

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	信託期間は2008年3月3日から無期限です。	
運 用 方 針	信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	グ ロー バ ル ・ インデックス・ バランス・ファンド	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。
	日 本 株 式 マザーファンド	わが国の金融商品取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外 国 株 式 マザーファンド	わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。
	外 国 債 券 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	グ ロー バ ル ・ インデックス・ バランス・ファンド	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。
	日 本 株 式 マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。
	外 国 株 式 マザーファンド	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式への投資割合には制限を設けません。
	外 国 債 券 マザーファンド	外貨建資産への投資には、制限を設けません。
分 配 方 針	年1回、毎決算時(決算日は6月10日。ただし当日が休業日の場合は翌営業日。)(に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 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。	

グローバル・インデックス・ バランス・ファンド (愛称:投資生活)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第14期（決算日 2021年6月10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期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			参 考 指 数		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	投資信託証券組入率	純資産総額
	(分配額)	税 込 分配金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
第10期(2017年6月12日)	14,905	0	13.5	15,733	15.0	64.0	2.2	32.0	0.2	0.8	3,275
第11期(2018年6月11日)	16,204	0	8.7	17,159	9.1	64.3	2.4	31.3	0.4	0.7	3,448
第12期(2019年6月10日)	15,823	0	△2.4	16,708	△2.6	63.1	2.2	32.5	0.4	0.9	3,163
第13期(2020年6月10日)	17,000	0	7.4	18,251	8.2	64.5	1.0	29.8	0.8	0.8	3,240
第14期(2021年6月10日)	20,530	0	20.8	22,210	21.7	64.0	1.8	32.4	0.4	0.7	3,676

(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」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は買建比率－売建比率です。

参考指数は、当ファンドの基本配分比率(3つの資産への均等配分)を基に、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)を当社で独自に合成した指数です。

TOPIX(東証株価指数、配当込み)

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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。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。

MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ・インデックスとは、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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及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及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、円ベース)

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。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 資 証 比	信 託 組 入 率
		騰落率		騰落率										
(当 期 首) 2020年 6月10日	円	%		%	%	%	%	%	%	%	%	%	%	%
	17,000	—	18,251	—	64.5	1.0	29.8	0.8	0.8					
6月末	16,570	△2.5	17,787	△2.5	62.5	2.2	33.1	0.6	0.8					
7月末	16,578	△2.5	17,829	△2.3	62.4	2.1	33.4	0.7	0.8					
8月末	17,419	2.5	18,734	2.6	64.8	1.6	31.9	0.4	0.8					
9月末	17,276	1.6	18,595	1.9	64.3	1.7	32.3	0.5	0.8					
10月末	16,860	△0.8	18,173	△0.4	64.1	1.7	32.5	0.6	0.7					
11月末	18,180	6.9	19,616	7.5	66.0	1.1	31.4	0.5	0.8					
12月末	18,577	9.3	20,054	9.9	65.6	1.1	31.7	0.3	0.7					
2021年 1月末	18,703	10.0	20,180	10.6	65.4	1.1	31.9	0.4	0.7					
2月末	19,049	12.1	20,616	13.0	65.7	1.0	31.5	0.3	0.7					
3月末	19,979	17.5	21,521	17.9	65.4	1.7	31.0	0.5	0.7					
4月末	20,097	18.2	21,711	19.0	65.2	1.8	31.3	0.5	0.8					
5月末	20,358	19.8	22,044	20.8	63.9	1.9	32.4	0.5	0.7					
(当 期 末) 2021年 6月10日	20,530	20.8	22,210	21.7	64.0	1.8	32.4	0.4	0.7					

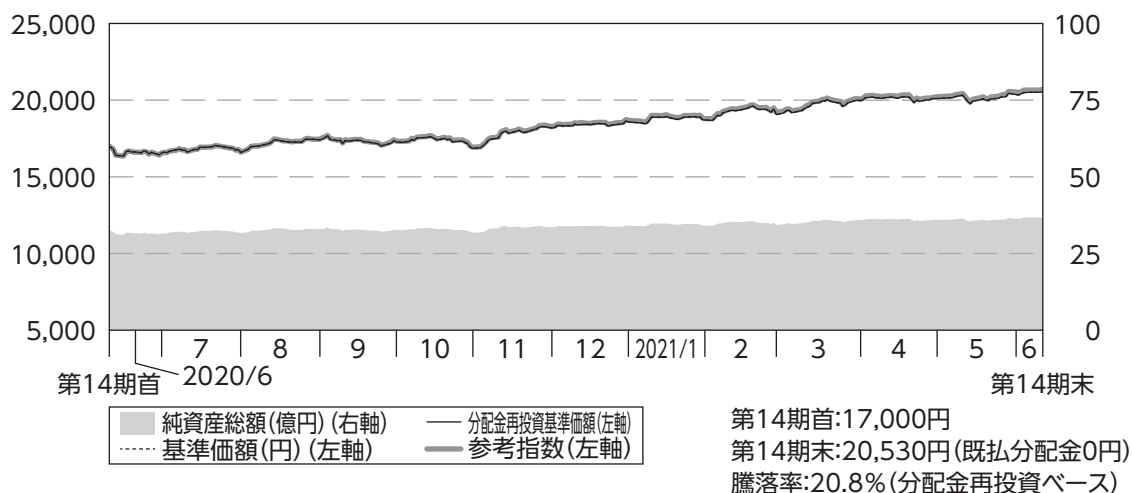
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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参考指数は、2020年6月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。期初より各国における大規模な財政出動や金融緩和策への期待に加え、新型コロナウイルスワクチン開発の進展などを背景に上昇基調で推移しました。新型コロナウイルスの新規感染者数増加や米長期金利の急上昇への懸念などから上昇幅を縮小する場面も見られましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や良好な経済指標などが支えとなり、期末まで堅調な推移が続きまし

組入ファンド	投資資産	基本組入比率	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
日本株式マザーファンド	国内株式	33.3%	33.5%	23.1%
外国株式マザーファンド	外国株式	33.3%	33.1%	37.4%
外国債券マザーファンド	外国債券	33.3%	33.0%	5.3%

国内株式市場

期初から2021年3月にかけては、新型コロナウイルスワクチン開発の進展や各国による追加経済対策に対する期待を背景に上昇基調で推移しました。その後期末にかけては、国内での新型コロナウイルスのワクチン接種の進展が期待された一方で新規感染者数の増加や緊急事態宣言発出を受けた国内景気の先行き懸念も高まり、上値の重い展開となりました。

外国株式市場

期初から各国の大規模な財政出動や金融緩和策への期待に加え、新型コロナウイルスワクチン開発の進展などを背景に上昇基調で推移しました。米欧各国での新型コロナウイルスの新規感染者数増加や米長期金利の急上昇への懸念などから上昇幅を縮小する場面も見られましたが、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や良好な経済指標などが支えとなり、期末まで堅調な推移が続きました。

外国債券市場

主要国の長期金利は、2020年7月にかけて、各国の中央銀行が大規模な金融緩和策を展開したことなどから概ね低下しました。2021年3月にかけては、新型コロナウイルスワクチン開発の進展や米国などでの大規模財政出動のための国債増発による債券需給悪化懸念の高まり、予想インフレ率の上昇などを背景に主要国の利回りは上昇しました。その後期末にかけては概ねレンジ内での推移となりました。

○当ファンド

国内外の株式および外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本としました。

・日本株式マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数、配当込み)に連動する投資成果を目標として、現物株式については、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た上で、ベンチマーク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て運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む国内株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

・外国株式マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマーク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て運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む外国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

・外国債券マザーファンド

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)に連動する投資成果を目標として、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た運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む外国債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

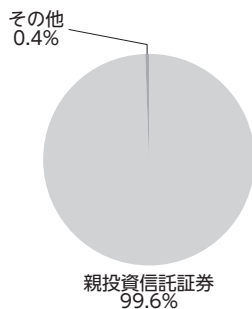
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

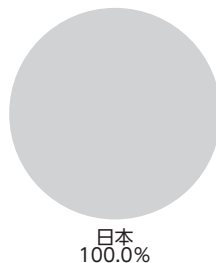
	当期末
	2021年6月10日
日本株式マザーファンド	33.5%
外国株式マザーファンド	33.1%
外国債券マザーファンド	33.0%
その他	0.4%
組入ファンド数	3

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

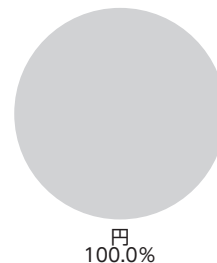
○資産別配分



○国別配分



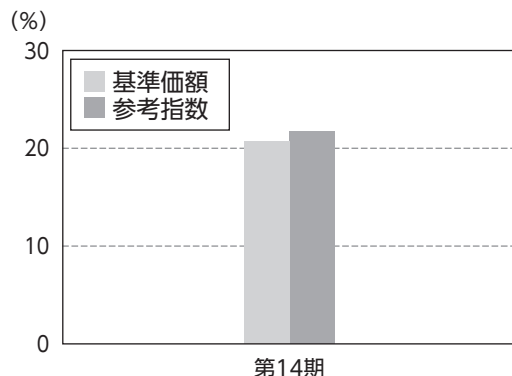
○通貨別配分



(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

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。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)と参考指数の騰落率の対比です。



分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送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14期	
	2020年6月11日～2021年6月10日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	12,906	

- (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。

○当ファンド

主として下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の株式および外国の公社債に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

各資産への配分は、3つの資産への均等配分を基本とします。

・日本株式マザーファンド

株式への投資は、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、配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

・外国株式マザーファンド

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、同インデックス（配当込み、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。

・外国債券マザーファンド

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年6月11日～2021年6月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	121円	0.660%	(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18,303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)	(60)	(0.330)	
(販売会社)	(50)	(0.275)	
(受託会社)	(10)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(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)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(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)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.016	(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)	(2)	(0.010)	
(監査費用)	(1)	(0.006)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	124	0.679	

(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。

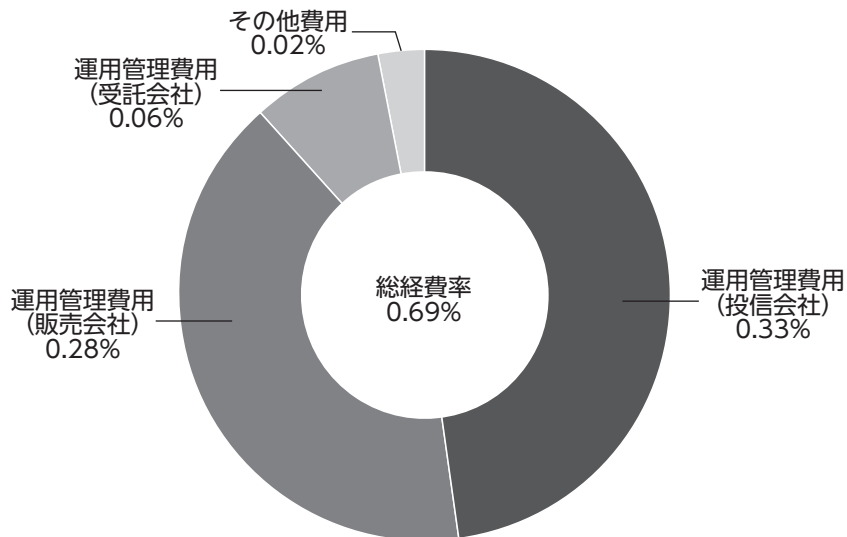
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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。

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.69%です。



(注1)各費用は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2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)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 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日 本 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	43,113	83,536	89,295	175,824
外 国 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	12,470	39,835	75,775	267,155
外 国 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	79,312	203,939	19,773	50,916

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

<日本株式マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	42,591,929千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	260,924,811千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.16

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

<外国株式マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	74,482,467千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	242,733,542千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.30

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.013577	百万円 0.013577	% 100.0	百万円 0.013577	百万円 0.013577	% 100.0
コール・ローン	3,393	107	3.2	3,386	111	3.3

(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。

<日本株式マザーファンド>

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 3	百万円 3	% 100.0	百万円 3	百万円 3	% 100.0
コール・ローン	572,790	20,015	3.5	571,483	20,267	3.5

<平均保有割合 0.4%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
為 替 先 物 取 引	百万円 11,991	百万円 11,991	% 100.0	百万円 12,031	百万円 12,031	% 100.0
為 替 直 物 取 引	34,193	34,193	100.0	57,431	57,431	100.0
金 銭 信 託	2	2	100.0	2	2	100.0
コール・ローン	344,884	11,129	3.2	347,032	11,943	3.4

<平均保有割合 0.4%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国債券マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
為 替 先 物 取 引	百万円 33,683	百万円 33,683	% 100.0	百万円 36,231	百万円 36,231	% 100.0
為 替 直 物 取 引	10,253	10,221	99.7	7,869	7,800	99.1
金 銭 信 託	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	466,731	19,743	4.2	469,088	20,711	4.4

<平均保有割合 0.8%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

■利害関係人の発行する有価証券等

＜日本株式マザーファンド＞

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 28	百万円 36	百万円 737

(注1) 買付額及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。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

種 類	当 期 首(前 期 末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 608,515	千口 562,333	千円 1,230,723
外 国 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	365,329	302,024	1,216,495
外 国 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	396,437	455,976	1,214,037

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

日本株式マザーファンド 133,684,734千口
 外国株式マザーファンド 70,987,930千口
 外国債券マザーファンド 55,650,103千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日 本 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	1, 230, 723	33. 4
外 国 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	1, 216, 495	33. 0
外 国 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	1, 214, 037	32. 9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	27, 390	0. 7
投 資 信 託 財 産 総 額	3, 688, 645	100. 0

(注1) 外国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(284, 934, 662千円)の投資信託財産総額(286, 279, 057千円)に対する比率は99. 5%です。

(注2) 外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(146, 558, 766千円)の投資信託財産総額(148, 339, 400千円)に対する比率は98. 8%です。

(注3) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=109. 65円	1カナダドル=90. 51円	1メキシコペソ=5. 5546円
1ユーロ=133. 49円	1イギリスポンド=154. 75円	1スイスフラン=122. 35円
1スウェーデンクローナ=13. 26円	1ノルウェークローネ=13. 25円	1デンマーククローネ=17. 95円
1ポーランドズロチ=29. 8245円	1オーストラリアドル=84. 69円	1ニュージーランドドル=78. 59円
1香港ドル=14. 13円	1シンガポールドル=82. 77円	1マレーシアリンギット=26. 6036円
1イスラエルシェケル=33. 8066円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年6月10日現在
(A) 資 産	3, 688, 645, 658円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	22, 773, 320
日本株式マザーファンド(評価額)	1, 230, 723, 150
外国株式マザーファンド(評価額)	1, 216, 495, 167
外国債券マザーファンド(評価額)	1, 214, 037, 404
未 収 入 金	4, 616, 617
(B) 負 債	12, 619, 251
未 払 解 約 金	920, 020
未 払 信 託 報 酬	11, 602, 579
未 払 利 息	25
そ の 他 未 払 費 用	96, 627
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	3, 676, 026, 407
元 本	1, 790, 587, 673
次 期 繰 越 損 益 金	1, 885, 438, 734
(D) 受 益 権 総 口 数	1, 790, 587, 673口
1万口当たり基準価額(C/D)	20, 530円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年6月11日 至 2021年6月10日
(A) 配 当 等 収 益	△4, 425円
受 取 利 息	48
支 払 利 息	△4, 473
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	640, 835, 127
売 買 益	672, 912, 548
売 買 損	△32, 077, 421
(C) 信 託 報 酬 等	△22, 593, 871
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	618, 236, 831
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	885, 822, 973
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	381, 378, 930
(配 当 等 相 当 額)	(806, 745, 580)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△425, 366, 650)
(G) 計 (D+E+F)	1, 885, 438, 734
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	1, 885, 438, 734
追 加 信 託 差 損 益 金	381, 378, 930
(配 当 等 相 当 額)	(806, 940, 838)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△425, 561, 908)
分 配 準 備 積 立 金	1, 504, 059, 804

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注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＞

※当ファンドの期首元本額は1,906,104,728円、期中追加設定元本額は106,278,424円、期中一部解約元本額は221,795,479円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	60,649,756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)	557,587,075円
(C) 収益調整金額	806,940,838円
(D) 分配準備積立金額	885,822,973円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	2,311,000,642円
(F) 期末残存口数	1,790,587,673口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	12,906円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	—円

お知らせ

該当事項はありません。

日本株式マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2021年1月22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2001年1月23日から無期限です。
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品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		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
		期 中 騰落率		期 中 騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第16期(2017年1月23日)	15,273	12.7	2,158.90	12.7	99.1	0.9	222,163
第17期(2018年1月22日)	19,496	27.7	2,754.01	27.6	98.8	1.2	252,989
第18期(2019年1月22日)	16,400	△15.9	2,315.87	△15.9	99.0	1.0	218,280
第19期(2020年1月22日)	18,844	14.9	2,660.66	14.9	99.1	0.9	262,004
第20期(2021年1月22日)	20,561	9.1	2,901.12	9.0	99.1	0.7	278,922

(注)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(当 期 首) 2020年 1月22日	円 18,844	% －	2,660.66	% －	% 99.1	% 0.9
1月末	18,200	△3.4	2,569.77	△3.4	98.7	1.3
2月末	16,330	△13.3	2,305.76	△13.3	98.8	1.1
3月末	15,357	△18.5	2,167.60	△18.5	97.4	2.5
4月末	16,023	△15.0	2,261.88	△15.0	97.8	2.1
5月末	17,113	△9.2	2,416.04	△9.2	98.1	1.7
6月末	17,086	△9.3	2,411.45	△9.4	98.6	1.3
7月末	16,399	△13.0	2,314.39	△13.0	99.0	1.0
8月末	17,738	△5.9	2,503.59	△5.9	99.0	0.9
9月末	17,967	△4.7	2,536.14	△4.7	98.2	1.8
10月末	17,458	△7.4	2,464.21	△7.4	98.1	1.9
11月末	19,409	3.0	2,738.72	2.9	98.0	1.6
12月末	19,986	6.1	2,819.93	6.0	99.0	0.9
(当 期 末) 2021年 1月22日	20,561	9.1	2,901.12	9.0	99.1	0.7

(注1)騰落率は期首比です。

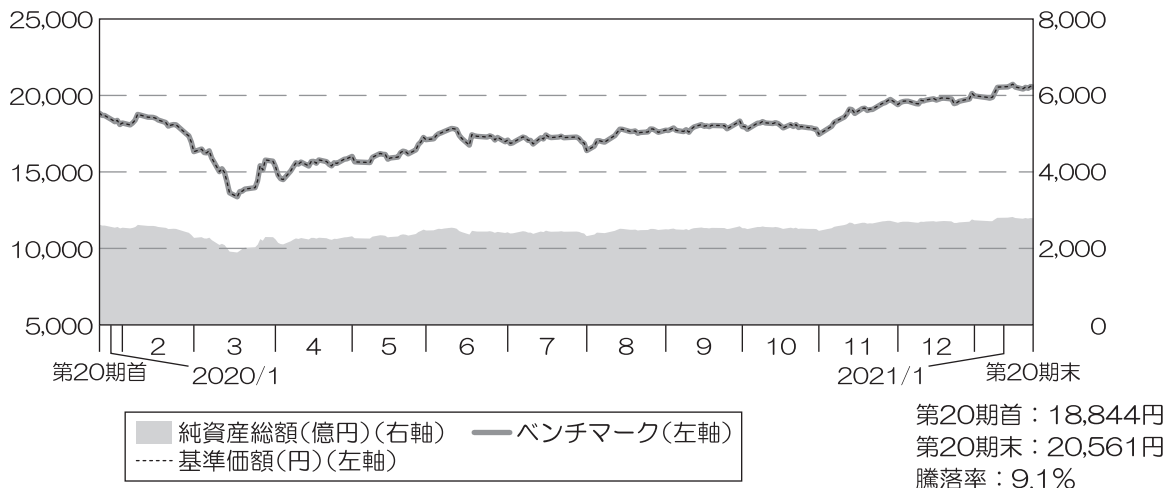
(注2)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

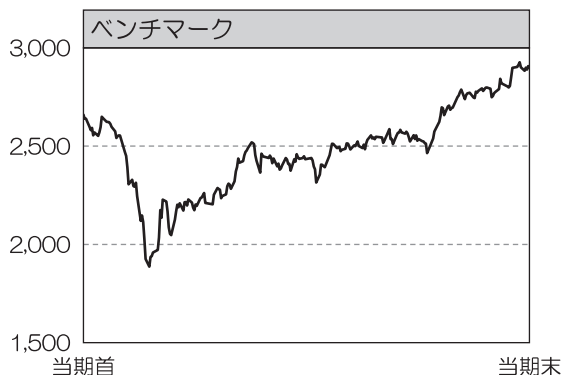


(注) ベンチマークは、2020年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期首比では上昇しました。

投資環境



期初の国内株式市場は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による景気や企業業績の減速懸念などから、大幅に下落しました。その後は、各国の大型経済対策や金融緩和策が好感されたこと、世界的な経済活動の再開、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ましたが、国内外の実質GDP(国内総生産)の悪化や、新型コロナウイルス感染再拡大への警戒感などが上値を抑えました。期末にかけては、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、新型コロナウイルスワクチンの早期の実用化期待、米国の追加経済対策の成立や財政支出拡大による景気回復が期待されたことなどから、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、配当込み)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

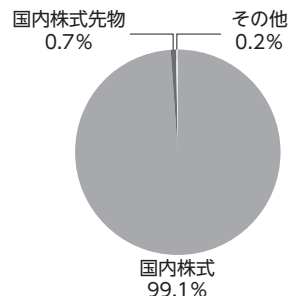
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.3%
2	ソフトバンクグループ	日本	2.6%
3	ソニー	日本	2.5%
4	キーエンス	日本	2.0%
5	任天堂	日本	1.5%
6	日本電信電話	日本	1.4%

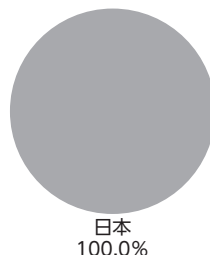
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本電産	日本	1.3%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	信越化学工業	日本	1.3%
10	リクルートホールディングス	日本	1.2%
組入銘柄数		2,092	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

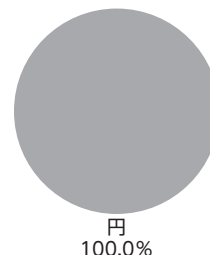
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

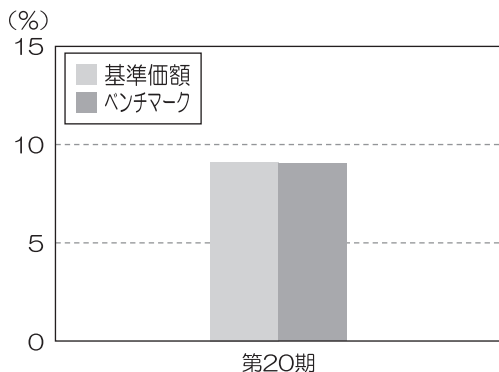


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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0.7%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。

今後の運用方針

株式への投資は、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、配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年1月23日～2021年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	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
（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)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(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
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用＝ $\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}} \times 10,000$ 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）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
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(17,422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 9,869 (△12,112)	千円 17,468,664 (－)	千株 9,008	千円 20,162,964

(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		証券 － (29,800)	千円 － (－)	証券 － (29,800)	千円 － (－)

(注1) 金額は受渡代金です。
 (注2) ()内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 37,335	百万円 38,268	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) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	37,631,629千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	241,588,595千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.15

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
 (注2) (c) 売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

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	$\frac{B}{A}$	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 450	百万円 450	% 100.0	百万円 450	百万円 450	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	584,665	52,697	9.0	584,452	52,697	9.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人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	百万円 42	百万円 35	百万円 634

(注1)買付額及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		銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)				銭高組	1.4	1.5	6,127
極洋	5	5.1	15,733	鹿島建設	260	264.8	385,813
日本水産	143.4	146.1	63,845	不動産トラ	8.7	8.8	15,180
マルハニチロ	20.7	21.1	48,846	大末建設	3.8	3.9	3,190
雪国まいたけ	—	9	16,551	鉄建建設	7.2	7.3	13,702
カネコ種苗	4.3	4.4	6,749	西松建設	25.5	26	63,258
サカタのタネ	17.1	17.4	62,814	三井住友建設	80	81.5	36,675
ホクト	10.9	11.1	23,798	大豊建設	7.4	8	29,720
ホクリョウ	2.2	2.3	1,610	前田建設工業	82.9	84.5	76,303
鉱業(0.1%)				佐田建設	7.1	7.3	3,219
住石ホールディングス	29	29.5	3,392	ナカノフドー建設	9	9.2	3,707
日鉄鉱業	3.3	3.3	19,107	奥村組	18	15.9	41,896
三井松島ホールディングス	5.6	5.7	4,508	東鉄工業	14.2	14.5	39,875
国際石油開発帝石	575.3	537.2	334,138	イチケン	2.4	2.4	4,526
石油資源開発	18.7	19.1	38,983	富士ビー・エス	4.9	5	2,975
K&Oエナジーグループ	7	7.1	10,153	浅沼組	3.7	3.8	16,112
建設業(2.3%)				戸田建設	137.5	140.1	101,712
ヒノキヤグループ	3.6	3.6	7,304	熊谷組	15.3	15.6	41,823
ショーボンドホールディングス	20.5	22.7	106,803	北野建設	2	2.1	5,189
ミライト・ホールディングス	42.6	43.4	74,127	植木組	1.5	1.5	4,060
タマホーム	6.8	7.9	15,057	矢作建設工業	14.6	14.9	12,635
サンヨーホームズ	1.2	1.3	1,085	ピーエス三菱	10.9	11.1	6,870
日本アクア	5.7	5.8	3,549	日本ハウスホールディングス	22.6	23	7,590
ファーストコーポレーション	4.4	4.5	3,163	大東建託	39.7	36.8	351,072
ベステラ	2.5	2.5	4,427	新日本建設	14.1	14.3	11,969
TATERU	29.6	27.4	4,877	N I P P O	27.4	27.9	75,413
キャンディル	—	2.5	1,340	東亜道路工業	2.1	2.1	8,001
スペースバリューホールディングス	17.5	17.8	12,406	前田道路	35.1	29.8	52,299
ダイセキ環境ソリューション	2.8	2.8	2,158	日本道路	3.2	3.3	24,882
第一カッター興業	1.8	3.6	4,946	東亜建設工業	10.3	10.5	22,501
明豊ファシリティワークス	3.5	—	—	日本国土開発	19.3	32.8	18,236
安藤・間	85.4	87	64,815	若築建設	6	6.1	7,521
東急建設	42	42.8	21,999	東洋建設	37.1	37.8	18,711
コムシスホールディングス	50.9	51.8	164,206	五洋建設	131.3	133.7	122,736
ピーアールホールディングス	15.6	15.9	10,271	世紀東急工業	15.9	16.2	13,251
高松コンストラクショングループ	8.9	9.1	18,736	福田組	3.8	3.9	20,163
東建コーポレーション	4.4	4.5	36,000	住友林業	83.9	85.4	185,830
ソネック	1.5	1.5	1,279	日本基礎技術	11.1	11.3	5,412
ヤマウラ	6.2	6.3	5,802	巴コーポレーション	14.7	15	5,985
大成建設	110.4	112.5	406,125	大和ハウス工業	327.7	333.8	1,015,753
大林組	331.2	337.4	314,794	ライト工業	19	19.3	33,485
清水建設	336.1	342.3	269,390	積水ハウス	362.3	365.9	778,818
飛島建設	9.5	9.7	10,369	日特建設	8.6	8.8	6,837
長谷工コーポレーション	128.2	130.6	164,294	北陸電気工事	5.7	5.8	7,197
松井建設	13	13.3	9,482	ユアテック	18.9	19.3	16,848

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本リーテック	—	7.1	17,650	モロゾフ	1.8	1.8	10,332
四電工	1.8	1.8	4,678	亀田製菓	6	6.1	29,432
中電工	13.3	13.6	29,430	寿スビリッツ	10.2	10.4	57,408
関電工	47.1	48	43,728	カルビー	48.3	49.2	153,258
きんでん	78.7	80.1	138,973	森永乳業	19.6	20	102,400
東京エネシス	11	11.2	11,144	六甲バター	7	7.2	12,679
トーエネック	3.3	3.4	12,376	ヤクルト本社	72.9	74.3	406,421
住友電設	9.3	9.5	25,887	明治ホールディングス	70.1	71.4	503,370
日本電設工業	18.2	18.5	37,869	雪印メグミルク	25.5	26	58,006
協和エクシオ	50.2	51.2	143,257	プリマハム	16.6	16.9	53,150
新日本空調	8.8	8.9	19,063	日本ハム	40.5	41.3	176,557
九電工	23.2	23.7	76,432	林兼産業	3.5	3.6	2,134
三機工業	23.9	23.9	29,636	丸大食品	11.3	11.5	19,446
日揮ホールディングス	101.9	103.9	126,238	S F o o d s	8.5	8.6	28,939
中外炉工業	3.6	3.6	6,012	柿安本店	3.7	3.7	9,808
ヤマト	10.6	10.8	7,711	伊藤ハム米久ホールディングス	68.2	69.5	48,372
太平電業	8	8.2	20,844	サッポロホールディングス	36.2	36.8	72,606
高砂熱学工業	28.8	25.8	41,305	アサヒグループホールディングス	222	235.9	1,024,041
三晃金属工業	1.4	1.5	4,281	キリンホールディングス	449.5	457.9	1,058,206
朝日工業社	2.2	2.3	6,856	宝ホールディングス	79.4	80	99,040
明星工業	21.4	21.8	17,745	オエノンホールディングス	28	30.7	11,758
大気社	16.1	16.4	47,150	養命酒製造	3.2	3.3	6,105
ダイダン	7.9	8.1	23,895	コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	74.4	82.7	127,606
日比谷総合設備	10.7	10.9	20,557	サントリー食品インターナショナル	70.9	72.2	262,447
フィル・カンパニー	—	1.9	3,499	ダイドーグループホールディングス	5.4	5.5	27,995
OSJBホールディングス	52.2	53.2	14,683	伊藤園	32.2	32.8	210,904
東洋エンジニアリング	13.9	14.2	6,631	キーコーヒー	10.4	10.6	22,493
レイズネクス	17.8	18.1	21,937	ユニカフェ	2.7	3.2	3,184
食料品 (3.4%)				ジャパンフーズ	1.5	1.5	1,821
ニッポン	31	31.6	51,286	日清オイリオグループ	13.6	13.9	42,117
日清製粉グループ本社	119.7	122	200,690	不二製油グループ本社	25.8	26.3	79,820
日東富士製粉	0.8	0.8	5,344	かどや製油	1.2	1.2	4,752
昭和産業	9.7	9.9	30,195	J-オイルミルズ	5.5	5.6	20,496
鳥越製粉	9.4	9.6	8,256	キッコーマン	76.3	77.7	583,527
中部飼料	12.9	13.2	18,849	味の素	234.1	238.4	585,748
フィード・ワン	71.2	74.5	12,368	キュービー	59	60.1	136,126
東洋精糖	1.8	1.8	2,174	ハウス食品グループ本社	39.6	40.4	150,692
日本甜菜製糖	5.5	5.6	8,982	カゴメ	40.2	44.1	149,278
三井製糖	9.3	9.5	17,651	焼津水産化学工業	5.1	5.2	5,174
塩水港精糖	11.5	11.7	2,585	アリアケジャパン	9.7	9.9	66,825
日新製糖	5	5.1	9,373	ピエトロ	1.4	1.4	2,429
森永製菓	24.9	25.3	98,164	エバラ食品工業	2.6	2.6	6,497
中村屋	2.7	2.8	10,780	やまみ	0.5	0.9	1,849
江崎グリコ	31.4	29.7	133,204	ニチレイ	50.5	51.4	147,106
名糖産業	5.1	5.2	7,394	東洋水産	54.5	55.5	285,270
井村屋グループ	4.5	6.1	15,445	イトアンドホールディングス	3.7	3.7	6,745
不二家	5.9	6.9	15,345	大冷	1.4	1.4	2,693
山崎製パン	79.4	80.9	142,141	ヨシムラ・フード・ホールディングス	5.8	6	4,764
第一屋製パン	1.8	2.1	2,039	日清食品ホールディングス	45.1	45.9	417,231

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
永谷園ホールディングス	5.2	5.3	12,142	ゴールドウイン	18.8	19	120,460
一正清鋸	4.1	4.2	4,620	デサント	20.2	20.6	36,482
フジッコ	11.5	11.7	23,762	キング	5	5.2	2,912
ロック・フィールド	11.4	11.6	17,284	ヤマトインターナショナル	6.5	9.6	3,158
日本たばこ産業	612	578.9	1,185,587	パルプ・紙 (0.2%)			
ケンコーマヨネーズ	5.9	6.1	10,729	特種東海製紙	6.6	6.5	29,867
わらべや日洋ホールディングス	6.9	7.1	11,502	王子ホールディングス	432.4	440.4	283,177
なとり	5.9	6	11,250	日本製紙	45.7	46.6	57,784
イフジ産業	1.8	1.9	1,649	三菱製紙	11.7	12	3,948
ビックスコーポレーション	2.3	2.4	9,096	北越コーポレーション	68.6	62.8	26,941
北の達人コーポレーション	37	37.7	19,943	中越パルプ工業	4.4	4.5	5,368
ユグレナ	45.2	46.7	39,461	巴川製紙所	3.1	3.1	2,387
ミヨシ油脂	4.1	3.8	4,385	大王製紙	45.4	50.8	99,415
理研ビタミン	5	10.2	13,719	阿波製紙	2.7	2.7	1,198
繊維製品 (0.5%)				レンゴー	97.8	99.6	85,357
片倉工業	15.3	14.3	19,305	トーモク	6.3	6.5	11,765
グンゼ	7.7	7.8	25,701	ザ・バック	7.8	8	20,744
東洋紡	41.1	41.9	56,062	化学 (7.5%)			
ユニチカ	31.3	31.7	12,584	クラレ	162.9	165.9	183,485
富士紡ホールディングス	5.1	5.2	22,048	旭化成	685.5	698.3	799,204
倉敷紡績	10.8	10.6	19,270	共和レザー	5.6	5.7	3,596
シキボウ	5.4	5.5	5,643	昭和電工	73.6	80	192,640
日本毛織	34.3	35	32,970	住友化学	759.9	774	366,102
トーア紡コーポレーション	4.1	4.2	1,961	住友精化	4.6	4.7	19,928
帝国繊維	11.8	12	27,516	日産化学	57.8	58.1	344,533
帝人	84.6	86.1	166,431	ラサ工業	3.6	3.7	9,390
東レ	749.4	763.3	547,057	クレハ	8.9	9	60,750
サカイオーベックス	2.9	2.9	5,634	多木化学	3	4.1	25,010
住江織物	3	2.3	4,715	テイカ	7.6	7.7	11,334
日本フエルト	6.6	6.7	2,854	石原産業	18.5	18.9	14,439
イチカワ	1.7	1.7	2,155	片倉コープアグリ	2.7	2.7	3,294
日東製網	1.2	1.2	1,789	日本曹達	15.3	14.7	44,247
アツギ	8.6	8.9	4,334	東ソー	159.9	162.9	287,518
ダイニツク	3.9	4	3,096	トクヤマ	29.8	30.4	77,489
セーレン	25.7	26.1	40,820	セントラル硝子	21.1	21.5	47,106
ソトー	4.2	4.3	3,504	東亜合成	64.9	66.1	76,676
東海染工	1.5	1.6	1,790	大阪ソーダ	10.5	10.7	27,798
小松マテーレ	17.1	17.4	17,121	関東電化工業	24.5	25	20,600
ワコールホールディングス	27	26.3	53,967	デンカ	37.7	38.4	157,632
ホギメディカル	11.8	12	37,260	信越化学工業	177.6	180.9	3,494,988
レナウン	26.6	—	—	日本カーバイド工業	3.5	3.7	4,713
クラウドシアホールディングス	2.7	—	—	堺化学工業	6.7	6.8	13,668
T S I ホールディングス	34.8	32.5	7,962	第一稀元素化学工業	11.2	11.4	10,203
マツオカコーポレーション	3	3.1	6,187	エア・ウォーター	96.2	98	171,402
ワールド	14.7	15	19,785	日本酸素ホールディングス	99.4	101.2	206,549
三陽商会	5.4	5.5	3,421	日本化学工業	3.2	3.3	10,774
ナイガイ	4	4.2	1,386	東邦アセチレン	1.6	1.6	2,272
オンワードホールディングス	62.3	63.8	15,312	日本パーカライジング	52.2	53.1	53,206
ルックホールディングス	3.6	3.7	3,396	高圧ガス工業	16.4	16.7	13,076

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
チタン工業	1.3	1.3	2,444	ニイタカ	1.6	2.2	6,199
四国化成工業	15.9	15.4	18,387	三洋化成工業	6.2	6.3	33,957
戸田工業	2.4	2.4	5,654	有機合成薬品工業	7.9	8.1	2,543
ステラ ケミファ	5.6	5.7	21,375	大日本塗料	11.7	11.9	10,900
保土谷化学工業	3.9	3.9	21,216	日本ペイントホールディングス	85.4	86.9	829,895
日本触媒	16.1	16.4	94,300	関西ペイント	116.2	118.4	353,068
大日精化工業	9.2	9.3	20,850	神東塗料	8.1	8.3	1,734
カネカ	26.8	27.3	96,778	中国塗料	29.4	30	29,370
三菱瓦斯化学	97.6	98	248,136	日本特殊塗料	7.7	7.9	8,539
三井化学	93.9	97.8	292,030	藤倉化成	13.9	14.2	7,085
J S R	96.4	98.2	319,150	太陽ホールディングス	7.6	7.7	50,435
東京応化工業	17.7	18.1	141,361	D I C	43.7	44.5	112,273
大阪有機化学工業	9.6	9.7	36,132	サカタインクス	22.6	23	23,897
三菱ケミカルホールディングス	691.4	704.3	507,096	東洋インキSCホールディングス	21.9	22.3	41,344
KHネオケム	18.2	17.4	43,621	T & K T O K A	8	8.2	6,666
ダイセル	141.5	131.5	102,438	富士フイルムホールディングス	202.5	206.2	1,296,379
住友ベークライト	16.3	16.6	62,997	資生堂	209.8	213.7	1,511,927
積水化学工業	222.4	222.8	449,164	ライオン	137.3	139.9	331,842
日本ゼオン	93.3	95	146,300	高砂香料工業	6.6	6.7	16,562
アイカ工業	31	31.6	113,602	マンダム	23.7	24.2	38,260
宇部興産	52.2	53.2	103,048	ミルボン	14.1	14.4	95,616
積水樹脂	18.6	19	39,368	ファンケル	42.7	43.5	173,130
タキロンシーアイ	22.4	22.8	14,637	コーセー	19.9	20.2	335,724
旭有機材	5.8	6	8,964	コタ	5.5	6.2	8,977
日立化成	43.7	—	—	シーボン	1.4	1.4	2,720
ニチバン	5.4	5.5	9,185	ボーラ・オルビスホールディングス	45.1	45.9	99,511
リケンテクノス	26	25.7	11,770	ノエビアホールディングス	10.1	9.1	41,905
大倉工業	4.9	5	9,515	アジュバンコスメジャパン	2.4	2.4	2,560
積水化成成品工業	13.9	14.1	7,571	エステー	6.8	6.9	13,482
群栄化学工業	2.4	2.4	5,767	アグロ カネショウ	3.3	4	6,340
タイガースポリマー	5.4	5.5	2,222	コニシ	17.4	17.7	27,541
ミライアル	3.6	3.7	4,514	長谷川香料	14	18.5	37,370
ダイキアクシス	3.7	3.7	4,169	星光PMC	6	6.2	4,681
ダイキョーニシカワ	21.8	22.2	17,404	小林製薬	29.6	30.1	359,093
竹本容器	3.7	3.8	3,496	荒川化学工業	9.5	9.7	11,843
森六ホールディングス	5.6	5.7	11,491	メック	7.2	7.4	17,249
日本化薬	64	65.2	64,874	日本高純度化学	2.9	3	8,100
カーリットホールディングス	11	11.2	8,400	タカラバイオ	27.6	28.2	79,947
日本精化	8.3	8.5	11,764	J C U	12.8	13	51,285
扶桑化学工業	10.5	10.7	41,997	新田ゼラチン	6.6	6.8	4,528
トリケミカル研究所	2.3	2.3	39,468	O A T アグリオ	1.8	2	2,612
A D E K A	47.6	48.5	86,087	デクセリアルズ	27.2	27.8	38,058
日油	38.9	39.7	198,103	アース製薬	8	8.1	49,005
新日本理化	17.1	17.4	4,872	北興化学工業	10.8	10	12,790
ハリマ化成グループ	8.6	8.7	8,256	大成ラミック	3.5	3.5	10,160
花王	252.9	257.6	1,979,656	クミアイ化学工業	43.7	44.5	38,537
第一工業製薬	3.9	3.9	16,029	日本農薬	18.8	19.2	9,312
石原ケミカル	2.8	2.9	6,087	アキレス	7.3	7.4	10,752
日華化学	3.5	3.5	3,059	有沢製作所	16.7	16.1	15,713

銘柄	当期首(前期末)	当期 末		銘柄	当期首(前期末)	当期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日東電工	72.9	74.2	695,254	第一三共	302.2	923.5	3,306,130
レック	11.3	11.5	15,088	キョーリン製薬ホールディングス	23.3	23.7	45,361
三光合成	12.1	12.3	5,731	大幸薬品	4.3	13.2	21,225
きもと	18	18.3	3,257	ダイト	6.2	6.9	24,667
藤森工業	9.5	9.7	45,008	大塚ホールディングス	201.2	223.6	986,746
前澤化成工業	6.7	6.8	6,602	大正製薬ホールディングス	22.3	22.7	153,906
未来工業	5.7	5.8	9,291	ペプチドリーム	53.4	54.7	318,901
ウェーブロックホールディングス	3.6	3.7	3,230	石油・石炭製品(0.4%)			
J S P	6.2	6.3	10,924	日本コークス工業	89.2	90.9	8,453
エフピコ	11.6	22.6	95,146	ニチレキ	12.5	12.7	18,973
天馬	7	7.2	15,235	ユシロ化学工業	5.9	6	6,540
信越ポリマー	19	19.3	18,470	ビービー・カストロール	3.8	3.8	4,674
東リ	26.3	26.8	6,539	富士石油	28.2	28.7	5,539
ニフコ	38.8	39.5	152,272	MORESCO	3.8	3.9	4,317
バルカー	8.6	8.7	18,896	出光興産	118.8	119.4	298,619
ユニ・チャーム	203.6	228.1	1,122,936	ENEOSホールディングス	1,588.7	1,618.2	700,680
ショーエイコーポレーション	1.2	1.8	1,837	コスモエネルギーホールディングス	30.6	31.1	71,685
医薬品(5.8%)				ゴム製品(0.6%)			
協和キリン	106.2	108.2	300,579	横浜ゴム	61.1	62.3	107,716
武田薬品工業	878.6	895	3,210,365	TOYO TIRE	60.6	56.6	95,371
アステラス製薬	928.9	932.7	1,571,599	ブリヂストン	324.6	286	1,172,600
大日本住友製薬	78.3	79.7	120,426	住友ゴム工業	94.9	96.6	98,242
塩野義製薬	135	135.3	765,527	藤倉コンポジット	9.2	9.4	3,647
わかもと製薬	12.6	12.8	3,136	オカモト	6.4	6.5	25,382
あすか製薬	12	12.2	18,702	フコク	4.6	4.7	3,149
日本新薬	27.6	28.2	202,476	ニッタ	11.9	12.1	26,983
バイオフェルミン製薬	1.8	1.8	4,428	住友理工	20.5	20.8	12,084
中外製薬	110.1	336.5	1,890,793	三ツ星ベルト	13.9	14.2	23,714
科研製薬	18.1	18.4	74,796	バンドー化学	18.6	18.9	12,398
エーザイ	126.4	128.8	983,130	ガラス・土石製品(0.8%)			
ロート製薬	54.2	55.2	171,672	日東紡績	15.7	16	74,480
小野薬品工業	242.5	247	754,585	AGC	104.4	98.8	377,910
久光製薬	27.9	28.4	170,968	日本板硝子	50.5	51.5	24,514
持田製薬	14.7	14.9	57,812	石塚硝子	1.9	2	3,782
参天製薬	196.7	200.5	336,639	日本山村硝子	4.4	4.6	3,965
扶桑薬品工業	3.7	3.8	10,104	日本電気硝子	42.4	39.9	89,934
日本ケミファ	1.4	1.4	3,109	オハラ	4.2	4.3	7,856
ツムラ	32.7	33.3	111,388	住友大阪セメント	20	19.4	59,267
日医工	29.9	30.5	29,859	太平洋セメント	66.7	68	179,996
キッセイ薬品工業	18.7	19	42,047	日本ヒューム	10.6	10.9	8,741
生化学工業	20.5	20.9	20,900	日本コンクリート工業	22.8	23.5	7,167
栄研化学	18.6	18.9	37,478	三谷セキサン	4.9	5	23,525
水戸製薬	4.4	4.5	4,473	アジアパイルホールディングス	15	15.5	7,595
鳥居薬品	6.6	6.7	21,272	東海カーボン	110.7	105.3	156,370
J C R ファーマ	7.4	30.3	74,568	日本カーボン	5.4	6	24,630
東和薬品	13.5	13.8	26,509	東洋炭素	6.2	6.4	13,030
富士製薬工業	7.2	7.3	8,854	ノリタケカンパニーリミテド	5.8	6	19,230
沢井製薬	21.7	22.1	104,754	TOTO	75.4	76.9	461,400
ゼリア新薬工業	19.2	19.5	37,186	日本碍子	128.9	129.2	225,841

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
日本特殊陶業	82.2	81.9	147,338	東邦亜鉛	5.4	5.5	12,804
MARUWA	4.1	4.1	47,232	三菱マテリアル	69	70.3	161,830
品川リフクトリーズ	2.8	2.9	8,108	住友金属鉱山	133.5	136	689,792
黒崎播磨	2.1	2.2	10,648	DOWAホールディングス	26.4	26.9	108,541
ヨータイ	8.4	8.7	7,290	古河機械金属	18.6	19	24,035
イソライト工業	5.5	5.7	3,135	大阪チタニウムテクノロジーズ	10.9	11.1	9,534
東京窯業	13.5	14	4,788	東邦チタニウム	18.8	19.1	17,552
ニッカトー	4.8	5	4,010	UACJ	15.9	16.2	30,634
フジミインコーポレーテッド	9.4	9.6	42,720	CKサンエツ	2.2	2.2	8,294
クニミネ工業	4.3	4.4	5,491	古河電気工業	32.5	33.1	93,110
エーアンドエーマテリアル	1.8	1.8	1,882	住友電気工業	390.5	397.8	576,611
ニチアス	28.9	29.5	73,248	フジクラ	126.3	128.5	61,808
ニチハ	14.7	15	47,925	昭和電線ホールディングス	12.1	12.4	21,712
鉄鋼(0.6%)				東京特殊電線	1.6	1.6	3,864
日本製鉄	467.4	476.1	621,548	タツタ電線	20.9	21.2	16,196
神戸製鋼所	191.2	194.8	104,997	カナレ電気	1.8	1.8	3,061
中山製鋼所	14.6	14.9	5,393	平河ヒューテック	4	5.4	7,041
合同製鐵	5.6	5.7	11,639	リョービ	12.9	13.1	16,257
ジェイエフイーホールディングス	282.1	287.3	285,863	アーレスティ	13.9	14.1	5,245
東京製鐵	50.9	51.9	35,343	アサヒホールディングス	18.3	18.7	78,540
共英製鋼	11.8	12	16,788	金属製品(0.6%)			
大和工業	22.2	22.6	59,641	稲葉製作所	5.9	6	8,352
東京鐵鋼	4.3	4.4	9,130	宮地エンジニアリンググループ	3.2	3.2	7,897
大阪製鐵	5.6	5.7	7,164	トーカロ	29	29.6	45,436
淀川製鋼所	14.1	14.4	31,233	アルファC o	3.7	3.7	3,718
丸一鋼管	33.9	34.6	80,272	SUMCO	125	136.1	332,900
モリ工業	3.1	3.2	7,427	川田テクノロジーズ	2.1	2.2	9,449
大同特殊鋼	17.1	17.4	74,211	RS Technologies	2.9	3.5	23,065
日本高周波鋼業	4	4.1	1,443	ジェイテックコーポレーション	—	0.7	2,681
日本冶金工業	8.7	8.8	15,681	信和	4.5	6.1	4,306
山陽特殊製鋼	7.6	7.3	11,161	東洋製罐グループホールディングス	66.5	67.8	78,783
愛知製鋼	5.9	6	19,290	ホッカンホールディングス	5.7	5.8	8,369
日立金属	112.5	114.6	192,184	コロナ	5.8	5.9	5,593
日本金属	2.4	2.5	3,147	横河ブリッジホールディングス	19.4	19.8	40,807
大太平洋金属	7.1	7.2	16,689	駒井ハルテック	2	2	4,608
新日本電工	67.5	68.8	19,401	高田機工	1	1	2,548
栗本鐵工所	5.2	5.3	8,755	三和ホールディングス	100.2	100.3	123,970
虹技	1.6	1.6	1,760	文化シャッター	30.8	31.3	29,109
三菱製鋼	7.8	7.9	5,016	三協立山	14.5	13.7	11,220
日亜鋼業	15.4	15.7	4,647	アルインコ	7.6	7.7	7,330
日本精線	1.7	1.7	6,324	東洋シャッター	2.5	2.6	1,768
エンビプロ・ホールディングス	4	4.6	3,238	LIXIL	154.1	157	399,094
シンニッタン	16.3	16.8	3,460	日本フィルコン	8	7.4	3,722
新家工業	2.4	2.5	3,237	ノーリツ	21.7	22.1	34,034
非鉄金属(0.8%)				長府製作所	10.6	10.8	22,334
大紀アルミニウム工業所	17.3	17.6	13,552	リンナイ	20.3	20.7	232,668
日本軽金属ホールディングス	264.7	27	52,353	ダイニチ工業	5.6	5.7	5,198
三井金属鉱業	28.2	28.7	113,365	日東精工	14.4	13.4	6,030
				三洋工業	1.4	1.4	2,602

銘柄	当期首(前期末)	当期 末		銘柄	当期首(前期末)	当期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
岡部	21.2	21.6	16,545	やまびこ	20.4	20.7	27,862
ジーテクト	13	13.2	19,496	平田機工	5	5	42,550
東ブレ	19.5	19.8	29,581	ペガサスミシン製造	10.9	11	3,674
高周波熱練	20.1	20.5	9,942	マルマエ	4.4	4	5,400
東京製綱	7.5	7.6	10,427	タツモ	5	4.6	7,088
サンコール	5.9	8	3,640	ナブテスコ	61.6	62.7	312,873
モリテック スチール	8.1	8.3	3,593	三井海洋開発	11.1	11.3	23,052
パイオラックス	15.4	15.7	24,068	レオン自動機	10.3	10.5	12,180
エイチワン	10.2	10.4	7,716	SMC	33.1	33.8	2,306,512
日本発條	112	114.1	83,407	ヤマハモーターロボティクスホールディングス	9.3	—	—
中央発條	1.3	1.3	3,627	ホソカワミクロン	3.7	3.8	24,206
アドバネクス	1.5	1.5	2,019	ユニオンツール	3.9	4	12,540
立川プラインド工業	4.6	4.7	6,166	オイレス工業	13.6	13.8	22,452
三益半導体工業	9.3	8.3	24,833	日精エー・エス・ビー機械	3.6	3.1	18,662
機械(5.8%)				サトーホールディングス	14.9	15.2	33,440
日本ドライケミカル	2.7	2.7	4,079	技研製作所	9.2	9.4	45,449
日本製鋼所	31.7	32.3	99,968	日本エアーテック	3.5	3.5	5,257
三浦工業	45.2	46	281,060	カワタ	3.2	3.2	3,219
タクマ	35.5	36.1	76,134	日精樹脂工業	8.9	9.1	8,390
ツガミ	21.7	22.1	39,713	オカダアイヨン	3.4	3.4	3,889
オークマ	12.2	12.4	76,508	ワイエイシイホールディングス	4.5	4.6	5,004
芝浦機械	11.8	12.1	28,810	小松製作所	478.4	487.3	1,455,321
アマダ	132.9	132	157,872	住友重機械工業	60.5	61.6	184,800
アイダエンジニアリング	27.4	28	27,300	日立建機	42.4	43.1	137,920
滝澤鉄工所	3.3	3.4	3,406	日工	14.6	14.9	10,653
F U J I	45	45.8	131,446	巴工業	4.6	4.3	8,664
牧野フライス製作所	12.3	12.5	51,312	井関農機	10.6	10.8	14,796
オーエスジー	48.3	52.5	101,167	T O W A	10.8	10.9	23,009
ダイジェット工業	1.3	1.3	1,726	丸山製作所	2.4	2.3	3,650
旭ダイヤモンド工業	27.6	28.2	13,197	北川鉄工所	4.8	4.9	6,610
DMG森精機	66.1	67.4	109,390	ローツェ	4.7	4.7	40,796
ソディック	24.7	23.2	21,204	タカキタ	3.9	3.8	2,675
ディスコ	14.1	14.4	531,360	クボタ	560.3	565.1	1,377,148
日東工器	5.8	5.9	10,165	荏原実業	2.7	2.7	10,530
日進工具	3.1	4.2	11,340	三菱化工機	3.7	3.7	12,709
パンチ工業	9.7	9.7	4,277	月島機械	19.5	19.9	27,860
富士ダイス	4.8	4.8	3,120	帝国電機製作所	8.8	8.9	10,653
豊和工業	5.9	6	5,172	新東工業	25.2	25.7	19,660
OKK	4.4	4.4	1,861	澁谷工業	9.3	9.4	32,853
東洋機械金属	7.7	7.7	3,349	アイチ コーポレーション	18.4	18.7	17,278
津田駒工業	2.1	2	1,804	小森コーポレーション	26.9	27.4	19,180
エンシュウ	2.6	2.7	2,403	鶴見製作所	8.3	8.3	15,321
島精機製作所	16.8	16.8	31,264	住友精密工業	1.6	1.6	3,174
オプトラン	11.7	13.4	30,418	日本ギア工業	3.5	4.5	1,327
N Cホールディングス	3.4	3.3	1,904	酒井重工業	2	2.1	4,515
イワキポンプ	5.1	6.8	5,596	荏原製作所	43.7	44.6	164,797
フリュー	10.3	10.5	11,802	石井鐵工所	1.4	1.4	4,044
ヤマシンフィルタ	22.8	23.9	25,357	西島製作所	10.8	11	9,339
日阪製作所	13	13.2	11,233	北越工業	11	11.1	11,444

銘柄	当期首(前期末)	当期		期末	銘柄	当期首(前期末)	当期		期末
	株数	株数	評価額			株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円			千株	千株	千円	
ダイキン工業	134.6	137.1	3,171,808	日本ビラー工業	10.8	10.9	17,876		
オルガノ	3.8	3.9	26,559	キッツ	43	39.3	23,462		
トーヨーカネツ	4.6	4.7	12,055	マキタ	137.8	140.3	701,500		
栗田工業	57.2	58.2	258,699	日立造船	84	85.4	57,218		
椿本チエイン	15.1	15.4	41,580	三菱重工業	177	180.3	563,617		
大同工業	5.2	5.3	3,826	I H I	76.1	77.5	153,217		
木村化工機	8.9	9.1	5,541	スター精密	16.4	16.6	26,178		
アネスト岩田	16.6	16.8	18,412	電気機器(18.1%)					
ダイフク	54	55	714,450	日清紡ホールディングス	70.5	65.9	51,204		
サムコ	3	2.7	10,773	イビデン	64.9	66	341,220		
加藤製作所	5.8	6	5,664	コニカミノルタ	231.6	236.5	100,039		
油研工業	1.8	1.9	2,981	ブラザー工業	129.2	131.6	307,549		
タダノ	51.1	52	48,880	ミネベアミツミ	196.3	200	464,200		
フジテック	38.5	39.1	91,376	日立製作所	507.5	516.9	2,252,650		
CKD	29.4	29.5	76,906	三菱電機	1,056.1	1,075.7	1,757,155		
キトー	8.1	8.2	12,587	富士電機	63.7	64.8	262,764		
平和	29.5	30	43,530	東洋電機製造	4.2	4	4,608		
理想科学工業	9.4	9.5	13,100	安川電機	113.7	115.8	661,218		
SANKYO	23.5	24	69,072	シンフォニアテクノロジー	13.8	14	20,412		
日本金銭機械	11.8	12	6,120	明電舎	19.5	19.8	47,916		
マースグループホールディングス	6.8	6.9	10,474	オリジン	2.9	3	3,987		
フクシマガリレイ	6.5	6.6	28,776	山洋電気	5.2	5.3	32,065		
オーイズミ	4.7	4.7	1,903	デンヨー	9.1	9.2	18,924		
ダイコク電機	4.9	5	4,380	東芝テック	13.3	13.5	50,827		
竹内製作所	17.8	18	43,938	芝浦メカトロニクス	2	2	10,940		
アマノ	27.7	28.2	67,116	マブチモーター	29.4	29.9	124,384		
J U K I	14.7	15	7,965	日本電産	127.1	258.9	3,676,380		
蛇の目ミシン工業	9.9	9.9	7,840	トレックス・セミコンダクター	6.5	6.6	9,358		
マックス	16.2	16.5	23,776	東光高岳	6.4	6.3	10,092		
グローリー	27.2	27.7	56,729	ダイヘン	11.6	11.8	59,236		
新晃工業	9.9	10	18,060	ヤーマン	16.2	17.8	33,891		
大和冷機工業	15.4	17.3	17,438	J V C ケンウッド	88.4	91.1	15,669		
セガサミーホールディングス	104.8	106.7	182,563	ミマキエン지니어リング	10.7	10.7	5,136		
日本ビストンリング	3.9	4	3,788	I - P E X	4.5	5.3	10,737		
リケン	4.9	5	10,685	日新電機	24.8	25.3	34,180		
T P R	14.3	14.5	20,938	大崎電気工業	21.2	21.5	12,685		
ツバキ・ナカシマ	21.6	20.6	26,017	オムロン	94.7	96.4	921,584		
ホシザキ	30.9	33.9	307,134	日東工業	15.6	15.8	32,247		
大豊工業	8.8	8.8	6,512	I D E C	15.3	15.6	28,719		
日本精工	199	202.6	192,064	正興電機製作所	3.2	2.8	5,905		
N T N	244.8	249	66,234	不二電機工業	1.8	2.2	2,884		
ジェイテクト	101.4	103.3	90,180	ジーエス・ユアサ コーポレーション	35.5	36.1	116,783		
不二越	9.8	10	45,100	サクサホールディングス	2.5	2.6	3,543		
日本トムソン	31.6	32	15,616	メルコホールディングス	3.8	3.9	13,494		
THK	61.5	67.1	239,547	テクノメディカ	2.7	2.8	4,443		
ユーシン精機	8.3	8.4	8,282	日本電気	128.1	130.5	768,645		
前澤給装工業	3.9	3.9	8,580	富士通	101.8	103.7	1,757,715		
イーグル工業	13.2	13.4	13,266	沖電気工業	43	43.8	46,515		
前澤工業	7.4	7.3	4,394	岩崎通信機	4.6	4.7	3,957		

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
電気興業	5.1	5.2	14,320	共和電業	11.3	11.5	4,473
サンケン電気	11.6	11.8	60,534	日本電子材料	4.3	4.3	9,378
ナカヨ	2.1	2.1	2,990	堀場製作所	20.9	21.3	145,905
アイホン	6	6.1	9,894	アドバンテスト	78.5	80	729,600
ルネサスエレクトロニクス	505.1	462.6	605,080	小野測器	5.6	5.5	2,876
セイコーエプソン	131.1	133.5	218,539	エスベック	9.6	9.8	19,580
ワコム	72.4	72.9	72,827	キーエンス	95.7	97.5	5,620,875
アルバック	21.1	19.8	100,782	日置電機	5.7	5.3	22,313
アクセル	5.1	5.1	3,855	シスメックス	75.5	77	1,001,000
E I Z O	8.2	8.4	30,912	日本マイクロニクス	18.9	19.1	28,821
日本信号	27	27.5	25,740	メガチップス	10.2	10.2	32,181
京三製作所	24.9	25.4	10,388	OBARA GROUP	5.6	6.4	26,560
能美防災	14.2	14.5	32,059	澤藤電機	1.6	1.6	3,400
ホーチキ	8	8.2	10,077	原田工業	5.6	5.7	4,873
星和電機	6.3	6.1	3,922	コーセル	13.4	14.8	18,455
エレコム	11.6	12.4	61,876	イリソ電子工業	9	9.2	43,424
パナソニック	1,206.7	1,229	1,782,050	オプテックスグループ	17.7	17.9	36,533
シャープ	122.3	124.5	268,422	千代田インテグレ	5.2	4.9	8,746
アンリツ	68	69.3	186,278	アイ・オー・データ機器	4.5	4	4,080
富士通ゼネラル	28.7	29.2	76,796	レーザーテック	43.4	47.3	717,541
ソニー	667.6	673.9	7,062,472	スタンレー電気	74.5	75.6	240,408
T D K	51	52	921,440	岩崎電気	4.5	4.6	6,541
帝国通信工業	5.2	5.2	5,543	ウシオ電機	61.7	59.8	83,361
タムラ製作所	35.5	36.1	20,613	岡谷電機産業	9.9	9.8	3,518
アルプスアルパイン	93.7	95.6	139,002	ヘリオス テクノ ホールディング	11.1	11.6	3,700
池上通信機	3.3	3.4	2,924	エノモト	3.6	3.6	5,976
鈴木	6.4	5.8	6,757	日本セラミック	10.9	11.1	31,224
日本トリム	1.6	1.6	7,008	遠藤照明	6.2	6.4	3,283
ローランド ディー・ジー	6.1	6.7	11,671	古河電池	8.3	8	13,280
フォスター電機	11.1	11.3	16,509	双信電機	6.4	6.4	2,848
SMK	2.7	2.8	8,596	山一電機	8	8.1	14,110
ヨコオ	7	7.1	22,613	図研	7.1	7.2	20,383
ホシデン	29.3	30	28,380	日本電子	21	21.3	96,169
ヒロセ電機	16.4	16.6	255,972	カシオ計算機	93.5	95.2	172,502
日本航空電子工業	24.3	24.7	38,606	ファナック	100.3	101.2	2,739,484
T O A	11.4	11.6	9,570	日本シイエムケイ	25.8	26.6	11,092
マクセルホールディングス	23.2	23.6	31,718	エンプラス	5.6	5.6	22,568
古野電気	14.1	14.4	16,228	大真空	4.2	4.2	10,592
ユニデンホールディングス	3	3	6,543	ローム	47	44.8	522,368
スミダコーポレーション	8.6	9.7	9,797	浜松ホトニクス	75.9	77.3	494,720
アイコム	5.9	6	16,584	三井ハイテック	12	12	52,560
リオン	4.6	4.7	16,003	新光電気工業	35.9	36.3	97,501
本多通信工業	10.2	10.3	4,923	京セラ	148.7	151.4	1,039,209
横河電機	96.9	98.7	223,160	太陽誘電	47.2	47.9	290,753
新電元工業	3.8	3.8	10,936	村田製作所	310.3	316	3,316,420
アズビル	66.7	67.9	379,561	双葉電子工業	17.2	17.6	16,702
東亜ディーケーケー	5.8	5.9	4,867	北陸電気工業	4.8	4.9	4,557
日本光電工業	43.8	44.6	137,368	ニチコン	36.4	36.9	55,276
チノー	3.7	3.8	5,411	日本ケミコン	8	8.7	16,886

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
K O A	16.4	16.6	26,377	ミクニ	13.6	13.9	3,794
市光工業	16.6	17	11,679	太平洋工業	22.2	22.6	25,854
小糸製作所	63.4	64.5	452,145	ケーヒン	22.1	—	—
ミツバ	20.3	19.8	9,088	河西工業	14.3	14.7	5,821
SCREENホールディングス	18.3	18.7	157,454	アイシン精機	87	88.6	275,103
キャノン電子	11.4	10.2	16,258	マツダ	310.7	316.5	245,287
キャノン	568.5	534.6	1,171,843	今仙電機製作所	9.9	10.1	7,514
リコー	268.8	273.8	205,350	本田技研工業	831.5	847	2,415,220
象印マホービン	31.3	29.4	51,273	スズキ	209.3	213.2	1,086,893
MUTOHホールディングス	1.8	1.7	2,546	S U B A R U	327.8	334	682,362
東京エレクトロン	70.4	68.3	2,971,733	安永	5.1	5.2	6,749
輸送用機器 (7.1%)				ヤマハ発動機	137.7	152	330,904
トヨタ紡織	30.8	31.4	53,066	ショーワ	22.7	—	—
芦森工業	2.2	2.3	2,162	T B K	12.7	12.9	5,676
ユニプレス	20.5	20.9	20,565	エクセディ	14.4	14.6	21,316
豊田自動織機	85.5	87.1	743,834	豊田合成	34.1	34.8	99,145
モリタホールディングス	18.5	18.8	32,693	愛三工業	16.6	17	8,840
三櫻工業	13.4	13.7	12,946	盟和産業	1.7	1.7	1,516
デンソー	232.5	236.8	1,427,904	日本プラス	8.4	8.5	4,165
東海理化電機製作所	27.8	28.4	48,848	ヨロズ	9.9	10.1	12,806
三井E&Sホールディングス	38.1	38.9	17,116	エフ・シー・シー	17.3	17.6	30,870
川崎重工業	82.2	83.7	201,214	シマノ	39.5	40.3	1,058,479
名村造船所	34	34.6	6,366	テイ・エス テック	24.5	25	76,625
日本車輻製造	3.8	3.9	9,906	ジヤムコ	5.3	5.4	3,547
三菱ロジスネクスト	14	14.2	17,167	精密機器 (2.6%)			
近畿車輻	1.6	1.6	1,950	テルモ	298.8	304.4	1,265,390
日産自動車	1,245.5	1,268.6	704,834	クリエートメディック	3.5	3.6	3,492
いすゞ自動車	306	311.7	301,725	日機装	31.7	34.8	35,844
トヨタ自動車	1,178.2	1,200.3	9,194,298	日本エム・ディ・エム	6.1	6.2	14,049
日野自動車	131.9	134.3	124,361	島津製作所	126.2	128.6	530,475
三菱自動車工業	390.9	398.2	94,373	J M S	9	9.1	8,481
エプテック	7.4	7.6	4,628	長野計器	7.7	7.8	7,683
レシップホールディングス	4.1	4.2	2,100	ブイ・テクノロジー	5	5	30,950
GMB	2	2	1,968	東京計器	6.8	6.9	6,382
ファルテック	1.9	2	1,358	愛知時計電機	1.4	1.4	5,964
武蔵精密工業	23.5	24	36,816	インターアクション	5.7	5.8	15,480
日産車体	20.6	21	18,333	オーバル	9.6	9.7	3,424
新明和工業	28.4	29	26,332	東京精密	19.1	19.5	99,450
極東開発工業	19.6	20	28,920	マニー	42.1	42.9	122,136
日信工業	19.5	—	—	ニコン	170.9	164.3	133,575
トビー工業	8.7	8.9	11,489	トプコン	53.2	54.2	70,351
ティラド	3.9	3.9	5,296	オリンパス	584.3	595.2	1,250,217
曙ブレーキ工業	58	59	9,912	理研計器	9.3	9.5	28,785
タチエス	17.4	17.7	19,434	タムロン	8.5	8.7	17,469
N O K	56.8	57.9	71,448	H O Y A	210.9	213.4	2,907,575
フタバ産業	29.4	30	15,480	シード	4.5	4.6	2,755
K Y B	11.8	12	27,888	ノーリツ鋼機	7.1	7.3	16,089
大同メタル工業	20.3	20.7	10,639	エー・アンド・ディ	9.7	9.8	12,632
プレス工業	52.5	53.5	16,531	朝日インテック	89.7	121.9	424,212

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
シチズン時計	123.7	126.1	38,712	オリバー	2.2	2.3	5,674
リズム	3.3	3.4	2,329	兼松サステック	0.7	0.7	1,229
大研医器	7.4	7.5	4,192	キングジム	8.8	8.9	7,636
メニコン	14.5	15.2	103,056	リンテック	25.1	25.6	61,542
シンシア	1.2	1.2	805	イトーキ	22.5	21.4	7,126
松風	4.8	4.9	8,330	任天堂	64.8	66	4,218,720
セイコーホールディングス	14.9	15.2	20,246	三菱鉛筆	17.4	17.7	23,222
ニプロ	73.1	74.5	89,996	タカラスタンダード	21.8	22.2	33,078
その他製品(2.7%)				コクヨ	50.7	51.6	68,989
中本パックス	2.7	2.7	4,368	ナカバヤシ	10.4	10.6	6,487
スノーピーク	5	6.4	12,051	グローブライド	4.7	4.8	21,288
パラマウントベッドホールディングス	11.1	11.3	52,884	オカムラ	36.8	37.5	34,387
トランザクション	6.7	5.9	6,189	美津濃	9.6	9.8	19,698
粧美堂	3.1	3.1	1,227	電気・ガス業(1.3%)			
ニホンフラッシュ	4.9	10	13,480	東京電力ホールディングス	843	858.7	351,208
前田工繊	11.6	11.9	32,106	中部電力	323.1	329.1	430,462
永大産業	13.8	14.1	3,976	関西電力	400.1	407.6	429,814
アートネイチャー	11.3	11.5	7,440	中国電力	146	155.2	197,259
パナダイナムコホールディングス	109.2	111.2	1,031,268	北陸電力	96.5	98.3	69,399
アイフィスジャパン	2.7	2.7	1,906	東北電力	263.8	268.7	242,367
共立印刷	17.6	18	2,106	四国電力	95.1	96.9	70,543
SHOEI	5.1	9.4	38,305	九州電力	217.7	221.7	222,586
フランスベッドホールディングス	14.9	15.2	14,181	北海道電力	98.8	100.7	42,092
パイロットコーポレーション	17.2	19	56,582	沖縄電力	19.6	20.9	29,531
萩原工業	5.9	6	8,874	電源開発	84	85.6	150,912
トッパン・フォームズ	22.6	23	24,357	エフオン	5	5.8	6,977
フジシールインターナショナル	23.7	24.1	46,127	イーレックス	15	15.7	27,757
タカラトミー	47.4	48.2	43,042	レノバ	17.4	18.1	80,545
廣済堂	7.4	7.5	6,285	東京瓦斯	203.1	206.9	475,559
エステールホールディングス	2.8	2.9	1,748	大阪瓦斯	204.9	208.7	413,643
アーク	40.3	—	—	東邦瓦斯	51.9	52.9	333,799
タカノ	4.1	4.2	2,494	北海道瓦斯	5.7	5.8	9,053
プロネクス	9.1	9.2	9,577	広島ガス	21.7	22.1	8,221
ホクシン	6.5	6.6	739	西部瓦斯	11.9	12.1	36,106
ウッドワン	3.5	3.6	3,783	静岡ガス	30	30.5	30,012
大建工業	7.1	7.2	12,369	メタウォーター	5.1	10.4	25,636
凸版印刷	149.1	151.8	221,628	陸運業(3.4%)			
大日本印刷	138.2	140.8	258,508	SBSホールディングス	9.1	8	19,200
共同印刷	3.3	3.3	11,764	東武鉄道	111.4	112.1	330,358
NISSHA	21.7	22.1	30,475	相鉄ホールディングス	33.8	34.4	83,248
光村印刷	0.9	0.9	1,534	東急	266.3	271.3	341,295
TAKARA & COMPANY	5.1	5.2	8,944	京浜急行電鉄	135.6	138.1	222,479
アシックス	87.2	95.1	169,848	小田急電鉄	157.1	160	519,200
ツツミ	3.3	3.4	6,439	京王電鉄	54.8	55.8	459,792
小松ウオール工業	3.2	3.3	5,695	京成電鉄	73.5	74.9	258,405
ヤマハ	62.8	64	382,720	富士急行	14.4	14.7	70,560
河合楽器製作所	3.3	3.3	9,454	新京成電鉄	2.7	2.8	6,076
クリナップ	9.8	10	4,610	東日本旅客鉄道	185.9	189.3	1,279,668
ビジョン	63.8	69.1	308,531	西日本旅客鉄道	94.1	95.9	514,791

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
東海旅客鉄道	87.8	89.4	1,307,475	澁澤倉庫	5.5	5.6	11,715
西武ホールディングス	141.7	140.4	138,013	東陽倉庫	18.1	18.4	5,814
鴻池運輸	16.8	17.1	17,117	日本トランスシティ	22	22.4	11,513
西日本鉄道	29.3	29.8	86,837	ケイヒン	1.9	2	2,596
ハマキョウレックス	8.1	8.3	24,692	中央倉庫	6.1	6.2	6,975
サカイ引越センター	5.6	5.7	28,899	川西倉庫	1.8	1.9	2,167
近鉄グループホールディングス	100	101.9	453,964	安田倉庫	8.2	8.4	8,013
阪急阪神ホールディングス	133.4	135.9	451,867	ファイズホールディングス	2.1	2.2	2,470
南海電気鉄道	47.4	48.3	121,233	東洋埠頭	3	3.1	4,330
京阪ホールディングス	44.5	45.4	223,595	宇徳	8.5	8.7	4,062
神戸電鉄	2.4	2.4	8,592	上組	57.3	56.8	105,080
名古屋鉄道	82.2	83.8	224,248	サンリツ	2.4	2.4	1,675
山陽電気鉄道	7.1	7.3	14,235	キムラユニティー	2.7	2.7	2,916
日本通運	35.3	35.3	255,572	キューソー流通システム	2.5	2.5	3,922
ヤマトホールディングス	175.3	168.7	435,246	近鉄エクスプレス	21.2	21.6	57,024
山九	27.8	28.3	112,209	東海運	5.7	5.8	1,803
丸運	5.7	5.8	1,450	エーアイティー	7.1	7.2	7,106
丸全昭和運輸	8.1	8.3	28,012	内外トランスライン	3.5	3.6	4,230
センコーグループホールディングス	55.1	56.2	55,413	日本コンセプト	3.2	3.2	4,630
トナミホールディングス	2.4	2.4	12,984	情報・通信業(9.3%)			
ニッコンホールディングス	35.8	36.5	76,942	NEC ネットスエスアイ	9.9	30	57,600
日本石油輸送	1.1	1.1	2,908	クロスキャット	2.9	2.9	3,526
福山通運	12.8	13	53,495	システナ	37.1	37.7	78,265
セイノーホールディングス	74.9	76.3	105,980	デジタルアーツ	5.1	5.2	55,588
エスライン	3	3.1	2,746	日鉄ソリューションズ	15.6	15.9	50,880
神奈川中央交通	2.5	2.5	9,587	キューブシステム	5.8	5.7	7,125
日立物流	18.3	18.7	57,409	エイジア	2.1	2	3,870
丸和運輸機関	10.5	21.5	48,224	コア	4.6	4.6	6,679
C&F ロジホールディングス	10.1	10.3	22,165	ラクーンホールディングス	—	5.3	9,582
九州旅客鉄道	89.2	89.3	191,816	ソリトンシステムズ	4.7	5.4	9,909
S Gホールディングス	105	213.9	599,775	ソフトクリエイティブホールディングス	4.7	4.7	13,131
海運業(0.2%)				T I S	34.6	105.6	232,742
日本郵船	84	85.5	225,121	J N Sホールディングス	4.1	4.2	2,335
商船三井	63.5	64.7	195,070	電算システム	4	4	12,700
川崎汽船	30.8	31.4	63,647	グリー	72	65	38,090
N S ユナイテッド海運	5.8	6.2	9,207	コーエーテクモホールディングス	21.3	21.6	129,168
飯野海運	49.4	49.2	21,352	三菱総合研究所	4.5	4.6	19,780
共栄タンカー	2.6	2.7	2,430	電算	1.3	1.2	2,971
乾汽船	5.8	5.9	5,439	A G S	6.2	6.1	5,142
空運業(0.4%)				ファインデックス	8.9	9	10,026
日本航空	180	228.7	433,157	ブレインパッド	2.2	2.8	11,746
A N Aホールディングス	182.8	253.7	560,550	K L a b	20	19.2	17,299
バスコ	1.9	2	2,744	ポルトガウイン・ビートルホールディングス	12.8	12.9	15,467
倉庫・運輸関連業(0.2%)				イーブックイニシアティブジャパン	1.6	1.6	4,433
トランコム	2.8	2.8	23,296	ネクソン	295.2	266.5	870,122
日新	8.6	8.8	11,035	アイスタイル	27.2	29.9	12,438
三菱倉庫	31.7	32.3	99,807	エムアップホールディングス	3.1	3.1	7,852
三井倉庫ホールディングス	11.4	11.6	26,610	エイチーム	7.4	7.4	8,428
住友倉庫	36.8	36.6	46,628	エニグモ	7.6	10.1	12,695

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
テクノスジャパン	8.5	8.4	5,728	パイブドHD	1.5	1.4	2,234
コロブラ	34.1	34.8	32,364	アイビーシー	2.1	1.8	2,017
ブロードリーフ	51.8	52.6	33,453	ネオジャパン	2.2	2.1	4,225
クロス・マーケティンググループ	5.3	5.1	1,866	PR TIMES	1	1.8	7,560
デジタルハーツホールディングス	5.7	5.7	7,854	ランドコンピュータ	1.8	1.7	1,895
システム情報	5.5	8	9,968	ダブルスタンダード	1.4	1.4	6,160
メディアドゥ	3.3	3.5	24,080	オープンドア	5.3	5.3	8,628
じげん	26.1	26.5	10,414	マイネット	3.3	3.5	3,227
ブイキューブ	—	5.8	19,633	アカツキ	3.7	3.8	18,012
エンカレッジ・テクノロジー	2	2.5	1,750	ベネフィットジャパン	0.9	0.9	1,659
サイバーリンクス	1.8	3.5	7,805	Ubicomホールディングス	2.5	2.4	8,964
フィックスターズ	11.2	11.4	11,377	L I N E	21.6	—	—
CARTA HOLDINGS	5.2	4.4	5,865	カナミックネットワーク	6.6	9.9	7,128
オブティム	2.8	5.6	18,284	ノムラシステムコーポレーション	2.7	5	1,880
セレス	3.6	3.5	8,813	チェンジ	2.2	14.8	51,430
SHIFT	2.7	4.7	61,805	シンクロ・フード	4.9	4.9	1,607
ティーガイア	9.3	9.4	17,662	オークネット	6.6	5.7	7,666
セック	1.6	1.6	4,512	セグエグループ	2	2.8	3,707
日本アジアグループ	10.9	11.1	9,557	エイトレッド	1.4	1.8	5,034
豆蔵ホールディングス	7.2	—	—	AOI TYO Holdings	10.8	11	4,829
テクマトリックス	7.4	14.9	29,859	マクロミル	18.7	21.8	16,153
プロシップ	3.2	3.2	4,569	ビーグリー	2.2	2.1	3,675
ガソホー・オンライン・エンターテイメント	25.1	25.5	66,300	オロ	2.8	3.4	13,872
GMOペイメントゲートウェイ	17.1	22.4	344,960	ユーザローカル	0.6	1.1	4,741
ザッパラス	6	4.8	2,443	テモナ	1.9	2.4	2,464
システムリサーチ	2.9	2.9	5,095	ニーズウェル	1.6	2.2	1,491
インターネットイニシアティブ	15.4	31.3	69,548	サインポスト	1.7	2.5	2,407
さくらインターネット	11.5	11.5	8,544	ソルクシーズ	4.7	4.2	4,200
ヴィンクス	3.1	3.1	3,658	フェイス	4	3.9	3,166
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2	2.4	22,368	プロトコーポレーション	9.5	9.6	10,147
SRAホールディングス	5.6	5.7	14,312	ハイマックス	1.3	2.6	3,068
システムインテグレータ	3.6	3.6	2,217	野村総合研究所	173.3	149.7	583,830
朝日ネット	7.8	7.7	6,768	サイバネットシステム	7.7	7.6	7,577
eBASE	6.4	12.7	13,423	CEホールディングス	6.5	5.8	3,630
アバント	7.6	10.2	12,546	日本システム技術	1.8	1.8	2,844
アドソル日進	3.8	3.8	12,141	インテージホールディングス	13.2	13.3	15,215
フリービット	6.4	5.6	5,504	東邦システムサイエンス	3	2.9	2,697
コムチュア	11.7	11.9	35,676	ソースネクスト	49.7	50.6	14,421
サイバーコム	2	2	3,386	インフォコム	11.4	11.6	39,672
アステリア	6.7	6.6	6,949	HEROZ	—	1.5	4,122
アイル	3.8	6	8,886	ラクスル	5.5	8.5	35,870
マークライNZ	5.3	4.5	11,245	F I G	12.1	12	3,180
メディカル・データ・ビジョン	8.2	12.1	36,481	システムサポート	1	2.5	3,882
gumi	—	13.7	11,946	イーソル	3.8	5.9	7,144
ショーケース	2.8	2.4	2,402	アルテリア・ネットワークス	11.6	11.8	18,703
モバイルファクトリー	2.5	2.5	2,755	EduLab	—	1	7,050
テラスカイ	3.8	3.9	14,917	東海ソフト	—	0.9	1,084
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4.7	4.2	6,539	ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.5	1.9	3,725
PCIホールディングス	2.2	4.1	6,543	東名	—	0.7	807

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
ヴィッツ	—	0.5	1,066	テレビ朝日ホールディングス	28.6	29.1	54,096
トピラスシステムズ	—	1.1	1,530	スカパーJ S A Tホールディングス	68.7	69.7	32,828
L i n k - U	—	0.8	1,064	テレビ東京ホールディングス	8.6	8.7	20,732
フォーカスシステムズ	6.7	6.7	6,311	日本BS放送	3.7	3.7	4,266
クレスコ	3.2	6.5	8,424	ビジョン	9.8	13.2	12,183
フジ・メディア・ホールディングス	100	101.8	119,513	スマートバリュー	3.4	2.9	2,679
オービック	35.9	36.6	766,038	ワイヤレスゲート	5.2	4.5	3,010
ジャストシステム	16.9	17.2	136,224	コネクシオ	6	6.1	8,442
TDCソフト	9.3	9.4	9,118	クロップス	2.2	2.1	1,558
Zホールディングス	1,423.6	1,449.8	1,014,570	日本電信電話	1,385.3	1,411	3,808,994
トレンドマイクロ	46.1	56.4	323,172	KDDI	772.3	769.6	2,496,582
IDホールディングス	4.1	4.1	4,956	ソフトバンク	941.9	959.4	1,292,311
日本オラクル	21	21.4	284,192	光通信	10.7	10.9	236,530
アルファシステムズ	3.3	3.3	11,731	NTTドコモ	765.5	—	—
フューチャー	12.6	12.8	22,720	エムティーアイ	10.4	10.4	8,548
CAC Holdings	6.9	7	9,604	GMOインターネット	41	37.9	117,111
SBテクノロジー	3.8	3.8	13,110	ファイバーゲート	2.1	3.5	7,423
トーセ	3.1	3	2,403	アイドママーケティングコミュニケーション	3.5	3.5	1,505
オービックビジネスコンサルタント	10.6	10.8	75,816	KADOKAWA	28	28.5	99,322
伊藤忠テクノソリューションズ	47.3	48.1	178,210	学研ホールディングス	3.5	14.2	23,572
アイティフォー	12.8	12.9	11,984	ゼンリン	20.8	21.2	24,825
東計電算	1.6	1.6	6,448	昭文社ホールディングス	5.4	5.2	2,371
エックスネット	1.9	1.8	1,746	インプレスホールディングス	8.6	8.7	1,635
大塚商会	56.1	57.1	295,207	アイネット	5.5	5.5	8,607
サイボウズ	12.3	12.4	34,211	松竹	6.9	7	100,100
ソフトブレイン	6.5	—	—	東宝	62	62.3	247,331
電通国際情報サービス	6.5	13.1	50,173	東映	3.9	4	69,560
ACCESS	—	10.1	7,706	エヌ・ティ・ティ・データ	276.1	281.1	421,650
デジタルガレージ	18.7	19	73,720	ビー・シー・エー	1.4	1.8	8,379
EMシステムズ	14.8	15.1	14,647	ビジネスブレイン太田昭和	1.9	3.7	5,920
ウェザーニューズ	3.6	3.6	18,504	DTS	23.3	23.7	50,030
C I J	8	7.4	6,430	スクウェア・エニックス・ホールディングス	44.2	45	266,850
ビジネスエンジニアリング	1.3	1.2	3,816	シーイーシー	11.2	11.4	16,666
日本エンタープライズ	11.6	11.4	2,553	カプコン	48.9	49.8	355,572
WOWOW	5.1	5.1	14,489	アイ・エス・ビー	2.1	5	6,725
スカラ	7.7	7.2	5,947	ジャステック	6.8	6.8	8,391
インテリジェント ウェイブ	4.2	6.4	4,652	S C S K	24	24.4	134,932
I M A G I C A GROUP	9.2	9.4	3,374	日本システムウエア	3.5	3.6	7,732
ネットワンシステムズ	39.6	40.3	153,946	アイネス	10.4	10.5	14,857
システムソフト	27	24.3	2,235	T K C	8.8	8.9	63,724
アルゴグラフィックス	8.9	9	27,675	富士ソフト	13.3	11.3	58,421
マーベラス	16.2	16.3	15,631	NSD	34.2	34	69,258
エイベックス	18	18.2	23,387	コナミホールディングス	37.7	38.4	254,976
日本ユニシス	32.4	33	134,145	福井コンピュータホールディングス	4.1	4.2	15,792
兼松エレクトロニクス	5.7	5.8	23,258	J B C Cホールディングス	7.1	7.2	10,958
都築電気	—	3.4	5,450	ミロク情報サービス	9.2	9.4	19,279
TBSホールディングス	63.1	64.3	124,806	ソフトバンクグループ	822.3	837.5	7,370,000
日本テレビホールディングス	86.7	88.2	101,341	卸売業(4.6%)			
朝日放送グループホールディングス	10.6	10.7	7,479	ハウスイ	0.9	0.9	900

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
高千穂交易	4	4.1	4,903	エコートレーディング	2.4	2.5	1,650
オルパヘルスケアホールディングス	—	1.3	1,927	伯東	6.4	6.5	7,507
伊藤忠食品	2.6	2.6	13,780	コンドーテック	8.1	8.2	8,634
エレマテック	9.7	9.9	9,830	中山福	6	6.1	3,397
J A L U X	2.9	3	4,119	ナガイレーベン	15.1	14.1	42,159
あらた	8.3	8.4	39,312	三菱食品	11.4	11.7	32,994
トーメンデバイス	1.6	1.6	5,656	松田産業	7.6	7.7	14,645
東京エレクトロン デバイス	3.8	3.8	12,882	第一興商	15.5	15.8	54,510
フィールズ	8	8.1	3,888	メディバルホールディングス	112.3	114.3	236,143
双日	574.5	585.2	143,959	S P K	2.2	4.6	5,763
アルフレッサ ホールディングス	115.6	117.8	239,134	萩原電気ホールディングス	3.9	3.9	9,816
横浜冷凍	29.2	27.7	24,015	アズワン	6.8	6.9	112,125
ラサ商事	5.5	5.6	5,045	スズデン	3.6	3.7	4,576
ラクーンホールディングス	5	—	—	尾家産業	3.1	3.1	3,964
アルコニックス	11.1	11.3	18,848	シモジマ	6.4	6.5	8,911
神戸物産	35.9	73.1	216,376	ドウシシャ	9.8	10	19,380
ハイパー	—	1.6	854	小津産業	2.3	2.3	4,379
あい ホールディングス	14.9	15.1	30,637	高速	6.2	6.3	9,714
ディーブイエックス	3.7	3.8	3,955	たけびし	3.7	3.7	5,812
ダイワボウホールディングス	8.8	9	80,010	リックス	2.4	2.4	3,686
マクニカ・富士エレホールディングス	24.8	25.3	52,649	丸文	9.2	9.4	5,057
ラクト・ジャパン	3.9	4.6	12,245	ハビネット	8.7	8.9	14,400
グリムス	—	2.4	3,835	橋本総業ホールディングス	2.1	2.1	5,334
バイタルケエスケー・ホールディングス	19.6	20	16,040	日本ライフライン	30.8	31.4	47,131
八洲電機	8.1	8.2	7,945	タカショー	5.1	6.9	5,582
メディアスホールディングス	5.9	6	4,722	エクセル	2.7	—	—
レスターホールディングス	10.8	11	23,551	マルカ	3.7	3.4	6,466
ジュテックホールディングス	2.4	2.4	2,438	I D O M	28.1	28.6	18,304
大光	4.5	4.5	2,979	進和	6.2	6.3	13,236
O C H I ホールディングス	3	3.1	4,048	エスケイジャパン	2.3	2.3	1,051
T O K A I ホールディングス	55	56	54,824	ダイトロン	4.4	4.5	7,375
黒谷	2.4	2.9	2,204	シークス	13.2	13.5	20,574
C o m i n i x	1.8	1.9	1,438	田中商事	3.2	3.3	2,283
三洋貿易	5.2	10.7	10,625	オーハシテクニカ	5.9	5.4	7,560
ビューティガレージ	1.7	1.7	4,170	白銅	3.7	3.8	5,304
ウイン・パートナーズ	7.5	7.7	8,477	ダイコー通産	—	0.7	1,076
ミタチ産業	3.1	3.2	1,910	伊藤忠商事	727.5	741	2,328,963
シップヘルスケアホールディングス	16.7	17	102,340	丸紅	1,082.6	1,102.8	796,552
明治電機工業	3.3	3.3	5,101	高島	1.7	1.7	2,801
デリカフーズホールディングス	3.7	3.8	2,337	長瀬産業	58.5	59.6	92,082
スターティアホールディングス	2.4	2.4	2,498	蝶理	6.6	6.8	10,370
コメダホールディングス	22.7	23.1	43,797	豊田通商	116.1	118.3	514,605
ビーバンドットコム	—	1.1	1,234	三共生興	15.8	16.1	7,550
アセンテック	0.8	2.3	4,367	兼松	38.8	39.5	52,337
富士興産	3.2	3.2	3,331	ツカモトコーポレーション	1.9	1.9	3,030
協栄産業	1.2	1.2	1,603	三井物産	914.2	917.3	1,889,179
小野建	9.3	9.5	11,628	日本紙パルプ商事	5.9	6	21,330
南陽	2.3	2.3	3,792	日立ハイテック	36.1	—	—
佐島電機	7.7	7.2	5,500	カメイ	13.6	13.8	16,284

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
東都水産	1.3	1.4	5,054	ソーダニッカ	10.8	11	5,885
ＯＵＧホールディングス	1.7	1.7	4,744	立花エレック	7.7	7.8	12,409
スターゼン	3.8	3.9	16,536	フォーバル	4.6	4.7	3,717
山善	40.6	41.4	41,275	PAL TAC	16.7	17	96,050
椿本興業	1.9	2	6,900	三谷産業	13.8	14	6,048
住友商事	656.3	668.5	947,264	西本Wismettacホールディングス	1.9	2.4	5,733
内田洋行	4.4	4.2	17,325	ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.9	1	1,525
三菱商事	729.9	694.7	1,864,227	コアア商事ホールディングス	—	2	2,726
第一実業	5.1	5.2	21,294	国際紙バルブ商事	24.7	25.2	5,997
キャンノンマーケティングジャパン	29.7	26.3	62,462	ヤマタネ	5.2	5.3	7,213
西華産業	5.9	6	8,064	丸紅建材リース	1	1	1,700
佐藤商事	8.6	8.8	7,990	日鉄物産	7.4	7.6	28,006
菱洋エレクトロ	10.6	10.7	36,380	泉州電業	3.2	3	9,600
東京産業	9.4	9.6	5,865	トラスコ中山	21.7	24.3	64,127
ユアサ商事	9.9	10.1	32,370	オートバックスセブン	38.6	39.3	55,413
神鋼商事	2.6	2.7	5,054	モリト	7.6	7.8	4,750
トルク	6.3	6.4	1,555	加藤産業	16.3	15.3	52,785
阪和興業	19.4	19.8	55,123	北恵	2	2.7	2,400
正栄食品工業	6.7	6.9	25,530	イノテック	6.2	5.5	6,088
カナデン	8.5	8.6	10,922	イエローハット	19.7	20	33,560
菱電商事	7.5	7.6	12,046	J Kホールディングス	9.4	9.6	7,670
フルサト工業	5.7	5.9	7,752	日伝	9.4	9.6	21,590
岩谷産業	23.1	27.4	197,554	北沢産業	7.9	8.1	2,219
ナイス	4	4.5	7,218	杉本商事	5.6	5.7	13,469
昭光通商	3.3	3.4	2,169	因幡電機産業	29.6	30.2	74,775
ニチモウ	1.6	1.7	3,196	東テク	3.5	3.5	9,684
極東貿易	3	3.1	4,302	ミスミグループ本社	130.3	132.8	419,648
イワキ	13.7	14	9,520	アルテック	8.4	7.9	2,235
三菱石油	25.6	26.1	28,762	タキヨー	3.2	3.2	5,884
稲畑産業	22.9	23.4	34,398	蔵王産業	2	2.1	2,847
G S Iクレオス	2.6	2.6	4,968	スズケン	44.1	44.9	180,498
明和産業	9.6	9.8	4,410	ジェコス	7.2	7.3	7,000
クワザワホールディングス	3.7	3.8	2,356	グローセル	10.5	10.7	5,146
ヤマエ久野	—	7.7	8,061	小売業(4.7%)			
ワキタ	22.2	22.6	22,215	ローソン	26.3	26.8	131,052
東邦ホールディングス	33.4	34	66,334	サンエー	8.7	8.9	36,490
サンゲツ	28.6	28.6	43,843	カワチ薬品	8.2	8.3	25,813
ミツロコグループホールディングス	15.3	15.6	20,826	エービーシー・マート	16.3	16.6	97,940
シナネンホールディングス	4.3	4.4	13,508	ハードオフコーポレーション	4.4	4.5	3,388
伊藤忠エネクス	23	23.5	23,876	アスクル	10.9	11.1	41,736
サンリオ	29.2	29.8	45,951	ゲオホールディングス	18.9	19.3	23,314
サンワテクノス	7.4	7.5	7,875	アダストリア	14.5	14.8	28,490
リョーサン	11.5	11.7	23,271	ジーフット	6.6	—	—
新光商事	16.3	15.9	11,845	くら寿司	5.5	6.3	39,060
トーホー	4.7	4.8	8,774	キャンドウ	5.1	5.2	9,739
三信電気	5.6	5.7	10,317	バルグループホールディングス	5.4	11	16,225
東陽テクニカ	12	11.4	13,531	エディオン	47.9	48.8	49,727
モスフードサービス	13.7	13.9	42,534	サーラコーポレーション	21.4	21.9	12,504
加賀電子	10.4	10.6	24,676	ワッツ	4.9	4.9	4,312

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
ハローズ	4	4	13,280	日本調剤	3.2	6.6	9,913
フジオフードグループ本社	8.9	8.9	10,617	コスモス薬品	4.6	9.4	152,280
あみやき亭	2.3	2.4	6,842	トーエル	5.3	5.4	4,428
ひらまつ	19.9	—	—	オンリー	2	2.2	998
大黒天物産	2.6	2.6	15,262	セブン&アイ・ホールディングス	406.9	414.5	1,637,275
ハニーズホールディングス	9.3	9.5	9,519	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	28.1	56.9	40,683
ファーマライズホールディングス	2.8	2.8	2,164	ツルハホールディングス	22.6	23.1	325,941
アルペン	8.1	8.2	19,630	サンマルクホールディングス	8.3	8.5	12,682
ハブ	3.2	3.3	1,996	フェリシモ	2.5	2.5	3,337
クオールホールディングス	15.4	15.8	18,154	トリドールホールディングス	12.9	26.4	38,913
ジンズホールディングス	5.5	5.6	37,576	TOKYO BASE	9.7	9.9	4,445
ビックカメラ	61.9	63	71,505	ウイルプラスホールディングス	1.8	1.6	1,243
DCMホールディングス	56.3	65.1	69,396	JMホールディングス	5.3	8.1	16,969
Monotaro	74	75.4	392,080	サツドラホールディングス	1.7	1.7	3,403
東京一番フーズ	3	3	1,716	アレンザホールディングス	5.4	5.4	6,744
DDホールディングス	4.1	—	—	串カツ田中ホールディングス	1.7	2.9	4,538
きちりホールディングス	3	3.1	1,776	パロックジャパンリミテッド	7.4	7.6	5,677
アークランドサービスホールディングス	7.7	8.9	18,485	クスリのアオキホールディングス	10.4	9.5	81,320
J. フロント リテイリング	124.3	126.8	107,906	力の源ホールディングス	4.9	4.8	2,745
ドトール・日レスホールディングス	16.7	15.4	24,008	スシローグローバルホールディングス	11.4	58.2	226,107
マツモトキヨシホールディングス	43	43.8	187,464	LIXILビバ	10.4	—	—
ブロンコビリー	5.5	5.6	12,208	メディカルシステムネットワーク	10.4	10.5	6,594
ZOZO	71.6	72.9	218,262	はるやまホールディングス	5.1	5.2	3,536
トレジャー・ファクトリー	3.2	3.4	2,482	ノジマ	18.6	18.9	53,865
物語コーポレーション	2.6	2.8	30,912	カッパ・クリエイト	14.6	14.9	22,126
ココカラファイン	10.9	11.1	80,142	ライトオン	7.8	7.9	4,834
三越伊勢丹ホールディングス	182	185.7	114,576	良品計画	138.2	140.8	334,822
Hamee	3.3	3.9	6,949	三城ホールディングス	11.7	11.9	3,736
ウエルシアホールディングス	31	63.1	226,844	アドヴァン	16.1	16.4	18,860
クリエイトSDホールディングス	15.4	17.9	61,934	アルビス	4	4.1	9,905
丸善CHIホールディングス	12.1	12.4	4,600	コナカ	12.8	12.5	3,850
ティーライフ	1.6	1.7	1,963	ハウス オブ ローゼ	1.4	1.4	2,335
エー・ピーホールディングス	2.3	—	—	G-7ホールディングス	6.2	6.3	15,605
チムニー	3.3	3.4	4,100	イオン北海道	10.6	14.1	14,085
シュッピン	7.2	7.4	6,859	コジマ	18.3	18.5	11,895
オイシックス・ラ・大地	—	10.5	34,597	ヒマラヤ	3.9	3.9	3,673
ネクステージ	15	18.3	25,894	コーナン商事	14.9	15.1	43,518
ジョイフル本田	30.6	31.2	44,148	エコス	3.9	4	7,520
鳥貴族	3.5	3.2	4,745	ワタミ	12.5	12.8	12,096
キリン堂ホールディングス	4.2	—	—	マルシェ	3	3.2	1,577
ホットランド	7.1	8.1	9,687	バ・バ・フィッシャー・インターナショナルホールディングス	249.4	233	532,638
すかいらくホールディングス	116.7	118.9	195,828	西松屋チェーン	23	23.4	34,117
SFPホールディングス	4.5	6.2	8,221	ゼンショーホールディングス	49.9	50.8	143,662
綿半ホールディングス	4	8.1	11,161	幸楽苑ホールディングス	6.7	6.7	11,095
ヨシックス	1.8	1.8	3,601	ハークスレイ	2.4	2.4	2,121
サイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	30.4	31	34,565	サイゼリヤ	17.2	15.8	33,338
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.1	5.7	4,810	VTホールディングス	43.5	44.4	19,225
BEENOS	4.206	5	11,965	魚力	3	3	5,370
あさひ	7.9	8	13,024	フジ・コーポレーション	2.8	2.9	6,101

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
ユナイテッドアローズ	11	11.2	17,673	シルバーライフ	—	1.5	3,166
ハイデイ日高	15.1	15.4	26,056	Genky DrugStores	5.2	4.7	18,729
京都きもの友禅	7.2	7.6	1,565	ナルミヤ・インターナショナル	1.9	2.6	2,511
コロイド	34.7	35.2	62,163	総合メディカルホールディングス	9.2	—	—
ピーシーデポコーポレーション	14.2	14.4	8,294	ブックオフグループホールディングス	6.1	6.2	5,158
壱番屋	7.4	7.5	38,175	ギフト	—	1.1	2,062
P L A N T	3	2.9	2,096	アインホールディングス	14	13	82,550
スギホールディングス	20.8	21.2	152,216	元気寿司	2.7	2.8	6,596
薬王堂ホールディングス	4.6	4.7	12,149	ヤマダホールディングス	317.2	323.2	174,204
スクロール	16.5	16.5	14,553	アークランドサカモト	16.5	16.7	25,885
ヨンドシーホールディングス	10.7	10.9	21,309	ニトリホールディングス	45	45.9	1,009,800
ファミリーマート	83.1	—	—	グルメ杵屋	7.6	7.8	7,581
木曽路	13.7	13.9	33,262	愛眼	8.3	8.4	1,898
S R Sホールディングス	12.5	12.7	10,452	ケーユーホールディングス	5.7	5.8	4,657
タカキュー	9.2	—	—	吉野家ホールディングス	34.2	34.9	74,965
リテールパートナーズ	—	14.2	19,439	松屋フーズホールディングス	5	5.2	18,122
ケーヨー	21.6	21.9	16,512	サガミホールディングス	14.1	14.3	16,716
上新電機	12.4	12.5	34,587	関西スーパーマーケット	8.8	9	10,170
日本瓦斯	16.5	16.2	82,944	王将フードサービス	7.7	7.8	44,772
ロイヤルホールディングス	18.2	18.5	33,133	プレナス	11.8	12	22,992
いなげや	13	13.2	23,192	ミニストップ	7.8	7.9	11,162
島忠	19.6	20	109,600	アークス	21.4	21.8	50,227
チヨダ	11	11.3	9,966	バローホールディングス	23.1	23.5	58,162
ライフコーポレーション	7.9	8.1	26,365	ベルク	5.2	5.3	30,846
リンガーハット	12.9	13.1	30,549	大庄	5.7	5.9	5,717
Mr M a x H D	14.7	14.8	10,863	ファーストリテイリング	13.9	14.2	1,303,844
テンアライド	9.6	—	—	サンドラッグ	39.2	39.9	163,590
A O K Iホールディングス	21	21.6	11,728	サックスパー ホールディングス	9	9.3	5,217
オークワ	16.4	16.7	21,175	ヤマザワ	2.6	2.6	4,469
コメリ	16.1	16.4	46,756	やまや	2.2	2.2	4,802
青山商事	21.6	22.2	14,496	ペルルーナ	22.6	22.9	26,518
しまむら	12.1	12.3	144,525	銀行業(4.5%)			
はせがわ	6	6.2	1,804	島根銀行	2.1	2.8	1,867
高島屋	75.9	77.3	72,662	じもとホールディングス	70.4	7.2	5,796
松屋	21.1	21.5	17,415	めぶきフィナンシャルグループ	541.2	551.3	114,119
エイチ・ツー・オー リテイリング	49.4	50.3	35,411	東京きらぼしフィナンシャルグループ	14.1	14.3	15,944
近鉄百貨店	4	4.1	12,587	九州フィナンシャルグループ	170.9	232.1	98,410
バルコ	9.3	—	—	ゆうちょ銀行	295.1	300.6	266,331
丸井グループ	95.4	97.2	174,085	富山第一銀行	24.8	25.3	7,235
アクシアル リテイリング	8.7	8.8	44,264	コンコルディア・フィナンシャルグループ	612.6	606	234,522
イオン	400.3	407.7	1,351,525	西日本フィナンシャルホールディングス	71	70.6	45,607
イズミ	21.2	21.6	80,028	関西みらいフィナンシャルグループ	61.1	62.3	32,396
平和堂	21.2	21.6	47,174	三十三フィナンシャルグループ	9.7	9.8	12,348
フジ	12.6	12.8	25,433	第四北越フィナンシャルグループ	18.1	18.4	41,216
ヤオコー	11.8	12	80,040	ひろぎんホールディングス	—	156.5	94,995
ゼビオホールディングス	12.7	13.1	11,397	新生銀行	76.4	77.9	104,541
ケーズホールディングス	100.5	102.4	146,227	あおぞら銀行	62.1	63.2	123,935
O l y m p i c グループ	5.7	5.7	5,135	三菱UFJフィナンシャル・グループ	7,169.9	7,257.7	3,505,469
日産東京販売ホールディングス	16	16.3	4,172	りそなホールディングス	1,143	1,153.5	432,101

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	196.9	200.5	634,582	長野銀行	3.4	3.5	4,410
三井住友フィナンシャルグループ	720.3	733.8	2,450,158	名古屋銀行	8.4	7.9	21,021
千葉銀行	358.3	354.1	204,669	北洋銀行	157	159.9	33,259
群馬銀行	204.7	203.8	64,604	愛知銀行	3.8	3.8	10,966
武蔵野銀行	15.5	15.8	24,537	中京銀行	4.3	4.4	8,505
千葉興業銀行	28.6	29.1	7,129	大光銀行	3.6	3.6	4,579
筑波銀行	43.3	44.1	7,938	愛媛銀行	14.5	14.8	14,282
七十七銀行	35.2	35.8	48,186	トマト銀行	4	4.1	4,227
青森銀行	8.1	8.2	19,442	千葉銀行	44.4	45.2	18,306
秋田銀行	6.7	6.8	9,486	栃木銀行	50.3	51.2	8,806
山形銀行	11.7	11.9	12,019	北日本銀行	3.2	3.3	6,246
岩手銀行	6.8	7	13,622	東和銀行	18.3	18.6	12,387
東邦銀行	93.1	94.9	19,359	福島銀行	9.8	10	2,090
東北銀行	5	5.1	5,553	大東銀行	5.4	5.5	3,498
みちのく銀行	6.7	6.8	6,847	トモニホールディングス	80.5	82	24,764
ふくおかフィナンシャルグループ	87.7	89.4	172,005	フィデアホールディングス	101.1	103	11,021
静岡銀行	257.9	258.4	198,192	池田泉州ホールディングス	119.8	122	18,178
十六銀行	13.1	13.3	25,030	証券・商品先物取引業(0.8%)			
スルガ銀行	106.6	108.5	34,286	FPG	32.3	33	16,203
八十二銀行	251.4	256	87,552	ジャパンインベストメントアドバイザー	—	5.5	6,501
山梨中央銀行	12.1	12.3	9,803	マーキュリアインベストメント	4.8	4.3	3,091
大垣共立銀行	20.6	21	41,853	SBIホールディングス	116.4	121.9	326,692
福井銀行	8.9	9.1	17,135	ジャフコグループ	16	16.3	87,694
北國銀行	10.7	10.6	26,584	大和証券グループ本社	836	851.6	425,544
清水銀行	4.3	4.4	7,466	野村ホールディングス	1,833	1,867.1	1,050,430
富山銀行	2	2	5,610	岡三証券グループ	89.1	90.7	36,552
滋賀銀行	20.9	21.3	41,598	丸三証券	31.3	31.8	16,472
南都銀行	17.3	17.6	30,166	東洋証券	38.3	38.9	5,601
百五銀行	93.7	95.5	27,790	東海東京フィナンシャル・ホールディングス	120.1	122.3	39,380
京都銀行	37.3	38	214,700	光世証券	2.7	2.7	1,746
紀陽銀行	36.9	37.6	51,624	水戸証券	30.8	31.2	8,299
ほくほくフィナンシャルグループ	69.3	70.6	66,152	いちよし証券	19.7	20.1	10,070
広島銀行	153.8	—	—	松井証券	59.7	60.8	49,856
山陰合同銀行	61.8	62.9	30,506	だいこう証券ビジネス	5.3	—	—
中国銀行	89.6	91.3	74,683	マネックスグループ	79.2	78.1	38,034
鳥取銀行	3.5	3.6	4,028	極東証券	14.2	14.4	10,886
伊予銀行	148.6	151.4	93,716	岩井コスモホールディングス	10	10.1	14,200
百十四銀行	11.1	11.3	16,633	藍澤證券	18.9	19.2	15,148
四国銀行	15.8	16.1	10,738	マネーパートナーズグループ	11.7	11.9	2,546
阿波銀行	17	17.3	38,544	スパークス・グループ	36.7	49.5	14,008
大分銀行	6	6.1	12,480	保険業(1.9%)			
宮崎銀行	6.9	7.1	15,676	かんぽ生命保険	36.9	37.6	84,336
佐賀銀行	6.3	6.4	8,435	SOMPOホールディングス	195.8	199.5	835,506
沖縄銀行	9.5	9.7	26,025	アニコムホールディングス	8.6	35.3	40,489
琉球銀行	24	24.5	18,154	MS&ADインシュアランスグループホールディングス	272.3	277.4	869,649
セブン銀行	347.9	354.5	79,762	ソニーフィナンシャルホールディングス	85.6	—	—
みずほフィナンシャルグループ	14,153.1	1,441.7	2,029,192	第一生命ホールディングス	589.4	600.4	988,558
高知銀行	3.8	3.8	2,644	東京海上ホールディングス	372.5	375.1	2,034,167
山口フィナンシャルグループ	130	132.4	79,440	T&Dホールディングス	311.3	317.1	403,351

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
アドバンスクリエイト	2.4	2.2	4,096	東急不動産ホールディングス	285.3	291.1	164,471
その他金融業(1.1%)				飯田グループホールディングス	87.7	89.2	212,028
全国保証	29.4	29.9	135,746	イーグラン	3.5	3.5	2,929
ジェイリース	2.9	—	—	ムゲンエステート	9.3	9.6	4,358
イントラスト	3.6	3.8	3,097	ハウスドゥ	5.7	5.2	6,494
日本モーゲージサービス	2.1	4.4	5,258	シーアールイー	4	3.9	5,089
C a s a	3.6	3.8	3,792	ケイアイスター不動産	4	—	—
アルヒ	16.6	16.9	28,949	グッドコムアセット	3.2	6.2	8,091
プレミアグループ	5.6	5.8	14,076	ジェイ・エス・ビー	1.4	2.4	8,280
クレディセゾン	73	74.4	90,396	テンポイノベーション	3.9	4	3,440
芙蓉総合リース	10.9	11.1	79,809	パーク24	56.5	57.7	115,457
みずほリース	16.1	16.4	53,136	バラカ	3.4	3.6	5,756
東京センチュリー	21	21.4	193,456	三井不動産	514.3	516.4	1,051,390
日本証券金融	45.9	46.9	24,341	三菱地所	730.5	744.3	1,205,766
アイフル	158.9	162.1	42,308	平和不動産	19.6	19.9	73,431
リコーリース	8.2	8.4	26,040	東京建物	114.7	105.8	153,939
イオンフィナンシャルサービス	63.7	65	84,435	ダイビル	28.1	28.5	34,513
アコム	209.3	213.4	99,871	京阪神ビルディング	18	17.8	30,705
ジャックス	11.5	11.8	22,561	住友不動産	234.6	239	727,994
オリエントコーポレーション	281.7	287.6	35,374	テアオーシー	22.2	22.8	16,347
日立キャピタル	24.6	25	64,700	東京楽天地	2	2.1	9,156
アプラスフィナンシャル	50	—	—	スターツコーポレーション	14.7	15	41,385
オリックス	651.5	658.3	1,141,492	フジ住宅	14.3	14.6	9,300
三菱UFJリース	264.3	269.4	138,741	空港施設	13.3	13.6	6,460
九州リースサービス	5.1	5.3	3,264	明和地所	8.3	8.3	4,822
日本取引所グループ	298.9	304.5	813,624	ゴールドクレスト	9	9.2	15,437
イー・ギャランティ	11.1	12.2	27,950	エスリード	4.8	5.1	7,670
アサックス	5.4	5.6	4,071	日神グループホールディングス	18.3	19.1	8,079
NECキャピタルソリューション	4.2	4.4	8,602	日本エスコン	20.5	19.2	15,244
不動産業(1.9%)				タカラレーベン	50.7	48.5	15,520
いちご	135.9	140.2	39,396	AVANTIA	7.4	7.7	6,575
日本駐車場開発	124.4	115.2	15,897	イオンモール	53	54	90,666
スター・マイカ・ホールディングス	6.3	6.6	7,260	毎日コムネット	4	4.8	3,225
ADワークスグループ	—	20.1	3,115	ファースト住建	5.7	5.9	6,265
ヒューリック	223.6	226.3	253,229	カチタス	13.2	26.7	88,243
三栄建築設計	5.1	5.1	9,399	トーセイ	15.4	16	15,968
野村不動産ホールディングス	63.8	65.1	145,238	穴吹興産	3.1	3.2	5,193
三重交通グループホールディングス	23.6	24.5	11,662	サンフロンティア不動産	15.6	16.3	14,441
サムディ	15.5	16	26,400	エフ・ジェー・ネクスト	10.5	10.7	10,817
ディア・ライフ	16.1	18.4	7,985	インテリックス	5	3	1,713
エー・ディー・ワークス	193.2	—	—	ランドビジネス	4.4	3.6	1,195
日本商業開発	7.5	7.6	12,920	サンネクスタグループ	4	4.9	4,655
ユニゾホールディングス	14.6	—	—	グランディハウス	11.3	11.7	5,054
ハウスコム	2.3	2.9	3,845	日本空港ビルデング	33.5	34.1	195,393
日本管理センター	8.1	6.9	8,204	サービス業(5.7%)			
サンセイランディック	4.8	5.1	3,758	明豊ファシリティワークス	—	5	3,180
エストラスト	1.4	—	—	日本工営	6.8	7	19,327
フージャースホールディングス	20.8	21.1	14,411	L I F U L L	35.4	36.4	13,358
オープンハウス	30.7	33.8	142,129				

銘柄	当期首(前期末)	当期 末		銘柄	当期首(前期末)	当期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
ミクシィ	—	19.7	48,659	ジャパンベストレスキュシステム	6.8	8.1	6,860
ジェイエイシーリクルートメント	6.8	7	13,097	ファンコミュニケーションズ	28	28.7	11,623
日本M&Aセンター	76.3	78.7	460,395	ライク	4.1	3.5	6,723
メンバーズ	3	3.1	8,463	ビジネス・ブレイクスルー	4.6	4.7	2,166
中広	1.3	2	640	エスプール	19.6	26.6	24,312
U T グループ	11.9	16.2	54,594	WDBホールディングス	4.6	4.8	12,571
アイティメディア	3.2	4.2	9,487	手間いらず	—	0.7	3,416
タケエイ	9.8	11.4	16,222	ティア	6.1	6.5	2,678
E・Jホールディングス	1.3	4.1	4,108	C D G	1.2	1.2	1,806
ビーネックスグループ	11.2	13	15,509	バリューコマース	5.7	7	22,750
コシダカホールディングス	24.4	25.2	10,357	インフォマート	110.7	104.2	96,697
アルトナー	2.6	2.7	2,411	J Pホールディングス	32.1	32.9	9,475
パソナグループ	12.4	11.2	21,056	エコナックホールディングス	19.1	20.7	1,904
C D S	2.6	2.7	3,666	E P Sホールディングス	15.3	14.1	14,367
リンクアンドモチベーション	22.4	18.9	10,546	レッグス	2.6	2.7	4,428
G C A	12.3	13.7	9,590	プレスステージ・インターナショナル	37.9	38.7	35,410
エス・エム・エス	31.4	32	131,040	アミューズ	5.5	5.7	14,181
サニーサイドアップグループ	2.4	3.9	2,418	ドリームインキュベータ	3.1	3.3	4,240
バーソルホールディングス	100.9	102.9	200,963	クイック	6.3	6.6	7,022
リニカル	5	5.2	3,962	T A C	6.6	6.9	1,745
クックパッド	35.6	32.9	10,133	ケネディクス	96.2	—	—
エスクリ	3.3	—	—	電通グループ	104	115.6	361,828
アイ・ケイ・ケイ	5.1	5.3	3,169	テイクアンドギヴ・ニーズ	3.9	—	—
学情	3.6	3.8	5,008	びあ	2.9	—	—
スタジオアリス	5.1	5.3	10,716	イオンファンタジー	3.9	4	8,676
シミックホールディングス	5.6	5.2	7,753	シーティーエス	11.5	11.8	10,879
エブコ	1.7	2.7	2,532	ネクシィーズグループ	3.6	3.4	2,992
N J S	2.3	2.6	5,223	H. U. グループホールディングス	28.3	28.8	89,280
総合警備保障	40.2	40.9	212,680	アルプス技研	9	9.2	19,384
カカクコム	75.6	76	226,784	ダイオーズ	2.1	2.2	2,083
アイロムグループ	3.6	3.7	6,660	日本空調サービス	10.7	11	8,184
セントケア・ホールディング	6.8	6.9	6,948	オリエンタルランド	107.3	109.3	1,748,800
サイネックス	1.9	2	1,368	ダスキン	26	25.6	72,550
ルネサンス	5.7	5.9	5,369	明光ネットワークジャパン	12	13.3	7,660
ディップ	14.3	14.1	35,799	ファルコホールディングス	5.6	5.8	9,575
デジタルホールディングス	5.5	7.3	13,870	ラウンドワン	28.3	28.9	24,565
ツクイホールディングス	24	24.5	14,577	リゾートトラスト	46.3	47.2	70,044
キャリアデザインセンター	2.6	2.5	2,282	ビー・エム・エル	13	13.3	49,941
ベネフィット・ワン	27.6	37.5	115,312	ワタベウェディング	1.8	—	—
エムスリー	222.5	226.7	2,301,005	りらいあコミュニケーションズ	18.3	18	24,858
ツカダ・グローバルホールディング	6.6	8.2	2,107	リソー教育	46.4	47.6	13,994
プラス	1.3	—	—	早稲田アカデミー	3.4	4.6	4,600
アウトソーシング	57.8	59	79,296	ユー・エス・エス	113	115.2	241,228
ウェルネット	9.7	10.8	4,892	東京個別指導学院	3.7	3.9	2,496
ワールドホールディングス	3.4	3.6	7,009	サイバーエージェント	58.1	63.4	476,134
ディー・エヌ・エー	49.5	43.6	84,322	楽天	470.5	479.3	469,234
博報堂D Yホールディングス	140.4	143.1	210,500	クリーク・アンド・リバー社	5.3	5.6	6,428
ぐるなび	17.7	18.3	9,790	モーニングスター	—	11.6	5,486
タカミヤ	10.9	11.2	6,025	テー・オー・ダブリュー	9	17.1	4,565

銘柄	当期首(前期末)			銘柄	当期首(前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
山田コンサルティンググループ	5	6.8	6,494	ソラスト	27.9	28.5	46,740
セントラルスポーツ	3.8	3.9	8,193	セラク	3.3	3.3	6,015
フルキャストホールディングス	10.1	9.1	14,896	インソース	4.9	8.6	16,271
エン・ジャパン	18	18.3	57,096	ベイカレント・コンサルティング	6.1	6.2	117,676
リソルホールディングス	1.1	1.2	4,578	Orchestra Holdings	2.1	2.2	4,540
テクノプロ・ホールディングス	20.2	20.5	175,480	アイモバイル	3.3	3.8	4,898
アトラ	2.6	2.4	804	キャリアインデックス	4.4	4.5	2,529
インタワークス	2.1	2.5	895	MS-Japan	3.3	3.5	3,895
アイ・アールジャパンホールディングス	4.1	4.2	79,926	船場	1.7	2.2	1,903
Keepers 技研	3.8	7.6	16,355	グレイステクノロジー	4.6	4.8	29,904
ファーストロジック	2.5	2.2	1,744	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	10.7	23.7	62,520
三機サービス	2.2	2.2	2,136	フルテック	1.5	1.6	2,198
Gunosy	7.1	6.6	4,910	グリーンズ	3.9	2.6	1,167
デザインワン・ジャパン	2.4	3.9	838	ツナググループ・ホールディングス	1.3	—	—
イー・ガーディアン	5.2	4.6	14,191	GameWith	2.4	3.4	1,948
リブセンス	6.9	6.4	1,555	ソウルドアウト	1.6	2.6	3,944
ジャパンマテリアル	31.1	31.7	49,483	MS&Consulting	1.5	2.2	1,227
ベクトル	12.7	13	17,342	エール・ディー・エス	—	0.8	3,208
ウチヤマホールディングス	5.2	5.6	1,881	ミダック	—	1.4	4,354
チャーム・ケア・コーポレーション	7.5	8.9	13,056	日総工産	6.8	7.1	5,623
ライクキッズ	2.3	—	—	キュービーネットホールディングス	6.2	4.4	6,076
キャリアリンク	3.5	3.4	8,840	RPAホールディングス	5.8	8.1	4,949
I B J	7	8.7	7,020	スプリックス	3.5	3.2	2,496
アサンテ	4.1	4.2	6,774	マネジメントソリューションズ	1.1	5.1	9,965
N・フィールド	7.1	7.3	6,307	プロレド・パートナーズ	—	1.4	5,173
バリューHR	2	4.2	7,371	テノ・ホールディングス	—	1	1,266
M&Aキャピタルパートナーズ	7.2	8.4	44,352	フロンティア・マネジメント	—	1.8	4,224
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.9	4	8,040	ピアラ	—	0.6	1,224
ERIホールディングス	3	3.2	1,987	コプロ・ホールディングス	—	0.7	2,891
アビスト	1.6	1.7	4,972	ギークス	—	1.2	1,741
シグマクス	7	7.2	12,787	カープスホールディングス	—	28.5	22,429
ウィルグループ	6.7	6.9	6,948	フォーラムエンジニアリング	—	5.6	5,213
エスクロー・エージェント・ジャパン	14.4	15.8	4,582	ダイレクトマーケティングミックス	—	4.1	14,760
メドピア	—	4.9	39,200	アドバンテッジリスクマネジメント	5.2	5.5	3,492
レアジョブ	—	1	2,386	リログループ	55.2	56.3	140,637
リクルートホールディングス	722.9	736.4	3,438,988	東祥	6.3	6.5	9,763
エラン	6	14.3	23,251	エイチ・アイ・エス	15.8	14.9	25,076
土木管理総合試験所	4.6	5.6	1,898	ラックランド	2.4	3	7,065
ネットマーケティング	3.8	4.3	2,906	共立メンテナンス	16.7	17.1	57,114
日本郵政	827.2	842.7	700,705	イチネンホールディングス	11.4	11.7	14,695
ベルシステム24ホールディングス	17	17.3	31,832	建設技術研究所	7	6.7	16,515
鎌倉新書	7.6	8	6,976	スペース	6.6	6.9	5,444
SMN	1.7	2.4	1,920	長大	3.8	4.2	6,728
一蔵	1.2	—	—	燦ホールディングス	4.5	4.6	5,244
LITALICO	3.5	3.6	13,662	スバル興業	0.6	0.6	5,394
グローバルキッズCOMPANY	1.7	2.1	1,971	東京テアトル	4	4.2	5,292
エアトリ	4.6	5.5	7,832	タナベ経営	2	2.1	2,818
アトラエ	2.6	3.2	8,784	ナガワ	3.2	3.3	32,472
ストライク	3.8	3.9	18,466	よみうりランド	2.2	—	—

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京都競馬	6.6	6.8	30,022
カナモト	16.6	18.2	41,714
東京ドーム	41	—	—
西尾レントオール	10.3	9.6	21,456
トランス・コスモス	9.6	9.9	25,502
乃村工藝社	43.3	44.3	35,440
藤田観光	4.4	4.1	5,817
KNT-CTホールディングス	6.3	6.4	5,760
日本管財	10.9	11.1	22,388
トーカイ	9.8	10	19,900
白洋舎	1.2	—	—
セコム	107.1	109.1	1,034,049
セントラル警備保障	4.9	5	17,250
丹青社	19.1	19.6	14,915
メイテック	12.5	12.6	65,646
応用地質	10.9	12.1	15,863

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
船井総研ホールディングス	20.9	21.1	48,340
進学会ホールディングス	4.2	4.4	2,090
オオバ	8	7.5	5,520
いであ	1.9	2.6	4,570
学究社	3	3.1	4,104
ベネッセホールディングス	33.7	34.3	68,908
イオンディライト	12.5	12.7	34,251
ナック	5.7	5.9	5,534
ニチイ学館	14.4	—	—
ダイセキ	17	17.3	54,408
ステップ	3.8	3.9	5,947
合 計	株 数 ・ 金 額	123,703	112,452
	銘 柄 数 < 比 率 >	2,092	2,091
			<99.1%>

(注1) ()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) < >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	売 建 額
国 内	T O P I X	百万円 1,966	百万円 —

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 276,533,619	% 99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,835,057	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	279,368,676	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年1月22日現在
(A) 資 産	279,368,675,190円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,321,081,697
株 式(評価額)	276,533,619,480
未 収 入 金	101,906,050
未 収 配 当 金	350,030,063
差 入 委 託 証 拠 金	62,037,900
(B) 負 債	446,436,029
未 払 解 約 金	446,434,994
未 払 利 息	1,035
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	278,922,239,161
元 本	135,654,719,286
次 期 繰 越 損 益 金	143,267,519,875
(D) 受 益 権 総 口 数	135,654,719,286口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,561円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年1月23日 至 2021年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	5,723,699,496円
受 取 配 当 金	5,723,612,547
受 取 利 息	19,270
そ の 他 収 益 金	1,211,259
支 払 利 息	△1,143,580
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	19,667,901,195
売 買 益	41,551,671,086
売 買 損	△21,883,769,891
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	561,484,850
取 引 益	1,259,909,900
取 引 損	△698,425,050
(D) そ の 他 費 用	△4,043
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	25,953,081,498
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	122,965,743,799
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,029,304,220
(H) 解 約 差 損 益 金	△15,680,609,642
(I) 計 (E+F+G+H)	143,267,519,875
次 期 繰 越 損 益 金(I)	143,267,519,875

(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139,038,929,074円、期中追加設定元本額は17,267,602,546円、期中一部解約元本額は20,651,812,334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。

DC日本株式インデックスファンドL	53,151,287,973円
インデックスコレクション（国内株式）	18,725,218,454円
インデックスコレクション（バランス株式30）	12,178,512,933円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	9,002,120,410円
私募日本株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	7,619,455,831円
バランスファンドVA3（適格機関投資家専用）	5,620,128,796円
DCバランスファンド50	3,439,883,370円
日本株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	2,804,770,606円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,435,297,987円
バランスファンドVA（適格機関投資家専用）	2,273,270,560円
DCバランスファンド30	2,229,972,152円
DCバランスファンド70	1,925,713,950円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,905,052,946円
日本株式インデックスe	1,538,973,375円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,435,179,355円
日本株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	1,233,084,870円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	982,619,835円
DC日本株式インデックスファンドA	902,954,069円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	811,914,642円
バランスファンドVA2（適格機関投資家専用）	738,287,744円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	737,022,911円
日本株式インデックスファンド	626,336,325円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	570,311,445円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	528,109,116円
VAバランスファンド（株60／100）（適格機関投資家専用）	448,988,590円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	337,369,764円
DC日本株式インデックスファンド	314,313,884円
VAバランスファンド（株50／100）（適格機関投資家専用）	181,397,043円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	174,219,341円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	152,599,543円
VAバランスファンド（株40／100）（適格機関投資家専用）	109,734,458円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	103,477,154円
VAバランスファンド（株25／100）（適格機関投資家専用）	87,152,076円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	72,164,982円
VAバランスファンド2（株40／100）（適格機関投資家専用）	67,546,320円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	64,778,174円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	44,139,272円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	35,777,089円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	28,803,354円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	10,041,429円
私募日本株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	4,149,118円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	2,588,040円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2021年2月8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2001年2月22日から無期限です。
運 用 方 針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。
組 入 制 限	外貨建資産への投資には、制限を設けません。 株式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1万円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 式 組 比	株 式 入 率	株 式 先 比	株 式 物 率	投資信託 証券組 比率	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
第16期(2017年2月7日)	22,040	15.7	2,603.252	16.7	95.6	1.7	2.6	2.6	2.6	226,230
第17期(2018年2月7日)	25,782	17.0	3,029.314	16.4	92.1	5.6	2.2	2.2	2.2	215,137
第18期(2019年2月7日)	25,969	0.7	3,064.555	1.2	92.7	4.7	2.5	2.5	2.5	183,233
第19期(2020年2月7日)	31,535	21.4	3,735.334	21.9	91.5	5.9	2.5	2.5	2.5	233,093
第20期(2021年2月8日)	35,382	12.2	4,196.617	12.3	96.0	1.8	2.1	2.1	2.1	277,252

(注)株式先物比率は買建比率ー売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 比	株 式 入 率	株 式 先 比	株 式 物 率	投資信託 証券組 比率	純 資 産 額
		騰 落 率		騰 落 率						
(当 期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%	
2020年 2月7日	31,535	—	3,735.334	—	91.5	5.9	2.5	2.5	2.5	
2月末	28,303	△10.2	3,369.370	△9.8	91.3	6.1	2.7	2.7	2.7	
3月末	24,054	△23.7	2,833.704	△24.1	92.8	4.7	2.6	2.6	2.6	
4月末	26,413	△16.2	3,121.076	△16.4	92.7	4.8	2.5	2.5	2.5	
5月末	27,549	△12.6	3,267.180	△12.5	91.9	5.7	2.4	2.4	2.4	
6月末	28,078	△11.0	3,327.646	△10.9	92.2	5.4	2.4	2.4	2.4	
7月末	29,015	△8.0	3,448.996	△7.7	92.2	5.4	2.4	2.4	2.4	
8月末	31,240	△0.9	3,702.597	△0.9	93.8	3.9	2.3	2.3	2.3	
9月末	30,017	△4.8	3,555.756	△4.8	94.3	3.4	2.3	2.3	2.3	
10月末	29,180	△7.5	3,463.659	△7.3	94.4	3.3	2.3	2.3	2.3	
11月末	32,546	3.2	3,866.173	3.5	96.2	1.7	2.2	2.2	2.2	
12月末	33,488	6.2	3,977.755	6.5	95.5	2.4	2.1	2.1	2.1	
2021年 1月末	34,183	8.4	4,052.926	8.5	95.8	2.0	2.1	2.1	2.1	
(当 期 末)										
2021年 2月8日	35,382	12.2	4,196.617	12.3	96.0	1.8	2.1	2.1	2.1	

(注1)騰落率は期首比です。

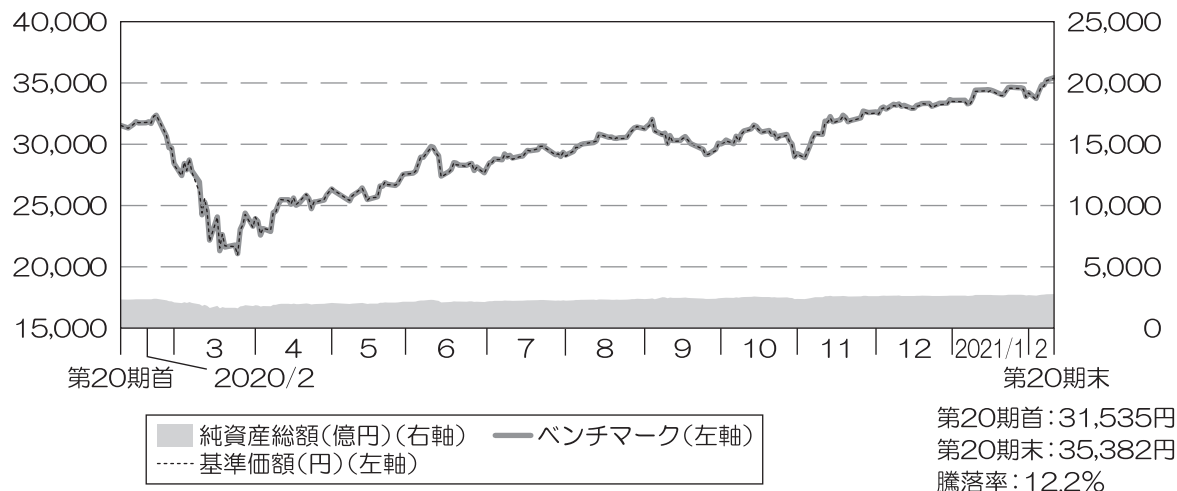
(注2)株式先物比率は買建比率ー売建比率です。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)です。

MSCIコクサイ・インデックスとは、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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した株価指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及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及び公表を停止する権利を有しています。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、2020年2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MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、新型コロナウイルスの世界的な感染急拡大を受けた外出制限措置などによる経済活動の停滞長期化への懸念などから、2020年3月中旬にかけて大幅に下落しました。しかし3月下旬以降は、世界的な金融緩和政策や各国の大型経済対策への期待などに支えられて急速に値を戻し、その後も米欧の中央銀行による低金利政策の長期化観測や、新型コロナウイルスのワクチン早期実用化による経済正常化への期待の高まりなどを受けて上昇基調で推移しました。期末にかけては、米国にて上下両院で民主党が多数を確保したことで大規模な経済対策が実現するとの期待が高まったことなどから、先進国株式市場は一段高となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(配当込み、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) 株式組入比率

運用の効率化を図るため株価指数先物取引と為替予約取引を利用し、先物を含む株式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、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

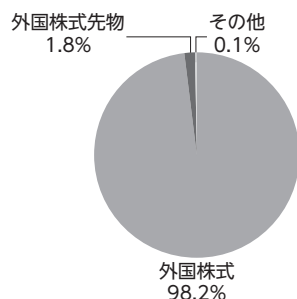
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	4.7%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.5%
3	AMAZON.COM	アメリカ	2.9%
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.3%
5	S&P 500 EMIN 2103	アメリカ	1.3%
6	TESLA INC	アメリカ	1.3%

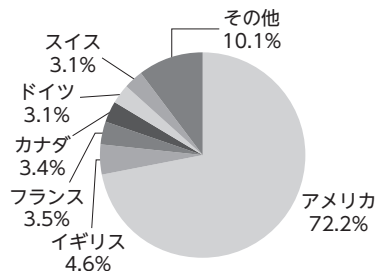
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
組入銘柄数			1,291

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

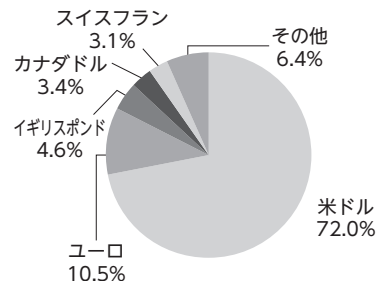
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

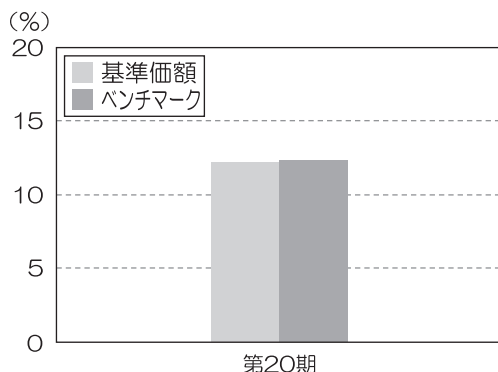


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.8%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、配当課税要因^(※)(マイナス要因)などです。

(※) ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。

今後の運用方針

MSCIコクサイ・インデックスに採用されている国の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年2月8日～2021年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%	(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
（株式）	(1)	(0.002)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(1)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	2	0.007	(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
（株式）	(2)	(0.007)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	6	0.021	(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
（保管費用）	(5)	(0.018)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(1)	(0.002)	
合計	9	0.032	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(29,505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
外 国	ア メ リ カ	百株 30,288 (9,950)	千米ドル 267,667 (6,845)	百株 16,825 (546)	千米ドル 116,573 (9,000)
	カ ナ ダ	4,833 (241)	千カナダドル 20,407 (445)	2,691 (255)	千カナダドル 7,001 (834)
	ド イ ツ	2,545 (242)	千ユーロ 12,373 (△191)	990 (34)	千ユーロ 3,866 (0.81015)
	イ タ リ ア	4,249	2,769	1,560 (266)	877 (241)
	フ ラ ン ス	2,367 (△183)	11,680 (△482)	759 (96)	4,626 (37)
	オ ラ ン ダ	2,135 (17)	6,674 (△3,415)	1,456	3,249
	ス ペ イ ン	4,324 (23,459)	2,638 (442)	6,735 (19,238)	1,804 (454)
	ベ ル ギ ー	193	1,373	103	545
	オ ー ス ト リ ア	25	96	36	127
	ルクセンブルク	177 (58)	277 (－)	117	68
	フ ィ ン ラ ン ド	1,117 (212)	1,537 (－)	415	679
	ア イ ル ラ ン ド	201 (30)	1,059 (249)	947	548
	ポ ル ト ガ ル	624 (1,194)	267 (－)	1,614	202
	そ の 他	－ (797)	－ (4,257)	－ (797)	－ (4,257)
	イ ギ リ ス	26,636 (6,782)	千イギリスポンド 13,855 (4,653)	15,454 (3,041)	千イギリスポンド 5,893 (705)
	ス イ ス	1,671 (0.17)	千スイスフラン 12,138 (△192)	821 (－)	千スイスフラン 5,296 (11)
	ス ウ ェ ー デ ン	3,013 (201)	千スウェーデンクローナ 53,139 (－)	1,431	千スウェーデンクローナ 21,243
	ノ ル ウ ェ ー	526	千ノルウェークローネ 8,800	131	千ノルウェークローネ 1,513
	デ ン マ ー ク	532	千デンマーククローネ 22,879	206	千デンマーククローネ 9,899

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 8,415 (505)	千オーストラリアドル 13,918 (201)	百株 6,485 (309)	千オーストラリアドル 5,795 (174)
	ニュージーランド	1,001	千ニュージーランドドル 735	490	千ニュージーランドドル 172
	香 港	7,351 (△1,000)	千香港ドル 30,443 (1,446)	4,984 (400)	千香港ドル 17,549 (1,926)
	シンガポール	2,456 (1,041)	千シンガポールドル 1,632 (159)	5,018 (778)	千シンガポールドル 1,502 (80)
	イスラエル	150 (23)	千イスラエルシェケル 298 (29)	23 (ー)	千イスラエルシェケル 22 (29)

(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
外 国	ア メ リ カ	証券 ー (5,434)	千米ドル ー (96)	証券 5,434	千米ドル 26
	ス イ ス	ー (57,456)	千スイスフラン ー (11)	57,456	千スイスフラン 9

(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。

<投資信託受益証券、投資証券>

			当 期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	千口	千米ドル	千口	千米ドル
		BOSTON PROPERTIES	1	194	ー	ー
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.89	114	ー	ー
		SL GREEN REALTY CORP	2	93	ー	ー
		PROLOGIS INC	ー	ー	4	168
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	643	3	308
		CAMDEN PROPERTY TRUST	0.599	96	ー	ー
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	0.99	104	ー	ー
		DUKE REALTY CORP	2	66	9	355
		CROWN CASTLE INTL CORP	3	104	ー	ー
		ESSEX PROPERTY TRUST	3	480	0.641	111
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	0.39	110	ー	ー
			3	213	1	90

			当期			
			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
外			千口	千米ドル	千口	千米ドル
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.94	109	4	351
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5	143	—	—
		WELLTOWER INC	5	375	1	86
		KIMCO REALTY CORP	—	—	17	195
		IRON MOUNTAIN INC	3	89	—	—
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	6	73	—	—
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.973	100	—	—
		REALTY INCOME CORP	5	373	1	86
		REGENCY CENTERS CORP	2	117	—	—
		SIMON PROPERTY GROUP	3	192	1	97
		PUBLIC STORAGE	1	265	0.836	177
		SUN COMMUNITIES INC	0.682	101	—	—
		VENTAS INC	1	85	—	—
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1	109	—	—
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5	813	1	150
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5	110	—	—
		AGNC INVESTMENT CORP	5	75	—	—
		VEREIT INC	—	—	—	—
			(△44)	(—)		
		AMERICAN TOWER CORPORATION	3	919	1	432
		WP CAREY INC	1	116	—	—
		EQUINIX INC	0.82	590	0.298	207
		VICI PROPERTIES INC	8	205	—	—
		SBA COMMUNICATIONS CORP	0.397	121	—	—
	小 計		96	7,313	48	2,820
			(△44)	(—)		
国	カナダ		千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	2	70
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2	144	—	—
		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	—	—	7	75
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	7	108
	小 計		2	144	17	255
	フランス		千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		ICADE	—	—	1	114
		KLEPIERRE	—	—	—	—
			(—)	(△7)		
		GECINA SA	0.8	105	—	—
		COVIVIO (FP)	1	73	—	—
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	59	—	—
	小 計		3	238	1	114
			(—)	(△7)		
	ユーロ計		3	238	1	114
			(—)	(△7)		
イギリス			千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
		SEGRO PLC	16	140	—	—
小 計			16	140	—	—

			当 期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外	オーストラリア	APA GROUP	千口 8	千オーストラリアドル 100	千口 —	千オーストラリアドル —
		GPT GROUP	35	136	—	—
		SYDNEY AIRPORT	—	—	—	—
			(10)	(59)	(—)	(12)
		DEXUS	11	107	—	—
		GOODMAN GROUP	19	313	—	—
		LENLEASE GROUP	8	115	—	—
		SCENTRE GROUP	46	159	—	—
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	—	—	—	—
			(10)	(12)	(10)	(12)
国	小 計		130 (20)	933 (71)	— (10)	— (24)
	香 港	LINK REIT	千口 12	千香港ドル 851	千口 —	千香港ドル —
		小 計	12	851	—	—
	シンガポール	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	千口 —	千シンガポールドル —	千口 —	千シンガポールドル —
			(79)	(195)	—	—
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	43	143	—	—
			(6)	(15)	—	—
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	(110)	(224)
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	165	339	—	—
			(3)	(4)	—	—
	小 計	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	76	160	—	—
			(—)	(△0.7271)	—	—
	小 計		285 (89)	642 (215)	— (110)	— (224)

(注1)金額は受渡代金です。

(注2) ()内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<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	株 式 先 物 取 引	百万円 70,935	百万円 80,792	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) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	58,735,095千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	216,062,127千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.27

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為 替 先 物 取 引	11,991	11,991	100.0	11,967	11,967	100.0
為 替 直 物 取 引	43,601	43,601	100.0	33,568	33,568	100.0
金 銭 信 託	198	198	100.0	198	198	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	330,424	28,121	8.5	330,935	28,249	8.5

(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

〈外国株式(上場・登録株式)〉

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	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	
ABBOTT LABORATORIES	839	930		11,541	1,218,101	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	324	367		986	104,133	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	421	468		5,700	601,579	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	217	237		3,855	406,877	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	105	116		2,938	310,082	素材
ALLEGHANY CORP	6	7		467	49,362	保険
RALPH LAUREN CORPORATION	25	—		—	—	耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	157	164		1,753	185,096	保険
HONEYWELL INTL INC	344	368		7,484	789,892	資本財
HESS CORP	132	145		829	87,569	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	335	359		4,541	479,300	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	240	—		—	—	公益事業
AFLAC	354	355		1,616	170,612	保険
AMERICAN INT'L GROUP	415	452		1,885	199,024	保険
JONES LANG LASALLE INC	22	—		—	—	不動産
VALERO ENERGY CORP	198	223		1,378	145,534	エネルギー
APACHE CORP	171	—		—	—	エネルギー
ALBEMARLE CORP	49	58		925	97,701	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	268	303		1,620	170,986	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	49	60		468	49,491	公益事業
AMEREN CORPORATION	108	135		1,004	106,063	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	38	38		386	40,810	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	38	38		364	38,473	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	11	12		1,557	164,354	小売
AVERY DENNISON CORP	41	41		717	75,702	素材
BALL CORP	162	178		1,593	168,202	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	624	737		17,352	1,831,353	各種金融
BANK NEW YORK CO	405	418		1,759	185,737	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	232	265		2,055	216,935	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	128	152		3,879	409,392	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	103	125		1,469	155,117	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	1,962	2,178		12,051	1,271,934	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	62	77		508	53,689	保険
BEST BUY COMPANY INC	108	127		1,456	153,692	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	9	12		740	78,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	146	164		1,732	182,884	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	252	280		904	95,445	公益事業
BOEING CO	254	281		5,859	618,408	資本財
ROBERT HALF INTL INC	49	63		447	47,200	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	93	115		497	52,461	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	664	751		2,928	309,041	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	11	13		1,564	165,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,113	1,184		7,216	761,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	198	243		1,041	109,877	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	38	38		380	40,197	保険
UNITED RENTALS INC	37	37		1,002	105,814	資本財
SEMPRA ENERGY	131	151		1,918	202,435	公益事業
FEDEX CORP	119	130		3,335	352,005	運輸
AMPHENOL CORPORATION	142	161		2,092	220,838	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	149	169		1,262	133,231	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	186	186		327	34,515	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	79	97		462	48,838	食品・飲料・タバコ

銘柄	株数	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	80	88	2,011	212,291	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	134	153	833	87,926	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	267	284	5,492	579,626	資本財
LUMEN TECHNOLOGIES INC	432	517	632	66,764	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	1,515	1,604	22,145	2,337,193	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	109	134	1,115	117,748	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	179	192	3,925	414,263	ヘルスケア機器・サービス
CLOROX COMPANY	58	68	1,316	138,970	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	1,927	2,144	10,648	1,123,851	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	388	427	3,418	360,773	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE INC	—	32	670	70,753	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC	112	—	—	—	保険
COMERICA INC	77	—	—	—	銀行
NRG ENERGY INC	122	122	514	54,305	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	221	255	883	93,295	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	159	182	1,308	138,048	公益事業
CMS ENERGY CORP	126	157	903	95,338	公益事業
THE COOPER COS INC	24	29	1,134	119,704	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	364	416	1,558	164,449	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	73	73	333	35,156	素材
HEICO CORP-CLASS A	32	40	461	48,746	資本財
CUMMINS INC	72	77	1,781	187,992	資本財
DR HORTON INC	160	188	1,512	159,582	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	297	335	7,905	834,317	ヘルスケア機器・サービス
MOODY'S CORP	81	88	2,458	259,428	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	243	263	4,968	524,358	小売
DEERE&CO	142	156	4,837	510,576	資本財
MORGAN STANLEY	590	712	5,215	550,439	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	104	116	1,058	111,706	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	854	950	17,221	1,817,588	メディア・娯楽
DOVER CORP	68	76	926	97,754	資本財
OMNICOM GROUP	103	115	760	80,279	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	88	105	1,284	135,515	公益事業
DUKE ENERGY CORP	352	386	3,661	386,385	公益事業
FLOWSERVE CORP	58	—	—	—	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	53	71	947	100,039	消費者サービス
BANK OF AMERICA CORP	4,193	4,098	13,266	1,400,134	銀行
CITIGROUP	1,072	1,094	6,846	722,606	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	64	75	786	83,014	素材
EATON CORP	201	210	2,563	270,505	資本財
EATON VANCE CORP	52	—	—	—	各種金融
ECOLAB INC	123	134	2,871	303,054	素材
PERKINELMER INC	54	61	890	94,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SALESFORCE.COM INC	395	478	11,425	1,205,886	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	293	313	2,703	285,310	資本財
ATMOS ENERGY CORP	50	61	551	58,166	公益事業
ENTERGY CORP	95	109	1,060	111,977	公益事業
EOG RESOURCES INC	280	318	1,802	190,207	エネルギー
EQUIFAX INC	53	66	1,188	125,471	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER CO-CL A	105	118	3,221	340,009	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	2,006	2,222	11,099	1,171,492	エネルギー
FMC CORP	66	66	769	81,202	素材
NEXTERA ENERGY INC	229	1,029	8,605	908,201	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	18	20	663	70,070	各種金融
FAIR ISAAC CORP	—	15	743	78,433	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	百株	千米ドル	千円	
ASSURANT INC	24	32	440	46,539	保険
M & T BANK CORP	61	70	993	104,806	銀行
FRANKLIN RESOURCES INC	147	147	381	40,251	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	724	762	2,420	255,418	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	90	99	1,175	124,022	保険
GAP	102	—	—	—	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	117	128	2,034	214,736	資本財
GENERAL MILLS INC	289	330	1,898	200,325	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	65	77	786	82,992	小売
GARTNER INC	38	46	766	80,903	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	89	88	1,621	171,157	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	4,187	4,599	5,243	553,421	資本財
GRAINGER (WW) INC	20	24	919	96,992	資本財
HALLIBURTON CO	433	470	892	94,188	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	154	171	5,041	532,043	各種金融
HARLEY-DAVIDSON	74	—	—	—	自動車・自動車部品
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	106	113	2,076	219,143	資本財
HEICO CORP	22	22	290	30,653	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	71	80	1,183	124,953	食品・飲料・タバコ
HP INC	711	750	1,963	207,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	75	74	691	73,005	素材
JUNIPER NETWORKS INC	163	163	400	42,254	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP	75	—	—	—	エネルギー
UNUM GROUP	97	—	—	—	保険
HOME DEPOT	519	566	15,805	1,668,142	小売
HORMEL FOODS CORP	143	162	798	84,294	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	225	270	577	60,999	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	15	18	516	54,475	資本財
HUMANA INC	64	69	2,636	278,257	ヘルスケア機器・サービス
IDEX CORP	37	41	799	84,349	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	154	166	3,358	354,507	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	52	118	1,502	158,558	素材
INT'L PAPER CO	176	197	930	98,198	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	161	208	540	57,034	メディア・娯楽
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	67	67	721	76,138	資本財
JOHNSON & JOHNSON	1,251	1,386	22,806	2,406,989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	174	197	994	104,946	保険
DEVON ENERGY CORPORATION	208	320	572	60,453	エネルギー
KELLOGG CO	116	133	775	81,896	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	487	487	904	95,459	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	164	179	2,368	249,928	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	55	80	5,820	614,328	各種金融
KOHL'S CORP	75	—	—	—	小売
KROGER CO	385	408	1,354	142,902	食品・生活必需品小売り
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	15	18	727	76,787	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	42	50	677	71,453	素材
LEGGETT & PLATT INC	53	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	124	142	1,298	137,048	耐久消費財・アパレル
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	128	—	—	—	各種金融
LILLY (ELI) & CO	413	452	9,127	963,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	97	97	499	52,718	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	332	371	6,108	644,676	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	148	162	1,997	210,840	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	121	132	4,456	470,286	資本財
LOEWS CORP	125	125	598	63,145	保険

銘柄	柄	当期首(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	
		百株	百株	千米ドル	千円	
CARNIVAL CORPORATION		205	267	569	60,157	消費者サービス
LOWES COMPANIES		371	397	6,951	733,660	小売
DOMINION ENERGY INC		397	441	3,255	343,543	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL		242	252	863	91,167	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		59	135	1,221	128,930	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP		360	391	8,313	877,415	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		117	126	4,103	433,071	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD		17	21	470	49,645	保険
MANPOWER GROUP		28	—	—	—	商業・専門サービス
MARKEL CORP		6	6	768	81,113	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		99	326	2,779	293,370	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS		241	266	3,023	319,072	保険
MASCO CORP		130	145	818	86,388	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS		31	31	952	100,476	素材
METLIFE INC		380	405	2,130	224,874	保険
MEDTRONIC PLC		637	705	8,358	882,188	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP		618	687	4,963	523,881	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	1,214	1,329	10,076	1,063,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LABORATORY CRP OF AMER	45	51	1,162	122,682	ヘルスケア機器・サービス	
3 M COMPANY	276	302	5,418	571,901	資本財	
MOHAWK INDUSTRIES INC	28	28	431	45,554	耐久消費財・アパレル	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	79	93	1,693	178,782	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KANSAS CITY SOUTHERN	45	52	1,091	115,219	運輸	
FORD MOTOR COMPANY	1,877	2,052	2,362	249,311	自動車・自動車部品	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	170	—	—	—	エネルギー	
NEWMONT CORPORATION	375	421	2,501	264,034	素材	
NVR INC	1	1	901	95,091	耐久消費財・アパレル	
NIKE B	594	654	9,493	1,001,993	耐久消費財・アパレル	
NORDSTROM INC	51	—	—	—	小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	125	134	3,292	347,524	運輸	
EVERSOURCE ENERGY	155	183	1,614	170,427	公益事業	
NISOURCE INC	160	200	456	48,138	公益事業	
TAPESTRY INC	127	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
NORTHROP GRUMMAN CORP	76	83	2,486	262,396	資本財	
WELLS FARGO & CO	1,986	2,056	6,697	706,829	銀行	
NUCOR CORP	143	160	849	89,676	素材	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	224	239	2,746	289,816	各種金融	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	434	497	1,122	118,520	エネルギー	
OGE ENERGY CORP	87	109	343	36,242	公益事業	
ORACLE CORP	1,109	1,048	6,666	703,608	ソフトウェア・サービス	
PARKER HANNIFIN CORP	62	67	1,887	199,181	資本財	
PPL CORPORATION	347	421	1,174	123,935	公益事業	
PENTAIR PLC	70	91	505	53,383	資本財	
PERRIGO CO PLC	59	73	317	33,521	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PFIZER	2,624	2,920	10,198	1,076,367	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ESSENTIAL UTILITIES INC	92	113	547	57,831	公益事業	
CONOCOPHILLIPS	528	715	3,177	335,352	エネルギー	
PG&E CORP	—	764	906	95,655	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES	77	113	1,456	153,737	エネルギー	
ALTRIA GROUP INC	888	976	4,147	437,695	食品・飲料・タバコ	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	212	223	3,500	369,431	銀行	
BROWN & BROWN INC	102	126	564	59,620	保険	
POLARIS INC	29	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
PPG INDUSTRIES INC	113	123	1,736	183,272	素材	
QUEST DIAGNOSTICS	60	73	896	94,641	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル	千円	
PROCTER & GAMBLE CO	1,186	1,310	16,982	1,792,344	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	279	307	2,690	283,917	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	242	276	1,640	173,175	公益事業
PULTE GROUP INC	127	148	712	75,204	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	143	157	3,117	329,010	ソフトウェア・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	53	65	718	75,806	各種金融
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	21	27	442	46,686	保険
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	26	33	368	38,856	保険
RESMED INC	64	79	1,599	168,861	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	712	712	3,301	348,446	銀行
ROLLINS INC	71	107	402	42,444	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	49	55	2,227	235,104	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	53	63	1,538	162,369	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	86	95	683	72,168	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	55	69	600	63,354	素材
RAYTHEON COMPANY	132	—	—	—	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	21	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	302	334	8,477	894,700	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	124	132	1,926	203,278	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	291	325	4,305	454,392	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	666	759	1,898	200,395	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	563	803	4,477	472,600	各種金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	98	113	1,807	190,735	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	62	79	582	61,510	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	121	132	3,843	405,682	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	73	84	921	97,267	ヘルスケア機器・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	39	43	3,085	325,653	素材
CENTENE CORP	276	304	1,792	189,135	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	68	68	410	43,351	資本財
ACUITY BRANDS INC	15	—	—	—	資本財
SNAP-ON INC	23	28	519	54,853	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	192	207	1,662	175,496	保険
ADVANCE AUTO PARTS	32	38	601	63,492	小売
EDISON INTL	161	207	1,215	128,323	公益事業
SOUTHERN CO	504	554	3,378	356,544	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	638	708	3,730	393,750	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	115	125	1,877	198,164	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	60	80	402	42,517	運輸
AT&T INC	3,465	3,744	10,833	1,143,377	電気通信サービス
CHEVRON CORP	900	1,011	9,028	952,827	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	69	84	1,489	157,212	資本財
STATE STREET CORP	179	192	1,440	152,024	各種金融
STRYKER CORP	160	177	4,241	447,642	ヘルスケア機器・サービス
SYSCO CORP	233	253	1,955	206,418	食品・生活必需品小売り
TELEFLEX INC	22	24	976	103,026	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	568	568	695	73,448	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON	109	109	524	55,343	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	190	207	10,240	1,080,815	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	48	—	—	—	小売
GLOBE LIFE INC	45	55	516	54,554	保険
DAVITA INC	43	43	479	50,654	ヘルスケア機器・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	16	20	856	90,348	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	133	161	1,069	112,836	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	87	113	423	44,692	公益事業
MARATHON OIL CORP	381	—	—	—	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
UNION PACIFIC CORP	百株	百株	千米ドル	千円		
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	336	356	7,285	768,884	運輸	
UNITEDHEALTH GROUP INC	392	802	5,806	612,849	資本財	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	449	500	16,235	1,713,466	ヘルスケア機器・サービス	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	38	38	509	53,765	ヘルスケア機器・サービス	
VF CORP	40	48	852	90,014	ヘルスケア機器・サービス	
VULCAN MATERIALS CO	162	181	1,482	156,444	耐久消費財・アパレル	
WALMART INC	59	67	1,038	109,567	素材	
WASTE MANAGEMENT INC	677	744	10,743	1,133,875	食品・生活必需品小売り	
WATERS CORP	202	221	2,524	266,408	商業・専門サービス	
ALLERGAN PLC	32	32	921	97,205	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	156	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JM SMUCKER CO	31	40	1,175	124,072	ヘルスケア機器・サービス	
VAIL RESORTS INC	50	59	681	71,937	食品・飲料・タバコ	
WABTEC CORP	16	21	605	63,868	消費者サービス	
WEYERHAEUSER CO	89	99	804	84,876	資本財	
WHIRLPOOL CORP	341	408	1,405	148,359	不動産	
WILLIAMS COS	30	30	592	62,513	耐久消費財・アパレル	
WEC ENERGY GROUP INC	564	663	1,466	154,749	エネルギー	
CARMAX INC	151	172	1,496	157,951	公益事業	
TJX COMPANIES INC	76	89	1,127	119,018	小売	
CBRE GROUP INC-A	575	630	4,305	454,363	小売	
REGIONS FINL CORP	144	184	1,242	131,145	不動産	
DOMINO'S PIZZA INC	460	530	1,004	106,055	銀行	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	17	20	756	79,864	消費者サービス	
LAS VEGAS SANDS CORP	20	—	—	—	素材	
MOSAIC CO/THE	166	181	1,007	106,294	消費者サービス	
CELANESE CORP-SERIES A	147	200	553	58,372	素材	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	60	60	767	81,000	素材	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	84	103	505	53,352	食品・飲料・タバコ	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	103	103	447	47,255	素材	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	61	63	1,332	140,646	各種金融	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	267	285	3,257	343,820	各種金融	
LIVE NATION ENTERTAINMENT	71	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	74	89	666	70,345	メディア・娯楽	
TRANSDIGM GROUP INC	12	14	2,178	229,966	消費者サービス	
MASTERCARD INC-CLASS A	23	28	1,700	179,423	資本財	
HANESBRANDS INC	428	470	15,924	1,680,721	ソフトウェア・サービス	
WESTERN UNION CO	159	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
OWENS CORNING	203	203	468	49,423	ソフトウェア・サービス	
LEIDOS HOLDINGS	49	60	494	52,211	資本財	
AERCAP HOLDINGS NV	63	71	760	80,235	ソフトウェア・サービス	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	56	—	—	—	資本財	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	50	—	—	—	資本財	
DELTA AIR LINES INC	52	60	872	92,120	ソフトウェア・サービス	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	78	78	322	34,053	運輸	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	41	—	—	—	エネルギー	
TE CONNECTIVITY LTD	153	168	1,563	165,003	各種金融	
CONCHO RESOURCES INC	161	173	2,220	234,303	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WABCO HOLDINGS INC	90	—	—	—	エネルギー	
VMWARE INC-CLASS A	20	—	—	—	資本財	
INVESCO LTD	36	43	637	67,238	ソフトウェア・サービス	
MSCI INC	194	194	426	44,974	各種金融	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	38	43	1,888	199,275	各種金融	
VISA INC-CLASS A SHARES	739	818	6,897	727,959	食品・飲料・タバコ	
	818	887	18,532	1,955,877	ソフトウェア・サービス	

銘柄	当期首(前期末)	株数	当期		業種等
			株数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
		百株	千米ドル	千円	
AMERICAN WATER WORKS CO INC		87	1,634	172,479	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP		315	1,697	179,102	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC		67	674	71,215	資本財
KINDER MORGAN INC		974	1,574	166,159	エネルギー
XYLEM INC		80	911	96,240	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A		129	1,366	144,254	素材
PVH CORP		34	—	—	耐久消費財・アパレル
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC		19	326	34,474	資本財
EPAM SYSTEMS INC		23	1,087	114,761	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC		130	2,511	265,061	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		41	1,182	124,754	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		81	1,465	154,654	銀行
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS		60	625	65,992	ソフトウェア・サービス
TARGA RESOURCES CORP		115	—	—	エネルギー
LEAR CORP		29	465	49,120	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP		123	2,535	267,643	小売
GENERAC HOLDINGS INC		—	891	94,066	資本財
GENERAL MOTORS CO		614	3,681	388,590	自動車・自動車部品
XPO LOGISTICS INC		39	589	62,249	運輸
ALLY FINANCIAL INC		181	754	79,671	各種金融
CAPRI HOLDINGS LTD		67	—	—	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC		124	2,159	227,905	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66		214	1,721	181,638	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC		35	540	57,040	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC		28	—	—	食品・飲料・タバコ
IQVIA HOLDINGS INC		75	1,941	204,875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SERVENOW INC		89	5,944	627,380	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC		46	2,005	211,631	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC		702	10,085	1,064,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC		227	3,976	419,705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		94	—	—	消費者サービス
COTY INC-CL A		157	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SPRINT CORP		398	—	—	電気通信サービス
IHS MARKIT LTD		183	1,768	186,651	商業・専門サービス
HOWMET AEROSPACE INC		182	494	52,189	資本財
TWILIO INC - A		55	2,671	281,918	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A		353	3,098	327,036	メディア・娯楽
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		73	—	—	耐久消費財・アパレル
BLACK KNIGHT INC		63	687	72,524	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO		306	771	81,374	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC		67	624	65,890	食品・飲料・タバコ
ALTICE USA INC- A		64	456	48,212	メディア・娯楽
TECHNIPFMC PLC		198	—	—	エネルギー
RINGCENTRAL INC-CLASS A		30	1,631	172,191	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION		70	288	30,452	運輸
BURLINGTON STORES INC		31	898	94,857	小売
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		151	589	62,234	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		63	2,114	223,130	ヘルスケア機器・サービス
TWITTER INC		339	2,433	256,781	メディア・娯楽
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		76	401	42,418	資本財
EVERGY INC		111	687	72,564	公益事業
ALLEGION PLC		46	527	55,699	資本財
CERIDIAN HCM HOLDING INC		—	709	74,839	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC		41	857	90,516	ヘルスケア機器・サービス
KKR & CO INC		214	1,232	130,070	各種金融

銘 柄	当期首(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		
	百株	百株	千米ドル	千円	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	130	151	1,694	178,788	消費者サービス
ARAMARK	116	116	427	45,084	消費者サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	78	132	1,054	111,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOW INC	355	389	2,228	235,186	素材
AMCOR PLC	716	864	991	104,669	素材
PINTEREST INC- CLASS A	57	242	1,991	210,179	メディア・娯楽
XEROX HOLDINGS CORP	90	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHEWY INC - CLASS A	—	39	436	46,113	小売
AVANTOR INC	—	271	811	85,595	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DYNATRACE INC	—	87	486	51,391	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	80	691	72,989	ソフトウェア・サービス
CARRIER GLOBAL CORP	—	432	1,691	178,559	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	—	225	1,438	151,831	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	71	506	2,966	313,083	運輸
CORTEVA INC	378	409	1,799	189,956	素材
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	211	913	96,382	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	316	352	2,497	263,537	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	93	473	49,972	各種金融
VOYA FINANCIAL INC	63	63	369	38,979	各種金融
GRUBHUB INC	45	—	—	—	小売
INGERSOLL-RAND INC	—	195	855	90,276	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	21	26	1,142	120,572	ソフトウェア・サービス
AON PLC	—	121	2,716	286,708	保険
ZENDESK INC	—	60	956	100,985	ソフトウェア・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	16	489	51,680	ソフトウェア・サービス
ARISTA NETWORKS INC	28	28	924	97,608	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FNFG GROUP	122	148	576	60,804	保険
CATALANT INC	—	83	943	99,546	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	281	281	1,049	110,790	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	202	235	942	99,471	銀行
WAYFAIR INC- CLASS A	26	35	1,020	107,658	小売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	83	95	1,371	144,698	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	—	22	943	99,551	ソフトウェア・サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	99	—	—	—	電気通信サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	108	108	300	31,747	素材
GODADDY INC - CLASS A	87	87	761	80,351	ソフトウェア・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	158	—	—	—	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	381	390	1,994	210,550	資本財
TRANSUNION	92	99	932	98,439	商業・専門サービス
SQUARE INC - A	153	197	4,750	501,330	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	356	282	2,146	226,501	素材
CARVANA CO	—	32	944	99,688	小売
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	109	109	556	58,771	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	—	62	1,780	187,952	ヘルスケア機器・サービス
WESTROCK CO	110	138	595	62,866	素材
FORTIVE CORP	146	166	1,144	120,761	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	118	143	1,422	150,147	商業・専門サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	631	708	930	98,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EQUITABLE HOLDINGS INC	180	222	594	62,782	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	122	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CABLE ONE INC	—	2	509	53,788	メディア・娯楽
LINDE PLC	257	276	7,105	749,965	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	65	65	289	30,572	保険
AVALARA INC	—	40	689	72,811	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	183	236	496	52,436	公益事業

銘柄	当期首(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	
	百株	百株	千米ドル 千円	
CHENIERE ENERGY INC	112	112	747 78,938	エネルギー
AMAZON.COM	199	224	75,306 7,947,800	小売
ABIOMED INC	18	24	812 85,707	ヘルスケア機器・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	492	616	5,423 572,370	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	230	252	12,406 1,309,417	ソフトウェア・サービス
AMGEN	284	307	7,274 767,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN ELECTRIC POWER	—	260	2,142 226,079	公益事業
AMERCO	3	5	268 28,361	運輸
ANALOG DEVICES	176	193	2,885 304,504	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	108	115	1,771 186,960	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	2,152	2,398	12,257 1,293,624	メディア・娯楽
ANSYS INC	40	46	1,775 187,355	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	2,140	9,026	123,452 13,029,155	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	440	479	4,832 510,071	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	105	115	3,522 371,774	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	206	225	3,779 398,873	ソフトウェア・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	62	72	640 67,564	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	51	59	1,234 130,296	メディア・娯楽
VERISIGN INC	51	56	1,136 119,942	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	700	604	368 38,918	メディア・娯楽
CSX CORP	361	401	3,559 375,682	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	117	117	817 86,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	55	56	671 70,843	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	57	61	809 85,407	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	153	166	1,330 140,465	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	69	79	690 72,881	保険
CINTAS CORP	39	46	1,594 168,246	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	2,031	2,219	10,669 1,126,057	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COPART INC	93	115	1,382 145,862	商業・専門サービス
COGNEX CORP	81	92	801 84,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARRIOTT INTL A	133	144	1,874 197,860	消費者サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	252	284	2,122 223,962	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	17	20	1,878 198,216	商業・専門サービス
DOLLAR TREE INC	106	129	1,372 144,902	小売
EBAY	371	367	2,287 241,430	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	108	—	—	各種金融
CADENCE DESIGN SYSTEMS	126	146	1,988 209,854	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	126	126	393 41,513	メディア・娯楽
ELECTRONIC ARTS INC	141	151	2,142 226,084	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	14	371 39,247	保険
EXPEDITORS INTL WASH INC	74	91	851 89,830	運輸
FASTENAL CO	258	313	1,481 156,315	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	341	375	1,206 127,335	銀行
FISERV INC	275	299	3,356 354,221	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	55	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	218	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	102	118	657 69,371	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	602	658	4,509 475,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP	274	324	17,657 1,863,564	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	63	72	700 73,983	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	68	79	555 58,671	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	27	32	652 68,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	130	130	1,080 114,013	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	88	94	806 85,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	39	45	658 69,492	運輸

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
HUNTINGTON BANCSHARES INC		百株	百株	千米ドル	千円	銀行
BIOGEN INC		495	495	696	73,522	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC		88	83	2,204	232,661	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC		123	137	5,336	563,168	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC		39	44	2,245	237,021	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP		66	66	400	42,269	半導体・半導体製造装置
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		2,101	2,235	13,004	1,372,532	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP		37	42	646	68,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP		89	97	875	92,439	半導体・半導体製造装置
EAST WEST BANCORP INC		76	81	2,352	248,235	銀行
LAM RESEARCH CORP		64	—	—	—	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC		69	76	3,900	411,678	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		75	84	968	102,191	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC		126	146	1,305	137,776	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP		366	405	4,120	434,897	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP		190	227	874	92,341	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY		3,436	3,794	91,896	9,698,730	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP		526	583	4,734	499,657	資本財
MICROCHIP TECHNOLOGY INC		21	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP		114	134	1,950	205,901	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV		304	363	1,821	192,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC		231	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC		70	76	3,289	347,199	公益事業
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC		247	275	1,750	184,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC		37	47	546	57,707	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC		108	108	730	77,107	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC		203	203	532	56,233	エネルギー
NORDSON CORP		208	—	—	—	資本財
NORTHERN TRUST CORP		—	29	553	58,435	各種金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE		91	102	997	105,301	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		27	51	1,084	114,439	小売
PACCAR INC		36	38	1,743	184,045	資本財
EXELON CORP		166	188	1,824	192,546	公益事業
PAYCHEX INC		464	511	2,235	235,985	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC		155	176	1,619	170,870	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC		33	39	2,439	257,476	食品・飲料・タバコ
GARMIN LTD		663	727	10,258	1,082,652	耐久消費財・アパレル
IPG PHOTONICS CORP		61	76	914	96,542	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP		17	17	424	44,842	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC		208	232	8,241	869,831	各種金融
QUALCOMM		113	119	1,905	201,143	半導体・半導体製造装置
EXACT SCIENCES CORP		578	592	8,648	912,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGENERON PHARMACEUTICALS		63	83	1,204	127,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEAGEN INC		38	54	2,739	289,168	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD		51	62	1,186	125,187	保険
ROSS STORES INC		196	223	756	79,842	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A		174	186	2,219	234,255	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC		686	750	4,218	445,256	保険
BOOKING HOLDINGS INC		59	70	1,576	166,365	小売
POOL CORP		20	21	4,511	476,143	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY		—	21	755	79,713	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		62	62	351	37,116	保険
SVB FINANCIAL GROUP		129	146	771	81,426	銀行
IAC/INTERACTIVECORP		23	27	1,353	142,893	メディア・娯楽
STARBUCKS CORP		37	—	—	—	消費者サービス
		569	614	6,541	690,389	

銘柄	当期首(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	
		百株	百株	千米ドル	千円	
STEEL DYNAMICS INC		91	117	442	46,684	素材
NETFLIX INC		207	231	12,766	1,347,403	メディア・娯楽
NORTONLIFELOCK INC		300	300	633	66,820	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC		72	82	2,246	237,114	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC		54	61	4,687	494,754	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC		72	91	1,151	121,553	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS		443	481	8,180	863,326	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY		55	63	962	101,564	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS		109	133	962	101,604	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VIACOMCBS INC-CLASS B		271	309	1,673	176,667	メディア・娯楽
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		122	136	2,945	310,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		366	386	1,926	203,333	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP		134	152	908	95,854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC		83	91	1,633	172,451	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD		43	52	609	64,328	消費者サービス
NASDAQ INC		55	63	900	95,079	各種金融
CME GROUP INC		170	188	3,606	380,615	各種金融
LKQ CORP		131	157	597	63,060	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION		102	126	629	66,394	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP		127	—	—	—	各種金融
XILINX INC		121	133	1,815	191,617	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A		25	29	1,189	125,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION		82	—	—	—	銀行
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		54	59	982	103,717	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK		28	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-A		78	78	192	20,348	電気通信サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC		—	22	804	84,915	半導体・半導体製造装置
MARKETAXESS HOLDINGS INC		16	19	1,129	119,157	各種金融
DEXCOM INC		40	50	2,070	218,505	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY INC - A		78	78	336	35,513	メディア・娯楽
EXPEDIA GROUP INC		64	74	1,055	111,447	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-C		182	188	459	48,531	電気通信サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC		26	—	—	—	運輸
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR		105	105	182	19,269	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC		226	—	—	—	銀行
INSULET CORP		25	36	1,013	106,947	ヘルスケア機器・サービス
MASIMO CORP		—	27	711	75,133	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC		53	64	2,170	229,111	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC		20	23	4,509	475,935	小売
ULTA BEAUTY INC		25	29	891	94,130	小売
DISCOVERY INC-C		183	183	667	70,490	メディア・娯楽
SPLUNK INC		72	86	1,475	155,757	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC		70	84	1,579	166,657	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		26	26	417	44,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV		133	146	2,669	281,731	半導体・半導体製造装置
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		111	127	882	93,095	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC		70	75	1,173	123,808	ソフトウェア・サービス
TESLA INC		64	392	33,481	3,533,643	自動車・自動車部品
ENPHASE ENERGY INC		—	62	1,213	128,071	半導体・半導体製造装置
TRIPADVISOR INC		42	—	—	—	メディア・娯楽
FACEBOOK INC-A	1,140	1,267	33,986	3,586,906	メディア・娯楽	
DIAMONDBACK ENERGY INC		71	—	—	—	エネルギー
SAREPTA THERAPEUTICS INC		31	40	384	40,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORKDAY INC-CLASS A		78	94	2,504	264,309	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC		164	292	3,666	386,982	電気通信サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
PTC INC	百株	百株	千米ドル	千円		ソフトウェア・サービス
NEWS CORP-CLASS A	53	53	768	81,057		メディア・娯楽
HD SUPPLY HOLDINGS INC	167	218	464	49,003		資本財
CDW CORP/DE	77	—	—	—		テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	68	75	1,139	120,249		運輸
KEURIG DR PEPPER INC	41	—	—	—		食品・飲料・タバコ
COUPA SOFTWARE INC	—	295	960	101,410		ソフトウェア・サービス
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	36	1,280	135,175		ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	22	1,917	202,324		メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A	98	98	438	46,247		メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	31	31	137	14,517		メディア・娯楽
OKTA INC	69	79	339	35,786		ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	52	63	1,797	189,710		半導体・半導体製造装置
MONGODB INC	189	211	9,850	1,039,623		ソフトウェア・サービス
DOCUSIGN INC	21	24	1,002	105,788		ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	45	91	2,292	241,991		ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	20	30	834	88,037		ソフトウェア・サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	84	165	409	43,269		ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	—	90	3,814	402,537		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	149	2,635	278,112		耐久消費財・アパレル
FOX CORP - CLASS A	—	107	1,596	168,442		メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	158	184	579	61,188		メディア・娯楽
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	65	94	286	30,229		ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	78	1,748	184,507		各種金融
CARLYLE GROUP INC/THE	—	45	293	31,021		各種金融
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	78	287	30,380		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DATADOG INC - CLASS A	—	32	596	62,975		ソフトウェア・サービス
PPD INC	—	73	838	88,535		ソフトウェア・サービス
SABRE CORP	—	63	226	23,912		ソフトウェア・サービス
IAC/INTERACTIVECORP	138	—	—	—		メディア・娯楽
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	43	1,089	114,979		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIATRIS INC	—	59	279	29,494		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DRAFTKINGS INC - CL A	—	652	1,167	123,218		消費者サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	89	569	60,108		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	115	985	103,981		ソフトウェア・サービス
CDK GLOBAL INC	13	21	340	35,929		ソフトウェア・サービス
QORVO INC	51	—	—	—		半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-A	56	63	1,055	111,378		メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	—	14	212	22,439		メディア・娯楽
ZILLOW GROUP INC-A	52	86	1,291	136,343		メディア・娯楽
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	31	514	54,269		半導体・半導体製造装置
ETSY INC	—	26	810	85,525		小売
KRAFT HEINZ CO/THE	—	62	1,447	152,745		食品・飲料・タバコ
NOVOCURE LTD	324	368	1,243	131,282		ヘルスケア機器・サービス
MATCH GROUP INC	—	45	792	83,590		メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	23	134	2,149	226,849		メディア・娯楽
PAYPAL HOLDINGS INC	142	158	33,091	3,492,449		ソフトウェア・サービス
SUNRUN INC	531	586	15,805	1,668,125		資本財
ZILLOW GROUP INC-C	—	64	480	50,713		メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	50	70	1,101	116,265		メディア・娯楽
BEIGENE LTD-ADR	148	158	33,207	3,504,681		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZSCALER INC	17	—	—	—		ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	—	39	860	90,806		食品・飲料・タバコ
ROKU INC	196	215	1,964	207,312		メディア・娯楽
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	40	55	2,457	259,335		メディア・娯楽
	73	75	4,655	491,377		メディア・娯楽

銘柄	柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		百株 170	百株 —	千米ドル —	千円 —	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		474	643	291	30,809	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		95	115	665	70,273	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		94	94	241	25,486	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC		50	58	527	55,654	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	142,305	165,172	1,818,739	191,949,780	
	銘柄数<比率>	609	593	—	<69.2%>	
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
AGNICO EAGLE MINES		110	126	1,143	94,556	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		420	470	1,867	154,417	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP		859	932	2,659	219,925	素材
ATCO LTD -CLASS I		43	43	163	13,515	公益事業
BANK MONTREAL		305	337	3,301	272,928	銀行
BANK NOVA SCOTIA		587	636	4,451	368,061	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA		162	184	1,348	111,476	銀行
BCE INC		76	76	424	35,138	電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC, CLASS-A		432	674	3,519	291,016	各種金融
BAUSCH HEALTH COS INC		145	145	521	43,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER B	1,044	—	—	—	—	資本財
SAPUTO INC		107	139	513	42,419	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LIMITED		250	250	423	35,037	ソフトウェア・サービス
CGI INC - CL A		109	126	1,297	107,307	ソフトウェア・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B		73	73	457	37,841	素材
CAE INC		119	119	382	31,629	資本財
CAMECO CORP		191	191	343	28,363	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B		175	195	1,158	95,782	電気通信サービス
CANADIAN IMPERIAL BANK		213	234	2,642	218,515	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES		568	619	1,998	165,266	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A		25	32	569	47,053	小売
CANADIAN UTILITIES LTD A		59	59	187	15,539	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO		342	372	5,048	417,428	運輸
YAMANA GOLD INC		—	570	357	29,528	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC		100	100	344	28,508	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP		132	150	937	77,493	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'		73	73	267	22,126	食品・生活必需品小売り
RITCHIE BROS AUCTIONEERS		—	56	427	35,334	商業・専門サービス
FORTIS INC		197	255	1,318	108,991	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		326	332	790	65,385	素材
TELUUS CORP		115	231	624	51,612	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC		115	158	475	39,276	保険
IMPERIAL OIL		116	116	300	24,850	エネルギー
ENBRIDGE		963	1,063	4,775	394,846	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		38	38	140	11,623	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		937	1,017	2,452	202,786	保険
LOBLAW COMPANIES LTD		90	90	562	46,499	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC		144	144	1,408	116,415	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC		267	320	1,953	161,490	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		11	13	653	54,046	保険
METRO INC		116	134	735	60,771	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC		127	—	—	—	エネルギー
EMERA INC		117	136	706	58,440	公益事業
METHANEX CORP		29	—	—	—	素材
ONEX CORP		31	48	352	29,155	各種金融
TC ENERGY CORP		443	493	2,720	224,925	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP		—	123	507	41,921	素材

銘 柄	当期首(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	
		百株	百株	千カナダドル	千円	
POWER CORP OF CANADA		135	310	948	78,455	保険
POWER FINANCIAL CORP		125	—	—	—	保険
QUEBECOR INC -CL B		112	112	353	29,188	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA		686	747	7,975	659,414	銀行
CP RAILWAY LIMITED		63	71	3,232	267,275	運輸
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		214	266	602	49,818	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY		744	837	1,847	152,735	エネルギー
LUNDIN MINING CORP		301	301	366	30,335	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B		215	283	663	54,839	素材
THOMSON REUTERS CORP		90	96	1,032	85,385	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		—	42	380	31,494	資本財
TORONTO-DOMINION BANK		873	947	7,065	584,145	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD		26	45	396	32,819	素材
WESTON (GEORGE) LTD		37	37	351	29,079	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP		601	698	648	53,631	素材
INTACT FINANCIAL CORP		66	78	1,153	95,367	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		200	234	1,218	100,726	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC		9	11	1,759	145,486	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		86	104	1,608	132,983	素材
B2GOLD CORP		—	614	395	32,663	素材
CI FINANCIAL CORP		98	98	175	14,520	各種金融
KEYERA CORP		109	109	283	23,430	エネルギー
PARKLAND CORP		53	85	334	27,656	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD		145	145	287	23,763	公益事業
PEMBINA PIPELINE CORP		264	304	1,076	89,013	エネルギー
DOLLARAMA INC		129	160	808	66,867	小売
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		260	330	738	61,049	公益事業
CENOVUS ENERGY INC		501	501	407	33,713	エネルギー
NORTHLAND POWER INC		—	99	503	41,651	公益事業
TMX GROUP LTD		—	33	417	34,531	各種金融
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		129	145	713	58,999	素材
INTER PIPELINE LTD		188	188	249	20,625	エネルギー
STARS GROUP INC/THE		91	—	—	—	消費者サービス
NUTRIEN LTD		275	298	2,041	168,754	素材
CRONOS GROUP INC		82	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SSR MINING INC		—	120	263	21,817	素材
WSP GLOBAL INC		54	54	634	52,487	資本財
IA FINANCIAL CORP INC		54	54	323	26,719	保険
FIRSTSERVICE CORP		—	20	368	30,458	不動産
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT		—	97	386	31,967	商業・専門サービス
OVINTIV INC		112	—	—	—	エネルギー
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A		—	62	452	37,377	公益事業
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		97	—	—	—	エネルギー
AIR CANADA		67	67	147	12,181	運輸
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		129	157	1,198	99,054	消費者サービス
AURORA CANNABIS INC		300	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHOPIFY INC - CLASS A		48	56	9,348	772,940	ソフトウェア・サービス
CANOPY GROWTH CORP		88	137	752	62,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYDRO ONE LTD		147	185	543	44,973	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	18,941	21,069	111,695	9,235,020	
	銘 柄 数 <比率>	85	87	—	<3.3%>	
(ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG		86	100	2,787	354,125	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG		467	559	314	40,006	銀行
PRESENIUS SE&CO KGAA		187	230	808	102,677	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	58	58	218	27,788	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	32	32	158	20,071	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	29	29	410	52,165	保険
GEA GROUP AG	76	76	231	29,399	資本財
CONTINENTAL AG	48	57	717	91,095	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	485	519	2,194	278,778	運輸
MERCK KGAA	61	68	959	121,916	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM	284	353	1,280	162,668	公益事業
SAP SE	467	548	5,953	756,267	ソフトウェア・サービス
E. ON SE	1,085	1,234	1,087	138,080	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	45	56	436	55,502	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	34	46	394	50,069	耐久消費財・アパレル
BAYER	444	516	2,880	365,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	79	98	858	109,058	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	438	482	3,224	409,637	素材
BEIERSDORF AG	47	56	523	66,553	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	9	9	80	10,287	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	67	83	517	65,740	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	95	111	634	80,596	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	202	219	4,290	545,032	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	97	180	200	25,504	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.	69	73	1,720	218,537	保険
VOLKSWAGEN STAMM	16	16	300	38,200	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD	89	97	1,581	200,842	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	434	449	3,013	382,729	自動車・自動車部品
NEMETSCHEK SE	—	33	197	25,028	ソフトウェア・サービス
THYSSEN KRUPP	189	—	—	—	素材
SIEMENS	367	402	5,359	680,792	資本財
DEUTSCHE BANK NAMEN	874	1,085	931	118,287	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	159	173	1,218	154,794	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	25	25	142	18,103	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM	1,592	1,751	2,638	335,184	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	17	19	916	116,401	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES	602	685	2,337	296,968	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	—	2	221	28,186	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	20	20	289	36,732	ヘルスケア機器・サービス
BECHTLE AG	—	14	246	31,285	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE	91	99	1,359	172,661	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	71	86	525	66,694	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	19	—	—	—	運輸
WIRECARD AG	52	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS	39	39	245	31,207	素材
MTU AERO ENGINES AG	24	28	586	74,474	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	161	188	782	99,454	不動産
SYMRISE AG	63	71	712	90,470	素材
BRENTNAG AG	70	84	553	70,307	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	96	96	263	33,421	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	408	408	92	11,802	電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN AG	—	37	454	57,793	不動産
KION GROUP AG	34	34	251	31,970	資本財
VONOVIA SE	254	282	1,562	198,432	不動産
KNORR-BREMSE AG	17	39	431	54,831	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	62	146	721	91,609	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	88	—	—	—	食品・生活必需品小売り

銘柄		当期首(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	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
TEAMVIEWER AG		—	72	323	41,045	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG		—	208	644	81,890	資本財
ZALANDO SE		70	81	798	101,455	小売
SCOUT24 AG		—	58	382	48,546	メディア・娯楽
COVESTRO AG		83	96	562	71,479	素材
HELLOFRESH SE		—	77	572	72,656	小売
UNIPER SE		89	115	350	44,489	公益事業
DELIVERY HERO SE		48	68	905	114,995	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	11,242	13,006	65,365	8,302,727	
	銘柄数<比率>	57	61	—	<3.0%>	
(イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI		512	574	892	113,355	保険
INTESA SANPAOLO		7,185	8,703	1,793	227,835	銀行
UNICREDIT SPA		976	1,119	946	120,276	銀行
MEDIOBANCA		294	294	241	30,670	銀行
LEONARDO SPA		220	—	—	—	資本財
ENEL		3,896	4,277	3,613	458,971	公益事業
ENI		1,227	1,339	1,153	146,518	エネルギー
SNAM SPA		910	1,088	487	61,944	公益事業
TELECOM ITALIA ORD		4,897	4,897	186	23,726	電気通信サービス
TELECOM ITALIA RNC		3,452	3,452	145	18,486	電気通信サービス
ATLANTIA SPA		213	260	414	52,623	運輸
TERNA SPA		666	815	504	64,135	公益事業
RECORDATI SPA		51	51	233	29,614	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA		—	66	239	30,400	ヘルスケア機器・サービス
PRYSMIAN SPA		112	112	317	40,358	資本財
DIASORIN SPA		—	14	253	32,258	ヘルスケア機器・サービス
MONCLER SPA		73	99	506	64,338	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA		—	197	316	40,167	ソフトウェア・サービス
FINECOBANK SPA		282	355	518	65,882	銀行
POSTE ITALIANE SPA		257	257	237	30,188	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		—	148	134	17,111	電気通信サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		266	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA		205	—	—	—	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	25,703	28,126	13,138	1,668,862	
	銘柄数<比率>	19	20	—	<0.6%>	
(フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BOUYGUES ORD		113	113	383	48,717	資本財
AIR LIQUIDE		226	248	3,391	430,792	素材
VEOLIA ENVIRONNEMENT		248	300	688	87,423	公益事業
LOREAL		120	132	4,043	513,591	家庭用品・パーソナル用品
LVMH		132	145	7,715	980,066	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA		1	1	108	13,794	資本財
THALES SA		46	60	468	59,467	資本財
CAPGEMINI SA		71	88	1,137	144,462	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		32	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP		33	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE		91	118	551	70,030	メディア・娯楽
FAURECIA		35	35	155	19,803	自動車・自動車部品
BOLLORE		372	372	132	16,830	メディア・娯楽
MICHELIN		77	93	1,105	140,441	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD		97	110	1,797	228,337	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		85	108	436	55,381	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU		10	10	161	20,470	食品・飲料・タバコ

銘 柄	当期首(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	
		百株	百株	千ユーロ	千円	
SEB SA	11	11	195	24,825	24,825	耐久消費財・アパレル
VINCI S.A.	245	273	2,353	298,938	298,938	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	252	283	3,528	448,211	448,211	資本財
VIVENDI	418	456	1,183	150,388	150,388	メディア・娯楽
TOTAL SE	1,141	1,324	4,646	590,215	590,215	エネルギー
VALEO SA	105	130	431	54,825	54,825	自動車・自動車部品
ORANGE	969	1,099	1,082	137,474	137,474	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	15	16	1,500	190,580	190,580	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	64	72	1,327	168,642	168,642	ソフトウェア・サービス
KERING	36	39	2,187	277,820	277,820	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES	84	84	114	14,489	14,489	保険
CARREFOUR	308	308	446	56,705	56,705	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	41	53	352	44,742	44,742	ソフトウェア・サービス
SANOFI	536	595	4,765	605,320	605,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR	78	108	344	43,773	43,773	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	392	451	775	98,521	98,521	銀行
TELEPERFORMANCE	26	30	859	109,158	109,158	商業・専門サービス
EURAZEO SA	23	23	142	18,130	18,130	各種金融
SODEXO	37	50	381	48,497	48,497	消費者サービス
AXA SA	926	1,016	1,952	248,034	248,034	保険
PEUGEOT SA	260	—	—	—	—	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA	37	—	—	—	—	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA	135	149	1,925	244,538	244,538	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA	516	594	602	76,558	76,558	銀行
BNP PARIBAS	538	591	2,577	327,439	327,439	銀行
ORPEA	—	29	336	42,755	42,755	ヘルスケア機器・サービス
SAINT-GOBAIN	226	285	1,212	154,068	154,068	資本財
WENDEL	10	10	104	13,265	13,265	各種金融
ILIAD SA	6	6	96	12,258	12,258	電気通信サービス
DANONE (GROUPE)	296	324	1,732	220,120	220,120	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	156	168	1,890	240,097	240,097	資本財
ENGIE	885	1,004	1,345	170,955	170,955	公益事業
ALSTOM	96	125	538	68,406	68,406	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS	86	—	—	—	—	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE	244	328	353	44,860	44,860	公益事業
IPSEN	18	18	140	17,906	17,906	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	34	34	305	38,798	38,798	素材
LEGRAND SA	120	147	1,138	144,569	144,569	資本財
EIFFAGE	37	46	383	48,743	48,743	資本財
ADP	15	15	159	20,276	20,276	運輸
NATIXIS	407	407	141	17,918	17,918	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT	34	49	420	53,396	53,396	メディア・娯楽
SCOR SE	65	93	248	31,594	31,594	保険
BUREAU VERITAS SA	133	167	378	48,033	48,033	商業・専門サービス
GETLINK	186	249	341	43,363	43,363	運輸
SUEZ	171	171	296	37,695	37,695	公益事業
EDENRED	101	126	600	76,268	76,268	ソフトウェア・サービス
BIOMERIEUX	18	23	308	39,200	39,200	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	53	197	25,025	25,025	消費者サービス
WORLDLINE SA	43	130	976	124,040	124,040	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	12	15	599	76,090	76,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	28	28	181	23,038	23,038	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額	12,440	13,768	70,384	8,940,198	
	銘 柄 数 <比 率>	67	64	—	<3.2%>	

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE		282	309	2,887	366,831	資本財
RANDSTAD NV		58	58	316	40,235	商業・専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD NV		566	581	1,357	172,393	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL		109	107	926	117,746	素材
WOLTERS KLUWER		127	142	976	124,073	商業・専門サービス
QIAGEN N.V.		110	110	497	63,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KONINKLIJKE DSM NV		86	95	1,404	178,361	素材
VOPAK		36	36	156	19,833	エネルギー
AEGON		763	1,070	388	49,324	保険
ASML HOLDING NV		202	223	10,300	1,308,405	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)		1,738	1,738	465	59,074	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS		354	351	1,185	150,618	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS		431	480	2,261	287,254	ヘルスケア機器・サービス
ING GROEP NV-CVA		1,916	2,057	1,598	202,985	銀行
HEINEKEN NV		124	136	1,242	157,845	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV		49	60	470	59,742	食品・飲料・タバコ
UNILEVER NV		697	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
FERRARI NV		59	66	1,115	141,734	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV		431	542	641	81,520	資本財
PROSUS		232	256	2,570	326,452	小売
JDE PEET' S BV		—	41	135	17,182	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		—	266	257	32,724	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV		142	163	580	73,685	保険
ARGENX SE		—	22	677	86,118	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STELLANTIS NV		507	1,050	1,404	178,366	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY		55	65	592	75,305	小売
ABN AMRO BANK NV-CVA		197	197	168	21,449	銀行
EXOR NV		43	58	400	50,820	各種金融
ALTICE NV -A		276	—	—	—	電気通信サービス
ADYEN NV		5	9	1,807	229,555	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	9,605	10,302	36,788	4,672,815	
	銘 柄 数 <比 率>	27	28	—	<1.7%>	
(スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA		2,946	3,158	3,553	451,401	公益事業
ENDESA		123	171	368	46,802	公益事業
BANKINTER SA		244	—	—	—	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA		3,264	3,468	1,533	194,794	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		141	141	300	38,221	公益事業
REPSOL SA		653	816	711	90,359	エネルギー
BANCO SANTANDER SA		7,989	9,144	2,549	323,848	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		173	232	357	45,347	公益事業
TELEFONICA		2,218	2,653	1,008	128,127	電気通信サービス
INDITEX		537	568	1,485	188,696	小売
ENAGAS		119	119	214	27,202	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		123	123	414	52,666	資本財
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS		107	145	384	48,777	資本財
GRIFOLS SA		142	142	336	42,723	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERROVIAL SA		261	278	599	76,113	資本財
MAPFRE SA		564	—	—	—	保険
BANCO DE SABADELL SA		2,910	—	—	—	銀行
CAIXABANK		1,525	1,909	418	53,164	銀行
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		204	234	1,317	167,403	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		595	—	—	—	銀行
ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS		—	145	6	765	資本財
IBERDROLA SA-RTS		—	3,158	53	6,853	公益事業

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
			株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
					外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
AENA SME SA			百株	百株	千ユーロ	千円	運輸 電気通信サービス
			35	35	478	60,817	
CELLNEX TELECOM SA			119	163	791	100,571	
小 計	株 数 ・ 金 額		25,003	26,812	16,884	2,144,657	
	銘柄数<比率>		22	20	—	<0.8%>	
(ベルギー)			百株	百株	千ユーロ	千円	素材 銀行 各種金融 素材 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 食品・生活必需品小売り 各種金融 保険 電気通信サービス 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス 公益事業 メディア・娯楽 食品・飲料・タバコ
UMICORE			99	99	467	59,440	
KBC GROEP NV			120	133	812	103,200	
SOFINA			—	7	221	28,130	
SOLVAY SA			36	36	347	44,096	
UCB (GROUPE)			62	67	595	75,631	
COLRUYT SA			22	22	113	14,433	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA			37	55	477	60,593	
AGEAS			76	86	391	49,769	
PROXIMUS			75	75	130	16,582	
GALAPAGOS NV			18	23	208	26,470	
ELIA GROUP SA/NV			—	19	198	25,231	
TELENET GROUP HOLDING NV			28	—	—	—	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV			363	402	2,205	280,156	
小 計	株 数 ・ 金 額		940	1,030	6,170	783,734	
	銘柄数<比率>		11	12	—	<0.3%>	
(オーストリア)			百株	百株	千ユーロ	千円	エネルギー 公益事業 素材 銀行 銀行 資本財
OMV AG			56	82	293	37,271	
VERBUND AG			31	31	253	32,150	
VOESTALPINE AG			59	59	185	23,624	
ERSTE GROUP BANK AG			140	140	376	47,777	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG			78	78	132	16,835	
ANDRITZ AG			36	—	—	—	
小 計	株 数 ・ 金 額		401	391	1,241	157,660	
	銘柄数<比率>		6	5	—	<0.1%>	
(ルクセンブルク)			百株	百株	千ユーロ	千円	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス エネルギー メディア・娯楽 素材 不動産
EUROFINS SCIENTIFIC			3	64	522	66,393	
TENARIS SA			195	195	135	17,185	
SES			162	162	111	14,199	
ARCELORMITTAL			309	353	658	83,597	
AROUNDTOWN SA			510	524	310	39,442	
小 計	株 数 ・ 金 額		1,181	1,299	1,738	220,818	
	銘柄数<比率>		5	5	—	<0.1%>	
(フィンランド)			百株	百株	千ユーロ	千円	食品・生活必需品小売り 資本財 素材 素材 保険 公益事業 電気通信サービス 資本財 テクノロジー・ハードウェアおよび機器 エネルギー 自動車・自動車部品 資本財 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KESKO OYJ-B SHS			—	143	311	39,560	
WARTSILA OYJ			187	187	155	19,702	
UPM KYMMENE OYJ			234	273	839	106,574	
STORA ENSO OYJ R			232	319	489	62,152	
SAMPO OYJ-A SHS			195	262	958	121,791	
FORTUM OYJ			190	242	525	66,738	
ELISA A			82	81	396	50,368	
NELES OYJ			49	—	—	—	
NOKIA OYJ			2,514	3,123	1,117	141,996	
NESTE OIL OYJ			196	222	1,226	155,844	
NOKIAN RENKAAT OYJ			61	—	—	—	
KONE OYJ-B			174	178	1,177	149,519	
ORION OYJ-CLASS B			53	53	208	26,428	
小 計	株 数 ・ 金 額		4,173	5,087	7,405	940,676	
	銘柄数<比率>		12	11	—	<0.3%>	

銘柄		当期首(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	
(アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KINGSPAN GROUP PLC		71	76	455	57,855	資本財
CRH PLC		360	414	1,471	186,972	素材
KERRY GROUP PLC-A		75	87	998	126,880	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		103	113	468	59,548	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC		467	—	—	—	銀行
AIB GROUP PLC		377	—	—	—	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		37	84	1,367	173,663	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,493	777	4,762	604,921	
	銘柄数<比率>	7	5	—	<0.2%>	
(ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		1,188	1,393	713	90,572	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		237	237	197	25,081	エネルギー
JERONIMO MARTINS		130	130	171	21,817	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	1,556	1,761	1,082	137,472	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額	93,743	102,363	224,961	28,574,546	
	銘柄数<比率>	236	234	—	<10.3%>	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC		169	228	338	49,064	素材
ASHTREAD GROUP PLC		223	249	961	139,408	資本財
SEVERN TRENT PLC		119	119	272	39,503	公益事業
BHP GROUP PLC		1,012	1,111	2,271	329,248	素材
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		509	509	361	52,463	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC		148	189	443	64,241	資本財
AVIVA PIC		1,819	2,066	706	102,389	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC		54	70	450	65,261	素材
DIAGEO		1,127	1,229	3,690	534,949	食品・飲料・タバコ
SCHROEDERS PLC		55	55	194	28,133	各種金融
DCC PLC		45	55	318	46,168	資本財
BAE SYSTEMS PLC		1,445	1,775	841	122,000	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO		1,093	1,206	3,224	467,456	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC		169	203	499	72,415	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC		1,251	1,420	636	92,278	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		458	526	750	108,852	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC		83	111	321	46,649	素材
ANGLO AMERICAN PLC		500	645	1,603	232,401	素材
COMPASS GROUP PLC		762	938	1,357	196,745	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)		9,601	10,709	4,203	609,292	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP		2,698	3,312	856	124,107	保険
UNILEVER PLC		529	1,387	5,522	800,427	家庭用品・パーソナル用品
MEGGITT PLC		316	—	—	—	資本財
MORRISON SUPERMARKETS		1,118	1,118	196	28,539	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC		347	347	311	45,208	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP		516	516	350	50,801	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		153	187	429	62,214	食品・飲料・タバコ
PEARSON		331	437	316	45,865	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC		134	166	459	66,578	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL		1,243	1,372	1,674	242,709	保険
RIO TINTO PLC REG		539	590	3,316	480,690	素材
VODAFONE GROUP PLC		12,814	14,111	1,892	274,250	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC		339	374	2,296	332,928	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		932	1,016	1,853	268,603	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC		849	1,035	528	76,600	商業・専門サービス
NATWEST GROUP PLC		2,057	2,529	430	62,454	銀行

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
ST JAMES' S PLACE PLC	百株	百株	千イギリスポンド	千円		各種金融
SSE PLC	267	267	313	45,386		公益事業
BP PLC	458	576	847	122,864		エネルギー
SAGE GROUP PLC	9,696	10,656	2,686	389,342		ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	469	587	347	50,400		資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	200	200	297	43,178		銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	33,586	37,246	1,378	199,757		耐久消費財・アパレル
TESCO	1,660	1,660	268	38,894		食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	4,715	5,154	1,269	184,080		各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	424	504	591	85,786		ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	395	484	752	109,027		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	2,375	2,638	3,339	484,085		資本財
WPP PLC	125	—	—	—		メディア・娯楽
ASTRAZENECA	566	651	530	76,906		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	624	689	5,019	727,602		電気通信サービス
CARNIVAL PLC	3,822	4,982	620	89,920		消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	81	—	—	—		公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,663	1,851	1,576	228,546		小売
BARCLAYS	823	—	—	—		銀行
INTERTEK GROUP PLC	7,810	9,128	1,343	194,795		商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	70	84	478	69,415		耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	182	230	407	59,043		小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	64	74	592	85,869		資本財
KINGFISHER PLC	840	4,410	414	60,036		小売
ITV PLC	900	1,226	344	49,974		メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	1,549	—	—	—		各種金融
SAINSBURY (J) PLC	152	166	1,572	227,999		食品・生活必需品小売り
G4S PLC	820	820	193	28,044		商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	779	—	—	—		保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	98	98	291	42,212		耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	65	65	285	41,328		公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,393	—	—	—		エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,036	2,156	2,902	420,746		エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	1,779	1,949	2,495	361,708		消費者サービス
WHITBREAD PLC	74	91	465	67,410		消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	67	101	333	48,351		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TUI AG-DI	—	85	199	28,873		消費者サービス
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	175	—	—	—		各種金融
EXPERIAN PLC	1,056	1,306	409	59,409		商業・専門サービス
MONDI PLC	451	498	1,314	190,531		素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	223	274	480	69,713		各種金融
FRESNILLO PLC	119	182	297	43,069		素材
OCADO GROUP PLC	—	98	101	14,647		小売
GLENCORE PLC	235	235	659	95,649		素材
ENTAIN PLC	5,202	5,202	1,348	195,473		消費者サービス
EVRAZ PLC	333	333	428	62,121		素材
NMC HEALTH PLC	166	344	173	25,146		ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	47	—	—	—		運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	99	—	—	—		保険
COCA-COLA HBC AG-CDI	688	688	210	30,571		食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	91	91	206	29,872		ソフトウェア・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	34	74	269	39,003		ソフトウェア・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	151	—	—	—		保険
FERGUSON PLC	—	290	203	29,505		資本財
M&G PLC	103	124	1,080	156,555		各種金融
	1,123	1,506	279	40,548		

銘柄		当期首(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	
			百株	百株	千イギリスポンド	千円	
INFORMA PLC			549	855	448	64,938	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC			423	548	316	45,873	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC			36	36	413	59,932	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC			2,388	2,388	418	60,597	資本財
JD SPORTS FASHION PLC			228	228	195	28,265	小売
小 計	株 数 ・ 金 額	141,154	156,077	85,297	12,363,926		
	銘 柄 数 <比 率>	93	85	—	<4.5%>		
(スイス)			百株	百株	千スイスフラン	千円	
BARRY CALLEBAUT AG-REG			1	1	302	35,464	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		0.48	0.55	443	52,041	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.05	0.05	427	50,124	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG - REG		23	23	363	42,663	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG		4	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG		30	30	156	18,332	耐久消費財・アパレル	
VIFOR PHARMA AG		—	21	249	29,277	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		4	4	355	41,642	素材	
SWISS PRIME SITE-REG		36	36	319	37,456	不動産	
PARGESA HOLDING SA-BR		22	—	—	—	各種金融	
DUFREY AG-REG		18	—	—	—	小売	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		9	9	218	25,571	資本財	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		—	15	154	18,104	銀行	
SIKA AG-BR		58	74	1,864	218,584	素材	
SGS SA		2	3	850	99,694	商業・専門サービス	
SWISSCOM		12	14	694	81,375	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG		16	20	1,128	132,361	資本財	
GIVAUDAN-REG		4	4	1,737	203,753	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		72	79	2,966	347,791	保険	
NOVARTIS		1,018	1,168	9,517	1,115,919	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD		893	971	2,517	295,128	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS		333	369	11,406	1,337,408	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG		66	85	486	57,021	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD		235	276	1,382	162,088	素材	
CLARIANT AG-REG		87	87	163	19,165	素材	
NESTLE SA - REGISTERED		1,410	1,516	15,201	1,782,398	食品・飲料・タバコ	
TEMENOS AG - REG		29	35	384	45,027	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG-REG		26	30	692	81,175	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		24	27	553	64,914	運輸	
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	5	636	74,654	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG		1,244	1,342	1,650	193,515	各種金融	
SWATCH GROUP AG(BEARER)		12	15	426	49,985	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG		35	39	2,212	259,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		15	16	693	81,278	保険	
VIFOR PHARMA AG		21	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		8	10	1,151	134,995	各種金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		20	20	487	57,155	資本財	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		—	82	827	97,021	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)		249	274	2,353	275,927	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD		107	127	706	82,841	各種金融	
SWISS RE LTD		140	151	1,246	146,125	保険	
ALCON INC		199	259	1,763	206,818	ヘルスケア機器・サービス	
UBS GROUP AG		1,838	1,932	2,593	304,121	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	8,336	9,186	71,286	8,358,290		
	銘 柄 数 <比 率>	39	39	—	<3.0%>		

銘柄	当期首(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	
ATLAS COPCO A		324	353	16,640	209,508	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS		23	40	1,837	23,137	各種金融
SKF AB-B		183	183	4,117	51,837	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A		784	849	7,850	98,833	銀行
SWEDBANK AB-A		392	468	6,986	87,956	銀行
SCA SV CELLULOSA B		—	319	4,806	60,517	素材
VOLVO B		715	750	15,731	198,062	資本財
SWEDISH MATCH AB		82	82	5,351	67,374	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		245	245	2,768	34,852	電気通信サービス
ELECTROLUX AB-SER B		89	120	2,520	31,730	耐久消費財・アパレル
SECURITAS B		155	155	1,931	24,318	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS		218	240	15,270	192,261	各種金融
HENNES & MAURITZ B		386	424	7,797	98,170	小売
ASSA ABLOY AB-B		483	521	11,332	142,680	資本財
SVENSKA HANDELSBK A		739	811	6,818	85,850	銀行
ERICSSON (LM) B		1,469	1,538	17,119	215,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANDVIK AB		548	587	12,546	157,959	資本財
TELIA CO AB		1,331	1,331	4,822	60,715	電気通信サービス
SKANSKA B		139	184	3,979	50,107	資本財
LUNDIN ENERGY AB		92	92	2,259	28,450	エネルギー
BOLIDEN AB		130	130	3,824	48,155	素材
ALFA LAVAL AB		142	167	3,951	49,751	資本財
KINNEVIK AB - B		111	128	5,454	68,666	各種金融
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		47	—	—	—	電気通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		—	54	2,316	29,161	不動産
ICA GRUPPEN AB		47	47	1,939	24,424	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		218	218	2,284	28,762	耐久消費財・アパレル
ATLAS COPCO B		187	203	8,322	104,778	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		—	57	1,669	21,019	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		86	86	2,374	29,893	各種金融
HEXAGON AB-B SHS		124	146	10,828	136,333	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EPIROC AB-A		265	359	5,948	74,889	資本財
EPIROC AB-B		211	211	3,159	39,774	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		291	321	8,623	108,565	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB		—	127	3,470	43,697	各種金融
EVOLUTION GAMING GROUP		—	84	7,718	97,180	消費者サービス
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	164	4,705	59,244	資本財
NORDEA BANK ABP		1,549	1,708	12,116	152,548	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		—	80	1,579	19,890	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	11,820	13,603	242,779	3,056,599	
	銘柄数 <比率>	32	38	—	<1.1%>	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
DNB ASA		430	485	8,336	103,043	銀行
NORSK HYDRO		613	613	2,434	30,085	素材
TELENOR ASA		327	383	5,541	68,487	電気通信サービス
SCHIBSTED ASA-CL A		—	40	1,388	17,157	メディア・娯楽
ORKLA		336	398	3,325	41,098	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		514	514	8,035	99,321	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		74	98	3,991	49,335	素材
MOWI ASA		188	233	4,520	55,874	食品・飲料・タバコ
AKER BP ASA		55	—	—	—	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		111	111	2,246	27,763	保険
ADEVINTA ASA		—	168	2,319	28,669	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS		47	47	1,369	16,926	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	2,698	3,093	43,508	537,762	
	銘柄数 <比率>	10	11	—	<0.2%>	

銘 柄	株 数	株 数	期 末		業 種 等
			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	
CARLSBERG AS-B	50	57	5,553	94,851	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	2	3	4,344	74,209	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	1	1	1,875	32,036	運輸
GN STORE NORD A/S	—	67	3,421	58,434	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	328	389	4,372	74,687	銀行
GENMAB A/S	31	36	9,032	154,278	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S	95	116	4,439	75,833	素材
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	4	984	16,813	資本財
DSV PANALPINA A S	98	108	11,055	188,825	運輸
DEMANT A/S	44	44	1,049	17,928	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSTEMS	96	103	13,842	236,426	資本財
NOVO NORDISK A/S-B	842	905	39,874	681,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S	36	36	919	15,697	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B	50	65	6,661	113,786	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S	51	80	1,559	26,637	保険
PANDORA A/S	55	55	3,479	59,425	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	53	53	3,002	51,281	素材
AMBU A/S-B	—	86	2,850	48,692	ヘルスケア機器・サービス
ISS A/S	61	—	—	—	商業・専門サービス
ORSTED A/S	88	99	11,422	195,091	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	1,989	2,315	129,741	2,215,992
	銘 柄 数 <比 率>	17	19	—	<0.8%>
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	81	96	639	51,782	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD	329	329	375	30,360	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,357	1,493	3,775	305,661	銀行
WESTPAC BANKING	1,668	1,900	4,210	340,855	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	575	892	2,074	167,920	素材
TELSTRA CORP	1,864	1,998	629	50,950	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	238	—	—	—	銀行
BRAMBLES LTD	733	822	896	72,605	商業・専門サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED	221	221	291	23,574	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	89	103	740	59,950	各種金融
BHP GROUP LTD	1,404	1,549	6,788	549,505	素材
AMPOL LTD	128	128	344	27,876	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	370	—	—	—	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	219	219	326	26,392	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	216	239	6,604	534,661	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	30	30	471	38,127	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	1,309	1,441	1,973	159,794	運輸
COCHLEAR LIMITED	29	34	720	58,288	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	878	878	398	32,227	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUST	853	931	8,253	668,152	銀行
BORAL LIMITED	428	—	—	—	素材
RIO TINTO LTD	169	195	2,217	179,481	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	257	307	1,031	83,537	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,145	1,145	565	45,789	保険
TPG CORP LTD	226	—	—	—	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	29	—	—	—	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	207	234	920	74,538	素材
ORICA LTD	195	195	306	24,840	素材
CIMIC GROUP LIMITED	29	29	76	6,175	資本財
BLUESCOPE STEEL LTD	215	215	361	29,253	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED	155	186	2,514	203,544	各種金融
WORLEY LTD	144	—	—	—	エネルギー

銘 柄	当期首(前期末)	株 数	株 数	期 末		業 種 等
				外 貨 建 金 額	評 価 額 邦貨換算金額	
SUNCORP GROUP LIMITED		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		585	743	781	63,289	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		1,380	1,764	4,452	360,441	素材
OIL SEARCH LTD		351	455	1,132	91,684	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD		701	1,101	451	36,569	素材
AMP LTD		812	—	—	—	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED		1,820	1,820	286	23,210	運輸
QBE INSURANCE GROUP		399	399	189	15,328	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		652	784	678	54,924	素材
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE		—	581	689	55,848	各種金融
SANTOS		305	—	—	—	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD		839	839	579	46,934	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		190	242	848	68,707	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD		48	48	137	11,095	消費者サービス
WESFARMERS LTD		905	988	453	36,716	小売
ALUMINA LIMITED		546	597	3,322	268,919	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		1,186	—	—	—	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD		418	480	1,221	98,905	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		606	665	2,741	221,896	各種金融
SEEK LTD		66	66	336	27,245	メディア・娯楽
AUSNET SERVICES		171	171	519	42,043	公益事業
CROWN RESORTS LTD		470	805	137	11,116	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD		188	188	187	15,188	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		—	883	411	33,312	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		936	936	364	29,475	食品・飲料・タバコ
XERO LTD		344	344	343	27,827	ソフトウェア・サービス
AFTERPAY LTD		—	64	831	67,270	ソフトウェア・サービス
TPG TELECOM LTD		—	112	1,699	137,554	電気通信サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD		—	226	167	13,596	保険
SOUTH32 LTD		1,292	1,292	390	31,598	素材
COLES GROUP LTD		2,161	2,680	710	57,501	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		502	754	1,379	111,649	ソフトウェア・サービス
		107	64	212	17,237	
小 計	株 数 ・ 金 額	33,798	35,924	73,167	5,922,937	
	銘 柄 数 <比率>	59	55	—	<2.1%>	
(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	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		491	646	464	35,342	運輸
RYMAN HEALTHCARE LTD		220	220	348	26,508	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD		283	403	446	33,915	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		265	297	997	75,844	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		490	—	—	—	素材
SPARK NEW ZEALAND LTD		666	1,045	496	37,749	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		150	466	333	25,336	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		640	640	447	34,026	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	3,208	3,719	3,534	268,724	
	銘 柄 数 <比率>	8	7	—	<0.1%>	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		117	117	1,382	18,821	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		720	1,150	2,374	32,320	不動産
BANK EAST ASIA		469	469	809	11,019	銀行
CLP HOLDINGS		725	840	6,052	82,370	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		320	320	1,339	18,226	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		586	636	32,881	447,513	各種金融
MTR CORP		680	825	3,671	49,965	運輸
HANG SENG BANK		337	393	5,513	75,042	銀行

銘柄	株数	当期首(前期末)	株数	当期末		業種等
				評価額	金額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	百株	百株	百株	千香港ドル	千円	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	567	797	797	2,456	33,434	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	590	735	735	3,050	41,513	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	5,154	5,412	5,412	5,899	80,290	公益事業
KERRY PROPERTIES LTD	1,120	1,120	1,120	7,470	101,672	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	370	—	—	—	—	不動産
NWS HOLDINGS LTD	1,625	1,960	1,960	4,488	61,087	銀行
PCCW LTD	735	—	—	—	—	資本財
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	2,120	2,120	2,120	937	12,753	電気通信サービス
NEW WORLD DEVELOPMENT	470	—	—	—	—	耐久消費財・アパレル
SINO LAND CO	3,050	762	762	2,680	36,477	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,286	2,046	2,046	2,221	30,240	不動産
SWIRE PACIFIC A	800	695	695	7,346	99,981	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	200	200	200	982	13,365	不動産
WHEELLOCK & CO LTD	240	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	400	—	—	—	—	不動産
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	730	735	735	8,967	122,040	資本財
SJM HOLDINGS LTD	—	1,020	1,020	2,005	27,292	資本財
WYNN MACAU LTD	1,500	920	920	857	11,669	消費者サービス
AIA GROUP LTD	608	608	608	801	10,906	消費者サービス
SANDS CHINA LTD	5,780	6,368	6,368	63,680	866,684	保険
SWIRE PROPERTIES LTD	1,046	1,270	1,270	4,197	57,125	消費者サービス
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	406	690	690	1,524	20,753	不動産
ESR CAYMAN LTD	610	810	810	3,410	46,411	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	924	924	2,711	36,909	不動産
WH GROUP LTD	536	830	830	2,029	27,619	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	5,160	5,160	5,160	3,276	44,594	食品・飲料・タバコ
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,349	1,439	1,439	7,636	103,931	資本財
	1,319	1,319	1,319	5,126	69,767	不動産
小計	株数・金額	41,727	42,693	197,781	2,691,804	
	銘柄数<比率>	34	31	—	<1.0%>	
(シンガポール)	百株	百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	748	748	748	282	22,365	資本財
DBS GROUP	878	941	941	2,378	188,166	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	220	220	220	159	12,581	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	46	—	—	—	—	小売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	146	—	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	425	425	425	417	33,012	各種金融
CAPITALAND LTD	1,189	1,189	1,189	374	29,625	不動産
GENTING SINGAPORE LTD	3,197	3,197	3,197	279	22,127	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	575	802	802	399	31,592	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,139	—	—	—	—	運輸
OCBC BANK	1,600	1,714	1,714	1,765	139,685	銀行
SINGAPORE AIRLINES	175	877	877	365	28,944	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	581	616	616	1,450	114,700	銀行
UOL GROUP LIMITED	248	248	248	182	14,398	不動産
VENTURE CORP LTD	143	143	143	285	22,588	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	845	—	—	—	—	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,081	4,262	4,262	993	78,564	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	620	—	—	—	—	資本財
WILMAR INTERNATIONAL LTD	768	1,116	1,116	592	46,874	食品・飲料・タバコ
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,174	—	—	—	—	資本財
小計	株数・金額	18,799	16,499	9,927	785,227	
	銘柄数<比率>	20	14	—	<0.3%>	

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イスラエル)		百株	百株	千イスラエルシェケル	千円	
BANK HAPOLIM BM		468	618	1,475	47,344	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		706	706	1,445	46,376	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		12	12	579	18,604	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		642	642	809	25,981	銀行
ICL LTD		284	284	496	15,926	素材
NICE LTD		31	31	2,848	91,379	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		62	62	497	15,975	銀行
AZRIELI GROUP		14	14	303	9,725	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	2,223	2,374	8,457	271,316	
	銘 柄 数 <比 率>	8	8	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	520,748	574,094	—	266,231,928	
	銘 柄 数 <比 率>	1,250	1,221	—	<96.0%>	

(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) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額
(アメリカ)	千口	千口	千米ドル	千円
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5	6	1,187	125,344
BOSTON PROPERTIES	6	7	721	76,164
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9	12	453	47,894
SL GREEN REALTY CORP	4	—	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	71	71	609	64,311
PROLOGIS INC	35	38	4,141	437,145
AVALONBAY COMMUNITIES INC	7	7	1,327	140,119
CAMDEN PROPERTY TRUST	4	5	518	54,719
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	7	—	—	—
DUKE REALTY CORP	15	19	790	83,418
CROWN CASTLE INTL CORP	20	22	3,679	388,376
ESSEX PROPERTY TRUST	2	3	865	91,308
EQUITY RESIDENTIAL PTY	18	20	1,324	139,832
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	24	29	903	95,387
WELLTOWER INC	18	22	1,462	154,396
KIMCO REALTY CORP	17	—	—	—
IRON MOUNTAIN INC	12	15	503	53,138
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8	8	563	59,502
HOST HOTELS AND RESORTS INC	32	39	557	58,876
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5	6	813	85,907
REALTY INCOME CORP	14	18	1,151	121,513
REGENCY CENTERS CORP	6	8	435	45,999
UDR INC	14	14	593	62,673
SIMON PROPERTY GROUP	14	16	1,621	171,156
PUBLIC STORAGE	7	8	1,895	200,002
SUN COMMUNITIES INC	4	5	805	84,971
VENTAS INC	18	20	994	104,980
VORNADO REALTY TRUST	7	7	285	30,144
EXTRA SPACE STORAGE INC	5	6	783	82,648
DIGITAL REALTY TRUST INC	9	14	2,056	217,055
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	21	27	592	62,572
AGNC INVESTMENT CORP	23	29	478	50,458
VEREIT INC	55	11	411	43,460

銘柄		当期首(前期末)		当		期		末	
		口	数	口	数	評 価 額			
						外貨建金額	邦貨換算金額		
		千口		千口		千米ドル		千円	
AMERICAN TOWER CORPORATION		21		23		5,430		573,187	
WP CAREY INC		7		8		603		63,648	
INVITATION HOMES INC		27		27		835		88,183	
EQUINIX INC		4		4		3,509		370,414	
VICI PROPERTIES INC		19		27		754		79,620	
SBA COMMUNICATIONS CORP		5		6		1,668		176,136	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	621		625		45,335		4,784,673	
(カナダ)		千口		千口		千カナダドル		千円	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		2		—		—		—	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		2		5		260		21,533	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT		7		—		—		—	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		8		8		161		13,327	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		7		—		—		—	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	29		14		421		34,860	
		5		2		—		<0.0%>	
(フランス)		千口		千口		千ユーロ		千円	
ICADE		1		—		—		—	
KLEPIERRE		8		8		152		19,322	
GECINA SA		1		2		332		42,244	
COVIVIO (FP)		1		3		212		27,037	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		6		7		451		57,375	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	20		21		1,149		145,979	
		5		4		—		<0.1%>	
(その他)		千口		千口		千ユーロ		千円	
BGP HOLDINGS PLC		1,605		1,605		—		—	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,605		1,605		—		—	
		1		1		—		<—%>	
ユーロ計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,625		1,627		1,149		145,979	
		6		5		—		<0.1%>	
(イギリス)		千口		千口		千イギリスポンド		千円	
BRITISH LAND CO PLC		39		39		179		26,058	
SEGRO PLC		50		66		636		92,282	
LAND SECURITIES GROUP PLC		32		32		201		29,277	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	121		137		1,018		147,617	
		3		3		—		<0.1%>	
(オーストラリア)		千口		千口		千オーストラリアドル		千円	
MIRVAC GROUP		176		176		433		35,094	
APA GROUP		54		63		613		49,683	
GPT GROUP		84		120		511		41,375	
SYDNEY AIRPORT		53		64		380		30,801	
STOCKLAND		121		121		578		46,809	
DEXUS		47		59		532		43,095	
GOODMAN GROUP		73		92		1,663		134,683	
VICINITY CENTERS		163		163		260		21,114	
LENDLEASE GROUP		27		36		453		36,733	
SCENTRE GROUP		228		274		773		62,622	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,030		1,171		6,201		502,015	
		10		10		—		<0.2%>	
(香港)		千口		千口		千香港ドル		千円	
LINK REIT		96		108		7,377		100,414	
HKT TRUST AND HKT LTD		185		185		1,935		26,336	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		130		130		990		13,482	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	411		423		10,303		140,233	
		3		3		—		<0.1%>	

銘 柄		当期首(前期末)				当 期 末	
		口 数		口 数		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額
(シンガポール)		千口		千口		千シンガポールドル	千円
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		117		196		420	33,228
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		139		189		589	46,619
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		110		—		—	—
SUNTEC REIT		113		113		170	13,496
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—		168		332	26,263
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		55		132		276	21,855
小 計	口 数 ・ 金 額	535		799		1,788	141,463
	銘 柄 数 <比 率>	5		5		—	<0.1%>
合 計	口 数 ・ 金 額	4,375		4,799		—	5,896,843
	銘 柄 数 <比 率>	72		64		—	<2.1%>

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

(注2) < >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	売 建 額
外国		百万円	百万円
	S&P 500 EMIN	3,542	—
	S&P/TSE 60	265	—
	SWISS MKT IX	224	—
	DJ EURO STOXX	518	—
	SPI 200 FUTU	150	—
	FTSE 100	224	—

(注) 外貨建の評価額は、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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 266,231,928	% 95.9
投 資 信 託 受 益 証 券	157,037	0.1
投 資 証 券	5,739,805	2.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,357,039	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	277,485,809	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(276,299,053千円)の投資信託財産総額(277,485,809千円)に対する比率は99.6%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=105.54円	1カナダドル=82.68円	1ユーロ=127.02円
1イギリスポンド=144.95円	1スイスフラン=117.25円	1スウェーデンクローナ=12.59円
1ノルウェークローネ=12.36円	1デンマーククローネ=17.08円	1オーストラリアドル=80.95円
1ニュージーランドドル=76.02円	1香港ドル=13.61円	1シンガポールドル=79.10円
1イスラエルシェケル=32.08円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年2月8日現在
(A) 資 産	278,694,077,999円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,067,042,965
株 式(評価額)	266,231,928,110
投資信託受益証券(評価額)	157,037,738
投資証券(評価額)	5,739,805,775
未 収 入 金	1,479,315,679
未 収 配 当 金	165,743,730
差 入 委 託 証 拠 金	1,853,204,002
(B) 負 債	1,441,644,753
未 払 金	1,258,996,296
未 払 解 約 金	182,648,064
未 払 利 息	393
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	277,252,433,246
元 本	78,359,437,234
次 期 繰 越 損 益 金	198,892,996,012
(D) 受 益 権 総 口 数	78,359,437,234口
1万口当たり基準価額(C/D)	35,382円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年2月8日 至 2021年2月8日
(A) 配 当 等 収 益	4,003,908,886円
受 取 配 当 金	3,978,696,392
受 取 利 息	5,314,452
そ の 他 収 益 金	29,314,414
支 払 利 息	△9,416,372
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	28,733,859,799
売 買 益 損	50,354,161,310
売 買 損	△21,620,301,511
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,224,687,805
取 引 益	4,864,254,684
取 引 損	△3,639,566,879
(D) そ の 他 費 用	△48,016,524
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	33,914,439,966
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	159,178,226,826
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	34,854,221,313
(H) 解 約 差 損 益 金	△29,053,892,093
(I) 計 (E+F+G+H)	198,892,996,012
次 期 繰 越 損 益 金(I)	198,892,996,012

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(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73,915,074,141円、期中追加設定元本額は19,137,011,914円、期中一部解約元本額は14,692,648,821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。

DC外国株式インデックスファンドL	23,205,489,161円
私募外国株式パッシブファンド（適格機関投資家専用）	11,695,733,335円
インデックスコレクション（外国株式）	10,935,677,317円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	5,310,051,100円
外国株式インデックスe	4,937,433,010円
DC外国株式インデックスファンド	4,563,430,207円
インデックスコレクション（バランス株式30）	3,642,134,060円
外国株式パッシブファンド私募A（適格機関投資家専用）	1,591,940,702円
外国株式インデックスファンド	1,589,711,225円
DCバランスファンド50	1,388,109,776円
VAバランスファンド（株60／100）（適格機関投資家専用）	1,195,624,128円
インデックスコレクション（バランス株式50）	988,023,802円
DCバランスファンド70	871,306,570円
インデックスコレクション（バランス株式70）	863,733,931円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	831,256,720円
外国株式インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	704,820,396円
DCバランスファンド30	674,993,689円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	550,695,255円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	433,372,583円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	396,095,054円
VAバランス50－50（適格機関投資家専用）	373,577,067円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	338,979,699円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	277,171,542円
VAバランス20－80（適格機関投資家専用）	260,444,235円
VAバランスファンド（株40／100）（適格機関投資家専用）	188,080,531円
VAバランスファンド2（株40／100）（適格機関投資家専用）	116,661,038円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	104,114,763円
VAバランスファンド（株50／100）（適格機関投資家専用）	102,374,429円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	90,508,266円
VAバランスファンド（株25／100）（適格機関投資家専用）	49,757,038円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	38,947,155円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	20,468,850円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	16,552,478円
私募外国株式インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	11,404,262円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	763,860円

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2021年2月8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2001年2月22日から無期限です。
運 用 方 針	長期的な信託財産の成長を目指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	株式への投資は転換社債を転換したものおよび新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）を行使したものに限ることとし、取得時において株式への投資は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、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		債券組入率 比	債券先物率 比	純 資 産 額 総
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
第16期(2017年2月7日)	22,198	△7.3	428.463	△6.7	97.6	0.9	162,596
第17期(2018年2月7日)	23,692	6.7	453.637	5.9	96.6	1.7	146,029
第18期(2019年2月7日)	23,318	△1.6	447.318	△1.4	96.6	1.6	133,456
第19期(2020年2月7日)	24,866	6.6	477.531	6.8	97.4	1.3	141,275
第20期(2021年2月8日)	25,857	4.0	496.296	3.9	97.7	1.5	144,346

(注) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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		債券組入率 比	債券先物率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(当 期 首)	円	%		%	%	%
2020年 2月 7日	24,866	－	477.531	－	97.4	1.3
2月末	25,147	1.1	484.794	1.5	97.5	1.4
3月末	25,133	1.1	480.583	0.6	96.7	2.2
4月末	24,714	△0.6	472.875	△1.0	95.6	2.9
5月末	25,058	0.8	481.049	0.7	96.1	3.2
6月末	25,446	2.3	488.814	2.4	97.2	1.8
7月末	25,702	3.4	494.135	3.5	97.1	1.9
8月末	25,669	3.2	492.649	3.2	98.0	1.1
9月末	25,785	3.7	494.877	3.6	97.6	1.5
10月末	25,413	2.2	488.038	2.2	97.3	1.7
11月末	25,671	3.2	493.201	3.3	97.7	1.6
12月末	25,881	4.1	497.331	4.1	98.4	0.9
2021年 1月末	25,844	3.9	496.213	3.9	97.9	1.2
(当 期 末)						
2021年 2月 8日	25,857	4.0	496.296	3.9	97.7	1.5

(注1) 騰落率は期首比です。

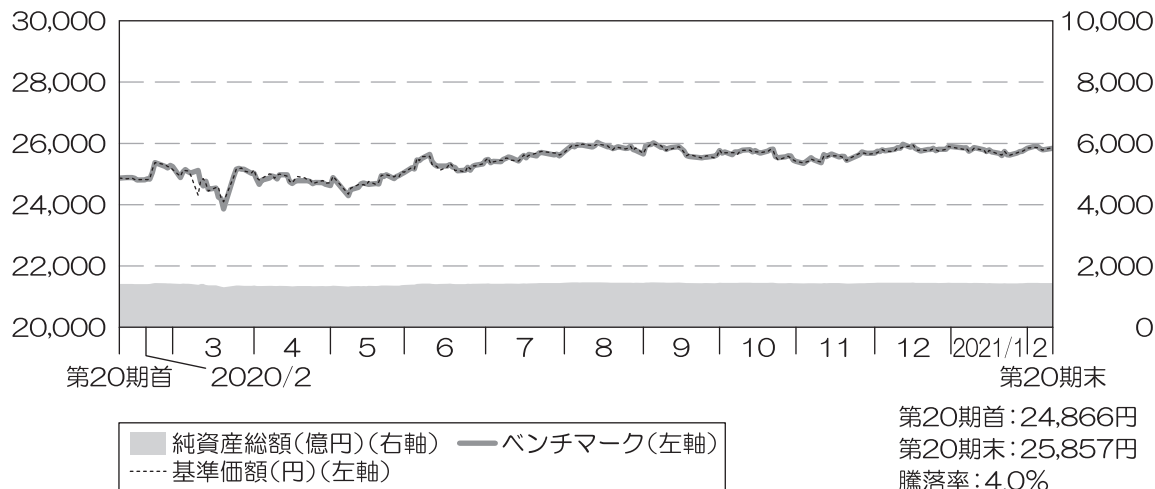
(注2) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、2020年2月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年2月下旬にかけて、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)したことや外国為替市場で円安・米ドル高が進行したことから、基準価額は上昇しました。3月上旬から中旬にかけては、長期金利が上昇(債券価格は下落)したことや円高となったことから基準価額は下落しましたが、3月下旬には下落幅を縮小しました。5月上旬にかけては、EU(欧州連合)の協議難航などから円高・ユーロ安となり、基準価額は下落しましたが、その後6月上旬にかけては、復興基金の設立期待などから円安・ユーロ高となり、上昇しました。6月中旬に基準価額は一旦下落した後8月中旬にかけては、主要国の長期金利が低下し、またEUでの復興基金の創設合意によりユーロが対円で上昇したことから、上昇しました。8月下旬から11月上旬にかけては、主要国の長期金利が上昇したことに加え、円高が進行したことから、基準価額は下落しました。11月中旬以降は、米ドル売りユーロ買いの動きが加速し、対円で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、2020年3月上旬にかけて低下しました。3月中旬に、財政出動機運の高まりから上昇しましたが、下旬には上昇幅は縮小しました。4月以降は、国債の需給悪化懸念が高まった米国では上昇、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、2020年2月下旬にかけて、対円で米ドルが上昇しました。3月上旬にリスク回避の動きから主要通貨は急激に円高となりましたが、下旬には反転しました。5月上旬にかけてユーロが対円で下落しましたが、中旬には政策期待から上昇しました。その後はリスク選好局面での円売りに加え米ドル売りの流れから、対円では米ドルが下落、ユーロは上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、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

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

当ファンドの組入資産の内容

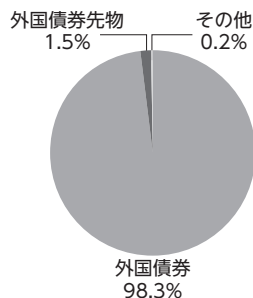
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.6%
2	T 1.5% 09/30/24	アメリカ	0.6%
3	T 2.125% 05/15/25	アメリカ	0.6%
4	T 2.375% 08/15/24	アメリカ	0.5%
5	EURO-BUND 2103	ドイツ	0.5%
6	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%

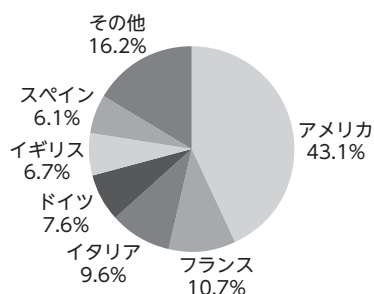
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 09/30/25	アメリカ	0.5%
8	T 2% 02/15/23	アメリカ	0.5%
9	T 2% 02/15/25	アメリカ	0.5%
10	T 2.875% 11/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数			721

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

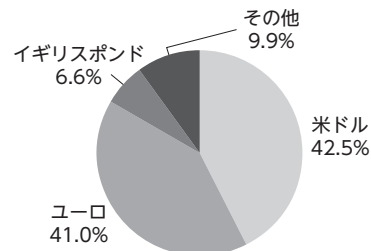
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

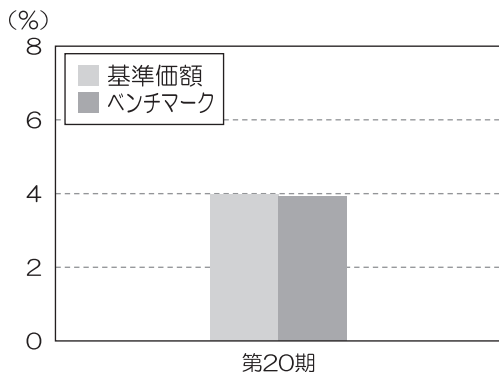


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.5%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、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)等です。

(※) 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)に採用されている国の国債等に投資し、同インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年2月8日～2021年2月8日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	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
（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）	（0.001）	
(b) 有価証券取引税	－	－	(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
（株式）	（－）	（－）	
（新株予約権証券）	（－）	（－）	
（オプション証券等）	（－）	（－）	
（新株予約権付社債（転換社債））	（－）	（－）	
（公社債）	（－）	（－）	
（投資信託証券）	（－）	（－）	
(c) その他費用	3	0.012	(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
（保管費用）	(3)	(0.012)	
（監査費用）	（－）	（－）	
（その他）	(0)	(0.001)	
合計	3	0.013	

(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(25,455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 180,577	千米ドル 228,827
	カナダ	国債証券	千カナダドル 15,557	千カナダドル 14,167
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 50,027	千メキシコペソ 53,506
	ドイツ	国債証券	千ユーロ 38,891	千ユーロ 23,247
	イタリア	国債証券	24,235	22,107
	フランス	国債証券	23,068	14,756
	オランダ	国債証券	4,516	4,251
	スペイン	国債証券	18,303	14,230
	ベルギー	国債証券	5,435	4,136
	オーストリア	国債証券	3,947	2,639
	フィンランド	国債証券	1,754	865
	アイルランド	国債証券	2,250	688
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 19,216	千イギリスポンド 14,858
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 6,397	千スウェーデンクローナ 1,357
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 7,701	千ノルウェークローネ 7,982
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 13,258	千デンマーククローネ 11,424
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 12,087	千ポーランドズロチ 8,858
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 20,463	千オーストラリアドル 7,367
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,394	千シンガポールドル 1,864
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 10,645	千マレーシアリンギット 8,918
国内	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 21,432	千イスラエルシェケル 806
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 1,664	千南アフリカランド 96,490

(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 27,108	百万円 27,028	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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為 替 先 物 取 引	41,534	41,534	100.0	41,888	41,888	100.0
為 替 直 物 取 引	16,359	16,251	99.3	18,371	18,280	99.5
金 銭 信 託	722	722	100.0	722	722	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	539,831	58,367	10.8	540,187	58,465	10.8

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期					末		
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち80%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 539,020	千米ドル 576,325	千円 60,825,445	% 42.1	% —	% 18.7	% 15.7	% 7.8
カ ナ ダ	千カナダドル 30,880	千カナダドル 33,752	2,790,681	1.9	—	0.9	0.6	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 194,280	千メキシコペソ 222,000	1,165,501	0.8	—	0.5	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 70,090	千ユーロ 84,205	10,695,756	7.4	—	4.6	2.0	0.8
イ タ リ ア	87,500	106,388	13,513,436	9.4	—	6.0	2.5	0.9
フ ラ ン ス	98,540	118,872	15,099,229	10.5	—	7.1	2.5	0.9
オ ラ ン ダ	16,910	20,809	2,643,228	1.8	—	1.3	0.4	0.2
ス ベ イ ン	55,700	68,113	8,651,805	6.0	—	4.0	1.5	0.5
ベ ル ギ ー	22,390	28,051	3,563,115	2.5	—	1.9	0.4	0.2
オーストリア	13,860	17,018	2,161,747	1.5	—	1.0	0.3	0.2
フィンランド	6,340	7,083	899,759	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,370	9,685	1,230,296	0.9	—	0.6	0.2	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 52,320	千イギリスポンド 65,385	9,477,601	6.6	—	4.9	1.0	0.7
ス ウ ェー デ ン	千スウェーデンクローナ 34,480	千スウェーデンクローナ 38,023	478,712	0.3	—	0.2	0.1	0.1
ノ ル ウ ェー	千ノルウェークローネ 25,490	千ノルウェークローネ 26,679	329,754	0.2	—	0.1	0.1	—
デ ン マー ク	千デンマーククローネ 33,690	千デンマーククローネ 42,375	723,765	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 29,920	千ポーランドズロチ 32,696	925,323	0.6	—	0.3	0.2	0.2
オーストラリア	千オーストラリアドル 43,160	千オーストラリアドル 47,732	3,863,927	2.7	—	1.9	0.5	0.2
シン ガ ポー ル	千シンガポールドル 6,910	千シンガポールドル 7,802	617,179	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 24,560	千マレーシアリンギット 26,769	695,207	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシェケル 17,140	千イスラエルシェケル 20,175	647,230	0.4	—	0.3	0.1	0.1
合 計	—	—	140,998,706	97.7	—	55.6	28.7	13.4

(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割合です。

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

(B) 個別銘柄開示

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	%	千米ドル	千米ドル	千円			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券						T 1.75% 05/15/23	1.75	1,750	1,814	191,469	2023/5/15
T 0.125% 10/15/23	0.125	5,200	5,194	548,272	2023/10/15	T 1.75% 05/31/22	1.75	2,650	2,707	285,744	2022/5/31
T 0.25% 05/31/25	0.25	1,180	1,174	123,919	2025/5/31	T 1.75% 06/30/22	1.75	2,500	2,557	269,951	2022/6/30
T 0.25% 06/30/25	0.25	4,310	4,285	452,283	2025/6/30	T 1.75% 06/30/24	1.75	2,000	2,102	221,897	2024/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	2,200	2,186	230,718	2025/7/31	T 1.75% 07/15/22	1.75	1,200	1,228	129,658	2022/7/15
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,000	6,945	733,066	2025/9/30	T 1.75% 09/30/22	1.75	1,050	1,078	113,825	2022/9/30
T 0.375% 07/31/27	0.375	4,000	3,908	412,463	2027/7/31	T 1.75% 11/15/29	1.75	3,220	3,410	359,910	2029/11/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	4,000	3,897	411,309	2027/9/30	T 1.875% 01/31/22	1.875	3,800	3,866	408,101	2022/1/31
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,770	3,757	396,564	2025/11/30	T 1.875% 03/31/22	1.875	5,100	5,204	549,250	2022/3/31
T 0.5% 03/15/23	0.5	3,980	4,011	423,412	2023/3/15	T 1.875% 04/30/22	1.875	2,800	2,861	301,982	2022/4/30
T 0.5% 03/31/25	0.5	4,000	4,026	424,930	2025/3/31	T 1.875% 05/31/22	1.875	2,350	2,404	253,812	2022/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	6,000	5,916	624,409	2027/6/30	T 1.875% 06/30/26	1.875	3,980	4,262	449,895	2026/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	1,100	1,081	114,180	2027/8/31	T 1.875% 07/31/22	1.875	2,880	2,955	311,969	2022/7/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	3,580	3,512	370,719	2027/10/31	T 1.875% 07/31/26	1.875	1,800	1,928	203,514	2026/7/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	3,400	3,389	357,700	2027/3/31	T 1.875% 08/31/22	1.875	2,600	2,671	281,992	2022/8/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	7,400	7,072	746,400	2030/5/15	T 1.875% 09/30/22	1.875	1,500	1,543	162,923	2022/9/30
T 0.625% 08/15/30	0.625	9,130	8,694	917,659	2030/8/15	T 1.875% 10/31/22	1.875	2,000	2,061	217,531	2022/10/31
T 0.625% 12/31/27	0.625	3,000	2,961	312,588	2027/12/31	T 2% 02/15/22	2.0	3,100	3,160	333,570	2022/2/15
T 0.875% 11/15/30	0.875	2,600	2,528	266,879	2030/11/15	T 2% 02/15/23	2.0	6,500	6,747	712,083	2023/2/15
T 1.125% 05/15/40	1.125	4,420	3,951	417,031	2040/5/15	T 2% 02/15/25	2.0	6,050	6,456	681,467	2025/2/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	4,000	3,565	376,250	2040/8/15	T 2% 02/15/50	2.0	3,370	3,398	358,642	2050/2/15
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,120	4,284	452,175	2050/5/15	T 2% 04/30/24	2.0	3,000	3,172	334,813	2024/4/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	3,950	4,058	428,298	2023/7/31	T 2% 05/31/24	2.0	1,500	1,587	167,579	2024/5/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	4,000	3,456	364,772	2050/8/15	T 2% 06/30/24	2.0	1,000	1,059	111,843	2024/6/30
T 1.375% 08/31/23	1.375	3,450	3,558	375,548	2023/8/31	T 2% 07/31/22	2.0	3,900	4,009	423,190	2022/7/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	3,550	3,664	386,799	2023/9/30	T 2% 08/15/25	2.0	3,750	4,021	424,391	2025/8/15
T 1.375% 10/15/22	1.375	2,250	2,298	242,543	2022/10/15	T 2% 10/31/22	2.0	4,500	4,647	490,448	2022/10/31
T 1.375% 11/15/40	1.375	700	651	68,775	2040/11/15	T 2% 11/15/26	2.0	2,700	2,912	307,431	2026/11/15
T 1.5% 01/15/23	1.5	2,000	2,053	216,752	2023/1/15	T 2% 11/30/22	2.0	5,500	5,688	600,344	2022/11/30
T 1.5% 01/31/22	1.5	3,000	3,041	321,035	2022/1/31	T 2.125% 02/29/24	2.125	1,400	1,482	156,442	2024/2/29
T 1.5% 02/15/30	1.5	1,820	1,884	198,865	2030/2/15	T 2.125% 03/31/24	2.125	1,200	1,272	134,261	2024/3/31
T 1.5% 02/28/23	1.5	1,760	1,809	191,025	2023/2/28	T 2.125% 05/15/22	2.125	5,400	5,538	584,575	2022/5/15
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	4,117	434,610	2023/3/31	T 2.125% 05/15/25	2.125	7,250	7,794	822,642	2025/5/15
T 1.5% 08/15/22	1.5	5,800	5,924	625,235	2022/8/15	T 2.125% 06/30/22	2.125	1,100	1,131	119,379	2022/6/30
T 1.5% 08/15/26	1.5	5,300	5,568	587,701	2026/8/15	T 2.125% 07/31/24	2.125	1,500	1,597	168,637	2024/7/31
T 1.5% 09/15/22	1.5	4,000	4,089	431,600	2022/9/15	T 2.125% 09/30/24	2.125	2,200	2,347	247,797	2024/9/30
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,000	8,355	881,885	2024/9/30	T 2.125% 11/30/23	2.125	2,700	2,848	300,664	2023/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,750	6,077	641,440	2026/2/15	T 2.125% 11/30/24	2.125	1,400	1,497	158,012	2024/11/30
T 1.625% 04/30/23	1.625	5,800	5,993	632,504	2023/4/30	T 2.125% 12/31/22	2.125	3,800	3,944	416,342	2022/12/31
T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	5,709	602,574	2026/5/15	T 2.25% 01/31/24	2.25	5,090	5,402	570,185	2024/1/31
T 1.625% 05/31/23	1.625	4,350	4,499	474,898	2023/5/31	T 2.25% 02/15/27	2.25	3,900	4,268	450,531	2027/2/15
T 1.625% 08/15/22	1.625	1,400	1,432	151,193	2022/8/15	T 2.25% 03/31/26	2.25	1,500	1,633	172,428	2026/3/31
T 1.625% 08/15/29	1.625	2,260	2,371	250,241	2029/8/15	T 2.25% 04/15/22	2.25	2,680	2,748	290,084	2022/4/15
T 1.625% 08/31/22	1.625	500	511	54,025	2022/8/31	T 2.25% 04/30/24	2.25	2,600	2,770	292,358	2024/4/30
T 1.625% 09/30/26	1.625	2,150	2,273	239,967	2026/9/30	T 2.25% 08/15/27	2.25	2,320	2,543	268,477	2027/8/15
T 1.625% 11/15/22	1.625	4,000	4,107	433,480	2022/11/15	T 2.25% 08/15/46	2.25	4,180	4,457	470,418	2046/8/15
T 1.625% 11/15/50	1.625	2,600	2,393	252,580	2050/11/15	T 2.25% 08/15/49	2.25	4,110	4,375	461,828	2049/8/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	3,030	3,204	338,211	2026/11/30	T 2.25% 10/31/24	2.25	2,500	2,682	283,113	2024/10/31
T 1.75% 01/31/23	1.75	2,650	2,736	288,759	2023/1/31	T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	5,368	566,638	2024/11/15
T 1.75% 02/28/22	1.75	3,650	3,714	391,999	2022/2/28	T 2.25% 11/15/25	2.25	5,500	5,972	630,376	2025/11/15
T 1.75% 03/31/22	1.75	2,500	2,547	268,864	2022/3/31	T 2.25% 11/15/27	2.25	5,260	5,770	609,006	2027/11/15
T 1.75% 04/30/22	1.75	2,000	2,040	215,375	2022/4/30	T 2.25% 12/31/23	2.25	3,500	3,709	391,524	2023/12/31
T 1.75% 05/15/22	1.75	4,600	4,696	495,705	2022/5/15	T 2.25% 12/31/24	2.25	2,900	3,118	329,176	2024/12/31

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千米ドル	千米ドル	千円			%	千米ドル	千米ドル	千円	
T 2.375% 01/31/23	2.375	5,000	5,223	551,291	2023/1/31	T 3.75% 08/15/41	3.75	1,100	1,480	156,255	2041/8/15
T 2.375% 04/30/26	2.375	1,820	1,995	210,585	2026/4/30	T 3.75% 11/15/43	3.75	2,000	2,717	286,821	2043/11/15
T 2.375% 05/15/27	2.375	3,600	3,973	419,348	2027/5/15	T 3.875% 08/15/40	3.875	680	925	97,637	2040/8/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	3,890	4,315	455,454	2029/5/15	T 4.25% 05/15/39	4.25	850	1,203	126,966	2039/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	6,700	7,201	760,096	2024/8/15	T 4.25% 11/15/40	4.25	900	1,283	135,488	2040/11/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	2,010	2,197	231,923	2049/11/15	T 4.375% 02/15/38	4.375	500	711	75,040	2038/2/15
T 2.5% 01/31/25	2.5	4,000	4,346	458,719	2025/1/31	T 4.375% 05/15/40	4.375	750	1,082	114,249	2040/5/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	2,150	2,404	253,732	2045/2/15	T 4.375% 05/15/41	4.375	550	799	84,403	2041/5/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,750	5,310	560,454	2046/2/15	T 4.375% 11/15/39	4.375	650	936	98,796	2039/11/15
T 2.5% 02/28/26	2.5	650	715	75,522	2026/2/28	T 4.5% 02/15/36	4.5	100	141	14,900	2036/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	3,700	3,975	419,617	2024/5/15	T 4.5% 05/15/38	4.5	970	1,400	147,810	2038/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	3,450	3,654	385,717	2023/8/15	T 4.5% 08/15/39	4.5	750	1,093	115,454	2039/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	1,350	1,493	157,634	2026/1/31	T 4.625% 02/15/40	4.625	1,500	2,224	234,818	2040/2/15
T 2.625% 02/15/29	2.625	5,390	6,079	641,656	2029/2/15	T 4.75% 02/15/41	4.75	750	1,138	120,130	2041/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	2,500	2,735	288,678	2025/3/31	T 5.0% 05/15/37	5.0	650	977	103,126	2037/5/15
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,900	4,202	443,489	2024/2/15	T 5.25% 02/15/29	5.25	500	666	70,369	2029/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,670	5,286	557,946	2028/2/15	T 5.25% 11/15/28	5.25	900	1,194	126,019	2028/11/15
T 2.75% 04/30/23	2.75	4,200	4,444	469,119	2023/4/30	T 5.375% 02/15/31	5.375	750	1,052	111,126	2031/2/15
T 2.75% 06/30/25	2.75	2,000	2,207	232,938	2025/6/30	T 5.5% 08/15/28	5.5	250	334	35,281	2028/8/15
T 2.75% 07/31/23	2.75	4,000	4,258	449,419	2023/7/31	T 6.0% 02/15/26	6.0	600	764	80,698	2026/2/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,450	1,694	178,857	2042/8/15	T 6.125% 11/15/27	6.125	1,050	1,422	150,148	2027/11/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	2,450	2,870	302,974	2047/8/15	T 6.25% 05/15/30	6.25	720	1,051	110,955	2030/5/15
T 2.75% 08/31/25	2.75	5,000	5,529	583,623	2025/8/31	T 6.25% 08/15/23	6.25	1,350	1,558	164,457	2023/8/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	4,450	4,768	503,317	2023/11/15	小 計				60,825,445	
T 2.75% 11/15/42	2.75	1,040	1,215	128,232	2042/11/15	(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
T 2.75% 11/15/47	2.75	2,500	2,930	309,322	2047/11/15	国債証券					
T 2.875% 04/30/25	2.875	2,300	2,543	268,429	2025/4/30	CAN 0.25% 03/01/26	0.25	890	877	72,535	2026/3/1
T 2.875% 05/15/28	2.875	2,260	2,581	272,490	2028/5/15	CAN 0.25% 11/01/22	0.25	810	811	67,067	2022/11/1
T 2.875% 05/15/43	2.875	1,050	1,251	132,088	2043/5/15	CAN 0.5% 03/01/22	0.5	1,110	1,114	92,140	2022/3/1
T 2.875% 05/15/49	2.875	4,400	5,299	559,355	2049/5/15	CAN 0.5% 09/01/25	0.5	1,330	1,331	110,069	2025/9/1
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,000	5,552	585,994	2025/7/31	CAN 0.5% 12/01/30	0.5	630	601	49,701	2030/12/1
T 2.875% 08/15/28	2.875	4,200	4,805	507,195	2028/8/15	CAN 1% 06/01/27	1.0	940	962	79,593	2027/6/1
T 2.875% 08/15/45	2.875	1,480	1,766	186,438	2045/8/15	CAN 1% 09/01/22	1.0	2,680	2,716	224,578	2022/9/1
T 2.875% 09/30/23	2.875	1,650	1,768	186,636	2023/9/30	CAN 1.25% 03/01/25	1.25	450	465	38,468	2025/3/1
T 2.875% 11/30/23	2.875	6,000	6,454	681,252	2023/11/30	CAN 1.25% 06/01/30	1.25	2,560	2,632	217,644	2030/6/1
T 3% 02/15/48	3.0	4,400	5,398	569,803	2048/2/15	CAN 1.5% 02/01/22	1.5	1,220	1,236	102,231	2022/2/1
T 3% 02/15/49	3.0	1,940	2,388	252,127	2049/2/15	CAN 1.5% 05/01/22	1.5	990	1,006	83,228	2022/5/1
T 3% 05/15/42	3.0	1,100	1,336	141,036	2042/5/15	CAN 1.5% 06/01/23	1.5	2,010	2,070	171,152	2023/6/1
T 3% 05/15/45	3.0	2,100	2,558	269,995	2045/5/15	CAN 1.5% 06/01/26	1.5	840	883	73,009	2026/6/1
T 3% 05/15/47	3.0	3,400	4,165	439,574	2047/5/15	CAN 1.75% 03/01/23	1.75	700	722	59,726	2023/3/1
T 3% 08/15/48	3.0	4,910	6,034	636,901	2048/8/15	CAN 2% 06/01/28	2.0	800	872	72,154	2028/6/1
T 3% 09/30/25	3.0	3,660	4,095	432,222	2025/9/30	CAN 2% 09/01/23	2.0	1,180	1,233	101,953	2023/9/1
T 3% 10/31/25	3.0	1,000	1,120	118,229	2025/10/31	CAN 2% 12/01/51	2.0	1,730	1,904	157,484	2051/12/1
T 3% 11/15/44	3.0	2,050	2,494	263,262	2044/11/15	CAN 2.25% 03/01/24	2.25	670	710	58,749	2024/3/1
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,000	1,238	130,729	2042/2/15	CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,530	1,650	136,472	2025/6/1
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,100	2,601	274,531	2043/2/15	CAN 2.25% 06/01/29	2.25	390	434	35,945	2029/6/1
T 3.125% 05/15/48	3.125	1,400	1,757	185,433	2048/5/15	CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,780	1,910	157,919	2024/6/1
T 3.125% 08/15/44	3.125	2,600	3,226	340,539	2044/8/15	CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,000	1,034	85,515	2022/6/1
T 3.125% 11/15/28	3.125	3,960	4,612	486,832	2028/11/15	CAN 2.75% 12/01/48	2.75	810	1,026	84,911	2048/12/1
T 3.125% 11/15/41	3.125	870	1,075	113,512	2041/11/15	CAN 2.75% 12/01/64	2.75	290	396	32,804	2064/12/1
T 3.375% 05/15/44	3.375	2,000	2,577	272,029	2044/5/15	CAN 3.5% 12/01/45	3.5	900	1,267	104,818	2045/12/1
T 3.5% 02/15/39	3.5	900	1,164	122,947	2039/2/15	CAN 4.0% 06/01/41	4.0	490	713	58,962	2041/6/1
T 3.625% 02/15/44	3.625	1,600	2,137	225,604	2044/2/15	CAN 5% 06/01/37	5.0	520	804	66,498	2037/6/1
T 3.625% 08/15/43	3.625	1,600	2,134	225,261	2043/8/15	CAN 5.75% 06/01/29	5.75	960	1,339	110,710	2029/6/1

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	670	1,023	84,631	2033/6/1	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,310	2,598	330,113	2040/7/4
小 計				2,790,681		DBR 5.5% 01/04/31	5.5	1,640	2,643	335,808	2031/1/4
(メキシコ)						DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	2,168	275,454	2028/1/4
国債証券						DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,370	1,653	209,993	2024/1/4
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,400	8,873	46,583	2036/11/20	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	610	991	125,910	2030/1/4
MBONO 10% 12/05/24	10.0	24,100	28,859	151,514	2024/12/5	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,270	1,868	237,346	2027/7/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	10,710	11,256	59,096	2026/3/5	OBL 0% 04/05/24	—	1,760	1,801	228,835	2024/4/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	17,400	17,932	94,148	2022/6/9	OBL 0% 04/08/22	—	1,460	1,471	186,925	2022/4/8
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	20,920	21,987	115,433	2023/3/9	OBL 0% 04/11/25	—	1,700	1,752	222,543	2025/4/11
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	22,800	26,081	136,928	2027/6/3	OBL 0% 04/14/23	—	1,110	1,128	143,288	2023/4/14
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	10,950	12,818	67,298	2031/5/29	OBL 0% 10/07/22	—	1,530	1,548	196,631	2022/10/7
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	13,980	15,782	82,857	2042/11/13	OBL 0% 10/10/25	—	1,170	1,209	153,620	2025/10/10
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	4,320	5,062	26,575	2034/11/23	OBL 0% 10/18/24	—	2,150	2,208	280,556	2024/10/18
MBONO 8% 09/05/24	8.0	5,910	6,618	34,746	2024/9/5	(イタリア)					
MBONO 8% 11/07/47	8.0	11,460	13,247	69,547	2047/11/7	国債証券					
MBONO 8% 12/07/23	8.0	15,420	16,949	88,987	2023/12/7	BTPS 0% 01/15/24	—	300	302	38,427	2024/1/15
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	20,040	24,499	128,620	2029/5/31	BTPS 0.05% 01/15/23	0.05	330	332	42,283	2023/1/15
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	9,870	12,031	63,163	2038/11/18	BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	1,100	1,117	141,995	2023/8/15
小 計				1,165,501		BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	1,740	1,776	225,656	2025/2/1
(ドイツ)						BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	720	736	93,577	2023/6/15
国債証券						BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	560	575	73,042	2023/10/15
BKO 0% 03/11/22	—	830	836	106,210	2022/3/11	BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	1,100	1,149	146,010	2027/1/15
BKO 0% 06/10/22	—	2,150	2,169	275,616	2022/6/10	BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	1,500	1,529	194,222	2022/8/1
BKO 0% 02/15/30	—	2,060	2,157	274,022	2030/2/15	BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	1,720	1,767	224,508	2023/3/1
DBR 0% 05/15/35	—	1,500	1,557	197,857	2035/5/15	BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	320	319	40,541	2037/3/1
DBR 0% 08/15/26	—	1,620	1,683	213,822	2026/8/15	BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	860	884	112,310	2023/3/15
DBR 0% 08/15/29	—	2,430	2,544	323,242	2029/8/15	BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	1,630	1,704	216,458	2030/8/1
DBR 0% 08/15/30	—	1,480	1,549	196,787	2030/8/15	BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,000	1,050	133,471	2027/9/15
DBR 0% 08/15/50	—	1,160	1,155	146,824	2050/8/15	BTPS 1.2% 04/01/22	1.2	1,000	1,018	129,377	2022/4/1
DBR 0% 11/15/27	—	1,580	1,648	209,405	2027/11/15	BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,170	1,251	158,922	2026/12/1
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	1,920	2,029	257,798	2027/2/15	BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	350	379	48,154	2030/4/1
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,880	2,007	255,011	2029/2/15	BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	1,000	1,020	129,667	2022/4/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	1,300	1,385	176,007	2028/8/15	BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,130	1,216	154,502	2036/3/1
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	1,140	1,197	152,105	2025/2/15	BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	1,070	1,141	145,048	2025/5/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	2,300	2,442	310,247	2026/2/15	BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,550	1,596	202,759	2022/9/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,510	1,632	207,391	2028/2/15	BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	600	637	80,960	2024/11/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	900	969	123,149	2027/8/15	BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,500	1,605	203,910	2025/6/1
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,610	1,710	217,230	2024/8/15	BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,465	186,119	2026/6/1
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,250	2,427	308,404	2025/8/15	BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	1,340	1,488	189,069	2032/3/1
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	1,560	2,105	267,401	2048/8/15	BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	1,330	1,476	187,499	2030/12/1
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	950	993	126,164	2023/2/15	BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	750	794	100,861	2051/9/1
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,290	2,407	305,759	2023/5/15	BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	990	1,056	134,247	2024/7/1
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	1,020	1,095	139,182	2024/5/15	BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	650	719	91,435	2041/3/1
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	920	952	120,948	2022/9/4	BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	750	801	101,828	2024/5/15
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,250	1,345	170,914	2024/2/15	BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	820	890	113,132	2025/7/1
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	1,650	1,706	216,815	2022/7/4	BTPS 2% 02/01/28	2.0	380	427	54,251	2028/2/1
DBR 2% 08/15/23	2.0	1,890	2,021	256,819	2023/8/15	BTPS 2% 12/01/25	2.0	1,050	1,154	146,704	2025/12/1
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,840	2,984	379,046	2044/7/4	BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,040	1,167	148,244	2027/8/1
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,980	3,289	417,864	2046/8/15	BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	1,470	1,636	207,816	2026/7/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,240	2,163	274,822	2042/7/4	BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	1,700	1,921	244,113	2027/6/1
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	1,670	2,834	360,032	2037/1/4	BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	990	1,180	149,900	2036/9/1
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,240	2,285	290,259	2039/7/4	BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	990	1,191	151,393	2033/9/1
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	700	986	125,364	2028/7/4	BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	500	621	78,949	2050/9/1
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,690	2,882	366,192	2034/7/4	BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	870	934	118,688	2023/10/1

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	660	741	94,139	2025/11/15	FRTR 1% 05/25/27	1.0	2,480	2,717	345,219	2027/5/25
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	1,300	1,433	182,020	2024/12/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0	2,240	2,412	306,458	2025/11/25
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,240	1,604	203,826	2047/3/1	FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	2,400	2,809	356,842	2034/5/25
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	600	803	102,076	2067/3/1	FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	2,410	2,843	361,167	2036/5/25
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,260	1,503	190,911	2028/12/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	2,950	3,476	441,560	2031/5/25
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	1,100	1,435	182,334	2038/9/1	FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	1,960	2,507	318,503	2050/5/25
BTPS 3% 08/01/29	3.0	1,760	2,147	272,748	2029/8/1	FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	2,600	2,746	348,838	2023/5/25
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	520	694	88,189	2040/3/1	FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	850	1,225	155,605	2066/5/25
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	680	960	121,955	2046/9/1	FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	2,010	2,589	328,977	2039/6/25
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,260	1,676	212,903	2035/3/1	FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	1,980	2,161	274,524	2024/11/25
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,120	1,643	208,788	2048/3/1	FRTR 2% 05/25/48	2.0	2,140	3,007	381,992	2048/5/25
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	1,950	2,484	315,583	2030/3/1	FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	2,040	2,237	284,219	2024/5/25
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	1,740	1,985	252,215	2024/9/1	FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	1,700	1,785	226,821	2022/10/25
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,320	2,075	263,677	2049/9/1	FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	2,450	3,094	393,078	2030/5/25
BTPS 4% 02/01/37	4.0	1,800	2,603	330,644	2037/2/1	FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	2,730	3,332	423,260	2027/10/25
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	1,130	1,295	164,551	2024/3/1	FRTR 3% 04/25/22	3.0	3,750	3,916	497,478	2022/4/25
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	1,980	2,433	309,160	2026/3/1	FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	1,710	2,870	364,568	2045/5/25
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	1,050	1,164	147,937	2023/5/1	FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,120	3,792	481,705	2026/4/25
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	1,610	1,816	230,688	2023/8/1	FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,070	2,231	283,450	2055/4/25
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	1,810	2,413	306,533	2028/9/1	FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,080	2,376	301,802	2060/4/25
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,230	2,095	266,200	2044/9/1	FRTR 4% 10/25/38	4.0	1,600	2,692	342,011	2038/10/25
BTPS 5% 03/01/22	5.0	650	687	87,318	2022/3/1	FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	2,870	3,257	413,786	2023/10/25
BTPS 5% 03/01/25	5.0	1,740	2,105	267,494	2025/3/1	FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	2,340	4,330	550,104	2041/4/25
BTPS 5% 08/01/34	5.0	1,800	2,765	351,274	2034/8/1	FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	1,810	3,046	386,994	2035/4/25
BTPS 5% 09/01/40	5.0	1,600	2,678	340,257	2040/9/1	FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	2,500	3,732	474,070	2029/4/25
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	1,440	2,386	303,195	2039/8/1	FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	2,350	3,998	507,943	2032/10/25
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	2,300	3,261	414,230	2029/11/1	FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,450	1,909	242,607	2025/10/25
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,700	1,856	235,797	2022/9/1	FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,100	1,325	168,313	2023/4/25
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	2,200	2,423	307,894	2022/11/1	(オランダ) 国債証券					
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	1,570	2,482	315,333	2033/2/1						
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,940	2,991	380,004	2031/5/1	NETHER 0% 01/15/24	—	550	561	71,332	2024/1/15
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,070	2,940	373,530	2027/11/1	NETHER 0% 01/15/27	—	480	496	63,127	2027/1/15
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	350	494	62,798	2026/11/1	NETHER 0% 01/15/52	—	390	380	48,389	2052/1/15
BTPS 9% 11/01/23	9.0	1,800	2,260	287,153	2023/11/1	NETHER 0% 07/15/30	—	850	881	111,998	2030/7/15
(フランス) 国債証券						NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	920	957	121,637	2025/7/15
						NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	630	668	84,881	2029/7/15
FRTR 0% 02/25/22	—	2,970	2,990	379,810	2022/2/25	NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	620	690	87,648	2040/1/15
FRTR 0% 02/25/23	—	610	618	78,563	2023/2/25	NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,260	1,338	169,976	2026/7/15
FRTR 0% 02/25/26	—	1,690	1,737	220,758	2026/2/25	NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	978	124,292	2027/7/15
FRTR 0% 03/25/23	—	1,880	1,907	242,274	2023/3/25	NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,040	1,140	144,820	2028/7/15
FRTR 0% 03/25/24	—	3,640	3,714	471,872	2024/3/25	NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,000	1,060	134,705	2023/7/15
FRTR 0% 03/25/25	—	2,310	2,368	300,871	2025/3/25	NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,460	1,597	202,886	2024/7/15
FRTR 0% 05/25/22	—	1,350	1,361	172,943	2022/5/25	NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	750	781	99,288	2022/7/15
FRTR 0% 11/25/29	—	3,300	3,390	430,667	2029/11/25	NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	860	1,153	146,481	2033/1/15
FRTR 0% 11/25/30	—	1,830	1,871	237,753	2030/11/25	NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,110	1,909	242,489	2047/1/15
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	2,050	2,143	272,311	2026/11/25	NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	300	326	41,420	2023/1/15
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,350	3,511	446,026	2025/5/25	NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,060	1,918	243,641	2042/1/15
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	3,130	3,307	420,134	2026/5/25	NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,020	1,714	217,732	2037/1/15
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	2,830	3,033	385,301	2029/5/25	NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,010	1,442	183,288	2028/1/15
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	720	755	95,946	2040/5/25	NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	700	812	103,188	2023/1/15
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	390	359	45,662	2072/5/25	(スペイン) 国債証券					
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	2,960	3,218	408,790	2028/5/25						
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,330	1,416	179,875	2052/5/25	SPGB 0% 01/31/25	—	1,240	1,260	160,095	2025/1/31
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	2,510	2,737	347,756	2028/11/25	SPGB 0% 04/30/23	—	1,360	1,375	174,776	2023/4/30

当 期 末						当 期 末						
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額		
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	480	476	60,480	2031/4/30	BGB 1.25% 04/22/33	1.25	330	385	48,943	2033/4/22	
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	1,000	1,024	130,173	2024/7/30	BGB 1.45% 06/22/37	1.45	400	486	61,737	2037/6/22	
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	1,570	1,603	203,718	2023/7/30	BGB 1.6% 06/22/47	1.6	690	885	112,497	2047/6/22	
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	1,040	1,052	133,652	2022/4/30	BGB 1.7% 06/22/50	1.7	490	650	82,589	2050/6/22	
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	800	813	103,383	2022/10/31	BGB 1.9% 06/22/38	1.9	510	661	84,065	2038/6/22	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	1,980	2,058	261,524	2030/4/30	BGB 2.15% 06/22/66	2.15	440	697	88,609	2066/6/22	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	1,200	1,261	160,243	2029/10/31	BGB 2.25% 06/22/23	2.25	970	1,038	131,884	2023/6/22	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	480	511	64,908	2027/7/30	BGB 2.25% 06/22/57	2.25	380	589	74,833	2057/6/22	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	850	850	107,970	2050/10/31	BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,200	1,333	169,425	2024/6/22	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	750	813	103,390	2040/10/31	BGB 3% 06/22/34	3.0	680	957	121,601	2034/6/22	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	1,200	1,330	169,033	2030/10/31	BGB 3.75% 06/22/45	3.75	650	1,157	146,999	2045/6/22	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	1,460	1,594	202,571	2026/10/31	BGB 4% 03/28/22	4.0	790	832	105,696	2022/3/28	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	1,020	1,133	143,957	2028/4/30	BGB 4% 03/28/32	4.0	620	912	115,872	2032/3/28	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	1,320	1,469	186,691	2028/7/30	BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,110	1,974	250,846	2041/3/28	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	750	841	106,887	2029/4/30	BGB 4.25% 09/28/22	4.25	940	1,016	129,145	2022/9/28	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,840	2,041	259,315	2027/10/31	BGB 4.5% 03/28/26	4.5	750	949	120,551	2026/3/28	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,970	2,185	277,546	2027/4/30	BGB 5% 03/28/35	5.0	1,270	2,174	276,252	2035/3/28	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,250	1,357	172,423	2025/4/30	BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,190	1,706	216,796	2028/3/28	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,290	1,540	195,730	2035/7/30	(オーストリア) 国債証券						
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	1,340	1,501	190,743	2026/4/30		RAGB 0% 02/20/30	—	660	679	86,318	2030/2/20
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,680	1,976	251,029	2030/7/30		RAGB 0% 07/15/23	—	650	660	83,910	2023/7/15
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,760	1,972	250,549	2025/10/31		RAGB 0% 07/15/24	—	590	603	76,640	2024/7/15
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	1,290	1,608	204,346	2033/7/30		RAGB 0% 09/20/22	—	430	434	55,225	2022/9/20
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,060	1,513	192,295	2048/10/31		RAGB 0% 10/20/40	—	220	215	27,411	2040/10/20
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	1,560	1,747	221,937	2024/10/31		RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	700	752	95,607	2029/2/20
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,100	1,606	204,068	2046/10/31		RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	650	693	88,035	2027/4/20
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	980	1,705	216,656	2066/7/30		RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	620	674	85,712	2028/2/20
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	1,500	1,709	217,124	2024/4/30		RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	260	295	37,583	2051/3/20
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,310	2,054	260,919	2037/1/31	RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	600	645	81,994	2026/10/20	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,320	1,498	190,400	2023/10/31	RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	200	232	29,523	2120/6/30	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	1,410	1,731	219,946	2025/7/30	RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	640	695	88,371	2025/10/20	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,300	2,283	290,098	2041/7/30	RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	450	597	75,944	2047/2/20	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	1,150	1,333	169,355	2024/1/31	RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	230	357	45,351	2086/11/2	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,310	2,324	295,293	2040/7/30	RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	560	608	77,301	2024/10/21	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	1,100	1,545	196,354	2028/10/31	RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	750	799	101,540	2023/10/20	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	950	1,836	233,239	2044/10/31	RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	340	687	87,268	2117/9/20	
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	1,790	2,001	254,197	2023/1/31	RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	530	710	90,259	2034/5/23	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	1,450	2,356	299,322	2032/7/30	RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	470	797	101,310	2044/6/20	
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	1,780	1,891	240,269	2022/1/31	RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,210	1,298	164,964	2022/11/22	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,360	1,826	231,978	2026/7/30	RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	500	525	66,799	2022/4/20	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	2,350	3,489	443,202	2029/1/31	RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	230	532	67,688	2062/1/26	
(ベルギー) 国債証券						RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	920	1,545	196,316	2037/3/15	
	BGB 0% 10/22/27	—	790	815	103,596	2027/10/22	RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	760	976	123,976	2026/3/15
	BGB 0.1% 06/22/30	0.1	730	755	96,021	2030/6/22	RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	690	997	126,689	2027/7/15
	BGB 0.2% 10/22/23	0.2	640	655	83,256	2023/10/22	(フィンランド) 国債証券					
	BGB 0.4% 06/22/40	0.4	290	297	37,811	2040/6/22		RFGB 0% 04/15/22	—	250	252	32,011
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	490	511	64,928	2024/10/22	RFGB 0% 09/15/23		—	100	101	12,937	2023/9/15
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,100	1,169	148,528	2025/6/22	RFGB 0% 09/15/24		—	300	307	39,051	2024/9/15
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	750	813	103,299	2027/6/22	RFGB 0% 09/15/30		—	40	41	5,232	2030/9/15
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	980	1,070	136,021	2028/6/22	RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	270	276	35,138	2036/4/15	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	990	1,095	139,171	2029/6/22	RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	200	207	26,308	2040/9/15	
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,080	1,172	148,890	2026/6/22	RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	470	497	63,213	2026/4/15	
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,140	1,285	163,239	2031/6/22							

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円			%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
RFCB 0.5% 09/15/27	0.5	380	406	51,595	2027/9/15	UKT 1.625% 10/22/71	1.625	470	605	87,801	2071/10/22
RFCB 0.5% 09/15/28	0.5	470	504	64,101	2028/9/15	UKT 1.75% 01/22/49	1.75	600	700	101,481	2049/1/22
RFCB 0.5% 09/15/29	0.5	290	312	39,685	2029/9/15	UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,060	1,296	187,894	2057/7/22
RFCB 0.75% 04/15/31	0.75	270	299	38,012	2031/4/15	UKT 1.75% 09/07/22	1.75	1,640	1,685	244,369	2022/9/7
RFCB 0.875% 09/15/25	0.875	300	321	40,821	2025/9/15	UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,540	1,743	252,666	2037/9/7
RFCB 1.125% 04/15/34	1.125	350	408	51,860	2034/4/15	UKT 2% 09/07/25	2.0	420	456	66,188	2025/9/7
RFCB 1.375% 04/15/47	1.375	230	303	38,535	2047/4/15	UKT 2.25% 09/07/23	2.25	1,160	1,226	177,815	2023/9/7
RFCB 1.5% 04/15/23	1.5	590	618	78,591	2023/4/15	UKT 2.5% 07/22/65	2.5	940	1,450	210,320	2065/7/22
RFCB 1.625% 09/15/22	1.625	380	394	50,079	2022/9/15	UKT 2.75% 09/07/24	2.75	820	899	130,365	2024/9/7
RFCB 2% 04/15/24	2.0	410	445	56,607	2024/4/15	UKT 3.25% 01/22/44	3.25	1,430	2,076	301,018	2044/1/22
RFCB 2.625% 07/04/42	2.625	340	526	66,818	2042/7/4	UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,400	2,128	308,520	2045/1/22
RFCB 2.75% 07/04/28	2.75	380	472	60,028	2028/7/4	UKT 3.5% 07/22/68	3.5	910	1,782	258,315	2068/7/22
RFCB 4% 07/04/25	4.0	320	386	49,130	2025/7/4	UKT 3.75% 07/22/52	3.75	910	1,569	227,491	2052/7/22
(アイルランド)						UKT 4% 01/22/60	4.0	840	1,646	238,607	2060/1/22
国債証券						UKT 4% 03/07/22	4.0	910	949	137,621	2022/3/7
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	460	479	60,911	2027/5/15	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,200	1,787	259,154	2036/3/7
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	470	489	62,114	2030/10/18	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,290	1,806	261,873	2032/6/7
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	180	189	24,066	2035/5/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	820	1,285	186,397	2039/9/7
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	630	639	81,258	2022/3/15	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	750	953	138,168	2027/12/7
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	440	482	61,241	2028/5/15	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,050	1,673	242,511	2040/12/7
IRISH 1% 05/15/26	1.0	730	789	100,335	2026/5/15	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,060	1,826	264,730	2046/12/7
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	550	615	78,194	2029/5/15	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	980	1,757	254,796	2049/12/7
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	690	807	102,535	2033/5/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,040	2,017	292,467	2055/12/7
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	340	394	50,065	2031/3/18	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,080	1,606	232,846	2034/9/7
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	300	385	48,936	2050/5/15	UKT 4.5% 12/07/42	4.5	1,170	1,973	285,994	2042/12/7
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	490	616	78,277	2037/5/15	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	850	1,197	173,604	2030/12/7
IRISH 2% 02/18/45	2.0	580	806	102,398	2045/2/18	UKT 4.75% 12/07/38	4.75	880	1,442	209,068	2038/12/7
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	770	963	122,330	2030/5/15	UKT 5% 03/07/25	5.0	600	720	104,439	2025/3/7
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	460	518	65,804	2024/3/18	UKT 6.0% 12/07/28	6.0	450	646	93,670	2028/12/7
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	580	636	80,812	2023/3/20						
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	700	873	111,011	2025/3/13						
小 計				58,458,375		小 計				9,477,601	
(イギリス)						(スウェーデン)					
国債証券						国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,750	1,747	253,345	2026/1/30	SGB 0.125% 05/12/31	0.125	1,690	1,687	21,251	2031/5/12
UKT 0.125% 01/31/23	0.125	2,050	2,053	297,676	2023/1/31	SGB 0.75% 05/12/28	0.75	3,860	4,085	51,434	2028/5/12
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	980	981	142,274	2024/1/31	SGB 0.75% 11/12/29	0.75	3,770	4,005	50,435	2029/11/12
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	1,320	1,304	189,020	2028/1/31	SGB 1% 11/12/26	1.0	4,940	5,274	66,404	2026/11/12
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	1,870	1,848	267,890	2030/10/22	SGB 1.5% 11/13/23	1.5	5,670	5,962	75,065	2023/11/13
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	1,800	1,813	262,885	2022/7/22	SGB 2.5% 05/12/25	2.5	4,380	4,901	61,712	2025/5/12
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	670	557	80,821	2061/10/22	SGB 3.5% 03/30/39	3.5	2,950	4,520	56,917	2039/3/30
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,460	1,494	216,589	2025/6/7	SGB 3.5% 06/01/22	3.5	7,220	7,584	95,491	2022/6/1
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	870	845	122,594	2035/7/31	小 計				478,712	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	1,200	1,060	153,648	2050/10/22	(ノルウェー)					
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	940	957	138,721	2023/7/22	国債証券					
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	190	182	26,402	2046/1/31	NOB 1.375% 08/19/30	1.375	2,800	2,845	35,170	2030/8/19
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	550	571	82,812	2029/10/22	NOB 1.5% 02/19/26	1.5	3,110	3,219	39,787	2026/2/19
UKT 1% 04/22/24	1.0	1,450	1,495	216,735	2024/4/22	NOB 1.75% 02/17/27	1.75	2,900	3,045	37,642	2027/2/17
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	1,190	1,266	183,609	2027/7/22	NOB 1.75% 03/13/25	1.75	3,120	3,255	40,238	2025/3/13
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	1,140	1,190	172,535	2041/10/22	NOB 1.75% 09/06/29	1.75	2,470	2,596	32,092	2029/9/6
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,060	1,137	164,921	2026/7/22	NOB 2% 04/26/28	2.0	2,510	2,682	33,154	2028/4/26
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,310	1,442	209,142	2047/7/22	NOB 2% 05/24/23	2.0	4,940	5,118	63,269	2023/5/24
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,400	1,539	223,111	2028/10/22	NOB 3% 03/14/24	3.0	3,640	3,915	48,397	2024/3/14
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	850	984	142,661	2054/10/22	小 計				329,754	

当 期 末						当 期 末					
銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク) 国債証券	%	千デンマーク クローネ	千デンマーク クローネ	千円		キオースト ラリアドル	%	キオースト ラリアドル	キオースト ラリアドル	千円	
DGB 0.25% 11/15/22	0.25	3,800	3,855	65,854	2022/11/15	ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	1,810	2,023	163,836	2023/4/21
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	1,580	1,622	27,714	2052/11/15	ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	3,270	3,536	286,245	2022/7/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	5,260	5,594	95,555	2027/11/15	小 計				3,863,927	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	6,410	6,886	117,622	2029/11/15	(シンガポール) 国債証券		千シンガ ポールドル	千シンガ ポールドル		
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	4,170	4,415	75,419	2023/11/15	STGB 1.75% 02/01/23	1.75	410	421	33,353	2023/2/1
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	4,230	4,697	80,234	2025/11/15	STGB 1.75% 04/01/22	1.75	160	162	12,866	2022/4/1
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	8,240	15,302	261,363	2039/11/15	STGB 2% 02/01/24	2.0	90	94	7,461	2024/2/1
小 計				723,765		STGB 2.125% 06/01/26	2.125	520	560	44,297	2026/6/1
(ポーランド) 国債証券		千ポーランド ズロチ	千ポーランド ズロチ			STGB 2.25% 08/01/36	2.25	340	384	30,419	2036/8/1
POLGB 0% 07/25/22	—	1,000	999	28,296	2022/7/25	STGB 2.375% 06/01/25	2.375	500	540	42,729	2025/6/1
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	720	730	20,665	2025/4/25	STGB 2.75% 07/01/39	2.75	230	265	21,010	2039/7/1
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	780	779	22,059	2030/10/25	STGB 2.625% 05/01/28	2.625	190	213	16,856	2028/5/1
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	3,900	4,006	113,393	2022/4/25	STGB 2.75% 03/01/46	2.75	630	797	63,060	2046/3/1
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	2,860	3,068	86,848	2024/10/25	STGB 2.75% 04/01/42	2.75	300	369	29,210	2042/4/1
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	1,550	1,624	45,977	2023/1/25	STGB 2.75% 07/01/23	2.75	540	571	45,175	2023/7/1
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	1,880	2,021	57,197	2024/4/25	STGB 2.875% 07/01/29	2.875	640	736	58,288	2029/7/1
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	3,420	3,767	106,609	2026/7/25	STGB 2.875% 09/01/30	2.875	550	641	50,716	2030/9/1
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	1,910	2,117	59,913	2027/7/25	STGB 3% 09/01/24	3.0	510	556	43,984	2024/9/1
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	2,070	2,336	66,118	2028/4/25	STGB 3.125% 09/01/22	3.125	430	448	35,504	2022/9/1
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	3,640	4,138	117,119	2029/10/25	STGB 3.375% 09/01/33	3.375	340	423	33,517	2033/9/1
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	1,710	1,921	54,382	2025/7/25	STGB 3.5% 03/01/27	3.5	530	615	48,724	2027/3/1
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,080	2,301	65,125	2023/10/25	小 計				617,179	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	900	1,243	35,195	2029/4/25	(マレーシア) 国債証券		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット		
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	1,500	1,640	46,422	2022/9/23	MCS 3.418% 08/15/22	3.418	1,220	1,249	32,446	2022/8/15
小 計				925,323		MCS 3.48% 03/15/23	3.48	1,300	1,343	34,895	2023/3/15
(オーストラリア) 国債証券		キオースト ラリアドル	キオースト ラリアドル			MCS 3.502% 05/31/27	3.502	100	106	2,766	2027/5/31
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	1,730	1,733	140,327	2024/11/21	MCS 3.733% 06/15/28	3.733	300	324	8,435	2028/6/15
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	1,000	994	80,475	2025/11/21	MCS 3.757% 05/22/40	3.757	150	153	3,974	2040/5/22
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	1,540	1,536	124,404	2026/9/21	MCS 3.795% 09/30/22	3.795	800	825	21,440	2022/9/30
ACGB 1% 11/21/31	1.0	1,810	1,758	142,355	2031/11/21	MCS 3.8% 08/17/23	3.8	550	575	14,948	2023/8/17
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,220	2,180	176,517	2030/12/21	MCS 3.844% 04/15/33	3.844	860	898	23,324	2033/4/15
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	1,140	1,131	91,566	2032/5/21	MCS 3.882% 03/10/22	3.882	930	950	24,695	2022/3/10
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	1,190	1,220	98,829	2031/6/21	MCS 3.882% 03/14/25	3.882	690	736	19,128	2025/3/14
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	990	882	71,440	2051/6/21	MCS 3.885% 08/15/29	3.885	1,530	1,663	43,197	2029/8/15
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,260	2,487	201,327	2028/5/21	MCS 3.892% 03/15/27	3.892	780	846	21,989	2027/3/15
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	430	446	36,151	2022/11/21	MCS 3.899% 11/16/27	3.899	1,160	1,263	32,815	2027/11/16
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	2,480	2,783	225,326	2030/5/21	MCS 3.9% 11/30/26	3.9	360	393	10,207	2026/11/30
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,590	2,808	227,334	2024/4/21	MCS 3.906% 07/15/26	3.906	1,010	1,094	28,416	2026/7/15
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	810	910	73,711	2041/5/21	MCS 3.955% 09/15/25	3.955	520	561	14,580	2025/9/15
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	630	724	58,636	2035/6/21	MCS 4.059% 09/30/24	4.059	750	803	20,860	2024/9/30
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,400	1,586	128,430	2027/11/21	MCS 4.181% 07/15/24	4.181	1,090	1,167	30,321	2024/7/15
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,750	1,993	161,343	2028/11/21	MCS 4.232% 06/30/31	4.232	850	947	24,604	2031/6/30
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,640	1,873	151,679	2029/11/21	MCS 4.254% 05/31/35	4.254	1,270	1,393	36,181	2035/5/31
ACGB 3% 03/21/47	3.0	880	1,025	83,049	2047/3/21	MCS 4.392% 04/15/26	4.392	1,160	1,280	33,265	2026/4/15
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	1,750	1,967	159,298	2025/4/21	MCS 4.498% 04/15/30	4.498	1,260	1,431	37,163	2030/4/15
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,330	2,750	222,648	2029/4/21	MCS 4.642% 11/07/33	4.642	1,160	1,305	33,911	2033/11/7
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	650	787	63,711	2039/6/21	MCS 4.736% 03/15/46	4.736	1,090	1,221	31,722	2046/3/15
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	810	1,039	84,187	2037/4/21	MCS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,333	34,639	2037/4/7
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	2,600	3,109	251,724	2026/4/21	MCS 4.893% 06/08/38	4.893	1,080	1,247	32,394	2038/6/8
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,220	1,650	133,611	2033/4/21	MCS 4.921% 07/06/48	4.921	900	1,039	26,989	2048/7/6
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,230	2,788	225,754	2027/4/21	MCS 4.935% 09/30/43	4.935	530	611	15,890	2043/9/30
小 計						小 計				695,207	

当 期 末						当 期 末							
銘 柄		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	銘 柄		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額						外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		%	千イスラエル	千イスラエル	千円				%	千イスラエル	千イスラエル	千円	
国債証券			ルシェケル	ルシェケル			ILGOV 6.25% 10/30/26		6.25	3,300	4,390	140,852	2026/10/30
ILGOV 0.5% 04/30/25		0.5	460	464	14,905	2025/4/30	小 計					647,230	
ILGOV 0.75% 07/31/22		0.75	3,180	3,213	103,091	2022/7/31	合 計					140,998,706	
ILGOV 1% 03/31/30		1.0	960	970	31,123	2030/3/31							
ILGOV 1.5% 05/31/37		1.5	740	736	23,631	2037/5/31							
ILGOV 1.5% 11/30/23		1.5	320	332	10,668	2023/11/30							
ILGOV 1.75% 08/31/25		1.75	1,040	1,112	35,676	2025/8/31							
ILGOV 2.25% 09/28/28		2.25	1,400	1,563	50,143	2028/9/28							
ILGOV 3.75% 03/31/24		3.75	2,000	2,225	71,380	2024/3/31							
ILGOV 3.75% 03/31/47		3.75	1,330	1,810	58,083	2047/3/31							
ILGOV 4.25% 03/31/23		4.25	200	217	6,987	2023/3/31							
ILGOV 5.5% 01/31/22		5.5	940	990	31,789	2022/1/31							
ILGOV 5.5% 01/31/42		5.5	1,270	2,147	68,897	2042/1/31							

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

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国	EURO-SCHATZ	百万円 185	百万円 —
	US 5YR NOTE	358	—
	EURO-BOBL FU	291	—
	EURO-BUND	760	—
	US 10YR NOTE	245	—
	US LONG BOND	316	—

(注) 外貨建の評価額は、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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
	140,998,706	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,426,921	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	144,425,627	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(142,323,161千円)の投資信託財産総額(144,425,627千円)に対する比率は98.5%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=105.54円	1カナダドル=82.68円	1メキシコペソ=5.25円
1ユーロ=127.02円	1イギリスポンド=144.95円	1スウェーデンクローナ=12.59円
1ノルウェークローネ=12.36円	1デンマーククローネ=17.08円	1ポーランドズロチ=28.30円
1オーストラリアドル=80.95円	1シンガポールドル=79.10円	1マレーシアリンギット=25.97円
1イスラエルシェケル=32.08円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年2月8日現在
(A) 資 産	146,405,742,032円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,108,918,499
公 社 債(評価額)	140,998,706,512
未 収 入 金	2,001,258,775
未 収 利 息	926,317,396
前 払 費 用	22,745,824
差 入 委 託 証 拠 金	347,795,026
(B) 負 債	2,059,602,139
未 払 金	1,998,005,448
未 払 解 約 金	61,595,966
未 払 利 息	725
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	144,346,139,893
元 本	55,823,831,282
次 期 繰 越 損 益 金	88,522,308,611
(D) 受 益 権 総 口 数	55,823,831,282口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,857円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年2月8日 至 2021年2月8日
(A) 配 当 等 収 益	2,916,516,407円
受 取 利 息	2,917,947,129
そ の 他 収 益 金	64,450
支 払 利 息	△1,495,172
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,399,013,948
売 買 益	7,375,431,289
売 買 損	△4,976,417,341
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	116,351,385
取 引 益	192,672,642
取 引 損	△76,321,257
(D) そ の 他 費 用	△17,656,746
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	5,414,224,994
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	84,461,818,973
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	13,066,741,663
(H) 解 約 差 損 益 金	△14,420,477,019
(I) 計 (E+F+G+H)	88,522,308,611
次 期 繰 越 損 益 金(I)	88,522,308,611

(注1) (B) 有価証券売買損益及び(C) 先物取引等取引損益は期末の評價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56,813,648,113円、期中追加設定元本額は8,513,837,704円、期中一部解約元本額は9,503,654,535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。

DC外国債券インデックスファンドL	13,692,935,312円
インデックスコレクション (外国債券)	7,540,858,753円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	6,504,596,395円
インデックスコレクション (バランス株式30)	4,622,279,891円
私募外国債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	3,843,461,876円
外国債券インデックスファンド	2,120,543,770円
DC外国債券インデックスファンド	2,033,526,644円
外国債券パッシブファンド私募A (為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	1,730,797,850円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	1,685,232,540円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	1,671,437,904円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	1,513,347,526円
外国債券インデックス e	1,126,000,321円
DCバランスファンド50	869,278,934円
DCバランスファンド30	858,603,748円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	801,390,111円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	623,734,755円
インデックスコレクション (バランス株式50)	572,973,881円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	549,025,573円

外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	531,389,538円
グローバル・インデックス・バランス・ファンド	430,589,437円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	336,452,507円
VAバランスファンド（株25／100）（適格機関投資家専用）	320,197,282円
VAバランスファンド（株40／100）（適格機関投資家専用）	294,167,473円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	242,526,416円
VAバランスファンド（株50／100）（適格機関投資家専用）	219,582,618円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	202,466,833円
DCバランスファンド70	165,849,535円
インデックスコレクション（バランス株式70）	153,437,609円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	111,463,679円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	109,779,508円
VAバランスファンド2（株40／100）（適格機関投資家専用）	104,255,258円
VAファンド25（適格機関投資家専用）	88,773,810円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	75,340,175円
VAバランス50－50（適格機関投資家専用）	55,651,159円
私募外国債券インデックスファンドAL（適格機関投資家専用）	21,422,217円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	460,444円

お知らせ

該当事項はありません。