	84,499,802,432	93,099,836	99.8

(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 1 月15日現在)

項 目	第28期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	93,099,836	99.2
コール・ローン等、その他	716,840	0.8
投資信託財産総額	93,816,676	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第26期末	第27期末	第28期末
	2020年 9 月15日現在	2020年11月16日現在	2021年 1 月15日現在
	円	円	円
(A) 資産	90,903,372,046	91,888,974,961	93,816,676,186
コール・ローン等	507,660,097	527,154,019	571,839,549
投資信託受益証券(評価額)	90,395,711,949	91,113,820,942	93,099,836,637
未収入金	—	248,000,000	145,000,000
(B) 負債	327,532,121	582,245,257	520,170,957
未払収益分配金	80,776,667	80,657,704	80,250,890
未払解約金	169,210,426	423,519,088	362,904,662
未払信託報酬	77,244,759	77,768,141	76,724,602
未払利息	1,388	1,443	1,565
その他未払費用	298,881	298,881	289,238
(C) 純資産総額(A－B)	90,575,839,925	91,306,729,704	93,296,505,229
元本	80,776,667,407	80,657,704,082	80,250,890,364
次期繰越損益金	9,799,172,518	10,649,025,622	13,045,614,865
(D) 受益権総口数	80,776,667,407口	80,657,704,082口	80,250,890,364口
1 万口当たり基準価額(C／D)	11,213円	11,320円	11,626円

(注) 当ファンドの第26期首元本額は80,773,594,519円、第26～28期中追加設定元本額は5,023,845,979円、第26～28期中一部解約元本額は5,546,550,134円です。

(注) 1 口当たり純資産額は、第26期1.1213円、第27期1.1320円、第28期1.1626円です。

○損益の状況

項 目	第26期	第27期	第28期
	2020年7月16日～ 2020年9月15日	2020年9月16日～ 2020年11月16日	2020年11月17日～ 2021年1月15日
	円	円	円
(A) 配当等収益	109,088,749	241,593,575	117,241,031
受取配当金	109,163,959	241,665,566	117,324,226
受取利息	—	8	—
支払利息	△ 75,210	△ 71,999	△ 83,195
(B) 有価証券売買損益	1,406,549,520	784,755,609	2,463,591,680
売買益	1,421,311,167	1,028,661,845	2,530,249,583
売買損	△ 14,761,647	△ 243,906,236	△ 66,657,903
(C) 信託報酬等	△ 77,543,640	△ 78,067,022	△ 77,013,840
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	1,438,094,629	948,282,162	2,503,818,871
(E) 前期繰越損益金	1,267,707,349	2,571,073,031	3,343,386,905
(F) 追加信託差損益金	7,174,147,207	7,210,328,133	7,278,659,979
(配当等相当額)	(7,373,959,651)	(7,422,286,583)	(7,462,969,024)
(売買損益相当額)	(△ 199,812,444)	(△ 211,958,450)	(△ 184,309,045)
(G) 計 (D + E + F)	9,879,949,185	10,729,683,326	13,125,865,755
(H) 収益分配金	△ 80,776,667	△ 80,657,704	△ 80,250,890
次期繰越損益金 (G + H)	9,799,172,518	10,649,025,622	13,045,614,865
追加信託差損益金	7,174,147,207	7,210,328,133	7,278,659,979
(配当等相当額)	(7,373,959,651)	(7,422,286,583)	(7,462,969,024)
(売買損益相当額)	(△ 199,812,444)	(△ 211,958,450)	(△ 184,309,045)
分配準備積立金	3,084,452,758	3,438,697,489	5,766,954,886
繰越損益金	△ 459,427,447	—	—

(注) 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。

(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1月15日) は以下の通りです。

項 目	2020年7月16日～ 2020年9月15日	2020年9月16日～ 2020年11月16日	2020年11月17日～ 2021年1月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	103,505,607円	223,216,598円	113,744,603円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円	275,080,752円	2,390,074,268円
c. 信託約款に定める収益調整金	7,373,959,651円	7,422,286,583円	7,462,969,024円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	3,061,723,818円	3,021,057,843円	3,343,386,905円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	10,539,189,076円	10,941,641,776円	13,310,174,800円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,304円	1,356円	1,658円
g. 分配金	80,776,667円	80,657,704円	80,250,890円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第26期	第27期	第28期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円

○お知らせ

2020年7月16日から2021年1月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

合成指数について

合成指数は、下記の指数と基本組入比率をもとにＪＰ投信が計算したものです。

資 産	指 数	基 本 組 入 比 率
日 本 株 式	TOPIX（東証株価指数、配当なし）	20%
日 本 債 券	NOMURA-BPI総合	55%
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）	10%
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）	15%

- * 「TOPIX（東証株価指数、配当なし）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- * 「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われるＪＰ投信株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- * 「MSCI-KOKUSAI指数」とは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- * 「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

FOFs用 国内株式インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第26期 (決算日 2020年 9月7日)
第27期 (決算日 2020年11月9日)
第28期 (決算日 2021年 1月7日)

受益者のみなさまへ

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

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6	第14期(2018年 9月7日)	円 12,075	円 4	% △1.6	11,977	% △1.6	% 99.2	% 0.8	百万円 50,804
	第15期(2018年11月7日)	11,857	86	△1.1	11,750	△1.9	98.9	1.8	60,853
	第16期(2019年 1月7日)	10,856	16	△8.3	10,756	△8.5	98.9	1.2	67,071
第7	第17期(2019年 3月7日)	11,492	5	5.9	11,389	5.9	98.7	1.3	72,972
	第18期(2019年 5月7日)	11,481	124	1.0	11,376	△0.1	98.8	2.1	73,394
	第19期(2019年 7月8日)	11,328	16	△1.2	11,224	△1.3	98.7	1.1	79,617
第8	第20期(2019年 9月9日)	11,132	2	△1.7	11,030	△1.7	98.9	1.0	81,080
	第21期(2019年11月7日)	12,193	111	10.5	12,075	9.5	98.3	2.0	79,038
	第22期(2020年 1月7日)	12,383	18	1.7	12,267	1.6	99.0	1.0	74,910
第9	第23期(2020年 3月9日)	9,973	2	△19.4	9,877	△19.5	98.7	1.3	62,196
	第24期(2020年 5月7日)	10,244	125	4.0	10,145	2.7	98.6	2.2	69,182
	第25期(2020年 7月7日)	11,283	15	10.3	11,176	10.2	98.6	0.9	74,337
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

(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 率	株 式 先 物 率
			騰落率		騰落率		
第26期	(期 首)2020年 7月7日	円 11,283	% —	11,176	% —	% 98.6	% 0.9
	7月末	10,739	△4.8	10,638	△4.8	98.7	1.3
	8月末	11,615	2.9	11,507	3.0	98.9	1.0
	(期 末)2020年 9月7日	11,554	2.4	11,447	2.4	99.1	0.8
第27期	(期 首)2020年 9月7日	11,553	—	11,447	—	99.1	0.8
	9月末	11,763	1.8	11,559	1.0	98.2	1.7
	10月末	11,428	△1.1	11,231	△1.9	98.3	1.6
	(期 末)2020年11月9日	12,173	5.4	11,960	4.5	98.9	1.6
第28期	(期 首)2020年11月9日	12,076	—	11,960	—	98.9	1.6
	11月末	12,601	4.3	12,479	4.3	98.1	1.3
	12月末	12,974	7.4	12,833	7.3	99.1	0.8
	(期 末)2021年 1月7日	13,129	8.7	12,987	8.6	99.3	0.7

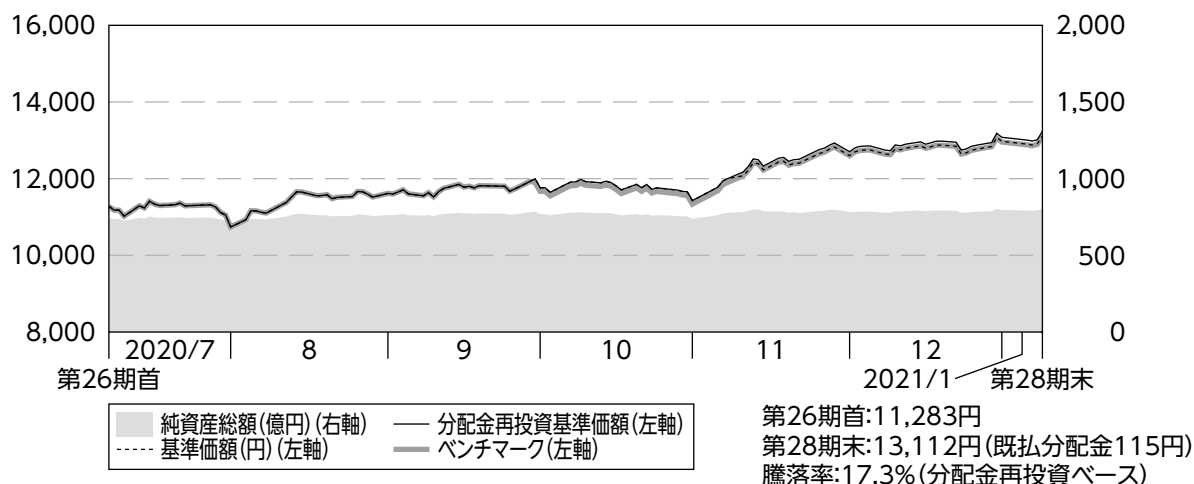
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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、2020年7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



当作成期初の国内株式市場は、各国の経済活動の再開や新型コロナウイルスワクチン開発の進展報道などが好感され上昇したものの、欧米の新型コロナウイルス新規感染者数の増加や欧州での外出制限の動きなどが重石となりました。2020年11月には、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や、新型コロナウイルスワクチンの早期の実用化期待などから上昇しました。当作成期末にかけては、追加の経済対策の成立が好感されたこと、財政支出の拡大による景気回復が期待されたことなどから、一段高の展開となりました。

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。

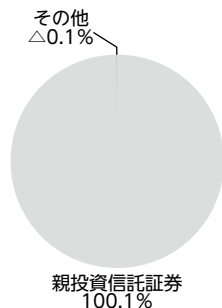
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

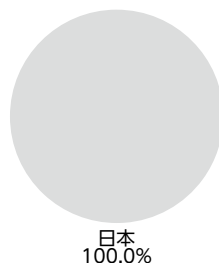
	当作成期末
	2021年1月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

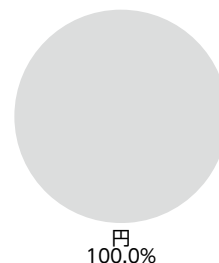
○資産別配分



○国別配分



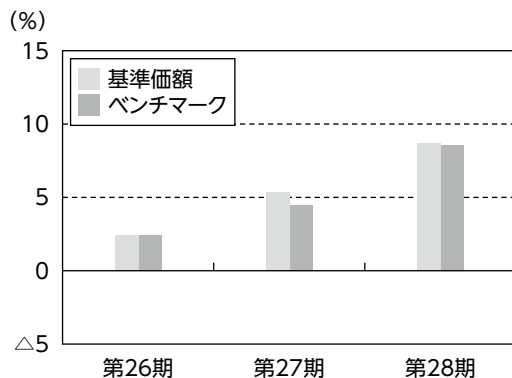
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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



当作成期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)および信託報酬要因(マイナス)です。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

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26期	第27期	第28期
	2020年7月8日～ 2020年9月7日	2020年9月8日～ 2020年11月9日	2020年11月10日～ 2021年1月7日
当期分配金 (円)	1	97	17
(対基準価額比率) (%)	(0.009)	(0.797)	(0.129)
当期の収益 (円)	1	97	17
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	4,055	4,062	5,097

(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
	(2020年7月8日～2021年1月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	7円	0.061%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,853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)	(0.044)	
(販売会社)	(1)	(0.006)	
(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＝ $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(株式)	(0)	(0.000)	
(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＝ $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(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＝ $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 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
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(－)	(－)	
合計	7	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
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	477, 488	732, 576	4, 388, 230	7, 078, 428

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	71, 661, 421千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	341, 614, 193千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 20

(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
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 12, 340	百万円 142	% 1. 2	百万円 12, 330	百万円 156	% 1. 3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<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
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 434, 470	百万円 9, 483	% 2. 2	百万円 434, 667	百万円 10, 035	% 2. 3

<平均保有割合 21. 9%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

■利害関係人の発行する有価証券等
 <国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当 作 成 期		
	買 付 額	売 付 額	当作成期末保有額
株 式	87百万円	68百万円	915百万円

(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	50, 066, 325	46, 155, 583	80, 513, 799

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、216, 855, 278千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス マザーファンド	80, 513, 799	99. 8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	131, 345	0. 2
投 資 信 託 財 産 総 額	80, 645, 144	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 26 期 末 2020年9月7日現在	第 27 期 末 2020年11月9日現在	第 28 期 末 2021年1月7日現在
(A) 資 産	75,916,199,374円	78,894,444,980円	80,645,144,483円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	53,600,867	84,353,575	67,706,502
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	75,862,341,250	78,809,226,077	80,513,799,826
未 収 入 金	257,257	865,328	63,638,155
(B) 負 債	22,315,532	674,646,189	196,037,013
未 払 収 益 分 配 金	6,569,384	628,301,045	104,304,383
未 払 解 約 金	60,998	29,999,999	76,009,998
未 払 信 託 報 酬	15,362,984	16,015,966	15,412,528
未 払 利 息	131	111	46
そ の 他 未 払 費 用	322,035	329,068	310,058
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	75,893,883,842	78,219,798,791	80,449,107,470
元 本	65,693,846,093	64,773,303,701	61,355,519,437
次 期 繰 越 損 益 金	10,200,037,749	13,446,495,090	19,093,588,033
(D) 受 益 権 総 口 数	65,693,846,093口	64,773,303,701口	61,355,519,437口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	11,553円	12,076円	13,112円

■損益の状況

項 目	第 26 期 自 2020年7月8日 至 2020年9月7日	第 27 期 自 2020年 9月8日 至 2020年11月9日	第 28 期 自 2020年11月10日 至 2021年 1月 7日
(A) 配 当 等 収 益	△4,756円	△5,457円	△11,552円
受 取 利 息	55	—	169
支 払 利 息	△4,811	△5,457	△11,721
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,801,304,832	4,027,047,195	6,466,560,335
売 買 損 益	1,840,043,000	4,061,248,380	6,593,653,589
売 買 損 益	△38,738,168	△34,201,185	△127,093,254
(C) 信 託 報 酬 等	△15,685,019	△16,345,034	△15,722,586
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,785,615,057	4,010,696,704	6,450,826,197
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,878,734,125	△97,920,519	3,104,256,284
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,299,726,201	10,162,019,950	9,642,809,935
(配 当 等 相 当 額)	(23,347,678,049)	(23,032,752,206)	(21,824,353,534)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,047,951,848)	(△12,870,732,256)	(△12,181,543,599)
(G) 計 (D+E+F)	10,206,607,133	14,074,796,135	19,197,892,416
(H) 収 益 分 配 金	△6,569,384	△628,301,045	△104,304,383
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	10,200,037,749	13,446,495,090	19,093,588,033
追 加 信 託 差 損 益 金	10,299,726,201	10,162,019,950	9,642,809,935
(配 当 等 相 当 額)	(23,347,646,273)	(23,032,788,699)	(21,824,427,626)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,047,920,072)	(△12,870,768,749)	(△12,181,617,691)
分 配 準 備 積 立 金	3,296,875,136	3,284,475,140	9,450,778,098
繰 越 損 益 金	△3,396,563,588	—	—

(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26期首元本額は65,884,874,187円、第26～28期中追加設定元本額は719,732,537円、第26～28期中一部解約元本額は5,249,087,287円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 26 期	第 27 期	第 28 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	7,208,682円	651,968,031円	104,486,045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	22,401,788円	6,346,340,152円
(C) 収益調整金額	23,347,646,273円	23,032,788,699円	21,824,427,626円
(D) 分配準備積立金額	3,296,235,838円	3,238,406,366円	3,104,256,284円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	26,651,090,793円	26,945,564,884円	31,379,510,107円
(F) 期末残存口数	65,693,846,093口	64,773,303,701口	61,355,519,437口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	4,056円	4,159円	5,114円
(H) 分配金額(1万口当たり)	1円	97円	17円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	6,569,384円	628,301,045円	104,304,383円

分配金のお知らせ

	第26期	第27期	第28期
1万口当たり分配金	1円	97円	17円

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

お知らせ

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。

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

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		株 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	1.9	151,002
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	1.8	162,440
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	1.8	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	2.2	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7	313,448

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(当 期 首) 2019年 5月29日	円 14,134	% －	1,536.41	% －	% 97.8	% 2.2
5月末	13,912	△1.6	1,512.28	△1.6	98.0	2.1
6月末	14,292	1.1	1,551.14	1.0	98.7	1.5
7月末	14,422	2.0	1,565.14	1.9	99.0	1.0
8月末	13,935	△1.4	1,511.86	△1.6	98.9	1.1
9月末	14,775	4.5	1,587.80	3.3	98.2	1.9
10月末	15,514	9.8	1,667.01	8.5	97.9	1.9
11月末	15,816	11.9	1,699.36	10.6	98.2	1.8
12月末	16,044	13.5	1,721.36	12.0	98.9	1.1
2020年 1月末	15,701	11.1	1,684.44	9.6	98.7	1.3
2月末	14,087	△0.3	1,510.87	△1.7	98.5	1.5
3月末	13,248	△6.3	1,403.04	△8.7	97.3	2.6
4月末	13,822	△2.2	1,464.03	△4.7	97.9	2.1
(当 期 末) 2020年 5月29日	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7

(注1) 騰落率は期首比です。

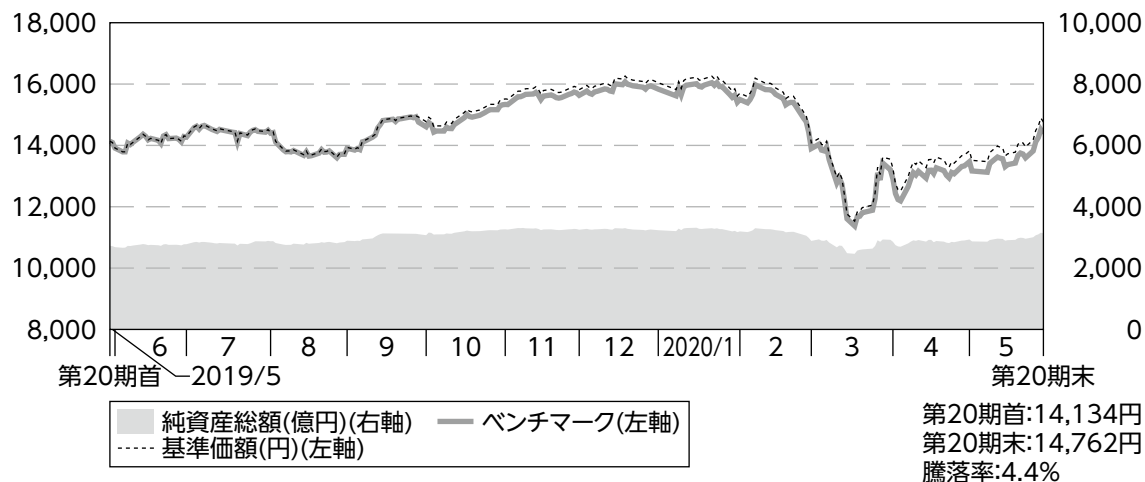
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、期首と比べて上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

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

当ファンドのポートフォリオ

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

- (1) 株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。
- (2) 東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX(東証株価指数)の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

当ファンドの組入資産の内容

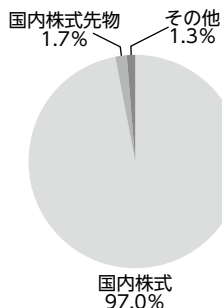
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.3%
2	ソニー	日本	1.9%
3	キーエンス	日本	1.8%
4	東証株価指数先物 2006	日本	1.7%
5	ソフトバンクグループ	日本	1.7%
6	武田薬品工業	日本	1.5%

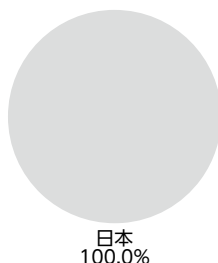
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本電信電話	日本	1.4%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	第一三共	日本	1.3%
10	任天堂	日本	1.2%
組入銘柄数			2,104

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

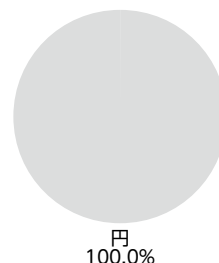
○資産別配分



○国別配分



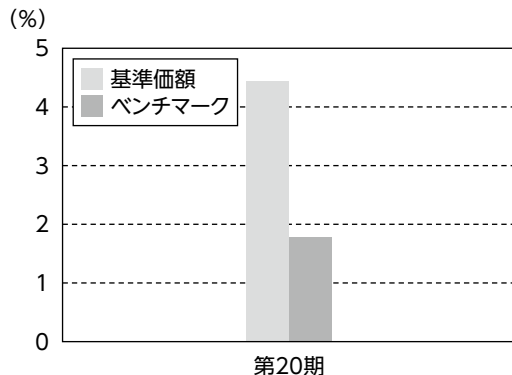
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.7%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)です。

今後の運用方針

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日～2020年5月29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)	0.001% (0.000) (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	0.001	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(14,630円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株 式＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 44,017 (2,402)	千円 77,573,825 (－)	千株 24,490	千円 48,238,316

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜新株予約権証券＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	内	証券 － (225,900)	千円 － (－)	証券 187,800	千円 562

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 48,977	百万円 49,910	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	125, 812, 141千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	295, 160, 588千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 42

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 998	百万円 998	% 100. 0	百万円 276	百万円 276	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	867, 507	151, 128	17. 4	868, 693	152, 069	17. 5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	221百万円	144百万円	818百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期首(前期末)	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	5.3	6.6	17,787
日本水産	164	188	93,812
マルハニチロ	23.7	27.2	63,403
カネコ種苗	5	5.7	8,128
サカタのタネ	20	22.4	82,880
ホクト	13.8	14.3	28,700
ホクリヨウ	2.2	2.9	1,899
鉱業(0.2%)			
住石ホールディングス	35.2	38	4,332
日鉄鉱業	3.8	4.3	19,694
三井松島ホールディングス	6.9	7.3	6,336
国際石油開発帝石	658	754.3	566,403
石油資源開発	23.6	24.6	49,790
K&Oエナジーグループ	8	9.1	14,177
建設業(2.6%)			
ヒノキヤグループ	4.6	4.7	7,755
ショーボンドホールディングス	11.7	29.3	146,060
ミライト・ホールディングス	46.1	55.9	86,030
タマホーム	7.9	10.1	13,170
サンヨーホームズ	2.4	1.6	1,016
日本アクア	5.2	7.5	4,567
ファーストコーポレーション	5	5.7	3,060
ベステラ	3.1	3.2	3,260
T A T E R U	14.2	38.8	6,440
キャンディル	—	3.1	1,692
スペースバリューホールディングス	19.9	22.9	8,106
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.6	3,589
第一カッター興業	2	2.3	4,261
明豊ファシリティワークス	—	6	3,426
安藤・間	105.9	112	78,064
東急建設	48.6	55.1	32,398
コムシスホールディングス	58.2	66.7	200,100
ミサワホーム	13.6	—	—
ピーアールホールディングス	17.8	20.5	11,890
高松コンストラクショングループ	10.4	11.7	29,987
東建コーポレーション	5.1	5.8	42,862
ソネック	1.7	1.9	1,548
ヤマウラ	7	8.2	6,674
大成建設	134.8	144.8	541,552
大林組	406.3	434.2	432,897
清水建設	414.5	440.7	401,918
飛島建設	12	12.5	13,937

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
長谷工コーポレーション	169.7	168.1	220,715
松井建設	15.7	17.1	10,602
銭高組	1.7	1.9	6,916
鹿島建設	317.5	340.9	416,579
不動テトラ	9.7	11.3	16,012
大末建設	5.4	5	3,900
鉄建建設	8.4	9.4	20,896
西松建設	29.4	33.5	70,618
三井住友建設	95.8	104.9	47,519
大豊建設	9.4	9.7	24,298
前田建設工業	97.1	108.8	91,936
佐田建設	10.2	9.3	3,822
ナカノフドー建設	11.5	11.9	4,605
奥村組	22.4	23.6	61,360
東鉄工業	16.2	18.6	53,512
イチケン	2.8	3.1	4,665
富士ビー・エス	5.6	6.4	3,628
浅沼組	5	4.9	20,727
戸田建設	158.2	180.3	119,719
熊谷組	19.5	20.1	52,923
青木あすなろ建設	7.3	—	—
北野建設	3	2.6	6,845
植木組	1.9	1.9	4,683
矢作建設工業	18.3	19.2	14,803
ビーエス三菱	15	14.3	7,907
日本ハウスホールディングス	25.7	29.6	9,324
大東建託	48.2	47.4	539,649
新日本建設	16.7	18.5	13,949
N I P P O	35.8	35.9	96,032
東亜道路工業	2.5	2.7	8,788
前田道路	42.4	38.3	76,944
日本道路	3.7	4.2	29,820
東亜建設工業	9.7	13.5	22,207
日本国土開発	22	42.2	23,252
若築建設	6.8	7.8	9,016
東洋建設	49.3	48.7	20,892
五洋建設	160.9	172.1	96,720
世紀東急工業	19.6	20.8	16,681
福田組	4.5	5	24,425
住友林業	96.3	110	150,810
日本基礎技術	13.8	14.6	6,161
巴コーポレーション	18.5	19.3	7,102
大和ハウス工業	374.9	429.6	1,148,965

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ライト工業	26	24.8	36,257	
積水ハウス	414.7	470.9	966,522	
日特建設	11.5	11.3	8,203	
北陸電気工事	6.5	7.5	7,020	
ユアテック	21.6	24.8	15,648	
日本リーテック	—	9.1	18,891	
四電工	2.1	2.4	5,616	
中電工	17.4	17.5	40,512	
関電工	61.6	61.8	60,811	
きんでん	90	103.2	186,069	
東京エネシス	14	14.4	10,742	
トーエネック	3.8	4.4	17,160	
住友電設	9.4	12.3	30,786	
日本電設工業	23.1	23.8	56,715	
協和エクシオ	53	65.8	162,789	
新日本空調	11.7	11.5	29,175	
九電工	26.7	30.5	91,286	
三機工業	31	31.3	42,974	
日揮ホールディングス	117	133.7	154,958	
中外炉工業	4.1	4.7	7,477	
ヤマト	13.3	13.9	9,201	
太平電業	9.2	10.5	24,874	
高砂熱学工業	33.2	37.7	68,991	
三晃金属工業	1.9	1.9	3,912	
朝日工業社	3	2.9	8,990	
明星工業	24.4	28.1	21,243	
大気社	18.6	21.1	71,001	
ダイダン	9.3	10.4	30,108	
日比谷総合設備	12.2	14	27,468	
東芝プラントシステム	29.6	—	—	
フィル・カンパニー	—	2.5	7,762	
OSJBホールディングス	59.7	68.5	16,988	
東洋エンジニアリング	10.1	18.2	7,352	
レイズネクスト	24.3	23.3	29,870	
食料品(4.0%)				
日本製粉	38.4	40.7	66,422	
日清製粉グループ本社	136.9	157	263,603	
日東富士製粉	0.9	1	6,130	
昭和産業	11.1	12.8	42,176	
鳥越製粉	10.7	12.3	11,033	
中部飼料	14.8	17	28,339	
フィード・ワン	81	93.3	17,353	
東洋精糖	1.8	2.3	2,877	
日本甜菜製糖	6.9	7.2	12,175	
三井製糖	9.6	12.2	25,412	
塩水港精糖	13.1	15	3,150	
日新製糖	5.7	6.6	12,889	
森永製菓	30.5	32.6	150,775	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
中村屋	3.1	3.6	14,634	
江崎グリコ	36.4	41.2	214,652	
名糖産業	5.8	6.7	8,723	
井村屋グループ	5.2	7.9	16,163	
不二家	6.8	7.8	16,941	
山崎製パン	99.1	104.2	201,210	
第一屋製パン	2.1	2.4	2,287	
モロゾフ	2.1	2.4	14,304	
亀田製菓	7.5	7.9	42,818	
寿スビリッツ	12.8	13.4	70,350	
カルビー	55.2	63.3	197,179	
森永乳業	24.3	25.7	116,421	
六甲バター	8.8	9.2	14,646	
ヤクルト本社	89.8	95.6	630,960	
明治ホールディングス	85.9	91.9	745,309	
雪印メグミルク	29.2	33.5	88,607	
ブリマハム	17	21.7	57,266	
日本ハム	50.2	53.1	211,338	
林兼産業	4	4.6	2,658	
丸大食品	12.9	14.8	28,786	
S F o o d s	10.9	11.1	28,338	
柿安本店	—	4.8	12,566	
伊藤ハム米久ホールディングス	78	89.5	59,965	
サッポロホールディングス	44.3	47.4	102,147	
アサヒグループホールディングス	253.8	291	1,180,878	
キリンホールディングス	548.3	589.4	1,301,100	
宝ホールディングス	90.8	103	89,507	
オエノンホールディングス	34.3	36.7	14,496	
養命酒製造	3.7	4.3	8,105	
コカ・コーラ ボトラーズ	92.8	97.5	208,650	
ジャパンホールディングス	81.1	93	409,200	
サントリー食品インターナショナル	6.8	7.1	37,488	
ダイドーグループホールディングス	36.8	42.2	260,796	
伊藤園	11.9	13.7	32,208	
キーコーヒー	3.3	3.6	3,470	
ユニカフェ	1.7	2	2,376	
ジャパンフーズ	15.6	17.9	61,576	
日清オイリオグループ	29.6	33.9	98,004	
不二製油グループ本社	1.3	1.5	5,572	
かどや製油	6.3	7.2	31,140	
J-オイルミルズ	80	100	542,000	
キッコーマン	267.7	306.9	563,775	
味の素	67.5	77.4	163,236	
キュービー	45.3	52	189,540	
ハウス食品グループ本社	48.6	52.7	159,944	
カゴメ	5.9	6.7	6,204	
焼津水産化学工業	11.1	12.7	94,996	
アリアケジャパン	1.6	1.8	2,901	
ビエトロ				

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エバラ食品工業	2.9	3.4	7,490	
やまみ	—	1.2	2,766	
ニチレイ	63	66.2	200,917	
東洋水産	62.4	71.5	402,545	
イトアイト	4.2	4.8	8,587	
大冷	1.4	1.8	3,520	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3.3	7.7	8,993	
日清食品ホールディングス	51.5	59.1	531,900	
永谷園ホールディングス	6.5	6.8	14,980	
一正蒲鉾	4.7	5.4	5,340	
フジッコ	13.1	15	29,865	
ロック・フィールド	13.1	15	20,910	
日本たばこ産業	699.9	802.4	1,715,130	
ケンコーマヨネーズ	6.8	7.8	16,723	
わらべや日洋ホールディングス	7.9	9.1	15,970	
なとり	6.8	7.8	13,657	
イフジ産業	2.1	2.4	1,924	
ビックルスコーポレーション	2.9	3	6,897	
北の達人コーポレーション	47.6	48.5	25,268	
ユウグレナ	51.7	59.9	44,565	
ミヨシ油脂	4.6	5.3	6,163	
理研ビタミン	5.7	13.1	29,606	
繊維製品(0.5%)				
片倉工業	14.6	20.1	24,321	
グンゼ	8	10.1	38,733	
東洋紡	50.2	53.9	81,335	
ユニチカ	34.7	41	14,514	
富士紡ホールディングス	6.2	6.7	21,607	
倉敷紡績	11.3	13.7	33,236	
シキボウ	6.2	7.1	7,518	
日本毛織	39	45.1	45,370	
トーア紡コーポレーション	5	5.4	2,770	
ダイドーリミテッド	14.4	—	—	
帝国繊維	13.3	15.5	35,495	
帝人	96.5	110.9	195,627	
東レ	917.7	982.7	514,836	
サカイオーベックス	3	3.8	8,230	
住江織物	3.5	3	5,790	
日本フェルト	6.9	8.6	4,110	
イチカワ	1.8	2.3	3,153	
日東製網	1.4	1.6	2,289	
アツギ	9.9	11.3	6,983	
ダイニック	4.8	5.1	3,937	
セーレン	29.2	33.7	45,023	
ソトー	4.8	5.5	5,274	
東海染工	1.7	2	2,234	
小松マテレー	19.6	22.4	16,598	
ワコールホールディングス	34.5	35.4	78,977	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ホギメディカル	14.7	15.5	54,715	
レナウン	34	—	—	
クラウドシアホールディングス	3.1	3.6	1,551	
T S I ホールディングス	43.8	45.7	21,113	
マツオカコーポレーション	3.8	3.9	9,426	
ワールド	15.5	19.3	30,243	
三陽商会	7.2	7.2	6,523	
ナイガイ	4.5	5.2	1,872	
オンワードホールディングス	71.3	81.7	30,229	
ルックホールディングス	4.4	4.7	4,037	
ゴールドウイン	10.7	24.6	169,494	
デサント	28.9	26.5	42,479	
キング	6.4	6.6	3,399	
ヤマトインターナショナル	7.8	12.2	4,318	
パルプ・紙(0.2%)				
特種東海製紙	7.5	8.6	37,238	
王子ホールディングス	532.5	566.9	306,692	
日本製紙	56.7	60	95,460	
三菱製紙	19.2	15.4	5,852	
北越コーポレーション	78.5	80.8	32,804	
中越パルプ工業	5	5.7	8,396	
巴川製紙所	3.9	4	3,528	
大王製紙	57.6	59.8	87,128	
阿波製紙	3	3.5	1,928	
レンゴー	122	128.2	109,226	
トーモク	7.3	8.3	14,292	
ザ・バック	9	10.3	32,136	
化学(7.2%)				
クラレ	199.6	213.6	241,795	
旭化成	841.5	898.8	763,980	
共和レザー	7.4	7.4	4,995	
昭和電工	78.6	96.5	248,487	
住友化学	931.1	996.3	332,764	
住友精化	5.8	6	18,240	
日産化学	72.6	75.3	358,051	
ラサ工業	4.2	4.8	7,123	
クレハ	10.9	11.6	55,042	
多木化学	3.5	5.3	38,160	
テイカ	9.6	9.9	15,592	
石原産業	22.7	24.3	18,516	
片倉コープアグリ	3.4	3.5	4,189	
日東エフシー	7.4	—	—	
日本曹達	18.7	20.1	60,119	
東ソー	182.8	209.6	313,980	
トクヤマ	34.1	39.1	100,721	
セントラル硝子	25.8	27.7	54,402	
東亜合成	74.2	85.1	87,738	
大阪ソーダ	12.7	13.8	36,156	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
関東電化工業	27.9	32.2	29,913	
デンカ	46.5	49.5	130,630	
信越化学工業	208.4	232.8	2,937,936	
日本カーバイド工業	4	4.6	6,536	
堺化学工業	7.9	8.8	17,512	
第一稀元素化学工業	12.8	14.7	11,598	
エア・ウォーター	96.9	126.1	197,346	
大陽日酸	97.4	130.3	236,103	
日本化学工業	4	4.2	9,979	
東邦アセチレン	1.8	2	2,564	
日本パーカライジング	64.6	68.4	78,523	
高圧ガス工業	18.7	21.5	16,598	
チタン工業	1.5	1.7	3,197	
四国化成工業	19.9	20.9	23,951	
戸田工業	2.5	3.1	5,270	
ステラ ケミファ	6.9	7.4	19,617	
保土谷化学工業	4.1	5.1	21,394	
日本触媒	19.9	21	126,630	
大日精化工業	9.8	12	29,940	
カネカ	30.6	35.1	100,842	
三菱瓦斯化学	121.6	126.2	202,424	
三井化学	107.4	123.1	275,744	
J S R	118.7	126.4	266,956	
東京応化工業	20.3	23.3	116,267	
大阪有機化学工業	11	12.5	23,437	
三菱ケミカルホールディングス	790.8	906.5	574,992	
KHネオケム	18	23.9	50,668	
ダイセル	174.2	176.6	161,059	
住友ベークライト	20.5	21.3	64,539	
積水化学工業	258.5	291.6	438,858	
日本ゼオン	106.7	122.3	126,825	
アイカ工業	35.5	40.7	130,647	
宇部興産	59.7	68.5	131,862	
積水樹脂	19.5	24.4	57,803	
タキロンシーアイ	25.5	29.3	21,564	
旭有機材	8.2	7.7	11,719	
日立化成	54.7	—	—	
ニチバン	6.2	7.1	10,848	
リケンテクノス	32.1	34.1	14,799	
大倉工業	6.1	6.4	10,534	
積水化成成品工業	17.5	18.2	11,011	
群栄化学工業	3	3.1	8,487	
タイガースポリマー	6.3	7.1	3,315	
ミライアル	3.5	4.8	6,196	
ダイキアクシス	4.3	4.8	3,796	
ダイキョーニシカワ	25	28.6	17,388	
竹本容器	4.3	4.8	3,561	
森六ホールディングス	6.4	7.3	11,680	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本化薬	75.3	83.9	90,779	
カーリットホールディングス	12.7	14.5	8,018	
日本精化	9.5	10.9	16,088	
扶桑化学工業	12	13.7	55,005	
トリケミカル研究所	2.6	3	32,070	
ADEKA	58.3	62.4	93,537	
日油	44.6	51.1	195,713	
新日本理化	—	22.4	4,032	
ハリマ化成グループ	9.8	11.2	11,144	
花王	293.2	331.5	2,866,480	
第一工業製薬	4.4	5.1	24,046	
石原ケミカル	3	3.7	7,211	
日華化学	4.1	4.6	4,324	
ニイタカ	1.9	2.8	10,262	
三洋化成工業	8	8.1	40,014	
有機合成薬品工業	9.3	10.4	3,983	
大日本塗料	13.4	15.3	15,055	
日本ペイントホールディングス	97.6	111.9	840,369	
関西ペイント	132.9	152.4	340,156	
神東塗料	9.6	10.7	1,926	
中国塗料	38.8	38.6	31,574	
日本特殊塗料	8.9	10.1	9,120	
藤倉化成	15.9	18.3	9,150	
太陽ホールディングス	9.7	10	50,600	
D I C	53.5	57.3	161,070	
サカタインクス	25.8	29.6	31,760	
東洋インキSCホールディングス	25	28.7	59,724	
T&K TOKA	9.2	10.5	8,379	
富士フイルムホールディングス	250.9	265.5	1,322,455	
資生堂	240	275.1	1,807,407	
ライオン	168.3	180	443,700	
高砂香料工業	8.3	8.7	21,523	
マンダム	27.2	31.1	67,704	
ミルボン	14.9	18.5	98,235	
ファンケル	53.8	56	171,360	
コーセー	20.5	26	350,740	
コタ	6.4	8	9,632	
シーボン	1.5	1.8	3,855	
ボーラ・オルビスホールディングス	51.6	59.1	123,873	
ノエビアホールディングス	11.5	11.7	56,394	
アジュパンコスメジャパン	2.8	3.1	2,945	
エスケー	8.7	8.9	14,747	
アグロ カネショウ	4.9	5.8	8,497	
コニシ	21.4	22.7	34,662	
長谷川香料	16	23.9	56,977	
星光PMC	8.1	7.9	5,688	
小林製薬	33.8	38.8	372,480	
荒川化学工業	10.8	12.4	16,132	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
メック	8.3	9.5	19,826	
日本高純度化学	3.3	3.8	10,199	
タカラバイオ	31.6	36.2	104,038	
J C U	15.7	16.8	54,600	
新田ゼラチン	7.6	8.7	6,298	
O A T アグリオ	1.7	2.4	2,733	
デクセリアルズ	31.2	35.8	30,716	
アース製薬	9.1	10.4	74,048	
北興化学工業	12.3	14.2	8,676	
大成ラミック	4	4.5	12,078	
クミアイ化学工業	49.9	57.3	49,851	
日本農薬	21.4	24.7	12,177	
アキレス	8.8	9.5	16,102	
有沢製作所	18.9	21.9	17,760	
日東電工	83.3	95.5	556,765	
レック	12.9	14.8	23,650	
三光合成	13.9	15.8	5,024	
きもと	20.9	23.5	3,689	
藤森工業	10.9	12.4	43,586	
前澤化成工業	8.3	8.8	9,160	
未来工業	6.5	7.4	14,481	
ウェーブロックホールディングス	3.4	4.8	3,758	
J S P	7.1	8.1	11,979	
エフピコ	13.3	15.2	120,232	
天馬	8.4	9.2	16,790	
信越ポリマー	21.6	24.9	23,655	
東リ	30.2	34.5	9,004	
ニフコ	48.4	50.8	119,786	
バルカー	9.8	11.2	23,307	
ユニ・チャーム	256.1	266.9	1,070,269	
ショーエイコーポレーション	1	2.1	1,852	
医薬品(7.2%)				
協和キリン	141.7	139.3	407,034	
武田薬品工業	1,054.4	1,152	4,828,032	
アステラス製薬	1,113.5	1,200.5	2,298,357	
大日本住友製薬	89.5	102.6	156,259	
塩野義製薬	154.4	174.1	1,107,450	
田辺三菱製薬	126.3	—	—	
わかもと製薬	14.3	16.5	4,158	
あすか製薬	14.9	15.8	18,644	
日本新薬	31.6	36.2	335,936	
バイオフェルミン製薬	2.1	2.4	5,481	
中外製薬	125.9	144.4	2,294,516	
科研製薬	21.8	23.7	140,304	
エーザイ	144.6	165.7	1,398,176	
ロート製薬	61.9	71.1	235,341	
小野薬品工業	285.2	318	978,486	
久光製薬	35.7	36.6	198,738	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
持田製薬	18.3	19.2	80,160	
参天製薬	224.8	257.9	513,221	
扶桑薬品工業	4.3	4.9	12,524	
日本ケミファ	1.6	1.8	4,939	
ツムラ	37.4	42.9	128,528	
日医工	31.8	39.2	51,352	
キッセイ薬品工業	21.4	24.5	66,885	
生化学工業	23.4	26.9	30,854	
栄研化学	21.2	24.3	44,833	
日水製薬	5.1	5.8	7,302	
鳥居薬品	6.5	8.7	28,231	
J C R ファーマ	8.5	9.8	121,226	
東和薬品	17.4	17.7	40,125	
富士製薬工業	8.2	9.4	11,674	
沢井製薬	24.8	28.4	168,696	
ゼリア新薬工業	23.9	25.1	53,337	
第一三共	345.6	396.2	3,995,677	
キョーリン製薬ホールディングス	26.6	30.6	71,328	
大幸薬品	5.4	16.9	37,974	
ダイト	7	8.4	36,624	
大塚ホールディングス	230.1	263.8	1,283,123	
大正製薬ホールディングス	27	29.3	200,412	
ペプチドリーム	60.5	70.4	340,384	
石油・石炭製品(0.5%)				
日本コークス工業	101.5	117	7,371	
ニチレキ	15.4	16.3	27,139	
ユシロ化学工業	6.3	7.8	9,633	
ビービー・カストロール	4.3	4.9	6,384	
富士石油	29.2	37	6,845	
MORESCO	4.4	5	5,270	
出光興産	139.4	153.7	367,343	
J X T Gホールディングス	2,031.3	2,082.9	862,945	
コスモエネルギーホールディングス	35	40.1	68,370	
ゴム製品(0.6%)				
横浜ゴム	69.9	80.2	130,485	
TOYO TIRE	62	79.5	121,555	
ブリヂストン	371.2	398.8	1,426,507	
住友ゴム工業	108.5	124.4	136,342	
藤倉コンポジット	10.5	12.1	4,634	
オカモト	8.4	8.4	32,130	
フコク	5.3	6.1	4,202	
ニッタ	13.6	15.6	34,850	
住友理工	23.3	26.8	16,991	
三ツ星ベルト	15.9	18.2	29,793	
バンダー化学	23	24.4	15,298	
ガラス・土石製品(0.8%)				
日東紡績	18	20.6	121,540	
A G C	119.4	136.9	417,545	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本板硝子	53	66.2	27,075	
石塚硝子	2	2.5	5,387	
日本山村硝子	5	5.8	4,912	
日本電気硝子	52.3	55.6	94,964	
オハラ	4.8	5.5	5,340	
住友大阪セメント	24.4	26.2	99,298	
太平洋セメント	76.3	87.5	222,862	
日本ヒューム	12.1	13.9	10,355	
日本コンクリート工業	26	29.9	8,162	
三谷セキサン	5.6	6.5	33,540	
アジアパイルホールディングス	17.1	19.7	9,101	
東海カーボン	109.7	145.1	142,052	
日本カーボン	5.8	7.1	24,282	
東洋炭素	7.1	8.1	13,170	
ノリタケカンパニーリミテド	7.2	7.7	28,259	
TOTO	92.9	98.9	422,303	
日本碍子	147.4	166.2	262,429	
日本特殊陶業	101.9	105.3	182,906	
MARUWA	4.2	5.3	43,566	
品川リフラクトリーズ	3.2	3.7	9,120	
黒崎播磨	2.4	2.8	11,046	
ヨータイ	10.6	11	7,667	
イソライト工業	6.2	7.2	3,722	
東京窯業	15.4	17.7	5,451	
ニッカトー	5.5	6.3	4,271	
フジミインコーポレーテッド	10.8	12.3	38,191	
クニミネ工業	5.4	5.6	5,588	
エーアンドエーマテリアル	2.3	2.3	2,785	
ニチアス	33.1	37.9	94,181	
ニチハ	16.8	19.3	45,046	
鉄鋼(0.6%)				
日本製鉄	554.9	612.8	608,265	
神戸製鋼所	218.6	250.8	100,570	
中山製鋼所	16.5	19.2	6,796	
合同製鐵	5.8	7.4	15,769	
ジェイ エフ イー ホールディングス	322.6	369.9	292,960	
東京製鐵	64	66.8	46,626	
共英製鋼	13.5	15.5	22,072	
大和工業	25.4	29.1	64,747	
東京鐵鋼	4.9	5.7	7,780	
大阪製鐵	7.9	7.3	9,475	
淀川製鋼所	16.1	18.5	31,820	
丸一鋼管	42.3	44.5	122,775	
モリ工業	3.6	4.1	9,840	
大同特殊鋼	19.6	22.4	82,768	
日本高周波鋼業	4.4	5.2	2,033	
日本冶金工業	98.9	11.4	19,619	
山陽特殊製鋼	15.1	9.4	9,240	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
愛知製鋼	6.7	7.7	23,331	
日立金属	128.7	147.6	183,319	
日本金属	2.8	3.2	2,256	
大平洋金属	8.1	9.3	15,717	
新日本電工	71.3	88.6	13,821	
栗本鐵工所	6	6.8	12,709	
虹技	1.8	2.1	2,522	
三菱製鋼	8.9	10.2	7,282	
日亜鋼業	17.5	20.3	5,582	
日本精練	1.7	2.3	7,498	
エンビプロ・ホールディングス	4.5	5.9	3,953	
シンニッタン	18.5	21.5	6,106	
新家工業	2.7	3.2	3,660	
非鉄金属(0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	19.8	22.7	13,847	
日本軽金属ホールディングス	326	347.1	64,213	
三井金属鉱業	32.3	37	85,914	
東邦亜鉛	6.7	7.1	10,635	
三菱マテリアル	78.9	90.5	221,996	
住友金属鉱山	163.6	175.1	525,475	
DOWAホールディングス	27.9	34.7	120,062	
古河機械金属	19.8	24.4	27,230	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13.9	14.3	14,800	
東邦チタニウム	21.5	24.7	16,598	
UACJ	18.2	20.8	41,392	
CKサンエツ	2.3	2.9	9,352	
古河電気工業	34.5	42.6	112,123	
住友電気工業	446.6	512	642,304	
フジクラ	144.6	165.7	52,526	
昭和電線ホールディングス	13.8	15.9	18,412	
東京特殊電線	1.6	2.1	4,886	
タツタ電線	23.9	27.3	17,144	
カナレ電気	2.1	2.3	4,034	
平河ヒューテック	5.1	6.9	7,824	
リョービ	14.8	16.9	23,676	
アーレスティ	14.9	18.2	6,715	
アサヒホールディングス	22.5	24	66,480	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	6.7	7.7	10,710	
宮地エンジニアリンググループ	3.6	4.2	7,035	
トーカロ	30.7	38	40,128	
アルファC o	4.2	4.8	4,560	
SUMCO	132	162.7	268,617	
川田テクノロジーズ	2.7	2.8	14,280	
RS Technologies	2.4	3.9	13,435	
信和	6.3	7.9	5,545	
東洋製罐グループホールディングス	76.1	87.2	99,931	
ホッカンホールディングス	6.1	7.5	12,870	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
コロナ	6.6	7.6	7,113	
横河ブリッジホールディングス	22.2	25.5	55,590	
駒井ハルテック	2.3	2.6	3,915	
高田機工	1.1	1.3	3,010	
三和ホールディングス	123.4	129.1	119,288	
文化シャッター	35.2	40.3	32,481	
三協立山	16.6	17.6	16,931	
アルインコ	9.5	9.9	9,444	
東洋シャッター	2.9	3.3	2,286	
L I X I Lグループ	176.2	202	303,808	
日本フィルコン	9.1	10.5	5,691	
ノーリツ	26.7	28.4	35,812	
長府製作所	12.2	13.9	32,331	
リンナイ	21.3	26.6	241,262	
ダイニチ工業	6.4	7.4	5,172	
日東精工	16.5	18.9	9,317	
三洋工業	1.6	1.8	3,261	
岡部	24.2	27.7	22,658	
ジーテクト	13.2	17	19,278	
東プレ	22.3	25.5	33,022	
高周波熱錬	23	26.4	14,731	
東京製綱	7.3	9.8	5,684	
サンコール	6.7	10.2	4,202	
モリテック スチール	9.3	10.7	3,349	
パイオラックス	19.1	20.2	34,622	
エイチワン	11.7	13.4	7,343	
日本発條	119	146.9	108,852	
中央発條	1.4	1.6	4,555	
アドバネクス	1.6	2	2,686	
立川ブラインド工業	5.3	6	7,104	
三益半導体工業	10.7	10.7	23,946	
機械(5.1%)				
日本ドライケミカル	3.3	3.4	5,440	
日本製鋼所	36.3	41.6	66,144	
三浦工業	51.7	59.3	272,780	
タクマ	43.7	46.5	65,332	
ツガミ	27	28.5	28,585	
オークマ	15.2	16	71,840	
芝浦機械	13.6	15.5	36,781	
アマダ	179.6	170	163,370	
アイダエンジニアリング	32.5	36	26,460	
滝澤鉄工所	3.8	4.3	4,497	
F U J I	47.8	58.9	117,034	
牧野フライス製作所	14.1	16.1	53,693	
オーエスジー	58.9	63.4	96,811	
ダイジェット工業	1.5	1.6	2,153	
旭ダイヤモンド工業	31.5	36.2	18,498	
DMG森精機	75.7	86.7	113,490	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ソディック	26.2	32.3	26,744	
ディスコ	16.2	18.6	447,516	
日東工器	6.6	7.5	14,842	
日進工具	3.6	5.4	15,233	
パンチ工業	8.4	12.5	5,600	
富士ダイス	5.4	6.2	3,918	
豊和工業	6.8	7.7	6,491	
OKK	5.1	5.9	2,596	
東洋機械金属	8.7	10	4,250	
津田駒工業	2.7	2.8	2,399	
エンシュウ	—	3.4	3,270	
島精機製作所	16.5	21.6	35,251	
オプトラン	11.7	15.3	43,268	
NCホールディングス	4	4.3	2,420	
イワキポンプ	5.2	8.8	8,976	
フリーュー	9.6	13.5	12,406	
ヤマシンフィルタ	20.8	29.8	29,680	
日阪製作所	14.8	17	12,852	
やまびこ	23.3	26.6	26,094	
平田機工	5.7	6.5	40,235	
ベガススミシン製造	11.3	14.1	4,723	
マルマエ	5	5.1	4,493	
タツモ	5.1	6.4	9,913	
ナプテスコ	65.8	80.7	269,941	
三井海洋開発	12.7	14.6	23,710	
レオン自動機	11.8	13.5	17,631	
SMC	35.4	43.4	2,359,658	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	5.9	—	—	
ホソカワミクロン	4.2	4.8	29,232	
ユニオンツール	5.2	5.1	14,331	
オイレス工業	16.8	17.8	25,276	
日精エー・エス・ビー機械	4.1	4	13,740	
サトーホールディングス	14.4	19.5	48,457	
技研製作所	10.5	12.1	59,290	
日本エアータック	3.9	4.8	5,155	
カワタ	3.3	4.1	3,161	
日精樹脂工業	10.2	11.6	10,498	
オカダアイヨン	4.2	4.4	4,272	
ワイエイシイホールディングス	4.7	5.9	2,849	
小松製作所	546.9	627.2	1,367,296	
住友重機械工業	69.2	79.3	195,078	
日立建機	48.5	55.5	157,065	
日工	3.4	19.1	12,567	
巴工業	5.2	5.9	10,667	
井関農機	12.2	13.9	17,124	
TOWA	10.4	14.1	15,777	
丸山製作所	2.8	2.9	3,654	
北川鉄工所	5.5	6.3	10,867	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ローツェ	5.3	6.1	29,737	
タカキタ	4.4	5	2,915	
クボタ	647.1	734.7	1,064,947	
荏原実業	3.6	3.5	9,170	
三菱化工機	4.3	4.8	8,587	
月島機械	24.1	25.6	32,947	
帝国電機製作所	8.5	11.5	15,065	
新東工業	28.8	33	26,037	
澁谷工業	10.6	12.1	37,268	
アイチ コーポレーション	21	24.1	18,050	
小森コーポレーション	32.9	35.3	27,534	
鶴見製作所	9.5	10.7	20,993	
住友精密工業	2	2.1	4,932	
日本ギア工業	—	5.8	1,716	
酒井重工業	2.3	2.7	6,048	
荏原製作所	53.6	57.3	148,808	
石井鐵工所	1.9	1.8	4,681	
西島製作所	12.5	14.1	11,801	
北越工業	12.5	14.3	14,657	
ダイキン工業	164.9	176.4	2,795,940	
オルガノ	4.4	5	30,300	
トーヨーカネツ	4.6	6.1	12,980	
栗田工業	65.4	75	224,025	
椿本チエイン	15.8	19.8	55,143	
大同工業	5.9	6.8	4,420	
木村化工機	10.6	11.8	5,723	
アネスト岩田	18.9	21.6	18,640	
ダイフク	66.5	70.8	593,304	
サムコ	3.4	3.5	6,730	
加藤製作所	6.3	7.7	9,432	
油研工業	2.1	2.4	3,602	
タダノ	58.4	67	57,352	
フジテック	44	50.4	81,244	
CKD	33.7	38	70,604	
キトー	9.2	10.5	12,421	
平和	33.7	38.7	70,782	
理想科学工業	10.7	12.3	16,236	
SANKYO	30.3	30.8	85,470	
日本金銭機械	13.4	15.4	8,747	
マースグループホールディングス	7.7	8.8	14,379	
フクシマガリレイ	7.5	8.6	28,509	
オーイズミ	5.3	6	2,640	
ダイコク電機	5.6	6.4	8,076	
竹内製作所	20.3	23.2	41,272	
アマノ	34.5	36.3	84,542	
JUKI	16.8	19.3	12,043	
蛇の目シン工業	11.1	12.8	5,900	
マックス	18.5	21.2	35,149	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
グローリー	33.5	35.6	91,064	
新晃工業	11.3	12.9	19,775	
大和冷機工業	17.5	20.1	19,677	
セガサミーホールディングス	119.9	137.4	192,909	
日本ビストンリング	4.5	5.1	6,278	
リケン	5.6	6.4	18,099	
T P R	16.3	18.7	27,470	
ツバキ・ナカシマ	18.4	28.3	26,885	
ホシザキ	35.3	40.5	352,350	
大豊工業	10	11.4	6,053	
日本精工	248.1	260.8	205,510	
N T N	259.9	320.8	72,500	
ジェイテクト	115.9	132.9	115,490	
不二越	11.2	12.9	44,827	
日本トムソン	35.9	41.3	16,809	
T H K	75.3	80.6	225,680	
ユーシン精機	9.4	10.8	7,527	
前澤給装工業	4.8	5.1	10,342	
イーグル工業	15	17.2	13,037	
前澤工業	8.3	9.4	3,318	
日本ビラー工業	12.3	14.1	20,233	
キッツ	49.1	56.2	40,351	
マキタ	147	180.6	659,190	
日立造船	96.2	110.1	45,141	
三菱重工業	202.4	232.1	646,978	
I H I	92.9	99.8	154,590	
スター精密	20.7	21.4	27,563	
電気機器 (14.5%)				
日清紡ホールディングス	67.2	92.4	74,012	
イビデン	74.1	84.9	242,134	
コニカミノルタ	264.2	303.7	121,176	
ブラザー工業	157.5	169.3	343,509	
ミネベアミツミ	224.4	257.3	486,554	
日立製作所	543.7	665.3	2,298,611	
三菱電機	1,207.7	1,384.6	1,964,055	
富士電機	78.4	83.5	240,396	
東洋電機製造	4.9	5.1	6,456	
安川電機	140	149.1	577,017	
シンフォニアテクノロジー	16.9	18	19,638	
明電舎	24	25.5	46,461	
オリジン	3.4	3.8	5,700	
山洋電気	5.9	6.8	33,320	
デンヨー	11.2	11.9	22,848	
東芝テック	15.2	17.4	65,163	
芝浦メカトロニクス	2.2	2.6	7,077	
マブチモーター	33.5	38.5	137,060	
日本電産	145.3	333.3	2,207,112	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.8	—	—	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
トレックス・セミコンダクター	5.7	8.4	9,811	
東光高岳	6.4	8.2	8,634	
ダブル・スコープ	17.8	—	—	
ダイヘン	13.3	15.2	54,948	
ヤーマン	17.8	23.3	17,195	
JVCケンウッド	93.2	115.7	20,363	
ミマキエンジニアリング	11.3	13.6	5,548	
第一精工	5.3	5.8	14,964	
日新電機	28.4	32.6	36,577	
大崎電気工業	24.1	27.8	14,400	
オムロン	128.4	124.1	886,074	
日東工業	19.4	20.4	38,984	
I D E C	16.3	20.1	35,798	
正興電機製作所	2.6	3.7	4,354	
不二電機工業	1.6	2.7	3,466	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43.6	46.5	88,629	
サクサホールディングス	3.1	3.3	5,765	
メルコホールディングス	5.1	5	13,485	
テクノメディカ	1.8	3.4	6,160	
日本電気	156.3	168	812,280	
富士通	116.4	133.5	1,481,850	
沖電気工業	52.4	56.4	60,122	
岩崎通信機	5.6	6.1	5,203	
電気興業	6.4	6.7	17,728	
サンケン電気	14.2	15.2	37,878	
ナカヨ	2.5	2.8	3,928	
アイホン	6.9	7.9	12,521	
ルネサスエレクトロニクス	125.7	663.2	370,728	
セイコーエプソン	149.9	171.9	208,686	
ワコム	88.3	94.1	45,732	
アルバック	24.1	25.5	82,492	
アクセル	5.6	6.4	5,408	
E I Z O	11.1	10.8	43,416	
日本信号	30.9	35.4	42,940	
京三製作所	26.2	32.7	17,363	
能美防災	16.1	18.6	37,460	
ホーチキ	7.9	10.4	14,206	
星和電機	7.1	7.6	5,479	
エレコム	11.5	15.4	78,694	
パナソニック	1,379.8	1,582.1	1,523,562	
シャープ	119.9	160.3	187,070	
アンリツ	77.8	89.2	189,371	
富士通ゼネラル	37	37.6	79,148	
ソニー	810.3	867.4	5,962,507	
T D K	63.2	66.9	674,352	
帝国通信工業	5.6	6.5	7,741	
タムラ製作所	46.8	46.5	21,111	
アルプスアルパイン	125.9	122.9	160,015	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
池上通信機	3.8	4.4	3,951	
鈴木	7	7.4	5,875	
日本トリム	2.3	2	6,470	
ローランド ディー・ジー	6.3	8	10,056	
フォスター電機	13.7	14.6	17,885	
SMK	3.4	3.6	9,216	
ヨコオ	8.8	9.1	25,789	
ホシデン	35.8	38.4	36,096	
ヒロセ電機	17.3	21.5	276,705	
日本航空電子工業	27.8	31.8	47,477	
T O A	13.1	15	11,430	
マクセルホールディングス	26.2	30.3	32,633	
古野電気	15.9	18.4	16,596	
ユニデンホールディングス	3.6	3.9	7,768	
スミダコーポレーション	10.5	11.3	8,316	
アイコム	6.7	7.7	22,915	
リオン	5.7	6	14,478	
本多通信工業	10.9	13	5,681	
横河電機	120.9	127.1	197,259	
新電元工業	4.3	4.9	13,024	
アズビル	78	87.4	240,262	
東亜ディーケーケー	6.4	7.4	6,726	
日本光電工業	53.3	57.4	206,353	
チノー	4.3	4.9	7,080	
共和電業	12.9	14.8	6,038	
日本電子材料	5	5.6	5,756	
堀場製作所	24	27.4	155,358	
アドバンテスト	82.4	103	547,960	
小野測器	6.1	6.7	3,638	
エスベック	10.8	12.6	22,201	
キーエンス	59.3	125.5	5,565,925	
日置電機	6.4	7.4	25,604	
シスメックス	94.1	99	852,390	
日本マイクロニクス	21.3	24.7	25,515	
メガチップス	9.7	13.1	25,112	
O B A R A G R O U P	6.2	8.2	26,240	
澤藤電機	1.7	1.9	3,009	
原田工業	5.3	7.1	5,878	
コーセル	15.6	19	17,746	
イリソ電子工業	11.1	11.8	40,533	
オプテックスグループ	21.4	23.1	33,610	
千代田インテグレ	5.2	6.7	11,838	
アイ・オー・データ機器	4.7	5	4,855	
レーザーテック	24.8	60.9	538,965	
スタンレー電気	85.5	97.5	255,352	
岩崎電気	4.9	5.7	10,368	
ウシオ電機	70.4	76.8	98,380	
岡谷電機産業	9.5	12.3	3,997	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ヘリオス テクノ ホールディング	11.6	14.2	5,140	
エノモト	3.7	4.6	5,027	
日本セラミック	12.4	14.3	29,543	
遠藤照明	6.5	7.8	4,414	
古河電池	9.1	10.7	6,430	
双信電機	6.7	8	3,176	
山一電機	9.1	10.3	16,902	
図研	8.1	9.2	23,938	
日本電子	23.9	27.5	88,550	
カシオ計算機	106.9	122.5	232,382	
ファナック	114.8	131.6	2,528,694	
日本シイエムケイ	27	33.8	13,790	
エンプラス	5.6	7.3	16,797	
大真空	4.7	5.3	10,573	
ローム	57.8	61.5	445,875	
浜松ホトニクス	86.7	99.4	485,072	
三井ハイテック	13.6	15.6	21,824	
新光電気工業	40.9	46.8	64,022	
京セラ	184.1	194.9	1,136,461	
太陽誘電	53.9	61.7	185,100	
村田製作所	380.2	406.8	2,446,902	
双葉電子工業	19.9	22.4	22,310	
北陸電気工業	4.8	6.1	5,776	
ニチコン	38.4	47.6	36,985	
日本ケミコン	8.6	10.5	16,285	
KOA	18.5	21.4	21,164	
市光工業	18.5	21.6	11,685	
小糸製作所	72.4	83.1	379,351	
ミツバ	22.6	26.6	11,650	
SCREENホールディングス	21	24	115,800	
キャノン電子	11.2	14.8	25,456	
キャノン	650.2	745.4	1,654,042	
リコー	363.2	352.4	280,510	
象印マホービン	30.2	40.9	69,325	
MUTOHホールディングス	1.8	2.1	3,328	
東京エレクトロン	80.5	87.9	1,889,850	
輸送用機器 (7.3%)				
トヨタ紡織	42.3	40.4	61,327	
芦森工業	2.6	2.9	2,650	
ユニプレス	23.4	26.9	28,083	
豊田自動織機	97.8	112.1	617,671	
モリタホールディングス	21.2	24.2	43,874	
三櫻工業	15.4	17.6	14,326	
デンソー	265.9	304.9	1,259,541	
東海理化電機製作所	31.8	36.5	57,560	
三井E&Sホールディングス	41.9	50	28,250	
川崎重工業	94	107.7	183,736	
名村造船所	36.1	44.6	7,760	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本車輛製造	4.4	5	13,945	
三菱ロジスネクスト	14.4	18.3	19,196	
近畿車輛	1.1	2.1	2,652	
日産自動車	1,424.3	1,633	654,669	
いすゞ自動車	381.7	401.2	405,011	
トヨタ自動車	1,345.8	1,544.9	10,435,799	
日野自動車	150.8	172.9	126,044	
三菱自動車工業	447	512.5	155,800	
エフテック	8.5	9.8	5,145	
レンップホールディングス	4.3	5.4	3,202	
GMB	2.4	2.6	1,781	
ファルテック	2.2	2.5	1,825	
武蔵精密工業	29.4	30.9	30,003	
日産車体	23.6	27	27,378	
新明和工業	50.6	37.3	39,799	
極東開発工業	24	25.7	35,388	
日信工業	22.1	28.2	62,322	
トビー工業	10	11.4	15,162	
ティラド	4.4	5.1	7,206	
曙ブレーキ工業	65.1	76	14,516	
タチエス	19.9	22.8	20,383	
NOK	65	74.5	102,735	
フタバ産業	33.6	38.6	20,187	
KYB	12.1	15.5	33,092	
大同メタル工業	19.6	26.7	15,219	
プレス工業	60	68.9	18,327	
ミクニ	15.5	17.8	5,251	
太平洋工業	25.3	29.1	28,721	
ケーヒン	27.8	31.8	80,899	
河西工業	14.8	18.8	9,719	
アイシン精機	99.5	114	387,030	
マツダ	379	407.4	280,698	
今仙電機製作所	11.3	12.9	9,636	
本田技研工業	1,018.8	1,090.2	3,035,116	
スズキ	220.9	274.4	1,027,902	
SUBARU	374.9	429.8	1,022,279	
安永	5.9	6.7	6,827	
ヤマハ発動機	170.6	180.6	280,833	
ショーワ	28.6	32.7	73,542	
TBK	14.5	16.6	7,719	
エクセディ	16.4	18.8	32,580	
豊田合成	39	44.7	102,944	
愛三工業	18.9	21.8	12,644	
盟和産業	1.9	2.2	2,127	
日本プラス	9.5	11	5,159	
ヨロズ	11.3	13	15,080	
エフ・シー・シー	21.7	22.7	41,541	
シマノ	48.7	51.8	1,026,158	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
テイ・エス テック	28.1	32.2	97,566	
ジャムコ	6.1	7	5,544	
精密機器 (2.6%)				
テルモ	341.7	391.8	1,657,314	
クリエートメディック	4	4.6	4,517	
日機装	39	41.6	41,516	
日本エム・ディ・エム	—	8	13,832	
島津製作所	155.4	165.5	482,432	
JMS	11.1	11.7	9,851	
長野計器	9.5	10.1	10,584	
ブイ・テクノロジー	5.6	6.5	26,617	
東京計器	7.7	8.8	8,509	
愛知時計電機	1.6	1.8	7,875	
インターアクション	6.1	7.4	16,346	
オーバル	11.8	12.5	2,862	
東京精密	21.8	25.1	87,473	
マニー	16	55.2	156,768	
ニコン	210.5	211.5	209,385	
トプコン	64.9	69.8	65,961	
オリンパス	719.6	766.1	1,433,756	
理研計器	10.7	12.2	29,597	
タムロン	10.7	11.2	22,747	
HOYA	243.1	276.5	2,795,415	
シード	5.2	5.9	4,690	
ノーリツ鋼機	9.5	9.4	13,583	
エー・アンド・ディ	11	12.7	9,575	
朝日インテック	51.2	156.8	517,440	
シチズン時計	132.2	162.3	62,485	
リズム時計工業	4.1	4.4	2,675	
大研医器	9.6	9.6	6,096	
メニコン	16.6	19.6	107,408	
シンシア	1.8	1.6	721	
松風	5.9	6.3	10,313	
セイコーホールディングス	18.6	19.6	35,750	
ニプロ	83.6	95.8	120,708	
その他製品 (2.4%)				
中本バックス	3.4	3.5	5,582	
スノーピーク	4.6	7.4	7,407	
パライマウントベッドホールディングス	13.9	14.6	61,101	
トランザクション	7.6	7.6	7,820	
粧美堂	3.5	4	1,444	
ニホンフラッシュ	5.2	12.9	18,098	
前田工繊	13.3	15.3	35,725	
永大産業	15.7	18.1	5,448	
アートネイチャー	12.8	14.8	9,442	
バンダイナムコホールディングス	124.9	143.1	858,027	
アイフィスジャパン	2.7	3.5	2,387	
共立印刷	20	23.1	3,303	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
SHOEI	5.8	12.1	29,850	
フランスベッドホールディングス	17.1	19.6	16,503	
パイロットコーポレーション	21.1	22.6	83,281	
萩原工業	6.7	7.7	10,795	
トッパン・フォームズ	25.9	29.7	33,293	
フジシールインターナショナル	27.1	31	68,944	
タカラトミー	50.5	62.1	57,194	
廣済堂	11.2	9.6	8,131	
エステールホールディングス	3.2	3.7	2,223	
アーク	45.9	52.8	5,966	
タカノ	4.7	5.4	3,817	
プロネクス	10.4	11.9	13,030	
ホクシン	7.4	8.5	1,062	
ウッドワン	4.1	4.7	5,292	
大建工業	9.1	9.3	16,070	
凸版印刷	170.5	195.4	360,122	
大日本印刷	170.2	181.2	443,758	
図書印刷	11.3	—	—	
共同印刷	3.7	4.3	12,882	
NISSHA	24.8	28.4	27,065	
光村印刷	1	1.2	1,814	
TAKARA & COMPANY	5.8	6.7	12,642	
アシックス	113.9	114.3	130,873	
ツツミ	3.8	4.3	7,417	
小松ウオール工業	3.7	4.2	8,127	
ヤマハ	71.8	82.3	431,252	
河合楽器製作所	3.7	4.3	12,603	
クリナップ	11.2	12.9	6,708	
ビジョン	73	83.7	351,540	
オリバー	—	2.9	7,612	
兼松サステック	0.8	0.9	1,295	
キングジム	10	11.5	10,856	
リンテック	28.7	32.9	84,388	
イトーキ	22.1	29.4	12,024	
任天堂	69.1	84.9	3,696,546	
三菱鉛筆	19.9	22.8	33,607	
タカラスタンダード	25	28.6	45,016	
コクヨ	57.9	66.4	93,092	
ナカバヤシ	11.8	13.6	8,731	
グローブライド	5.8	6.2	14,390	
オカムラ	42.1	48.3	42,600	
美津濃	12	12.6	25,741	
電気・ガス業 (1.6%)				
東京電力ホールディングス	964.1	1,105.3	401,223	
中部電力	369.5	423.6	614,643	
関西電力	492.8	524.6	563,158	
中国電力	167	199.7	295,556	
北陸電力	118.3	126.6	89,379	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
東北電力	282.8	345.9	386,024	
四国電力	108.7	124.7	100,757	
九州電力	248.9	285.4	255,718	
北海道電力	113	129.6	56,376	
沖縄電力	22.4	26.89	54,264	
電源開発	96.1	110.2	224,036	
エフオン	5.6	7.4	4,610	
イーレックス	21	19.7	28,998	
レノバ	19.8	23.1	21,760	
東京瓦斯	236.9	266.3	684,524	
大阪瓦斯	234.4	268.7	578,511	
東邦瓦斯	59.8	68.1	361,611	
北海道瓦斯	6.5	7.4	11,566	
広島ガス	24.7	28.5	10,260	
西部瓦斯	13.6	15.6	40,981	
静岡ガス	37.1	39.3	38,907	
メタウォーター	5.8	6.7	32,193	
陸運業(4.3%)				
SBSホールディングス	11.9	12	28,836	
東武鉄道	127.4	144.3	551,226	
相鉄ホールディングス	41.4	44.3	137,108	
東急	328	349.2	596,433	
京浜急行電鉄	165.4	177.8	320,217	
小田急電鉄	193.4	205.9	553,665	
京王電鉄	67.5	71.8	459,520	
京成電鉄	90.5	96.4	340,774	
富士急行	16.5	18.9	66,055	
新京成電鉄	3.1	3.6	7,704	
東日本旅客鉄道	214.7	243.7	2,059,265	
西日本旅客鉄道	108.3	123.4	857,753	
東海旅客鉄道	108.1	115.1	2,121,868	
西武ホールディングス	149.6	185.8	261,606	
鴻池運輸	19.2	22	27,280	
西日本鉄道	33.5	38.4	111,590	
ハマキョウレックス	9.3	10.6	34,450	
サカイ引越センター	6.3	7.3	44,603	
近鉄グループホールディングス	114.4	131.1	693,519	
阪急阪神ホールディングス	152.5	174.9	696,102	
南海電気鉄道	51	62.2	162,404	
京阪ホールディングス	50.9	58.4	299,008	
神戸電鉄	2.9	3.1	11,687	
名古屋鉄道	93.8	107.8	350,350	
山陽電気鉄道	8.8	9.4	21,056	
日本通運	44.1	45.4	251,516	
ヤマトホールディングス	200.5	229.9	548,081	
山九	31.8	36.4	159,978	
丸運	6.5	7.5	1,792	
丸全昭和運輸	9.3	10.6	30,464	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
センコーグループホールディングス	63	72.3	62,178	
トナミホールディングス	2.7	3.1	18,724	
ニッコンホールディングス	43.5	46.9	102,335	
日本石油輸送	1.4	1.4	4,445	
福山通運	14.6	16.8	59,472	
セイノーホールディングス	85.7	98.2	144,746	
エスライン	3.4	3.9	3,919	
神奈川中央交通	2.8	3.2	13,216	
日立物流	25.1	24	71,112	
丸和運輸機関	6	13.8	40,751	
C&Fロジホールディングス	11.6	13.3	20,282	
九州旅客鉄道	96	115	351,325	
S Gホールディングス	108.1	137.6	483,664	
海運業(0.1%)				
日本郵船	96.1	110.3	171,295	
商船三井	68.2	83.4	159,210	
川崎汽船	34.7	40.4	44,884	
N Sユナイテッド海運	6.6	7.9	11,218	
飯野海運	56.3	64.8	22,161	
共栄タンカー	1.5	3.4	3,012	
乾汽船	10.2	7.6	8,838	
空運業(0.4%)				
日本航空	209.4	231.9	490,932	
A N Aホールディングス	209.1	239.7	622,980	
パスコ	2.2	2.5	3,632	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	3.2	3.7	24,901	
日新	9.9	11.3	18,023	
三菱倉庫	39.6	41.6	115,148	
三井倉庫ホールディングス	14	15	24,045	
住友倉庫	42.1	47.2	63,248	
澁澤倉庫	6.3	7.2	15,292	
東陽倉庫	20.5	23.7	8,058	
日本トランスシティ	25.1	28.9	14,970	
ケイヒン	2.2	2.5	3,275	
中央倉庫	7	8	8,144	
川西倉庫	2.3	2.4	2,438	
安田倉庫	9.4	10.8	9,622	
ファイズホールディングス	2	2.8	3,094	
東洋埠頭	3.5	4	5,396	
宇徳	9.7	11.2	5,140	
上組	70.5	73.2	154,086	
サンリツ	2.7	3.1	1,863	
キムラユニティー	3.1	3.5	3,636	
キューソー流通システム	2.9	3.3	5,778	
近鉄エクスプレス	21.6	27.9	48,462	
東海運	6.5	7.5	1,995	
エーアイティー	7.4	9.3	7,337	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
内外トランスライン	3.6	4.6	4,765	
日本コンセプト	4.2	4.2	6,304	
情報・通信業(9.5%)				
NEC ネットエスアイ	13.1	38.7	78,367	
クロスキャット	3.3	3.8	3,936	
システナ	42.4	48.6	74,844	
デジタルアーツ	6.4	6.7	57,553	
日鉄ソリューションズ	17.8	20.5	60,516	
キューブシステム	6.5	7.6	5,867	
エイジア	2.5	2.7	3,677	
コア	5.1	6	7,398	
ラクーンホールディングス	—	6.4	4,992	
ソリトンシステムズ	6.9	6.2	8,332	
ソフトクリエイトホールディングス	5.3	6.1	13,542	
T I S	39.5	136	312,392	
ネオス	2.6	5.4	3,866	
電算システム	4.6	5.3	18,603	
グリー	82.1	84	37,128	
コーエーテクモホールディングス	24.3	27.9	86,769	
三菱総合研究所	5.1	5.9	24,455	
電算	1.4	1.6	3,476	
A G S	6.9	8	6,808	
ファインデックス	10.2	11.7	11,384	
ブレインパッド	2.3	3.5	17,307	
K L a b	21.2	26.3	20,487	
ボールトゥウィン・ビット クルーホールディングス	15.9	16.7	16,032	
イーブクイニシアティブジャパン	2	2.1	5,260	
ネクソン	302.4	379.1	851,458	
アイスタイル	30.6	38.9	11,981	
エムアップホールディングス	4.2	4	10,556	
エイチーム	8.3	9.7	7,449	
エニグモ	—	13.1	13,231	
テクノスジャパン	10.2	11	6,644	
コロブラ	39.1	44.8	48,249	
ブロードリーフ	59.1	67.8	37,900	
クロス・マーケティンググループ	4.9	6.9	2,297	
デジタルハーツホールディングス	5.6	7.5	6,577	
システム情報	6.2	10.4	11,980	
メディアドゥホールディングス	3.7	4.3	18,511	
じげん	16.9	34.4	13,037	
エンカレッジ・テクノロジー	1.8	3.3	2,808	
サイバーリンクス	2	2.3	4,130	
フィックスターズ	12.7	14.7	19,359	
CARTA HOLDINGS	5.8	6.8	7,296	
オブティム	5.3	7.2	19,980	
セレス	4	4.7	5,860	
S H I F T	—	5.5	55,990	
ティーガイア	12	12.2	27,938	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
セック	2	2.1	7,570	
日本アジアグループ	12.4	14.3	4,533	
豆蔵ホールディングス	8.2	—	—	
テクマトリックス	8.4	9.7	31,767	
プロシップ	3.6	4.2	5,472	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	286.1	32.9	57,673	
GMOペイメントゲートウェイ	19.5	28.8	349,344	
ザッパラス	6.6	6.6	2,534	
システムリサーチ	1.6	3.8	7,193	
インターネットイニシアティブ	19.4	20.2	76,861	
さくらインターネット	14.4	15	9,735	
ヴィンクス	4.1	4.1	4,460	
GMOクラウド	2.7	2.6	14,482	
SRAホールディングス	6.4	7.3	18,155	
Minor iソリューションズ	2.4	—	—	
システムインテグレータ	—	4.6	4,140	
朝日ネット	9.9	9.9	10,662	
e B A S E	7.2	16.5	21,450	
アバント	4.3	13.2	14,876	
アドソル日進	4.3	4.9	12,705	
フリービット	7.2	7.4	6,482	
コムチュア	6.7	15.3	45,395	
サイバーコム	2.2	2.6	4,924	
アステリア	8.1	8.8	4,488	
アイル	—	7.7	13,675	
マークラインズ	5.5	6.9	14,013	
メディカル・データ・ビジョン	10.6	10.6	11,363	
ショーケース	2.9	3.6	2,282	
モバイルファクトリー	3.4	3.3	3,927	
テラスカイ	2	5	14,205	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	5.3	5.5	8,217	
P C I ホールディングス	2.5	5.4	5,205	
パイブドHD	2	1.9	3,013	
アイビーシー	2.3	2.5	2,557	
ネオジャパン	2.4	2.8	3,841	
P R T I M E S	1.1	1.3	3,139	
ランドコンピュータ	2	2.3	2,573	
ダブルスタンダード	1.1	1.8	8,793	
オーブンドア	5.9	6.9	8,666	
マイネット	4	4.4	5,341	
アカツキ	4.2	4.9	19,967	
ベネフィットジャパン	1.1	1.2	1,874	
U b i c o mホールディングス	2.3	3.2	5,273	
L I N E	36.2	31.2	168,168	
カナミックネットワーク	2.5	12.7	11,379	
ノムラシステムコーポレーション	1.5	3.5	1,799	
チェンジ	2.2	4.8	25,344	
シンクロ・フード	5.3	6.5	2,379	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
オークネット	6.4	8.6	9,718	
セグエグループ	—	3.3	2,986	
エイトレッド	1.4	2.4	4,754	
AOI TYO Holdings	13.1	14.3	7,221	
マクロミル	21.1	28.1	20,541	
ビーグリー	3.2	2.8	4,379	
オロ	3.2	3.7	10,881	
ユーザーローカル	—	1.4	4,508	
テモナ	—	3.3	2,554	
ニーズウェル	—	3	2,115	
サインポスト	—	3	5,133	
ソルクシーズ	5.2	6.2	4,451	
フェイス	4.9	5.2	3,452	
プロトコルポレーション	5.4	12.4	14,309	
ハイマックス	1.5	1.7	3,371	
野村総合研究所	75.4	192.7	548,809	
サイバネットシステム	10	10.1	6,827	
CEホールディングス	3.6	7.7	3,826	
日本システム技術	2	2.4	3,187	
インテージホールディングス	15.3	17.3	15,051	
東邦システムサイエンス	3.7	3.9	3,494	
ソースネクスト	46.4	65.3	21,418	
インフォコム	13	15	42,105	
HEROZ	—	2	7,890	
ラクスル	—	11	31,966	
F I G	11	15.7	4,286	
システムサポート	—	3.2	6,304	
イーソル	—	6.7	9,849	
アルテリア・ネットワークス	13.3	15.2	30,141	
東海ソフト	—	1.2	1,632	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.8	2.6	2,875	
トピラシステムズ	—	1.8	3,214	
フォーカスシステムズ	8.1	8.7	8,021	
クレスコ	3.7	8.4	13,112	
フジ・メディア・ホールディングス	123.1	131.1	141,850	
オービック	41.1	47.1	879,828	
ジャストシステム	16.9	22.1	163,540	
TDCソフト	10.5	12.2	11,565	
Zホールディングス	773.3	1,866.4	821,216	
トレンドマイクロ	63.2	60.5	358,160	
IDホールディングス	4.7	5.4	8,218	
日本オラクル	24	27.6	347,208	
アルファシステムズ	3.8	4.3	17,028	
フューチャー	16.2	16.6	29,697	
CAC Holdings	8.6	9.1	11,811	
SBテクノロジ	5.1	5	13,965	
トーセ	3.4	4	3,444	
オービックビジネスコンサルタント	12.1	13.9	77,840	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
伊藤忠テクノソリューションズ	54.1	62	225,680	
アイティフォー	14.6	16.8	12,180	
東計電算	1.8	2.1	8,505	
エックスネット	2.4	2.4	2,284	
大塚商会	64.2	73.6	382,720	
サイボウズ	14	16	44,384	
ソフトブレーン	9.7	8.5	4,496	
電通国際情報サービス	7.4	8.5	42,755	
ACCESS	—	13	12,454	
デジタルガレージ	23.1	24.5	93,712	
EMシステムズ	9.7	19.4	16,296	
ウェザーニューズ	4.1	4.7	17,742	
C I J	9.4	9.6	9,081	
ビジネスエンジニアリング	1.3	1.7	4,576	
日本エンタープライズ	13.3	14.8	4,114	
WOWOW	5.8	6.6	16,896	
スカラ	8.4	9.4	6,645	
インテリジェント ウェイブ	4.7	8.3	6,415	
IMAGICA GROUP	10.3	12.3	5,190	
ネットワンシステムズ	42	51.8	168,868	
システムソフト	29.8	32.7	2,746	
アルゴグラフィックス	10.1	11.6	43,094	
マーベラス	18.3	21.1	16,458	
エイベックス	20.5	23.6	22,490	
日本ユニシス	37.1	42.5	141,525	
兼松エレクトロニクス	6.5	7.5	29,775	
東京放送ホールディングス	78.7	82.8	140,180	
日本テレビホールディングス	108.9	113.6	141,318	
朝日放送グループホールディングス	12	13.9	10,216	
テレビ朝日ホールディングス	32.7	37.5	63,450	
スカパーJ SATホールディングス	90.9	90	39,510	
テレビ東京ホールディングス	9.8	11.3	27,707	
日本BS放送	4.2	4.8	5,414	
ビジョン	3.7	13	11,063	
スマートバリュー	3.7	3.8	4,503	
ワイヤレスゲート	5.6	6.9	3,891	
コネクシオ	8.5	7.9	11,707	
クロップス	2.4	2.9	2,061	
日本電信電話	810.6	1,816.3	4,439,037	
KDDI	1,044.4	1,012.6	3,175,513	
ソフトバンク	1,256.6	1,234.9	1,686,873	
光通信	14	14	330,540	
NTTドコモ	750.4	971.6	2,867,677	
エムティーアイ	11.7	13.6	8,173	
GMOインターネット	43.3	53.7	146,493	
ファイバーゲート	—	4.6	6,375	
アイドマーケティングコミュニケーション	2.9	4.6	2,249	
KADOKAWA	34.7	36.7	65,032	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
学研ホールディングス	4	18.4	30,562	
ゼンリン	23.7	27.3	37,237	
昭文社ホールディングス	5.9	7	2,828	
インプレスホールディングス	9.8	11.2	1,702	
アイネット	6.9	7.2	11,066	
松竹	7.9	9	126,900	
東宝	78	80.2	317,592	
東映	5	5.1	74,919	
エヌ・ティ・ティ・データ	315.7	362	450,690	
ビー・シー・エー	1.6	2.4	10,080	
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	2.4	6,376	
D T S	13.3	30.5	69,997	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55.2	58	303,340	
シーイーシー	12.8	14.7	27,489	
カプコン	50.9	64.1	243,900	
アイ・エス・ピー	2.4	2.8	5,966	
ジャステック	7.1	8.9	10,101	
S C S K	31.3	31.4	165,478	
日本システムウエア	4	4.6	10,842	
アイネス	15.2	13.6	19,067	
T K C	10.1	11.5	64,860	
富士ソフト	17.7	17.4	78,996	
NSD	19.5	43.8	73,759	
コナミホールディングス	48.5	49.4	186,979	
福井コンピュータホールディングス	4	5.4	16,956	
J B C Cホールディングス	9.5	9.3	15,205	
ミロク情報サービス	11.8	12.1	30,322	
ソフトバンクグループ	495.2	1,078.1	5,209,379	
卸売業(4.7%)				
ハウスイ	1	1.1	1,013	
高千穂交易	4.6	5.3	5,199	
カワニシホールディングス	—	1.6	2,142	
伊藤忠食品	2.9	3.4	15,946	
エレマテック	11.2	12.8	11,392	
J A L U X	3.4	3.9	7,070	
あらた	8.8	10.9	49,649	
トーメンデバイス	1.8	2.1	7,434	
東京エレクトロン デバイス	4.3	4.9	13,837	
フィールズ	10.4	10.4	3,993	
双日	656.9	753.2	189,053	
アルフレッサ ホールディングス	132.2	151.6	329,426	
横浜冷凍	33.4	35.7	32,772	
神栄	1.6	—	—	
ラサ商事	6.3	7.2	6,501	
ラクーンホールディングス	5.7	—	—	
アルコニックス	12.6	14.5	18,429	
神戸物産	18	47.1	262,818	
ハイパー	—	2.1	1,220	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
あい ホールディングス	17	19.5	28,158	
ディーブイエックス	4.7	4.9	4,581	
ダイワボウホールディングス	10.8	11.6	83,868	
マクニカ・富士エレホールディングス	33	32.5	56,322	
ラクト・ジャパン	5	5.1	19,584	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22.4	25.7	27,396	
八洲電機	9.2	10.6	9,550	
メディアスホールディングス	6.7	7.8	7,651	
レスターホールディングス	13	14.2	29,507	
ジュテックホールディングス	2.7	3.1	3,038	
大光	5	5.8	3,967	
O C H I ホールディングス	3.5	4	5,804	
T O K A I ホールディングス	62.9	72.1	72,532	
黒谷	2.7	3.8	1,869	
C o m i n i x	2.1	2.4	1,804	
三洋貿易	6	13.7	13,152	
ビューティガレージ	1.9	2.2	3,832	
ウイン・パートナーズ	7.7	9.9	10,107	
ミタチ産業	3.6	4.1	2,492	
シップヘルスケアホールディングス	24.8	21.9	102,054	
明治電機工業	3.7	4.3	5,912	
デリカフーズホールディングス	2.1	4.8	3,120	
スターティアホールディングス	2.3	3.1	2,263	
コメダホールディングス	27.5	29.7	55,390	
ビーバードットコム	—	1.4	1,400	
アセンテック	—	1.5	4,680	
富士興産	4.6	4.2	2,150	
協栄産業	1.4	1.5	1,852	
小野建	10.7	12.2	15,786	
南陽	2.4	3	4,440	
佐島電機	8.8	9.3	7,812	
エコートレーディング	2.7	3.2	1,667	
伯東	8.2	8.3	8,183	
コンドーテック	9.2	10.6	11,267	
中山福	6.8	7.9	3,531	
ナガイレーベン	17.2	18.1	48,327	
三菱食品	13.1	15	40,875	
松田産業	8.7	10	14,450	
第一興商	17.7	20.3	76,937	
メディバルホールディングス	128.4	147.2	314,566	
S P K	2.6	5.9	8,324	
萩原電気ホールディングス	4.4	5.1	11,332	
アズワン	8.5	8.9	105,821	
スズデン	4.1	4.7	5,649	
尾家産業	3.8	4	5,960	
シモジマ	7.3	8.4	10,575	
ドウシシャ	11.2	12.9	20,201	
小津産業	2.6	3	5,412	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
高速	7.1	8.1	11,939	
たけびし	4.2	4.8	7,041	
リックス	2.7	3.1	4,727	
丸文	10.5	12.1	5,844	
ハビネット	9.9	11.4	12,209	
橋本総業ホールディングス	2.4	2.8	5,213	
日本ライフライン	37.3	40.4	58,660	
タカショー	5.8	8.9	4,191	
エクセル	2.9	—	—	
マルカ	3.9	4.8	8,856	
I DOM	40	36.8	19,062	
日本エム・ディ・エム	7	—	—	
進和	7	8.1	15,624	
エスケイジャパン	2.9	3	939	
ダイトロン	5.5	5.8	9,831	
シークス	15.1	17.4	18,444	
田中商事	4	4.2	2,910	
オーハシテクニカ	6.7	7.7	12,520	
白銅	3.8	4.9	6,928	
伊藤忠商事	832	953.8	2,203,278	
丸紅	1,172.9	1,419.5	742,824	
高島	1.9	2.2	3,707	
長瀬産業	66.9	76.7	102,624	
蝶理	7.6	8.7	15,842	
豊田通商	132.8	152.2	415,506	
三共生興	20.2	20.7	9,294	
兼松	47.5	50.9	68,053	
ツカモトコーポレーション	2.1	2.4	2,673	
三井物産	979.9	1,180.8	1,931,198	
日本紙パルプ商事	6.8	7.8	30,381	
日立ハイテク	36.2	—	—	
カメイ	15.5	17.8	19,152	
東都水産	1.7	1.7	5,499	
OUGホールディングス	1.9	2.2	5,904	
スターゼン	4.4	5	23,150	
山善	46.5	53.3	49,888	
椿本興業	2.7	2.5	8,162	
住友商事	703.5	860.4	1,116,799	
内田洋行	5.1	5.4	30,456	
三菱商事	834.7	957	2,406,855	
第一実業	5.4	6.7	25,292	
キャノンマーケティングジャパン	34	33.8	74,224	
西華産業	6.7	7.7	9,301	
佐藤商事	10.6	11.3	10,203	
菱洋エレクトロ	12.1	13.8	36,873	
東京産業	11.8	12.4	6,931	
ユアサ商事	12.2	12.9	40,699	
神鋼商事	2.7	3.4	6,630	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
トルク	7.1	8.2	2,476	
阪和興業	20.6	25.5	50,643	
正栄食品工業	8.3	8.8	38,720	
カナデン	10.7	11.1	14,152	
菱電商事	9.4	9.8	13,847	
フルサト工業	6.6	7.5	10,837	
岩谷産業	26.4	30.3	115,140	
ナイス	5	5.8	4,825	
昭光通商	4.2	4.4	2,688	
ニチモウ	1.9	2.1	3,815	
極東貿易	3.7	3.9	5,772	
イワキ	14.2	17.9	8,771	
三愛石油	32	33.6	37,094	
稲畑産業	28.6	30	39,570	
G S I クレオス	3.2	3.4	3,937	
明和産業	11	12.6	6,186	
クワザワ	4.2	4.9	2,572	
ヤマエ久野	—	9.9	12,513	
ワキタ	25.4	29.1	30,031	
東邦ホールディングス	35.2	43.8	94,213	
サンゲツ	35.4	37.2	59,334	
ミツウロコグループホールディングス	15.7	20.1	24,200	
シナネンホールディングス	4.9	5.6	15,288	
伊藤忠エネクス	26.3	30.2	26,032	
サンリオ	36.7	38.3	69,169	
サンワテクノス	7.2	9.7	8,633	
リョーサン	13.1	15.1	36,844	
新光商事	11.2	21.4	19,388	
トーホー	5.4	6.2	11,742	
三信電気	8.2	7.3	12,074	
東陽テクニカ	13.7	14.6	15,271	
モスフードサービス	15.6	17.9	53,700	
加賀電子	11.8	13.6	31,756	
ソーダニッカ	12.2	14.1	7,402	
立花エレテック	8.8	10.1	17,856	
フォーバル	5.2	6	7,002	
PAL TAC	21.4	21.9	115,632	
三谷産業	13.9	18	7,038	
西本Wismettacホールディングス	2.7	2.5	4,797	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1	1.2	2,326	
国際紙パルプ商事	27.7	32.4	9,201	
ヤマタネ	6	6.8	8,384	
丸紅建材リース	1.2	1.3	2,024	
日鉄物産	8.5	9.7	36,181	
泉州電業	4	4.2	11,310	
トラスコ中山	24.8	28.4	70,545	
オートバックスセブン	47.3	50.6	66,893	
モリト	8.6	10	6,810	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
加藤産業	18.6	19.7	74,269	
北恵	2.3	3.5	3,192	
イノテック	7.1	7.1	7,902	
イエローハット	22.5	25.8	39,628	
J Kホールディングス	10.7	12.3	10,553	
日伝	9.9	12.3	28,154	
北沢産業	9	10.3	2,853	
杉本商事	6.4	7.4	13,712	
因幡電機産業	16.9	38.8	95,409	
東テク	3.9	4.5	10,053	
ミスミグループ本社	149	170.9	489,115	
アルテック	8.8	10.9	2,572	
タキヒヨー	3.6	4.1	7,027	
蔵王産業	2	2.6	3,775	
スズケン	54.3	57.8	226,287	
ジェコス	8.2	9.4	9,353	
グローセル	10.9	13.7	5,959	
小売業(4.9%)				
ローソン	30.1	34.5	205,620	
サンエー	9	11.4	48,963	
カワチ薬品	9.3	10.6	27,899	
エービーシー・マート	18.6	21.3	139,515	
ハードオフコーポレーション	4.9	5.7	4,172	
アスクル	12.5	14.3	46,475	
ゲオホールディングス	18.2	24.7	33,295	
アダストリア	16.5	19	33,326	
ジーフット	7.3	8.2	3,927	
くら寿司	7	7.2	35,424	
キャンドウ	5.7	6.6	12,421	
パルグループホールディングス	6.1	14.1	19,542	
エディオン	50.5	62.8	62,800	
サウラコーポレーション	24.4	28	16,016	
ワッツ	5.4	6.3	4,788	
ハローズ	4.5	5.2	16,120	
フジオフードシステム	5	11.6	19,360	
あみやき亭	2.6	3	9,510	
ひらまつ	23.9	25.1	5,095	
大黒天物産	2.9	3.3	13,299	
ハニーズホールディングス	10.6	12.2	15,103	
ファーマライズホールディングス	3	3.6	2,386	
アルベン	9.2	10.6	18,687	
ハブ	3.9	4.2	3,095	
クオールホールディングス	17.6	20.2	26,037	
ジンズホールディングス	6.3	7.2	49,176	
ビックカメラ	70.7	81.1	92,048	
DCMホールディングス	64.3	75.7	84,784	
ペッパーフードサービス	9.5	—	—	
MonotaRO	75.2	97	379,755	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
東京一番フーズ	3.2	3.9	2,024	
DDホールディングス	2.6	5.4	5,589	
きちりホールディングス	3.3	3.9	2,613	
アークランドサービスホールディングス	8.8	10.1	19,321	
J. フロント リテイリング	152.3	163.1	149,236	
ドール・日レスホールディングス	20.9	19.7	36,208	
マツモトキヨシホールディングス	49.2	56.4	227,574	
ブロンコビリー	6.3	7.2	17,496	
Z O Z O	128.6	93.9	186,297	
トレジャー・ファクトリー	3.6	4.3	3,160	
物語コーポレーション	2.9	3.7	29,045	
ココカラファイン	13.4	14.3	77,792	
三越伊勢丹ホールディングス	222.7	238.7	172,102	
H a m e e	3.8	5	6,420	
ウエルシアホールディングス	31.5	40.6	367,430	
クリエイトSDホールディングス	17.6	23	78,430	
丸善CH Iホールディングス	13.8	15.9	6,105	
ティーライフ	1.7	2.2	2,552	
エー・ビーカンパニー	2.5	—	—	
チムニー	3.7	4.3	7,761	
シュッピン	8.2	9.5	7,818	
オイシックス・ラ・大地	—	13.5	31,104	
ネクステージ	18.6	19.8	17,701	
ジョイフル本田	34.9	40.1	53,934	
鳥貴族	4	4.1	7,683	
キリン堂ホールディングス	4.8	5.5	12,078	
ホットランド	6.3	9.3	11,559	
すかいらーくホールディングス	110.9	152.9	267,116	
S F Pホールディングス	5.1	7.9	13,335	
綿半ホールディングス	4.5	5.2	9,770	
ヨシックス	2	2.3	5,694	
ユナイテッド・スーパーマー ケット・ホールディングス	34.7	39.8	44,894	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	6.6	3,907	
BEENOS	4.2	6.5	7,013	
あさひ	9.9	10.3	15,965	
日本調剤	4.2	8.4	14,523	
コスモス薬品	5.3	12.1	187,187	
トーエル	5.9	6.9	4,954	
オンリー	2.2	2.7	1,630	
セブン&アイ・ホールディングス	498.6	533.5	1,967,014	
薬王堂	5.2	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32.1	73.5	61,152	
ツルハホールディングス	25.9	29.7	472,824	
サンマルクホールディングス	9.4	10.9	20,383	
フェリシモ	2.8	3.2	3,376	
トリドールホールディングス	14.7	33.9	41,391	
T O K Y O B A S E	10.8	12.9	4,579	
ウィルプラスホールディングス	2	2	1,494	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
J Mホールディングス	6.1	10.4	28,558	
サツドラホールディングス	1.8	2.1	4,244	
デファクトスタンダード	0.9	—	—	
アレザホールディングス	6.6	7.1	6,184	
串カツ田中ホールディングス	—	2.9	5,109	
パロックジャパンリミテッド	9.8	9.8	6,370	
クスリのアオキホールディングス	11.8	12.2	108,580	
力の源ホールディングス	4.6	6.5	5,044	
スシローグローバルホールディングス	13.1	74.9	170,772	
L I X I L ビバ	10.2	13.5	32,575	
メディカルシステムネットワーク	12.8	13.6	6,405	
はるやまホールディングス	5.7	6.7	4,991	
ノジマ	21.2	24.3	60,968	
カップ・クリエイト	16.7	19.1	28,917	
ライトオン	9	10.2	5,610	
良品計画	16.9	181.2	295,174	
三城ホールディングス	15	15.2	4,620	
アドヴァン	18.3	21	25,410	
アルビス	4.6	5.3	11,267	
コナカ	14.2	16.7	5,494	
ハウス オブ ローゼ	1.5	1.8	2,896	
G-7ホールディングス	3.5	8.1	19,083	
イオン北海道	12.1	18.2	14,232	
コジマ	20.6	23.9	11,878	
ヒマラヤ	4.3	5	4,105	
コーナン商事	15.7	19.5	61,327	
エコス	4.5	5.1	9,715	
ワタミ	15.7	16.3	17,147	
マルシェ	3.3	3.9	2,519	
バン・バシフィック・インター ナショナルホールディングス	71.2	299.8	650,865	
西松屋チェーン	26.2	30.1	27,812	
ゼンショーホールディングス	56.2	65.4	150,093	
幸楽苑ホールディングス	7.6	8.8	15,716	
ハークスレイ	2.6	3	3,000	
サイゼリヤ	19.7	20.3	46,568	
V Tホールディングス	54	57.1	21,812	
魚力	3.4	3.9	6,165	
フジ・コーポレーション	3.2	3.7	7,429	
ユナイテッドアローズ	13.6	14.4	26,654	
ハイデイ日高	17.2	19.8	37,818	
京都きもの友禅	7.9	9.5	2,251	
コロワイド	39.6	45.3	73,023	
ビーンデポコーポレーション	16	18.4	11,592	
老番屋	8.4	9.6	53,568	
P L A N T	3.2	3.8	2,276	
スギホールディングス	26.1	27.3	190,008	
薬王堂ホールディングス	—	6	16,152	
スクロール	18.6	21.5	8,019	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ヨンドシーホールディングス	13.3	14	27,510	
ファミリーマート	133.1	109	220,071	
木曽路	14.6	17.9	45,466	
S R Sホールディングス	14.1	16.3	15,028	
タカキュー	9.8	12	1,692	
リテールパートナーズ	—	18.2	28,901	
ケーヨー	22.2	28.3	18,310	
上新電機	14.1	16.1	35,919	
日本瓦斯	19.4	21.6	92,340	
ロイヤルホールディングス	20.8	23.9	47,226	
いなげや	13.4	17	28,696	
島忠	25.2	25.7	75,223	
チヨダ	12.6	14.5	15,283	
ライフコーポレーション	9.1	10.4	35,100	
リンガーハット	14.7	16.9	41,252	
M r M a x H D	16.5	19.2	8,467	
テンアライド	10.9	12.6	4,901	
A O K Iホールディングス	23.9	27.6	18,988	
オークワ	17.1	21.5	32,766	
コメリ	18.4	21.1	56,083	
青山商事	20.8	28.4	23,316	
しまむら	13.9	15.9	120,522	
はせがわ	6.6	7.7	2,664	
高島屋	93.4	99.5	102,982	
松屋	24.1	27.7	18,946	
エイチ・ツー・オー リテイリング	61.2	64.8	54,691	
近鉄百貨店	4.6	5.3	17,092	
パルコ	11.5	—	—	
丸井グループ	100.7	125.1	243,069	
アクシアル リテイリング	9.9	11.4	47,025	
イオン	457.8	524.8	1,250,860	
イズミ	24.2	27.8	94,103	
平和堂	24.2	27.8	53,820	
フジ	14.4	16.5	31,069	
ヤオコー	13.5	15.5	109,275	
ゼビオホールディングス	14.5	16.7	15,581	
ケーズホールディングス	123.7	131.7	181,746	
O l y m p i c グループ	7.2	7.3	5,015	
日産東京販売ホールディングス	17.9	21	4,893	
シルバーライフ	—	1.9	4,516	
一家ダイニングプロジェクト	—	1.4	931	
Genky DrugStores	5.9	6.1	17,330	
ナルミヤ・インターナショナル	—	3.3	2,590	
総合メディカルホールディングス	10.4	—	—	
ブックオフグループホールディングス	6.2	7.9	6,888	
アインホールディングス	16	16.8	116,928	
元気寿司	3.4	3.5	8,459	
ヤマダ電機	362.6	415.9	217,931	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アークランドサカモト	20.3	21.5	25,585	
ニトリホールディングス	51.5	59	1,152,565	
グルメ杵屋	8.6	9.9	10,226	
愛眼	9.4	10.9	2,376	
ケユーホールディングス	6.3	7.4	6,208	
吉野家ホールディングス	41.6	44.9	110,947	
松屋フーズホールディングス	5.8	6.6	26,103	
サガミホールディングス	16	18.4	23,809	
関西スーパーマーケット	9.1	11.5	12,949	
王将フードサービス	8.7	10	62,800	
ブレナス	13.4	15.4	28,875	
ミニストップ	8.9	10.2	15,453	
アークス	22.4	28	61,040	
パローホールディングス	25.7	30.3	64,084	
ベルク	5.9	6.8	45,152	
大庄	6.4	7.4	10,434	
ファーストリテイリング	15.9	18.2	1,101,646	
サンドラッグ	44.8	51.4	186,582	
サックスパー ホールディングス	10.2	11.9	6,592	
ヤマザワ	2.5	3.3	5,662	
やまや	2.1	2.9	6,498	
ペルーナ	29.2	29.7	16,067	
銀行業(5.1%)				
島根銀行	3.8	3.6	1,868	
じもとホールディングス	80.1	92.3	8,860	
めぶきフィナンシャルグループ	622	709.6	173,142	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16.6	18.4	19,908	
九州フィナンシャルグループ	197.4	298.8	136,850	
ゆうちょ銀行	338.2	386.9	344,341	
富山第一銀行	30.8	32.6	8,704	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	749.2	780	274,560	
西日本フィナンシャルホールディングス	76	90.9	67,447	
関西みらいフィナンシャルグループ	57.1	80.1	31,239	
三十三フィナンシャルグループ	10.9	12.7	19,583	
第四北越フィナンシャルグループ	21	23.7	53,609	
新生銀行	87.4	100.2	137,775	
あおぞら銀行	66.5	81.4	162,962	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,199.5	9,341.8	4,149,627	
りそなホールディングス	1,307.1	1,498.6	581,157	
三井住友トラスト・ホールディングス	234.1	258.1	818,435	
三井住友フィナンシャルグループ	839.5	944.5	2,945,895	
千葉銀行	411.3	455.7	233,318	
群馬銀行	240.4	262.3	88,395	
武蔵野銀行	18.1	20.3	30,795	
千葉興業銀行	36.4	37.4	9,387	
筑波銀行	49.3	56.8	10,508	
七十七銀行	37.9	46.1	70,855	
青森銀行	9.5	10.6	23,139	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
秋田銀行	8	8.8	13,666	
山形銀行	13.9	15.3	20,578	
岩手銀行	8.6	8.9	22,107	
東邦銀行	106.5	122.1	28,815	
東北銀行	6.1	6.5	6,136	
みちのく銀行	7.6	8.8	10,630	
ふくおかフィナンシャルグループ	105.3	115	201,595	
静岡銀行	300.8	338.2	232,005	
十六銀行	16.4	17.1	35,892	
スルガ銀行	—	139.7	54,622	
八十二銀行	289.3	329.6	131,180	
山梨中央銀行	15	15.9	14,771	
大垣共立銀行	25.4	27	61,398	
福井銀行	10.7	11.7	19,351	
北國銀行	12.5	13.6	37,576	
清水銀行	5.4	5.6	10,371	
富山銀行	2.6	2.6	5,917	
滋賀銀行	24.2	27.4	68,691	
南都銀行	19	22.7	51,097	
百五銀行	109.7	122.9	39,205	
京都銀行	42.9	48.9	189,243	
紀陽銀行	42.7	48.4	80,924	
ほくほくフィナンシャルグループ	80	90.9	82,537	
広島銀行	177.3	201.6	101,808	
山陰合同銀行	71.8	81	43,011	
中国銀行	103.3	117.5	113,740	
鳥取銀行	4.7	4.7	5,851	
伊予銀行	159.3	194.9	118,694	
百十四銀行	13	14.5	28,492	
四国銀行	17.8	20.7	17,139	
阿波銀行	18.5	22.3	55,170	
大分銀行	7.6	7.9	19,947	
宮崎銀行	8.3	9.1	21,284	
佐賀銀行	7.7	8.3	9,254	
沖縄銀行	11.1	12.5	41,375	
琉球銀行	28.2	31.5	30,555	
セブン銀行	405.3	456.2	140,053	
みずほフィナンシャルグループ	16,185.5	18,556.6	2,495,862	
高知銀行	4.3	5	3,635	
山ロフィナンシャルグループ	149.7	170.5	109,802	
長野銀行	4.5	4.5	5,197	
名古屋銀行	9.9	10.2	24,072	
北洋銀行	182.9	205.9	41,797	
愛知銀行	4.5	4.9	14,798	
中京銀行	5.3	5.6	11,978	
大光銀行	4.6	4.7	7,214	
愛媛銀行	17.4	19.1	22,767	
トマト銀行	5.5	5.3	5,543	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
京葉銀行	54	58.2	30,147	
栃木銀行	66.3	66	10,956	
北日本銀行	4.2	4.3	8,496	
東和銀行	20.8	24	16,992	
福島銀行	7.3	12.9	2,347	
大東銀行	5.7	7.1	4,842	
トモニホールディングス	94.4	105.6	36,643	
フィデアホールディングス	115.1	132.6	14,188	
池田泉州ホールディングス	130.4	157	26,533	
証券・商品先物取引業(0.8%)				
F P G	37.5	42.4	25,779	
マーキュリアインベストメント	4.7	6.4	3,596	
S B I ホールディングス	142	152.6	352,353	
ジャフコ	19.6	21	76,020	
大和証券グループ本社	956	1,096.2	489,672	
野村ホールディングス	2,096.2	2,403.3	1,112,487	
岡三証券グループ	101.8	116.9	40,915	
丸三証券	35.6	41	18,655	
東洋証券	43.3	50.2	6,726	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142.4	157.5	39,690	
光世証券	3	3.6	1,879	
水戸証券	34.9	40.4	8,322	
いちよし証券	25	25.9	11,888	
松井証券	58.4	78.2	66,235	
だいこう証券ビジネス	5.1	6.8	6,242	
マネックスグループ	110.2	101	24,240	
カブドットコム証券	86.9	—	—	
極東証券	16.1	18.7	9,854	
岩井コスモホールディングス	12.3	13.1	12,903	
藍澤證券	21.6	24.8	17,211	
マネーパートナーズグループ	14.3	15.4	3,280	
スパークス・グループ	47.4	63.9	14,185	
保険業(2.1%)				
かんぽ生命保険	45	48.4	66,211	
SOMPOホールディングス	210	256.8	984,057	
アニコム ホールディングス	9.8	11.3	60,116	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	311.4	357.1	1,130,221	
ソニーフィナンシャルホールディングス	97.9	112.2	291,271	
第一生命ホールディングス	673.9	772.8	1,084,238	
東京海上ホールディングス	425.9	482.8	2,253,710	
T & Dホールディングス	368.4	408.2	397,178	
アドバンスクリエイト	2.8	2.8	6,412	
その他金融業(1.1%)				
全国保証	33.6	38.5	159,582	
ジェイリース	3.3	3.8	1,554	
イントラスト	3.3	4.8	3,571	
日本モーゲージサービス	2.1	2.8	5,602	
C a s a	5.4	4.8	6,000	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
アルヒ	10.8	21.7	32,419	
プレミアグループ	6.8	7.4	14,467	
クレディセゾン	83.4	95.7	122,783	
芙蓉総合リース	13.6	14.3	88,374	
みずほリース	22.4	21.1	50,133	
東京センチュリー	24	27.5	128,837	
日本証券金融	52.5	60.2	30,401	
アイフル	181.7	208.3	55,616	
リコーリース	9.4	10.7	33,544	
イオンフィナンシャルサービス	76.1	83.6	101,406	
アコム	239.4	274.5	120,505	
ジャックス	13.2	15.1	28,508	
オリエントコーポレーション	322.2	369.4	47,283	
日立キャピタル	28.1	32.2	73,222	
アプラスフィナンシャル	56.9	65.5	4,519	
オリックス	794.7	854.1	1,220,508	
三菱UFJリース	268.7	346.6	182,311	
九州リースサービス	5.8	6.7	3,283	
日本取引所グループ	321.8	392	908,264	
イー・ギャランティ	11.2	14.6	31,886	
アサックス	4.9	7.1	4,529	
NECキャピタルソリューション	4.8	5.6	11,379	
不動産業(2.1%)				
いちご	155.2	180.3	55,352	
日本駐車場開発	138	149.1	21,023	
スター・マイカ・ホールディングス	—	8.3	12,433	
ADワークスグループ	—	25.3	4,705	
ヒューリック	250	293.5	319,915	
三栄建築設計	5.6	7.1	8,548	
スター・マイカ	6.4	—	—	
野村不動産ホールディングス	79.9	83.9	167,296	
三重交通グループホールディングス	26.2	31.7	15,120	
サムティ	17.4	20.8	30,534	
ディア・ライフ	18.3	23.6	11,210	
コーセーアールイー	5.2	—	—	
エー・ディー・ワークス	115	—	—	
日本商業開発	8.3	10	15,280	
プレサンスコーポレーション	19.8	—	—	
ユニゾホールディングス	18.7	—	—	
ハウスコム	—	3.8	5,099	
日本管理センター	9	10.7	12,936	
サンセイラニディック	4.9	6.4	5,574	
エストラスト	1.2	—	—	
フージャースホールディングス	21.2	27.2	16,755	
オープンハウス	17.5	40.4	120,311	
東急不動産ホールディングス	322.4	375	204,750	
飯田グループホールディングス	100.1	115.2	184,320	
イーグランド	3.6	5.1	3,386	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ムゲンエステート	10.5	13.2	7,048	
ファーストブラザーズ	4.4	—	—	
ハウストゥ	6.6	6.7	6,880	
シーアールイー	4.2	4.9	5,782	
ケイアイスター不動産	4.1	—	—	
グッドコムアセット	3.6	4.5	7,429	
ジェイ・エス・ビー	0.9	3.7	8,757	
テンポイノベーション	2.2	5.6	4,060	
パーク24	70.2	74.3	155,361	
バラカ	3.7	4.7	8,460	
三井不動産	632.4	674.5	1,398,575	
三菱地所	835.1	958	1,641,054	
平和不動産	23.1	25.7	75,686	
東京建物	131.2	145.3	201,821	
ダイビル	36.4	37.1	38,955	
京阪神ビルディング	22.4	23.3	34,833	
住友不動産	268.1	307.7	918,330	
テオーシー	29.2	29.7	20,790	
東京楽天地	2	2.7	12,258	
スターツコーポレーション	16.7	19.5	42,724	
フジ住宅	16.8	19.5	10,276	
空港施設	16.4	18.1	7,927	
明和地所	8.9	11.9	5,081	
ゴールドクレスト	10.1	12	18,936	
エスリード	5.5	6.7	10,150	
日神グループホールディングス	20.4	25	10,275	
日本エスコン	23.4	24.7	19,932	
タカラレーベン	57.8	62.4	23,400	
AVANTIA	8.1	10.3	8,075	
イオンモール	60.5	69.8	105,747	
毎日コムネット	4.2	5.8	4,843	
ファースト住建	5.5	7.9	7,260	
カチタス	13.6	34.7	83,453	
トーセイ	17.8	20.7	22,169	
穴吹興産	1.7	4.2	7,303	
サンフロンティア不動産	17.7	21.1	19,876	
エフ・ジェー・ネクス	11.7	14.2	12,538	
インテリックス	5.1	3.8	1,987	
ランドビジネス	5	4.6	1,614	
日本社宅サービス	—	6	6,636	
グランディハウス	13.2	15.6	6,162	
日本空港ビルデング	38.3	44	208,560	
サービス業(5.4%)				
日本工営	7.8	8.9	29,325	
LIFULL	40.5	46.5	19,762	
ジェイエシールクルートメント	9.3	9	12,429	
日本M&Aセンター	86.1	100	433,000	
メンバーズ	3.9	4	7,320	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
中広	1.5	2.1	1,117	
UTグループ	—	20.9	42,218	
アイティメディア	2.6	5.4	5,740	
タケエイ	12.1	12.8	12,377	
E・Jホールディングス	1.6	2.4	3,748	
ビーネックスグループ	6.4	16.7	13,677	
コンダカホールディングス	27.9	32.1	17,237	
アルトナー	3	3.4	2,611	
パソナグループ	14.2	14.4	18,432	
CDS	3	3.4	4,508	
リンクアンドモチベーション	21.4	29.5	13,393	
GCA	11.8	16.2	10,627	
エス・エム・エス	42.5	41.2	110,292	
サニーサイドアップグループ	1.3	4.7	3,896	
パソルホールディングス	115.4	132.4	188,670	
リニカル	6.6	6.5	6,175	
クックパッド	36.5	46.6	14,632	
エスクリ	3.3	4.4	1,971	
アイ・ケイ・ケイ	5.8	6.7	4,073	
学情	4.8	4.8	6,393	
スタジオアリス	5.9	6.7	10,974	
シミックホールディングス	6.5	6.6	10,071	
エプコ	—	2.9	3,352	
NJS	2.6	3	5,364	
総合警備保障	45.9	52.7	279,310	
カカコム	86.5	97.8	254,866	
アイロムグループ	4.4	4.7	10,753	
セントケア・ホールディング	8.7	8.9	3,835	
サイネックス	2.2	2.4	1,596	
ルネサンス	6.5	7.5	8,820	
ディップ	18.7	18.7	47,591	
オプトホールディング	7.2	7.3	11,161	
ツクイ	27.5	31.4	15,794	
キャリアデザインセンター	3	3.2	3,145	
ベネフィット・ワン	32	48.2	113,462	
エムスリー	243	291.8	1,266,412	
ツカダ・グローバルホールディング	7.6	8.7	3,654	
プラス	1.5	1.9	1,069	
アウトソーシング	61	75.9	48,044	
ウェルネット	11.1	13.5	9,639	
ワールドホールディングス	3.3	4.6	8,303	
ディー・エヌ・エー	62.3	64.9	96,052	
博報堂DYホールディングス	160.5	184.1	246,509	
ぐるなび	16.6	23.2	15,288	
タカミヤ	12.1	14.3	7,150	
ジャパンベストレスキューシステム	7.8	10.4	9,120	
ファンコミュニケーションズ	31.9	36.7	17,469	
ライク	4.7	4.4	7,066	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ビジネス・ブレイクスルー	5.2	5.9	2,236	
エスブルー	—	34.1	25,745	
WDBホールディングス	5.3	6.1	16,463	
時間いらず	—	0.9	4,279	
ティア	6.9	8	4,296	
CDG	1.2	1.5	2,320	
バリューコマース	7.8	7.5	20,205	
インフオマート	63.3	145.1	131,170	
J Pホールディングス	33.3	42	11,886	
エコナックホールディングス	21.9	25.2	2,520	
E P Sホールディングス	17.4	18	19,944	
レッグス	3	3.4	3,532	
プレステージ・インターナショナル	21.7	49.7	47,314	
アミューズ	7	7.3	17,541	
ドリームインキュベータ	3.6	4.1	6,338	
クイック	7.2	8.3	10,391	
T A C	7	8.7	1,609	
ケネディクス	101.6	123.5	72,371	
電通グループ	140.6	136.4	393,514	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.5	5.2	3,536	
びあ	3.3	3.8	14,421	
イオンファンタジー	3.8	5.2	9,906	
シーティーエス	13.2	15.1	10,690	
ネクシィーズグループ	4.1	4.2	4,548	
みらかホールディングス	32.3	37.1	92,972	
アルプス技研	10.2	11.8	22,939	
ダイオーズ	2.8	2.7	3,061	
日本空調サービス	13.2	14	10,164	
オリエンタルランド	136.4	140.7	2,197,030	
ダスキン	29.7	32.9	97,055	
明光ネットワークジャパン	13.7	16.9	14,534	
ファルコホールディングス	6.4	7.4	12,321	
ラウンドワン	35.9	37.1	34,020	
リゾートトラスト	48.9	60.7	82,066	
ビー・エム・エル	14.9	17.1	51,898	
ワタベウェディング	2.1	2.5	1,070	
りらいあコミュニケーションズ	21	24	29,400	
リソー教育	58.9	60.9	18,574	
早稲田アカデミー	3.5	5.9	5,782	
ユー・エス・エス	141	148.2	278,319	
東京個別指導学院	4.2	4.9	2,979	
サイバーエージェント	66.4	81.5	442,545	
楽天	538	616.8	601,996	
クリーク・アンド・リバー社	6.9	7	7,420	
テー・オー・ダブリュー	10.2	21.4	7,597	
山田コンサルティンググループ	5.7	8.7	11,449	
セントラルスポーツ	4.3	5	13,000	
フルキャストホールディングス	11.6	13.3	21,027	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エン・ジャパン	16.8	23.6	68,581	
リソルホールディングス	1.3	1.5	5,385	
テクノプロ・ホールディングス	23.2	26.4	170,280	
アトラ	2.8	3.5	941	
インターワークス	2.4	2.9	1,142	
アイ・アールジャパンホールディングス	4.7	5.4	51,570	
Keeper 技研	4.3	5	8,205	
ファーストロジック	2.9	2.8	1,713	
三機サービス	2.5	2.7	2,986	
G u n o s y	8.1	8.4	7,778	
デザインワン・ジャパン	2.7	4.4	1,174	
イー・ガーディアン	5.9	5.9	15,015	
リブセンス	6.9	9	2,529	
ジャパンマテリアル	31.7	40.8	71,563	
ベクトル	14.2	16.6	14,159	
ウチヤマホールディングス	5.9	6.9	2,608	
チャーム・ケア・コーポレーション	3.8	11.4	10,225	
ライクキッズ	2.9	2.4	1,773	
キャリアリンク	4.6	4.6	2,640	
I B J	7.9	9.2	7,746	
アサンテ	4.7	5.4	8,310	
N・フィールド	7.6	9.3	4,975	
バリューHR	2.5	5.3	7,753	
M&Aキャピタルパートナーズ	4.1	10.8	43,254	
ライドオンエクспレスホールディングス	4.9	5.1	8,670	
E R I ホールディングス	3.4	3.9	2,624	
アビスト	1.8	2.1	5,142	
シグマクシス	5.6	9.1	17,371	
ウィルグループ	7.7	8.8	6,406	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16.3	18.9	3,855	
日本ビューホテル	3.8	—	—	
リクルートホールディングス	826.7	947.9	3,516,709	
エラン	8	7.9	14,212	
土木管理総合試験所	5.3	6.1	2,360	
ネットマーケティング	—	5.3	3,614	
日本郵政	946	1,084.6	850,434	
ベルシステム24ホールディングス	19.4	22.3	30,261	
鎌倉新書	8.5	10.1	12,089	
SMN	1.6	3	2,739	
一蔵	1.5	1.8	770	
L I T A L I C O	2.7	4.6	12,939	
グローバルキッズCOMPANY	1.9	2.6	1,622	
エアトリ	5	6.9	8,659	
アトラエ	3	4	12,860	
ストライク	4.4	5	24,000	
ソラスト	28.4	36.6	45,676	
セラク	3.8	4.3	4,205	
インソース	4.5	5.5	15,994	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ベイカレント・コンサルティング	8.2	8	60,560	
Orchestra Holdings	2.1	2.9	3,735	
アイモバイル	3.8	4.9	3,660	
キャリアインデックス	4.1	5.8	1,943	
MS-Japan	4.8	4.4	3,964	
船場	2	2.3	2,219	
グレイステクノロジー	4.2	6.1	26,443	
ジャパンエレベーター	9.1	14	46,550	
サービスホールディングス				
フルテック	1.7	2	2,612	
グリーンズ	4.4	3.6	1,983	
ツナググループ・ホールディングス	1.6	2.5	1,190	
GameWith	—	4.1	2,730	
ソウルドアウト	1.2	2.8	6,210	
MS&Consulting	2	2.7	1,746	
ミダック	—	1.8	2,959	
日総工産	7.7	9	6,345	
キュービーネットホールディングス	7	5.5	11,792	
RPAホールディングス	2.3	10.2	9,353	
スプリックス	3.9	3.9	3,494	
マネジメントソリューションズ	—	5.9	6,372	
プロレド・パートナーズ	—	1.8	9,432	
and factory	—	1.4	1,759	
ギークス	—	1.5	2,040	
カープスホールディングス	—	36.5	24,126	
フォーラムエンジニアリング	—	7	6,426	
アドバンテッジリスクマネジメント	4.7	6.8	6,140	
リログループ	63.1	72.4	178,176	
東祥	7.2	8.3	11,769	
エイチ・アイ・エス	20.6	20.6	40,726	
ラックランド	2.4	3.1	6,513	
共立メンテナンス	17.7	22	75,680	
イチネンホールディングス	12.1	14.9	18,222	
建設技術研究所	8.1	9.2	16,173	
スペース	7.6	8.7	8,813	
長大	4.8	5.4	5,562	
燦ホールディングス	2.6	5.9	6,962	
スバル興業	0.8	0.8	6,296	
東京テアトル	4.6	5.3	6,752	
タナベ経営	2.3	2.6	3,335	
ナガワ	3.2	4.2	33,600	
よみうりランド	2.5	2.9	10,875	
東京都競馬	7.6	8.7	30,841	
カナモト	17.3	21.7	50,387	
東京ドーム	43.3	53.7	48,330	
西尾レントオール	11.8	12.3	29,151	
トランス・コスモス	12.9	12.6	31,941	
乃村工藝社	54	56.8	55,436	
藤田観光	4.6	5.8	10,950	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
KNT-CTホールディングス	6.1	8.2	9,913	
日本管財	12.4	14.2	26,341	
トーカイ	11.2	12.8	35,212	
白洋舎	1.4	1.6	4,608	
セコム	122.5	140.4	1,310,493	
セントラル警備保障	5.6	6.4	29,024	
丹青社	21.9	25.2	18,975	
メイテック	14.3	16.2	84,240	
応用地質	12.5	14.3	19,204	
船井総研ホールディングス	23.9	27.4	69,459	
進学会ホールディングス	5.5	5.4	2,786	
オオバ	9.2	9.6	6,297	
いであ	2.4	3.3	5,857	
学究社	3.9	4	4,520	
ベネッセホールディングス	42.3	44.1	128,639	
イオンディライト	14.3	16.3	50,285	
ナック	7.4	7.5	6,945	
ニチイ学館	16.5	18.9	30,901	
ダイセキ	19.4	22.2	62,359	
ステップ	4.3	4.9	7,154	
合 計	株 数・金 額	140,334	162,264	304,033,610
	銘柄数<比率>	2,078	2,102	<97.0%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<国内新株予約権証券>

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	評 価 (千円)	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	5,440	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	304,033,610	96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,854,107	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	313,887,717	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年5月29日現在
(A)資 産	314,236,713,295円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,890,233,378
株 式(評価額)	304,033,610,080
未 収 入 金	3,121,635,512
未 収 配 当 金	3,191,234,325
(B)負 債	788,647,808
前 受 金	362,427,200
未 払 金	72,987,000
未 払 解 約 金	353,225,006
未 払 利 息	8,602
(C)純 資 産 総 額(A-B)	313,448,065,487
元 本	212,335,378,830
次 期 繰 越 損 益 金	101,112,686,657
(D)受 益 権 総 口 数	212,335,378,830口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,762円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配 当 等 収 益	7,604,285,657円
受 取 配 当 金	7,602,413,988
受 取 利 息	9,261
そ の 他 収 益 金	3,857,899
支 払 利 息	△1,995,491
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	8,380,434,231
売 買 益	32,786,368,842
売 買 損	△24,405,934,611
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	494,851,340
取 引 益	1,325,902,390
取 引 損	△831,051,050
(D)そ の 他 費 用	△2,167
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	16,479,569,061
(F)前 期 繰 越 損 益 金	79,635,221,720
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	22,559,756,391
(H)解 約 差 損 益 金	△17,561,860,515
(I)計 (E+F+G+H)	101,112,686,657
次 期 繰 越 損 益 金(I)	101,112,686,657

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は192,648,275,463円、期中追加設定元本額は57,404,489,163円、期中一部解約元本額は37,717,385,796円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信 託 期 間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運 用 方 針	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 国内債券 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券 を主要投資対象とします。
	国内債券 インデックス マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象 とします。
組 入 制 限	FOFs用 国内債券 インデックス・ファンドP (適格機関投資家専用)	外貨建資産への投資は行いま せん。
	国内債券 インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資は、行いま せん。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用 国内債券インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第26期 (決算日 2020年 9月7日)
第27期 (決算日 2020年11月9日)
第28期 (決算日 2021年 1月7日)

受益者のみなさまへ

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

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6		円	円	%		%	%	%	百万円
	第14期(2018年 9月7日)	9,958	9	△0.9	10,144	△0.9	99.5	0.1	73,316
	第15期(2018年11月7日)	9,932	9	△0.2	10,129	△0.2	99.7	—	85,662
第7	第16期(2019年 1月7日)	10,061	9	1.4	10,271	1.4	99.7	—	94,983
	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28期(2021年 1月7日)	9,986	7	△0.1	10,329	△0.1	99.8	—	106,985

(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。

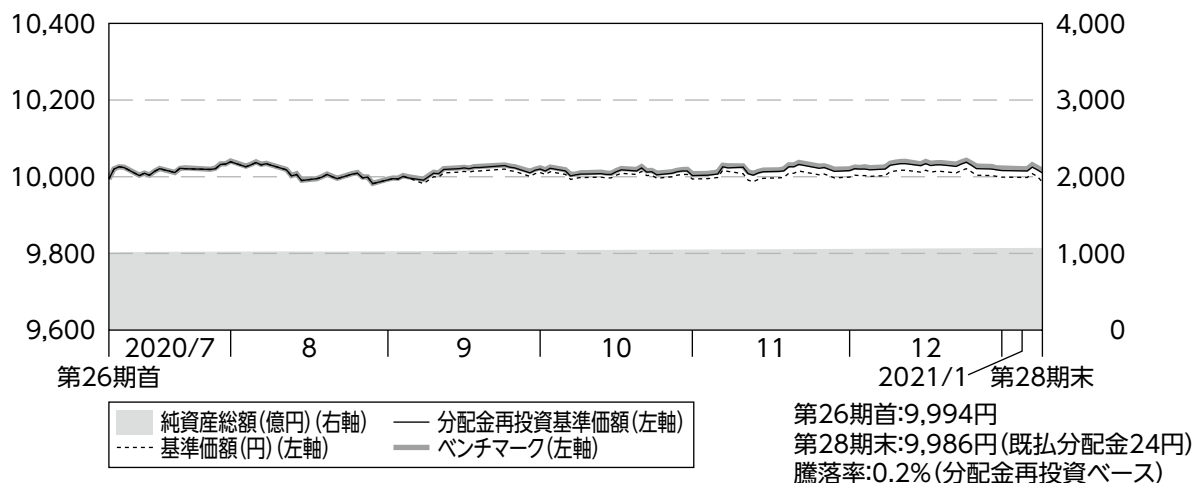
当作成期中の基準価額と市況の推移

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26期	(期 首)2020年 7月7日	円 9,994	% —	10,306	% —	% 99.7	% 0.0
	7月末	10,039	0.5	10,354	0.5	99.7	—
	8月末	9,992	△0.0	10,305	△0.0	99.7	—
	(期 末)2020年 9月7日	9,991	△0.0	10,305	△0.0	99.7	—
第27期	(期 首)2020年 9月7日	9,982	—	10,305	—	99.7	—
	9月末	10,011	0.3	10,336	0.3	99.8	—
	10月末	9,994	0.1	10,320	0.1	99.8	—
	(期 末)2020年11月9日	10,016	0.3	10,341	0.3	99.7	—
第28期	(期 首)2020年11月9日	10,008	—	10,341	—	99.7	—
	11月末	9,999	△0.1	10,333	△0.1	99.8	—
	12月末	9,999	△0.1	10,335	△0.1	99.8	—
	(期 末)2021年 1月7日	9,993	△0.1	10,329	△0.1	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

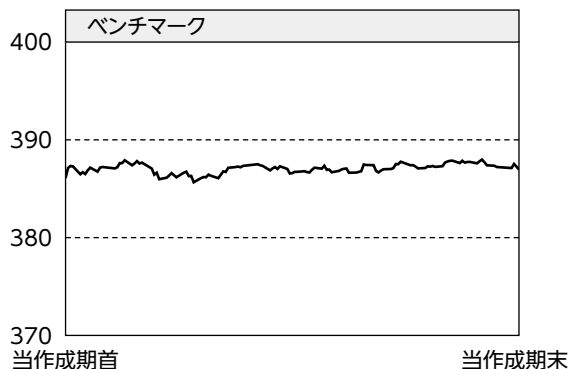


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2020年7月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年8月上旬にかけて、国債入札が順調な結果となったこと、また国内で新型コロナウイルスの感染者数増加が続いたことでリスク回避目的の債券買いが入ったことから、国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。その後9月上旬にかけては、国内株式の上昇を受けて市場のリスク回避姿勢が後退したことや新型コロナウイルスのワクチン開発を巡る報道などを背景に米長期金利が上昇した影響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。以降作成期末にかけては、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。

投資環境



2020年8月上旬にかけて、国債入札が順調な結果となったこと、また国内で新型コロナウイルスの感染者数増加が続いたことでリスク回避目的の債券買いが入ったことから、国内金利は低下しました。その後9月上旬にかけては、国内株式の上昇を受けて市場のリスク回避姿勢が後退したことや新型コロナウイルスのワクチン開発を巡る報道などを背景に米長期金利が上昇した影響から、国内金利は上昇しました。以降作成期末にかけては、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。

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。

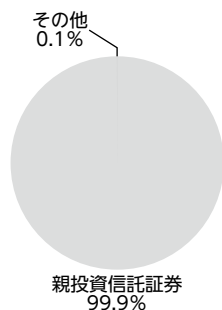
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

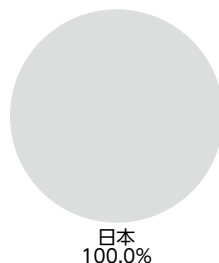
	当作成期末
	2021年1月7日
国内債券インデックス マザーファンド	99.9%
その他	0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

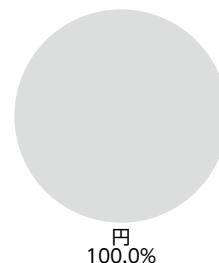
○資産別配分



○国別配分



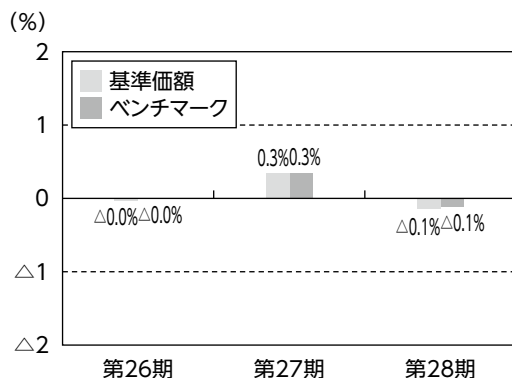
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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



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

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

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26期	第27期	第28期
	2020年7月8日～ 2020年9月7日	2020年9月8日～ 2020年11月9日	2020年11月10日～ 2021年1月7日
当期分配金 (円)	9	8	7
(対基準価額比率) (%)	(0.090)	(0.080)	(0.070)
当期の収益 (円)	9	8	7
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	579	583	585

(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
	(2020年7月8日～2021年1月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.055%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,005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)	(0.039)	
(販売会社)	(1)	(0.006)	
(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	6	0.056	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
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
	4, 126, 049	5, 817, 108	144, 320	203, 438

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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 8, 297	百万円 194	% 2. 3	百万円 8, 264	百万円 216	% 2. 6

(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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 163, 000	百万円 3, 458	% 2. 1	百万円 163, 161	百万円 3, 594	% 2. 2

<平均保有割合 17.9%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

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 71, 883, 475	千口 75, 865, 204	千円 106, 932, 005

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、430, 406, 768千口です。

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 106, 932, 005	% 99. 9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	147, 746	0. 1
投 資 信 託 財 産 総 額	107, 079, 751	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 26 期 末 2020年9月7日現在	第 27 期 末 2020年11月9日現在	第 28 期 末 2021年1月7日現在
(A) 資 産	102,981,864,234円	105,349,042,542円	107,079,751,161円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	163,690,602	81,595,777	127,471,816
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	102,818,173,632	105,192,128,747	106,932,005,635
未 収 入 金	—	75,318,018	20,273,710
(B) 負 債	112,226,942	104,298,980	94,211,122
未 払 収 益 分 配 金	92,747,344	84,130,448	74,993,334
未 払 信 託 報 酬	19,131,337	19,813,090	18,883,286
未 払 利 息	400	107	88
そ の 他 未 払 費 用	347,861	355,335	334,414
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	102,869,637,292	105,244,743,562	106,985,540,039
元 本	103,052,605,407	105,163,061,128	107,133,334,600
次 期 繰 越 損 益 金	△182,968,115	81,682,434	△147,794,561
(D) 受 益 権 総 口 数	103,052,605,407口	105,163,061,128口	107,133,334,600口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,982円	10,008円	9,986円

■損益の状況

項 目	第 26 期 自 2020年7月8日 至 2020年9月7日	第 27 期 自 2020年 9月8日 至 2020年11月9日	第 28 期 自 2020年11月10日 至 2021年 1月 7日
(A) 配 当 等 収 益	△5,807円	△4,869円	△4,453円
受 取 利 息	72	—	197
支 払 利 息	△5,879	△4,869	△4,650
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△11,051,173	367,634,699	△135,353,509
売 買 益	646	372,238,699	52,943
売 買 損	△11,051,819	△4,604,000	△135,406,452
(C) 信 託 報 酬 等	△19,479,198	△20,168,425	△19,217,700
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△30,536,178	347,461,405	△154,575,662
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△419,113,053	△542,173,331	△278,597,681
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	359,428,460	360,524,808	360,372,116
(配 当 等 相 当 額)	(2,992,315,893)	(3,116,377,876)	(3,234,559,541)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,632,887,433)	(△2,755,853,068)	(△2,874,187,425)
(G) 計 (D+E+F)	△90,220,771	165,812,882	△72,801,227
(H) 収 益 分 配 金	△92,747,344	△84,130,448	△74,993,334
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△182,968,115	81,682,434	△147,794,561
追 加 信 託 差 損 益 金	359,428,460	360,524,808	360,372,116
(配 当 等 相 当 額)	(2,992,852,002)	(3,117,003,318)	(3,235,318,290)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,633,423,542)	(△2,756,478,510)	(△2,874,946,174)
分 配 準 備 積 立 金	2,979,036,861	3,016,266,708	3,042,314,760
繰 越 損 益 金	△3,521,433,436	△3,295,109,082	△3,550,481,437

(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26期首元本額は101, 209, 694, 297円、第26～28期中追加設定元本額は6, 098, 637, 049円、第26～28期中一部解約元本額は174, 996, 746円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 26 期	第 27 期	第 28 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	110, 179, 339円	122, 586, 432円	103, 688, 246円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	2, 992, 852, 002円	3, 117, 003, 318円	3, 235, 318, 290円
(D) 分配準備積立金額	2, 961, 604, 866円	2, 977, 810, 724円	3, 013, 619, 848円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	6, 064, 636, 207円	6, 217, 400, 474円	6, 352, 626, 384円
(F) 期末残存口数	103, 052, 605, 407口	105, 163, 061, 128口	107, 133, 334, 600口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10, 000)	588円	591円	592円
(H) 分配金額(1万口当たり)	9円	8円	7円
(I) 収益分配金金額(F×H/10, 000)	92, 747, 344円	84, 130, 448円	74, 993, 334円

分配金のお知らせ

	第26期	第27期	第28期
1 万 口 当 たり 分 配 金	9円	8円	7円

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

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

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 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
第16期(2016年5月30日)	円	%		%	%	%	百万円
	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4	0.2	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	—	300,760
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382,463	0.8	99.9	—	379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390,052	2.0	99.7	0.0	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388,127	△0.5	100.5	—	540,159

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(当 期 首) 2019年 5月29日	円	%		%	%	%
	14,211	—	390,052	—	99.7	0.0
5月末	14,221	0.1	390,322	0.1	99.7	—
6月末	14,306	0.7	392,695	0.7	99.8	—
7月末	14,322	0.8	393,155	0.8	99.7	—
8月末	14,514	2.1	398,496	2.2	99.7	—
9月末	14,359	1.0	394,271	1.1	99.8	0.0
10月末	14,301	0.6	392,608	0.7	99.7	—
11月末	14,251	0.3	391,325	0.3	99.7	0.0
12月末	14,208	△0.0	390,136	0.0	100.1	—
2020年 1月末	14,268	0.4	391,771	0.4	99.7	—
2月末	14,380	1.2	394,745	1.2	99.7	—
3月末	14,149	△0.4	388,450	△0.4	99.9	—
4月末	14,197	△0.1	389,790	△0.1	99.9	—
(当 期 末) 2020年 5月29日	14,136	△0.5	388,127	△0.5	100.5	—

(注1) 騰落率は期首比です。

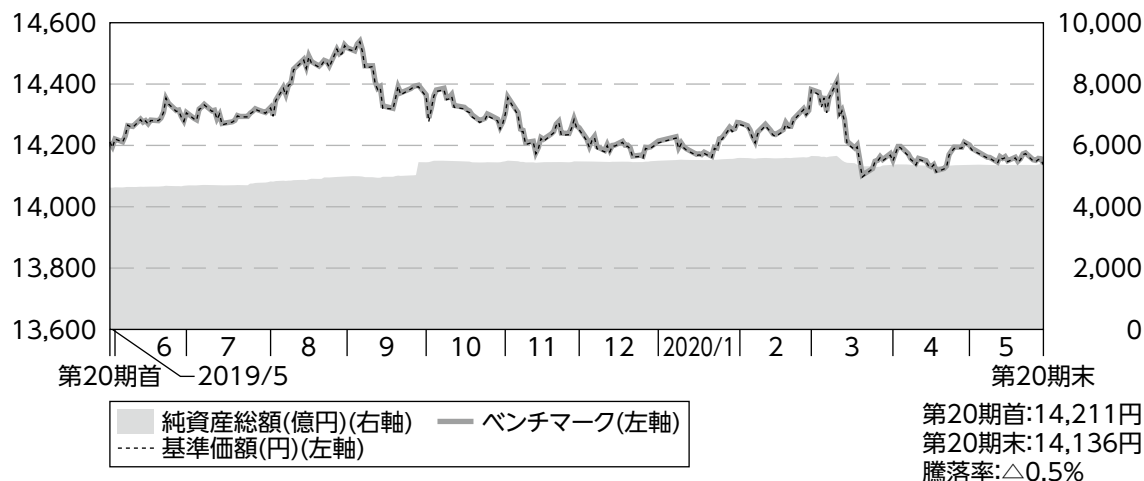
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2019年9月上旬にかけて、米中対立の激化による世界経済の減速懸念の高まりから、国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。9月中旬以降2020年1月中旬にかけて、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退し、米金利上昇に影響を受けて国内金利が上昇(債券価格は下落)したことから、基準価額は下落しました。1月下旬から3月上旬にかけて、中国で新型コロナウイルスの感染が拡大し、インバウンド需要の減少による国内景気の減速懸念、さらにグローバルなリスク回避姿勢の高まりなどから、国内金利が低下し、基準価額は上昇しました。3月中旬に、新型コロナウイルス感染拡大を受けた財政出動による国債増発への懸念から国内金利が一旦急上昇し、基準価額は下落しましたが、3月下旬には、日銀の大規模な国債買い入れオペ実施により国内金利が低下に転じ、基準価額の下落は収まりました。4月以降は、基準価額はレンジ内推移となりました。

投資環境



国内金利は、2019年9月上旬にかけて、米中対立の激化による世界経済の減速懸念の高まりから、低下しました。9月中旬以降2020年1月中旬にかけて、米中通商協議の進展により市場のリスク回避姿勢が後退したことから国内金利は上昇しましたが、1月下旬から3月上旬にかけては、中国で新型コロナウイルスの感染が拡大しインバウンド需要の減少による国内景気の減速懸念などから、低下しました。3月中旬に、新型コロナウイルス感染拡大を受けた財政出動による国債増発への懸念から国内金利は一旦急上昇しましたが、3月下旬には日銀の大規模な国債買い入れオペ実施により低下に転じ、4月以降はレンジ内推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

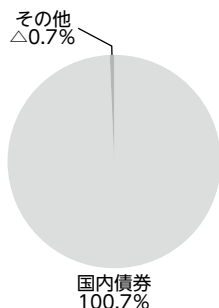
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第138回利付国債(5年)	日本	1.8%
2	第140回利付国債(5年)	日本	1.4%
3	第344回利付国債(10年)	日本	1.3%
4	第137回利付国債(5年)	日本	1.3%
5	第340回利付国債(10年)	日本	1.2%
6	第342回利付国債(10年)	日本	1.2%

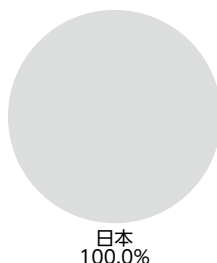
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第142回利付国債(5年)	日本	1.1%
8	第134回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第141回利付国債(5年)	日本	1.1%
10	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%
組入銘柄数		924	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

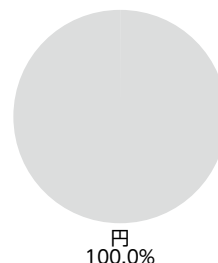
○資産別配分



○国別配分



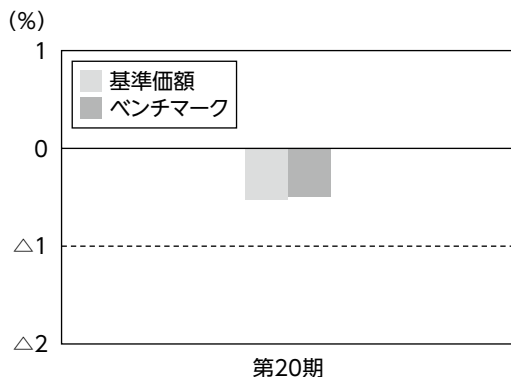
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2019年5月30日~2020年5月29日)		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(14,289円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

		当		期	
		買	付 額	売	付 額
国 内	国 債 証 券	千円		千円	
		179, 904, 416		104, 571, 764	
	地 方 債 証 券	8, 327, 272		4, 426, 367	
	特 殊 債 券	13, 007, 698		6, 598, 900 (560, 845)	
	社 債 券(投 資 法 人 債 券 を 含 む)	7, 754, 408		3, 325, 991 (100, 000)	

(注1) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)
(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		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 37, 124	百万円 37, 274	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 693	百万円 693	% 100. 0	百万円 184	百万円 184	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	421, 215	73, 246	17. 4	422, 632	74, 036	17. 5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	418,120,000 (4,080,000)	454,188,617 (4,110,967)	84.1 (0.8)	— (—)	56.7 (—)	20.8 (0.8)	6.6 (—)
地 方 債 証 券	27,459,430 (27,459,430)	28,860,716 (28,860,716)	5.3 (5.3)	— (—)	3.5 (3.5)	1.3 (1.3)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	33,023,820 (33,023,820)	34,708,788 (34,708,788)	6.4 (6.4)	— (—)	4.1 (4.1)	1.6 (1.6)	0.7 (0.7)
金 融 債 証 券	2,300,000 (2,300,000)	2,301,003 (2,301,003)	0.4 (0.4)	— (—)	0.0 (0.0)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	22,366,000 (22,366,000)	22,648,161 (22,648,161)	4.2 (4.2)	— (—)	1.9 (1.9)	1.7 (1.7)	0.6 (0.6)
合 計	503,269,250 (89,229,250)	542,707,286 (92,629,636)	100.5 (17.1)	— (—)	66.1 (9.4)	25.7 (5.6)	8.7 (2.1)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) () 内は非上場債で内書きです。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

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

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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第13回利付国債(40年)	0.5	340,000	336,644	2060/3/20
第317回利付国債(10年)	1.1	890,000	904,649	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	2,260,000	2,294,239	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,710,000	1,743,687	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	4,570,000	4,652,899	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	2,470,000	2,521,721	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	764,347	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,930,000	1,972,305	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	2,740,000	2,794,416	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,920,000	2,985,145	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	3,120,000	3,188,764	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	3,190,000	3,268,505	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	3,400,000	3,473,134	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,250,000	2,316,600	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,690,000	1,743,877	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	922,716	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	3,110,000	3,193,876	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,330,000	2,396,777	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	1,790,000	1,844,344	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,450,000	2,518,428	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	510,000	524,953	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	3,330,000	3,396,333	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	3,060,000	3,139,070	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.5	2,300,000	5,372,308	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	6,320,000	6,498,856	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,160,000	2,211,948	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	6,380,000	6,463,833	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	3,250,000	3,294,590	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	6,940,000	7,039,172	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	2,290,000	2,323,273	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	5,200,000	5,276,596	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	2,000,000	2,029,840	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,840,000	4,912,987	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	3,130,000	3,177,638	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	5,790,000	5,878,702	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	3,590,000	3,643,814	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	4,190,000	4,251,257	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,470,000	4,531,462	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	3,780,000	3,828,421	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	4,940,000	5,000,515	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	2,420,000	2,447,055	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,698,061	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	3,680,000	3,716,064	2030/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	138,784	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	197,432	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	147,361	2030/5/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	142,953	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	61,691	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	190,000	240,241	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	226,962	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	100,000	120,725	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	277,989	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	179,427	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	90,000	107,995	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	238,482	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	290,000	361,023	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	300,000	390,468	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	448,412	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	370,000	489,702	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	570,000	748,392	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	345,000	449,141	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	380,000	496,242	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	642,984	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	656,400	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	538,844	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	581,102	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	380,000	514,744	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	464,047	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	530,000	713,141	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	1,010,000	1,383,477	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	1,640,000	2,259,198	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,400,000	1,913,436	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,770,000	2,399,978	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,480,017	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,560,000	2,141,115	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,770,000	2,339,143	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,615,000	2,207,107	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	1,940,000	2,584,856	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,880,000	2,513,372	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	1,910,000	2,525,096	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,230,000	1,604,891	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,200,000	1,595,052	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,170,000	1,532,232	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	780,000	1,005,841	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,350,000	1,742,742	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,500,000	1,938,480	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,220,000	1,578,301	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	990,000	1,236,232	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,590,000	1,986,848	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,350,000	1,720,831	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,820,000	2,235,633	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,440,000	1,769,731	2045/12/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第50回利付国債(30年)	0.8	1,110,000	1,203,972	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,840,000	1,769,436	2046/6/20
第52回利付国債(30年)	0.5	1,600,000	1,615,008	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	690,000	713,701	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	2,110,000	2,286,607	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,040,000	1,126,424	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,870,000	2,026,668	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,550,000	1,678,867	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	1,620,000	1,755,756	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	120,000	126,997	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	2,530,000	2,808,780	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,330,000	1,405,238	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	170,000	170,644	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	980,000	956,352	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	1,700,000	1,656,548	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	860,000	837,855	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	720,000	701,323	2050/3/20
第52回利付国債(20年)	2.1	110,000	113,262	2021/9/21
第53回利付国債(20年)	2.1	80,000	82,815	2021/12/20
第54回利付国債(20年)	2.2	200,000	207,350	2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	140,000	145,467	2022/3/21
第56回利付国債(20年)	2.0	150,000	156,685	2022/6/20
第57回利付国債(20年)	1.9	240,000	250,202	2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	300,000	314,328	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	200,000	209,564	2022/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	350,000	364,045	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	240,000	247,864	2023/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	329,472	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	212,054	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	341,836	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	236,110	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	352,987	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	140,158	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	207,024	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	423,454	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	441,400	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	219,070	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	691,103	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	395,211	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	220,478	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	144,002	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	296,473	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	319,835	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	187,549	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	299,246	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	244,948	2025/6/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	434,249	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	671,280	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	326,081	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	525,850	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	327,697	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	210,000	239,750	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	550,000	624,706	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	481,962	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	399,500	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	722,843	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	519,174	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	1,008,708	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	469,269	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	702,360	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	714,224	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,839,073	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	467,692	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	511,222	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,150,000	1,342,038	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	566,342	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	854,846	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,513,234	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	477,152	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	360,000	423,601	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,393,875	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	452,048	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	308,149	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	770,880	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	609,086	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	950,000	1,129,531	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,166,337	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	942,730	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	1,450,000	1,736,534	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,800,124	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	847,931	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,811,244	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,302,264	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	791,887	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	625,267	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,820,666	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,789,050	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,111,474	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	830,000	1,010,209	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	736,032	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	820,000	1,009,930	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	883,380	2031/3/20

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

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

当		期		末	
銘	柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成21年度第3回京都府公募債(20年)		2.19	100,000	119,012	2029/9/20
平成23年度第5回京都府公募債(20年)		1.79	100,000	117,376	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公募債		0.8	100,000	102,544	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公募債		0.553	100,000	102,460	2025/6/19
平成28年度第5回京都府公募債(20年)		0.327	100,000	98,986	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公募債(20年)		0.63	100,000	103,616	2037/8/14
第1回兵庫県公募債(12年)		1.1	100,000	104,274	2024/6/26
第2回兵庫県公募債(20年)		2.37	100,000	116,338	2027/9/17
第3回兵庫県公募債(12年)		0.56	100,000	102,509	2025/4/16
第6回兵庫県公募債(15年)		1.35	400,000	439,420	2028/7/14
第7回兵庫県公募債(15年)		1.12	100,000	108,443	2028/12/25
平成24年度第13回兵庫県公募債		0.75	200,000	203,098	2022/8/16
平成25年度第4回兵庫県公募債		0.82	100,000	102,476	2023/8/18
平成26年度第17回兵庫県公募債		0.46	100,000	101,965	2025/2/26
第35回兵庫県公募債(20年)		0.578	100,000	102,486	2038/5/28
令和元年度第17回兵庫県公募債		0.15	300,000	300,138	2030/1/28
第9回静岡県公募債(30年)		1.539	100,000	122,040	2045/6/20
第12回静岡県公募債(30年)		0.822	100,000	106,055	2048/3/19
平成23年度第8回静岡県公募債		1.025	100,000	101,401	2021/10/25
平成24年度第10回静岡県公募債		0.678	100,000	101,821	2023/3/22
平成29年度第5回静岡県公募債		0.19	100,000	100,630	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公募債		0.21	100,000	100,770	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公募債		0.215	100,000	100,833	2027/9/17
平成21年度第5回愛知県公募債(20年)		2.28	100,000	119,310	2029/6/20
平成23年度第14回愛知県公募債(10年)		1.006	100,000	101,470	2021/11/30
平成24年度第19回愛知県公募債(10年)		0.639	100,000	101,722	2023/3/28
平成26年度第3回愛知県公募債(10年)		0.665	100,000	102,487	2024/4/30
平成27年度第17回愛知県公募債(10年)		0.38	100,000	101,749	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公募債(10年)		0.07	100,000	99,878	2026/6/29
平成29年度第6回愛知県公募債(10年)		0.22	200,000	201,706	2027/7/28
平成29年度第12回愛知県公募債(20年)		0.606	300,000	309,576	2037/11/20
平成30年度第1回愛知県公募債(10年)		0.185	100,000	100,706	2028/4/27
平成30年度第6回愛知県公募債(30年)		0.777	100,000	105,012	2048/6/19
令和元年度第16回愛知県公募債(10年)		0.09	200,000	199,044	2030/2/15
平成20年度第1回広島県公募債(20年)		2.34	100,000	118,378	2028/9/21
平成24年度第4回広島県公募債		0.81	100,000	101,950	2022/11/28
平成27年度第4回広島県公募債		0.476	125,230	128,012	2025/11/25
平成29年度第1回広島県公募債		0.175	200,000	201,180	2027/5/25
第3回埼玉県公募債(20年)		2.42	100,000	116,257	2027/6/18
第5回埼玉県公募債(20年)		2.35	100,000	117,461	2028/3/17
第6回埼玉県公募債(20年)		2.26	200,000	235,436	2028/9/21
第6回埼玉県公募債(30年)		0.957	100,000	109,195	2046/12/20
第10回埼玉県公募債(20年)		1.94	200,000	236,068	2030/11/12
第18回埼玉県公募債(20年)		0.323	200,000	198,124	2036/5/20

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

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	205,256	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	128,532	2025/7/25
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	102,331	2025/11/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,173	2026/3/25
第157回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,058	2026/4/24
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	199,756	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	199,508	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	399,252	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	99,741	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,595	2027/1/25
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	101,039	2027/2/25
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	201,194	2027/6/25
第174回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	194,933	2027/9/24
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	100,845	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	302,001	2028/4/25
平成23年度第2回熊本県公債(10年)	1.0	100,000	101,373	2021/10/28
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	200,000	203,710	2022/10/26
平成29年度第1回熊本県公債(5年)	0.01	100,000	99,955	2022/7/28
平成23年度第1回浜松市公債公債	1.045	100,000	101,515	2021/11/25
平成23年度第1回静岡市公債公債	1.045	100,000	101,515	2021/11/25
平成29年度第1回静岡市公債公債	0.22	100,000	100,892	2027/11/24
第13回大阪市公債公債(20年)	2.08	200,000	237,968	2030/6/14
第22回大阪市公債公債(20年)	0.347	300,000	298,266	2036/5/30
第24回大阪市公債公債(20年)	0.655	100,000	103,950	2037/4/21
平成29年度第1回大阪市公債公債(5年)	0.01	100,000	99,958	2022/5/25
第1回名古屋市公債公債(30年)	2.53	100,000	131,154	2035/3/20
第5回名古屋市公債公債(30年)	2.49	100,000	136,859	2039/3/18
第9回名古屋市公債公債(20年)	2.07	100,000	116,627	2028/12/20
第11回名古屋市公債公債(30年)	1.774	100,000	127,339	2044/9/20
第481回名古屋市公債公債(10年)	0.744	100,000	101,827	2022/12/20
第499回名古屋市公債公債(10年)	0.225	100,000	100,915	2027/3/26
平成23年度第4回京都市公債公債	1.067	100,000	101,625	2021/12/22
平成24年度第2回京都市公債公債	0.849	122,500	124,756	2022/8/29
平成24年度第4回京都市公債公債	0.801	100,000	101,847	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債公債	0.854	100,000	102,204	2023/1/31
平成28年度第6回京都市公債公債	0.18	200,000	201,192	2027/1/27
平成18年度第3回神戸市公債公債(20年)	2.54	120,000	137,716	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公債公債(20年)	2.38	200,000	236,254	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公債公債(20年)	2.233	100,000	120,146	2030/1/29
第5回横浜市公債公債(20年)	2.17	100,000	110,618	2025/6/20
第20回横浜市公債公債(20年)	2.1	100,000	118,334	2029/10/19
平成23年度第5回横浜市公債公債	1.011	100,000	101,636	2022/1/28
平成28年度第4回横浜市公債公債	0.175	100,000	100,562	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公債公債	0.24	200,000	201,982	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公債公債	0.195	100,000	100,782	2028/4/17

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成30年度第4回横浜市公債公債	0.289	200,000	202,974	2028/10/17
平成23年度第9回札幌市公債公債(15年)	1.493	100,000	109,359	2027/2/12
平成24年度第10回札幌市公債公債(10年)	0.8	100,000	101,971	2022/12/20
平成26年度第9回札幌市公債公債(10年)	0.43	100,000	101,843	2024/12/20
第11回川崎市公債公債(20年)	1.84	100,000	116,883	2030/10/18
第89回川崎市公債公債	0.16	100,000	100,456	2026/12/18
平成26年度第2回北九州市公債公債	0.451	100,000	101,804	2024/12/24
平成27年度第2回北九州市公債公債	0.484	100,000	102,150	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公債公債	0.08	100,000	99,912	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市公債公債(20年)	2.14	100,000	118,541	2029/9/18
平成23年度第6回福岡市公債公債	1.0	100,000	101,373	2021/10/28
平成26年度第5回福岡市公債公債	0.539	200,000	204,532	2024/10/28
平成28年度第10回福岡市公債公債(5年)	0.02	100,000	99,981	2022/3/31
平成30年度第9回福岡市公債公債(10年)	0.289	100,000	101,493	2028/10/30
平成25年度第3回広島市公債公債	0.67	150,000	153,586	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公債公債	0.456	100,000	101,967	2024/12/25
平成28年度第4回広島市公債公債	0.165	105,000	105,514	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公債公債	0.23	170,000	171,747	2028/2/25
令和元年度第6回広島市公債公債	0.115	550,000	548,696	2030/2/25
平成23年度第2回千葉市公債公債	1.06	200,000	203,076	2021/11/25
令和元年度第5回千葉市公債公債	0.08	200,000	198,854	2030/2/25
平成26年度第1回山梨県公債公債(10年)	0.33	200,000	202,844	2025/1/30
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	116,078	2027/12/20
小 計		27,459,430	28,860,716	
特殊債券(除く金融債)				
第25回政府保証日本政策金融公債債券	0.815	200,000	204,694	2023/2/24
第40回政府保証日本政策金融公債債券	0.02	126,000	125,926	2026/3/13
第46回政府保証日本政策金融公債債券	0.16	100,000	100,783	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公債債券	0.09	210,000	210,611	2027/9/24
第53回政府保証日本政策金融公債債券	0.209	187,000	189,378	2028/9/15
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	102,000	104,722	2023/6/27
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	102,768	2021/9/13
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	310,000	316,138	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	106,679	2023/6/19
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.085	100,000	100,228	2026/12/14
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	148,559	2049/6/30
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	237,656	2029/9/28
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	134,131	2040/5/31
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	120,681	2030/12/27
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	101,334	2021/7/30

銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第147回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	1.0	300,000	304,428	2021/10/29
第155回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.9	301,000	305,746	2022/1/31
第157回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.9	200,000	203,298	2022/2/28
第163回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.901	200,000	203,774	2022/5/31
第166回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.895	100,000	101,951	2022/6/30
第170回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	101,899	2022/8/31
第180回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.734	300,000	306,003	2022/12/28
第181回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	117,778	2032/12/28
第182回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	102,342	2023/1/31
第184回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	307,068	2023/2/28
第186回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	203,968	2023/3/17
第189回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	203,390	2023/4/28
第190回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.605	428,000	436,303	2023/5/31
第193回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.882	200,000	205,352	2023/6/30
第200回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	151,877	2023/9/29
第213回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	102,413	2024/3/29
第214回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	232,602	2034/3/31
第215回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.669	102,000	104,614	2024/4/30
第220回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	102,568	2024/6/28
第222回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	102,453	2024/7/31
第229回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	102,339	2024/10/31
第234回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	102,086	2024/12/27
第236回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	304,344	2025/1/31
第239回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	112,302	2035/2/28
第242回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	1.216	200,000	226,322	2035/3/30
第266回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.32	200,000	203,286	2026/1/30
第269回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,660	2026/2/27
第277回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.394	100,000	96,464	2046/5/31

銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第294回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	106,686	2026/11/30
第297回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.085	316,000	316,723	2026/12/28
第300回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.115	205,000	205,885	2027/1/29
第306回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,647	2027/3/31
第309回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.14	200,000	201,240	2027/4/30
第321回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	100,759	2027/8/31
第339回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.195	120,000	121,380	2028/2/29
第348回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.145	200,000	201,594	2028/5/31
第361回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.625	300,000	312,294	2038/9/30
第363回政府保証日本高速 道路保有・債務返済機構債券	0.219	214,000	216,942	2028/10/31
第1回政府保証地方公共団 体金融機構債券（8年）	0.576	110,000	110,896	2021/9/24
第2回政府保証地方公共団 体金融機構債券（8年）	0.502	100,000	100,853	2021/12/24
第3回政府保証地方公共団 体金融機構債券（8年）	0.46	100,000	100,873	2022/2/25
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,445	2021/10/18
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	300,000	304,686	2022/1/25
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	102,331	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	200,000	203,968	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	101,684	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	101,914	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	102,631	2023/8/14
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	204,798	2024/2/16
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	101,930	2025/12/12
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,942	2026/3/13
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,228	2026/12/14
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	100,000	100,430	2027/1/19
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,548	2027/4/16
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,781	2027/7/16
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,754	2027/8/13
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	111,252	2028/2/15
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	157,964	2028/8/15
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,368	2028/10/16
第59回政府保証関西国際空港債券	0.9	500,000	508,565	2022/3/25
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	100,526	2027/1/18
第119回株式会社日本 政策投資銀行無担保社債	0.001	300,000	299,754	2023/3/20
第14回道路債券	1.91	100,000	104,813	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	103,865	2022/12/20
第21回道路債券	2.75	100,000	131,371	2033/6/20

当 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 8回道路債券	2.83	200,000	266,118	2033/12/20
第3 3回道路債券	2.91	200,000	269,884	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	117,498	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	156,495	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	118,269	2028/6/20
第4 2回道路債券	2.22	100,000	110,442	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	119,996	2029/4/20
第8 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.03	100,000	101,578	2021/12/20
第8 2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	100,000	101,892	2022/3/18
第9 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	118,246	2032/9/17
第1 0 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	500,000	509,610	2023/3/20
第1 0 6回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	102,828	2023/3/20
第1 1 5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	102,324	2023/9/20
第1 3 1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	115,129	2034/6/20
第1 4 4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,959	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	136,918	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	225,692	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	619,752	2037/9/18
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	113,801	2058/3/19
第2回公営企業債券（30年）	2.39	300,000	381,705	2033/12/20
第3回公営企業債券（20年）	1.03	110,000	113,092	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券（15年）	1.176	100,000	108,868	2029/1/26
第5回公営企業債券（30年）	2.72	300,000	399,126	2034/9/22
第7回公営企業債券（20年）	2.2	100,000	108,247	2024/3/22
第7回公営企業債券（30年）	2.67	100,000	133,671	2035/6/20
第8回公営企業債券（20年）	2.25	40,000	43,375	2024/3/22
第8回公営企業債券（30年）	2.5	100,000	131,557	2035/9/21
第8回地方公共団体金融機構債券（20年）	2.043	200,000	237,244	2030/6/28
第1 9回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.84	200,000	236,584	2031/12/26
第2 1回地方公共団体金融機構債券（5年）	0.01	400,000	399,920	2022/4/28
第2 4回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.702	100,000	117,369	2032/9/28
第3 8回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	508,700	2022/7/28
第4 2回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,927	2022/11/28
第4 4回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	204,054	2023/1/27
第5 8回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,673	2024/3/28
第6 5回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	306,612	2024/10/28
F 7 7回地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	108,949	2026/10/20
第8 8回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,748	2026/9/28
F 1 1 6回地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	109,318	2027/4/23
F 1 3 2回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	105,216	2025/7/30
F 1 4 6回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	211,256	2025/10/28

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
F 2 0 8回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	104,341	2026/2/4
F 2 1 4回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	105,625	2027/4/28
第7 回阪神高速道路債券	2.18	100,000	110,144	2025/3/21
第1 9回阪神高速道路株式会社債	0.02	100,000	100,000	2021/12/20
第2 2回阪神高速道路株式会社債	0.005	200,000	199,802	2023/3/20
第1 8回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	121,117	2031/5/9
第8 1回株式会社日本政策金融公庫社債	0.001	100,000	99,972	2021/11/8
第1 1 7回都市再生債券	0.804	200,000	212,890	2030/11/20
第1 5 9回都市再生債券	0.43	200,000	178,806	2059/3/19
第1 6 1回都市再生債券	0.687	100,000	98,098	2059/3/19
第5 回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	109,845	2024/12/20
第3 4 4回東京交通債券	1.67	100,000	104,378	2023/2/17
第3 4 6回東京交通債券	1.13	20,000	20,653	2023/6/20
第5 9回独立行政法人体質医療機構債券	0.001	100,000	99,925	2022/12/20
第1 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.13	12,945	13,340	2042/5/10
第1 回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.08	13,434	13,977	2037/11/10
第2 回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.27	13,750	14,363	2037/11/10
第2 回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.18	216,330	216,433	2032/5/10
第3 回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.16	152,482	152,661	2033/1/10
第4 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.29	13,623	14,167	2042/8/10
第4 回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.03	14,591	15,258	2038/5/10
第4 回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.08	276,201	275,742	2033/4/10
第5 回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	1.76	11,864	12,077	2036/11/10
第6 回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.26	24,558	25,299	2037/5/10
第6 回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.94	14,300	14,860	2038/11/10
第6 回一般担保宅金融支援機構債券	2.46	100,000	116,374	2027/6/18
第6 回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.06	291,057	290,003	2034/2/10
第8 回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.15	12,971	13,417	2037/5/10
第8 回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	15,129	15,913	2039/5/10
第9 回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.19	12,925	13,388	2037/5/10
第1 0 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	15,110	15,894	2039/11/10
第1 2 回一般担保宅金融支援機構債券	2.29	100,000	116,179	2027/12/20
第1 4 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.7	12,106	12,242	2032/5/10
第1 5 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.65	12,445	12,582	2032/5/10
第2 3 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.25	19,874	21,275	2044/4/10
第2 4 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.34	20,435	21,948	2044/5/10
第2 5 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.28	23,104	25,000	2044/6/10
第2 8 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.98	24,793	26,547	2044/9/10
第3 0 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.97	27,175	29,252	2044/11/10
第3 1 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.89	28,216	30,288	2044/12/10
第3 4 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.86	59,974	64,403	2045/3/10
第3 6 回貸付債権担保宅金融公庫債券	1.88	13,179	13,634	2040/11/10
第3 6 回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.81	28,700	30,426	2045/5/10
第3 9 回貸付債権担保宅金融公庫債券	1.84	13,240	13,690	2041/2/10
第4 2 回貸付債権担保宅金融公庫債券	2.34	13,044	13,621	2041/5/10

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4 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	31,426	33,443	2046/2/10
第4 6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,243	12,640	2041/9/10
第4 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	31,749	33,835	2046/3/10
第4 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	29,745	31,648	2046/5/10
第4 9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,331	15,088	2041/12/10
第5 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	60,800	64,381	2046/7/10
第5 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,824	34,769	2046/8/10
第5 3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	13,802	14,410	2042/4/10
第5 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	43,219	45,705	2046/12/10
第5 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	40,990	43,334	2047/1/10
第5 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	41,066	43,459	2047/2/10
第6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	87,658	92,452	2047/5/10
第6 4回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	109,670	2025/12/19
第6 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	94,810	99,200	2047/11/10
第6 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	48,286	50,467	2047/12/10
第6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	48,406	51,005	2048/1/10
第6 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,907	51,595	2048/2/10
第7 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	42,874	45,045	2048/3/10
第7 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	42,877	44,729	2048/5/10
第7 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	48,352	51,043	2048/6/10
第7 5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	180,336	2031/6/13
第7 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	130,533	136,161	2048/11/10
第7 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	176,092	183,672	2048/12/10
第8 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	49,443	51,508	2049/5/10
第8 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	51,116	53,288	2049/6/10
第8 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	51,976	54,036	2049/8/10
第8 8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,456	2031/11/18
第8 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	164,916	171,420	2049/10/10
第9 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,382	2049/11/10
第9 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	116,858	120,211	2050/1/10
第9 2回一般担保住宅金融支援機構債券	1.06	100,000	101,624	2021/12/20
第9 3回一般担保住宅金融支援機構債券	1.557	100,000	109,350	2026/12/18
第9 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	65,841	67,949	2050/3/10
第9 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	69,531	71,547	2050/5/10
第9 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	68,891	71,233	2050/6/10
第9 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	213,495	221,635	2050/7/10
第9 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	142,638	147,931	2050/8/10
第1 0 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	70,047	72,523	2050/9/10
第1 0 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	74,650	77,370	2051/1/10
第1 0 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	80,329	80,761	2051/5/10
第1 1 1回一般担保住宅金融支援機構債券	1.404	100,000	108,985	2027/6/18
第1 1 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	84,682	85,350	2051/10/10
第1 1 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	84,789	85,277	2051/11/10
第1 1 4回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	109,799	2027/9/17
第1 1 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	84,869	85,727	2051/12/10
第1 1 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	85,432	86,710	2052/1/10
第1 1 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,903	87,060	2052/2/10

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第1 1 7回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	109,546	2027/9/17
第1 2 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	87,888	88,967	2052/7/10
第1 2 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	88,681	89,878	2052/8/10
第1 2 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,436	89,385	2052/9/10
第1 2 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,850	89,800	2052/10/10
第1 2 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	89,394	90,405	2052/11/10
第1 2 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	179,914	181,562	2052/12/10
第1 2 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	89,468	90,416	2053/1/10
第1 2 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	180,984	183,383	2053/2/10
第1 3 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	90,657	91,637	2053/3/10
第1 3 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	182,278	183,958	2053/4/10
第1 3 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	91,473	92,446	2053/6/10
第1 3 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,300	186,836	2053/7/10
第1 3 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,552	187,079	2053/8/10
第1 3 5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	132,731	2043/3/20
第1 3 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	93,640	94,950	2053/10/10
第1 3 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	94,239	95,761	2053/11/10
第1 4 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	94,225	94,910	2054/1/10
第1 4 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	191,012	191,514	2054/3/10
第1 4 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	95,611	95,771	2054/4/10
第1 4 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	95,873	96,175	2054/5/10
第1 4 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	192,842	193,113	2054/6/10
第1 4 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	97,147	96,525	2054/7/10
第1 4 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	292,560	289,172	2054/9/10
第1 4 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	195,718	193,420	2054/10/10
第1 5 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	99,211	99,506	2055/2/10
第1 5 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	99,521	99,486	2055/3/10
第1 6 1回一般担保住宅金融支援機構債券	0.713	100,000	104,149	2027/6/18
第1 6 8回一般担保住宅金融支援機構債券	0.495	100,000	102,194	2025/9/19
第1 6 9回一般担保住宅金融支援機構債券	0.617	200,000	207,198	2027/9/17
第1 9 2回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	96,561	2036/7/18
第1 9 4回一般担保住宅金融支援機構債券	0.075	100,000	99,745	2026/10/20
第1 2 回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	114,315	2027/3/19
第5 7 回日本学生支援機構債券	0.001	100,000	99,972	2021/11/19
第5 8 回日本学生支援機構債券	0.001	100,000	99,967	2022/2/18
第5 9 回日本学生支援機構債券	0.001	200,000	199,958	2022/6/20
第6 回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	109,907	2025/6/20
第2 1 回国際協力機構債券	1.734	100,000	118,503	2033/9/20
第3 8 回東日本高速道路株式会社債	0.03	100,000	100,012	2021/9/17
第3 9 回東日本高速道路株式会社債	0.03	200,000	200,032	2021/12/20
第6 4 回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	99,247	2029/11/29
第6 7 回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	200,092	2030/1/31
第3 3 回中日本高速道路株式会社債	1.084	100,000	101,387	2021/9/17
第4 2 回中日本高速道路株式会社債	0.942	100,000	101,661	2022/3/18
第5 9 回中日本高速道路株式会社債	0.309	100,000	100,451	2021/12/20
第8 3 回中日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	99,971	2023/4/20
第2 7 回西日本高速道路株式会社債	0.58	100,000	102,357	2025/9/2

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	100,252	2026/10/19
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	102,149	2023/9/20
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	99,690	2026/8/19
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	198,682	2034/5/30
小 計		33,023,820	34,708,788	
金融債券				
い第795号商工債	0.03	200,000	199,924	2021/8/27
い第800号商工債	0.05	200,000	199,950	2022/1/27
い第802号商工債	0.06	100,000	99,990	2022/3/25
い第804号商工債	0.06	300,000	299,964	2022/5/27
い第832号商工債	0.06	200,000	199,352	2024/9/27
い第795号農林債	0.03	100,000	99,975	2021/8/27
い第796号農林債	0.03	200,000	199,946	2021/9/27
第337回信金中金債 (5年)	0.11	100,000	100,102	2022/12/27
第338回信金中金債 (5年)	0.11	100,000	100,106	2023/1/27
第339回信金中金債 (5年)	0.11	200,000	200,218	2023/2/27
第342回信金中金債 (5年)	0.11	100,000	100,119	2023/5/26
第350回信金中金債 (5年)	0.08	100,000	99,890	2024/1/26
第236号商工債 (3年)	0.02	300,000	299,511	2022/9/27
第2回信金中金債 (10年)	0.52	100,000	101,956	2025/9/26
小 計		2,300,000	2,301,003	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	103,331	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	101,907	2025/3/25
第507回中部電力株式会社社債	0.605	100,000	102,093	2026/1/23
第511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	99,696	2026/7/24
第519回中部電力株式会社社債	0.84	100,000	103,236	2037/1/23
第540回中部電力株式会社社債	0.53	100,000	97,212	2040/2/24
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	100,289	2023/8/25
第508回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	100,469	2027/4/23
第510回関西電力株式会社社債	0.49	200,000	201,248	2027/7/23
第511回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	100,034	2027/9/17
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	102,580	2025/7/25
第398回中国電力株式会社社債	0.425	100,000	100,663	2027/7/23
第400回中国電力株式会社社債	0.34	100,000	100,034	2027/9/24
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,327	2024/10/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	104,598	2026/6/25
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	100,345	2027/6/25
第330回北陸電力株式会社社債	0.34	100,000	99,608	2029/5/25
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	130,585	2023/12/25
第481回東北電力株式会社社債	0.803	100,000	102,883	2025/7/25
第487回東北電力株式会社社債	0.17	100,000	100,097	2023/9/25
第496回東北電力株式会社社債	0.355	100,000	100,070	2027/9/24
第521回東北電力株式会社社債	0.45	100,000	100,337	2030/5/24
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	102,737	2023/6/23
第426回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	103,361	2024/2/23

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第449回九州電力株式会社社債	0.43	200,000	201,144	2027/4/23
第465回九州電力株式会社社債	0.38	100,000	99,920	2028/7/25
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	100,318	2028/8/25
第484回九州電力株式会社社債	0.375	200,000	199,164	2029/11/22
第317回北海道電力株式会社社債	1.139	200,000	206,616	2023/11/24
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	201,000	202,435	2021/12/24
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	100,000	102,625	2025/12/25
第340回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	100,638	2027/4/23
第344回北海道電力株式会社社債	0.18	200,000	200,138	2022/9/22
第351回北海道電力株式会社社債	0.18	200,000	200,060	2023/7/25
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,374	2021/12/3
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,747	2027/11/30
第7回住友林業株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,757	2024/3/6
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	99,892	2024/9/13
第1回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	99,839	2024/6/13
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	100,000	101,583	2025/2/28
第24回株式会社エチレイン無担保社債	0.25	100,000	99,811	2025/8/29
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	100,439	2022/7/15
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	102,603	2024/4/24
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	99,907	2028/10/20
第7回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,138	2024/5/22
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.856	100,000	102,161	2024/7/29
第11回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,912	2022/5/31
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,631	2023/8/30
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.45	100,000	100,282	2028/11/29
第21回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	102,541	2024/6/19
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,784	2024/9/13
第9回イビデン株式会社無担保社債	0.03	100,000	99,580	2022/9/12
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	99,797	2028/8/31
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	99,850	2028/2/25
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	200,000	198,238	2027/2/26
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	99,508	2028/3/23
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.005	400,000	398,244	2022/9/27
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,760	2026/3/6
第42回DIC株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,887	2023/4/17
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	96,749	2029/7/31
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,454	2023/3/3
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	102,781	2024/10/23

銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,205	2024/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	99,502	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	100,000	99,552	2026/4/17
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	98,571	2026/6/19
第22回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	101,346	2024/9/19
第28回ジェイ・エフ・イーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	98,473	2026/5/27
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.494	100,000	100,505	2022/2/25
第33回株式会社豊田自動機械無担保社債	0.15	100,000	99,657	2024/6/20
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	98,738	2030/3/12
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	200,000	201,490	2022/3/18
第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	200,000	200,164	2021/9/17
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,314	2023/9/20
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	200,000	200,638	2026/9/18
第12回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,850	2021/9/17
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	99,694	2028/3/17
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,584	2024/9/3
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,400	2027/8/27
第11回JFA三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,532	2023/9/7
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	100,000	99,711	2021/8/2
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	99,452	2022/8/4
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	200,000	197,976	2026/9/25
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	0.05	200,000	199,400	2023/3/3
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	100,000	98,895	2023/9/25
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	102,364	2024/3/14
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	96,335	2040/3/9
第14回株式会社岡村製作所無担保社債	0.18	200,000	199,870	2022/4/25
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	101,817	2024/5/30
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	98,603	2027/7/12
第22回ユニ・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,686	2024/2/22
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	116,777	2033/3/4
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,276	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	99,478	2028/9/14
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債 (劣後特)	0.61	100,000	97,092	2029/12/12
第111回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.05	700,000	698,894	2021/7/27
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.91	100,000	118,468	2029/10/16
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	114,321	2027/4/20
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.82	100,000	101,852	2023/1/23

銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第1回三井住友FG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	100,892	2024/9/12
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	100,000	101,401	2024/12/20
第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	300,000	302,340	2024/7/16
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,152	2026/6/19
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.233	100,000	100,127	2021/9/17
第23回コーリス株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,806	2021/9/24
第37回コーリス株式会社無担保社債	0.02	300,000	298,416	2022/10/11
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	103,254	2026/9/18
第77日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,719	2023/12/20
第193回オリックス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,723	2024/9/13
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.18	200,000	199,586	2023/11/27
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,765	2023/10/25
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	199,456	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,224	2028/1/18
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	99,062	2027/8/27
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,454	2023/9/4
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	199,406	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	198,292	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	96,927	2039/8/5
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,473	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	102,237	2024/9/9
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	102,570	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	104,131	2026/6/17
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	100,877	2046/9/26
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	103,343	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	97,408	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	97,535	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	99,841	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,876	2028/9/7
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.36	100,000	104,028	2022/2/25
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	114,222	2026/9/18
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	235,460	2028/12/12
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.06	100,000	99,298	2026/7/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	109,489	2047/7/26
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	112,454	2058/9/27
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	19,771	2022/3/25
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	116,836	2028/3/17

当 期 銘 柄 名	期 末		
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	106,198
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.042	100,000	107,437
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	20,836
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	130,999
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	126,557
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	100,000	111,881
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	111,128
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	96,839
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	98,522
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.878	200,000	196,448
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,244
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,640
第63回日本電信電話株式会社電信債券	0.69	200,000	202,708
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,989
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,831
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	101,729
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	108,967
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	102,935
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	99,799
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,283
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,525
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	101,958
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,692
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	100,000	100,702
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	200,000	199,300
第20回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.16	100,000	99,346

当 期 銘 柄 名	期 末		
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)
第24回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.384	100,000	98,562
第29回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.25	300,000	294,594
第1回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.64	100,000	99,934
第2回B・P・C・E・S・A円貨社債（ソーシャルボンド）	0.367	100,000	99,294
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	99,471
第14回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,258
第15回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,529
第17回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,478
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	400,000	399,620
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.202	200,000	199,688
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	99,535
第1回HSBC・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	0.45	100,000	99,821
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	2.45	200,000	204,640
第12回ウェストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	398,256
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,607
小 計		22,366,000	22,648,161
合 計		503,269,250	542,707,286

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 542,707,286	% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,366,250	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	556,073,536	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年5月29日現在
(A)資 産	556,173,583,556円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,743,391,241
公 社 債(評価額)	542,707,286,724
未 収 入 金	9,459,139,400
未 収 利 息	1,143,782,560
前 払 費 用	19,936,631
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B)負 債	16,014,280,413
未 払 金	15,848,798,730
未 払 解 約 金	65,428,617
未 払 利 息	6,066
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純 資 産 総 額(A-B)	540,159,303,143
元 本	382,125,773,582
次 期 繰 越 損 益 金	158,033,529,561
(D)受 益 権 総 口 数	382,125,773,582口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,136円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配 当 等 収 益	3,993,324,195円
受 取 利 息	3,994,494,011
支 払 利 息	△1,169,816
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△7,739,893,112
売 買 益	221,216,098
売 買 損	△7,961,109,210
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△3,408,610
取 引 益	17,620,912
取 引 損	△21,029,522
(D)そ の 他 費 用	△1,950
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△3,749,979,477
(F)前 期 繰 越 損 益 金	136,990,780,662
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	41,595,030,113
(H)解 約 差 損 益 金	△16,802,301,737
(I) 計 (E+F+G+H)	158,033,529,561
次 期 繰 越 損 益 金(I)	158,033,529,561

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は325,310,168,792円、期中追加設定元本額は96,281,195,630円、期中一部解約元本額は39,465,590,840円です。

※担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 101,532,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	89,987,093,499円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	71,630,702,303円
DC日本債券インデックス・オープンP	68,684,918,633円
DCマイセクション50	21,921,808,610円
DCマイセクション25	20,736,719,257円
SMT 国内債券インデックス・オープン	18,108,334,758円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,702,516,558円
分散投資コア戦略ファンドA	11,300,905,890円
分散投資コア戦略ファンドS	9,428,922,910円
DCマイセクションS50	9,381,437,203円
DCマイセクションS25	8,976,050,867円
DCマイセクション75	5,935,137,366円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	5,920,306,932円

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

お知らせ

該当事項はありません。

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

第26期～第28期(2020年7月8日～2021年1月7日)

○当ファンドの仕組み

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

○最近15期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み	騰落率	騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
14期(2018年9月7日)	13,810	40	1.9	146.89	2.0	96.1	1.4	2.4	29,857
15期(2018年11月7日)	13,531	25	△ 1.8	144.11	△ 1.9	96.8	0.6	2.4	36,432
16期(2019年1月7日)	12,055	20	△ 10.8	128.83	△ 10.6	95.6	1.8	2.5	39,149
17期(2019年3月7日)	13,555	60	12.9	145.65	13.1	96.5	0.8	2.6	43,824
18期(2019年5月7日)	14,075	30	4.1	151.69	4.1	96.4	0.9	2.6	44,356
19期(2019年7月8日)	14,032	100	0.4	152.43	0.5	95.7	1.6	2.7	47,613
20期(2019年9月9日)	13,654	40	△ 2.4	148.99	△ 2.3	96.0	1.1	2.8	47,978
21期(2019年11月7日)	14,385	35	5.6	157.38	5.6	96.3	1.0	2.7	47,357
22期(2020年1月7日)	15,043	30	4.8	164.96	4.8	95.9	1.3	2.7	44,771
23期(2020年3月9日)	12,858	60	△ 14.1	141.65	△ 14.1	95.3	1.8	2.9	37,378
24期(2020年5月7日)	12,496	25	△ 2.6	138.13	△ 2.5	96.0	0.9	2.5	41,386
25期(2020年7月7日)	14,264	65	14.7	158.43	14.7	96.0	1.5	2.5	46,430
26期(2020年9月7日)	15,021	40	5.6	167.29	5.6	96.3	1.2	2.4	46,454
27期(2020年11月9日)	14,979	30	△ 0.1	167.40	0.1	96.2	1.4	2.3	46,493
28期(2021年1月7日)	16,325	40	9.3	182.84	9.2	96.4	1.4	2.1	48,397

* 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ても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26期	(期 首)	円	%		%	%	%	%
	2020年7月7日	14,264	—	158.43	—	96.0	1.5	2.5
	7月末	14,198	△0.5	157.53	△0.6	96.3	1.2	2.5
	8月末	15,286	7.2	169.89	7.2	95.8	1.0	2.3
	(期 末)							
第27期	2020年9月7日	15,061	5.6	167.29	5.6	96.3	1.2	2.4
	(期 首)							
	2020年9月7日	15,021	—	167.29	—	96.3	1.2	2.4
	9月末	14,645	△2.5	163.23	△2.4	96.3	1.3	2.3
	10月末	14,238	△5.2	158.70	△5.1	96.3	1.3	2.3
第28期	(期 末)							
	2020年11月9日	15,009	△0.1	167.40	0.1	96.2	1.4	2.3
	(期 首)							
	2020年11月9日	14,979	—	167.40	—	96.2	1.4	2.3
	11月末	15,843	5.8	177.10	5.8	95.6	1.5	2.2
第28期	12月末	16,300	8.8	182.22	8.9	96.3	1.5	2.2
	(期 末)							
	2021年1月7日	16,365	9.3	182.84	9.2	96.4	1.4	2.1

*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+15.3%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの+15.4%を0.1ポイント下回りました。新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待が高まったことや米大統領・国会選挙の結果などを受けて、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（投資信託証券と先物を含む）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い、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

【分配金】

収益分配金は、経費控除後の配当等収益の水準等を勘案して決定させていただきました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

【今後の運用方針】

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

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

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年 7 月 8 日～2021年 1 月 7 日)

項 目	第26期～第28期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 13	% 0.089	(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)	(11)	(0.072)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(1)	(0.006)	口座内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(2)	(0.011)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(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)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	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)	(0)	(0.003)	
(新 株 予 約 権 証 券)	(0)	(0.000)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.006	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.004)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	14	0.099	
作成期間の平均基準価額は、15,085円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2020年7月8日～2021年1月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第26期～第28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 354,660	千円 1,064,181	千口 1,888,581	千円 5,892,035

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2020年7月8日～2021年1月7日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第26期～第28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	101,885,805千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	700,031,820千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.14

*(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7月8日～2021年1月7日)

該当事項はございません。

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

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2020年7月8日～2021年1月7日)

第26期首残高 (元本)	設定元本	解約元本	第28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1月7日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第25期末	第28期末	
	口 数	口 数	評 価 額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 15,898,131	千口 14,364,210	千円 48,393,025

*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1月7日現在)

項 目	第28期末	
	評 価 額	比 率
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千円 48,393,025	% 99.7
コール・ローン等、その他	137,312	0.3
投資信託財産総額	48,530,337	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28期末における外貨建て純資産（805,587,897千円）の投資信託財産総額（806,844,599千円）に対する比率は99.8%です。

*外貨建て資産は、第28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=102.99円、1カナダドル=81.29円、1英ポンド=140.28円、1スイスフラン=117.26円、1スウェーデンクローナ=12.61円、1ノルウェークローネ=12.24円、1デンマーククローネ=17.07円、1ユーロ=127.03円、1香港ドル=13.28円、1シンガポールドル=78.18円、1豪ドル=80.27円、1ニュージーランドドル=75.12円、1新シェケル=32.39円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第26期末	第27期末	第28期末
	2020年9月7日現在	2020年11月9日現在	2021年1月7日現在
	円	円	円
(A) 資産	46,651,232,337	46,600,426,476	48,530,337,415
コール・ローン等	27,330,028	18,800,410	18,722,667
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	46,449,535,712	46,488,510,802	48,393,025,841
未収入金	174,366,597	93,115,264	118,588,907
(B) 負債	197,012,812	107,260,246	132,511,542
未払収益分配金	123,703,761	93,115,264	118,588,906
未払解約金	59,129,998	—	—
未払信託報酬	13,918,074	13,884,651	13,666,399
未払利息	38	14	11
その他未払費用	260,941	260,317	256,226
(C) 純資産総額(A-B)	46,454,219,525	46,493,166,230	48,397,825,873
元本	30,925,940,409	31,038,421,427	29,647,226,685
次期繰越損益金	15,528,279,116	15,454,744,803	18,750,599,188
(D) 受益権総口数	30,925,940,409口	31,038,421,427口	29,647,226,685口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,021円	14,979円	16,325円

(注) 第26期首元本額は32,550,908,094円、第26～28期中追加設定元本額は774,130,840円、第26～28期中一部解約元本額は3,677,812,249円、1口当たり純資産額は、第26期1.5021円、第27期1.4979円、第28期1.6325円です。

○損益の状況

項 目	第26期	第27期	第28期
	2020年7月8日～ 2020年9月7日	2020年9月8日～ 2020年11月9日	2020年11月10日～ 2021年1月7日
	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 727	△ 604	△ 540
支払利息	△ 727	△ 604	△ 540
(B) 有価証券売買損益	2,478,693,117	8,615,021	4,117,209,311
売買益	2,549,373,603	23,837,841	4,235,456,742
売買損	△ 70,680,486	△ 15,222,820	△ 118,247,431
(C) 信託報酬等	△ 14,179,015	△ 14,144,968	△ 13,922,625
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,464,513,375	△ 5,530,551	4,103,286,146
(E) 前期繰越損益金	4,172,946,688	6,389,302,094	6,002,096,734
(F) 追加信託差損益金	9,014,522,814	9,164,088,524	8,763,805,214
(配当等相当額)	(11,125,690,860)	(11,314,379,469)	(10,814,820,537)
(売買損益相当額)	(△ 2,111,168,046)	(△ 2,150,290,945)	(△ 2,051,015,323)
(G) 計(D+E+F)	15,651,982,877	15,547,860,067	18,869,188,094
(H) 収益分配金	△ 123,703,761	△ 93,115,264	△ 118,588,906
次期繰越損益金(G+H)	15,528,279,116	15,454,744,803	18,750,599,188
追加信託差損益金	9,014,522,814	9,164,088,524	8,763,805,214
(配当等相当額)	(11,125,773,916)	(11,315,302,114)	(10,815,215,173)
(売買損益相当額)	(△ 2,111,251,102)	(△ 2,151,213,590)	(△ 2,051,409,959)
分配準備積立金	6,513,756,302	6,382,746,999	9,986,793,974
繰越損益金	—	△ 92,090,720	—

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

*損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

○お知らせ

該当事項はございません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

第18期(計算期間：2019年4月2日～2020年3月31日)

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【運用経過】

- (1) 株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じて高位に維持しました。MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させました。MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。
- (2) ベンチマークとしているMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）が11.3%の下落となったのに対して、基準価額は11.6%の下落となりました。

【今後の運用方針】

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

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

*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年4月2日～2020年3月31日)

項 目	当 期		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)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.008	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.008)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	3	0.010	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(3)	(0.009)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	6	0.020	
期中の平均基準価額は、28,483円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2019年4月2日～2020年3月31日)

株式

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

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

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

投資信託証券

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

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ		口 千米ドル		口 千米ドル
	WEYERHAEUSER CO	20,000	511	5,500	165
	小計	541,310 (4,820)	30,390 (-)	59,200	3,630
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	629	-	-
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	-	-	9,000	188
		(25,000)	(535)		
	小計	11,500 (25,000)	629 (535)	9,000	188
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	HAMMERSON PLC	-	-	108,000	300
	SEGRO PLC	31,000	238	-	-
	LAND SECURITIES GROUP PLC	12,000	91	-	-
	小計	43,000	329	108,000	300
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	ICADE	1,400	98	1,300	121
	KLEPIERRE	4,300	88	-	-
	GECINA SA	700	121	-	-
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,300	243	-	-
	小計	8,700	551	1,300	121
	ユーロ計	8,700	551	1,300	121
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	55,000	4,384	13,000	1,056
	小計	55,000	4,384	13,000	1,056
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	70,000	178	60,000	146
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	-	-	-	-
		(60,800)	(170)		
	ASCENDAS REAL ESTATE-RTS	-	-	-	-
		(60,800)	(159)	(60,800)	(20)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,000	138	-	-
	SUNTEC REIT	-	-	-	-
		(-)	(△ 2)		
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	845	-	-
		(-)	(△ 0.09)		
	小計	510,000 (121,600)	1,162 (327)	60,000 (60,800)	146 (20)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	170,000	433	-	-
	GPT GROUP	29,000	178	-	-
	LENDLEASE GROUP	11,000	195	-	-
DEXUS	31,000	390	-	-	
GOODMAN GROUP	27,000	378	-	-	
SCENTRE GROUP	147,000	330	-	-	
VICINITY CENTRES	60,000	159	70,000	171	
小計	475,000	2,067	70,000	171	

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* () 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 104, 098	百万円 105, 073	百万円 －	百万円 －

*単位未満は切り捨て。

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

○株式売買比率

(2019年4月2日～2020年3月31日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	133,290,598千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	580,156,228千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2019年4月2日～2020年3月31日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 112,554	百万円 —	% —	百万円 54,520	百万円 743	% 1.4

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2020年3月31日現在)

外国株式

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

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
APPLIED MATERIALS		1,363	1,436	6,792	739,203	半導体・半導体製造装置
ARAMARK		354	410	864	94,104	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND		755	884	3,167	344,705	食品
ARCONIC INC		570	570	934	101,734	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC		74	81	1,666	181,355	通信機器
ARROW ELECTRS INC		121	121	650	70,740	電子装置・機器・部品
ASSURANT INC		76	90	965	105,126	保険
ATMOS ENERGY CORP		156	184	1,891	205,894	ガス
AUTODESK INC.		300	342	5,332	580,294	ソフトウェア
AUTOLIV INC		119	119	555	60,505	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS		595	679	9,357	1,018,428	情報技術サービス
AUTOZONE		34	36	3,216	350,028	専門小売り
AVERY DENNISON CORP		122	134	1,403	152,788	容器・包装
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC		310	—	—	—	各種金融サービス
BB&T CORPORATION		1,049	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES CO		681	1,010	1,106	120,470	エネルギー設備・サービス
BALL CORP		454	475	3,134	341,130	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP		12,735	13,370	29,467	3,206,945	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP		1,368	1,279	4,348	473,258	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC.		696	755	6,205	675,327	ヘルスケア機器・用品
BECTON, DICKINSON		369	420	9,360	1,018,707	ヘルスケア機器・用品
BEIGENE, LTD ADR		46	63	789	85,971	バイオテクノロジー
WR BERKLEY CORP		130	217	1,182	128,731	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B		1,768	2,055	37,643	4,096,741	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC		338	363	2,168	236,044	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A		—	36	1,270	138,296	ライフサイエンス・ツール/サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		241	280	2,309	251,366	バイオテクノロジー
BIOTEN INC		275	283	8,959	975,021	バイオテクノロジー
BLACK KNIGHT INC		—	242	1,426	155,255	情報技術サービス
BLACKROCK INC		161	181	8,282	901,418	資本市場
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A		—	1,040	4,917	535,130	資本市場
H & R BLOCK INC		279	—	—	—	各種消費者サービス
BOEING CO		739	838	12,761	1,388,786	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC		63	65	8,503	925,435	インターネット販売・通信販売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS		—	226	1,610	175,317	情報技術サービス
BORGWARNER INC		296	296	727	79,181	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP		1,891	2,193	6,938	755,133	ヘルスケア機器・用品
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		139	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUITBB CO		2,222	3,670	19,961	2,172,369	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC		163	179	1,735	188,844	情報技術サービス
BROADCOM INC		565	622	14,934	1,625,358	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC		—	388	1,447	157,503	保険
BROWN-FORMAN CORP-CL B		356	478	2,706	294,593	飲料
BURLINGTON STORES INC		89	105	1,706	185,725	専門小売り
CBS CORP-CL B		470	—	—	—	メディア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		150	179	1,665	181,227	資本市場
CBRE GROUP INC		455	483	1,981	215,673	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC		167	200	683	74,330	ソフトウェア
CDW CORPORATION		211	224	2,170	236,246	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		314	353	939	102,266	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		183	201	1,310	142,602	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP		519	580	10,339	1,125,202	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC		134	—	—	—	銀行
CME GROUP INC		488	562	9,778	1,064,165	資本市場

銘柄	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	
CMS ENERGY CORP	378	433	2,682	291,882	総合公益事業
CSX CORP	1,090	1,162	6,741	733,723	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,781	2,040	12,174	1,324,974	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	585	640	1,120	121,959	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	378	446	2,984	324,768	ソフトウェア
CAMPBELL SOUP CO	248	248	1,153	125,583	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	656	723	3,894	423,871	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	410	443	2,145	233,537	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	239	261	1,455	158,355	専門小売り
CARNIVAL CORP	586	621	794	86,506	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	811	868	9,696	1,055,262	機械
CELANESE CORP-SERIES A	180	196	1,452	158,060	化学
CELGENE CORP	962	—	—	—	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	558	921	5,315	578,441	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	704	754	1,223	133,179	総合公益事業
CENTURYLINK INC	1,360	1,480	1,456	158,491	各種電気通信サービス
CERNER CORP	406	499	3,205	348,862	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	217	235	10,633	1,157,287	メディア
CHEMOURS CO/THE	234	—	—	—	化学
CHENIERE ENERGY INC	286	364	1,184	128,904	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	2,619	2,960	21,297	2,317,774	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	33	41	2,636	286,949	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	329	375	2,430	264,497	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	138	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	216	246	1,961	213,481	保険
CISCO SYSTEMS	6,163	6,638	26,764	2,912,771	通信機器
CINTAS CORP	127	134	2,418	263,154	商業サービス・用品
CITIGROUP	3,345	3,421	15,079	1,641,131	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	639	700	1,375	149,695	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	185	199	2,903	315,999	ソフトウェア
CLOROX CO	177	193	3,367	366,481	家庭用品
COCA COLA CO	5,520	6,368	28,656	3,118,632	飲料
COGNEX CORP	248	278	1,263	137,538	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	804	866	4,103	446,541	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,127	1,265	8,422	916,606	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	6,220	7,104	25,212	2,743,832	メディア
COMERICA INC	230	230	713	77,670	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	228	—	—	—	通信機器
CONAGRA BRANDS INC	667	769	2,170	236,257	食品
CONCHO RESOURCES INC	276	310	1,273	138,592	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,586	1,710	5,008	545,084	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	423	525	4,238	461,256	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	228	259	3,792	412,769	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	139	139	107	11,663	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	65	75	2,123	231,104	ヘルスケア機器・用品
COPART INC	279	319	2,291	249,405	商業サービス・用品
CORNING INC	1,080	1,190	2,532	275,592	電子装置・機器・部品
CORTEVA INC	—	1,150	2,770	301,497	化学
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	597	691	20,133	2,191,167	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	51	58	3,485	379,375	専門サービス
COTY INC-CL A	650	490	265	28,849	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	191	212	1,240	135,017	容器・包装
CUMMINS INC	205	226	3,039	330,761	機械
DR HORTON INC	480	538	1,981	215,700	家庭用耐久財

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
DTE ENERGY COMPANY		251	305	3,032	330,039	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO		378	378	545	59,402	情報技術サービス
DANAHER CORP		860	981	13,814	1,503,425	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC		166	198	1,125	122,502	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC		175	148	1,130	123,072	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY		422	471	6,651	723,929	機械
DELL TECHNOLOGIES-C		207	266	1,058	115,216	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC		224	252	722	78,627	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC		303	352	1,379	150,167	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP		624	624	396	43,122	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC		116	144	4,025	438,088	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC		216	231	544	59,304	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO	2,459	2,820	28,143	3,062,867		娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		463	496	1,864	202,909	消費者金融
DISCOVERY INC - A		193	245	490	53,353	メディア
DISCOVERY INC - C		398	570	1,023	111,349	メディア
DISH NETWORK CORP-A		319	371	769	83,699	メディア
DOCUSIGN INC		—	166	1,463	159,231	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP		361	397	5,826	634,127	複合小売り
DOLLAR TREE INC		324	376	3,002	326,746	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	1,024	1,278	9,816	1,068,309		総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC		52	59	2,045	222,647	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP		197	229	1,961	213,432	機械
DOW INC		—	1,152	3,300	359,191	化学
DOWDUPONT INC	3,141	—	—	—	—	化学
DROPBOX INC-CLASS A		—	390	707	77,035	ソフトウェア
DUKE ENERGY CORP	973	1,138	9,497	1,033,639		電力
DUPONT DE NEMOURS INC		—	1,150	3,866	420,769	化学
EOG RESOURCES INC	800	904	3,162	344,141		石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	350	350	1,235	134,497		資本市場
EAST WEST BANCORP INC	207	207	556	60,577		銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	186	208	990	107,773		化学
EATON VANCE CORP	164	164	553	60,290		資本市場
EBAY INC	1,237	1,200	3,742	407,328		インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC	360	401	6,472	704,362		化学
EDISON INTERNATIONAL	450	555	3,125	340,116		電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	284	325	6,371	693,459		ヘルスケア機器・用品
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	361	600	1,355	147,508		医薬品
ELECTRONIC ARTS	408	461	4,503	490,116		娯楽
EMERSON ELEC	861	938	4,373	476,010		電気設備
ENTERGY CORP	254	313	3,132	340,876		電力
EPAM SYSTEMS INC	—	84	1,581	172,065		情報技術サービス
EQUIFAX INC	161	185	2,258	245,830		専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	620	958	104,315		各種金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	37	645	70,201		保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	349	1,502	163,511		水道
EVERGY INC	372	359	2,122	230,942		電力
EVERSOURCE ENERGY	442	503	4,207	457,912		電力
EXACT SCIENCES CORP	—	226	1,320	143,711		バイオテクノロジー
EXELON CORPORATION	1,322	1,515	5,640	613,838		電力
EXPEDIA GROUP INC	173	207	1,167	127,034		インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	230	273	1,828	198,971		航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	5,784	6,621	24,828	2,702,112		石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	178	207	665	72,404		電子装置・機器・部品

銘柄	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		
FMC CORP	180	196	1,619	176,276	化学	
FACEBOOK INC-A	3,283	3,761	62,413	6,792,493	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	59	1,586	172,710	資本市場	
FASTENAL CO	387	874	2,779	302,473	商社・流通業	
FEDEX CORPORATION	344	391	4,860	528,970	航空貨物・物流サービス	
F5 NETWORKS INC	81	93	1,021	111,140	通信機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	451	964	12,077	1,314,443	情報技術サービス	
FNF GROUP	372	405	1,069	116,361	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	1,063	1,120	1,776	193,377	銀行	
FIRST DATA CORP- CLASS A	740	—	—	—	情報技術サービス	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	226	257	2,220	241,654	銀行	
FISERV INC	541	908	8,928	971,673	情報技術サービス	
FIRSTENERGY CORP	714	834	3,376	367,504	電力	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	121	138	2,677	291,389	情報技術サービス	
FLUOR CORP	184	—	—	—	建設・土木	
FLOWSERVE CORP	172	206	463	50,420	機械	
FORD MOTOR COMPANY	5,160	6,070	3,053	332,280	自動車	
FORTINET INC	199	228	2,301	250,489	ソフトウェア	
FORTIVE CORP	406	476	2,479	269,894	機械	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	194	216	961	104,630	建設関連製品	
FOX CORP-CLASS A	480	528	1,283	139,690	メディア	
FOX CORP-CLASS B	198	254	603	65,706	メディア	
FRANKLIN RESOURCES INC	434	434	770	83,884	資本市場	
FREEPORT-MCMORAN INC	1,870	2,250	1,404	152,797	金属・鉱業	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	249	297	2,471	268,987	保険	
GAP INC	315	315	233	25,436	専門小売り	
GARTNER INC	127	141	1,520	165,434	情報技術サービス	
GENERAL DYNAMICS	345	383	5,116	556,870	航空宇宙・防衛	
GENERAL ELEC CO	11,980	13,550	10,690	1,163,496	コングロマリット	
GENERAL MILLS	805	943	5,101	555,210	食品	
GENERAL MOTORS CO	1,757	1,990	4,242	461,730	自動車	
GENUINE PARTS CO	196	232	1,533	166,842	販売	
GILEAD SCIENCES INC	1,762	1,982	15,049	1,637,818	バイオテクノロジー	
GLOBAL PAYMENTS INC	212	473	7,153	778,480	情報技術サービス	
GLOBE LIFE INC	—	157	1,165	126,814	保険	
GODADDY INC - CLASS A	227	269	1,591	173,192	情報技術サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP	457	501	7,996	870,309	資本市場	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	340	—	—	—	自動車部品	
GRAINGER(W.W.) INC	64	70	1,785	194,368	商社・流通業	
GRUBHUB INC	119	145	573	62,411	インターネット販売・通信販売	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	121	1,005	109,403	ソフトウェア	
HCA HEALTHCARE INC	375	424	3,856	419,725	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	229	268	740	80,616	商社・流通業	
HP INC	2,190	2,320	4,138	450,434	コンピュータ・周辺機器	
HALLIBURTON CO	1,196	1,280	815	88,735	エネルギー設備・サービス	
HANESBRANDS INC	510	510	411	44,735	繊維・アパレル・贅沢品	
HARLEY-DAVIDSON INC	224	224	401	43,685	自動車	
HARRIS CORP	160	—	—	—	航空宇宙・防衛	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	482	545	1,953	212,575	保険	
HASBRO INC	158	196	1,401	152,471	レジャー用品	
HEICO CORP	—	63	484	52,718	航空宇宙・防衛	
HEICO CORP-CLASS A	—	124	818	89,079	航空宇宙・防衛	
HELMERICH & PAYNE	146	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	106	117	1,825	198,700	情報技術サービス	

銘柄	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	
HERSHEY CO/THE	190	235	3,237	352,373	食品
HESS CORP	366	432	1,379	150,117	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,000	2,020	2,030	220,935	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	395	416	2,857	310,936	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	236	236	614	66,829	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	408	433	1,515	164,931	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,548	1,706	33,454	3,640,870	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,009	1,120	14,756	1,605,895	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	391	456	2,133	232,152	食品
HUMANA INC	185	204	6,377	694,020	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	118	132	1,234	134,404	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,410	1,540	1,289	140,363	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	56	65	1,232	134,079	航空宇宙・防衛
IAC/INTERACTIVE CORP	104	126	2,268	246,840	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IPG PHOTONICS CORP	47	59	644	70,116	電子装置・機器・部品
IDEX CORP	103	123	1,683	183,228	機械
IDEXX LABORATORIES INC	121	136	3,277	356,730	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	405	500	7,117	774,597	機械
ILLUMINA INC	201	228	6,320	687,821	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	249	285	2,056	223,846	バイオテクノロジー
INGERSOLL-RAND INC	—	528	1,254	136,581	機械
INGREDION INC	96	96	741	80,739	食品
INSULET CORP	—	98	1,710	186,195	ヘルスケア機器・用品
INTEL CORP	6,256	6,802	37,744	4,107,711	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	785	876	7,341	799,003	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,244	1,388	15,674	1,705,875	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	115	155	1,674	182,198	化学
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	523	598	1,873	203,896	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	500	580	939	102,256	メディア
INTUIT INC	337	404	9,617	1,046,642	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	155	181	9,151	995,967	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	214	1,031	112,279	バイオテクノロジー
IQVIA HOLDINGS INC	224	252	2,847	309,849	ライフサイエンス・ツール/サービス
JPMORGAN CHASE & CO	4,544	4,903	45,843	4,989,099	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	179	200	1,559	169,753	建設・土木
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	420	430	602	65,515	各種金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	3,665	4,114	54,720	5,955,211	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	63	76	816	88,864	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	467	530	1,073	116,801	通信機器
KLA CORP	219	244	3,648	397,043	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC-A	680	784	1,922	209,211	資本市場
KANSAS CITY SOUTHERN	142	151	1,953	212,614	陸運・鉄道
KELLOGG CO	356	400	2,436	265,153	食品
KEYCORP	1,460	1,580	1,704	185,535	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	252	289	2,475	269,416	電子装置・機器・部品
KIMBERLY-CLARK CORP	469	533	7,058	768,178	家庭用品
KINDER MORGAN INC	2,730	3,150	4,180	454,914	石油・ガス・消耗燃料
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	167	208	692	75,357	陸運・鉄道
KOHL'S CORP	225	253	405	44,136	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	847	1,041	2,620	285,156	食品
KROGER CO	1,076	1,269	3,762	409,482	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	303	—	—	—	専門小売り
LKQ CORP	450	450	945	102,844	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	109	—	—	—	航空宇宙・防衛

銘柄	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	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	344	6,259	681,213	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	142	149	1,966	213,965	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	212	224	5,718	622,368	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	193	217	1,250	136,123	食品
LAS VEGAS SANDS CORP	549	538	2,339	254,636	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	299	344	5,683	618,580	パーソナル用品
LEAR CORP	93	84	743	80,949	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	189	189	530	57,736	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	200	215	2,008	218,611	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	407	430	1,718	187,000	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	51	954	103,891	建設関連製品
LIBERTY BROADBAND CORP-C	139	167	1,904	207,263	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	129	129	390	42,482	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	224	267	815	88,800	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	293	293	778	84,756	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,224	1,353	18,730	2,038,487	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	299	299	815	88,769	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	208	230	1,040	113,214	娯楽
LOCKHEED MARTIN	349	397	13,880	1,510,641	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	361	433	1,534	166,958	保険
LOWES COS INC	1,098	1,205	10,689	1,163,344	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	138	172	3,335	363,031	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	179	200	2,138	232,678	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	700	790	910	99,129	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	120	131	3,865	420,666	資本市場
MACYS INC	437	—	—	—	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	80	96	529	57,650	専門サービス
MARATHON OIL CORP	1,110	1,230	398	43,370	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	946	985	2,396	260,811	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	18	21	2,017	219,519	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	58	2,051	223,287	資本市場
MARSH & MCLENNAN COS	691	794	7,110	773,810	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	394	432	3,290	358,062	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	89	97	1,741	189,510	建設資材
MASCO CORP	428	428	1,509	164,284	建設関連製品
MASTERCARD INC	1,259	1,403	35,553	3,869,316	情報技術サービス
MATCH GROUP INC	—	84	560	60,947	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MATTEL INC	480	—	—	—	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	374	424	2,116	230,304	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	168	189	2,705	294,443	食品
MCDONALD'S CORP	1,056	1,179	19,822	2,157,285	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	270	256	3,533	384,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	340	340	423	46,141	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	57	69	3,270	355,921	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	3,564	3,983	30,649	3,335,550	医薬品
METLIFE INC	1,159	1,206	3,862	420,390	保険
METTLER-TOLEDO INTL	34	38	2,659	289,417	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	9,970	11,321	181,396	19,741,368	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	330	373	2,573	280,055	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,545	1,740	7,746	843,049	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	75	87	495	53,968	機械
MOHAWK INDUSTRIES	87	87	697	75,887	家庭用耐久財
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	256	284	1,144	124,558	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,985	2,259	11,550	1,257,015	食品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
MONGODB INC		—	74	1,009	109,872	情報技術サービス
MONSTER BEVERAGE CORP		559	638	3,700	402,714	飲料
MOODYS CORP		235	268	5,955	648,136	資本市場
MORGAN STANLEY		1,753	1,910	6,654	724,202	資本市場
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		450	450	199	21,744	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE		488	560	560	60,944	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC		221	268	3,574	388,992	通信機器
NRG ENERGY INC		400	405	1,152	125,396	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NVR INC		4	5	1,517	165,127	家庭用耐久財
NASDAQ INC		154	184	1,829	199,125	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC		506	580	545	59,334	エネルギー設備・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS		250	—	—	—	医薬品
NETAPP INC		352	352	1,433	155,990	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC		595	685	25,440	2,768,682	娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		—	142	1,300	141,541	バイオテクノロジー
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		1,610	1,840	697	75,893	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		307	354	1,663	181,071	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		300	333	690	75,198	コングロマリット
NEWELL BRANDS INC		670	660	900	97,973	家庭用耐久財
NEWMONT CORP		717	1,276	5,915	643,787	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I		550	550	485	52,793	メディア
NEXTERA ENERGY INC		651	765	18,819	2,048,155	電力
NIKE INC-B		1,742	1,952	16,666	1,813,779	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC		476	582	1,517	165,188	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC		644	710	377	41,029	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC		150	150	236	25,760	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP		371	403	5,976	650,377	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP		284	321	2,432	264,768	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP		223	251	7,893	859,016	航空宇宙・防衛
NORTONLIFELOCK INC		—	980	1,871	203,707	ソフトウェア
NUCOR CORP		427	467	1,630	177,476	金属・鉱業
NVIDIA CORP		796	909	24,166	2,629,989	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP		286	325	1,036	112,829	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,		110	119	3,808	414,504	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP		1,029	1,420	1,563	170,146	石油・ガス・消耗燃料
OKTA INC		—	165	2,061	224,354	情報技術サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE		86	153	2,060	224,238	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP		303	345	1,894	206,204	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION		590	590	765	83,279	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC		560	670	1,342	146,123	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION		3,631	3,598	18,119	1,971,948	ソフトウェア
OWENS CORNING INC		142	168	669	72,914	建設関連製品
PNC FINANCIAL		627	689	6,956	757,112	銀行
PPG INDUSTRIES		326	368	3,161	344,104	化学
PPL CORPORATION		976	1,148	2,965	322,711	電力
PVH CORP		99	116	443	48,249	繊維・アパレル・贅沢品
PTC INC		147	170	1,007	109,656	ソフトウェア
PACCAR		478	538	3,350	364,594	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA		132	145	1,316	143,222	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC		126	152	2,530	275,377	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP		181	201	2,620	285,138	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		370	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PAYCHEX INC		450	505	3,253	354,046	情報技術サービス
PAYCOM SOFTWARE INC		—	75	1,606	174,881	ソフトウェア

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額	期末	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,526	1,747	16,951	1,844,792	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	500	710	817	88,936	銀行
PEPSICO INC	1,926	2,182	27,379	2,979,736	飲料
PERKINELMER INC	—	174	1,331	144,882	ライフサイエンス・ツール/サービス
PFIZER INC	7,924	8,658	28,285	3,078,331	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,121	2,437	17,680	1,924,161	タバコ
PHILLIPS 66	594	703	3,807	414,364	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	154	170	1,332	144,974	電力
PINTEREST INC- CLASS A	—	460	709	77,195	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	232	261	1,735	188,862	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	190	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INC	83	83	391	42,608	レジャー用品
T ROWE PRICE GROUP INC	324	366	3,617	393,657	資本市場
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	380	444	1,474	160,472	保険
PROCTER & GAMBLE CO	3,403	3,899	44,838	4,879,773	家庭用品
PROGRESSIVE CO	808	920	7,008	762,741	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	572	630	3,386	368,525	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	695	781	3,476	378,318	総合公益事業
PULTEGROUP INC	379	379	900	98,001	家庭用耐久財
QORVO INC	176	176	1,434	156,067	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,655	1,791	12,363	1,345,495	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	191	205	1,702	185,308	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QURATE RETAIL INC - A	580	—	—	—	インターネット販売・通信販売
RPM INTERNATIONAL INC	—	211	1,289	140,304	化学
RALPH LAUREN CORPORATION	78	78	555	60,490	繊維・アパレル・贅沢品
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	177	196	1,262	137,369	資本市場
RAYTHEON COMPANY	394	433	6,114	665,429	航空宇宙・防衛
RED HAT INC	243	—	—	—	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	110	127	6,030	656,326	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,390	1,500	1,425	155,082	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	90	90	782	85,135	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	308	343	2,629	286,124	商業サービス・用品
RESMED INC	192	225	3,469	377,610	ヘルスケア機器・用品
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	119	2,713	295,316	ソフトウェア
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	171	689	75,016	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	168	178	2,710	294,954	電気設備
ROKU INC	—	142	1,272	138,482	娯楽
ROLLINS INC	210	239	856	93,221	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	143	164	5,209	566,951	コングロマリット
ROSS STORES INC	505	561	4,761	518,162	専門小売り
S&P GLOBAL INC	344	384	9,484	1,032,188	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	191	191	887	96,532	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	306	367	1,604	174,660	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	74	81	1,261	137,323	銀行
SABRE CORP	360	420	261	28,476	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC	1,043	1,304	19,540	2,126,586	ソフトウェア
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	112	1,103	120,085	バイオテクノロジー
HENRY SCHEIN INC	205	231	1,203	130,952	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,911	2,140	2,841	309,286	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,662	1,797	6,169	671,383	資本市場
SEALED AIR CORP	219	219	563	61,324	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	154	187	2,155	234,629	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	371	436	5,231	569,351	総合公益事業
SERVICENOW INC	248	296	8,485	923,502	ソフトウェア

銘柄	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		
SHERWIN-WILLIAMS	116	129	6,230	678,017	化学	
SIGNATURE BANK	76	89	738	80,412	銀行	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,290	2,290	1,101	119,875	メディア	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	238	272	2,450	266,741	半導体・半導体製造装置	
SMITH (A. O.) CORP	186	218	841	91,578	建設関連製品	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	159	174	1,924	209,493	食品	
SNAP-ON INC	74	84	949	103,328	機械	
SNAP INC-A	—	1,170	1,386	150,887	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
SOUTHERN CO.	1,402	1,647	9,550	1,039,430	電力	
SOUTHWEST AIRLINES	198	198	694	75,634	旅客航空輸送業	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	146	146	354	38,531	航空宇宙・防衛	
SPLUNK INC	197	237	3,015	328,134	ソフトウェア	
SPRINT CORP	1,090	1,290	1,088	118,489	無線通信サービス	
SQUARE INC - A	418	531	2,920	317,838	情報技術サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	211	239	2,399	261,092	機械	
STARBUCKS CORP	1,696	1,852	12,567	1,367,739	ホテル・レストラン・レジャー	
STATE STREET CORP	522	559	2,893	314,947	資本市場	
STEEL DYNAMICS	334	334	729	79,350	金属・鉱業	
STRYKER CORP	465	529	8,620	938,178	ヘルスケア機器・用品	
SUNTRUST BKS INC.	607	—	—	—	銀行	
SYMANTEC CORP	830	—	—	—	ソフトウェア	
SYNOPSYS INC	207	239	3,090	336,340	ソフトウェア	
SYNCHRONY FINANCIAL	872	940	1,576	171,557	消費者金融	
SYSCO CORP	678	758	3,513	382,355	食品・生活必需品小売り	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	379	412	1,460	158,905	資本市場	
TJX COS INC	1,696	1,898	9,024	982,189	専門小売り	
T-MOBILE US INC	472	530	4,405	479,435	無線通信サービス	
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	102	—	—	—	ソフトウェア	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	157	181	2,145	233,443	娯楽	
TAPESTRY INC	383	450	594	64,693	繊維・アパレル・贅沢品	
TARGET CORP	686	788	7,565	823,362	複合小売り	
TARGA RESOURCES CORP	299	348	225	24,541	石油・ガス・消耗燃料	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	57	1,704	185,483	航空宇宙・防衛	
TELEFLEX INC	63	71	2,058	224,053	ヘルスケア機器・用品	
TERADYNE INC	—	250	1,381	150,294	半導体・半導体製造装置	
TESLA INC	175	212	10,650	1,159,058	自動車	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,330	1,670	1,421	154,665	医薬品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,314	1,465	14,945	1,626,565	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	335	335	926	100,879	航空宇宙・防衛	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	548	628	17,895	1,947,565	ライフサイエンス・ツール/サービス	
3M CORP	797	902	12,424	1,352,120	コングロマリット	
TIFFANY & CO	144	169	2,171	236,322	専門小売り	
TORCHMARK CORP	140	—	—	—	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	222	—	—	—	情報技術サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	163	178	1,522	165,725	専門小売り	
TRANSDIGM GROUP INC	63	76	2,625	285,729	航空宇宙・防衛	
TRUNSONIC	253	290	1,977	215,180	専門サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	367	408	4,185	455,526	保険	
TRIMBLE INC	349	388	1,203	131,027	電子装置・機器・部品	
TRIPADVISOR INC	146	146	260	28,393	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
TRUIST FINANCIAL CORP	—	2,085	6,788	738,820	銀行	
TWILIO INC - A	—	186	1,804	196,351	情報技術サービス	
TWITTER INC	942	1,147	2,935	319,434	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	61	1,834	199,696	ソフトウェア	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
TYSON FOODS INC-CL A		410	469	2, 774	301, 909	食品
UGI CORP		227	309	831	90, 494	ガス
US BANCORP		2, 112	2, 305	8, 268	899, 810	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC		—	655	1, 822	198, 382	陸運・鉄道
ULTA BEAUTY INC		78	85	1, 527	166, 241	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		240	240	229	24, 996	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		250	250	210	22, 881	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP		1, 005	1, 088	15, 253	1, 660, 066	陸運・鉄道
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC		92	92	277	30, 197	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		946	1, 099	10, 752	1, 170, 207	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC		112	112	1, 065	115, 990	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES		1, 128	1, 286	12, 665	1, 378, 420	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP		63	—	—	—	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC		1, 313	1, 482	37, 239	4, 052, 796	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		118	118	1, 181	128, 586	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP		312	312	497	54, 124	保険
V F CORP		454	525	3, 136	341, 386	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC		54	60	893	97, 267	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP		580	628	2, 963	322, 521	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		129	142	1, 472	160, 287	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		167	207	3, 269	355, 804	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC		147	162	3, 054	332, 422	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS		5, 643	6, 468	35, 425	3, 855, 328	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC		219	242	3, 554	386, 809	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS		350	404	9, 369	1, 019, 690	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B		502	—	—	—	娯楽
VIACOMCBS INC-CLASS B		—	880	1, 239	134, 892	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES		2, 404	2, 678	44, 339	4, 825, 483	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP		482	590	947	103, 120	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A		116	130	1, 566	170, 510	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC		217	217	899	97, 936	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO		186	208	2, 118	230, 576	建設資材
WABCO HOLDINGS INC		70	81	1, 094	119, 111	機械
WEC ENERGY GROUP INC		435	498	4, 576	498, 019	総合公益事業
WABTEC CORP		179	288	1, 417	154, 270	機械
WALMART INC		1, 989	2, 225	25, 629	2, 789, 288	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		1, 101	1, 182	5, 337	580, 924	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC		368	403	3, 118	339, 420	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC		578	668	6, 319	687, 727	商業サービス・用品
WATERS CORP		106	103	1, 937	210, 895	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A		75	86	447	48, 678	インターネット販売・通信販売
WELLCARE HEALTH PLANS INC		70	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WELLS FARGO CO		6, 129	6, 291	18, 822	2, 048, 471	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		—	118	1, 791	194, 953	ヘルスケア機器・用品
WESTERN DIGITAL CORP		383	476	2, 071	225, 395	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO		590	660	1, 248	135, 826	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP		50	50	189	20, 606	化学
WESTROCK CO		342	387	1, 122	122, 139	容器・包装
WHIRLPOOL CORP		93	94	824	89, 727	家庭用耐久財
WILLIAMS COS		1, 681	1, 910	2, 639	287, 269	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A		207	254	3, 487	379, 535	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A		407	—	—	—	情報技術サービス
WYNN RESORTS LTD		138	155	947	103, 067	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC		180	143	735	80, 038	航空貨物・物流サービス

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

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

銘柄	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
			千カナダドル			
(カナダ)	百株	百株				
GREAT-WEST LIFE CO INC	—	420	987	75,604	保険	
HUSKY ENERGY INC	520	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
HUSKY ENERGY INC	—	520	166	12,786	石油・ガス・消耗燃料	
HYDRO ONE LTD	420	490	1,236	94,735	電力	
IGM FINANCIAL INC	103	150	350	26,875	資本市場	
IA FINANCIAL CORP INC	147	183	780	59,757	保険	
IMPERIAL OIL	375	375	557	42,685	石油・ガス・消耗燃料	
INTACT FINANCIAL CORP	189	215	2,483	190,249	保険	
INTER PIPELINE LTD	520	600	470	36,032	石油・ガス・消耗燃料	
KEYERA CORP	285	340	398	30,523	石油・ガス・消耗燃料	
KINROSS GOLD CORP	1,740	1,980	1,140	87,360	金属・鉱業	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	441	1,908	146,202	金属・鉱業	
LOBLAW COMPANIES	261	285	1,970	150,939	食品・生活必需品小売り	
LUNDIN MINING CORP	950	950	477	36,603	金属・鉱業	
MAGNA INTERNATIONAL INC	445	451	2,028	155,390	自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,750	3,030	5,151	394,566	保険	
METHANEX CORP	86	86	147	11,310	化学	
METRO INC	334	396	2,250	172,385	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	460	523	2,721	208,441	銀行	
NUTRIEN LTD	831	900	4,134	316,710	化学	
ONEX CORPORATION	109	132	673	51,567	各種金融サービス	
OPEN TEXT CORP	354	417	2,023	155,015	ソフトウェア	
OVINTIV INC	—	410	141	10,803	石油・ガス・消耗燃料	
PARKLAND FUEL CORP	—	217	543	41,638	石油・ガス・消耗燃料	
PEMBINA PIPELINE CORP	706	880	2,081	159,419	石油・ガス・消耗燃料	
POWER CORPORATION OF CANADA	460	869	1,868	143,131	保険	
POWER FINANCIAL CORP	325	—	—	—	保険	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	310	310	218	16,764	石油・ガス・消耗燃料	
QUEBECOR INC-CL B	—	270	844	64,713	メディア	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	320	433	2,468	189,122	ホテル・レストラン・レジャー	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	502	555	3,174	243,174	無線通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	1,962	2,248	19,063	1,460,228	銀行	
SNC-LAVALIN GROUP INC	252	—	—	—	建設・土木	
SAPUTO INC	321	366	1,218	93,330	食品	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	370	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	630	770	1,711	131,116	メディア	
SHOPIFY INC - CLASS A	122	163	9,967	763,531	情報技術サービス	
STARS GROUP INC/THE	230	380	978	74,953	ホテル・レストラン・レジャー	
SUN LIFE FINANCIAL INC	838	923	4,079	312,501	保険	
SUNCOR ENERGY INC	2,180	2,440	4,628	354,556	石油・ガス・消耗燃料	
TC ENERGY CORP	—	1,470	8,565	656,131	石油・ガス・消耗燃料	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	680	820	801	61,430	金属・鉱業	
TELUS CORP	293	586	1,257	96,328	各種電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	282	317	2,987	228,859	専門サービス	
TORONTO DOMINION BANK	2,495	2,841	16,608	1,272,210	銀行	
TOURMALINE OIL CORP	330	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
TRANSCANADA CORP	1,257	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,260	—	—	—	金属・鉱業	
VERMILION ENERGY INC	185	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
WSP GLOBAL INC	132	157	1,186	90,906	建設・土木	
WEST FRASER TIMBER	84	84	224	17,186	紙製品・林産品	
WESTON(GEORGE)LTD	107	123	1,216	93,191	食品・生活必需品小売り	

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		630	716	2,826	216,475	金属・鉱業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	58,286	62,765	234,126	17,934,123	
		89	84	—	<3.2%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC		590	590	431	57,562	金属・鉱業
ASHTAD GROUP PLC		680	687	1,121	149,567	商社・流通業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		1,450	1,590	708	94,436	家庭用耐久財
AVIVA PLC		5,420	6,040	1,617	215,646	保険
DIAGEO PLC		3,319	3,681	9,476	1,263,438	飲料
SCHRODERS PLC		158	197	496	66,185	資本市場
DCC PLC		128	160	828	110,495	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC		4,410	5,020	2,552	340,255	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		3,125	3,597	9,478	1,263,619	タバコ
HALMA PLC		—	590	1,103	147,091	電子装置・機器・部品
STANDARD CHARTERED PLC		3,830	4,140	1,885	251,410	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		1,295	1,490	1,986	264,796	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		27,340	31,810	14,716	1,962,056	銀行
LEGAL & GENERAL		8,080	9,400	1,807	240,929	保険
MEGGITT PLC		1,110	1,110	298	39,808	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS		3,150	3,700	674	89,975	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		494	541	942	125,715	食品
PEARSON		1,090	1,260	706	94,204	メディア
PERSIMMON PLC		426	480	875	116,756	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC		3,550	4,100	4,110	547,978	保険
RIO TINTO PLC-REG		1,578	1,749	6,425	856,691	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC		700	810	610	81,445	資本市場
SSE PLC		1,370	1,650	2,085	278,052	電力
BP PLC		27,490	31,780	10,284	1,371,063	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC		97,300	110,500	3,701	493,517	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		4,500	5,000	586	78,192	家庭用耐久財
TESCO PLC		13,620	15,300	3,566	475,476	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		1,230	1,370	1,972	262,922	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC		6,760	7,820	11,589	1,545,077	医薬品
WEIR GROUP PLC		370	380	253	33,750	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC		390	—	—	—	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC		1,727	2,055	14,596	1,946,027	医薬品
BT GROUP PLC		11,450	12,900	1,540	205,381	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC		229	229	208	27,758	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC		2,080	3,100	306	40,899	複合小売り
BARCLAYS PLC		23,700	27,400	2,575	343,378	銀行
INTERTEK GROUP PLC		216	256	1,186	158,123	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		550	660	864	115,268	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC		198	198	784	104,639	複合小売り
KINGFISHER PLC		3,080	3,080	439	58,534	専門小売り
ITV PLC		5,000	5,000	311	41,582	メディア
SAINSBURY		2,550	2,550	536	71,460	食品・生活必需品小売り
G4S PLC		2,190	2,190	191	25,529	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC		270	308	677	90,378	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS		171	195	702	93,590	家庭用耐久財
CENTRICA PLC		7,800	9,200	353	47,074	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		6,170	6,560	8,693	1,158,992	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B		5,107	5,860	7,395	985,944	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE		444	500	777	103,622	商社・流通業
RENTOKIL INTIAL PLC		—	2,850	1,100	146,665	商業サービス・用品

銘柄	株数	期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	426	492	3,602	480,275	資本市場
UNILEVER PLC	1,509	1,742	6,995	932,689	パーソナル用品
TUI AG-DI	600	700	256	34,137	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	920	—	—	—	資本市場
EXPERIAN PLC	1,262	1,411	3,313	441,692	専門サービス
MONDI PLC	494	750	1,003	133,836	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	324	370	862	114,984	水道
WHITBREAD PLC	245	211	626	83,491	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	401	520	708	94,491	資本市場
SMITHS GROUP PLC	540	610	680	90,718	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,433	1,600	2,140	285,368	金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,320	1,550	1,183	157,836	資本市場
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	913	1,102	6,832	910,895	家庭用品
RELX PLC	2,710	3,000	5,181	690,730	専門サービス
FRESNILLO PLC	260	—	—	—	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	960	1,060	1,004	133,885	水道
OCADO GROUP PLC	—	720	889	118,644	インターネット販売・通信販売
GLENCORE PLC	15,330	17,000	2,023	269,706	金属・鉱業
WOOD GROUP (JOHN) PLC	860	—	—	—	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC	710	870	435	57,994	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,370	2,770	890	118,654	航空宇宙・防衛
EVRAZ PLC	—	760	172	22,969	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	133	133	31	4,159	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EASYJET PLC	210	210	115	15,454	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	6,500	7,700	903	120,518	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,430	1,750	1,050	139,986	ソフトウェア
WPP PLC	1,690	2,000	1,031	137,532	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	290	290	477	63,638	飲料
AVEVA GROUP PLC	—	112	387	51,664	ソフトウェア
CONVATEC GROUP PLC-WI	2,100	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	2,150	2,510	2,988	398,380	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	580	—	—	—	ソフトウェア
NATIONAL GRID PLC	4,610	5,480	5,228	697,059	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	1,360	—	—	—	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	890	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,590	3,660	815	108,715	資本市場
FERGUSON PLC	325	—	—	—	商社・流通業
BHP GROUP PLC	2,890	3,290	4,007	534,330	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	36,500	42,100	4,813	641,764	無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	237	258	875	116,741	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	—	481	192	25,659	ソフトウェア
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	193	812	108,275	化学
FERGUSON PLC	—	346	1,705	227,414	商社・流通業
M&G PLC	—	3,780	444	59,214	各種金融サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,400	1,620	677	90,365	保険
INFORMA PLC	1,730	1,860	786	104,893	メディア
AUTO TRADER GROUP PLC	1,380	1,410	625	83,332	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	116	948	126,504	機械
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,830	2,190	606	80,875	保険
JD SPORTS FASHION PLC	—	760	348	46,497	専門小売り
CRODA INTERNATIONAL PLC	172	—	—	—	化学
MELROSE INDUSTRIES PLC	6,800	7,300	638	85,158	電気設備

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	化学
JOHNSON MATTHEY PLC		267	302	539	71,949	
小 計	株 数 ・ 金 額	410,536	468,722	209,991	27,996,065	
	銘 柄 数 < 比 率 >	92	93	—	<5.0%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA-REG		7	9	2,070	234,344	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		3	4	896	101,497	食品
SWISSCOM AG-REG		35	40	2,160	244,542	各種電気通信サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		1	1	1,221	138,250	食品
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.15	0.17	1,390	157,429	食品
GIVAUDAN-REG		12	14	4,337	491,054	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		207	235	7,814	884,704	保険
NOVARTIS AG-REG		2,960	3,361	26,148	2,960,280	医薬品
ABB LTD		2,500	2,850	4,742	536,887	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		959	1,098	33,927	3,840,972	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		215	249	915	103,680	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		670	774	2,650	300,114	建設資材
CLARIANT AG-REG		259	320	508	57,546	化学
NESTLE SA-REG		4,184	4,652	46,426	5,255,996	食品
BALOISE HOLDING AG		66	74	922	104,467	保険
TEMENOS AG-REG		84	104	1,284	145,406	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG-REG		76	88	1,518	171,852	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG		14	16	1,130	128,026	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		3,470	3,960	3,167	358,559	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		41	47	886	100,378	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		74	74	274	31,047	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		103	115	4,544	514,477	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		45	51	1,678	190,016	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		12	12	725	82,110	化学
SWISS PRIME SITE-REG		101	114	1,070	121,186	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		58	58	370	41,957	各種金融サービス
DUFREY AG-REG		44	65	194	22,024	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		24	29	1,990	225,371	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		55	61	1,266	143,433	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		30	30	589	66,771	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		73	84	1,108	125,479	海運業
GEBERIT AG-REG		50	56	2,396	271,269	建設関連製品
JULIUS BAER GROUP LTD		310	358	1,181	133,786	資本市場
SWISS RE LTD		414	462	3,247	367,690	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		716	815	4,246	480,706	繊維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG		180	199	3,143	355,842	化学
ALCON INC		—	659	3,211	363,589	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG		5,330	6,010	5,447	616,707	資本市場
VIFOR PHARMA AG		57	67	853	96,595	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	23,443	27,221	181,662	20,566,059	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	39	—	<3.7%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		92	126	5,057	54,673	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		2,210	2,510	16,586	179,295	銀行
SWEDBANK AB		1,260	1,370	14,782	159,796	銀行
SWEDISH MATCH AB		234	260	13,951	150,816	タバコ
SECURITAS AB-B SHS		450	450	4,736	51,198	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		617	715	32,053	346,497	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B		1,180	1,270	15,527	167,847	専門小売り
ERICSSON LM-B		4,170	4,740	37,294	403,151	通信機器

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
TELIA CO AB		3,960	4,300	15,265	165,014	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		450	510	7,494	81,015	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB		248	288	4,968	53,704	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB		389	510	8,774	94,852	機械
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR		97	158	4,392	47,481	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB		105	138	5,662	61,207	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		550	550	2,698	29,174	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B		340	340	4,125	44,600	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES		550	580	7,682	83,043	機械
VOLVO AB-B SHS		2,140	2,340	26,617	287,735	機械
SANDVIK AB		1,510	1,780	25,026	270,539	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		250	250	4,817	52,077	各種金融サービス
HEXAGON AB-B SHS		361	423	17,359	187,660	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS		690	780	10,327	111,637	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B		337	—	—	—	各種金融サービス
ATLAS COPCO AB-A		940	1,045	34,589	373,912	機械
ATLAS COPCO AB-B		529	627	18,139	196,083	機械
BOLIDEN AB		363	—	—	—	金属・鉱業
EPIROC AB - A		920	1,030	10,164	109,873	機械
EPIROC AB - B		580	580	5,738	62,033	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B		817	925	28,203	304,877	家庭用品
BOLIDEN AB		—	440	7,508	81,167	金属・鉱業
KINNEVIK AB - B		—	390	6,312	68,234	各種金融サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A		2,120	2,430	19,371	209,410	銀行
ASSA ABLOY AB-B		1,360	1,590	28,866	312,046	建設関連製品
NORDEA BANK ABP		4,130	5,150	28,041	303,131	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	33,949	38,595	472,136	5,103,793	
	銘柄 数 < 比 率 >	32	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		1,350	1,450	16,363	167,886	銀行
TELENOR ASA		1,020	1,160	17,649	181,082	各種電気通信サービス
EQUINOR ASA		1,610	1,580	18,999	194,934	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		232	262	8,499	87,202	化学
MOWI ASA		620	690	10,746	110,261	食品
NORSK HYDRO		1,840	2,180	4,843	49,699	金属・鉱業
AKER AB ASA		141	180	2,151	22,069	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA		1,150	1,150	10,589	108,645	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		250	310	5,380	55,199	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		129	129	2,394	24,564	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	8,342	9,091	97,616	1,001,546	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG B		145	162	12,198	195,299	飲料
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		8	10	6,050	96,872	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A		5	6	3,468	55,535	海運業
DANSKE BANK AS		970	970	7,119	113,987	銀行
GENMAB A/S		84	100	13,505	216,215	バイオテクノロジー
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		268	298	16,229	259,827	電気設備
H LUNDBECK A/S		105	105	2,025	32,427	医薬品
DSV PANALPINA A S		251	325	19,805	317,086	航空貨物・物流サービス
PANDORA A/S		162	160	3,433	54,971	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S		137	167	8,348	133,656	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		311	337	10,312	165,098	化学
COLOPLAST-B		164	185	17,793	284,870	ヘルスケア機器・用品

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
NOVO NORDISK A/S-B		2,475	2,772	112,224	1,796,712	医薬品
ISS A/S		218	218	1,973	31,600	商業サービス・用品
TRYG A/S		160	199	3,275	52,441	保険
ORSTED A/S		254	300	20,250	324,202	電力
DEMANT A/S		130	160	2,342	37,501	ヘルスケア機器・用品
小 計		5,848	6,474	260,356	4,168,307	
銘柄 数 < 比 率 >		17	17	—	<0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		246	281	5,811	694,714	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		576	642	2,175	260,071	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		168	168	438	52,460	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		105	105	336	40,168	化学
HANNOVER RUECK SE		79	96	1,237	147,935	保険
GEA GROUP AG		242	242	442	52,871	機械
CONTINENTAL AG		154	175	1,120	133,958	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		1,371	1,534	3,767	450,405	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE		59	—	—	—	メディア
MERCK KGAA		173	199	1,781	212,924	医薬品
RWE AG		720	931	2,149	256,994	総合公益事業
SAP SE		1,340	1,539	15,725	1,879,983	ソフトウェア
E.ON SE		3,070	3,550	3,389	405,177	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		144	163	1,052	125,883	家庭用品
PUMA SE		10	126	682	81,567	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG		1,273	1,543	8,128	971,765	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		246	277	1,974	236,046	家庭用品
BASF SE		1,254	1,445	6,134	733,409	化学
BEIERSDORF AG		137	160	1,497	179,076	パーソナル用品
HOCHTIEF AG		26	38	218	26,167	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG		203	226	834	99,778	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE		294	333	1,950	233,207	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG		580	654	9,995	1,194,990	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		310	420	364	43,593	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		207	228	4,135	494,449	保険
VOLKSWAGEN AG		45	51	605	72,371	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF		252	289	3,035	362,843	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		1,257	1,403	3,816	456,305	自動車
THYSSENKRUPP AG		620	620	287	34,355	金属・鉱業
SIEMENS AG		1,042	1,201	9,038	1,080,579	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG		80	—	—	—	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG		2,750	3,140	1,828	218,625	資本市場
BAYER MOTOREN WERK		449	521	2,382	284,831	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		78	78	291	34,800	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG		4,600	5,180	6,208	742,255	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		45	53	1,166	139,395	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		1,550	1,990	2,693	322,027	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR		—	60	533	63,767	ヘルスケア機器・用品
DEUTSCHE BOERSE AG		256	295	3,702	442,603	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE		203	227	852	101,929	自動車
FRAPORT AG		63	63	232	27,799	運送インフラ
WIRECARD AG		159	180	1,798	215,060	情報技術サービス
LANXESS		120	120	436	52,190	化学
MTU AERO ENGINES AG		69	84	1,132	135,419	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE		484	562	1,924	230,115	不動産管理・開発
SYMRISE AG		163	198	1,626	194,480	化学

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BRENNTAG AG		206	238	773	92,443	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG		227	330	613	73,340	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		970	1,500	329	39,361	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG		93	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG		1,350	1,580	527	63,051	銀行
OSRAM LIGHT AG		143	—	—	—	電気設備
KION GROUP AG		99	99	389	46,548	機械
VONOVIA SE		664	795	3,578	427,785	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE		340	—	—	—	メディア
KNORR-BREMSE AG		—	71	541	64,763	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG		199	239	851	101,817	ヘルスケア機器・用品
METRO AG		250	250	178	21,393	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE		195	—	—	—	総合公益事業
ZALANDO SE		171	215	709	84,872	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG		270	269	736	88,019	化学
QIAGEN NV		314	354	1,295	154,851	ライフサイエンス・ツール/サービス
UNIPER SE		262	311	713	85,253	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE		119	179	1,193	142,734	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 ・ 金 額	33,144	37,820	131,372	15,705,597	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	58	—	<2.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,620	1,750	2,163	258,691	保険
INTESA SANPAOLO		20,620	23,300	3,426	409,693	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.		880	880	437	52,338	銀行
ENEL SPA		11,040	12,630	8,065	964,232	電力
ENI SPA		3,450	4,030	3,462	413,999	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA		2,980	3,200	1,323	158,226	ガス
TENARIS SA		600	710	393	47,006	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA		15,300	15,500	558	66,727	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		8,800	8,800	315	37,747	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		700	790	841	100,630	運送インフラ
TERNA SPA		1,850	2,220	1,281	153,242	電力
RECORDATI SPA		141	168	657	78,590	医薬品
LEONARDO SPA		550	640	381	45,631	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA		309	370	566	67,743	電気設備
FERRARI NV		171	189	2,629	314,408	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		1,410	1,540	790	94,520	機械
MONCLER SPA		252	281	955	114,218	繊維・アパレル・贅沢品
FINECOBANK BANCA FINECO SPA		—	910	766	91,623	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		1,500	1,700	1,072	128,241	自動車
UNICREDIT SPA		2,710	3,130	2,276	272,186	銀行
EXOR NV		151	172	803	96,089	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		770	770	609	72,869	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		760	910	605	72,345	飲料
PIRELLI & C. SPA		530	530	177	21,169	自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	77,094	85,120	34,564	4,132,174	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	24	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		314	348	958	114,534	建設・土木
AIRBUS SE		793	918	5,593	668,687	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT		710	820	1,617	193,366	総合公益事業
LOREAL-ORD		344	394	9,704	1,160,139	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		378	435	15,239	1,821,822	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA		3	3	232	27,813	航空宇宙・防衛

銘柄	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			
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
THALES SA	141	163	1,189	142,252	航空宇宙・防衛	
CAPGEMINI SA	219	245	1,911	228,460	情報技術サービス	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	83	83	289	34,580	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	81	95	902	107,939	電子装置・機器・部品	
PUBLICIS GROUPE	292	321	748	89,530	メディア	
FAURECIA	105	105	281	33,628	自動車部品	
BOLLORE	1,060	1,380	332	39,759	娯楽	
MICHELIN (CGDE)	238	267	2,042	244,123	自動車部品	
PERNOD RICARD SA	291	335	4,380	523,643	飲料	
RENAULT SA	255	281	483	57,807	自動車	
REMY COINTREAU	30	40	408	48,776	飲料	
SEB SA	30	38	405	48,518	家庭用耐久財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	754	869	6,884	823,008	電気設備	
VIVENDI SA	1,437	1,300	2,363	282,544	娯楽	
ORANGE SA	2,770	3,120	3,497	418,128	各種電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	44	50	3,205	383,205	繊維・アパレル・贅沢品	
SOCIETE BIC SA	38	—	—	—	商業サービス・用品	
DASSAULT SYSTEMES SA	178	209	2,777	332,063	ソフトウェア	
KERING SA	105	117	5,676	678,671	繊維・アパレル・贅沢品	
CNP ASSURANCES	212	280	244	29,189	保険	
CARREFOUR SUPERMARCHE	800	950	1,349	161,386	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	136	153	918	109,783	情報技術サービス	
SANOFI	1,536	1,767	14,226	1,700,732	医薬品	
ACCOR SA	262	262	653	78,179	ホテル・レストラン・レジャー	
STMICROELECTRONICS NV	970	1,050	2,037	243,523	半導体・半導体製造装置	
SOCIETE GENERALE	1,043	1,270	1,960	234,362	銀行	
TELEPERFORMANCE	77	90	1,618	193,455	専門サービス	
EURAZEO SE	56	59	244	29,264	各種金融サービス	
SODEXO	121	132	785	93,863	ホテル・レストラン・レジャー	
AXA	2,650	3,010	4,619	552,218	保険	
PEUGEOT CITROEN	820	880	1,035	123,825	自動車	
JC DECAUX SA	93	150	235	28,100	メディア	
ESSILORLUXOTTICA	399	439	4,364	521,780	繊維・アパレル・贅沢品	
CREDIT AGRICOLE SA	1,540	1,840	1,232	147,337	銀行	
BNP PARIBAS	1,529	1,739	4,912	587,310	銀行	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	669	790	1,694	202,536	建設関連製品	
WENDEL	34	43	316	37,886	各種金融サービス	
ILIAD SA	39	24	305	36,481	各種電気通信サービス	
SES FDR	480	560	294	35,201	メディア	
IMERYS	38	—	—	—	建設資材	
SAFRAN SA	457	508	4,312	515,609	航空宇宙・防衛	
ENGIE	2,510	2,900	2,740	327,626	総合公益事業	
ALSTOM	205	303	1,129	135,077	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	241	241	218	26,120	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	820	940	653	78,169	電力	
IPSEN	55	55	259	31,048	医薬品	
ARKEMA	99	99	596	71,320	化学	
LEGRAND SA	370	410	2,360	282,231	電気設備	
EIFFAGE SA	108	121	798	95,472	建設・土木	
TOTAL SA	3,294	3,762	12,629	1,509,801	石油・ガス・消耗燃料	
ADP	39	47	416	49,783	運送インフラ	
NATIXIS	1,280	1,580	492	58,914	資本市場	
UBISOFT ENTERTAINMENT	111	144	985	117,786	娯楽	
SCOR SE	232	232	465	55,637	保険	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
REXEL SA		450	—	—	—	商社・流通業
VINCI		702	810	5,913	706,899	建設・土木
DANONE		844	972	5,552	663,749	食品
AIR LIQUIDE SA		592	734	8,264	988,061	化学
BUREAU VERITAS SA		342	470	799	95,520	専門サービス
GETLINK		620	720	770	92,101	運送インフラ
SUEZ		520	520	493	59,032	総合公益事業
EDENRED		328	382	1,452	173,630	情報技術サービス
VALEO SA		331	373	540	64,658	自動車部品
BIOMERIEUX		59	69	691	82,654	ヘルスケア機器・用品
WORLDLINE SA		—	198	1,070	127,941	情報技術サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		41	41	732	87,541	ライフサイエンス・ツール/サービス
AMUNDI SA		82	100	529	63,301	資本市場
小 計	株 数 ・ 金 額	38,931	44,157	169,043	20,209,116	
	銘 柄 数 < 比 率 >	72	70	—	<3.6%>	
(ユーロ…オランダ)						
RANDSTAD NV		174	184	571	68,367	専門サービス
WOLTERS KLUWER		390	418	2,606	311,624	専門サービス
VOPAK		90	114	533	63,727	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		2,460	2,930	684	81,825	保険
KONINKLIJKE KPN NV		4,460	5,600	1,201	143,603	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		1,259	1,426	5,233	625,655	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV		357	400	2,920	349,181	飲料
HEINEKEN HOLDING NV		160	172	1,158	138,489	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		247	285	2,958	353,664	化学
UNILEVER NV-CVA		2,102	—	—	—	パーソナル用品
UNILEVER NV		—	2,276	9,957	1,190,419	パーソナル用品
ASML HOLDING NV		560	666	16,317	1,950,755	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,606	1,706	3,665	438,191	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL		310	324	2,002	239,377	化学
PROSUS NV		—	768	4,798	573,656	インターネット販売・通信販売
NN GROUP NV		429	470	1,148	137,268	保険
ARCELOMITTAL		885	990	789	94,387	金属・鉱業
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV		—	175	1,193	142,682	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV-CVA		581	700	513	61,424	銀行
ALTICE EUROPE N.V.		—	990	340	40,666	メディア
ADYEN NV		14	16	1,293	154,610	情報技術サービス
ING GROEP NV		5,280	6,170	3,080	368,258	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	21,365	26,781	62,968	7,527,838	
	銘 柄 数 < 比 率 >	18	21	—	<1.4%>	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA S.A.		444	500	969	115,903	電力
BANKINTER S.A.		880	910	286	34,279	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.		9,230	10,560	3,083	368,634	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		493	490	773	92,467	ガス
REPSOL SA		1,882	2,204	1,673	200,116	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		22,110	26,140	5,788	692,039	銀行
TELEFONICA SA		6,400	7,320	3,029	362,118	各種電気通信サービス
ENAGAS SA		304	390	697	83,411	ガス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		300	380	513	61,329	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		350	403	658	78,666	建設・土木
FERROVIAL SA		665	770	1,650	197,362	建設・土木
MAPFRE SA		1,630	1,630	254	30,389	保険
BANCO DE SABADELL SA		7,900	8,019	365	43,707	銀行

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
CAIXABANK		5,050	5,300	885	105,908	銀行
IBERDROLA SA		8,586	9,660	8,413	1,005,876	電力
AMADEUS IT GROUP SA		595	667	2,910	347,904	情報技術サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA		590	700	1,184	141,636	電力
INDITEX SA		1,480	1,680	3,815	456,116	専門小売り
AENA SME SA		93	107	1,073	128,302	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SA		—	386	1,638	195,844	各種電気通信サービス
GRIFOLS SA		401	468	1,452	173,610	バイオテクノロジー
BANKIA SA		1,510	1,510	157	18,864	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	70,894	80,196	41,275	4,934,493	
	銘 柄 数 < 比 率 >	21	22	—	<0.9%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV		346	382	1,542	184,362	銀行
SOLVAY SA		103	114	745	89,077	化学
UCB SA		165	195	1,472	176,054	医薬品
COLRUYT SA		87	87	427	51,068	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		110	124	871	104,184	各種金融サービス
PROXIMUS		216	260	562	67,263	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV		—	70	1,221	145,988	バイオテクノロジー
TELENET GROUP HOLDING NV		67	67	190	22,828	メディア
AGEAS		258	289	1,013	121,166	保険
UMICORE		280	310	952	113,812	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		1,036	1,201	4,672	558,596	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額	2,668	3,099	13,671	1,634,401	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		210	210	527	63,090	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		90	110	357	42,712	電力
VOESTALPINE AG		165	200	360	43,038	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		400	480	819	97,954	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		201	201	276	33,028	銀行
ANDRITZ AG		92	117	320	38,353	機械
小 計	株 数 ・ 金 額	1,158	1,318	2,661	318,177	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		14	17	719	85,968	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		54	—	—	—	メディア
AROUNDTOWN SA		1,070	1,850	798	95,433	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	1,138	1,867	1,517	181,402	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ		630	630	406	48,594	機械
UPM-KYMMENE OYJ		733	832	1,941	232,152	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		730	850	747	89,342	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		612	682	1,756	209,947	保険
FORTUM OYJ		600	720	943	112,845	電力
ELISA OYJ		195	221	1,217	145,524	各種電気通信サービス
METSO OYJ		162	162	334	39,934	機械
NOKIA OYJ		7,810	8,800	2,409	287,995	通信機器
NESTE OYJ		176	668	1,881	224,963	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		158	210	393	47,047	自動車部品
KONE OYJ		456	540	2,732	326,658	機械

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

銘	柄	期首(前期末)	当		業	種	等	
		株	株	評				価
				外貨建金額				邦貨換算金額
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円			
AIA GROUP LTD		16,470	18,930	129,007	1,811,271	保険		
HKT TRUST AND HKT LTD		5,196	5,996	6,259	87,887	各種電気通信サービス		
SANDS CHINA LTD		3,360	3,840	10,752	150,958	ホテル・レストラン・レジャー		
SWIRE PROPERTIES LTD		1,730	1,730	3,607	50,642	不動産管理・開発		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,640	1,830	5,572	78,235	不動産管理・開発		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		—	2,160	4,315	60,592	飲料		
WH GROUP LIMITED		11,700	14,600	10,278	144,308	食品		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		3,710	4,250	21,868	307,031	コングロマリット		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		890	1,070	4,242	59,565	電力		
CK ASSET HOLDINGS LTD		3,610	4,090	16,647	233,736	不動産管理・開発		
小	計	株 数 ・ 金 額	125,416	140,483	445,260	6,251,459		
	銘 柄 数 < 比 率 >		39	35	—	<1.1%>		
(シンガポール)				千シンガポールドル				
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,980	2,490	739	56,477	航空宇宙・防衛		
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		9,400	—	—	—	食品		
DBS GROUP HLDGS		2,430	2,840	5,197	396,910	銀行		
CITY DEVELOPMENTS LTD		510	700	490	37,421	不動産管理・開発		
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		140	140	265	20,282	販売		
SATS LTD		770	1,150	368	28,104	運送インフラ		
SINGAPORE EXCHANGE LTD		1,110	1,290	1,150	87,877	資本市場		
CAPITALAND LIMITED		3,300	3,800	1,048	80,096	不動産管理・開発		
COMFORTDELGRO CORP LTD		3,100	3,100	458	35,038	陸運・鉄道		
SINGAPORE AIRLINES LTD		770	770	446	34,124	旅客航空輸送業		
UNITED OVERSEAS BANK		1,850	2,000	3,842	293,413	銀行		
UOL GROUP LIMITED		650	650	416	31,819	不動産管理・開発		
VENTURE CORP LTD		350	450	594	45,363	電子装置・機器・部品		
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		2,400	2,400	424	32,441	メディア		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		11,100	12,900	3,121	238,411	各種電気通信サービス		
SEMBCORP INDUSTRIES		1,400	1,400	219	16,790	コングロマリット		
OCBC-ORD		4,330	5,240	4,464	340,952	銀行		
WILMAR INTERNATIONAL LTD		2,470	2,890	887	67,757	食品		
KEPPEL CORP.		2,020	2,320	1,215	92,841	コングロマリット		
YANGZIJANG SHIPBUILDING		3,800	4,400	365	27,890	機械		
GENTING SINGAPORE LTD		8,700	8,700	556	42,522	ホテル・レストラン・レジャー		
小	計	株 数 ・ 金 額	62,581	59,630	26,273	2,006,539		
	銘 柄 数 < 比 率 >		21	20	—	<0.4%>		
(オーストラリア)				千豪ドル				
RAMSAY HEALTH CARE LTD		205	250	1,458	96,375	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		3,930	4,390	7,366	486,846	銀行		
AMCOR PLC-CDI		1,550	—	—	—	容器・包装		
WESTPAC BANKING CORP		4,690	5,630	9,098	601,292	銀行		
BANK OF QUEENSLAND LTD		560	—	—	—	銀行		
FORTESCUE METALS GROUP LTD		2,230	2,190	2,211	146,184	金属・鉱業		
TELSTRA CORP LTD		5,900	6,500	2,112	139,615	各種電気通信サービス		
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD		670	920	592	39,157	銀行		
COCA-COLA AMATIL LTD		770	770	668	44,171	飲料		
ASX LTD		263	307	2,379	157,244	資本市場		
BHP GROUP LIMITED		4,010	4,580	13,831	914,130	金属・鉱業		
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		333	400	892	58,952	石油・ガス・消耗燃料		
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		971	971	295	19,512	複合小売り		
COMPUTERSHARE LTD		630	760	737	48,771	情報技術サービス		
CSL LIMITED		618	712	22,262	1,471,349	バイオテクノロジー		
REA GROUP LTD		69	88	714	47,225	インタラクティブ・メディアおよびサービス		
TRANSURBAN GROUP		3,720	4,340	5,273	348,499	運送インフラ		

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千豪ドル	千円	
COCHLEAR LTD		81	89	1,627	107,529	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		2,390	2,650	1,173	77,586	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		2,424	2,778	17,765	1,174,109	銀行
BORAL LTD		1,530	2,000	404	26,700	建設資材
RIO TINTO LTD		512	575	5,033	332,667	金属・鉱業
APA GROUP		1,590	1,800	1,873	123,839	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		760	880	1,899	125,565	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		3,080	3,610	2,310	152,694	保険
TPG TELECOM LTD		520	520	369	24,400	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		73	73	72	4,781	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD		500	590	962	63,597	化学
BLUESCOPE STEEL LTD		680	880	806	53,273	金属・鉱業
WORLEY LTD		470	470	280	18,513	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD		1,810	1,903	1,731	114,459	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		3,710	4,560	7,437	491,535	銀行
NEWCREST MINING		1,030	1,170	2,867	189,524	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,790	2,040	475	31,413	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD		2,330	2,330	456	30,181	化学
AMP LIMITED		3,900	5,300	707	46,761	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED		—	1,080	345	22,840	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE		1,790	1,950	1,677	110,832	保険
CHALLENGER LIMITED		800	800	321	21,254	各種金融サービス
SANTOS LTD.		2,320	2,610	882	58,303	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD		620	690	1,689	111,633	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		170	170	299	19,774	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS		2,470	3,400	833	55,052	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED		1,540	1,750	6,280	415,094	複合小売り
ALUMINA LTD		3,500	3,500	549	36,316	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM		1,270	1,520	2,731	180,520	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,810	1,970	7,513	496,572	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		—	192	810	53,574	資本市場
SEEK LTD		480	480	717	47,394	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L		85	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD		2,180	2,510	2,663	176,004	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED		439	530	4,539	300,012	資本市場
CROWN RESORTS LTD		550	550	396	26,171	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		580	670	1,255	82,981	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD		1,000	1,110	1,091	72,112	飲料
SYDNEY AIRPORT		1,440	1,680	999	66,063	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD		2,730	3,050	1,473	97,360	陸運・鉄道
AUSNET SERVICES		2,300	3,300	572	37,839	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD		3,500	4,500	1,269	83,868	保険
AGL ENERGY LTD		930	1,050	1,782	117,831	総合公益事業
SOUTH32 LTD		7,000	7,800	1,450	95,883	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD		117	180	411	27,182	建設・土木
COLES GROUP LTD		1,610	1,760	2,960	195,647	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		—	210	332	21,998	ソフトウェア
小 計	株 数 ・ 金 額	101,530	116,038	163,997	10,838,587	
銘 柄 数 < 比 率 >		61	61	—	<1.9%>	
(ニュージーランド)						
RYMAN HEALTHCARE LTD		580	580	593	38,424	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD		1,060	1,170	1,979	128,201	食品
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L		740	860	2,610	169,030	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD		1,126	1,500	480	31,084	建設資材

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

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

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	71,000	80,000	934	101,690	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	17,900	2,589	281,786	0.1
AMERICAN TOWER CORP	60,200	69,400	16,002	1,741,525	0.3
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	214,000	1,213	132,052	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,200	21,900	3,330	362,511	0.1
BOSTON PROPERTIES	20,700	24,700	2,296	249,885	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	15,000	—	—	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	14,500	1,208	131,513	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	64,500	9,549	1,039,312	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	40,700	5,690	619,271	0.1
DUKE REALTY CORP	47,800	56,600	1,870	203,580	0.0
EQUINIX INC	10,930	13,250	8,544	929,900	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	26,500	1,499	163,234	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	51,300	57,700	3,610	392,970	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	10,070	2,270	247,140	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	20,700	2,002	217,956	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	11,100	832	90,600	0.0
HCP INC	66,100	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	75,700	1,843	200,605	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	109,000	1,244	135,469	0.0
INVITATION HOMES INC	45,000	85,000	1,801	196,019	0.0
IRON MOUNTAIN INC	38,300	43,100	1,071	116,560	0.0
KIMCO REALTY CORP	58,000	65,000	656	71,446	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	—	—	—	—
MACERICH CO /THE	14,200	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	83,000	1,459	158,888	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	17,600	1,885	205,197	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	27,900	919	100,017	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	32,200	856	93,180	0.0
PROLOGIS INC	86,300	114,500	9,489	1,032,770	0.2
PUBLIC STORAGE	21,500	24,500	4,939	537,613	0.1
REALTY INCOME CORP	39,300	49,900	2,651	288,528	0.1
REGENCY CENTERS CORP	21,000	26,200	1,046	113,911	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	15,200	17,770	4,951	538,903	0.1
SL GREEN REALTY CORP	12,500	12,500	576	62,686	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	47,900	2,695	293,333	0.1
SUN COMMUNITIES INC	—	14,300	1,749	190,362	0.0
UDR INC	36,700	46,300	1,746	190,064	0.0
VENTAS INC	49,200	56,800	1,635	177,966	0.0
VEREIT INC	125,000	160,000	796	86,715	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	68,000	1,090	118,703	0.0
VORNADO REALTY TRUST	24,200	27,000	1,015	110,484	0.0
WP CAREY INC	21,500	27,400	1,625	176,858	0.0
WELLTOWER INC	51,700	63,100	2,977	323,993	0.1

銘		柄	期首(前期末)	当 期 末			
			口 数	口 数	評 価 額	比 率	
(アメリカ)			口	口	千米ドル	千円	%
WEYERHAEUSER CO			100,500	115,000	1,949	212,136	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		1,666,260	2,153,190	116,120	12,637,351	
	銘 柄 数 < 比 率 >		39	41	—	<2.3%>	
(カナダ)					千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA			—	11,500	481	36,909	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT			—	16,000	216	16,570	0.0
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS			20,000	20,000	171	13,113	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR			22,000	22,000	357	27,350	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV			11,000	11,000	204	15,647	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		53,000	80,500	1,430	109,591	
	銘 柄 数 < 比 率 >		3	5	—	<0.0%>	
(イギリス)					千英ポンド		
BRITISH LAND			128,000	128,000	416	55,495	0.0
HAMMERSON PLC			108,000	—	—	—	—
SEGRO PLC			145,000	176,000	1,319	175,935	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC			99,000	111,000	607	80,947	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		480,000	415,000	2,343	312,378	
	銘 柄 数 < 比 率 >		4	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)					千ユーロ		
ICADE			5,100	5,200	378	45,256	0.0
KLEPIERRE			28,000	32,300	590	70,587	0.0
GECINA SA			6,400	7,100	864	103,299	0.0
COVIVIO			6,600	6,600	346	41,384	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD			19,100	21,400	1,049	125,513	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額		65,200	72,600	3,229	386,042	
	銘 柄 数 < 比 率 >		5	5	—	<0.1%>	
(香港)					千香港ドル		
LINK REIT			288,000	330,000	21,285	298,841	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS			370,000	370,000	2,797	39,272	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		658,000	700,000	24,082	338,114	
	銘 柄 数 < 比 率 >		2	2	—	<0.1%>	
(シンガポール)					千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST			380,000	390,000	682	52,122	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT			380,000	440,800	1,194	91,229	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST			369,972	439,972	655	50,064	0.0
SUNTEC REIT			300,000	300,000	372	28,409	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST			—	370,000	673	51,427	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		1,429,972	1,940,772	3,578	273,253	
	銘 柄 数 < 比 率 >		4	5	—	<0.0%>	
(オーストラリア)					千豪ドル		
MIRVAC GROUP			490,000	660,000	1,320	87,238	0.0
GPT GROUP			256,000	285,000	1,014	67,054	0.0
LENDLEASE GROUP			77,000	88,000	902	59,671	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP			348,000	348,000	803	53,128	0.0
DEXUS			140,000	171,000	1,539	101,712	0.0
GOODMAN GROUP			227,000	254,000	3,030	200,267	0.0
SCENTRE GROUP			723,000	870,000	1,283	84,809	0.0

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア) VICINITY CENTRES	口 480,000	口 470,000	千豪ドル 458	千円 30,285	% 0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 2,741,000	3,146,000	10,352	684,168	
銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 7,093,432	8,508,062	—	14,740,901	
銘 柄 数 < 比 率 >	65	69	—	<2.7%>	

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

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*金額の単位未満は切り捨て。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	CAN60	百万円 279	百万円 —
		EUR050	905	—
		FT100	436	—
		SPI200	180	—
		SPEMINI	5,996	—
		SWISSMKT	314	—

*単位未満は切り捨て。

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

○投資信託財産の構成

(2020年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 532,708,715	% 94.0
投資証券	14,740,901	2.6
コール・ローン等、その他	19,044,821	3.4
投資信託財産総額	566,494,437	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（549,961,136千円）の投資信託財産総額（566,494,437千円）に対する比率は97.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝108.83円、1カナダドル＝76.60円、1英ポンド＝133.32円、1スイスフラン＝113.21円、1スウェーデンクローナ＝10.81円、1ノルウェークローネ＝10.26円、1デンマーククローネ＝16.01円、1ユーロ＝119.55円、1香港ドル＝14.04円、1シンガポールドル＝76.37円、1豪ドル＝66.09円、1ニュージーランドドル＝64.76円、1新シエケル＝30.46円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年3月31日現在）

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

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

○損益の状況（2019年4月2日～2020年3月31日）

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

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI（確定拠出年金向け）	67,352,314,919
野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	36,321,368,128
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	22,255,621,713
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	16,200,200,467
マイバランス50（確定拠出年金向け）	10,232,027,680
マイバランス70（確定拠出年金向け）	8,902,069,455
のむらップ・ファンド（普通型）	8,834,948,702
野村世界6資産分散投信（分配コース）	6,135,950,276
のむらップ・ファンド（積極型）	5,764,474,434
野村インデックスファンド・外国株式	5,085,341,526
野村世界6資産分散投信（安定コース）	4,660,174,843
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,420,419,039
野村つみたて外国株投信	4,278,259,185
野村外国株（含む新興国）インデックス B コース（野村投資一任口座向け）	3,653,207,390
マイバランス30（確定拠出年金向け）	3,019,550,038
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	2,961,246,485
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	2,177,660,268
マイバランスDC50	2,046,408,931

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイ・ロード	1,600,015,897
マイバランスDC70	1,584,081,235
野村外国株インデックス Bコース（野村SMA・EW向け）	1,570,017,565
ファンドラップ（ウェルス・スクエア）外国株式	1,246,658,042
ノムラFPIs用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	1,240,519,467
のむらップ・ファンド（保守型）	1,222,162,509
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	1,151,069,845
マイバランスDC30	1,099,765,570
野村6資産均等バランス	643,512,929
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	607,510,683
野村外国株式インデックスファンド	518,274,940
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	485,371,313
のむらップ・ファンド（やや積極型）	440,681,091
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	275,786,534
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	246,564,408
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	228,702,850
のむらップ・ファンド（やや保守型）	223,325,959
野村DC運用戦略ファンド	216,326,337

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

ファンド名	当期末
	元本額 円
ネクストコア	15,297,514
野村資産設計ファンド2050	14,984,107
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	14,057,350
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	12,569,368
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	11,389,463
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	10,685,299
野村資産設計ファンド2045	9,067,287
インデックス・ブレンド（タイプIV）	7,480,531
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	6,606,701
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	5,768,243
野村資産設計ファンド2060	4,928,471
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	4,900,497
インデックス・ブレンド（タイプII）	3,672,056
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	3,286,325
インデックス・ブレンド（タイプI）	2,914,635
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	2,756,083
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,662,077
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	2,203,199
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,110,719
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	2,088,740
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	1,982,969
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,775,244
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	1,595,704
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,124,486
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	667,236
野村スリーゼロ先進国株式投信	415,117
野村FoFs用・ターゲット・リターン・資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	129,074

○お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

FOFs用 外国債券インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第26期（決算日 2020年 9月7日）
第27期（決算日 2020年11月9日）
第28期（決算日 2021年 1月7日）

受益者のみなさまへ

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

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6	第14期(2018年 9月7日)	円 9,123	円 27	% △1.1	9,583	% △0.6	% 97.7	% 1.0			百万円 20,631
	第15期(2018年11月7日)	9,167	27	0.8	9,619	0.4	98.3	0.6			24,138
	第16期(2019年 1月7日)	8,953	23	△2.1	9,384	△2.4	98.3	0.6			26,040
第7	第17期(2019年 3月7日)	9,234	28	3.5	9,753	3.9	98.6	0.4			29,391
	第18期(2019年 5月7日)	9,207	24	△0.0	9,765	0.1	97.9	0.8			29,955
	第19期(2019年 7月8日)	9,304	28	1.4	9,875	1.1	98.6	0.4			31,905
第8	第20期(2019年 9月9日)	9,337	28	0.7	9,951	0.8	98.4	0.6			32,456
	第21期(2019年11月7日)	9,389	27	0.8	10,050	1.0	98.4	0.6			31,711
	第22期(2020年 1月7日)	9,382	24	0.2	10,050	0.0	98.1	0.8			30,957
第9	第23期(2020年 3月9日)	9,286	30	△0.7	10,329	2.8	98.4	0.8			30,384
	第24期(2020年 5月7日)	9,265	26	0.1	9,989	△3.3	97.9	1.2			29,172
	第25期(2020年 7月7日)	9,651	28	4.5	10,477	4.9	98.0	1.1			30,347
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

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
			騰落率		騰落率		
第26期	(期 首)2020年 7月7日	円 9,651	% —	10,477	% —	% 98.0	% 1.1
	7月末	9,750	1.0	10,581	1.0	97.5	1.5
	8月末	9,736	0.9	10,549	0.7	97.7	1.4
	(期 末)2020年 9月7日	9,830	1.9	10,638	1.5	98.4	0.8
第27期	(期 首)2020年 9月7日	9,802	—	10,638	—	98.4	0.8
	9月末	9,751	△0.5	10,597	△0.4	97.9	1.2
	10月末	9,609	△2.0	10,451	△1.8	98.0	1.1
	(期 末)2020年11月9日	9,601	△2.1	10,433	△1.9	98.3	0.9
第28期	(期 首)2020年11月9日	9,577	—	10,433	—	98.3	0.9
	11月末	9,681	1.1	10,561	1.2	97.9	1.4
	12月末	9,759	1.9	10,650	2.1	98.4	1.0
	(期 末)2021年 1月7日	9,710	1.4	10,609	1.7	97.9	1.2

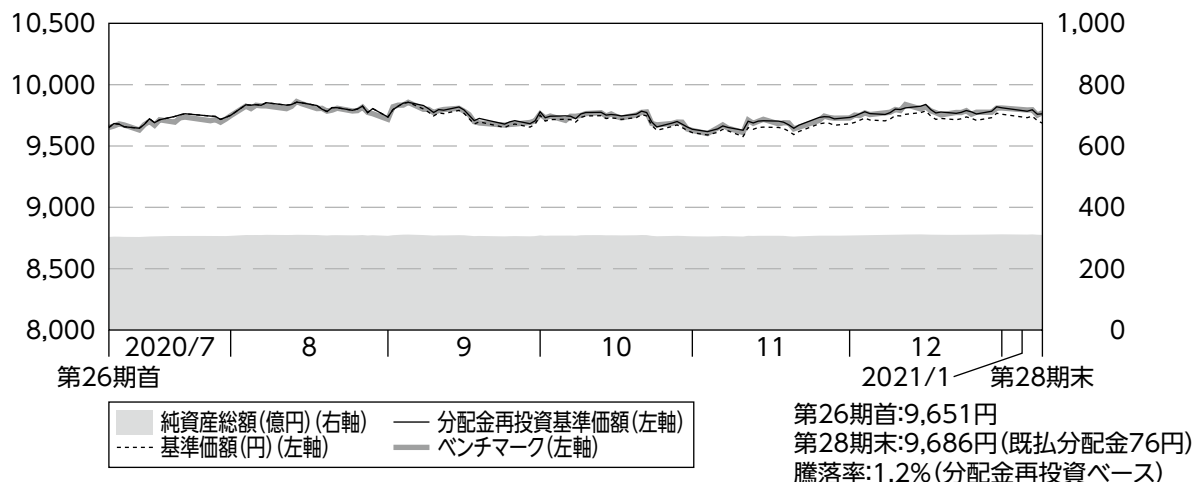
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み合わせるので、「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

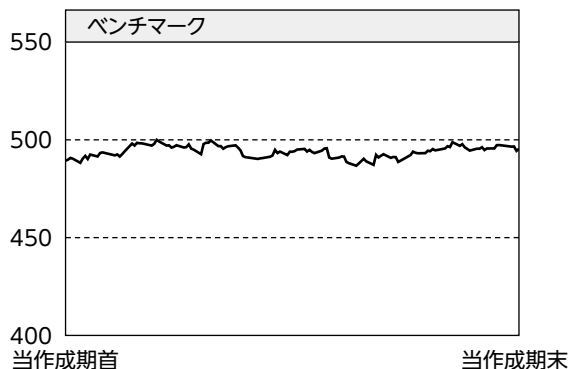


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2020年7月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年8月中旬にかけて、米国で与野党協議の難航から景気回復の遅れが懸念されたことや新型コロナウイルスの感染拡大などリスク回避要因が強まったことから、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)し、また外国為替市場では、EU(欧州連合)で復興基金の創設が合意され、ユーロ圏の景気回復期待からユーロが対円で上昇したことから、基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。8月下旬から11月上旬にかけては、米国で先行きの財政や債券需給の悪化が意識され、主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)したことに加え、中国・人民元高や英ポンド買い戻しの動きをきっかけに円高・米ドル安が進行し、またユーロ圏で先行きの経済悪化への懸念が高まったことから円高・ユーロ安となり、基準価額は下落しました。11月中旬以降は、米長期金利の上昇と円高・米ドル安が続いたものの、新型コロナウイルスに対するワクチンの実用化による世界経済の正常化が期待される中、米ドル売りユーロ買いの動きが加速し、対円でもユーロ高が進行した影響から、基準価額は上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、新型コロナウイルス感染拡大による景気減速への懸念とワクチン普及による先行きの経済正常化への期待が交錯し、国によりまちまちの動きとなりました。国債の需給悪化懸念が高まった米国では上昇、新型コロナウイルスの感染が急拡大したユーロ圏では概ね低下推移となりました。

外国為替市場では、リスク選好局面での円売りに加え米ドル売りの傾向も強まったことから、対円では各通貨まちまちの動きとなりました。当作成期を通じては、米ドルが対円で緩やかに下落した一方、ユーロや英ポンドは対円で上下動しながらも上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

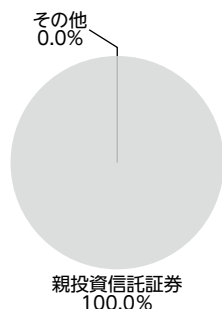
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

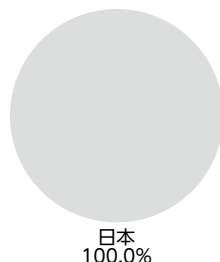
	当作成期末
	2021年1月7日
外国債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

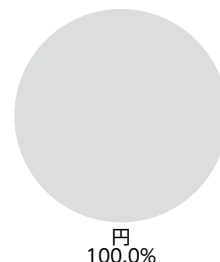
○資産別配分



○国別配分



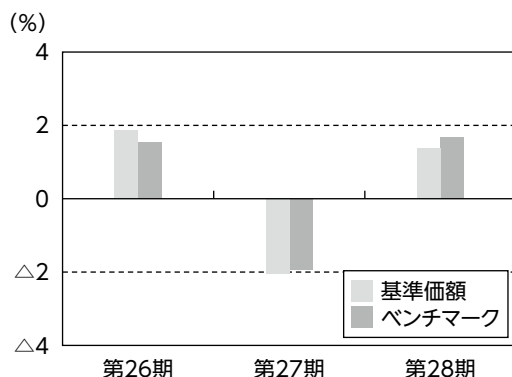
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬および為替評価差要因*です。

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

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

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26期	第27期	第28期
	2020年7月8日～ 2020年9月7日	2020年9月8日～ 2020年11月9日	2020年11月10日～ 2021年1月7日
当期分配金 (円)	28	24	24
(対基準価額比率) (%)	(0.285)	(0.250)	(0.247)
当期の収益 (円)	28	24	24
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	926	931	936

(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
	(2020年7月8日～2021年1月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.067%	(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9,714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)	(0.050)	
(販売会社)	(1)	(0.006)	
(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	0.013	(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)	(0.010)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.080	

(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 204, 377	千円 608, 608	千口 108, 808	千円 324, 054

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
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 2, 337	百万円 59	% 2. 5	百万円 2, 344	百万円 67	% 2. 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 9, 822	百万円 215	% 2. 2	百万円 16, 705	百万円 53	% 0. 3
コ ー ル ・ ロ ー ン	360, 798	12, 395	3. 4	360, 255	13, 148	3. 6

<平均保有割合 10. 9%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

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, 297, 584	10, 393, 153	30, 988, 227

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、94, 264, 055千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	30, 988, 227	99. 7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	99, 188	0. 3
投 資 信 託 財 産 総 額	31, 087, 415	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(277, 741, 332千円)の投資信託財産総額(281, 474, 562千円)に対する比率は98. 7%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=102. 99円	1カナダドル=81. 29円	1メキシコペソ=5. 24円
1ユーロ=127. 03円	1イギリスポンド=140. 28円	1スウェーデンクローナ=12. 61円
1ノルウェークローネ=12. 24円	1デンマーククローネ=17. 07円	1ポーランドズロチ=28. 07円
1オーストラリアドル=80. 27円	1シンガポールドル=78. 18円	1マレーシアリングgit=25. 64円
1イスラエルシェケル=32. 39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 26 期 末 2020年9月7日現在	第 27 期 末 2020年11月9日現在	第 28 期 末 2021年1月7日現在
(A) 資 産	31,061,381,214円	30,563,882,364円	31,087,415,497円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	25,631,015	22,515,366	23,273,735
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	30,950,216,600	30,464,930,735	30,988,227,954
未 収 入 金	85,533,599	76,436,263	75,913,808
(B) 負 債	95,641,584	83,674,793	83,689,350
未 払 収 益 分 配 金	88,455,409	76,386,036	76,823,350
未 払 信 託 報 酬	6,905,142	7,003,277	6,598,493
未 払 利 息	62	29	16
そ の 他 未 払 費 用	280,971	285,451	267,491
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	30,965,739,630	30,480,207,571	31,003,726,147
元 本	31,591,217,662	31,827,515,069	32,009,729,298
次 期 繰 越 損 益 金	△625,478,032	△1,347,307,498	△1,006,003,151
(D) 受 益 権 総 口 数	31,591,217,662口	31,827,515,069口	32,009,729,298口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,802円	9,577円	9,686円

■損益の状況

項 目	第 26 期 自 2020年7月8日 至 2020年9月7日	第 27 期 自 2020年 9月8日 至 2020年11月9日	第 28 期 自 2020年11月10日 至 2021年 1月 7日
(A) 配 当 等 収 益	△1,475円	△1,433円	△1,238円
受 取 利 息	17	—	45
支 払 利 息	△1,492	△1,433	△1,283
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	572,330,926	△631,098,060	429,327,261
売 買 益	574,647,584	1,776	431,580,368
売 買 損	△2,316,658	△631,099,836	△2,253,107
(C) 信 託 報 酬 等	△7,186,113	△7,288,728	△6,865,984
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	565,143,338	△638,388,221	422,460,039
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,191,777,994	1,668,460,467	951,200,866
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△2,293,943,955	△2,300,993,708	△2,302,840,706
(配 当 等 相 当 額)	(1,256,928,230)	(1,278,871,494)	(1,300,337,746)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,550,872,185)	(△3,579,865,202)	(△3,603,178,452)
(G) 計 (D+E+F)	△537,022,623	△1,270,921,462	△929,179,801
(H) 収 益 分 配 金	△88,455,409	△76,386,036	△76,823,350
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△625,478,032	△1,347,307,498	△1,006,003,151
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,293,943,955	△2,300,993,708	△2,302,840,706
(配 当 等 相 当 額)	(1,256,984,189)	(1,278,969,349)	(1,300,432,548)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,550,928,144)	(△3,579,963,057)	(△3,603,273,254)
分 配 準 備 積 立 金	1,668,465,923	1,686,031,755	1,695,954,103
繰 越 損 益 金	—	△732,345,545	△399,116,548

(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26期首元本額は31,446,788,396円、第26～28期中追加設定元本額は646,393,745円、第26～28期中一部解約元本額は83,452,843円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 26 期	第 27 期	第 28 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	101,859,965円	93,957,324円	91,139,564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)	463,283,373円	－円	－円
(C) 収益調整金額	1,256,984,189円	1,278,969,349円	1,300,432,548円
(D) 分配準備積立金額	1,191,777,994円	1,668,460,467円	1,681,637,889円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	3,013,905,521円	3,041,387,140円	3,073,210,001円
(F) 期末残存口数	31,591,217,662口	31,827,515,069口	32,009,729,298口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	954円	955円	960円
(H) 分配金額(1万口当たり)	28円	24円	24円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	88,455,409円	76,386,036円	76,823,350円

分配金のお知らせ

	第26期	第27期	第28期
1万口当たり分配金	28円	24円	24円

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

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

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 総 額
	円	騰 落 率	円	騰 落 率			
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7	436,679	△8.5	97.9	0.9	212,962
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440,540	0.9	97.3	1.4	219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441,246	0.2	98.0	0.8	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454,282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481,049	5.9	97.3	2.1	276,169

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率	円	騰 落 率		
(当 期 首) 2019年 5月29日	27,366	—	454,282	—	97.3	1.4
5月末	27,402	0.1	455,639	0.3	97.1	1.4
6月末	27,746	1.4	459,552	1.2	98.4	0.6
7月末	27,832	1.7	460,690	1.4	98.0	0.9
8月末	28,013	2.4	464,284	2.2	97.9	0.9
9月末	28,139	2.8	467,478	2.9	97.9	1.7
10月末	28,439	3.9	470,059	3.5	98.4	0.5
11月末	28,435	3.9	470,899	3.7	98.4	0.5
12月末	28,569	4.4	472,814	4.1	99.1	1.7
2020年 1月末	28,778	5.2	475,349	4.6	97.6	1.0
2月末	29,142	6.5	484,794	6.7	98.3	0.7
3月末	29,120	6.4	480,583	5.8	98.4	0.7
4月末	28,619	4.6	472,875	4.1	97.0	1.6
(当 期 末) 2020年 5月29日	29,017	6.0	481,049	5.9	97.3	2.1

(注1) 騰落率は期首比です。

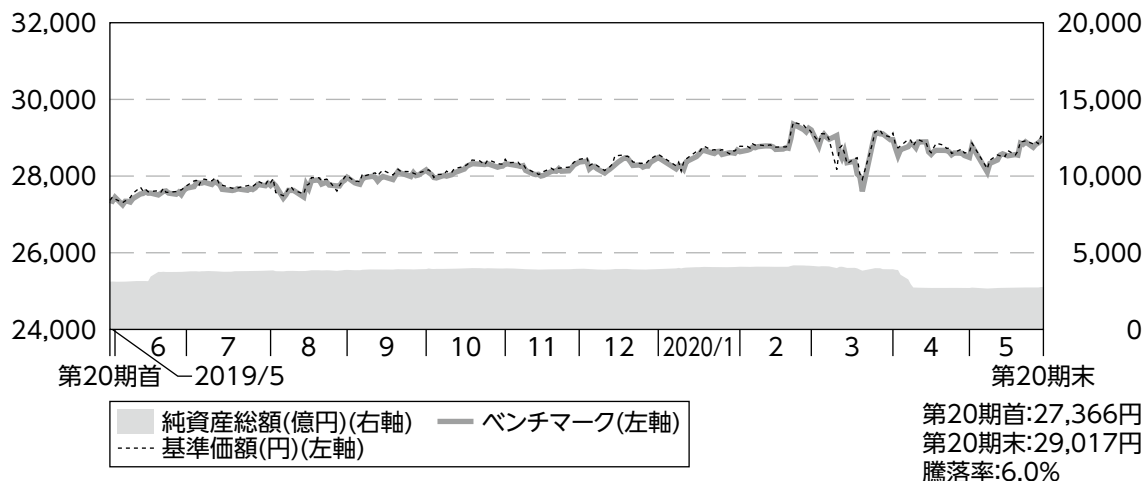
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

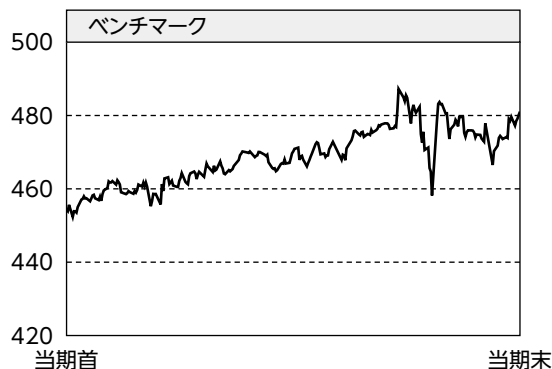


(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2019年8月下旬にかけて、主要中央銀行の金融緩和観測などを受けて低下しましたが、2020年1月上旬にかけては、米中通商協議の進展期待などから上昇しました。その後は、主要国による財政出動への期待から長期金利が上昇する局面がありましたが、主要中央銀行の金融緩和などを背景に低下しました。

外国為替市場では、2019年8月下旬にかけて、英国の合意なきEU離脱への警戒感などから、主要通貨は対円で下落しました。2020年2月中旬にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景に主要通貨は対円で上昇しましたが、その後は新型コロナウイルスの感染拡大を背景に、下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

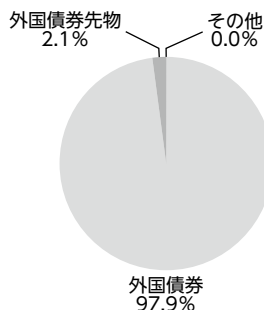
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	EURO-BUND 2006	ドイツ	0.7%
2	T 2.375% 05/15/29	アメリカ	0.7%
3	T 1.625% 08/15/29	アメリカ	0.6%
4	T 2.375% 08/15/24	アメリカ	0.5%
5	T 2.25% 08/15/46	アメリカ	0.5%
6	T 1.625% 11/15/22	アメリカ	0.5%

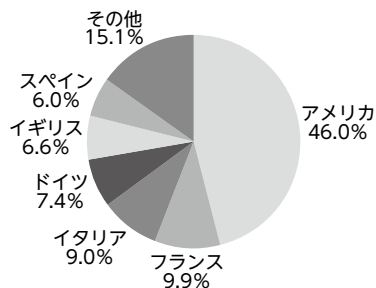
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.75% 09/15/21	アメリカ	0.5%
8	T 2.5% 05/15/46	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.5%
10	T 2.25% 08/15/49	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		718	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

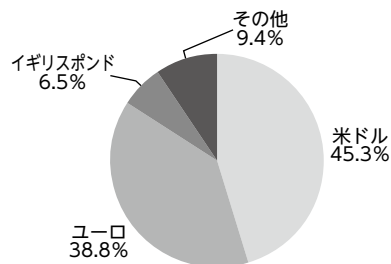
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

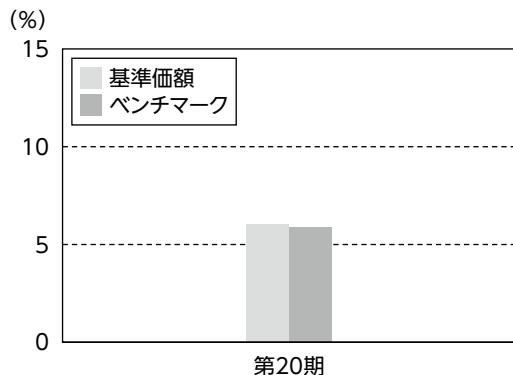


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.1%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2019年5月30日~2020年5月29日)		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)	0.001% (-) (-) (-) (-) (-) (-) (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)	6 (6) (-) (0)	0.022 (0.021) (-) (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	6	0.023	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(28,352円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外 国	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 713,642	千米ドル 1,036,192
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 35,839	千カナダドル 46,078
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 233,036	千メキシコペソ 264,389
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 106,346	千ユーロ 104,068
	イ タ リ ア	国 債 証 券	97,486	123,245
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	111,478	135,468
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	19,409	25,545
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	66,198	77,411
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	25,072	31,306
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	17,446	20,370
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	7,251	9,108
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	8,829	9,543
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 63,239	千イギリスポンド 89,009
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 33,847	千スウェーデンクローナ 56,129
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 29,265	千ノルウェークローネ 29,767
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 43,596	千デンマーククローネ 51,922
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 31,983	千ポーランドズロチ 37,841
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 37,801	千オーストラリアドル 43,626
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 8,923	千シンガポールドル 9,887
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 25,938	千マレーシアリンギット 28,174
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 33,969	千イスラエルシェケル ー
	南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 96,190	千南アフリカランド 280,720

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 55,242	百万円 54,007	百万円 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
為 替 直 物 取 引	百万円 106,567	百万円 1,239	% 1.2	百万円 162,547	百万円 675	% 0.4
金 銭 信 託	1,095	1,095	100.0	225	225	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,101,321	199,145	18.1	1,102,823	200,295	18.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちＢＢ格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 1,029,250	千米ドル 1,151,242	千円 123,793,130	% 44.8	% —	% 19.8	% 16.3	% 8.7
カ ナ ダ	千カナダドル 58,080	千カナダドル 67,421	5,259,580	1.9	—	0.9	0.6	0.4
メ キ シ コ	千メキシコペソ 408,420	千メキシコペソ 445,600	2,156,705	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 135,890	千ユーロ 165,647	19,733,645	7.1	—	4.2	2.0	0.9
イ タ リ ア	177,870	202,782	24,157,538	8.7	—	5.1	2.5	1.1
フ ラ ン ス	187,210	224,321	26,723,420	9.7	—	6.3	2.2	1.1
オ ラ ン ダ	35,710	43,203	5,146,805	1.9	—	1.2	0.5	0.2
ス ペ イ ン	112,110	133,586	15,914,219	5.8	—	3.8	1.3	0.6
ベ ル ギ ー	45,730	56,383	6,716,910	2.4	—	1.9	0.4	0.2
オーストリア	28,080	34,170	4,070,753	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	11,650	12,896	1,536,409	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	15,080	17,098	2,036,942	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 96,200	千イギリスポンド 134,378	17,809,166	6.4	—	5.2	1.0	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 61,110	千スウェーデンクローナ 68,936	778,291	0.3	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 57,620	千ノルウェークローネ 61,814	679,335	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 67,500	千デンマーククローネ 85,645	1,368,613	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 56,380	千ポーランドズロチ 61,735	1,650,199	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 67,390	千オーストラリアドル 77,797	5,550,816	2.0	—	1.3	0.6	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 14,210	千シンガポールドル 16,152	1,225,821	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 49,750	千マレーシアリンギット 54,058	1,336,319	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 27,680	千イスラエルシェケル 33,945	1,039,070	0.4	—	0.2	0.1	0.0
合 計	—	—	268,683,695	97.3	—	53.7	29.3	14.3

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

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)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 1.125% 06/30/21	1.125	9,800	9,899	1,064,537	2021/6/30
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	5,055	543,604	2021/7/31
T 1.125% 09/30/21	1.125	2,800	2,835	304,876	2021/9/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,697	505,086	2023/7/31
T 1.25% 10/31/21	1.25	10,000	10,151	1,091,618	2021/10/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	5,177	556,761	2023/6/30
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,592	278,779	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	4,151	446,434	2023/9/30
T 1.375% 10/15/22	1.375	5,000	5,140	552,771	2022/10/15
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,599	494,555	2022/1/31
T 1.5% 02/28/23	1.5	7,800	8,077	868,581	2023/2/28
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	4,146	445,913	2023/3/31
T 1.5% 08/15/22	1.5	10,000	10,291	1,106,592	2022/8/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	8,400	8,927	960,022	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,939	961,276	2024/9/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	8,648	929,989	2026/2/15
T 1.625% 04/30/23	1.625	3,500	3,643	391,835	2023/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	8,841	950,723	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	1,042	112,053	2023/5/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,579	277,414	2022/8/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	14,650	15,929	1,712,908	2029/8/15
T 1.625% 08/31/22	1.625	5,000	5,161	555,039	2022/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	5,000	5,236	563,083	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	7,300	7,824	841,419	2026/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	12,150	12,576	1,352,369	2022/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	8,780	9,416	1,012,561	2026/11/30
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,861	845,340	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,568	276,212	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,825	1,056,495	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,500	5,666	609,319	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,916	421,175	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,856	414,718	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,849	1,059,162	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	7,228	777,290	2022/6/30
T 1.75% 06/30/24	1.75	7,600	8,053	866,038	2024/6/30
T 1.75% 07/15/22	1.75	8,320	8,596	924,389	2022/7/15
T 1.75% 07/31/21	1.75	6,700	6,822	733,663	2021/7/31
T 1.75% 09/30/22	1.75	5,150	5,337	573,940	2022/9/30
T 1.75% 11/30/21	1.75	6,050	6,192	665,930	2021/11/30
T 1.875% 01/31/22	1.875	7,000	7,197	773,997	2022/1/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,574	276,800	2022/2/28
T 1.875% 03/31/22	1.875	5,500	5,670	609,792	2022/3/31
T 1.875% 04/30/22	1.875	4,450	4,594	494,041	2022/4/30
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	9,329	1,003,191	2022/7/31
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,634	605,888	2026/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,152	446,467	2022/8/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	6,399	688,149	2024/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	7,450	7,752	833,674	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,538	595,507	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,578	277,220	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	5,000	5,242	563,755	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	9,120	980,738	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	5,669	609,602	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,649	715,052	2024/4/30
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,868	416,012	2021/5/31
T 2% 05/31/24	2.0	8,000	8,549	919,280	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,883	632,698	2024/6/30
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,118	335,317	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	7,467	802,959	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	3,740	3,824	411,297	2021/8/31
T 2% 10/31/21	2.0	5,650	5,796	623,278	2021/10/31
T 2% 10/31/22	2.0	10,000	10,436	1,122,260	2022/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,464	264,987	2021/11/15

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 2% 11/15/26	2.0	10,220	11,200	1,204,430	2026/11/15
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,090	224,754	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,263	243,404	2021/12/31
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,454	586,512	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,924	852,168	2024/3/31
T 2.125% 05/15/22	2.125	3,790	3,934	423,044	2022/5/15
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,608	280,542	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	8,600	9,452	1,016,475	2026/5/31
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,657	823,455	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	6,000	6,243	671,390	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	5,165	555,439	2024/7/31
T 2.125% 08/15/21	2.125	5,370	5,496	591,037	2021/8/15
T 2.125% 09/30/21	2.125	10,300	10,567	1,136,329	2021/9/30
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,627	927,715	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	5,680	6,052	650,828	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	3,500	3,607	387,961	2021/12/31
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,584	600,528	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,291	461,488	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	9,982	1,073,444	2027/2/15
T 2.25% 04/15/22	2.25	4,000	4,155	446,795	2022/4/15
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	7,540	810,780	2024/4/30
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	3,072	330,396	2021/7/31
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	9,590	1,031,287	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	10,790	12,684	1,363,926	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	10,200	12,139	1,305,370	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,836	735,127	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	11,021	1,185,096	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,839	520,371	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	8,603	925,108	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,821	518,418	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	8,400	9,136	982,462	2024/12/31
T 2.375% 01/31/23	2.375	5,000	5,289	568,795	2023/1/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	6,214	668,245	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	7,600	8,458	909,549	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	10,750	12,116	1,302,879	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	15,010	17,276	1,857,768	2029/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	12,500	13,589	1,461,315	2024/8/15
T 2.5% 01/15/22	2.5	6,500	6,745	725,305	2022/1/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	6,300	6,816	732,983	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	5,503	591,835	2025/1/31
T 2.5% 02/15/22	2.5	7,800	8,109	871,972	2022/2/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	4,410	5,394	580,088	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	8,500	10,439	1,122,512	2046/2/15
T 2.5% 03/31/23	2.5	4,050	4,312	463,718	2023/3/31
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	8,592	923,916	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	10,050	12,357	1,328,809	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,881	524,866	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	5,270	566,705	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	9,990	11,682	1,256,171	2029/2/15
T 2.625% 02/28/23	2.625	1,400	1,493	160,550	2023/2/28
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	8,044	865,012	2025/3/31
T 2.625% 06/15/21	2.625	10,000	10,254	1,102,686	2021/6/15
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	5,262	565,837	2023/6/30
T 2.625% 07/15/21	2.625	3,350	3,442	370,124	2021/7/15
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,797	408,301	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	6,531	702,316	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,275	352,227	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,000	4,660	501,157	2028/2/15
T 2.75% 04/30/23	2.75	3,600	3,865	415,657	2023/4/30
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	4,173	448,784	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	6,161	662,523	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,079	116,107	2023/7/31
T 2.75% 08/15/21	2.75	11,000	11,342	1,219,631	2021/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	3,807	409,412	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,950	6,409	689,211	2047/8/15

銘柄	利 率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	7,751	833,513	2025/8/31
T 2.75% 09/15/21	2.75	12,000	12,398	1,333,254	2021/9/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,120	6,649	715,048	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	5,329	573,071	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	4,550	5,900	634,434	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,493	483,145	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	8,557	920,212	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	5,150	6,672	717,533	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	7,461	802,301	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	4,296	462,045	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	6,160	662,452	2025/7/31
T 2.875% 08/15/28	2.875	8,920	10,549	1,134,365	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	9,300	12,156	1,307,147	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	5,166	555,599	2023/9/30
T 2.875% 10/15/21	2.875	7,250	7,519	808,598	2021/10/15
T 2.875% 10/31/23	2.875	5,500	5,993	644,503	2023/10/31
T 2.875% 11/15/21	2.875	8,350	8,678	933,246	2021/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,388	471,934	2023/11/30
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	6,039	649,388	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	7,000	9,569	1,029,036	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	2,138	229,969	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	4,661	501,287	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	5,710	7,715	829,662	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	7,425	798,477	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,780	514,024	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,698	612,731	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	6,050	8,037	864,223	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	2,350	3,160	339,816	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,500	4,706	506,079	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,700	6,528	702,059	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	2,490	3,369	362,340	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	10,140	1,090,394	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	2,349	252,628	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	4,510	6,328	680,535	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	7,300	10,628	1,142,865	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	1,084	116,564	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	3,487	375,010	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,898	311,685	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,922	314,239	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	5,500	8,127	874,000	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	2,145	230,735	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,384	148,885	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	3,648	392,368	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,546	166,285	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,987	321,192	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	3,079	331,119	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	1,260	1,971	211,985	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,590	2,423	260,613	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,600	2,510	269,940	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,692	289,525	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	2,380	3,839	412,893	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	1,234	132,784	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,797	193,272	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	1,250	1,743	187,473	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,800	193,618	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,896	311,511	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,674	180,005	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,236	240,447	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	2,045	219,991	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,617	173,946	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,969	211,793	2023/8/15
T 8.0% 01/15/21	8.0	1,700	1,894	203,765	2021/11/15
小 計				123,793,130	
(カナダ) 国債証券					
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	4,030	4,046	315,653	2022/3/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	700	703	54,843	2025/9/1

銘柄	利 率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	2,700	2,717	211,971	2021/9/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	500	518	40,469	2027/6/1
CAN 1% 09/01/22	1.0	1,500	1,524	118,894	2022/9/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,730	1,846	144,015	2030/6/1
CAN 1.25% 11/01/21	1.25	1,880	1,906	148,709	2021/11/1
CAN 1.5% 02/01/22	1.5	1,210	1,234	96,313	2022/2/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,109	86,532	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,447	112,913	2026/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	600	628	48,993	2024/9/1
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	3,620	3,765	293,717	2023/3/1
CAN 1.75% 05/01/21	1.75	2,700	2,737	213,541	2021/5/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,465	114,360	2028/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	2,110	2,223	173,489	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	1,970	2,418	188,632	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,461	192,059	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,966	153,424	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	2,190	2,525	197,007	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	4,560	4,950	386,161	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	3,670	3,853	300,622	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,980	2,756	215,048	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	560	877	68,416	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,840	1,895	147,857	2021/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,140	3,266	254,844	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,850	2,874	224,208	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,580	2,590	202,074	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,706	133,133	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,600	2,597	202,630	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	1,850	2,807	219,040	2027/6/1
小 計				5,259,580	
(メキシコ) 国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	11,303	54,709	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	25,860	30,593	148,073	2024/12/5
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	25,630	25,781	124,780	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	26,230	26,923	130,309	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	39,660	40,226	194,696	2021/6/10
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	10,400	10,813	52,335	2023/3/9
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	30,180	31,112	150,584	2021/12/9
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	41,630	45,458	220,021	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	16,780	18,574	89,901	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,190	25,966	125,676	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	15,580	17,256	83,522	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	37,957	183,712	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	18,770	20,739	100,377	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	30,620	33,286	161,104	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	37,670	43,717	211,591	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	22,200	25,889	125,306	2038/11/18
小 計				2,156,705	
(ドイツ) 国債証券					
BKO 0% 03/11/22	—	3,100	3,135	373,549	2022/3/11
BKO 0% 06/11/21	—	2,640	2,656	316,457	2021/6/11
DBR 0% 02/15/30	—	3,570	3,719	443,103	2030/2/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,470	4,639	552,648	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	2,510	2,617	311,824	2029/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	860	853	101,630	2050/8/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	4,140	4,375	521,224	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,890	4,145	493,822	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,180	2,318	276,255	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,000	3,163	376,848	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,194	380,550	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,390	2,584	307,841	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	3,160	3,405	405,738	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,139	254,907	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	4,120	4,474	533,042	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,050	4,122	491,064	2048/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,960	3,133	373,346	2023/2/15

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
				邦貨換算金額 (千円)	
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,180	2,319	276,307	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,486	296,269	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,800	2,936	349,866	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,798	214,288	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,090	2,194	261,469	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,300	3,440	409,809	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	3,106	370,031	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,020	240,674	2021/9/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,320	5,394	642,649	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	4,020	6,693	797,360	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	4,100	4,272	508,986	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,940	5,143	612,753	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	5,005	596,339	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	3,010	5,574	664,092	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/48	4.75	2,550	3,650	434,898	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	3,720	6,413	763,998	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,830	5,651	673,269	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,140	3,503	417,382	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	4,360	6,429	765,984	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	5,440	6,801	810,288	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	2,069	246,546	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,478	176,102	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	2,900	2,973	354,177	2024/4/5
OBL 0% 04/08/22	—	2,650	2,680	319,334	2022/4/8
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,864	460,405	2025/4/11
OBL 0% 04/14/23	—	2,220	2,261	269,435	2023/4/14
OBL 0% 10/07/22	—	4,160	4,223	503,123	2022/10/7
OBL 0% 10/08/21	—	2,600	2,621	312,253	2021/10/8
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,543	183,899	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,350	2,415	287,788	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0.05% 01/15/23	0.05	2,030	2,011	239,633	2023/1/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	566	67,543	2025/2/1
BTPS 0.35% 01/01/21	0.35	2,580	2,584	307,897	2021/11/1
BTPS 0.45% 06/01/21	0.45	1,400	1,404	167,291	2021/6/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	2,170	2,177	259,418	2023/10/15
BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	3,180	3,218	383,477	2022/8/1
BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	2,000	2,027	241,477	2023/3/1
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	2,580	2,615	311,626	2023/3/15
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	650	619	73,767	2030/8/1
BTPS 1% 07/15/22	1.0	2,160	2,191	261,015	2022/7/15
BTPS 1.2% 04/01/22	1.2	2,010	2,042	243,323	2022/4/1
BTPS 1.25% 02/01/26	1.25	1,950	1,967	234,341	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,000	993	118,390	2030/4/1
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	2,900	2,955	352,063	2022/4/15
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	550	521	62,149	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,359	281,122	2025/5/15
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,050	1,076	128,213	2022/9/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,467	293,964	2024/11/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,478	295,239	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	3,180	3,282	391,007	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	3,036	361,702	2032/3/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,600	1,663	198,186	2024/7/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,000	2,087	248,714	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,817	335,604	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	1,650	1,739	207,191	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,203	262,507	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,740	1,838	219,042	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,388	403,614	2026/7/15
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,573	306,546	2021/12/15
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	3,680	3,927	467,891	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,390	1,459	173,903	2036/9/1
BTPS 2.3% 10/15/21	2.3	2,700	2,776	330,787	2021/10/15
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,500	2,717	323,787	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	870	888	105,870	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,960	3,143	374,468	2023/10/1

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
				邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,184	379,407	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,165	377,130	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,510	2,713	323,302	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,320	1,421	169,358	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,890	2,113	251,753	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,750	3,126	372,429	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	4,960	5,648	672,855	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,644	195,906	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	2,306	274,723	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,210	1,443	171,924	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,592	308,864	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,694	559,305	2030/3/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	3,220	3,353	399,473	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,413	287,560	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	2,590	3,387	403,577	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	4,210	5,401	643,449	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	3,135	373,554	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,480	295,473	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,994	475,876	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	5,790	6,555	781,004	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,950	4,173	497,227	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	3,630	4,597	547,707	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,200	3,192	380,263	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/22	5.0	3,250	3,516	418,957	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,400	5,241	624,474	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,420	4,760	567,151	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,190	4,663	555,571	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,800	4,078	485,825	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,759	566,987	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,250	1,393	166,031	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,450	3,871	461,175	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,080	4,486	534,481	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,940	5,678	676,529	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,520	4,811	573,152	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,929	229,896	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,027	122,385	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/22	—	2,000	2,018	240,512	2022/2/25
FRTR 0% 03/25/23	—	5,290	5,370	639,776	2023/3/25
FRTR 0% 03/25/24	—	5,950	6,065	722,574	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	5,090	5,196	619,053	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/21	—	4,100	4,120	490,894	2021/5/25
FRTR 0% 05/25/22	—	4,050	4,094	487,781	2022/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	5,290	630,295	2029/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,530	4,687	558,457	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,980	6,259	745,709	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	5,090	5,347	637,090	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	4,000	4,219	502,635	2029/5/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,640	6,060	721,949	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,550	1,568	186,809	2052/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	4,570	4,918	585,909	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	5,056	602,408	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,480	5,897	702,604	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	5,110	5,843	696,134	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,430	5,081	605,313	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,420	6,301	750,643	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,330	4,065	484,360	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	4,590	4,906	584,550	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	2,459	292,979	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,460	4,311	513,598	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	5,810	6,394	761,788	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,460	4,651	554,086	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,554	542,585	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	5,740	6,129	730,154	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,160	6,475	771,412	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,700	5,749	684,986	2027/10/25

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)				
FRTR 3% 04/25/22	3.0	8,490	9,065	1,079,952	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,190	5,165	615,387	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,650	5,950	708,875	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	6,350	7,804	929,757	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,050	4,126	491,558	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,850	3,915	466,471	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	5,539	659,905	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,020	5,849	696,794	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,830	8,708	1,037,465	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,680	6,123	729,540	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	7,778	926,661	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	7,371	878,144	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,562	305,215	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,264	150,628	2023/4/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/22	—	980	988	117,819	2022/1/15
NETHER 0% 01/15/24	—	1,850	1,888	225,022	2024/1/15
NETHER 0% 07/15/30	—	1,610	1,646	196,135	2030/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,400	2,495	297,251	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,600	1,678	199,966	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	760	831	99,034	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,860	1,969	234,621	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	2,110	2,284	272,208	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,620	1,765	210,345	2028/7/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	3,060	3,284	391,282	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,202	262,379	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	660	700	83,412	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,650	2,205	262,792	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,130	3,629	432,328	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,740	2,857	340,399	2021/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	2,940	3,278	390,563	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,060	3,712	442,251	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,110	3,534	421,054	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,380	2,006	238,993	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	242	28,941	2023/1/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/25	—	870	872	103,947	2025/1/31
SPGB 0% 04/30/23	—	2,380	2,396	285,541	2023/4/30
SPGB 0.05% 10/31/21	0.05	1,930	1,940	231,224	2021/10/31
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,328	277,423	2024/7/30
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	1,440	1,466	174,707	2023/7/30
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	2,390	2,424	288,823	2022/4/30
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	2,210	2,251	268,233	2022/10/31
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	2,150	2,149	256,057	2030/4/30
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,780	2,816	335,544	2029/10/31
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	2,200	2,229	265,611	2021/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	1,180	1,077	128,326	2050/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	3,256	387,983	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	3,450	3,705	441,467	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	4,430	4,804	572,401	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,300	3,581	426,631	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,860	3,116	371,214	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,600	2,824	336,485	2027/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	3,050	3,322	395,867	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,299	393,021	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,820	2,068	246,455	2035/7/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	3,122	371,936	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,510	2,863	341,104	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,360	2,633	313,696	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,925	348,468	2033/7/30
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,780	2,364	281,629	2048/10/31
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,600	4,057	483,392	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,170	2,954	352,001	2046/10/31
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,500	2,424	288,866	2066/7/30
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,914	347,172	2024/4/30

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)				
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,720	4,094	487,818	2037/1/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	3,490	4,045	481,996	2023/10/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,526	420,145	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,640	4,410	525,374	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,843	338,699	2024/1/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,590	4,374	521,177	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,630	6,462	769,864	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,850	3,372	401,731	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,900	3,341	398,122	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,390	3,572	425,559	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,730	4,358	519,179	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	4,280	4,724	562,839	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,715	561,755	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,550	184,717	2029/1/31
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	—	2,310	2,338	278,529	2027/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,060	1,071	127,595	2030/6/22
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,510	1,546	184,225	2023/10/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	690	670	79,915	2040/6/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	970	1,009	120,293	2024/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,180	2,310	275,201	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,810	215,642	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,560	1,679	200,069	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,550	1,686	200,932	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,380	2,565	305,677	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,490	1,642	195,706	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	850	969	115,452	2033/4/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	530	620	73,952	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,480	1,819	216,760	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	630	798	95,127	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,280	1,602	190,943	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	940	1,424	169,705	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,450	1,574	187,518	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	680	1,005	119,733	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,440	2,747	327,251	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,424	169,684	2034/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,300	2,241	267,032	2045/6/22
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,220	1,322	157,496	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,573	187,429	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,140	3,688	439,420	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,350	2,499	297,722	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,100	2,336	278,375	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,462	174,248	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,920	4,919	586,026	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	4,022	479,239	2028/3/28
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	—	470	475	56,591	2030/2/20
RAGB 0% 07/15/23	—	1,500	1,524	181,657	2023/7/15
RAGB 0% 07/15/24	—	920	938	111,760	2024/7/15
RAGB 0% 09/20/22	—	320	324	38,625	2022/9/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,170	1,237	147,436	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	890	939	111,921	2027/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,620	1,742	207,547	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	560	619	73,857	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,140	2,288	272,618	2026/10/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,660	1,803	214,855	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	830	1,079	128,626	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	450	657	78,315	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,083	129,076	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,433	170,766	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	760	1,452	173,049	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,030	1,362	162,345	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,391	165,826	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	2,990	3,286	391,565	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,730	1,820	216,914	2021/9/15

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,160	1,252	149,266	2022/4/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	470	1,066	127,066	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,770	2,947	351,127	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,310	1,709	203,671	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,731	206,260	2027/7/15	
(フィンランド)						
国債証券						
RFGB 0% 04/15/22	—	390	394	46,968	2022/4/15	
RFGB 0% 09/15/23	—	540	549	65,469	2023/9/15	
RFGB 0% 09/15/24	—	420	428	51,056	2024/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	510	509	60,731	2036/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	652	77,723	2026/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	1,310	1,384	164,934	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	670	709	84,569	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	650	689	82,138	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	500	545	64,958	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	737	87,874	2025/9/15	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	640	732	87,314	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	450	579	69,028	2047/4/15	
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	688	82,022	2023/4/15	
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	1,250	1,313	156,464	2022/9/15	
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	802	95,575	2024/4/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	570	870	103,658	2042/7/4	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	420	522	62,199	2028/7/4	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	640	786	93,723	2025/7/4	
(アイルランド)						
国債証券						
IRISH 0% 10/18/22	—	530	535	63,739	2022/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	1,270	1,291	153,802	2027/5/15	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	480	476	56,758	2035/5/15	
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	820	838	99,859	2022/3/15	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	1,070	1,145	136,434	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,420	1,516	180,693	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	920	1,002	119,450	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	630	706	84,193	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	390	436	52,050	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	630	746	88,885	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	750	892	106,276	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,090	1,426	169,892	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,400	1,709	203,705	2030/5/15	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	1,160	1,324	157,801	2024/3/18	
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	1,010	1,131	134,802	2023/3/20	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,510	1,918	228,596	2025/3/13	
ユ ー ロ 計				106,036,644		
(イギリス)						
国債証券						
UKT 0.125% 01/31/23	0.125	1,090	1,092	144,854	2023/1/31	
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	3,540	3,580	474,528	2022/7/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	3,400	3,505	464,559	2025/6/7	
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,910	2,980	394,968	2023/7/22	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	2,760	2,946	390,520	2029/10/22	
UKT 1% 04/22/24	1.0	3,100	3,224	427,301	2024/4/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	2,990	3,247	430,444	2027/7/22	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	650	734	97,340	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,000	2,185	289,583	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,980	3,635	481,845	2047/7/22	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	4,040	4,566	605,151	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,100	1,456	192,970	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,530	2,362	313,107	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	2,120	2,748	364,283	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,030	2,856	378,518	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,470	2,569	340,542	2022/9/7	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	3,530	4,240	561,984	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,972	261,463	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,686	355,995	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	2,350	4,233	561,028	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,620	1,812	240,195	2024/9/7	

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,820	4,442	588,772	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,030	5,013	664,426	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,140	4,883	647,220	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,090	4,027	533,810	2052/7/22	
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,820	2,953	391,367	2021/9/7	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,920	4,310	571,290	2060/1/22	
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,950	2,089	276,890	2022/3/7	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,790	4,395	582,480	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,950	2,854	378,257	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,880	3,151	417,640	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	670	880	116,670	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,270	3,880	514,304	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,180	4,101	543,585	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,890	3,738	495,496	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,310	5,048	669,046	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,770	2,775	367,851	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,460	4,481	593,920	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,900	4,270	565,917	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	3,317	439,621	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,980	2,452	324,984	2025/3/7	
UKT 6% 12/07/28	6.0	1,250	1,873	248,352	2028/12/7	
UKT 8% 06/07/21	8.0	740	800	106,068	2021/6/7	
小 計				17,809,166		
(スウェーデン)						
国債証券						
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,150	6,575	74,241	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,600	7,197	81,264	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,740	9,304	105,047	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	13,277	149,897	2023/11/13	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	8,370	9,517	107,456	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,900	9,231	104,228	2039/3/30	
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	12,850	13,831	156,155	2022/6/1	
小 計				778,291		
(ノルウェー)						
国債証券						
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	3,610	3,880	42,643	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,910	5,233	57,513	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,120	4,484	49,280	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,190	5,554	61,039	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	5,420	5,998	65,919	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	4,900	5,473	60,154	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,866	130,414	2023/5/24	
NGB 3% 03/14/24	3.0	6,830	7,542	82,887	2024/3/14	
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	11,380	11,781	129,481	2021/5/25	
小 計				679,335		
(デンマーク)						
国債証券						
DGB 0.25% 11/15/22	0.25	3,140	3,199	51,223	2022/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	10,730	11,425	182,576	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,460	13,360	213,501	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,380	7,893	126,139	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	8,930	10,013	160,036	2025/11/15	
DGB 3% 11/15/21	3.0	8,330	8,759	139,970	2021/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,530	30,994	495,285	2039/11/15	
小 計				1,368,613		
(ポーランド)						
国債証券						
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	4,550	4,636	123,934	2021/7/25	
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	4,710	4,895	130,866	2022/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	4,218	112,757	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,860	6,209	165,968	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,760	4,055	108,392	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,750	5,226	139,711	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,200	3,543	94,718	2027/7/25	

当		期		末	
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
POLGB 2.75% 04/25/28		2.75	6,030	6,808	181,988 2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29		2.75	4,060	4,654	124,420 2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25		3.25	3,480	3,925	104,929 2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23		4.0	4,900	5,504	147,131 2023/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29		5.75	600	838	22,411 2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22		5.75	3,150	3,551	94,944 2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21		5.75	3,400	3,667	98,023 2021/10/25
小 計				1,650,199	
(オーストラリア)			千オーストラリア ドル	千オーストラリア ドル	
国債証券					
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	1,800	1,790	127,757	2024/11/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	1,940	1,993	142,247	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	2,060	2,175	155,214	2031/6/21
ACGB 2% 12/21/21	2.0	1,930	1,981	141,406	2021/12/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	3,570	3,987	284,498	2028/5/21
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	4,050	4,249	303,199	2022/11/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,790	4,374	312,112	2030/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	4,200	4,595	327,888	2024/4/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	800	963	68,732	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	730	882	62,936	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	3,330	3,831	273,357	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	2,960	3,435	245,116	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	4,650	5,445	388,539	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	2,147	153,191	2047/3/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	3,480	3,960	282,569	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	4,100	4,950	353,219	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,320	1,699	121,283	2039/6/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	2,198	156,829	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	3,700	4,504	321,403	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,910	2,708	193,244	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	4,150	5,308	378,795	2027/4/21
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	2,820	3,245	231,541	2023/4/21
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	3,450	3,630	259,010	2021/5/15
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	3,350	3,738	266,721	2022/7/15
小 計				5,550,816	
(シンガポール)			千シンガポールドル	千シンガポールドル	
国債証券					
SIGB 1.25% 10/01/21	1.25	1,440	1,459	110,766	2021/10/1
SIGB 1.75% 02/01/23	1.75	800	830	63,055	2023/2/1
SIGB 1.75% 04/01/22	1.75	290	297	22,614	2022/4/1
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	434	32,956	2024/2/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	740	808	61,362	2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	1,080	1,102	83,650	2021/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	510	592	44,994	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	320	349	26,547	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	260	312	23,727	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	1,050	1,204	91,390	2028/5/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	1,240	1,664	126,298	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	610	794	60,287	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	1,070	1,149	87,223	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	840	990	75,187	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	350	418	31,769	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	840	930	70,640	2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	640	680	51,674	2022/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	840	1,085	82,379	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	1,044	79,294	2027/3/1
小 計				1,225,821	
(マレーシア)			千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット	
国債証券					
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,500	1,539	38,050	2022/8/15
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	700	728	18,002	2024/6/14
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	2,840	2,934	72,543	2023/3/15

当		期		末	
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,596	39,455	2027/5/31
MGS 3.62% 11/30/21	3.62	1,240	1,268	31,364	2021/11/30
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,930	2,058	50,882	2028/6/15
MGS 3.757% 04/20/23	3.757	350	364	8,999	2023/4/20
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	1,500	1,554	38,415	2022/9/30
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	1,660	1,735	42,904	2023/8/17
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	2,350	2,505	61,944	2033/4/15
MGS 3.882% 03/10/22	3.882	750	772	19,106	2022/3/10
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,093	27,023	2025/3/14
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	730	794	19,638	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,216	30,072	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	2,127	52,580	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,440	1,546	38,240	2026/11/30
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,630	1,751	43,293	2025/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	2,050	2,102	51,985	2021/9/30
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,900	2,024	50,045	2024/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	430	469	11,606	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	2,030	2,077	51,353	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,280	1,366	33,770	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,000	2,224	54,983	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	810	892	22,052	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,440	2,676	66,170	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,410	1,598	39,524	2030/4/15
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,500	1,726	42,667	2033/11/7
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,480	1,696	41,937	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,280	2,667	65,932	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	800	952	23,535	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,050	1,253	30,987	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	2,550	3,004	74,273	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	1,480	1,738	42,972	2028/9/15
小 計				1,336,319	
(イスラエル)			千イスラエル シェケル	千イスラエル シェケル	
国債証券					
ILGOV 0.75% 07/31/22	0.75	6,750	6,841	209,430	2022/7/31
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	830	851	26,054	2030/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,160	2,437	74,622	2028/9/28
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	4,080	4,618	141,365	2024/3/31
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,100	3,028	92,701	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/22	5.5	3,160	3,446	105,492	2022/1/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	2,580	4,520	138,387	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	6,020	8,200	251,016	2026/10/30
小 計				1,039,070	
合 計				268,683,695	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

		当	期	末
銘 柄 別		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)	
外 国	EURO-SCHATZ	480	—	
	US 5YR NOTE	970	—	
	EURO-BOBL FU	723	—	
	EURO-BUND	1,926	—	
	US 10YR NOTE	685	—	
	US LONG BOND	913	—	

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	268,683,695	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,533,784	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	276,217,479	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(271,471,612千円)の投資信託財産総額(276,217,479千円)に対する比率は98.3%です。

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

1米ドル=107.53円

1カナダドル=78.01円

1メキシコペソ=4.84円

1ユーロ=119.13円

1イギリスポンド=132.53円

1スウェーデンクローナ=11.29円

1ノルウェークローネ=10.99円

1デンマーククローネ=15.98円

1ポーランドズロチ=26.73円

1オーストラリアドル=71.35円

1シンガポールドル=75.89円

1マレーシアリングギット=24.72円

1イスラエルシェケル=30.61円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年5月29日現在
(A)資 産	282,057,087,912円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,286,374,371
公 社 債(評価額)	268,683,695,354
未 収 入 金	5,895,453,132
未 収 利 息	1,601,557,980
前 払 費 用	116,375,539
差 入 委 託 証 拠 金	473,631,536
(B)負 債	5,888,038,235
未 払 金	5,850,176,156
未 払 解 約 金	37,851,717
未 払 利 息	10,362
(C)純 資 産 総 額(A-B)	276,169,049,677
元 本	95,174,617,742
次 期 繰 越 損 益 金	180,994,431,935
(D)受 益 権 総 口 数	95,174,617,742口
1万口当たり基準価額(C/D)	29,017円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配 当 等 収 益	8,041,707,766円
受 取 利 息	8,044,189,823
そ の 他 収 益 金	887,085
支 払 利 息	△3,369,142
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	13,280,421,919
売 買 益	25,274,222,739
売 買 損	△11,993,800,820
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	263,017,893
取 引 益	423,218,651
取 引 損	△160,200,758
(D)そ の 他 費 用	△81,577,091
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	21,503,570,487
(F)前 期 繰 越 損 益 金	197,353,550,378
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	75,605,124,172
(H)解 約 差 損 益 金	△113,467,813,102
(I) 計 (E+F+G+H)	180,994,431,935
次 期 繰 越 損 益 金(I)	180,994,431,935

(注1) (B) 有価証券売買損益および(C) 先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (G) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H) 解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は113,640,718,674円、期中追加設定元本額は42,174,376,204円、期中一部解約元本額は60,640,477,136円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。