

## 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。
- ・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			参考指數	株組比率	株式比率	債券組比率	債券比率	券物率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率								
第10期(2017年6月12日)	円 14,905	円 0	% 13.5	% 15,733	% 15.0	% 64.0	% 2.2	% 32.0	% 0.2	% 0.8	百万円 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。

参考指數は、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數です。

### 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、公表する指數で、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數です。「配当込み」指數は、配当収益を考慮して算出した株価指數です。同指數は、東証の知的財産であり、指數の算出、指數値の公表、利用など同指數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數で、株式時価総額をベースに算出されます。「配当込み」指數は、配当収益を考慮して算出した株価指數です。同指數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. は同指數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	投資信託証券組入率
		騰落率		騰落率									
(当 期 首) 2020年 6月10日	円 17,000	% —	% 18,251	% —	64.5	1.0	2.2	33.1	29.8	0.8	0.6	0.8	0.8
6月末	16,570	△2.5	17,787	△2.5	62.5	2.2	2.1	33.4	31.9	0.7	0.6	0.8	0.8
7月末	16,578	△2.5	17,829	△2.3	62.4	1.6	1.7	32.3	32.3	0.4	0.4	0.8	0.8
8月末	17,419	2.5	18,734	2.6	64.8	1.6	1.7	31.9	31.9	0.4	0.4	0.8	0.8
9月末	17,276	1.6	18,595	1.9	64.3	1.7	1.7	32.3	32.3	0.5	0.5	0.8	0.8
10月末	16,860	△0.8	18,173	△0.4	64.1	1.7	1.7	32.5	32.5	0.6	0.6	0.7	0.7
11月末	18,180	6.9	19,616	7.5	66.0	1.1	1.1	31.4	31.4	0.5	0.5	0.8	0.8
12月末	18,577	9.3	20,054	9.9	65.6	1.1	1.1	31.7	31.7	0.3	0.3	0.7	0.7
2021年 1月末	18,703	10.0	20,180	10.6	65.4	1.1	1.1	31.9	31.9	0.4	0.4	0.7	0.7
2月末	19,049	12.1	20,616	13.0	65.7	1.0	1.0	31.5	31.5	0.3	0.3	0.7	0.7
3月末	19,979	17.5	21,521	17.9	65.4	1.7	1.7	31.0	31.0	0.5	0.5	0.7	0.7
4月末	20,097	18.2	21,711	19.0	65.2	1.8	1.8	31.3	31.3	0.5	0.5	0.8	0.8
5月末	20,358	19.8	22,044	20.8	63.9	1.9	1.9	32.4	32.4	0.5	0.5	0.7	0.7
(当 期 末) 2021年 6月10日	20,530	20.8	22,210	21.7	64.0	1.8	1.8	32.4	32.4	0.4	0.4	0.7	0.7

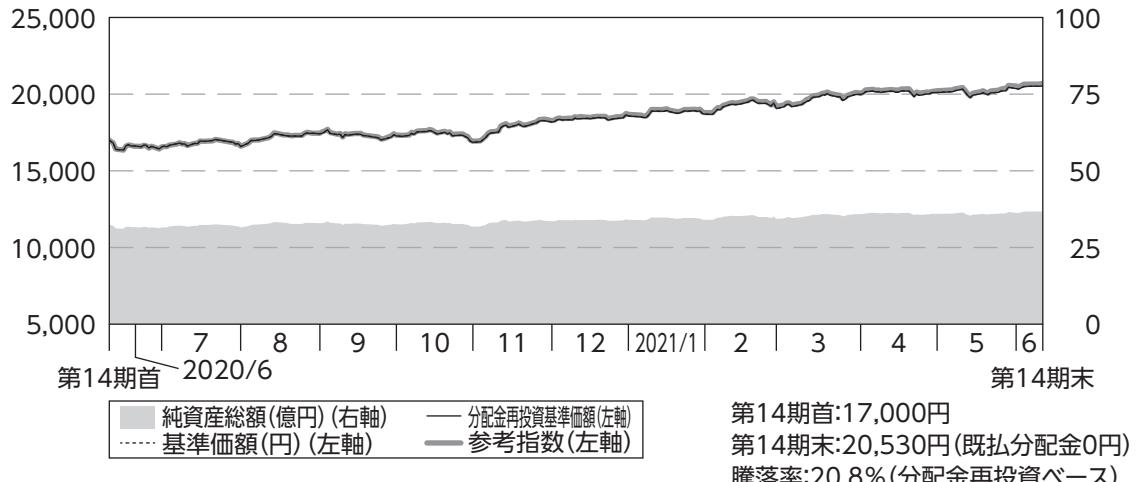
(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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標は、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、新型コロナワ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た。

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%

## 投資環境

### 国内株式市場

期初から2021年3月にかけては、新型コロナ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。

## 当ファンドのポートフォリオ

---

### ○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。

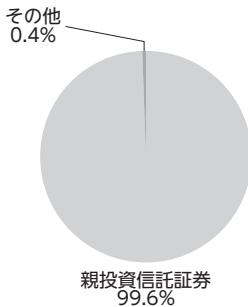
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

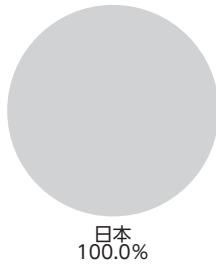
	当期末
	2021年6月10日
日本株式マザーファンド	33.5%
外国株式マザーファンド	33.1%
外国債券マザーファンド	33.0%
その他	0.4%
組入ファンド数	3

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

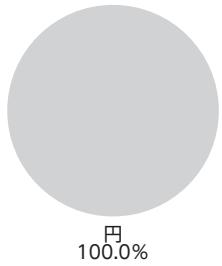
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

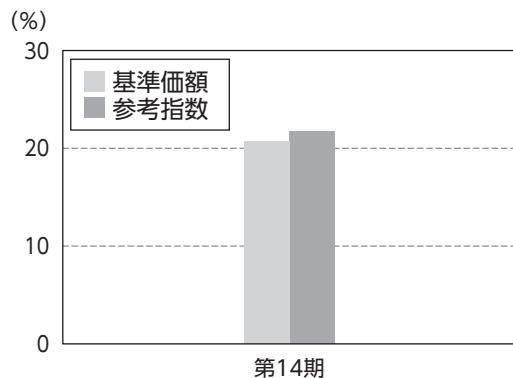


(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

## 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した。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第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)ー印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

---

### ○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=〔期中の売買委託手数料〕 〔期中の平均受益権口数〕×10,000 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲間に支払う手数料	
(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=〔期中の有価証券取引税〕 〔期中の平均受益権口数〕×10,000 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取 引に関する税金	
(株式)	(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=〔期中のその他費用〕 〔期中の平均受益権口数〕×10,000	
(保管費用)	(2)	(0.010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証 券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する 費用	
(監査費用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人に支払うファンの監査に係る 費用	
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等	
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。

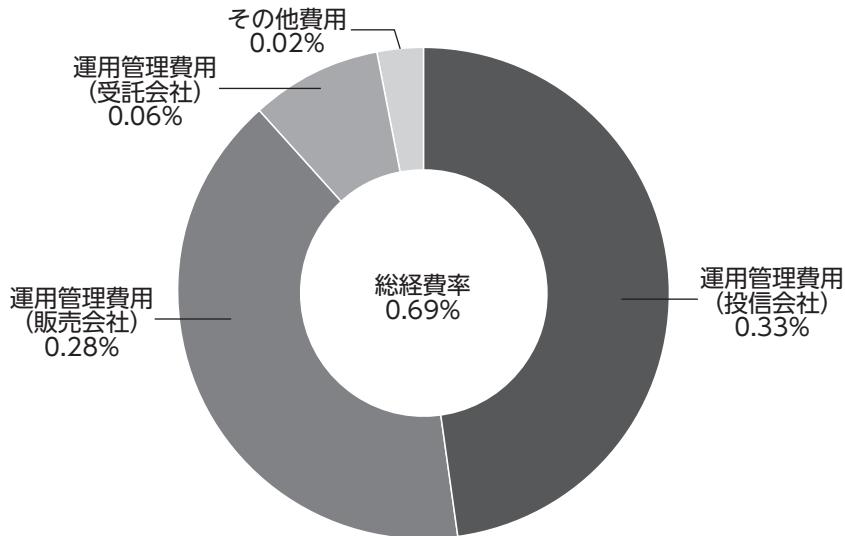
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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>

### 総経费率

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费率(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
日本株式マザーファンド	千口	千円	千口	千円
	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	<u>B</u> <u>A</u>	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	<u>D</u> <u>C</u>
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	<u>B</u> <u>A</u>	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	<u>D</u> <u>C</u>
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	<u>B</u> <u>A</u>	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	<u>D</u> <u>C</u>
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	<u>B</u> <u>A</u>	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	<u>D</u> <u>C</u>
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
日本株式マザーファンド	千円 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=5,554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 緑 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
賣 賣 買 買	672,912,548
賣 賣 買 買	△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 緑 越 損 益 金	885,822,973
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金 (配 当 等 相 當 額)	381,378,930 (806,745,580) (△425,366,650)
(G) 計 (D+E+F)	1,885,438,734
(H) 収 益 分 配 金 次 期 緑 越 損 益 金 (G+H)	0 1,885,438,734 381,378,930 (806,940,838) (△425,561,908)
追 加 信 託 差 損 益 金 (配 当 等 相 當 額)	
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あげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・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	株式先物比率	純資産額
		期 中 騰落率	期 中 騰落率			
第16期(2017年1月23日)	円 15,273	% 12.7	% 12.7	% 99.1	% 0.9	百万円 222,163
第17期(2018年1月22日)	19,496	27.7	2,754.01	27.6	98.8	1.2
第18期(2019年1月22日)	16,400	△15.9	2,315.87	△15.9	99.0	1.0
第19期(2020年1月22日)	18,844	14.9	2,660.66	14.9	99.1	0.9
第20期(2021年1月22日)	20,561	9.1	2,901.12	9.0	99.1	0.7

(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	株式先物比率
		騰 落 率	騰 落 率		
(当 期 首) 2020年 1月22日	円 18,844	% 一	% 一	% 99.1	% 0.9
1月末	18,200	△3.4	2,569.77	△3.4	98.7
2月末	16,330	△13.3	2,305.76	△13.3	98.8
3月末	15,357	△18.5	2,167.60	△18.5	97.4
4月末	16,023	△15.0	2,261.88	△15.0	97.8
5月末	17,113	△9.2	2,416.04	△9.2	98.1
6月末	17,086	△9.3	2,411.45	△9.4	98.6
7月末	16,399	△13.0	2,314.39	△13.0	99.0
8月末	17,738	△5.9	2,503.59	△5.9	99.0
9月末	17,967	△4.7	2,536.14	△4.7	98.2
10月末	17,458	△7.4	2,464.21	△7.4	98.1
11月末	19,409	3.0	2,738.72	2.9	98.0
12月末	19,986	6.1	2,819.93	6.0	99.0
(当 期 末) 2021年 1月22日	20,561	9.1	2,901.12	9.0	99.1

(注1)騰落率は期首比です。

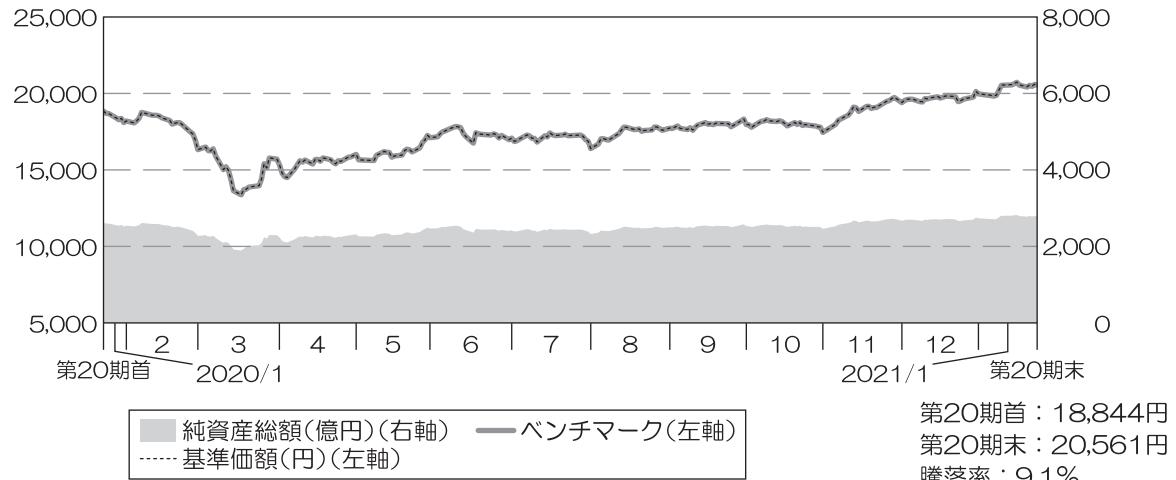
(注2)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

## 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

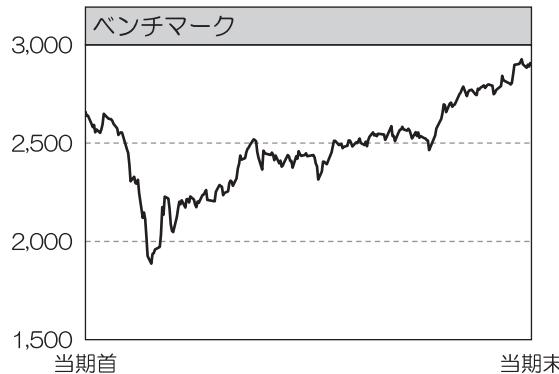


(注)ベンチマークは、2020年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 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

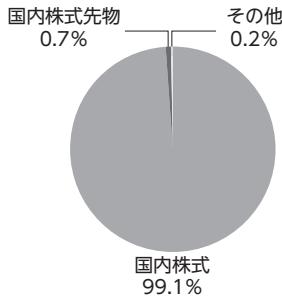
### ○上位10銘柄

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%

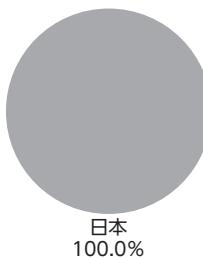
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本電産	日本	1.3%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	信越化学工業	日本	1.3%
10	リクルートホールディングス	日本	1.2%
組入銘柄数			2,092

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

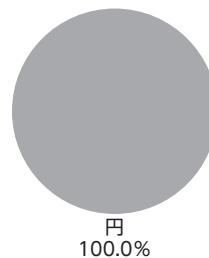
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

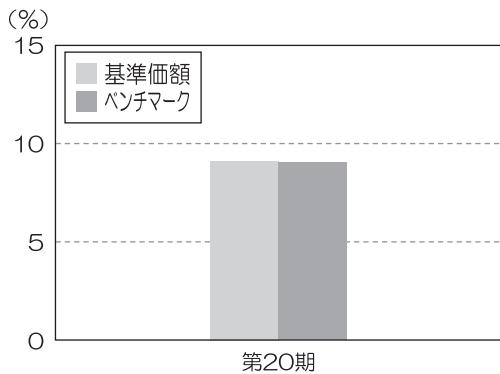


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
(株式)	(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金	
(株式)	(-)	(-)		
(新株予約権証券)	(-)	(-)		
(オプション証券等)	(-)	(-)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)		
(公社債)	(-)	(-)		
(投資信託証券)	(-)	(-)		
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$	
(保管費用)	(-)	(-)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用	
(監査費用)	(-)	(-)	監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用	
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等	
合計	0	0.000		

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

(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(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 錢 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

## &lt;国内株式(上場株式)&gt;

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
水産・農林業(0.1%)	千株	千株	千円	
極洋	5	5.1	15,733	
日本水産	143.4	146.1	63,845	
マルハニチロ	20.7	21.1	48,846	
雪国まいたけ	—	9	16,551	
カネコ種苗	4.3	4.4	6,749	
サカタのタネ	17.1	17.4	62,814	
ホクト	10.9	11.1	23,798	
ホクリヨウ	2.2	2.3	1,610	
鉱業(0.1%)				
住石ホールディングス	29	29.5	3,392	
日鉄鉱業	3.3	3.3	19,107	
三井松島ホールディングス	5.6	5.7	4,508	
国際石油開発帝石	575.3	537.2	334,138	
石油資源開発	18.7	19.1	38,983	
K&Oエナジーグループ	7	7.1	10,153	
建設業(2.3%)				
ヒノキヤグループ	3.6	3.6	7,304	
ショーボンドホールディングス	20.5	22.7	106,803	
ミライト・ホールディングス	42.6	43.4	74,127	
タマホーム	6.8	7.9	15,057	
サンヨーホームズ	1.2	1.3	1,085	
日本アクリア	5.7	5.8	3,549	
ファーストコーポレーション	4.4	4.5	3,163	
ベステラ	2.5	2.5	4,427	
T A T E R U	29.6	27.4	4,877	
キャンディル	—	2.5	1,340	
スペースバリューホールディングス	17.5	17.8	12,406	
ダイセキ環境ソリューション	2.8	2.8	2,158	
第一カッタ一興業	1.8	3.6	4,946	
明豊ファシリティワークス	3.5	—	—	
安藤・間	85.4	87	64,815	
東急建設	42	42.8	21,999	
コムシスホールディングス	50.9	51.8	164,206	
ビーアールホールディングス	15.6	15.9	10,271	
高松コンストラクショングループ	8.9	9.1	18,736	
東建コーポレーション	4.4	4.5	36,000	
ソネック	1.5	1.5	1,279	
ヤマウラ	6.2	6.3	5,802	
大成建設	110.4	112.5	406,125	
大林組	331.2	337.4	314,794	
清水建設	336.1	342.3	269,390	
飛島建設	9.5	9.7	10,369	
長谷工コーポレーション	128.2	130.6	164,294	
松井建設	13	13.3	9,482	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
錢高組	千株	千株	千円	
鹿島建設	1.4	1.5	6,127	
不動テトラ	260	264.8	385,813	
大末建設	8.7	8.8	15,180	
鉄建建設	3.8	3.9	3,190	
西松建設	7.2	7.3	13,702	
三井住友建設	25.5	26	63,258	
大豊建設	80	81.5	36,675	
前田建設工業	7.4	8	29,720	
佐田建設	82.9	84.5	76,303	
奥村組	7.1	7.3	3,219	
ナカノフード一建設	9	9.2	3,707	
東鉄工業	18	15.9	41,896	
イチケン	14.2	14.5	39,875	
富士ピー・エス	2.4	2.4	4,526	
淺沼組	4.9	5	2,975	
戸田建設	3.7	3.8	16,112	
熊谷組	137.5	140.1	101,712	
北野建設	15.3	15.6	41,823	
植木組	2	2.1	5,189	
矢作建設工業	1.5	1.5	4,060	
ビーエス三菱	14.6	14.9	12,635	
日本ハウスホールディングス	10.9	11.1	6,870	
大東建託	22.6	23	7,590	
新日本建設	39.7	36.8	351,072	
N I P P O	14.1	14.3	11,969	
東亜道路工業	27.4	27.9	75,413	
前田道路	2.1	2.1	8,001	
日本道路	35.1	29.8	52,299	
東亜建設工業	3.2	3.3	24,882	
日本国土開発	10.3	10.5	22,501	
若築建設	19.3	32.8	18,236	
東洋建設	6	6.1	7,521	
五洋建設	37.1	37.8	18,711	
世紀東急工業	131.3	133.7	122,736	
福田組	15.9	16.2	13,251	
住友林業	3.8	3.9	20,163	
日本基礎技術	83.9	85.4	185,830	
巴コーポレーション	11.1	11.3	5,412	
大和ハウス工業	14.7	15	5,985	
ライト工業	327.7	333.8	1,015,753	
積水ハウス	19	19.3	33,485	
日特建設	362.3	365.9	778,818	
北陸電気工事	8.6	8.8	6,837	
ユアテック	5.7	5.8	7,197	
	18.9	19.3	16,848	

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
日本リーテック	千株	千株	千円
四電工	—	7.1	17,650
中電工	1.8	1.8	4,678
関電工	13.3	13.6	29,430
きんでん	47.1	48	43,728
東京エネシス	78.7	80.1	138,973
トーエネック	11	11.2	11,144
住友電設	3.3	3.4	12,376
日本電設工業	9.3	9.5	25,887
協和エクシオ	18.2	18.5	37,869
新日本空調	50.2	51.2	143,257
九電工	8.8	8.9	19,063
三機工業	23.2	23.7	76,432
日揮ホールディングス	23.9	23.9	29,636
中外炉工業	101.9	103.9	126,238
ヤマト	3.6	3.6	6,012
太平電業	10.6	10.8	7,711
高砂熱学工業	8	8.2	20,844
三晃金属工業	28.8	25.8	41,305
朝日工業社	1.4	1.5	4,281
明星工業	2.2	2.3	6,856
大氣社	21.4	21.8	17,745
ダイダン	16.1	16.4	47,150
日比谷総合設備	7.9	8.1	23,895
フィル・カンパニー	10.7	10.9	20,557
OSJBホールディングス	—	1.9	3,499
東洋エンジニアリング	52.2	53.2	14,683
レイズネクスト	13.9	14.2	6,631
食料品(3.4%)	17.8	18.1	21,937
ニップン	31	31.6	51,286
日清製粉グループ本社	119.7	122	200,690
日東富士製粉	0.8	0.8	5,344
昭和産業	9.7	9.9	30,195
鳥越製粉	9.4	9.6	8,256
中部飼料	12.9	13.2	18,849
フィード・ワン	71.2	14.5	12,368
東洋精糖	1.8	1.8	2,174
日本甜菜製糖	7.1	5.5	8,982
三井製糖	9.3	9.5	17,651
塩水港精糖	11.5	11.7	2,585
日新製糖	5	5.1	9,373
森永製菓	24.9	25.3	98,164
中村屋	2.7	2.8	10,780
江崎グリコ	31.4	29.7	133,204
名糖産業	5.1	5.2	7,394
井村屋グループ	4.5	6.1	15,445
不二家	5.9	6.9	15,345
山崎製パン	79.4	80.9	142,141
第一屋製パン	1.8	2.1	2,039

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
モロゾフ	千株	千株	千円
亀田製菓	1.8	1.8	10,332
寿スピリッツ	6	6.1	29,432
カルビー	10.2	10.4	57,408
森永乳業	48.3	49.2	153,258
六甲バター	19.6	20	102,400
ヤクルト本社	7	7.2	12,679
明治ホールディングス	72.9	74.3	406,421
雪印メグミルク	70.1	71.4	503,370
ブリマハム	25.5	26	58,006
日本ハム	16.6	16.9	53,150
林兼産業	40.5	41.3	176,557
丸大食品	3.5	3.6	2,134
S F o o d s	11.3	11.5	19,446
柿安本店	8.5	8.6	28,939
伊藤ハム久米久ホールディングス	3.7	3.7	9,808
サッポロホールディングス	68.2	69.5	48,372
アサヒグループホールディングス	36.2	36.8	72,606
キリンホールディングス	222	235.9	1,024,041
宝ホールディングス	449.5	457.9	1,058,206
オエノンホールディングス	79.4	80	99,040
養命酒製造	28	30.7	11,758
コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス	3.2	3.3	6,105
サントリー食糧インターナショナル	74.4	82.7	127,606
ダイドーグループホールディングス	70.9	72.2	262,447
伊藤園	5.4	5.5	27,995
キーコーヒー	32.2	32.8	210,904
ユニカフエ	10.4	10.6	22,493
ジャパンフーズ	2.7	3.2	3,184
日清オイリオグループ	1.5	1.5	1,821
不二製油グループ本社	13.6	13.9	42,117
かどや製油	25.8	26.3	79,820
J一オイルミルズ	1.2	1.2	4,752
キッコーマン	5.5	5.6	20,496
味の素	76.3	77.7	583,527
キューピー	234.1	238.4	585,748
ハウス食品グループ本社	59	60.1	136,126
カゴメ	39.6	40.4	150,692
焼津水産化学工業	40.2	44.1	149,278
アリアケジャパン	5.1	5.2	5,174
ピエトロ	9.7	9.9	66,825
エバラ食品工業	1.4	1.4	2,429
やまみ	2.6	2.6	6,497
ニチレイ	0.5	0.9	1,849
東洋水産	50.5	51.4	147,106
イートアンドホールディングス	54.5	55.5	285,270
大冷	3.7	3.7	6,745
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.4	1.4	2,693
日清食品ホールディングス	5.8	6	4,764
第一屋製パン	45.1	45.9	417,231

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
永谷園ホールディングス	千株	千株	千円	
一正蒲鉾	5.2	5.3	12,142	
フジッコ	4.1	4.2	4,620	
ロック・フィールド	11.5	11.7	23,762	
日本たばこ産業	11.4	11.6	17,284	
ケンコーマヨネーズ	612	578.9	1,185,587	
わらべや日洋ホールディングス	5.9	6.1	10,729	
なとり	6.9	7.1	11,502	
イフジ産業	5.9	6	11,250	
ピックルスコーポレーション	1.8	1.9	1,649	
北の達人コーポレーション	2.3	2.4	9,096	
ユーロレナ	37	37.7	19,943	
ミヨシ油脂	45.2	46.7	39,461	
理研ビタミン	5	10.2	13,719	
織維製品(0.5%)				
片倉工業	15.3	14.3	19,305	
グンゼ	7.7	7.8	25,701	
東洋紡	41.1	41.9	56,062	
ユニチカ	31.3	31.7	12,584	
富士紡ホールディングス	5.1	5.2	22,048	
倉敷紡績	10.8	10.6	19,270	
シキボウ	5.4	5.5	5,643	
日本毛織	34.3	35	32,970	
トーア紡コーポレーション	4.1	4.2	1,961	
帝國織維	11.8	12	27,516	
帝人	84.6	86.1	166,431	
東レ	749.4	763.3	547,057	
サカイオーベックス	2.9	2.9	5,634	
住江織物	3	2.3	4,715	
日本エルト	3	6.7	2,854	
イチカワ	1.7	1.7	2,155	
日東製綱	1.2	1.2	1,789	
アツギ	8.6	8.9	4,334	
ダイニック	3.9	4	3,096	
セーレン	25.7	26.1	40,820	
ソトー	4.2	4.3	3,504	
東海染工	1.5	1.6	1,790	
小松マテーレ	17.1	17.4	17,121	
ワコールホールディングス	27	26.3	53,967	
ホギメディカル	11.8	12	37,260	
レナウン	26.6	—	—	
クラウディアホールディングス	2.7	—	—	
T S I ホールディングス	34.8	32.5	7,962	
マツオカコーポレーション	3	3.1	6,187	
ワールド	14.7	15	19,785	
三陽商會	5.4	5.5	3,421	
ナイガイ	4	4.2	1,386	
オンワードホールディングス	62.3	63.8	15,312	
ルックホールディングス	3.6	3.7	3,396	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ゴールドワイン	千株	千株	千円	
デサント	18.8	19	120,460	
ヤング	20.2	20.6	36,482	
ヤマトイインターナショナル	5	5.2	2,912	
パルプ・紙(0.2%)	6.5	9.6	3,158	
特種東海製紙	6.6	6.5	29,867	
王子ホールディングス	432.4	440.4	283,177	
日本製紙	45.7	46.6	57,784	
三菱製紙	11.7	12	3,948	
北越コーポレーション	68.6	62.8	26,941	
中越パルプ工業	4.4	4.5	5,368	
巴川製紙所	3.1	3.1	2,387	
大王製紙	45.4	50.8	99,415	
阿波製紙	2.7	2.7	1,198	
レンゴー	97.8	99.6	85,357	
トモク	6.3	6.5	11,765	
ザ・パック	7.8	8	20,744	
化学(7.5%)				
クラレ	162.9	165.9	183,485	
旭化成	685.5	698.3	799,204	
共和レザー	5.6	5.7	3,596	
昭和電工	73.6	80	192,640	
住友化学	759.9	774	366,102	
住友精化	4.6	4.7	19,928	
日産化学	57.8	58.1	344,533	
ラサ工業	3.6	3.7	9,390	
クレハ	8.9	9	60,750	
多木化学	3	4.1	25,010	
ティカ	7.6	7.7	11,334	
石原産業	18.5	18.9	14,439	
片倉コーポアグリ	2.7	2.7	3,294	
日本曹達	15.3	14.7	44,247	
東ソー	159.9	162.9	287,518	
トクヤマ	29.8	30.4	77,489	
セントラル硝子	21.1	21.5	47,106	
東亞合成	64.9	66.1	76,676	
大阪ソーダ	10.5	10.7	27,798	
関東電化工業	24.5	25	20,600	
デンカ	37.7	38.4	157,632	
信越化学工業	177.6	180.9	3,494,988	
日本カーバイド工業	3.5	3.7	4,713	
堺化学工業	6.7	6.8	13,668	
第一稀元素化学工業	11.2	11.4	10,203	
エア・ウォーター	96.2	98	171,402	
日本酸素ホールディングス	99.4	101.2	206,549	
日本化学工業	3.2	3.3	10,774	
東邦アセチレン	1.6	1.6	2,272	
日本パークライジング	52.2	53.1	53,206	
高圧ガス工業	16.4	16.7	13,076	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		銘柄	当期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額			株数	評価額
チタン工業	千株	千株	千円	ニイタカ	千株	千株	千円
四国化成工業	1.3	1.3	2,444	三洋化成工業	1.6	2.2	6,199
戸田工業	15.9	15.4	18,387	有機合成薬品工業	2.4	6.3	33,957
ステラ ケミファ	2.4	2.4	5,654	大日本塗料	6.2	8.1	2,543
保土谷化学工業	5.6	5.7	21,375	日本ペイントホールディングス	7.9	11.9	10,900
日本触媒	3.9	3.9	21,216	関西ペイント	11.7	11.9	829,895
大日精化工業	16.1	16.4	94,300	神東塗料	85.4	86.9	353,068
カネカ	9.2	9.3	20,850	中国塗料	116.2	118.4	1,734
三菱瓦斯化学	26.8	27.3	96,778	日本特殊塗料	29.4	30	29,370
三井化学	97.6	98	248,136	藤倉化成	7.7	7.9	8,539
J S R	93.9	97.8	292,030	太陽ホールディングス	13.9	14.2	7,085
東京応化工業	96.4	98.2	319,150	D I C	7.6	7.7	50,435
大阪有機化学工業	17.7	18.1	141,361	サカタインクス	43.7	44.5	112,273
三菱ケミカルホールディングス	9.6	9.7	36,132	東洋インキSCホールディングス	22.6	23	23,897
KHネオケム	691.4	704.3	507,096	T & K T O K A	43,9	44.3	41,344
ダイセル	18.2	17.4	43,621	富士フィルムホールディングス	8	8.2	6,666
住友ベークライト	141.5	131.5	102,438	資生堂	202.5	206.2	1,296,379
積水化学工業	16.3	16.6	62,997	ライオン	209.8	213.7	5,111,927
日本ゼオン	222.4	222.8	449,164	高砂香料工業	137.3	139.9	331,842
アイカ工業	93.3	95	146,300	マンダム	6.6	6.7	16,562
宇部興産	31	31.6	113,602	ミルボン	23.7	24.2	38,260
積水樹脂	52.2	53.2	103,048	ファンケル	14.1	14.4	95,616
タキロンシーアイ	18.6	19	39,368	コーワ	42.7	43.5	173,130
旭有機材	22.4	22.8	14,637	コタ	19.9	20.2	335,724
日立化成	5.8	6	8,964	シーボン	5.5	6.2	8,977
ニチバン	43.7	—	—	ボーラ・オルビスホールディングス	1.4	1.4	2,720
リケンテクノス	5.4	5.5	9,185	ノエビアホールディングス	45.1	45.9	99,511
大倉工業	26	25.7	11,770	アジュバンコスマジヤパン	10.1	9.1	41,905
積水化成品工業	4.9	5	9,515	エステー	2.4	2.4	2,560
群栄化学工業	13.9	14.1	7,571	アグロ カネショウ	6.8	6.9	13,482
ダイガースポリマー	2.4	2.4	5,767	コニシ	6.8	7.3	6,340
ミライアル	5.4	5.5	2,222	長谷川香料	17.4	17.7	27,541
ダイキアクシス	3.6	3.7	4,514	星光P M C	14	18.5	37,370
ダイキヨーニシカワ	3.7	3.7	4,169	小林製薬	6	6.2	4,681
竹本容器	21.8	22.2	17,404	荒川化学工業	29.6	30.1	359,093
森六ホールディングス	3.7	3.8	3,496	メック	9.5	9.7	11,843
日本化薬	5.6	5.7	11,491	日本高純度化学	7.2	7.4	17,249
カーリットホールディングス	64	65.2	64,874	タカラバイオ	2.9	3	8,100
日本精化	11	11.2	8,400	J C U	27.6	28.2	79,947
扶桑化学工業	8.3	8.5	11,764	新田ゼラチン	12.8	13	51,285
トリケミカル研究所	10.5	10.7	41,997	O A Tアグリオ	6.6	6.8	4,528
A D E K A	2.3	2.3	39,468	デクセリアルズ	1.8	2	2,612
日油	47.6	48.5	86,087	アース製薬	27.2	27.8	38,058
新日本理化	38.9	39.7	198,103	北興化学工業	8	8.1	49,005
ハリマ化成グループ	17.1	17.4	4,872	大成ラミック	10.8	10	12,790
花王	8.6	8.7	8,256	クミアイ化学工業	3.5	3.5	10,160
第一工業製薬	252.9	257.6	1,979,656	日本農薬	43.7	44.5	38,537
石原ケミカル	3.9	3.9	16,029	アキレス	18.8	19.2	9,312
日華化学	2.8	2.9	6,087	有沢製作所	7.3	7.4	10,752
	3.5	3.5	3,059		16.7	16.1	15,713

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
日東電工	72.9	74.2	695,254	
レック	11.3	11.5	15,088	
三光合成	12.1	12.3	5,731	
きもと	18	18.3	3,257	
藤森工業	9.5	9.7	45,008	
前澤化成工業	6.7	6.8	6,602	
未来工業	5.7	5.8	9,291	
ウェーブロックホールディングス	3.6	3.7	3,230	
J S P	6.2	6.3	10,924	
エフピコ	11.6	22.6	95,146	
天馬	7	7.2	15,235	
信越ボリマー	19	19.3	18,470	
東リ	26.3	26.8	6,539	
ニフコ	38.8	39.5	152,272	
バルカー	8.6	8.7	18,896	
ユニ・チャーム	203.6	228.1	1,122,936	
ショーエイコーポレーション	1.2	1.8	1,837	
医薬品(5.8%)				
協和キリン	106.2	108.2	300,579	
武田薬品工業	878.6	895	3,210,365	
アステラス製薬	928.9	932.7	1,571,599	
大日本住友製薬	78.3	79.7	120,426	
塩野義製薬	135	135.3	765,527	
わかもと製薬	12.6	12.8	3,136	
あすか製薬	12	12.2	18,702	
日本新薬	27.6	28.2	202,476	
ビオフェルミン製薬	1.8	1.8	4,428	
中外製薬	110.1	336.5	1,890,793	
科研製薬	18.1	18.4	74,796	
エーザイ	126.4	128.8	983,130	
ロート製薬	54.2	55.2	171,672	
小野薬品工業	242.5	247	754,585	
久光製薬	27.9	28.4	170,968	
持田製薬	14.7	14.9	57,812	
参天製薬	196.7	200.5	336,639	
扶桑製薬工業	3.7	3.8	10,104	
日本ケミファ	1.4	1.4	3,109	
ツムラ	32.7	33.3	111,388	
日医工	29.9	30.5	29,859	
キッセイ薬品工業	18.7	19	42,047	
生化学工業	20.5	20.9	20,900	
栄研化学	18.6	18.9	37,478	
日水製薬	4.4	4.5	4,473	
鳥居薬品	6.6	6.7	21,272	
J C R ファーマ	7.4	30.3	74,568	
東和薬品	13.5	13.8	26,509	
富士製薬工業	7.2	7.3	8,854	
沢井製薬	21.7	22.1	104,754	
ゼリア新薬工業	19.2	19.5	37,186	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
第一三共	302.2	923.5	3,306,130	
キョーリン製薬ホールディングス	23.3	23.7	45,361	
大幸薬品	4.3	13.2	21,225	
ダイト	6.2	6.9	24,667	
大塚ホールディングス	201.2	223.6	986,746	
大正製薬ホールディングス	22.3	22.7	153,906	
ペプチドリーム	53.4	54.7	318,901	
石油・石炭製品(0.4%)				
日本コクス工業	89.2	90.9	8,453	
ニチレキ	12.5	12.7	18,973	
ユシロ化学工業	5.9	6	6,540	
ビーピー・カストロール	3.8	3.8	4,674	
富士石油	28.2	28.7	5,539	
M O R E S C O	3.8	3.9	4,317	
出光興産	118.8	119.4	298,619	
E N E O S ホールディングス	1,588.7	1,618.2	700,680	
コスモエネルギーホールディングス	30.6	31.1	71,685	
ゴム製品(0.6%)				
横浜ゴム	61.1	62.3	107,716	
T O Y O T I R E	60.6	56.6	95,371	
ブリヂストン	324.6	286	1,172,600	
住友ゴム工業	94.9	96.6	98,242	
藤倉コンポジット	9.2	9.4	3,647	
オカモト	6.4	6.5	25,382	
フコク	4.6	4.7	3,149	
ニッタ	11.9	12.1	26,983	
住友理工	20.5	20.8	12,084	
三ツ星ペルト	13.9	14.2	23,714	
パンドー化学	18.6	18.9	12,398	
ガラス・土石製品(0.8%)				
日東紡績	15.7	16	74,480	
A G C	104.4	98.8	377,910	
日本板硝子	50.5	51.5	24,514	
石塚硝子	1.9	2	3,782	
日本山村硝子	4.4	4.6	3,965	
日本電気硝子	42.4	39.9	89,934	
オハラ	4.2	4.3	7,856	
住友大阪セメント	20	19.4	59,267	
太平洋セメント	66.7	68	179,996	
日本ヒューム	10.6	10.9	8,741	
日本コンクリート工業	22.8	23.5	7,167	
三谷セキサン	4.9	5	23,525	
アジアパイルホールディングス	15	15.5	7,595	
東海カーボン	110.7	105.3	156,370	
日本カーボン	5.4	6	24,630	
東洋炭素	6.2	6.4	13,030	
ノリタケカンパニーリミテド	5.8	6	19,230	
T O T O	75.4	76.9	461,400	
日本碍子	128.9	129.2	225,841	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
日本特殊陶業	82.2	81.9	147,338	千円
MARUWA	4.1	4.1	47,232	
品川リフラクトリーズ	2.8	2.9	8,108	
黒崎播磨	2.1	2.2	10,648	
ヨータイ	8.4	8.7	7,290	
イソライト工業	5.5	5.7	3,135	
東京窯業	13.5	14	4,788	
ニッカトー	4.8	5	4,010	
フジミインコーポレーテッド	9.4	9.6	42,720	
クニミネ工業	4.3	4.4	5,491	
エーアンドエーマテリアル	1.8	1.8	1,882	
ニチアス	28.9	29.5	73,248	
ニチハ	14.7	15	47,925	
<b>鉄鋼(0.6%)</b>				
日本製鉄	467.4	476.1	621,548	
神戸製鋼所	191.2	194.8	104,997	
中山製鋼所	14.6	14.9	5,393	
合同製鐵	5.6	5.7	11,639	
ジェイ エフ イー ホールディングス	282.1	287.3	285,863	
東京製鐵	50.9	51.9	35,343	
共英製鋼	11.8	12	16,788	
大和工業	22.2	22.6	59,641	
東京鐵鋼	4.3	4.4	9,130	
大阪製鐵	5.6	5.7	7,164	
淀川製鋼所	14.1	14.4	31,233	
丸一鋼管	33.9	34.6	80,272	
モリ工業	3.1	3.2	7,427	
大同特殊鋼	17.1	17.4	74,211	
日本高周波鋼業	4	4.1	1,443	
日本冶金工業	8.7	8.8	15,681	
山陽特殊製鋼	7.6	7.3	11,161	
愛知製鋼	5.9	6	19,290	
日立金属	112.5	114.6	192,184	
日本金属	2.4	2.5	3,147	
大太平洋金属	7.1	7.2	16,689	
新日本電工	67.5	68.8	19,401	
栗本鍛工所	5.2	5.3	8,755	
虹技	1.6	1.6	1,760	
三菱製鋼	7.8	7.9	5,016	
日亜鋼業	15.4	15.7	4,647	
日本精線	1.7	1.7	6,324	
エンビプロ・ホールディングス	4	4.6	3,238	
シンニッタン	16.3	16.8	3,460	
新家工業	2.4	2.5	3,237	
<b>非鉄金属(0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	17.3	17.6	13,552	
日本軽金属ホールディングス	264.7	27	52,353	
三井金属鉱業	28.2	28.7	113,365	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
東邦亜鉛	5.4	5.5	12,804	千円
三菱マテリアル	69	70.3	161,830	
住友金属鉱山	133.5	136	689,792	
DOWAホールディングス	26.4	26.9	108,541	
古河機械金属	18.6	19	24,035	
大阪チタニウムテクノロジーズ	10.9	11.1	9,534	
東邦チタニウム	18.8	19.1	17,552	
UACJ	15.9	16.2	30,634	
CKサンエツ	2.2	2.2	8,294	
古河電気工業	32.5	33.1	93,110	
住友電気工業	390.5	397.8	576,611	
フジクラ	126.3	128.5	61,808	
昭和電線ホールディングス	12.1	12.4	21,712	
東京特殊電線	1.6	1.6	3,864	
タツタ電線	20.9	21.2	16,196	
カナレ電気	1.8	1.8	3,061	
平河ヒューテック	4	5.4	7,041	
リヨービ	12.9	13.1	16,257	
アーレスティ	13.9	14.1	5,245	
アサヒホールディングス	18.3	18.7	78,540	
<b>金属製品(0.6%)</b>				
稻葉製作所	5.9	6	8,352	
宮地エンジニアリンググループ	3.2	3.2	7,897	
トーカロ	29	29.6	45,436	
アルファコ	3.7	3.7	3,718	
SUMCO	125	136.1	332,900	
川田テクノロジーズ	2.1	2.2	9,449	
RS Technologies	2.9	3.5	23,065	
ジェイティックコーポレーション	—	0.7	2,681	
信和	4.5	6.1	4,306	
東洋製罐グループホールディングス	66.5	67.8	78,783	
ホッカンホールディングス	5.7	5.8	8,369	
コロナ	5.8	5.9	5,593	
横河ブリッジホールディングス	19.4	19.8	40,807	
駒井ハルテック	2	2	4,608	
高田機工	1	1	2,548	
三和ホールディングス	100.2	100.3	123,970	
文化シヤッター	30.8	31.3	29,109	
三協立山	14.5	13.7	11,220	
アルインコ	7.6	7.7	7,330	
東洋シヤッター	2.5	2.6	1,768	
LIXIL	154.1	157	399,094	
日本フィルコン	8	7.4	3,722	
ノーリツ	21.7	22.1	34,034	
長府製作所	10.6	10.8	22,334	
リンナイ	20.3	20.7	232,668	
ダイニチ工業	5.6	5.7	5,198	
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		
		株数	株数	評価額
岡部	千株	千株	千円	
21.2	21.6	16,545		
ジーク	13	13.2	19,496	
東プレ	19.5	19.8	29,581	
高周波熱鍊	20.1	20.5	9,942	
東京製綱	7.5	7.6	10,427	
サンコール	5.9	8	3,640	
モリテック スチール	8.1	8.3	3,593	
パイオラックス	15.4	15.7	24,068	
エイチワン	10.2	10.4	7,716	
日本発條	112	114.1	83,407	
中央発條	1.3	1.3	3,627	
アドバネックス	1.5	1.5	2,019	
立川ブラインド工業	4.6	4.7	6,166	
三益半導体工業	9.3	8.3	24,833	
<b>機械(5.8%)</b>				
日本ドライケミカル	2.7	2.7	4,079	
日本製鋼所	31.7	32.3	99,968	
三浦工業	45.2	46	281,060	
タクマ	35.5	36.1	76,134	
ツガミ	21.7	22.1	39,713	
オークマ	12.2	12.4	76,508	
芝浦機械	11.8	12.1	28,810	
アマダ	132.9	132	157,872	
アイダエンジニアリング	27.4	28	27,300	
滝澤鉄工所	3.3	3.4	3,406	
F U J I	45	45.8	131,446	
牧野フライス製作所	12.3	12.5	51,312	
オーエスジー	48.3	52.5	101,167	
ダイジェット工業	1.3	1.3	1,726	
旭ダイヤモンド工業	27.6	28.2	13,197	
DMG森精機	66.1	67.4	109,390	
ソディック	24.7	23.2	21,204	
ディスコ	14.1	14.4	531,360	
日東工器	5.8	5.9	10,165	
日進工具	3.1	4.2	11,340	
パンチ工業	9.7	9.7	4,277	
富士ダイス	4.8	4.8	3,120	
豊和工業	5.9	6	5,172	
OKK	4.4	4.4	1,861	
東洋機械金属	7.7	7.7	3,349	
津田駒工業	2.1	2	1,804	
エンシュウ	2.6	2.7	2,403	
島精機製作所	16.8	16.8	31,264	
オプトラン	11.7	13.4	30,418	
N Cホールディングス	3.4	3.3	1,904	
イワキポンプ	5.1	6.8	5,596	
フリュー	10.3	10.5	11,802	
ヤマシンフィルタ	22.8	23.9	25,357	
日阪製作所	13	13.2	11,233	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
やまびこ	千株	千株	千円	
20.4	20.7	27,862		
平田機工		5	5	42,550
ペガサスミシン製造	10.9	11	3,674	
マルマエ	4.4	4	5,400	
タツモ	5	4.6	7,088	
ナブテスコ	61.6	62.7	312,873	
三井海洋開発	11.1	11.3	23,052	
レオン自動機	10.3	10.5	12,180	
SMC	33.1	33.8	2,306,512	
ヤマハモーターポティクスホールディングス	9.3	—	—	
ホソカワミクロン	3.7	3.8	24,206	
ユニオンツール	3.9	4	12,540	
オイレス工業	13.6	13.8	22,452	
日精エー・エス・ビー機械	3.6	3.1	18,662	
サトーホールディングス	14.9	15.2	33,440	
技研製作所	9.2	9.4	45,449	
日本エーテック	3.5	3.5	5,257	
カワタ	3.2	3.2	3,219	
日精樹脂工業	8.9	9.1	8,390	
オカダアイヨン	3.4	3.4	3,889	
ワイエイシホールディングス	4.5	4.6	5,004	
小松製作所	478.4	487.3	1,455,321	
住友重機械工業	60.5	61.6	184,800	
日立建機	42.4	43.1	137,920	
日工	14.6	14.9	10,653	
巴工業	4.6	4.3	8,664	
井関農機	10.6	10.8	14,796	
TOWA	10.8	10.9	23,009	
丸山製作所	2.4	2.3	3,650	
北川鉄工所	4.8	4.9	6,610	
ローツエ	4.7	4.7	40,796	
タカキタ	3.9	3.8	2,675	
クボタ	560.3	565.1	1,377,148	
荏原実業	2.7	2.7	10,530	
三菱化機	3.7	3.7	12,709	
月島機械	19.5	19.9	27,860	
帝国電機製作所	8.8	8.9	10,653	
新東工業	25.2	25.7	19,660	
瀧谷工業	9.3	9.4	32,853	
アイチ コーポレーション	18.4	18.7	17,278	
小森コーポレーション	26.9	27.4	19,180	
鶴見製作所	8.3	8.3	15,321	
住友精密工業	1.6	1.6	3,174	
日本ギア工業	3.5	4.5	1,327	
酒井重工業	2	2.1	4,515	
荏原製作所	43.7	44.6	164,797	
石井鉄工所	1.4	1.4	4,044	
酉島製作所	10.8	11	9,339	
北越工業	11	11.1	11,444	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
ダイキン工業	134.6	137.1	3,171,808	
オルガノ	3.8	3.9	26,559	
トーヨーカネツ	4.6	4.7	12,055	
栗田工業	57.2	58.2	258,699	
椿本エイン	15.1	15.4	41,580	
大同工業	5.2	5.3	3,826	
木村化工機	8.9	9.1	5,541	
アネスト岩田	16.6	16.8	18,412	
ダイワク	54	55	714,450	
サムコ	3	2.7	10,773	
加藤製作所	5.8	6	5,664	
油研工業	1.8	1.9	2,981	
タダノ	51.1	52	48,880	
フジテック	38.5	39.1	91,376	
CKD	29.4	29.5	76,906	
キトー	8.1	8.2	12,587	
平和	29.5	30	43,530	
理想科学工業	9.4	9.5	13,100	
SANKYO	23.5	24	69,072	
日本金銭機械	11.8	12	6,120	
マースグループホールディングス	6.8	6.9	10,474	
フクシマガリレイ	6.5	6.6	28,776	
オーライズミ	4.7	4.7	1,903	
ダイコク電機	4.9	5	4,380	
竹内製作所	17.8	18	43,938	
アマノ	27.7	28.2	67,116	
JUKI	14.7	15	7,965	
蛇の目ミシン工業	9.9	9.9	7,840	
マックス	16.2	16.5	23,776	
グローリー	27.2	27.7	56,729	
新晃工業	9.9	10	18,060	
大和冷機工業	15.4	17.3	17,438	
セガサミーホールディングス	104.8	106.7	182,563	
日本ピストンリング	3.9	4	3,788	
リケン	4.9	5	10,685	
TPR	14.3	14.5	20,938	
ツバキ・ナカシマ	21.6	20.6	26,017	
ホシザキ	30.9	33.9	307,134	
大豊工業	8.8	8.8	6,512	
日本精工	199	202.6	192,064	
NTN	244.8	249	66,234	
ジェイテクト	101.4	103.3	90,180	
不二越	9.8	10	45,100	
日本トムソン	31.6	32	15,616	
THK	61.5	67.1	239,547	
ユーシン精機	8.3	8.4	8,282	
前澤給装工業	3.9	3.9	8,580	
イーグル工業	13.2	13.4	13,266	
前澤工業	7.4	7.3	4,394	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
日本ピラー工業	10.8	10.9	17,876	
キッツ	43	39.3	23,462	
マキタ	137.8	140.3	701,500	
日立造船	84	85.4	57,218	
三菱重工業	177	180.3	563,617	
IHI	76.1	77.5	153,217	
スター精密	16.4	16.6	26,178	
電気機器(18.1%)				
日清紡ホールディングス	70.5	65.9	51,204	
イビデン	64.9	66	341,220	
コニカミノルタ	231.6	236.5	100,039	
プラザー工業	129.2	131.6	307,549	
ミネベアミツミ	196.3	200	464,200	
日立製作所	507.5	516.9	2,252,650	
三菱電機	1,056.1	1,075.7	1,757,155	
富士電機	63.7	64.8	262,764	
東洋電機製造	4.2	4	4,608	
安川電機	113.7	115.8	661,218	
シンフォニアテクノロジー	13.8	14	20,412	
明電舎	19.5	19.8	47,916	
オリジン	2.9	3	3,987	
山洋電気	5.2	5.3	32,065	
デンヨー	9.1	9.2	18,924	
東芝テック	13.3	13.5	50,827	
芝浦メカトロニクス	2	2	10,940	
マブチモーター	29.4	29.9	124,384	
日本電産	127.1	258.9	3,676,380	
トレックス・セミコンダクター	6.5	6.6	9,358	
東光高岳	6.4	6.3	10,092	
ダイヘン	11.6	11.8	59,236	
ヤーマン	16.2	17.8	33,891	
JVCケンウッド	88.4	91.1	15,669	
ミマキエンジニアリング	10.7	10.7	5,136	
I-PLEX	4.5	5.3	10,737	
日新電機	24.8	25.3	34,180	
大崎電気工業	21.2	21.5	12,685	
オムロン	94.7	96.4	921,584	
日東工業	15.6	15.8	32,247	
IDEC	15.3	15.6	28,719	
正興電機製作所	3.2	2.8	5,905	
不二電機工業	1.8	2.2	2,884	
ジース・ユアサ コーポレーション	35.5	36.1	116,783	
サクサホールディングス	2.5	2.6	3,543	
メルコホールディングス	3.8	3.9	13,494	
テクノメディカ	2.7	2.8	4,443	
日本電気	128.1	130.5	768,645	
富士通	101.8	103.7	1,757,715	
沖電気工業	43	43.8	46,515	
岩崎通信機	4.6	4.7	3,957	

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
電気興業	千株	千株	千円
電気興業	5.1	5.2	14,320
サンケン電気	11.6	11.8	60,534
ナカヨ	2.1	2.1	2,990
アイホン	6	6.1	9,894
ルネサスエレクトロニクス	505.1	462.6	605,080
セイコーエプソン	131.1	133.5	218,539
ワコム	72.4	72.9	72,827
アルパック	21.1	19.8	100,782
アクセル	5.1	5.1	3,855
E I Z O	8.2	8.4	30,912
日本信号	27	27.5	25,740
京三製作所	24.9	25.4	10,388
能美防災	14.2	14.5	32,059
ホーチキ	8	8.2	10,077
星和電機	6.3	6.1	3,922
エレコム	11.6	12.4	61,876
パナソニック	1,206.7	1,229	1,782,050
シャープ	122.3	124.5	268,422
アンリツ	68	69.3	186,278
富士通ゼネラル	28.7	29.2	76,796
ソニー	667.6	673.9	7,062,472
T D K	51	52	921,440
帝国通信工業	5.2	5.2	5,543
タムラ製作所	35.5	36.1	20,613
アルプスアルパイン	93.7	95.6	139,002
池上通信機	3.3	3.4	2,924
鈴木	6.4	5.8	6,757
日本トリム	1.6	1.6	7,008
ローランド ディー.ジー.	6.1	6.7	11,671
フォスター電機	11.1	11.3	16,509
SMK	2.7	2.8	8,596
ヨコオ	7	7.1	22,613
ホシデン	29.3	30	28,380
ヒロセ電機	16.4	16.6	255,972
日本航空電子工業	24.3	24.7	38,606
T O A	11.4	11.6	9,570
マクセルホールディングス	23.2	23.6	31,718
古野電気	14.1	14.4	16,228
ユニデンホールディングス	3	3	6,543
スミダコボレーション	8.6	9.7	9,797
アイコム	5.9	6	16,584
リオン	4.6	4.7	16,003
本多通信工業	10.2	10.3	4,923
横河電機	96.9	98.7	223,160
新電元工業	3.8	3.8	10,936
アズビル	66.7	67.9	379,561
東亜ディーケーベー	5.8	5.9	4,867
日本光工業	43.8	44.6	137,368
チノー	3.7	3.8	5,411

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
共和電業	千株	千株	千円
共和電業	11.3	11.5	4,473
日本電子材料		4.3	9,378
堀場製作所	20.9	21.3	145,905
アドバンテスト	78.5	80	729,600
小野測器	5.6	5.5	2,876
エスペック	9.6	9.8	19,580
キーエンス	95.7	97.5	5,620,875
日置電機	5.7	5.3	22,313
シスメックス	75.5	77	1,001,000
日本マイクロニクス	18.9	19.1	28,821
メガチップス	10.2	10.2	32,181
O B A R A G R O U P	5.6	6.4	26,560
澤藤電機	1.6	1.6	3,400
原田工業	5.6	5.7	4,873
コーセル	13.4	14.8	18,455
イリソ電子工業	9	9.2	43,424
オプテックスグループ	17.7	17.9	36,533
千代田インテグレ	5.2	4.9	8,746
アイ・オー・データ機器	4.5	4	4,080
レーザーテック	43.4	47.3	717,541
スタンレー電気	74.5	75.6	240,408
岩崎電気	4.5	4.6	6,541
ウシオ電機	61.7	59.8	83,361
岡谷電機産業	9.9	9.8	3,518
ヘリオス テクノ ホールディング	11.1	11.6	3,700
エノモト	3.6	3.6	5,976
日本セラミック	10.9	11.1	31,224
遠藤照明	6.2	6.4	3,283
古河電池	8.3	8	13,280
双信電機	6.4	6.4	2,848
山一電機	8	8.1	14,110
図研	7.1	7.2	20,383
日本電子	21	21.3	96,169
カシオ計算機	93.5	95.2	172,502
ファナック	100.3	101.2	2,739,484
日本シエムケイ	25.8	26.6	11,092
エンプラス	5.6	5.6	22,568
大真空	4.2	4.2	10,592
ローム	47	44.8	522,368
浜松ホトニクス	75.9	77.3	494,720
三井ハイテック	12	12	52,560
新光電気工業	35.9	36.3	97,501
京セラ	148.7	151.4	1,039,209
太陽誘電	47.2	47.9	290,753
村田製作所	310.3	316	3,316,420
双葉電子工業	17.2	17.6	16,702
北陸電気工業	4.8	4.9	4,557
ニチコン	36.4	36.9	55,276
日本ケミコン	8	8.7	16,886

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
KOA	千株	千株	千円	
市光工業	16.4	16.6	26,377	
小糸製作所	16.6	17	11,679	
ミツバ	63.4	64.5	452,145	
SCREENホールディングス	20.3	19.8	9,088	
キヤノン電子	18.3	18.7	157,454	
キヤノン	11.4	10.2	16,258	
リコー	568.5	534.6	1,171,843	
象印マホービン	268.8	273.8	205,350	
MUTOHホールディングス	31.3	29.4	51,273	
東京エレクトロン	1.8	1.7	2,546	
輸送用機器(7.1%)	70.4	68.3	2,971,733	
トヨタ紡織	30.8	31.4	53,066	
芦森工業	2.2	2.3	2,162	
ユニプレス	20.5	20.9	20,565	
豊田自動織機	85.5	87.1	743,834	
モリタホールディングス	18.5	18.8	32,693	
三櫻工業	13.4	13.7	12,946	
デンソー	232.5	236.8	1,427,904	
東海理化電機製作所	27.8	28.4	48,848	
三井E&Sホールディングス	38.1	38.9	17,116	
川崎重工業	82.2	83.7	201,214	
名村造船所	34	34.6	6,366	
日本車輛製造	3.8	3.9	9,906	
三菱ロジスネクスト	14	14.2	17,167	
近畿車輛	1.6	1.6	1,950	
日産自動車	1,245.5	1,268.6	704,834	
いすゞ自動車	306	311.7	301,725	
トヨタ自動車	1,178.2	1,200.3	9,194,298	
日野自動車	131.9	134.3	124,361	
三菱自動車工業	390.9	398.2	94,373	
エフテック	7.4	7.6	4,628	
レシップホールディングス	4.1	4.2	2,100	
GMB	2	2	1,968	
ファルテック	1.9	2	1,358	
武藏精密工業	23.5	24	36,816	
日産車体	20.6	21	18,333	
新明和工業	28.4	29	26,332	
極東開発工業	19.6	20	28,920	
日信工業	19.5	—	—	
トピー工業	8.7	8.9	11,489	
ティラド	3.9	3.9	5,296	
曙ブレーキ工業	58	59	9,912	
タチエス	17.4	17.7	19,434	
NOK	56.8	57.9	71,448	
フタバ産業	29.4	30	15,480	
KYB	11.8	12	27,888	
大同メタル工業	20.3	20.7	10,639	
ブレス工業	52.5	53.5	16,531	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ミクニ	千株	千株	千円	
太平洋工業	13.6	13.9	3,794	
ケーヒン	22.2	22.6	25,854	
河西工業	22.1	—	—	
アイシン精機	14.3	14.7	5,821	
マツダ	87	88.6	275,103	
今仙電機製作所	310.7	316.5	245,287	
本田技研工業	9.9	10.1	7,514	
スズキ	831.5	847	2,415,220	
SUBARU	209.3	213.2	1,086,893	
安永	327.8	334	682,362	
ヤマハ発動機	5.1	5.2	6,749	
ショーワ	137.7	152	330,904	
TBK	22.7	—	—	
エクセディ	12.7	12.9	5,676	
豊田合成	14.4	14.6	21,316	
愛三工業	34.1	34.8	99,145	
盟和産業	16.6	17	8,840	
日本プラスト	1.7	1.7	1,516	
ヨロズ	8.4	8.5	4,165	
エフ・シー・シー	9.9	10.1	12,806	
シマノ	17.3	17.6	30,870	
ティ・エス・テック	39.5	40.3	1,058,479	
ジャムコ	24.5	25	76,625	
精密機器(2.6%)	5.3	5.4	3,547	
テルモ	298.8	304.4	1,265,390	
クリエートメディック	3.5	3.6	3,492	
日機装	31.7	34.8	35,844	
日本エム・ディ・エム	6.1	6.2	14,049	
島津製作所	126.2	128.6	530,475	
JMS	9	9.1	8,481	
長野計器	7.7	7.8	7,683	
ブイ・テクノロジー	5	5	30,950	
東京計器	6.8	6.9	6,382	
愛知時計電機	6.1	6.4	5,964	
インター・アクション	1.4	1.4	15,480	
オーバル	5.7	5.8	9.6	
東京精密	9.6	9.7	9.7	
マニー	19.1	19.5	3,424	
ニコン	42.1	42.9	99,450	
トプコン	170.9	164.3	122,136	
オリンパス	53.2	54.2	133,575	
理研計器	584.3	595.2	70,351	
タムロン	9.3	9.5	1,250,217	
HOYA	8.5	8.7	28,785	
シード	210.9	213.4	17,469	
ノーリツ鋼機	4.5	4.6	2,755	
エー・アンド・ディ	7.1	7.3	16,089	
朝日インテック	9.7	9.8	12,632	
	89.7	121.9	424,212	

銘柄	当期首(期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
シチズン時計	123.7	126.1	38,712	
リズム	3.3	3.4	2,329	
大研医器	7.4	7.5	4,192	
メニコン	14.5	15.2	103,056	
シンシア	1.2	1.2	805	
松風	4.8	4.9	8,330	
セイコーホールディングス	14.9	15.2	20,246	
ニプロ	73.1	74.5	89,996	
<b>その他製品(2.7%)</b>				
中本パックス	2.7	2.7	4,368	
スノーピーク	5	6.4	12,051	
バラマウントベッドホールディングス	11.1	11.3	52,884	
トランザクション	6.7	5.9	6,189	
粧美堂	3.1	3.1	1,227	
ニホンフラッシュ	4.9	10	13,480	
前田工織	11.6	11.9	32,106	
永大産業	13.8	14.1	3,976	
アートネイチャー	11.3	11.5	7,440	
バンダイナムコホールディングス	109.2	111.2	1,031,268	
アイフィスジャパン	2.7	2.7	1,906	
共立印刷	17.6	18	2,106	
SHOEI	5.1	9.4	38,305	
フランスベッドホールディングス	14.9	15.2	14,181	
バイロットコーポレーション	17.2	19	56,582	
萩原工業	5.9	6	8,874	
トッパン・フォームズ	22.6	23	24,357	
フジシールインターナショナル	23.7	24.1	46,127	
タカラトミー	47.4	48.2	43,042	
廣済堂	7.4	7.5	6,285	
エステールホールディングス	2.8	2.9	1,748	
アーク	40.3	—	—	
タカノ	4.1	4.2	2,494	
プロネクサス	9.1	9.2	9,577	
ホクシン	6.5	6.6	739	
ウッドワン	3.5	3.6	3,783	
大建工業	7.1	7.2	12,369	
凸版印刷	149.1	151.8	221,628	
大日本印刷	138.2	140.8	258,508	
共同印刷	3.3	3.3	11,764	
NISSHA	21.7	22.1	30,475	
光村印刷	0.9	0.9	1,534	
TAKARA & COMPANY	5.1	5.2	8,944	
アシックス	87.2	95.1	169,848	
ツツミ	3.3	3.4	6,439	
小松ウォール工業	3.2	3.3	5,695	
ヤマハ	62.8	64	382,720	
河合楽器製作所	3.3	3.3	9,454	
クリナップ	9.8	10	4,610	
ビジョン	63.8	69.1	308,531	

銘柄	当期首(期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
オリバー	千株	千株	千円	
兼松サステック	2.2	2.3	5,674	
キングジム	0.7	0.7	1,229	
リンテック	8.8	8.9	7,636	
イトーキ	25.1	25.6	61,542	
任天堂	22.5	21.4	7,126	
三菱鉛筆	64.8	66	4,218,720	
タカラスタンダード	17.4	17.7	23,222	
コクヨ	21.8	22.2	33,078	
ナカバヤシ	50.7	51.6	68,989	
グローブライド	10.4	10.6	6,487	
オカムラ	4.7	4.8	21,288	
美津濃	36.8	37.5	34,387	
<b>電気・ガス業(1.3%)</b>				
東京電力ホールディングス	843	858.7	351,208	
中部電力	323.1	329.1	430,462	
関西電力	400.1	407.6	429,814	
中国電力	146	155.2	197,259	
北陸電力	96.5	98.3	69,399	
東北電力	263.8	268.7	242,367	
四国電力	95.1	96.9	70,543	
九州電力	217.7	221.7	222,586	
北海道電力	98.8	100.7	42,092	
沖縄電力	19.6	20.9	29,531	
電源開発	84	85.6	150,912	
エフオン	5	5.8	6,977	
イーレックス	15	15.7	27,757	
レノバ	17.4	18.1	80,545	
東京瓦斯	203.1	206.9	475,559	
大阪瓦斯	204.9	208.7	413,643	
東邦瓦斯	51.9	52.9	333,799	
北海道瓦斯	5.7	5.8	9,053	
広島ガス	21.7	22.1	8,221	
西部瓦斯	11.9	12.1	36,106	
静岡ガス	30	30.5	30,012	
メタウォーター	5.1	10.4	25,636	
<b>陸運業(3.4%)</b>				
SBSホールディングス	9.1	8	19,200	
東武鉄道	111.4	112.1	330,358	
相鉄ホールディングス	33.8	34.4	83,248	
東急	266.3	271.3	341,295	
京浜急行電鉄	135.6	138.1	222,479	
小田急電鉄	157.1	160	519,200	
京王電鉄	54.8	55.8	459,792	
京成電鉄	73.5	74.9	258,405	
富士急行	14.4	14.7	70,560	
新京成電鉄	2.7	2.8	6,076	
東日本旅客鉄道	185.9	189.3	1,279,668	
西日本旅客鉄道	94.1	95.9	514,791	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
東海旅客鉄道	千株	千株	千円	
西武ホールディングス	87.8	89.4	1,307,475	
鴻池運輸	141.7	140.4	138,013	
西日本鉄道	16.8	17.1	17,117	
ハマキヨウレックス	29.3	29.8	86,837	
サカイ引越センター	8.1	8.3	24,692	
近鉄グループホールディングス	5.6	5.7	28,899	
阪急阪神ホールディングス	100	101.9	453,964	
南海電気鉄道	133.4	135.9	451,867	
京阪ホールディングス	47.4	48.3	121,233	
神戸電鉄	44.5	45.4	223,595	
名古屋鉄道	2.4	2.4	8,592	
山陽電気鉄道	82.2	83.8	224,248	
日本通運	7.1	7.3	14,235	
ヤマトホールディングス	35.3	35.3	255,572	
山九	175.3	168.7	435,246	
丸運	27.8	28.3	112,209	
丸全昭和運輸	5.7	5.8	1,450	
センコーグループホールディングス	8.1	8.3	28,012	
トナミホールディングス	55.1	56.2	55,413	
ニッコンホールディングス	2.4	2.4	12,984	
日本石油輸送	35.8	36.5	76,942	
福山通運	1.1	1.1	2,908	
セイノーホールディングス	12.8	13	53,495	
エスライン	74.9	76.3	105,980	
神奈川中央交通	3	3.1	2,746	
日立物流	2.5	2.5	9,587	
丸和運輸機関	18.3	18.7	57,409	
C&Fロジホールディングス	10.5	21.5	48,224	
九州旅客鉄道	10.1	10.3	22,165	
S G ホールディングス	89.2	89.3	191,816	
海運業(0.2%)	105	213.9	599,775	
日本郵船	84	85.5	225,121	
商船三井	63.5	64.7	195,070	
川崎汽船	30.8	31.4	63,647	
N S ユナイテッド海運	5.8	6.2	9,207	
飯野海運	49.4	49.2	21,352	
共栄タンカー	2.6	2.7	2,430	
乾汽船	5.8	5.9	5,439	
空運業(0.4%)				
日本航空	180	228.7	433,157	
A N A ホールディングス	182.8	253.7	560,550	
バスコ	1.9	2	2,744	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	2.8	2.8	23,296	
日新	8.6	8.8	11,035	
三菱倉庫	31.7	32.3	99,807	
三井倉庫ホールディングス	11.4	11.6	26,610	
住友倉庫	36.8	36.6	46,628	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
滋澤倉庫	千株	千株	千円	
東陽倉庫	5.5	5.6	11,715	
日本トランシスティ	18.1	18.4	5,814	
ケイヒン	22	22.4	11,513	
中央倉庫	1.9	2	2,596	
川西倉庫	6.1	6.2	6,975	
安田倉庫	1.8	1.9	2,167	
ファイズホールディングス	8.2	8.4	8,013	
東洋埠頭	2.1	2.2	2,470	
宇徳	3	3.1	4,330	
上組	8.5	8.7	4,062	
サンリツ	57.3	56.8	105,080	
キムラユニティー	2.4	2.4	1,675	
キユースー流通システム	2.7	2.7	2,916	
近鉄エクスプレス	2.5	2.5	3,922	
東海運	21.2	21.6	57,024	
エーアイティー	5.7	5.8	1,803	
内外トランスライン	7.1	7.2	7,106	
日本コンセプト	3.5	3.6	4,230	
情報・通信業(9.3%)	3.2	3.2	4,630	
N E C ネッツエスアイ	9.9	30	57,600	
クロスキャット	2.9	2.9	3,526	
システナ	37.1	37.7	78,265	
デジタルアーツ	5.1	5.2	55,588	
日鉄ソリューションズ	15.6	15.9	50,880	
キューブシステム	5.8	5.7	7,125	
エイジア	2.1	2	3,870	
コア	4.6	4.6	6,679	
ラクーンホールディングス	—	5.3	9,582	
ソリトンシステムズ	4.7	5.4	9,909	
ソフトクリエイトホールディングス	4.7	4.7	13,131	
T I S	34.6	105.6	232,742	
J N S ホールディングス	4.1	4.2	2,335	
電算システム	4	4	12,700	
グリー	72	65	38,090	
コーデーテクモホールディングス	21.3	21.6	129,168	
三菱総合研究所	4.5	4.6	19,780	
電算	1.3	1.2	2,971	
A G S	6.2	6.1	5,142	
ファインデックス	8.9	9	10,026	
ブレインパッド	2.2	2.8	11,746	
K L a b	20	19.2	17,299	
ポルトウェーブ・ピックルホールディングス	12.8	12.9	15,467	
イーブックインシアティブジャパン	1.6	1.6	4,433	
ネクソン	295.2	266.5	870,122	
アイスタイル	27.2	29.9	12,438	
エムアップホールディングス	3.1	3.1	7,852	
エイチーム	7.4	7.4	8,428	
エニグモ	7.6	10.1	12,695	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
テクノスジャパン	千株	千株	千円	
コロプラ	8.5	8.4	5,728	
プロードリーフ	34.1	34.8	32,364	
クロス・マーケティンググループ	51.8	52.6	33,453	
デジタルハーツホールディングス	5.3	5.1	1,866	
システム情報	5.7	5.7	7,854	
メディアドゥ	5.5	8	9,968	
じげん	3.3	3.5	24,080	
ブイキューブ	26.1	26.5	10,414	
エンカレッジ・テクノロジ	—	5.8	19,633	
サイバーリンクス	2	2.5	1,750	
フィックスターズ	1.8	3.5	7,805	
CARTA HOLDINGS	11.2	11.4	24,080	
オプティム	5.2	4.4	5,865	
セレス	2.8	5.6	18,284	
SHIFT	3.6	3.5	8,813	
ティーガイア	2.7	4.7	61,805	
セック	9.3	9.4	17,662	
日本アジアグループ	1.6	1.6	4,512	
豆蔵ホールディングス	10.9	11.1	9,557	
テクマトリックス	7.2	—	—	
プロシップ	7.4	14.9	29,859	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3.2	3.2	4,569	
GMOペイメントゲートウェイ	25.1	25.5	66,300	
ザッパラス	17.1	22.4	344,960	
システムリサーチ	6	4.8	2,443	
インターネットニシアティブ	2.9	2.9	5,095	
インターネット	15.4	31.3	69,548	
さくらインターネット	11.5	11.5	8,544	
ヴィンクス	3.1	3.1	3,658	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.1	2.4	22,368	
SRAホールディングス	5.6	5.7	14,312	
システムインテグレータ	3.6	3.6	2,217	
朝日ネット	7.8	7.7	6,768	
e B A S E	6.4	12.7	13,423	
アバント	7.6	10.2	12,546	
アドソル日進	3.8	3.8	12,141	
フリービット	6.4	5.6	5,504	
コムチュア	11.7	11.9	35,676	
サイバーコム	2	2	3,386	
アステリア	6.7	6.6	6,949	
アイル	3.8	6	8,886	
マークライズ	5.3	4.5	11,245	
メディカル・データ・ビジョン	5.5	12.1	36,481	
g u m i	—	13.7	11,946	
ショーケース	2.8	2.4	2,402	
モバイルファクトリー	2.5	2.5	2,755	
テラスカイ	3.8	3.9	14,917	
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	
P C I ホールディングス	2.2	4.1	6,543	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
パイプドHD	千株	千株	千円	
アイビーシー	1.5	1.4	2,234	
ネオジャパン	2.1	1.8	2,017	
P R T I M E S	2.2	2.1	4,225	
ランドコンピュータ	1	1.8	7,560	
ダブルスタンダード	1.8	1.7	1,895	
オーブンドア	1.4	1.4	6,160	
マイネット	5.3	5.3	8,628	
アカツキ	3.3	3.5	3,227	
ベネフィットジャパン	3.7	3.8	18,012	
U b i c o m ホールディングス	0.9	0.9	1,659	
L I N E	2.5	2.4	8,964	
カナミックネットワーク	21.6	—	—	
ノムラシステムコーポレーション	6.6	9.9	7,128	
チエンジ	2.7	5	1,880	
シンクロ・フード	2.2	14.8	51,430	
オーネット	4.9	4.9	1,607	
セグエグループ	6.6	5.7	7,666	
エイトレッド	2	2.8	3,707	
AOI TYO Holdings	1.4	1.8	5,034	
マクロミル	10.8	11	4,829	
ビーグリー	18.7	21.8	16,153	
オロ	2.2	2.1	3,675	
ユーチーローカル	2.8	3.4	13,872	
デモナ	0.6	1.1	4,741	
ニーズウェル	1.9	2.4	2,464	
サンインポスト	1.6	2.2	1,491	
ソルクシーズ	1.7	2.5	2,407	
フェイス	4.7	4.2	4,200	
プロトコーポレーション	4	3.9	3,166	
ハイマックス	9.5	9.6	10,147	
野村総合研究所	1.3	2.6	3,068	
サイバネットシステム	173.3	149.7	583,830	
C E ホールディングス	7.7	7.6	7,577	
日本システム技術	6.5	5.8	3,630	
インテージホールディングス	1.8	1.8	2,844	
東邦システムサイエンス	13.2	13.3	15,215	
ソースネクスト	3	2.9	2,697	
インフォコム	49.7	50.6	14,421	
HERO Z	11.4	11.6	39,672	
ラクスル	—	1.5	4,122	
F I G	5.5	8.5	35,870	
システムサポート	12.1	12	3,180	
イーソル	1	2.5	3,882	
アルテリア・ネットワークス	3.8	5.9	7,144	
E d u L a b	11.6	11.8	18,703	
東海ソフト	—	1	7,050	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.5	0.9	1,084	
東名	—	0.7	3,725	
			807	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ヴィッツ	千株	千株	千円	
トビラシステムズ	—	0.5	1,066	
Link-U	—	1.1	1,530	
フォーカスシステムズ	—	0.8	1,064	
クレスコ	6.7	6.7	6,311	
フジ・メディア・ホールディングス	3.2	6.5	8,424	
オーピック	100	101.8	119,513	
ジャストシステム	35.9	36.6	766,038	
TDCソフト	16.9	17.2	136,224	
Zホールディングス	9.3	9.4	9,118	
トレンドマイクロ	1,423.6	1,449.8	1,014,570	
IDホールディングス	46.1	56.4	323,172	
日本オラクル	4.1	4.1	4,956	
アルファシステムズ	21	21.4	284,192	
フューチャー	3.3	3.3	11,731	
CAC Holdings	12.6	12.8	22,720	
SBテクノロジー	6.9	7	9,604	
トーセ	3.8	3.8	13,110	
オーピックビジネスコンサルタント	3.1	3	2,403	
伊藤忠テクノソリューションズ	10.6	10.8	75,816	
アイティフォー	47.3	48.1	178,210	
東計電算	12.8	12.9	11,984	
エックスネット	1.6	1.6	6,448	
大塚商会	1.9	1.8	1,746	
サイボウズ	56.1	57.1	295,207	
ソフトブレーン	12.3	12.4	34,211	
電通国際情報サービス	6.5	—	—	
ACCESSIONS	6.5	13.1	50,173	
デジタルガレージ	—	10.1	7,706	
EMシステムズ	18.7	19	73,720	
ウェザーニューズ	14.8	15.1	14,647	
C I J	3.6	3.6	18,504	
ビジネスエンジニアリング	8	7.4	6,430	
日本エンタープライズ	1.3	1.2	3,816	
WOWOW	11.6	11.4	2,553	
スカラ	5.1	5.1	14,489	
インテリジェント ウェイブ	7.7	7.2	5,947	
IMAGICA GROUP	4.2	6.4	4,652	
ネットワンシステムズ	9.2	9.4	3,374	
システムソフト	39.6	40.3	153,946	
アルゴグラフィックス	27	24.3	2,235	
マーベラス	8.9	9	27,675	
エイベックス	16.2	16.3	15,631	
日本ユニシス	18	18.2	23,387	
兼松エレクトロニクス	32.4	33	134,145	
都築電気	5.7	5.8	23,258	
TBSホールディングス	—	3.4	5,450	
日本テレビホールディングス	63.1	64.3	124,806	
朝日放送グループホールディングス	86.7	88.2	101,341	
—	10.6	10.7	7,479	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
テレビ朝日ホールディングス	千株	千株	千円	
スカパーJSATホールディングス	28.6	29.1	54,096	
テレビ東京ホールディングス	68.7	69.7	32,828	
日本B S放送	8.6	8.7	20,732	
ビジョン	3.7	3.7	4,266	
スマートバリュー	9.8	13.2	12,183	
ワイヤレスゲート	3.4	2.9	2,679	
コネクシオ	5.2	4.5	3,010	
クロップス	6	6.1	8,442	
日本電信電話	2.2	2.1	1,558	
KDDI	1,385.3	1,411	3,808,994	
ソフトバンク	772.3	769.6	2,496,582	
光通信	941.9	959.4	1,292,311	
N T Tドコモ	10.7	10.9	236,530	
エムティーアイ	765.5	—	—	
GMOインターネット	10.4	10.4	8,548	
ファイバーゲート	41	37.9	117,111	
アイドマーケティングコミュニケーション	2.1	3.5	7,423	
KADOKAWA	3.5	3.5	1,505	
学研ホールディングス	28	28.5	99,322	
ゼンリン	3.5	14.2	23,572	
昭文社ホールディングス	20.8	21.2	24,825	
インプレスホールディングス	5.4	5.2	2,371	
アイネット	8.6	8.7	1,635	
松竹	5.5	5.5	8,607	
東宝	6.9	7	100,100	
東映	62	62.3	247,331	
エヌ・ティ・ティ・データ	3.9	4	69,560	
ビー・シー・エー	276.1	281.1	421,650	
ビジネスブレイン太田昭和	1.4	1.8	8,379	
D T S	1.9	3.7	5,920	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	23.3	23.7	50,030	
シーアーキー	44.2	45	266,850	
カプコン	11.2	11.4	16,666	
アイ・エス・ピー	48.9	49.8	355,572	
ジャスティック	2.1	5	6,725	
S C S K	6.8	6.8	8,391	
日本システムウェア	24	24.4	134,932	
アイネス	3.5	3.6	7,732	
T K C	10.4	10.5	14,857	
富士ソフト	8.8	8.9	63,724	
N S D	13.3	11.3	58,421	
コナミホールディングス	34.2	34	69,258	
福井コンピュータホールディングス	37.7	38.4	254,976	
J B C Cホールディングス	4.1	4.2	15,792	
ミクロ情報サービス	7.1	7.2	10,958	
ソフトバンクグループ	9.2	9.4	19,279	
卸売業(4.6%)	822.3	837.5	7,370,000	
ホウスイ	0.9	0.9	900	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
高千穂交易	千株	千株	千円	
オルパヘルスケアホールディングス	4	4.1	4,903	
伊藤忠食品	—	1.3	1,927	
エレマテック	2.6	2.6	13,780	
JALUX	9.7	9.9	9,830	
あらた	2.9	3	4,119	
トーメンデバイス	8.3	8.4	39,312	
東京エレクトロン デバイス	1.6	1.6	5,656	
フィールズ	3.8	3.8	12,882	
双日	574.5	585.2	143,959	
アルフレッサ ホールディングス	115.6	117.8	239,134	
横浜冷凍	29.2	27.7	24,015	
ラサ商事	5.5	5.6	5,045	
ラクーンホールディングス	5	—	—	
アルコニックス	11.1	11.3	18,848	
神戸物産	35.9	73.1	216,376	
ハイパー	—	1.6	854	
あい ホールディングス	14.9	15.1	30,637	
ディーブイエックス	3.7	3.8	3,955	
ダイワボウホールディングス	8.8	9	80,010	
マクニカ・富士エレホールディングス	24.8	25.3	52,649	
ラクト・ジャパン	3.9	4.6	12,245	
グリムス	—	2.4	3,835	
バイタルケーエスケーホールディングス	19.6	20	16,040	
八洲電機	8.1	8.2	7,945	
メディアスホールディングス	5.9	6	4,722	
レスターホールディングス	10.8	11	23,551	
ジュー・テックホールディングス	2.4	2.4	2,438	
大光	4.5	4.5	2,979	
O C H I ホールディングス	3	3.1	4,048	
TOKAIホールディングス	55	56	54,824	
黒谷	2.4	2.9	2,204	
Cominix	1.8	1.9	1,438	
三洋貿易	5.2	10.7	10,625	
ビューティガレージ	1.7	1.7	4,170	
ワイン・パートナーズ	7.5	7.7	8,477	
ミタチ産業	3.1	3.2	1,910	
シップヘルスケアホールディングス	16.7	17	102,340	
明治電機工業	3.3	3.3	5,101	
デリカフーズホールディングス	3.7	3.8	2,337	
スター・ティアホールディングス	2.4	2.4	2,498	
コメダホールディングス	22.7	23.1	43,797	
ビーバンドットコム	—	1.1	1,234	
アセンテック	0.8	2.3	4,367	
富士興産	3.2	3.2	3,331	
協栄産業	1.2	1.2	1,603	
小野建	9.3	9.5	11,628	
南陽	2.3	2.3	3,792	
佐鳥電機	7.7	7.2	5,500	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
エコートレーディング	千株	千株	千円	
伯東	2.4	2.5	1,650	
コンドーテック	6.4	6.5	7,507	
中山福	8.1	8.2	8,634	
ナガイレーベン	6	6.1	3,397	
三義食品	15.1	14.1	42,159	
松田産業	11.4	11.7	32,994	
第一興商	7.6	7.7	14,645	
メディパルホールディングス	15.5	15.8	54,510	
S P K	112.3	114.3	236,143	
萩原電気ホールディングス	2.2	4.6	5,763	
アズワン	3.9	3.9	9,816	
スズデン	6.8	6.9	112,125	
尾家産業	3.6	3.7	4,576	
シモジマ	3.1	3.1	3,964	
ドウシシャ	6.4	6.5	8,911	
小津産業	9.8	10	19,380	
高速	2.3	2.3	4,379	
たけびし	6.2	6.3	9,714	
リックス	3.7	3.7	5,812	
丸文	2.4	2.4	3,686	
ハピネット	9.2	9.4	5,057	
橋本総業ホールディングス	8.7	8.9	14,400	
日本ライフライン	2.1	2.1	5,334	
タカショ一	30.8	31.4	47,131	
エクセル	5.1	6.9	5,582	
マルカ	2.7	—	—	
I D O M	3.7	3.4	6,466	
進和	28.1	28.6	18,304	
エスケイジャパン	6.2	6.3	13,236	
ダイトロン	2.3	2.3	1,051	
シーカス	4.4	4.5	7,375	
田中商事	13.2	13.5	20,574	
オーハシテクニカ	3.2	3.3	2,283	
白銅	5.9	5.4	7,560	
ダイコー通産	3.7	3.8	5,304	
伊藤忠商事	6.2	0.7	1,076	
丸紅	727.5	741	2,328,963	
高島	1,082.6	1,102.8	796,552	
長瀬産業	1.7	1.7	2,801	
蝶理	58.5	59.6	92,082	
豊田通商	6.6	6.8	10,370	
三共生興	116.1	118.3	514,605	
兼松	15.8	16.1	7,550	
ツカモトコーポレーション	38.8	39.5	52,337	
三井物産	1.9	1.9	3,030	
日本紙パルプ商事	914.2	917.3	1,889,179	
日立ハイテク	5.9	6	21,330	
カメリ	36.1	—	—	
	13.6	13.8	16,284	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
東都水産		千株	千株	千円
O U G ホールディングス	1.3	1.4	5,054	
スター・ゼン	1.7	1.7	4,744	
山善	3.8	3.9	16,536	
椿本興業	40.6	41.4	41,275	
住友商事	1.9	2	6,900	
内田洋行	656.3	668.5	947,264	
三菱商事	4.4	4.2	17,325	
第一実業	729.9	694.7	1,864,227	
キヤノンマークティングジャパン	5.1	5.2	21,294	
西華産業	29.7	26.3	62,462	
佐藤商事	5.9	6	8,064	
菱洋エレクトロ	8.6	8.8	7,990	
東京産業	10.6	10.7	36,380	
ユアサ商事	9.4	9.6	5,865	
神鋼商事	9.9	10.1	32,370	
トルク	2.6	2.7	5,054	
阪和興業	6.3	6.4	1,555	
正栄食品工業	19.4	19.8	55,123	
カナデン	6.7	6.9	25,530	
菱電商事	8.5	8.6	10,922	
フルサト工業	7.5	7.6	12,046	
岩谷産業	5.7	5.9	7,752	
ナイス	23.1	27.4	197,554	
昭光通商	4	4.5	7,218	
ニチモウ	3.3	3.4	2,169	
極東貿易	1.6	1.7	3,196	
イワキ	3	3.1	4,302	
三愛石油	13.7	14	9,520	
稻畑産業	25.6	26.1	28,762	
G S I クレオス	22.9	23.4	34,398	
明和産業	2.6	2.6	4,968	
クワザワホールディングス	9.6	9.8	4,410	
ヤマエ久野	3.7	3.8	2,356	
ワキタ	—	7.7	8,061	
東邦ホールディングス	22.2	22.6	22,215	
サンゲツ	33.4	34	66,334	
ミツウロコグループホールディングス	28.6	28.6	43,843	
シナネンホールディングス	15.3	15.6	20,826	
伊藤忠エヌクス	4.3	4.4	13,508	
サンリオ	23	23.5	23,876	
サンワテクノス	29.2	29.8	45,951	
リヨーサン	7.4	7.5	7,875	
新光商事	11.5	11.7	23,271	
トーホー	16.3	15.9	11,845	
三信電気	4.7	4.8	8,774	
東陽テクニカ	5.6	5.7	10,317	
モスクードサービス	12	11.4	13,531	
加賀電子	13.7	13.9	42,534	
	10.4	10.6	24,676	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ソーダニッカ		千株	千株	千円
立花エレテック	10.8	11	5,885	
フォーバル	7.7	7.8	12,409	
P A L T A C	4.6	4.7	3,717	
三谷産業	16.7	17	96,050	
西本Wismettacホールディングス	13.8	14	6,048	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.9	2.4	5,733	
コーワ商事ホールディングス	0.9	1	1,525	
国際紙パルプ商事	—	2	2,726	
ヤマタネ	24.7	25.2	5,997	
丸紅建材リース	5.2	5.3	7,213	
日鉄物産	1	1	1,700	
泉州電業	7.4	7.6	28,006	
トラスコ中山	3.2	3	9,600	
オートバックスセブン	21.7	24.3	64,127	
モリト	38.6	39.3	55,413	
加藤産業	7.6	7.8	4,750	
北恵	16.3	15.3	52,785	
イノテック	2	2.7	2,400	
イエロー・ハット	6.2	5.5	6,088	
J K ホールディングス	19.7	20	33,560	
日伝	9.4	9.6	21,590	
北沢産業	5.6	5.7	2,219	
杉本商事	29.6	30.2	13,469	
因幡電機産業	3.5	3.5	7,670	
東テク	3.5	3.5	9,684	
ミスミグループ本社	130.3	132.8	419,648	
アルテック	8.4	7.9	2,235	
タキヒヨー	3.2	3.2	5,884	
蔵王産業	2	2.1	2,847	
スズケン	44.1	44.9	180,498	
ジェコス	7.2	7.3	7,000	
グローセル	10.5	10.7	5,146	
小売業(4.7%)				
ローソン	26.3	26.8	131,052	
サンエー	8.7	8.9	36,490	
カワチ薬品	8.2	8.3	25,813	
エービーシー・マート	16.3	16.6	97,940	
ハードオフコーポレーション	4.4	4.5	3,388	
アスクル	10.9	11.1	41,736	
ゲオホールディングス	18.9	19.3	23,314	
アグストリア	14.5	14.8	28,490	
ジーフット	6.6	—	—	
くら寿司	5.5	6.3	39,060	
キャンドゥ	5.1	5.2	9,739	
パルグループホールディングス	5.4	11	16,225	
エディオン	47.9	48.8	49,727	
サーラコーポレーション	21.4	21.9	12,504	
ワッツ	4.9	4.9	4,312	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ハローズ	千株	千株	千円	
	4	4	13,280	
フジオフードグループ本社	8.9	8.9	10,617	
あみやき亭	2.3	2.4	6,842	
ひらまつ	19.9	—	—	
大黒天物産	2.6	2.6	15,262	
ハニーズホールディングス	9.3	9.5	9,519	
ファーマライズホールディングス	2.8	2.8	2,164	
アルペン	8.1	8.2	19,630	
ハブ	3.2	3.3	1,996	
クオールホールディングス	15.4	15.8	18,154	
ジンズホールディングス	5.5	5.6	37,576	
ピックカメラ	61.9	63	71,505	
DCMホールディングス	56.3	65.1	69,396	
Mon o n a R O	74	75.4	392,080	
東京一番フーズ	3	3	1,716	
DDホールディングス	4.1	—	—	
きちりホールディングス	3	3.1	1,776	
アークランドサービスホールディングス	7.7	8.9	18,485	
J. フロント リテイリング	124.3	126.8	107,906	
ドトール・日レスホールディングス	16.7	15.4	24,008	
マツモトキヨシホールディングス	43	43.8	187,464	
プロンコビリー	5.5	5.6	12,208	
Z O Z O	71.6	72.9	218,262	
トレジャー・ファクトリー	3.2	3.4	2,482	
物語コーポレーション	2.6	2.8	30,912	
ココカラファイン	10.9	11.1	80,142	
三越伊勢丹ホールディングス	182	185.7	114,576	
H a m e e	3.3	3.9	6,949	
ウェルシアホールディングス	31	63.1	226,844	
クリエイトSDホールディングス	15.4	17.9	61,934	
丸善CHIホールディングス	12.1	12.4	4,600	
ティーライフ	1.6	1.7	1,963	
エー・ピー・ホールディングス	2.3	—	—	
チムニー	3.3	3.4	4,100	
シュッピン	7.2	7.4	6,859	
オイシックス・ラ・大地	—	10.5	34,597	
ネクステージ	15	18.3	25,894	
ジョイフル本田	30.6	31.2	44,148	
鳥貴族	3.5	3.2	4,745	
キリン堂ホールディングス	4.2	—	—	
ホットtrand	7.1	8.1	9,687	
すかいらーくホールディングス	116.7	118.9	195,828	
S F P ホールディングス	4.5	6.2	8,221	
綿半ホールディングス	4	8.1	11,161	
ヨシックス	1.8	1.8	3,601	
ヨナイトド・スーパーマーケット・ホールディングス	30.4	31	34,565	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.1	5.7	4,810	
B E E N O S	4.206	5	11,965	
あさひ	7.9	8	13,024	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
日本調剤	千株	千株	千円	
	3.2	6.6	9,913	
コスモス薬品	4.6	9.4	152,280	
トーエル	5.3	5.4	4,428	
オンリー	2	2.2	998	
セブン&アイ・ホールディングス	406.9	414.5	1,637,275	
クリエイトレストラン・ホールディングス	28.1	56.9	40,683	
ツルハホールディングス	22.6	23.1	325,941	
サンマルクホールディングス	8.3	8.5	12,682	
フェリシモ	2.5	2.5	3,337	
トリドールホールディングス	12.9	26.4	38,913	
TOKYO BASE	9.7	9.9	4,445	
ウイルプラスホールディングス	1.8	1.6	1,243	
J M ホールディングス	5.3	8.1	16,969	
サツドラホールディングス	1.7	1.7	3,403	
アレンザホールディングス	5.4	5.4	6,744	
串カツ田中ホールディングス	1.7	2.9	4,538	
パロックジャパンリミテッド	7.4	7.6	5,677	
クスリのアオキホールディングス	10.4	9.5	81,320	
力の源ホールディングス	4.9	4.8	2,745	
スシロー・グローバルホールディングス	11.4	58.2	226,107	
L I X I L ビバ	10.4	—	—	
メディカルシステムネットワーク	10.4	10.5	6,594	
はるやまホールディングス	5.1	5.2	3,536	
ノジマ	18.6	18.9	53,865	
カッパ・クリエイト	14.6	14.9	22,126	
ライトイオン	7.8	7.9	4,834	
良品計画	138.2	140.8	334,822	
三城ホールディングス	11.7	11.9	3,736	
アドヴァン	16.1	16.4	18,860	
アルビス	4	4.1	9,905	
コナカ	12.8	12.5	3,850	
ハウス オブ ローゼ	1.4	1.4	2,335	
G-7 ホールディングス	6.2	6.3	15,605	
イオン北海道	10.6	14.1	14,085	
コジマ	18.3	18.5	11,895	
ヒマラヤ	3.9	3.9	3,673	
コーナン商事	14.9	15.1	43,518	
エコス	3.9	4	7,520	
ワタミ	12.5	12.8	12,096	
マルシェ	3	3.2	1,577	
心・パワーアイ・インターナショナルホールディングス	249.4	233	532,638	
西松屋チエーン	23	23.4	34,117	
ゼンショーホールディングス	49.9	50.8	143,662	
幸楽苑ホールディングス	6.7	6.7	11,095	
ハーカスレイ	2.4	2.4	2,121	
サイゼリヤ	17.2	15.8	33,338	
V T ホールディングス	43.5	44.4	19,225	
魚力	3	3	5,370	
フジ・コーポレーション	2.8	2.9	6,101	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ユナイティドアローズ	千株	千株	千円	
ハイディ日高	11	11.2	17,673	
京都きもの友禅	15.1	15.4	26,056	
コロワイド	7.2	7.6	1,565	
ビーシーデボコーポレーション	34.7	35.2	62,163	
壱番屋	14.2	14.4	8,294	
P L A N T	7.4	7.5	38,175	
スギホールディングス	3	2.9	2,096	
葉王堂ホールディングス	20.8	21.2	152,216	
スクロール	4.6	4.7	12,149	
ヨンドシホールディングス	16.5	16.5	14,553	
ファミリーマート	10.7	10.9	21,309	
木曽路	83.1	—	—	
S R S ホールディングス	13.7	13.9	33,262	
タカキュー	12.5	12.7	10,452	
リテールパートナーズ	9.2	—	—	
ケーヨー	21.6	21.9	19,439	
上新電機	12.4	12.5	34,587	
日本瓦斯	16.5	16.2	82,944	
ロイヤルホールディングス	16.5	18.5	33,133	
いなげや	18.2	13.2	23,192	
島忠	13	20	109,600	
チヨダ	19.6	—	—	
ライフコーポレーション	11	11.3	9,966	
リングアハット	7.9	8.1	26,365	
M r M a x H D	12.9	13.1	30,549	
テンアライド	14.7	14.8	10,863	
A O K I ホールディングス	9.6	—	—	
オーワク	21	21.6	11,728	
コメリ	16.4	16.7	21,175	
青山商事	16.1	16.4	46,756	
しまむら	21.6	22.2	14,496	
はせがわ	12.1	12.3	144,525	
高島屋	6	6.2	1,804	
松屋	75.9	77.3	72,662	
エイチ・ツー・オー リテイリング	21.1	21.5	17,415	
近鉄百貨店	49.4	50.3	35,411	
バルコ	4	4.1	12,587	
丸井グループ	9.3	—	—	
アクシアル リテイリング	95.4	97.2	174,085	
イオン	8.7	8.8	44,264	
イズミ	400.3	407.7	1,351,525	
平和堂	21.2	21.6	80,028	
フジ	21.2	21.6	47,174	
ヤオコー	12.6	12.8	25,433	
ゼビオホールディングス	11.8	12	80,040	
ケーズホールディングス	12.7	13.1	11,397	
O l y m p i c グループ	100.5	102.4	146,227	
日産東京販売ホールディングス	5.7	5.7	5,135	
	16	16.3	4,172	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
シルバーライフ	千株	千株	千円	
Genky Drug Stores	—	1.5	3,166	
ナルミヤ・インターナショナル	5.2	4.7	18,729	
総合メディカルホールディングス	1.9	2.6	2,511	
ブックオフグループホールディングス	9.2	—	—	
ギフト	6.1	6.2	5,158	
AINホールディングス	—	1.1	2,062	
元気寿司	14	13	82,550	
ヤマダホールディングス	2.7	2.8	6,596	
アークランドサカモト	317.2	323.2	174,204	
ニトリホールディングス	16.5	16.7	25,885	
グルメ杵屋	45	45.9	1,009,800	
愛眼	7.6	7.8	7,581	
ケーユーホールディングス	8.3	8.4	1,898	
吉野家ホールディングス	5.7	5.8	4,657	
松屋フーズホールディングス	34.2	34.9	74,965	
サガミホールディングス	5	5.2	18,122	
関西スーパー マーケット	14.1	14.3	16,716	
王将フードサービス	8.8	9	10,170	
ブレナス	7.7	7.8	44,772	
ミニストップ	11.8	12	22,992	
アーツ	7.8	7.9	11,162	
パローホールディングス	21.4	21.8	50,227	
ベルク	23.1	23.5	58,162	
大庄	5.2	5.3	30,846	
ファーストリティリング	5.7	5.9	5,717	
サンドラッグ	13.9	14.2	1,303,844	
サックスパー ホールディングス	39.2	39.9	163,590	
ヤマザワ	9	9.3	5,217	
やまや	2.6	2.6	4,469	
ペルーナ	2.2	2.2	4,802	
銀行業(4.5%)	22.6	22.9	26,518	
島根銀行	2.1	2.8	1,867	
じもとホールディングス	70.4	7.2	5,796	
めぶきフィナンシャルグループ	541.2	551.3	114,119	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	14.1	14.3	15,944	
九州フィナンシャルグループ	170.9	232.1	98,410	
ゆうちょ銀行	295.1	300.6	266,331	
富山第一銀行	24.8	25.3	7,235	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	612.6	606	234,522	
西日本フィナンシャルホールディングス	71	70.6	45,607	
関西みらいフィナンシャルグループ	61.1	62.3	32,396	
三十三フィナンシャルグループ	9.7	9.8	12,348	
第四北越フィナンシャルグループ	18.1	18.4	41,216	
ひろぎんホールディングス	—	156.5	94,995	
新生銀行	76.4	77.9	104,541	
あおぞら銀行	76.4	63.2	123,935	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	62.1	7,169.9	7,257.7	3,505,469
りそなホールディングス	1,143	1,153.5	432,101	

銘柄	当期首(期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
三井住友トラスト・ホールディングス	千株	千株	千円	
三井住友フィナンシャルグループ	196.9	200.5	634,582	
千葉銀行	720.3	733.8	2,450,158	
群馬銀行	358.3	354.1	204,669	
武藏野銀行	204.7	203.8	64,604	
千葉興業銀行	15.5	15.8	24,537	
筑波銀行	28.6	29.1	7,129	
七十七銀行	43.3	44.1	7,938	
青森銀行	35.2	35.8	48,186	
秋田銀行	8.1	8.2	19,442	
山形銀行	6.7	6.8	9,486	
岩手銀行	11.7	11.9	12,019	
東邦銀行	6.8	7	13,622	
東北銀行	93.1	94.9	19,359	
みちのく銀行	5	5.1	5,553	
ふくおかフィナンシャルグループ	6.7	6.8	6,847	
静岡銀行	87.7	89.4	172,005	
十六銀行	257.9	258.4	198,192	
スルガ銀行	13.1	13.3	25,030	
八十二銀行	106.6	108.5	34,286	
山梨中央銀行	251.4	256	87,552	
大垣共立銀行	12.1	12.3	9,803	
福井銀行	20.6	21	41,853	
北國銀行	8.9	9.1	17,135	
清水銀行	10.7	10.6	26,584	
富山銀行	4.3	4.4	7,466	
滋賀銀行	2	2	5,610	
南都銀行	20.9	21.3	41,598	
百五銀行	17.3	17.6	30,166	
京都銀行	93.7	95.5	27,790	
紀陽銀行	37.3	38	214,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	36.9	37.6	51,624	
広島銀行	69.3	70.6	66,152	
山陰合同銀行	153.8	—	—	
中国銀行	61.8	62.9	30,506	
鳥取銀行	89.6	91.3	74,683	
伊予銀行	3.5	3.6	4,028	
伊予銀行	148.6	151.4	93,716	
百十四銀行	11.1	11.3	16,633	
四国銀行	15.8	16.1	10,738	
阿波銀行	17	17.3	38,544	
大分銀行	6	6.1	12,480	
宮崎銀行	6.9	7.1	15,676	
佐賀銀行	6.3	6.4	8,435	
沖縄銀行	9.5	9.7	26,025	
琉球銀行	24	24.5	18,154	
セブン銀行	347.9	354.5	79,762	
みずほフィナンシャルグループ	14,153.1	1,441.7	2,029,192	
高知銀行	3.8	3.8	2,644	
山口フィナンシャルグループ	130	132.4	79,440	

銘柄	当期首(期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
長野銀行	千株	千株	千円	
名古屋銀行	3.4	3.5	4,410	
北洋銀行	8.4	7.9	21,021	
愛知銀行	157	159.9	33,259	
中京銀行	3.8	3.8	10,966	
大光銀行	4.3	4.4	8,505	
愛媛銀行	3.6	3.6	4,579	
トマト銀行	14.5	14.8	14,282	
京葉銀行	4	4.1	4,227	
栃木銀行	44.4	45.2	18,306	
北日本銀行	50.3	51.2	8,806	
東和銀行	3.2	3.3	6,246	
福島銀行	18.3	18.6	12,387	
大東銀行	9.8	10	2,090	
トモニホールディングス	5.4	5.5	3,498	
フィデアホールディングス	80.5	82	24,764	
池田泉州ホールディングス	101.1	103	11,021	
証券、商品先物取引業(0.8%)	119.8	122	18,178	
F P G	32.3	33	16,203	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	5.5	6,501	
マーキュリアインベストメント	4.8	4.3	3,091	
S B I ホールディングス	116.4	121.9	326,692	
ジャフコ グループ	16	16.3	87,694	
大和証券グループ本社	836	851.6	425,544	
野村ホールディングス	1,833	1,867.1	1,050,430	
岡三証券グループ	89.1	90.7	36,552	
丸三証券	31.3	31.8	16,472	
東洋証券	38.3	38.9	5,601	
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	
光世証券	2.7	2.7	1,746	
水戸証券	30.8	31.2	8,299	
いちよし証券	19.7	20.1	10,070	
松井証券	59.7	60.8	49,856	
だいこう証券ビジネス	5.3	—	—	
マネックスグループ	79.2	78.1	38,034	
極東証券	14.2	14.4	10,886	
岩井コスモホールディングス	10	10.1	14,200	
藍澤證券	18.9	19.2	15,148	
マネーパートナーズグループ	11.7	11.9	2,546	
スパークス・グループ	36.7	49.5	14,008	
保険業(1.9%)	—	—	—	
かんぽ生命保険	36.9	37.6	84,336	
S O M P O ホールディングス	195.8	199.5	835,506	
アニコム ホールディングス	8.6	35.3	40,489	
MS&ADインシュアنسグループホールディングス	272.3	277.4	869,649	
ソニーフィナンシャルホールディングス	85.6	—	—	
第一生命ホールディングス	589.4	600.4	988,558	
東京海上ホールディングス	372.5	375.1	2,034,167	
T & D ホールディングス	311.3	317.1	403,351	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
アドバンスクリエイト	千株	千株	千円	
	2.4	2.2	4,096	
その他金融業(1.1%)				
全国保証	29.4	29.9	135,746	
ジェイリース	2.9	—	—	
イントラスト	3.6	3.8	3,097	
日本モーゲージサービス	2.1	4.4	5,258	
C a s a	3.6	3.8	3,792	
アルヒ	16.6	16.9	28,949	
プレミアグループ	5.6	5.8	14,076	
クレディセゾン	73	74.4	90,396	
芙蓉総合リース	10.9	11.1	79,809	
みずほリース	16.1	16.4	53,136	
東京センチュリー	21	21.4	193,456	
日本証券金融	45.9	46.9	24,341	
アイフル	158.9	162.1	42,308	
リコリース	8.2	8.4	26,040	
イオンフィナンシャルサービス	63.7	65	84,435	
アコム	209.3	213.4	99,871	
ジャックス	11.5	11.8	22,561	
オリエントコーポレーション	281.7	287.6	35,374	
日立キャピタル	24.6	25	64,700	
アプラスフィナンシャル	50	—	—	
オリックス	651.5	658.3	1,141,492	
三菱UFJリース	264.3	269.4	138,741	
九州リースサービス	5.1	5.3	3,264	
日本取引所グループ	298.9	304.5	813,624	
イー・ギャランティ	11.1	12.2	27,950	
アサックス	5.4	5.6	4,071	
NECキャピタルソリューション	4.2	4.4	8,602	
不動産業(1.9%)				
いちご	135.9	140.2	39,396	
日本駐車場開発	124.4	115.2	15,897	
スター・マイカ・ホールディングス	6.3	6.6	7,260	
ADワークスグループ	—	20.1	3,115	
ヒューリック	223.6	226.3	253,229	
三栄建築設計	5.1	5.1	9,399	
野村不動産ホールディングス	63.8	65.1	145,238	
三重交通グループホールディングス	23.6	24.5	11,662	
サムティ	15.5	16	26,400	
ディア・ライフ	16.1	18.4	7,985	
エー・ディー・ワークス	193.2	—	—	
日本商業開発	7.5	7.6	12,920	
ユニゾホールディングス	14.6	—	—	
ハウスコム	2.3	2.9	3,845	
日本管理センター	8.1	6.9	8,204	
サンセイランディック	4.8	5.1	3,758	
エストラスト	1.4	—	—	
フージャースホールディングス	20.8	21.1	14,411	
オーブンハウス	30.7	33.8	142,129	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
東急不動産ホールディングス	千株	千株	千円	
	285.3	291.1	164,471	
飯田グループホールディングス		87.7	89.2	212,028
イーグランド		3.5	3.5	2,929
ムゲンエステート		9.3	9.6	4,358
ハウスドゥ		5.7	5.2	6,494
シーアールイー		4	3.9	5,089
ケイアイスター不動産		4	—	—
グッドコムアセット		3.2	6.2	8,091
ジェイ・エス・ビー		1.4	2.4	8,280
テンポイノベーション		3.9	4	3,440
パーク24		56.5	57.7	115,457
パラカ		3.4	3.6	5,756
三井不動産		514.3	516.4	1,051,390
三義地所		730.5	744.3	1,205,766
平和不動産		19.6	19.9	73,431
東京建物		114.7	105.8	153,939
ダイビル		28.1	28.5	34,513
京阪神ビルディング		18	17.8	30,705
住友不動産		234.6	239	727,994
テーオーサー		22.2	22.8	16,347
東京楽天地		2	2.1	9,156
スターツコーポレーション		14.7	15	41,385
フジ住宅		14.3	14.6	9,300
空港施設		13.3	13.6	6,460
明和地所		8.3	8.3	4,822
ゴールドクリスト		9	9.2	15,437
エスリー		4.8	5.1	7,670
日神グループホールディングス		18.3	19.1	8,079
日本エスコン		20.5	19.2	15,244
タカラレーベン		50.7	48.5	15,520
AVANTIA		7.4	7.7	6,575
イオンモール		53	54	90,666
毎日コムネット		4	4.8	3,225
ファースト住建		5.7	5.9	6,265
カチタス		13.2	26.7	88,243
トーセイ		15.4	16	15,968
穴吹興産		3.1	3.2	5,193
サンフロンティア不動産		15.6	16.3	14,441
エフ・ジェー・ネクスト		10.5	10.7	10,817
インテリックス		5	3	1,713
ランドビジネス		4.4	3.6	1,195
サンネクスタグループ		4	4.9	4,655
グランディハウス		11.3	11.7	5,054
日本空港ビルディング		33.5	34.1	195,393
サービス業(5.7%)				
明豊ファシリティワークス		—	5	3,180
日本工営		6.8	7	19,327
L I F U L L		35.4	36.4	13,358

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ミクシィ	千株	千株	千円	
ジェイエイシリクルートメント	—	19.7	48,659	
日本M&Aセンター	6.8	7	13,097	
メンバーズ	76.3	78.7	460,395	
中広	3	3.1	8,463	
UTグループ	1.3	2	640	
アイティメディア	11.9	16.2	54,594	
タケエイ	3.2	4.2	9,487	
E・Jホールディングス	9.8	11.4	16,222	
ビーネックスグループ	1.3	4.1	4,108	
コシダカホールディングス	11.2	13	15,509	
アルトナー	24.4	25.2	10,357	
パソナグループ	2.6	2.7	2,411	
CDS	12.4	11.2	21,056	
リンクアンドモチベーション	2.6	2.7	3,666	
GCA	22.4	18.9	10,546	
エス・エム・エス	12.3	13.7	9,590	
サニーサイドアップグループ	31.4	32	131,040	
パーソルホールディングス	2.4	3.9	2,418	
リニカル	100.9	102.9	200,963	
タックパッド	5	5.2	3,962	
エスクリ	35.6	32.9	10,133	
アイ・ケイ・ケイ	3.3	—	—	
学情	5.1	5.3	3,169	
スタジオアリス	3.6	3.8	5,008	
シミックホールディングス	5.1	5.3	10,716	
エプロ	5.6	5.2	7,753	
NJS	1.7	2.7	2,532	
綜合警備保障	2.3	2.6	5,223	
カカクコム	40.2	40.9	212,680	
アイロムグループ	75.6	76	226,784	
セントケア・ホールディング	3.6	3.7	6,660	
サイネットス	6.8	6.9	6,948	
ルネサンス	1.9	2	1,368	
デイップ	5.7	5.9	5,369	
デジタルホールディングス	14.3	14.1	35,799	
ツクイホールディングス	5.5	7.3	13,870	
キャリアデザインセンター	24	24.5	14,577	
ベネフィット・ワン	2.6	2.5	2,282	
エムスリー	27.6	37.5	115,312	
ツカダ・グローバルホールディング	222.5	226.7	2,301,005	
プラス	6.6	8.2	2,107	
アウトソーシング	57.8	—	—	
ウェルネット	1.3	59	79,296	
ワールドホールディングス	9.7	10.8	4,892	
ディー・エヌ・エー	3.4	3.6	7,009	
博報堂DYホールディングス	49.5	43.6	84,322	
ぐるなび	140.4	143.1	210,500	
タカミヤ	17.7	18.3	9,790	
モーニングスター	10.9	11.2	6,025	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ジャパンベストレスキューシステム	千株	千株	千円	
ファンコミュニケーションズ	6.8	7	6,860	
ライク	28	28.7	11,623	
ビジネス・ブレークスルー	4.1	3.5	6,723	
エスプール	4.6	4.7	2,166	
WD Bホールディングス	19.6	26.6	24,312	
手間いらす	4.6	4.8	12,571	
ティア	—	0.7	3,416	
CDG	6.1	6.5	2,678	
バリューコマース	1.2	1.2	1,806	
インフォマート	5.7	7	22,750	
J Pホールディングス	110.7	104.2	96,697	
エコナックホールディングス	32.1	32.9	9,475	
EPSホールディングス	19.1	20.7	1,904	
レッグス	15.3	14.1	14,367	
プレステージ・インターナショナル	2.6	2.7	4,428	
アミユーズ	37.9	38.7	35,410	
ドリームインキュベータ	5.5	5.7	14,181	
クイック	3.1	3.3	4,240	
TAC	6.3	6.6	7,022	
ケネディクス	6.6	6.9	1,745	
電通グループ	96.2	—	—	
テイクアンドギヴ・ニーズ	104	115.6	361,828	
びあ	3.9	—	—	
イオンファンタジー	2.9	—	—	
シーティース	9.9	4	8,676	
ネクシィーズグループ	11.5	11.8	10,879	
H.U.グループホールディングス	3.6	3.4	2,992	
アルプス技研	28.3	28.8	89,280	
ダイオーズ	9	9.2	19,384	
日本空調サービス	2.1	2.2	2,083	
オリエンタルランド	10.7	11	8,184	
ダスキン	107.3	109.3	1,748,800	
明光ネットワークジャパン	26	25.6	72,550	
ファルコホールディングス	12	13.3	7,660	
ラウンドワン	5.6	5.8	9,575	
リゾートトラスト	28.3	28.9	24,565	
ビー・エム・エル	46.3	47.2	70,044	
ワタベウェディング	13	13.3	49,941	
りらいあコミュニケーションズ	1.8	—	—	
リゾーエducation	18.3	18	24,858	
早稻田アカデミー	46.4	47.6	13,994	
ユー・エス・エス	3.4	4.6	4,600	
東京個別指導学院	113	115.2	241,228	
サイバーエージェント	3.7	3.9	2,496	
楽天	58.1	63.4	476,134	
クリーク・アンド・リバー社	470.5	479.3	469,234	
モーニングスター	5.3	5.6	6,428	
ティー・オー・ダブリュー	—	11.6	5,486	
タカミヤ	9	17.1	4,565	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
山田コンサルティンググループ	千株	千株	千円	
セントラルスポーツ	5	6.8	6,494	
フルキャストホールディングス	3.8	3.9	8,193	
エン・ジャパン	10.1	9.1	14,896	
リソルホールディングス	1.8	18.3	57,096	
テクノプロ・ホールディングス	1.1	1.2	4,578	
アトラ	20.2	20.5	175,480	
インターワークス	2.6	2.4	804	
アイ・アールジャパンホールディングス	2.1	2.5	895	
Ke e P e r 技研	4.1	4.2	79,926	
ファーストロジック	3.8	7.6	16,355	
三機サービス	2.5	2.2	1,744	
Gun o s y	2.2	2.2	2,136	
デザインワン・ジャパン	7.1	6.6	4,910	
イー・ガーディアン	2.4	3.9	838	
リブセンス	5.2	4.6	14,191	
ジャパンマテリアル	6.9	6.4	1,555	
ベクトル	31.1	31.7	49,483	
ウチヤマホールディングス	12.7	13	17,342	
チャーム・ケア・コーポレーション	5.2	5.6	1,881	
ライクキッズ	7.5	8.9	13,056	
キャリアリンク	2.3	—	—	
I B J	3.5	3.4	8,840	
アサンテ	4.1	4.2	7,020	
N・フィールド	4.1	7.3	6,774	
バリューHR	7.1	4.2	6,307	
M&Aキャピタルパートナーズ	2	4.2	7,371	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7.2	8.4	44,352	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.9	4	8,040	
E R I ホールディングス	3	3.2	1,987	
アビスト	1.6	1.7	4,972	
シグマクシス	1.6	7.2	12,787	
ウィルグループ	7	6.9	6,948	
エスクロー・エージェント・ジャパン	6.7	15.8	4,582	
メドビア	14.4	4.9	39,200	
レアジョブ	—	1	2,386	
リクルートホールディングス	722.9	736.4	3,438,988	
エラン	6	14.3	23,251	
土木管理総合試験所	4.6	5.6	1,898	
ネットマーケティング	3.8	4.3	2,906	
日本郵政	827.2	842.7	700,705	
ベルシステム24ホールディングス	17	17.3	31,832	
鎌倉新書	7.6	8	6,976	
SMN	1.7	2.4	1,920	
一蔵	1.2	—	—	
L I T A L I C O	1.7	3.6	13,662	
グローバルキッズCOMPANY	4.6	2.1	1,971	
エアトリ	2.6	5.5	7,832	
アトラエ	3.8	3.2	8,784	
ストライク	3.8	3.9	18,466	

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ソラスト	千株	千株	千円	
セラク	27.9	28.5	46,740	
インソース	3.3	3.3	6,015	
ペイカレント・コンサルティング	4.9	8.6	16,271	
Orchestra Holdings	6.1	6.2	117,676	
アイモバイル	2.1	2.2	4,540	
キャリアインデックス	3.3	3.8	4,898	
MS-Japan	3.3	3.5	3,895	
船場	1.7	2.2	1,903	
グレイステクノロジー	4.6	4.8	29,904	
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	
フルテック	1.5	1.6	2,198	
グリーンズ	3.9	2.6	1,167	
ツナグループ・ホールディングス	1.3	—	—	
G a m e W i t h	2.4	3.4	1,948	
ソウルドアウト	1.6	2.6	3,944	
M S & C o n s u l t i n g	1.5	2.2	1,227	
エル・ディー・エス	—	0.8	3,208	
ミダック	—	1.4	4,354	
日総工産	6.8	7.1	5,623	
キュービーネットホールディングス	6.2	4.4	6,076	
R P A ホールディングス	5.8	8.1	4,949	
スプリックス	3.5	3.2	2,496	
マネジメントソリューションズ	1.1	5.1	9,965	
プロレド・パートナーズ	—	1.4	5,173	
テノ・ホールディングス	—	1	1,266	
フロンティア・マネジメント	—	1.8	4,224	
ピアラ	—	0.6	1,224	
コプロ・ホールディングス	—	0.7	2,891	
ギークス	—	1.2	1,741	
カーブスホールディングス	—	28.5	22,429	
フォーラムエンジニアリング	—	5.6	5,213	
ダイレクトマーケティングミックス	—	4.1	14,760	
アドバンテッジリスクマネジメント	—	5.5	3,492	
リログループ	5.2	56.3	140,637	
東洋	55.2	6.3	9,763	
エイチ・アイ・エス	6.3	6.5	25,076	
ラックランド	15.8	3	7,065	
共立メンテナンス	2.4	16.7	57,114	
イチネンホールディングス	7	11.7	14,695	
建設技術研究所	6.6	6.7	16,515	
スペース	6.6	6.9	5,444	
長大	6.6	3.8	6,728	
燐ホールディングス	4.5	4.6	5,244	
スバル興業	0.6	0.6	5,394	
東京テアトル	4	4.2	5,292	
タナベ経営	2	2.1	2,818	
ナガワ	3.2	3.3	32,472	
よみうりランド	2.2	—	—	

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

銘柄	当期首(前期末) 株数	当期末	
		株数	評価額
船井総研ホールディングス	千株	千株	千円
進学会ホールディングス	20.9	21.1	48,340
オオバ	4.2	4.4	2,090
いであ	8	7.5	5,520
学究社	1.9	2.6	4,570
ベネッセホールディングス	3	3.1	4,104
イオンディライト	33.7	34.3	68,908
ナック	12.5	12.7	34,251
ニチイ学館	5.7	5.9	5,534
ダイセキ	14.4	—	—
ステップ	17	17.3	54,408
合計	3.8	3.9	5,947
銘柄数	株数	・ 金額	276,533,619
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) &lt; &gt;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
コード・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
その他の収益金	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。

## &lt;注記事項&gt;

※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 インデックスコレクション（国内株式）	53,151,287,973円
インデックスコレクション（バランス株式30）	18,725,218,454円
バランスVA50L（適格機関投資家専用）	12,178,512,933円
私募日本株式バッジファンド（適格機関投資家専用）	9,002,120,410円
バランスファンDVA3（適格機関投資家専用）	7,619,455,831円
DCバランスファンD50	5,620,128,796円
日本株式バッジファンド私募A（適格機関投資家専用）	3,439,883,370円
インデックスコレクション（バランス株式50）	2,804,770,606円
バランスファンDVA（適格機関投資家専用）	2,435,297,987円
DCバランスファンD30	2,273,270,560円
DCバランスファンD70	2,229,972,152円
インデックスコレクション（バランス株式70）	1,925,713,950円
日本株式インデックスe	1,905,052,946円
VAポートフォリオ40（適格機関投資家専用）	1,538,973,375円
日本株式インデックスファンDVA（適格機関投資家専用）	1,435,179,355円
バランスVA25（適格機関投資家専用）	1,233,084,870円
DC日本株式インデックスファンD	982,619,835円
バランスVA75（適格機関投資家専用）	902,954,069円
バランスファンDVA2（適格機関投資家専用）	811,914,642円
バランスVA50（適格機関投資家専用）	738,287,744円
日本株式インデックスファンD	737,022,911円
グローバル・インデックス・バランス・ファンD	626,336,325円
バランスVA37.5（適格機関投資家専用）	570,311,445円
VAバランスファンD（株60／100）（適格機関投資家専用）	528,109,116円
バランスVA25L（適格機関投資家専用）	448,988,590円
DC日本株式インデックスファンD	337,369,764円
VAバランスファンD（株50／100）（適格機関投資家専用）	314,313,884円
バランスVA40（適格機関投資家専用）	181,397,043円
VAバランス20-80（適格機関投資家専用）	174,219,341円
VAバランスファンD（株40／100）（適格機関投資家専用）	152,599,543円
世界バランスVA25（適格機関投資家専用）	109,734,458円
VAバランスファンD（株25／100）（適格機関投資家専用）	103,477,154円
VAバランス50-50（適格機関投資家専用）	87,152,076円
VAバランスファンD2（株40／100）（適格機関投資家専用）	72,164,982円
バランスVA30（適格機関投資家専用）	67,546,320円
国内バランスVA30（適格機関投資家専用）	64,778,174円
VAポートフォリオ20（適格機関投資家専用）	44,139,272円
VAファンD25（適格機関投資家専用）	35,777,089円
国内バランスVA25（適格機関投資家専用）	28,803,354円
私募日本株式インデックスファンDAL（適格機関投資家専用）	10,041,429円
VAバランス株式30（適格機関投資家専用）	4,149,118円
	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あげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	期	中騰落率	期	中騰落率						
第16期(2017年2月7日)	円 22,040	% 15.7	2,603.252	% 16.7	95.6	1.7	% 2.6	% 226,230	百万円	
第17期(2018年2月7日)	25,782	17.0	3,029.314	16.4	92.1	5.6	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	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	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	277,252		

(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		株式組入率	株式先物比	投資信託証券組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(当 期 首) 2020年 2月7日	円 31,535	% —	3,735.334	% —	91.5	% 5.9	% 2.5
2月末	28,303	△10.2	3,369.370	△9.8	91.3	6.1	2.7
3月末	24,054	△23.7	2,833.704	△24.1	92.8	4.7	2.6
4月末	26,413	△16.2	3,121.076	△16.4	92.7	4.8	2.5
5月末	27,549	△12.6	3,267.180	△12.5	91.9	5.7	2.4
6月末	28,078	△11.0	3,327.646	△10.9	92.2	5.4	2.4
7月末	29,015	△8.0	3,448.996	△7.7	92.2	5.4	2.4
8月末	31,240	△0.9	3,702.597	△0.9	93.8	3.9	2.3
9月末	30,017	△4.8	3,555.756	△4.8	94.3	3.4	2.3
10月末	29,180	△7.5	3,463.659	△7.3	94.4	3.3	2.3
11月末	32,546	3.2	3,866.173	3.5	96.2	1.7	2.2
12月末	33,488	6.2	3,977.755	6.5	95.5	2.4	2.1
2021年 1月末	34,183	8.4	4,052.926	8.5	95.8	2.0	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

(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、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的一切の権利は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つたことなどから、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

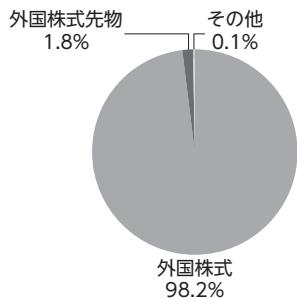
### ○上位10銘柄

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%

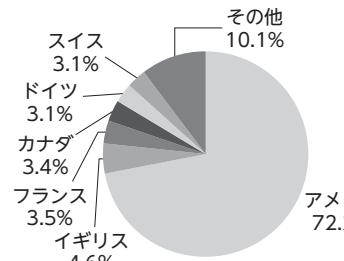
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
10	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.8%
組入銘柄数			1,291

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

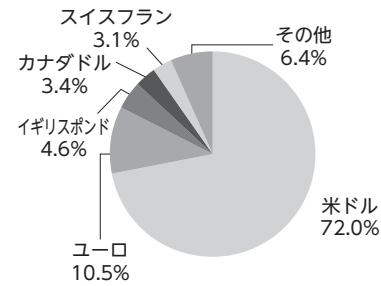
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

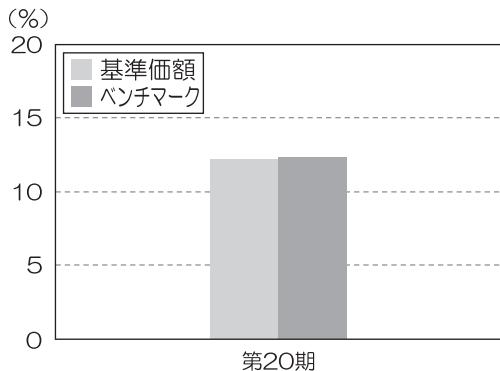


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2)国別配分においては、上記の他、オー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<sup>(※)</sup>（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 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
(株式)	(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金	
(株式)	(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 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等	
(保管費用)	(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おります。

(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

## &lt;株式&gt;

		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 一	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 一	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 一 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 (-)	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。

## &lt;新株予約権証券&gt;

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	証券 — (5,434)	千米ドル — (96)	証券 5,434	千米ドル 26
	ス イ ス	— (57,456)	千スイスフラン — (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。

## &lt;投資信託受益証券、投資証券&gt;

			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 1	千米ドル 194	千口 —	千米ドル —
		BOSTON PROPERTIES	0.89	114	—	—
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2	93	—	—
		SL GREEN REALTY CORP	—	—	4	168
		PROLOGIS INC	6	643	3	308
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.599	96	—	—
		CAMDEN PROPERTY TRUST	0.99	104	—	—
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	66	9	355
		DUKE REALTY CORP	3	104	—	—
		CROWN CASTLE INTL CORP	3	480	0.641	111
		ESSEX PROPERTY TRUST	0.39	110	—	—
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	3	213	1	90

			当 期			
			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
外		FEDERAL REALTY INVS TRUST	千口	千米ドル	千口	千米ドル
		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 (△44)	7,313 (—)	48	2,820
国	カ ナ ダ	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
		—	—	—	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
国	フ ラ ン ス	ICADE	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
		KLEPIERRE	—	—	1	114
		(—)	(△7)	(—)	—	—
		GECINA SA	0.8	105	—	—
		COVIVIO(FP)	1	73	—	—
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1	59	—	—
	小 計		3 (—)	238 (△7)	1	114
国	ユーロ計		3 (—)	238 (△7)	1	114
	イ ギ リ ス	SEGRO PLC	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
		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	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル	
		8	100	—	—	—	
		GPT GROUP	35	136	—	—	
		SYDNEY AIRPORT	—	—	—	—	
		(10)	(59)	(—)	(—)	(12)	
		DEXUS	11	107	—	—	
		GOODMAN GROUP	19	313	—	—	
		LENDLEASE GROUP	8	115	—	—	
		SCENTRE GROUP	46	159	—	—	
		SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	—	—	—	—	
		(10)	(12)	(10)	(10)	(12)	
小 計			130	933	—	—	
			(20)	(71)	(10)	(24)	
国	香 港	LINK REIT	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル	
			12	851	—	—	
		小 計	12	851	—	—	
		SINGAPORE	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—	
		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	(79)	(195)	—	—	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	43	143	—	—	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	(6)	(15)	—	—	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	(110)	(224)	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	165	339	—	—	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(3)	(4)	—	—	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	76	160	—	—	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(—)	(△0.7271)	—	—	
小 計			285	642	—	—	
			(89)	(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。

## &lt;先物取引の種類別取引状況&gt;

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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 11,991	百万円 11,991	% 100.0	百万円 11,967	百万円 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

## &lt;外国株式(上場、登録株式)&gt;

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	
(アメリカ)					
ABBOTT LABORATORIES	百株	百株	千米ドル	千円	
	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	当期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額	外 貨 建 金 額		
			邦 貨 換 算 金 額			
CONSTELLATION BRANDS INC-A	百株 80	百株 88	千米ドル 2,011	千円 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 柏	当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 金 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
ASSURANT INC	百株	百株	千米ドル	千円	
M & T BANK CORP	24	32	440	46,539	保険
FRANKLIN RESOURCES INC	61	70	993	104,806	銀行
FREEPORT-MCMORAN INC	147	147	381	40,251	各種金融
ARTHUR J GALLAGHER & CO	724	762	2,420	255,418	素材
GAP	90	99	1,175	124,022	保険
GENERAL DYNAMICS CORP	102	—	—	—	小売
GENERAL MILLS INC	117	128	2,034	214,736	資本財
GENUINE PARTS CO	289	330	1,898	200,325	食品・飲料・タバコ
GARTNER INC	65	77	786	82,992	小売
MCKESSON CORP	38	46	766	80,903	ソフトウェア・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
INT'L 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
KOHLS CORP	75	—	—	—	小売
KROGER CO	385	408	1,354	142,902	食品・生活必需品小売
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 INC	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 柏	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	
CARNIVAL CORPORATION	百株	百株	千米ドル	千円	
LOWES COMPANIES	205	267	569	60,157	消費者サービス
DOMINION ENERGY INC	371	397	6,951	733,660	小売
MGM RESORTS INTERNATIONAL	397	441	3,255	343,543	公益事業
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	242	252	863	91,167	消費者サービス
MCDONALD'S CORP	59	135	1,221	128,930	食品・飲料・タバコ
S&P GLOBAL INC	360	391	8,313	877,415	消費者サービス
EVEREST RE GROUP LTD	117	126	4,103	433,071	各種金融
MANPOWER GROUP	17	21	470	49,645	保険
MARKEL CORP	28	—	—	—	商業・専門サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6	6	768	81,113	保険
MARSH & MCLENNAN COS	99	326	2,779	293,370	ヘルスケア機器・サービス
MASCO CORP	241	266	3,023	319,072	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	130	145	818	86,388	資本財
METLIFE INC	31	31	952	100,476	素材
MEDTRONIC PLC	380	405	2,130	224,874	保険
CVS HEALTH CORP	637	705	8,358	882,188	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	618	687	4,963	523,881	ヘルスケア機器・サービス
LABORATORY CRP OF AMER	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
3 M COMPANY	45	51	1,162	122,682	ヘルスケア機器・サービス
MOHAWK INDUSTRIES INC	276	302	5,418	571,901	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28	28	431	45,554	耐久消費財・アパレル
KANSAS CITY SOUTHERN	79	93	1,693	178,782	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORD MOTOR COMPANY	45	52	1,091	115,219	運輸
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,877	2,052	2,362	249,311	自動車・自動車部品
NEWMONT CORPORATION	170	—	—	—	エネルギー
NVR INC	375	421	2,501	264,034	素材
NIKE B	1	1	901	95,091	耐久消費財・アパレル
NORDSTROM INC	594	654	9,493	1,001,993	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	51	—	—	—	小売
EVERSOURCE ENERGY	125	134	3,292	347,524	運輸
NISOURCE INC	155	183	1,614	170,427	公益事業
TAPESTRY INC	160	200	456	48,138	公益事業
NORTHROP GRUMMAN CORP	127	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WELLS FARGO & CO	76	83	2,486	262,396	資本財
NUCOR CORP	1,986	2,056	6,697	706,829	銀行
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	143	160	849	89,676	素材
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	224	239	2,746	289,816	各種金融
OGE ENERGY CORP	434	497	1,122	118,520	エネルギー
ORACLE CORP	87	109	343	36,242	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	1,109	1,048	6,666	703,608	ソフトウェア・サービス
PPL CORPORATION	62	67	1,887	199,181	資本財
PENTAIR PLC	347	421	1,174	123,935	公益事業
PERRIGO CO PLC	70	91	505	53,383	資本財
PFIZER	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
ESSENTIAL UTILITIES INC	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
CONOCOPHILLIPS	92	113	547	57,831	公益事業
PG&E CORP	528	715	3,177	335,352	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES	77	113	3,177	95,655	公益事業
ALTRIA GROUP INC	888	976	4,147	153,737	エネルギー
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	212	223	3,500	437,695	食品・飲料・タバコ
BROWN & BROWN INC	102	126	564	369,431	銀行
POLARIS INC	29	—	—	59,620	保険
PPG INDUSTRIES INC	113	123	1,736	—	耐久消費財・アパレル
QUEST DIAGNOSTICS	60	73	896	183,272	素材
				94,641	ヘルスケア機器・サービス

銘 柏	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
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
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	外貨建金額 邦貨換算金額	
			千米ドル	千円	
UNION PACIFIC CORP	百株	百株	7,285	768,884	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	336	356	5,806	612,849	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	392	802	16,235	1,713,466	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	449	500	509	53,765	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	38	48	852	90,014	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	40	48	1,482	156,444	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	162	181	1,038	109,567	素材
WALMART INC	59	67	10,743	1,133,875	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	677	744	2,524	266,408	商業・専門サービス
WATERS CORP	202	221	921	97,205	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	32	32	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	156	—	—	124,072	ヘルスケア機器・サービス
JM SMUCKER CO	31	40	1,175	71,937	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	50	59	605	63,868	消費者サービス
WABTEC CORP	16	21	804	84,876	資本財
WEYERHAEUSER CO	89	99	1,405	148,359	不動産
WHIRLPOOL CORP	341	408	592	62,513	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS	30	30	1,466	154,749	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	564	663	1,496	157,951	公益事業
CARMAX INC	151	172	1,27	119,018	小売
TJX COMPANIES INC	76	89	4,305	454,363	小売
CBRE GROUP INC-A	575	630	1,242	131,145	不動産
REGIONS FINL CORP	144	184	1,004	106,055	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	460	530	756	79,864	消費者サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	17	20	—	—	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	20	—	1,007	106,294	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	166	181	553	58,372	素材
CELANESE CORP-SERIES A	147	200	767	81,000	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	60	60	505	53,352	食品・飲料・タバコ
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	84	103	447	47,255	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	103	103	1,332	140,646	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	61	63	3,257	343,820	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	267	285	—	—	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT	71	—	70,345	—	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	74	89	2,178	229,966	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	12	14	1,700	179,423	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	23	28	15,924	1,680,721	ソフトウェア・サービス
HANESBRANDS INC	428	470	—	—	耐久消費財・アパレル
WESTERN UNION CO	159	—	468	49,423	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	203	203	494	52,211	資本財
LEIDOS HOLDINGS	49	60	760	80,235	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	63	71	—	—	資本財
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	637	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 柏	当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 金 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
AMERICAN WATER WORKS CO INC	百株	百株	千米ドル	千円	
MARATHON PETROLEUM CORP	87	99	1, 634	172, 479	公益事業
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	315	356	1, 697	179, 102	エネルギー
KINDER MORGAN INC	67	76	674	71, 215	資本財
XYLEM INC	974	1, 112	1, 574	166, 159	エネルギー
LYONDELLBASELL INDU-CL A	80	92	911	96, 240	資本財
PVH CORP	129	146	1, 366	144, 254	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34	—	—	—	耐久消費財・アパレル
EPAM SYSTEMS INC	19	19	326	34, 474	資本財
HCA HEALTHCARE INC	23	28	1, 087	114, 761	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	130	142	2, 511	265, 061	ヘルスケア機器・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	41	45	1, 182	124, 754	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	81	94	1, 465	154, 654	銀行
TARGA RESOURCES CORP	60	76	625	65, 992	ソフトウェア・サービス
LEAR CORP	115	—	—	—	エネルギー
DOLLAR GENERAL CORP	29	29	465	49, 120	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	123	130	2, 535	267, 643	小売
GENERAL MOTORS CO	—	32	891	94, 066	資本財
XPO LOGISTICS INC	614	676	3, 681	388, 590	自動車・自動車部品
ALLY FINANCIAL INC	39	50	589	62, 249	運輸
CAPRI HOLDINGS LTD	181	181	754	79, 671	各種金融
APTV PLC	67	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PHILLIPS 66	124	146	2, 159	227, 905	自動車・自動車部品
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	214	238	1, 721	181, 638	エネルギー
INGREDION INC	35	44	540	57, 040	ソフトウェア・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	28	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SERVICENOW INC	75	104	1, 941	204, 875	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PALO ALTO NETWORKS INC	89	100	5, 944	627, 380	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	46	52	2, 005	211, 631	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	702	927	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
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	227	249	3, 976	419, 705	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COTY INC-CL A	94	—	—	—	消費者サービス
SPRINT CORP	157	—	—	—	家庭用品・バーソナル用品
IHS MARKIT LTD	398	—	—	—	電気通信サービス
HOWMET AEROSPACE INC	183	198	1, 768	186, 651	商業・専門サービス
TWILIO INC - A	182	182	494	52, 189	資本財
SNAP INC - A	55	66	2, 671	281, 918	ソフトウェア・サービス
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	353	486	3, 098	327, 036	メディア・娯楽
BLACK KNIGHT INC	73	—	—	—	耐久消費財・アパレル
BAKER HUGHES CO	63	80	687	72, 524	ソフトウェア・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	306	349	771	81, 374	エネルギー
ALTIICE USA INC- A	67	78	624	65, 890	食品・飲料・タバコ
TECHNIPFMC PLC	64	123	456	48, 212	メディア・娯楽
RINGCENTRAL INC-CLASS A	198	—	—	—	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	30	40	1, 631	172, 191	ソフトウェア・サービス
BURLINGTON STORES INC	70	70	288	30, 452	運輸
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	31	35	898	94, 857	小売
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	151	207	589	62, 234	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TWITTER INC	63	70	2, 114	223, 130	ヘルスケア機器・サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	339	428	2, 433	256, 781	メディア・娯楽
EVERGY INC	76	76	401	42, 418	資本財
ALLEGION PLC	111	125	687	72, 564	公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	46	46	527	55, 699	資本財
STERIS PLC	—	69	709	74, 839	ソフトウェア・サービス
KKR & CO INC	41	46	857	90, 516	ヘルスケア機器・サービス
	214	276	1, 232	130, 070	各種金融

銘 柏	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
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	百株	百株	千米ドル	千円	
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
FNF GROUP	122	148	576	60,804	保険
CATALENT 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
AVALARIA 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 柏	当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 金 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
CHENIERE ENERGY INC	百株	百株	千米ドル	千円	
AMAZON.COM	112	112	747	78,938	エネルギー
ABIOMED INC	199	224	75,306	7,947,800	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	18	24	812	85,707	ヘルスケア機器・サービス
ADOBE INC	492	616	5,423	572,370	半導体・半導体製造装置
AMGEN	230	252	12,406	1,309,417	ソフトウェア・サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	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
AMERCO	—	260	2,142	226,079	公益事業
ANALOG DEVICES	3	5	268	28,361	運輸
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	176	193	2,885	304,504	半導体・半導体製造装置
COMCAST CORP-CL A	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
ANSYS INC	2,152	2,398	12,257	1,293,624	メディア・娯楽
APPLE INC	40	46	1,775	187,355	ソフトウェア・サービス
APPLIED MATERIALS	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
AUTODESK INC	440	479	4,832	510,071	半導体・半導体製造装置
AUTOMATIC DATA PROCESS	105	115	3,522	371,774	ソフトウェア・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	206	225	3,779	398,873	ソフトウェア・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	62	72	640	67,564	運輸
VERISIGN INC	51	59	1,234	130,296	メディア・娯楽
SIRIUS XM HOLDINGS INC	51	56	1,136	119,942	ソフトウェア・サービス
CSX CORP	700	604	368	38,918	メディア・娯楽
SEAGATE TECHNOLOGY	361	401	3,559	375,682	運輸
CHECK POINT SOFTWARE TECH	117	117	817	86,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CITRIX SYSTEMS INC	55	56	671	70,843	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	57	61	809	85,407	ソフトウェア・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	153	166	1,330	140,465	ヘルスケア機器・サービス
CINTAS CORP	69	79	690	72,881	保険
CISCO SYSTEMS	39	46	1,594	168,246	商業・専門サービス
COPART INC	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
COGNEX CORP	93	115	1,382	145,862	商業・専門サービス
MARRIOTT INTL A	81	92	801	84,622	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	133	144	1,874	197,860	消費者サービス
COSTAR GROUP INC	252	284	2,122	223,962	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	17	20	1,878	198,216	商業・専門サービス
EBAY	106	129	1,372	144,902	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	371	367	2,287	241,430	小売
CADENCE DESIGN SYSTEMS	108	—	—	—	各種金融
DISH NETWORK CORPORATION-A	126	146	1,988	209,854	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	141	151	393	41,513	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	126	126	2,142	226,084	メディア・娯楽
EXPEDITORS INTL WASH INC	9	14	371	39,247	保険
FASTENAL CO	258	313	851	89,830	運輸
FIFTH THIRD BANCORP	341	375	1,481	156,315	資本財
FISERV INC	341	375	1,206	127,335	銀行
FLIR SYSTEMS INC	275	299	3,356	354,221	ソフトウェア・サービス
FLEX LTD	55	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	218	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GILEAD SCIENCES INC	102	118	657	69,371	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	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
HASBRO INC	274	324	17,657	1,863,564	半導体・半導体製造装置
HENRY SCHEIN INC	63	72	652	73,983	耐久消費財・アパレル
F5 NETWORKS INC	68	79	555	58,671	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	27	32	652	68,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	130	130	1,080	114,013	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS 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
	39	45	658	69,492	運輸

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

銘 柄	当期首(前期末) 株 数	当 期 末			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		
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	
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	
ALNYLAN 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 金 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額
PTC INC	百株	百株	千米ドル	千円	
NEWS CORP-CLASS A	53	53	768	81,057	ソフトウェア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	167	218	464	49,003	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	77	—	—	—	資本財
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	68	75	1,139	120,249	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KEURIG DR PEPPER INC	41	—	—	—	運輸
COUPA SOFTWARE INC	—	295	960	101,410	食品・飲料・タバコ
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	98	22	1,917	202,324	ソフトウェア・サービス
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	メディア・娯楽
BROADCOM INC	52	63	1,797	189,710	ソフトウェア・サービス
MONGODB INC	189	211	9,850	1,039,623	半導体・半導体製造装置
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	ソフトウェア・サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	149	2,635	278,112	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FOX CORP - CLASS A	158	107	1,596	168,442	耐久消費財・アパレル
FOX CORP- CLASS B	65	184	579	61,188	メディア・娯楽
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	94	286	30,229	メディア・娯楽
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	78	1,748	184,507	ソフトウェア・サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	—	45	293	31,021	各種金融
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	78	287	30,380	各種金融
DATADOG INC - CLASS A	—	32	596	62,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PPD INC	—	73	838	88,535	ソフトウェア・サービス
SABRE CORP	—	63	226	23,912	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IAC/INTERACTIVECORP	138	—	—	114,979	ソフトウェア・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	43	1,089	メディア・娯楽	
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	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	89	569	60,108	消費者サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	115	985	103,981	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CDK GLOBAL INC	13	21	340	35,929	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	51	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LIBERTY BROADBAND-A	56	63	1,055	111,378	半導体・半導体製造装置
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	メディア・娯楽
ETSY INC	—	26	810	85,525	半導体・半導体製造装置
KRAFT HEINZ CO/THE	62	62	1,447	152,745	小売
NOVOCURE LTD	324	368	1,243	131,282	食品・飲料・タバコ
MATCH GROUP INC	—	45	792	83,590	ヘルスケア機器・サービス
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	メディア・娯楽
SUNRUN INC	531	586	15,805	1,668,125	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC-C	—	64	480	50,713	資本財
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	メディア・娯楽
ZSCALER INC	17	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONSTER BEVERAGE CORP	—	39	860	90,806	ソフトウェア・サービス
ROKU INC	196	215	1,964	207,312	食品・飲料・タバコ
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	当期首(前期末) 株数	当期末			業種等	
		株数	評価額	外貨建金額 邦貨換算金額		
				千円		
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	百株	百株	千米ドル	—	食品・生活必需品小売り	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	170	—	—	—	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	474	643	291	30,809	資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	95	115	665	70,273	資本財	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	94	94	241	25,486	各種金融	
	50	58	527	55,654		
小計	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 ASSEST 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	
TELUS CORP	115	231	624	51,612	電気通信サービス	
GREAT-WEST LIFECO 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	評価金額	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
POWER CORP OF CANADA	百株 135	百株 310	千カナダドル 948	千円 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
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
C1 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)	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
FRESENIUS SE&CO KGAA	187	230	808	102,677	ヘルスケア機器・サービス

銘 柏	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	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	百株	百株	千ユーロ	千円		
FUCHS PETROLUB SE -PREF	58	58	218	27,788	電気通信サービス	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	32	32	158	20,071	素材	
GEA GROUP AG	29	29	410	52,165	保険	
CONTINENTAL AG	76	76	231	29,399	資本財	
DEUTSCHE POST AG-REG	48	57	717	91,095	自動車・自動車部品	
MERCK KGAA	485	519	2,194	278,778	運輸	
RWE STAMM	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	
SAP SE	284	353	1,280	162,668	公益事業	
E. ON SE	467	548	5,953	756,267	ソフトウェア・サービス	
HENKEL AG & CO KGAA	1,085	1,234	1,087	138,080	公益事業	
PUMA SE	45	56	436	55,502	家庭用品・パーソナル用品	
BAYER	34	46	394	50,069	耐久消費財・アパレル	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	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	
BASF SE	79	98	858	109,058	家庭用品・パーソナル用品	
BEIERSDORF AG	438	482	3,224	409,637	素材	
HOCHTIEF AG	47	56	523	66,553	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERGCEMENT AG	9	9	80	10,287	資本財	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	67	83	517	65,740	素材	
ALLIANZ SE-REG	95	111	634	80,596	ヘルスケア機器・サービス	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	202	219	4,290	545,032	保険	
MUENCHENER RUECKVERSICHR.	97	180	200	25,504	運輸	
VOLKSWAGEN STAMM	69	73	1,720	218,537	保険	
VOLKSWAGEN AG-PFD	16	16	300	38,200	自動車・自動車部品	
DAIMLER AG	89	97	1,581	200,842	自動車・自動車部品	
NEMETSCHKE SE	434	449	3,013	382,729	自動車・自動車部品	
THYSSEN KRUPP	189	—	197	25,028	ソフトウェア・サービス	
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	20	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	
BRENNTAG 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
TEAMVIEWER AG	百株	百株	千ユーロ	千円	
SIEMENS ENERGY AG	—	72	323	41,045	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE	—	208	644	81,890	資本財
SCOUT24 AG	70	81	798	101,455	小売
COVESTRO AG	—	58	382	48,546	メディア・娯楽
HELLOFRESH SE	83	96	562	71,479	素材
UNIPER SE	—	77	572	72,656	小売
DELIVERY HERO SE	89	115	350	44,489	公益事業
	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) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 金 額	外 貨 建 金 額		
			邦 貨 換 算 金 額			
SEB SA	百株 11	百株 11	千ユーロ 195	千円 24,825	耐久消費財・アパレル	
VINCI S.A.	245	273	2,353	298,938	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	252	283	3,528	448,211	資本財	
VIVENDI	418	456	1,183	150,388	メディア・娯楽	
TOTAL SE	1,141	1,324	4,646	590,215	エネルギー	
VALEO SA	105	130	431	54,825	自動車・自動車部品	
ORANGE	969	1,099	1,082	137,474	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	15	16	1,500	190,580	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	64	72	1,327	168,642	ソフトウェア・サービス	
KERING	36	39	2,187	277,820	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	84	84	114	14,489	保険	
CARREFOUR	308	308	446	56,705	食品・生活必需品小売	
ATOS SE	41	53	352	44,742	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	536	595	4,765	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	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	392	451	775	98,521	銀行	
TELEPERFORMANCE	26	30	859	109,158	商業・専門サービス	
EURAZEO SA	23	23	142	18,130	各種金融	
SODEXO	37	50	381	48,497	消費者サービス	
AXA SA	926	1,016	1,952	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	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE SA	516	594	602	76,558	銀行	
BNP PARIBAS	538	591	2,577	327,439	銀行	
ORPEA	—	29	336	42,755	ヘルスケア機器・サービス	
SAINT-GOBAIN	226	285	1,212	154,068	資本財	
WENDEL	10	10	104	13,265	各種金融	
ILIAD SA	6	6	96	12,258	電気通信サービス	
DANONE (GROUPE)	296	324	1,732	220,120	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	156	168	1,890	240,097	資本財	
ENGIE	885	1,004	1,345	170,955	公益事業	
ALSTOM	96	125	538	68,406	資本財	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	86	—	—	—	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE	244	328	353	44,860	公益事業	
IPSEN	18	18	140	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	素材	
LEGRAND SA	120	147	1,138	144,569	資本財	
EIFFAGE	37	46	383	48,743	資本財	
ADP	15	15	159	20,276	運輸	
NATIXIS	407	407	141	17,918	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	34	49	420	53,396	メディア・娯楽	
SCOR SE	65	93	248	31,594	保険	
BUREAU VERITAS SA	133	167	378	48,033	商業・専門サービス	
GETLINK	186	249	341	43,363	運輸	
SUEZ	171	171	296	37,695	公益事業	
EDENRED	101	126	600	76,268	ソフトウェア・サービス	
BIOMERIEUX	18	23	308	39,200	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	53	197	25,025	消費者サービス	
WORLDLINE SA	43	130	976	124,040	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	12	15	599	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	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数(比率)	12,440 67	13,768 64	70,384 —	8,940,198 <3.2%	

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
(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	
				外貨建金額	
AENA SME SA		百株	百株	千ユーロ	千円
CELLNEX TELECOM SA		35	35	478	60,817 運輸
小計	株数・金額	119	163	791	100,571 電気通信サービス
	銘柄数(比率)	25,003	26,812	16,884	2,144,657
		22	20	—	<0.8%
(ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円
UMICORE		99	99	467	59,440 素材
KBC GROEP NV		120	133	812	103,200 銀行
SOFINA		—	7	221	28,130 各種金融
SOLVAY SA		36	36	347	44,096 素材
UCB (GROUPE)		62	67	595	75,631 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		22	22	113	14,433 食品・生活必需品小売
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		37	55	477	60,593 各種金融
AGEAS		76	86	391	49,769 保険
PROXIMUS		75	75	130	16,582 電気通信サービス
GALAPAGOS NV		18	23	208	26,470 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELIA GROUP SA/NV		—	19	198	25,231 公益事業
TELENET GROUP HOLDING NV		28	—	—	— メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		363	402	2,205	280,156 食品・飲料・タバコ
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
OMV AG		56	82	293	37,271 エネルギー
VERBUND AG		31	31	253	32,150 公益事業
VOESTALPINE AG		59	59	185	23,624 素材
ERSTE GROUP BANK AG		140	140	376	47,777 銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		78	78	132	16,835 銀行
ANDRITZ AG		36	—	—	— 資本財
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
EUROFINS SCIENTIFIC		3	64	522	66,393 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		195	195	135	17,185 エネルギー
SES		162	162	111	14,199 メディア・娯楽
ARCELORMITTAL		309	353	658	83,597 素材
AROUNDOWN SA		510	524	310	39,442 不動産
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
KESKO OYJ-B SHS		—	143	311	39,560 食品・生活必需品小売
WARTSILA OYJ		187	187	155	19,702 資本財
UPM KYMMENE OYJ		234	273	839	106,574 素材
STORA ENSO OYJ R		232	319	489	62,152 素材
SAMPO OYJ-A SHS		195	262	958	121,791 保険
FORTUM OYJ		190	242	525	66,738 公益事業
ELISA A		82	81	396	50,368 電気通信サービス
NELES OYJ		49	—	—	— 資本財
NOKIA OYJ		2,514	3,123	1,117	141,996 テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		196	222	1,226	155,844 エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ		61	—	—	— 自動車・自動車部品
KONE OYJ-B		174	178	1,177	149,519 資本財
ORION OYJ-CLASS B		53	53	208	26,428 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
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
ASHTEAD 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
SCHRODERS 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 柏	当期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 金 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	
	267	267	313	45,386	各種金融
SSE PLC	458	576	847	122,864	公益事業
BP PLC	9,696	10,656	2,686	389,342	エネルギー
SAGE GROUP PLC	469	587	347	50,400	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	200	200	297	43,178	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	33,586	37,246	1,378	199,757	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	1,660	1,660	268	38,894	耐久消費財・アパレル
TESCO	4,715	5,154	1,269	184,080	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	424	504	591	85,786	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	395	484	752	109,027	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	2,375	2,638	3,339	484,085	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	125	—	—	—	資本財
WPP PLC	566	651	530	76,906	メディア・娯楽
ASTRAZENECA	624	689	5,019	727,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	3,822	4,982	620	89,920	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	81	—	—	—	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	1,663	1,851	1,576	228,546	公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	823	—	—	—	小売
BARCLAYS	7,810	9,128	1,343	194,795	銀行
INTERTEK GROUP PLC	70	84	478	69,415	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	182	230	407	59,043	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	64	74	592	85,869	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	840	4,410	414	60,036	資本財
KINGFISHER PLC	900	1,226	344	49,974	小売
ITV PLC	1,549	—	—	—	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	152	166	1,572	227,999	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	820	820	193	28,044	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	779	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	98	98	291	42,212	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	65	65	285	41,328	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	2,393	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,036	2,156	2,902	420,746	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,779	1,949	2,495	361,708	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	74	91	465	67,410	消費者サービス
WHITBREAD PLC	67	101	333	48,351	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	85	199	28,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TUI AG-DI	175	—	—	—	消費者サービス
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,056	1,306	409	59,409	各種金融
EXPERIAN PLC	451	498	1,314	190,531	商業・専門サービス
MONDI PLC	223	274	480	69,713	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	119	182	297	43,069	各種金融
FRESNILLO PLC	—	98	101	14,647	素材
OCADO GROUP PLC	235	235	659	95,649	小売
GLENCORE PLC	5,202	5,202	1,348	195,473	素材
ENTAIN PLC	333	333	428	62,121	消費者サービス
EVRAZ PLC	166	344	173	25,146	素材
NMC HEALTH PLC	47	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	99	—	—	—	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	688	688	210	30,571	保険
COCA-COLA HBC AG-CDI	91	91	206	29,872	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	34	74	269	39,003	ソフトウェア・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	151	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	290	203	29,505	保険
FERGUSON PLC	103	124	1,080	156,555	資本財
M&G PLC	1,123	1,506	279	40,548	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	
INFORMA PLC	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
	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 & SPRUNGLI 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
DUFRY 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
LAFARGEHELCIM 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
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	銘柄数(比率)	32	38	<1.1%	
(ノルウェー)	百株	百株	千円		
DNB ASA	430	485	8,336	103,043	銀行
NORSK HYDRO	613	613	2,434	30,085	素材
TELENR 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	銘柄数(比率)	10	11	<0.2%	

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	
(デンマーク)					
CARLSBERG AS-B	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	50	57	5,553	94,851	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	3	4,344	74,209	運輸
GN STORE NORD A/S	1	1	1,875	32,036	運輸
DANSKE BANK A/S	328	389	3,421	58,434	ヘルスケア機器・サービス
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)					
RAMSAY HEALTH CARE LTD	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
AGL ENERGY LTD	81	96	639	51,782	ヘルスケア機器・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP	329	329	375	30,360	公益事業
WESTPAC BANKING	1,357	1,493	3,775	305,661	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,668	1,900	4,210	340,855	銀行
TELSTRA CORP	575	892	2,074	167,920	素材
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	1,864	1,998	629	50,950	電気通信サービス
BRAMBLES LTD	238	—	—	—	銀行
COCA-COLA AMATIL LIMITED	733	822	896	72,605	商業・専門サービス
ASX LTD	221	221	291	23,574	食品・飲料・タバコ
BHP GROUP LTD	89	103	740	59,950	各種金融
AMPOL LTD	1,404	1,549	6,788	549,505	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	128	128	344	27,876	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED	370	—	—	—	小売
CSL LIMITED	219	219	326	26,392	ソフトウェア・サービス
REA GROUP LTD	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
TRANSURBAN GROUP	30	30	471	38,127	メディア・娯楽
COCHLEAR LIMITED	1,309	1,441	1,973	159,794	運輸
ORIGIN ENERGY LIMITED	29	34	720	58,288	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUST	878	878	398	32,227	エネルギー
BORAL LIMITED	853	931	8,253	668,152	銀行
RIO TINTO LTD	428	—	—	—	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	169	195	2,217	179,481	素材
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	257	307	1,031	83,537	消費者サービス
TPG CORP LTD	1,145	1,145	565	45,789	保険
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	226	—	—	—	電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	29	—	—	—	消費者サービス
ORICA LTD	207	234	920	74,538	素材
CIMIC GROUP LIMITED	195	195	306	24,840	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	29	29	76	6,175	資本財
MACQUARIE GROUP LIMITED	215	215	361	29,253	素材
WORLEY LTD	155	186	2,514	203,544	各種金融
	144	—	—	—	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	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
SUNCORP GROUP LIMITED	585	743	781	63,289	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	1,380	1,764	4,452	360,441	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	351	455	1,132	91,684	素材
OIL SEARCH LTD	701	1,101	451	36,569	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	812	—	—	—	素材
AMP LTD	1,820	1,820	286	23,210	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED	399	399	189	15,328	運輸
QBE INSURANCE GROUP	652	784	678	54,924	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	581	689	55,848	素材
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	305	—	—	—	各種金融
SANTOS	839	839	579	46,934	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	190	242	848	68,707	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	48	48	137	11,095	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD	905	988	453	36,716	消費者サービス
WESFARMERS LTD	546	597	3,322	268,919	小売
ALUMINA LIMITED	1,186	—	—	—	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	418	480	1,221	98,905	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	606	665	2,741	221,896	食品・生活必需品小売
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	66	66	336	27,245	各種金融
SEEK LTD	171	171	519	42,043	メディア・娯楽
AUSNET SERVICES	470	805	137	11,116	公益事業
CROWN RESORTS LTD	188	188	187	15,188	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	—	883	411	33,312	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	936	936	364	29,475	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	344	344	343	27,827	食品・飲料・タバコ
XERO LTD	—	64	831	67,270	ソフトウェア・サービス
AFTERPAY LTD	—	112	1,699	137,554	ソフトウェア・サービス
TPG TELECOM LTD	—	226	167	13,596	電気通信サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,292	1,292	390	31,598	保険
SOUTH32 LTD	2,161	2,680	710	57,501	素材
COLES GROUP LTD	502	754	1,379	111,649	食品・生活必需品小売
WISETECH GLOBAL LTD	107	64	212	17,237	ソフトウェア・サービス
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)					
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)					
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	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		
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	百株	百株	千香港ドル	千円	
	567	797	2,456	33,434	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	590	735	3,050	41,513	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	5,154	5,412	5,899	80,290	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,120	1,120	7,470	101,672	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	370	—	—	—	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	1,625	1,960	4,488	61,087	銀行
NWS HOLDINGS LTD	735	—	—	—	資本財
PCCW LTD	2,120	2,120	937	12,753	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	470	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	3,050	762	2,680	36,477	不動産
SINO LAND CO	1,286	2,046	2,221	30,240	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	800	695	7,346	99,981	不動産
SWIRE PACIFIC A	200	200	982	13,365	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	240	—	—	—	食品・飲料・タバコ
WHEELOCK & CO LTD	400	—	—	—	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	730	735	8,967	122,040	資本財
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	1,020	2,005	27,292	資本財
SJM HOLDINGS LTD	1,500	920	857	11,669	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	608	608	801	10,906	消費者サービス
AIA GROUP LTD	5,780	6,368	63,680	866,684	保険
SANDS CHINA LTD	1,046	1,270	4,197	57,125	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	406	690	1,524	20,753	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	610	810	3,410	46,411	不動産
ESR CAYMAN LTD	—	924	2,711	36,909	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	536	830	2,029	27,619	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	5,160	5,160	3,276	44,594	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,349	1,439	7,636	103,931	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	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	千シンガポールドル	千円	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	748	748	282	22,365	資本財
DBS GROUP	878	941	2,378	188,166	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	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	417	33,012	各種金融
CAPITALAND LTD	1,189	1,189	374	29,625	不動産
GENTING SINGAPORE LTD	3,197	3,197	279	22,127	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	575	802	399	31,592	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,139	—	—	—	運輸
OCBC BANK	1,600	1,714	1,765	139,685	銀行
SINGAPORE AIRLINES	175	877	365	28,944	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	581	616	1,450	114,700	銀行
UOL GROUP LIMITED	248	248	182	14,398	不動産
VENTURE CORP LTD	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	993	78,564	電気通信サービス
SEMCORP INDUSTRIES LTD	620	—	—	—	資本財
WILMAR INTERNATIONAL LTD	768	1,116	592	46,874	食品・飲料・タバコ
YANGZIJIANG 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	千円	千円		
BANK HAPOALIM 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		業種等	
	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 PPTY	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
AMERICAN TOWER CORPORATION		千口	千口	千米ドル	千円
WP CAREY INC	21	23	5,430	573,187	
INVITATION HOMES INC	7	8	603	63,648	
EQUINIX INC	27	27	835	88,183	
VICI PROPERTIES INC	4	4	3,509	370,414	
SBA COMMUNICATIONS CORP	19	27	754	79,620	
	5	6	1,668	176,136	
小計	口数・金額	621	625	45,335	4,784,673
	銘柄数(比率)	40	36	—	<1.7%
(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	29	14	421	34,860
	銘柄数(比率)	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	20	21	1,149	145,979
	銘柄数(比率)	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	1,605	1,605	—	—
	銘柄数(比率)	1	1	—	<-%
ユーロ計	口数・金額	1,625	1,627	1,149	145,979
	銘柄数(比率)	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	121	137	1,018	147,617
	銘柄数(比率)	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	1,030	1,171	6,201	502,015
	銘柄数(比率)	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	411	423	10,303	140,233
	銘柄数(比率)	3	3	—	<0.1%

銘柄	当期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額		邦貨換算金額
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール) CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT CAPITALAND COMMERCIAL TRUST SUNTEC REIT MAPLETREE LOGISTICS TRUST MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	千口 117 139 110 113 — 55	千口 196 189 — 113 168 132	千シンガポールドル 420 589 — 170 332 276	千円 33,228 46,619 — 13,496 26,263 21,855	
小計	535	799	1,788	141,463	
銘柄数<比率>	5	5	—	<0.1%>	
合計	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)&lt;&gt;内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

## &lt;先物取引の銘柄別期末残高&gt;

銘柄別	当期末		
	買建額	売建額	
外 国 S&P 500 EMIN S&P/TSE 60 SWISS MKT IX DJ EURO STOX SPI 200 FUTU FTSE 100	百万円 3,542 265 224 518 150 224		百万円 — — — — — —

(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	%
投資信託受益証券	266,231,928	95.9
投資証券	157,037	0.1
コール・ローン等、その他	5,739,805	2.1
投資信託財産総額	5,357,039	1.9
	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、

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
未払資金	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
その他の収益	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	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	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算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。

## &lt;注記事項&gt;

※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
私募外国株式ペッシャップファンド (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
外国株式ペッシャップファンド私募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あげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・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	債券先物比率	純資産額
		期中騰落率	期中騰落率			
第16期(2017年2月7日)	円 22,198	% △7.3	% 428.463	% △6.7	% 97.6	% 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	債券先物比率
		騰落率	騰落率		
(当期首) 2020年2月7日	円 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。

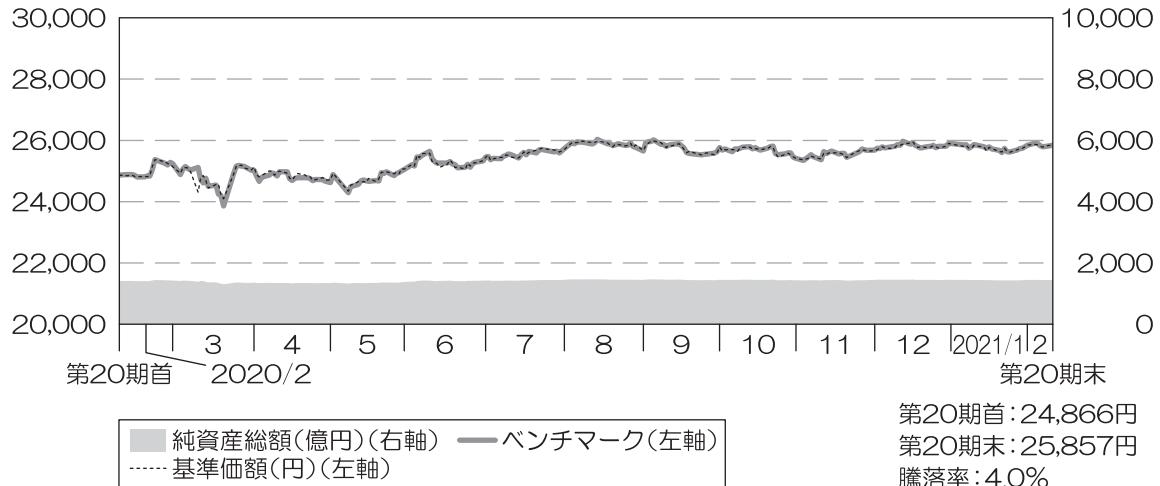
(注2)債券先物比率は買建比率-売建比率です。

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

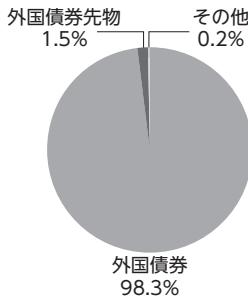
## ○上位10銘柄

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%

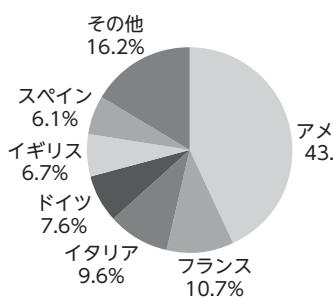
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 09/30/25	アメリカ	0.5%
8	T 2% 02/15/23	アメリカ	0.5%
9	T 2% 02/15/25	アメリカ	0.5%
10	T 2.875% 11/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数			721

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

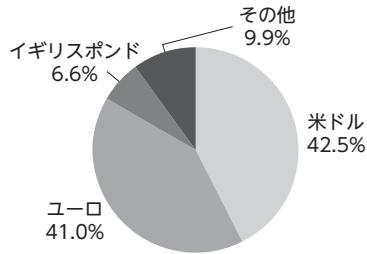
## ○資産別配分



## ○国別配分



## ○通貨別配分

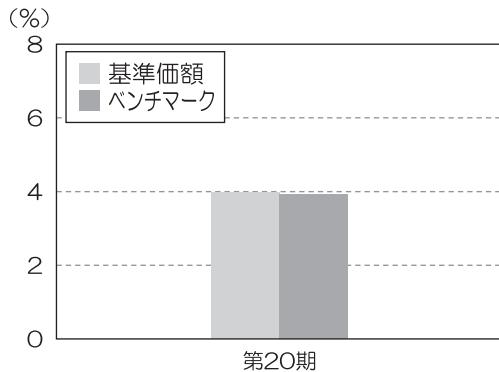


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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<sup>(※)</sup>(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 = $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料	
(株式)	(一)	(一)		
(新株予約権証券)	(一)	(一)		
(オプション証券等)	(一)	(一)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(一)	(一)		
(投資信託証券)	(一)	(一)		
(商品)	(一)	(一)		
(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 = $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金	
(株式)	(一)	(一)		
(新株予約権証券)	(一)	(一)		
(オプション証券等)	(一)	(一)		
(新株予約権付社債(転換社債))	(一)	(一)		
(公社債)	(一)	(一)		
(投資信託証券)	(一)	(一)		
(c) その他費用	3	0.012	(c) その他費用 = $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等	
(保管費用)	(3)	(0.012)		
(監査費用)	(一)	(一)		
(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おります。

(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

## &lt;公社債&gt;

			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 一	国 債 証 券	5,435	4,136
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	3,947	2,639
	フ イ 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 ボ ン ド 19,216	千 イ ギ リ ス ボ 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 一	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 一 ク	国 債 証 券	千 デ ン マ ー ク ロ ー ネ 13,258	千 デ ン マ ー ク ロ ー ネ 11,424
	ボ 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 一 シ ア	国 債 証 券	千 マ レ ー シ ア リ ギ ッ ト 10,645	千 マ レ ー シ ア リ ギ ッ ト 8,918
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千 イ ス ラ エ ル シ ケ ル 21,432	千 イ ス ラ エ ル シ 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。)

## &lt;先物取引の種類別取引状況&gt;

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	<u>B</u> <u>A</u>	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	<u>D</u> <u>C</u>
為替先物取引	百万円 41,534	百万円 41,534	% 100.0	百万円 41,888	百万円 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

## &lt;外国(外貨建)公社債&gt;

## (A) 債券種類別開示

区分	当 期						末		
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率			
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満	
アメリカ	千米ドル 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	
スペイン	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

(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) 国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円							
T 0.125% 10/15/23	0.125	5,200	5,194	548,272	2023/10/15	T 1.75% 05/15/23	1.75	1,750	1,814	191,469	2023/5/15
T 0.25% 05/31/25	0.25	1,180	1,174	123,919	2025/5/31	T 1.75% 05/31/22	1.75	2,650	2,707	285,744	2022/5/31
T 0.25% 06/30/25	0.25	4,310	4,285	452,283	2025/6/30	T 1.75% 06/30/22	1.75	2,500	2,557	269,951	2022/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	2,200	2,186	230,718	2025/7/31	T 1.75% 06/30/24	1.75	2,000	2,102	221,897	2024/6/30
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,000	6,945	733,066	2025/9/30	T 1.75% 07/15/22	1.75	1,200	1,228	129,658	2022/7/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	4,000	3,908	412,463	2027/7/31	T 1.75% 09/30/22	1.75	1,050	1,078	113,825	2022/9/30
T 0.375% 09/30/27	0.375	4,000	3,897	411,309	2027/9/30	T 1.75% 11/15/29	1.75	3,220	3,410	359,910	2029/11/15
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,770	3,757	396,564	2025/11/30	T 1.875% 01/31/22	1.875	3,800	3,866	408,101	2022/1/31
T 0.5% 03/15/23	0.5	3,980	4,011	423,412	2023/3/15	T 1.875% 03/31/22	1.875	5,100	5,204	549,250	2023/3/31
T 0.5% 03/31/25	0.5	4,000	4,026	424,930	2025/3/31	T 1.875% 04/30/22	1.875	2,800	2,861	301,982	2022/4/30
T 0.5% 06/30/27	0.5	6,000	5,916	624,409	2027/6/30	T 1.875% 05/31/22	1.875	2,350	2,404	253,812	2022/5/31
T 0.5% 08/31/27	0.5	1,100	1,081	114,180	2027/8/31	T 1.875% 06/30/26	1.875	3,980	4,262	449,895	2026/6/30
T 0.5% 10/31/27	0.5	3,580	3,512	370,719	2027/10/31	T 1.875% 07/31/22	1.875	2,880	2,955	311,969	2022/7/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	3,400	3,389	357,700	2027/3/31	T 1.875% 07/31/26	1.875	1,800	1,928	203,514	2026/7/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	7,400	7,072	746,400	2030/5/15	T 1.875% 08/31/22	1.875	2,600	2,671	281,992	2022/8/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	9,130	8,694	917,659	2030/8/15	T 1.875% 09/30/22	1.875	1,500	1,543	162,923	2022/9/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	3,000	2,961	312,588	2027/12/31	T 1.875% 10/31/22	1.875	2,000	2,061	217,531	2022/10/31
T 0.875% 11/15/30	0.875	2,600	2,528	266,879	2030/11/15	T 2% 02/15/22	2.0	3,100	3,160	333,570	2022/2/15
T 1.125% 05/15/40	1.125	4,420	3,951	417,031	2040/5/15	T 2% 02/15/23	2.0	6,500	6,747	712,083	2023/2/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	4,000	3,565	376,250	2040/8/15	T 2% 02/15/25	2.0	6,050	6,456	681,467	2025/2/15
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,120	4,284	452,175	2050/5/15	T 2% 02/15/50	2.0	3,370	3,398	358,642	2050/2/15
T 1.25% 07/31/23	1.25	3,950	4,058	428,298	2023/7/31	T 2% 04/30/24	2.0	3,000	3,172	334,813	2024/4/30
T 1.375% 08/15/50	1.375	4,000	3,456	364,772	2050/8/15	T 2% 05/31/24	2.0	1,500	1,587	167,579	2024/5/31
T 1.375% 08/31/23	1.375	3,450	3,558	375,548	2023/8/31	T 2% 06/30/24	2.0	1,000	1,059	111,843	2024/6/30
T 1.375% 09/30/23	1.375	3,550	3,664	386,799	2023/9/30	T 2% 07/31/22	2.0	3,900	4,009	423,190	2022/7/31
T 1.375% 10/15/22	1.375	2,250	2,298	242,543	2022/10/15	T 2% 08/15/25	2.0	3,750	4,021	424,391	2025/8/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	700	651	68,775	2040/11/15	T 2% 10/31/22	2.0	4,500	4,647	490,448	2022/10/31
T 1.5% 01/15/23	1.5	2,000	2,053	216,752	2023/1/15	T 2% 11/15/26	2.0	2,700	2,912	307,431	2026/11/15
T 1.5% 01/31/22	1.5	3,000	3,041	321,035	2022/1/31	T 2% 11/30/22	2.0	5,500	5,688	600,344	2022/11/30
T 1.5% 02/15/30	1.5	1,820	1,884	198,865	2030/2/15	T 2.125% 02/29/24	2.125	1,400	1,482	156,442	2024/2/29
T 1.5% 02/28/23	1.5	1,760	1,809	191,025	2023/2/28	T 2.125% 03/31/24	2.125	1,200	1,272	134,261	2024/3/31
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	4,117	434,610	2023/3/31	T 2.125% 05/15/22	2.125	5,400	5,538	584,575	2022/5/15
T 1.5% 08/15/22	1.5	5,800	5,924	625,235	2022/8/15	T 2.125% 05/15/25	2.125	7,250	7,794	822,642	2025/5/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	5,300	5,568	587,701	2026/8/15	T 2.125% 06/30/22	2.125	1,100	1,131	119,379	2022/6/30
T 1.5% 09/15/22	1.5	4,000	4,089	431,600	2022/9/15	T 2.125% 07/31/24	2.125	1,500	1,597	168,637	2024/7/31
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,000	8,355	881,885	2024/9/30	T 2.125% 09/30/24	2.125	2,200	2,347	247,797	2024/9/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,750	6,077	641,440	2026/2/15	T 2.125% 11/30/23	2.125	2,700	2,848	300,664	2023/11/30
T 1.625% 04/30/23	1.625	5,800	5,993	632,504	2023/4/30	T 2.125% 11/30/24	2.125	1,400	1,497	158,012	2024/11/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	5,400	5,709	602,574	2026/5/15	T 2.125% 12/31/22	2.125	3,800	3,944	416,342	2022/12/31
T 1.625% 05/31/23	1.625	4,350	4,499	474,898	2023/5/31	T 2.25% 01/31/24	2.25	5,090	5,402	570,185	2024/1/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	1,400	1,432	151,193	2022/8/15	T 2.25% 02/15/27	2.25	3,900	4,268	450,531	2027/2/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	2,260	2,371	250,241	2029/8/15	T 2.25% 03/31/26	2.25	1,500	1,633	172,428	2026/3/31
T 1.625% 08/31/22	1.625	500	511	54,025	2022/8/31	T 2.25% 04/15/22	2.25	2,680	2,748	290,084	2022/4/15
T 1.625% 09/30/26	1.625	2,150	2,273	239,967	2026/9/30	T 2.25% 04/30/24	2.25	2,600	2,770	292,358	2024/4/30
T 1.625% 11/15/22	1.625	4,000	4,107	433,480	2022/11/15	T 2.25% 08/15/27	2.25	2,320	2,543	268,477	2027/8/15
T 1.625% 11/15/50	1.625	2,600	2,393	252,580	2050/11/15	T 2.25% 08/15/46	2.25	4,180	4,457	470,418	2046/8/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	3,030	3,204	338,211	2026/11/30	T 2.25% 08/15/49	2.25	4,110	4,375	461,828	2049/8/15
T 1.75% 01/31/23	1.75	2,650	2,736	288,759	2023/1/31	T 2.25% 10/31/24	2.25	2,500	2,682	283,113	2024/10/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	3,650	3,714	391,999	2022/2/28	T 2.25% 11/15/24	2.25	5,000	5,368	566,638	2024/11/15
T 1.75% 03/31/22	1.75	2,500	2,547	268,864	2022/3/31	T 2.25% 11/15/25	2.25	5,500	5,972	630,376	2025/11/15
T 1.75% 04/30/22	1.75	2,000	2,040	215,375	2022/4/30	T 2.25% 11/15/27	2.25	5,260	5,770	609,006	2027/11/15
T 1.75% 05/15/22	1.75	4,600	4,696	495,705	2022/5/15	T 2.25% 12/31/23	2.25	3,500	3,709	391,524	2023/12/31
						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	
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額
T 2.375% 01/31/23	2.375	% 千米ドル	5,223	551,291	2023/1/31	T 3.75% 08/15/41	3.75	% 千米ドル	1,100	1,480
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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) 国債証券		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	CAN 0.25% 03/01/26	0.25	890	877	72,535
T 2.875% 04/30/25	2.875	2,300	2,543	268,429	2025/4/30	CAN 0.25% 11/01/22	0.25	810	811	67,067
T 2.875% 05/15/28	2.875	2,260	2,581	272,490	2028/5/15	CAN 0.5% 03/01/22	0.5	1,110	1,114	92,140
T 2.875% 05/15/43	2.875	1,050	1,251	132,088	2043/5/15	CAN 0.5% 09/01/25	0.5	1,330	1,331	110,069
T 2.875% 05/15/49	2.875	4,400	5,299	559,355	2049/5/15	CAN 0.5% 12/01/30	0.5	630	601	49,701
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,000	5,552	585,994	2025/7/31	CAN 1% 06/01/27	1.0	940	962	79,593
T 2.875% 08/15/28	2.875	4,200	4,805	507,195	2028/8/15	CAN 1% 09/01/22	1.0	2,680	2,716	224,578
T 2.875% 08/15/45	2.875	1,480	1,766	186,438	2045/8/15	CAN 1.25% 03/01/25	1.25	450	465	38,468
T 2.875% 09/30/23	2.875	1,650	1,768	186,636	2023/9/30	CAN 1.25% 06/01/30	1.25	2,560	2,632	217,644
T 2.875% 11/30/23	2.875	6,000	6,454	681,252	2023/11/30	CAN 1.5% 02/01/22	1.5	1,220	1,236	102,231
T 3% 02/15/48	3.0	4,400	5,398	569,803	2048/2/15	CAN 1.5% 05/01/22	1.5	990	1,006	83,228
T 3% 02/15/49	3.0	1,940	2,388	252,127	2049/2/15	CAN 1.5% 06/01/23	1.5	2,010	2,070	171,152
T 3% 05/15/42	3.0	1,100	1,336	141,036	2042/5/15	CAN 1.5% 06/01/26	1.5	840	883	73,009
T 3% 05/15/45	3.0	2,100	2,558	269,995	2045/5/15	CAN 1.75% 03/01/23	1.75	700	722	59,726
T 3% 05/15/47	3.0	3,400	4,165	439,574	2047/5/15	CAN 2% 06/01/28	2.0	800	872	72,154
T 3% 08/15/48	3.0	4,910	6,034	696,901	2048/8/15	CAN 2% 09/01/23	2.0	1,180	1,233	101,953
T 3% 09/30/25	3.0	3,660	4,095	432,222	2025/9/30	CAN 2% 12/01/51	2.0	1,730	1,904	157,484
T 3% 10/31/25	3.0	1,000	1,120	118,229	2025/10/31	CAN 2.25% 03/01/24	2.25	670	710	58,749
T 3% 11/15/44	3.0	2,050	2,494	263,262	2044/11/15	CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,530	1,650	136,472
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,000	1,238	130,729	2042/2/15	CAN 2.25% 06/01/29	2.25	390	434	35,945
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,100	2,601	274,531	2043/2/15	CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,780	1,910	157,919
T 3.125% 05/15/48	3.125	1,400	1,757	185,433	2048/5/15	CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,000	1,034	85,515
T 3.125% 08/15/44	3.125	2,600	3,226	340,539	2044/8/15	CAN 2.75% 12/01/48	2.75	810	1,026	84,911
T 3.125% 11/15/28	3.125	3,960	4,612	486,832	2028/11/15	CAN 2.75% 12/01/64	2.75	290	396	32,804
T 3.125% 11/15/41	3.125	870	1,075	113,512	2041/11/15	CAN 3.5% 12/01/45	3.5	900	1,267	104,818
T 3.375% 05/15/44	3.375	2,000	2,577	272,029	2044/5/15	CAN 4.0% 06/01/41	4.0	490	713	58,962
T 3.5% 02/15/39	3.5	900	1,164	122,947	2039/2/15	CAN 5% 06/01/37	5.0	520	804	66,498
T 3.625% 02/15/44	3.625	1,600	2,137	225,604	2044/2/15	CAN 5.75% 06/01/29	5.75	960	1,339	110,710
T 3.625% 08/15/43	3.625	1,600	2,134	225,261	2043/8/15					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		
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	千カナダドル 670	千カナダドル 1,023	千円 84,631	2033/6/1	DBR 4.75% 07/04/40	4.75	千ユーロ 1,310	千円 2,598	千円 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) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,500	2,168	275,454	2028/1/4
MBONO 10% 11/20/36	10.0	6,400	8,873	46,583	2036/11/20	DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,370	1,653	209,993	2024/1/4
MBONO 10% 12/05/24	10.0	24,100	28,859	151,514	2024/12/5	DBR 6.25% 01/04/30	6.25	610	991	125,910	2030/1/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	10,710	11,256	59,096	2026/3/5	DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,270	1,868	237,346	2027/7/4
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	17,400	17,932	94,148	2022/6/9	OBL 0% 04/05/24	—	1,760	1,801	228,835	2024/4/5
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	20,920	21,987	115,433	2023/9/	OBL 0% 04/08/22	—	1,460	1,471	186,925	2022/4/8
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	22,800	26,081	136,928	2027/6/3	OBL 0% 04/11/25	—	1,700	1,752	222,543	2025/4/11
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	10,950	12,818	67,298	2031/5/29	OBL 0% 04/14/23	—	1,110	1,128	143,388	2023/4/14
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	13,980	15,782	82,857	2042/11/13	OBL 0% 10/07/22	—	1,530	1,548	196,631	2022/10/7
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	4,320	5,062	26,575	2034/11/23	OBL 0% 10/10/25	—	1,170	1,209	153,620	2025/10/10
MBONO 8% 09/05/24	8.0	5,910	6,618	34,746	2024/9/5	OBL 0% 10/18/24	—	2,150	2,208	280,556	2024/10/18
MBONO 8% 11/07/47	8.0	11,460	13,247	69,547	2047/11/7	(イタリア) 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) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ			BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	720	736	93,577	2023/6/15
BKO 0% 03/11/22	—	830	836	106,210	2022/3/11	BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	560	575	73,042	2023/10/15
BKO 0% 06/10/22	—	2,150	2,169	275,616	2022/6/10	BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	1,100	1,149	146,010	2027/1/15
DBR 0% 02/15/30	—	2,060	2,157	274,022	2030/2/15	BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	1,500	1,529	194,222	2022/8/1
DBR 0% 05/15/35	—	1,500	1,557	197,857	2035/5/15	BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	1,720	1,767	224,508	2023/3/1
DBR 0% 08/15/26	—	1,620	1,683	213,822	2026/8/15	BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	320	319	40,541	2037/3/1
DBR 0% 08/15/29	—	2,430	2,544	323,242	2029/8/15	BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	860	884	112,310	2023/3/15
DBR 0% 08/15/30	—	1,480	1,549	196,787	2030/8/15	BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	1,630	1,704	216,458	2030/8/1
DBR 0% 08/15/50	—	1,160	1,155	146,824	2050/8/15	BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,000	1,050	133,471	2027/9/15
DBR 0% 11/15/27	—	1,580	1,648	209,405	2027/11/15	BTPS 1.2% 04/01/22	1.2	1,000	1,018	129,377	2022/4/1
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	1,920	2,029	257,798	2027/2/15	BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,170	1,251	158,922	2026/12/1
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,880	2,007	255,011	2029/2/15	BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	350	379	48,154	2030/4/1
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	1,300	1,385	176,007	2028/8/15	BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	1,000	1,020	129,667	2022/4/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	1,140	1,197	152,105	2025/2/15	BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,130	1,216	154,502	2036/3/1
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	2,300	2,442	310,247	2026/2/15	BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	1,070	1,141	145,048	2025/5/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,510	1,632	207,391	2028/2/15	BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,550	1,596	202,759	2022/9/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	900	969	123,149	2027/8/15	BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	600	637	80,960	2024/11/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,610	1,710	217,230	2024/8/15	BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,500	1,605	203,910	2025/6/1
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,250	2,427	308,404	2025/8/15	BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,350	1,465	186,119	2026/6/1
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	1,560	2,105	267,401	2028/8/15	BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	1,340	1,488	189,069	2032/3/1
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	950	993	126,164	2023/2/15	BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	1,330	1,476	187,499	2030/12/1
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,290	2,407	305,759	2023/5/15	BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	750	794	100,361	2051/9/1
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	1,020	1,095	139,182	2024/5/15	BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	990	1,056	134,247	2024/7/1
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	920	952	120,948	2022/9/4	BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	650	719	91,435	2041/3/1
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,250	1,345	170,914	2024/2/15	BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	750	801	101,828	2024/5/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	1,650	1,706	216,815	2022/7/4	BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	820	890	113,132	2025/7/1
DBR 2% 08/15/23	2.0	1,890	2,021	256,819	2023/8/15	BTPS 2% 02/01/28	2.0	380	427	54,251	2028/2/1
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	1,840	2,984	379,046	2044/7/4	BTPS 2% 12/01/25	2.0	1,050	1,154	146,704	2025/12/1
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,980	3,289	417,864	2046/8/15	BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,040	1,167	148,244	2027/8/1
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,240	2,163	274,822	2042/7/4	BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	1,470	1,636	207,816	2026/7/15
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	1,670	2,834	360,032	2037/1/4	BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	1,700	1,921	244,113	2027/6/1
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,240	2,285	290,259	2039/7/4	BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	990	1,180	149,900	2036/9/1
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	700	986	125,364	2028/7/4	BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	990	1,191	151,393	2033/9/1
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,690	2,982	366,192	2034/7/4	BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	500	621	78,949	2050/9/1
						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		
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
BTIPS 2.5% 11/15/25	2.5%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2025/11/15	FRTR 1% 05/25/27	1.0%	2,480	2,717	345,219	2027/5/25
BTIPS 2.5% 12/01/24	2.5%	660	741	94,139	2024/12/1	FRTR 1% 11/25/25	1.0%	2,240	2,412	306,458	2025/11/25
BTIPS 2.7% 03/01/47	2.7%	1,300	1,433	182,020	2047/3/1	FRTR 1.25% 05/25/34	1.25%	2,400	2,809	356,842	2034/5/25
BTIPS 2.8% 03/01/67	2.8%	1,240	1,604	203,826	2067/3/1	FRTR 1.25% 05/25/36	1.25%	2,410	2,843	361,167	2036/5/25
BTIPS 2.8% 03/01/28	2.8%	600	803	102,076	2028/12/1	FRTR 1.5% 05/25/31	1.5%	2,950	3,476	441,560	2031/5/25
BTIPS 2.95% 09/01/38	2.95%	1,260	1,503	190,911	2038/9/1	FRTR 1.5% 05/25/50	1.5%	1,960	2,507	318,503	2050/5/25
BTIPS 3% 08/01/29	3.0%	1,100	1,435	182,334	2038/9/1	FRTR 1.75% 05/25/23	1.75%	2,600	2,746	348,838	2023/5/25
BTIPS 3.1% 03/01/40	3.1%	1,760	2,147	272,748	2029/8/1	FRTR 1.75% 05/25/66	1.75%	850	1,225	155,605	2066/5/25
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
BTIPS 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
<b>(オランダ)</b>											
<b>国債証券</b>											
NETHER 0% 01/15/24	—				—	550	561	71,332		2024/1/15	
NETHER 0% 01/15/27	—				—	480	496	63,127		2027/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—				—	390	380	48,389		2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—				—	850	881	111,998		2030/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25%				0.25%	920	957	121,637		2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25%				0.25%	630	668	84,881		2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5%				0.5%	620	690	87,648		2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5%				0.5%	1,260	1,338	169,976		2026/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75%				0.75%	900	978	124,292		2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75%				0.75%	1,040	1,140	144,820		2028/7/15	
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75%				1.75%	1,000	1,060	134,705		2023/7/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0%				2.0%	1,460	1,597	202,886		2024/7/15	
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25%				2.25%	750	781	99,288		2022/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5%				2.5%	860	1,153	146,481		2033/1/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75%				2.75%	1,110	1,909	242,489		2047/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75%				3.75%	300	326	41,420		2023/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75%				3.75%	1,060	1,918	243,641		2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0%				4.0%	1,020	1,714	217,732		2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5%				5.5%	1,010	1,442	183,288		2028/1/15	
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5%				7.5%	700	812	103,188		2023/1/15	
<b>(スペイン)</b>											
<b>国債証券</b>											
SPGB 0% 01/31/25	—				—	1,240	1,260	160,095		2025/1/31	
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		
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
SPGB 0.1% 04/30/31	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	2031/4/30	BGB 1.25% 04/22/33	1.25	330	385	48,943	2033/4/22
SPGB 0.25% 07/30/24	0.1	480	476	60,480		BGB 1.45% 06/22/37	1.45	400	486	61,737	2037/6/22
SPGB 0.35% 07/30/23	0.25	1,000	1,024	130,173	2024/7/30	BGB 1.6% 06/22/47	1.6	690	885	112,497	2047/6/22
SPGB 0.4% 04/30/22	0.35	1,570	1,603	203,718	2023/7/30	BGB 1.7% 06/22/50	1.7	490	650	82,589	2050/6/22
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	1,040	1,052	133,652	2022/4/30	BGB 1.9% 06/22/38	1.9	510	661	84,065	2038/6/22
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	800	813	103,383	2022/10/31	BGB 2.15% 06/22/66	2.15	440	697	88,609	2066/6/22
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	1,980	2,058	261,524	2030/4/30	BGB 2.25% 06/22/23	2.25	970	1,038	131,884	2023/6/22
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	1,200	1,261	160,243	2029/10/31	BGB 2.25% 06/22/57	2.25	380	589	74,833	2057/6/22
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	480	511	64,908	2027/7/30	BGB 2.6% 06/22/24	2.6	1,200	1,333	169,425	2024/6/22
SPGB 1% 10/31/50	1.0	850	850	107,970	2050/10/31	BGB 3% 06/22/34	3.0	680	957	121,601	2034/6/22
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	750	813	103,390	2040/10/31	BGB 3.75% 06/22/45	3.75	650	1,157	146,999	2045/6/22
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	1,200	1,330	169,033	2030/10/31	BGB 4% 03/28/22	4.0	790	832	105,696	2022/3/28
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	1,460	1,594	202,571	2026/10/31	BGB 4% 03/28/32	4.0	620	912	115,872	2032/3/28
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	1,020	1,133	143,957	2028/4/30	BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,110	1,974	250,846	2041/3/28
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	1,320	1,469	186,691	2028/7/30	BGB 4.25% 09/28/22	4.25	940	1,016	129,145	2022/9/28
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	750	841	106,887	2029/4/30	BGB 4.5% 03/28/26	4.5	750	949	120,551	2026/3/28
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,840	2,041	259,315	2027/10/31	BGB 5% 03/28/35	5.0	1,270	2,174	276,252	2035/3/28
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,970	2,185	277,546	2027/4/30	BGB 5.5% 03/28/28	5.5	1,190	1,706	216,796	2028/3/28
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,250	1,357	172,423	2025/4/30	(オーストリア) 国債証券					2030/2/20
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	1,290	1,540	195,730	2035/7/30						
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	2023/7/15
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	
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	2029/9/20
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					2022/4/15
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	290	297	37,811	2040/6/22						
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	490	511	64,928	2024/10/22	RFGB 0% 04/15/22	—	250	252	32,011	2023/9/15
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,100	1,169	148,528	2025/6/22	RFGB 0% 09/15/23	—	100	101	12,937	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	750	813	103,299	2027/6/22	RFGB 0% 09/15/24	—	300	307	39,051	2024/9/15
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	980	1,070	136,021	2028/6/22	RFGB 0% 09/15/30	—	40	41	5,332	2030/9/15
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	990	1,095	139,171	2029/6/22	RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	270	276	35,138	2036/4/15
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,080	1,172	148,890	2026/6/22	RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	200	207	26,308	2040/9/15
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,140	1,285	163,239	2031/6/22	RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	470	497	63,213	2026/4/15

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		
			外貨建金額	邦貨換算金額					外貨建金額	邦貨換算金額	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5%	千ユーロ	千円	千円	2027/9/15	UKT 1.625% 10/22/71	1.625	千イギリスポンド	千円	2071/10/22	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5%	380	406	51,595	2028/9/15	UKT 1.75% 01/22/49	1.75	600	700	101,481	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5%	470	504	64,101	2029/9/15	UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,060	1,296	187,894	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75%	290	312	39,685	2031/4/15	UKT 1.75% 09/07/22	1.75	1,640	1,685	244,369	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875%	270	299	38,012	2025/9/15	UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,540	1,743	252,666	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125%	300	321	40,821	2034/4/15	UKT 2% 09/07/25	2.0	420	456	66,188	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375%	350	408	51,860	2047/4/15	UKT 2.25% 09/07/23	2.25	1,160	1,226	177,815	
RFGB 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	
RFGB 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	
RFGB 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	
RFGB 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	
RFGB 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	
RFGB 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	
<b>(アイルランド) 国債証券</b>										2052/7/22	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2%	460	479	60,911	2027/5/15	UKT 4% 01/22/60	4.0	840	1,646	238,607	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2%	470	489	62,114	2030/10/18	UKT 4% 03/07/22	4.0	910	949	137,621	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4%	180	189	24,066	2035/5/15	UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,200	1,787	259,154	
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8%	630	639	81,258	2022/3/15	UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,290	1,806	261,873	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9%	440	482	61,241	2028/5/15	UKT 4.25% 09/07/39	4.25	820	1,285	186,397	
IRISH 1% 05/15/26	1.0%	730	789	100,335	2026/5/15	UKT 4.25% 12/07/27	4.25	750	953	138,168	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1%	550	615	78,194	2029/5/15	UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,050	1,673	242,511	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3%	690	807	102,535	2033/5/15	UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,060	1,826	264,730	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35%	340	394	50,065	2031/3/18	UKT 4.25% 12/07/49	4.25	980	1,757	254,796	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5%	300	385	48,936	2050/5/15	UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,040	2,017	292,467	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7%	490	616	78,277	2037/5/15	UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,080	1,606	232,846	
IRISH 2% 02/18/45	2.0%	580	806	102,398	2045/2/18	UKT 4.5% 12/07/42	4.5	1,170	1,973	285,994	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4%	770	963	122,330	2030/5/15	UKT 4.75% 12/07/30	4.75	850	1,197	173,604	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4%	460	518	65,804	2024/3/18	UKT 4.75% 12/07/38	4.75	880	1,442	209,068	
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9%	580	636	80,812	2023/3/20	UKT 5% 03/07/25	5.0	600	720	104,439	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4%	700	873	111,011	2025/3/13	UKT 6.0% 12/07/28	6.0	450	646	93,670	
<b>小 計</b>			58,458,375							9,477,601	
<b>(イギリス) 国債証券</b>											
UKT 0.125% 01/30/26	0.125%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千イギリスポンド	UKT 0.125% 05/12/31	0.125	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	2031/5/12	
UKT 0.125% 01/31/23	0.125%	1,750	1,747	253,345	2026/1/30	SGB 0.125% 05/12/28	0.125	1,690	1,687	21,251	
UKT 0.125% 01/31/24	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	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125%	980	981	142,274	2024/1/31	SGB 0.75% 11/12/29	0.75	3,770	4,005	50,435	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375%	1,320	1,304	189,020	2028/1/31	SGB 1% 11/12/26	1.0	4,940	5,274	66,404	
UKT 0.5% 07/22/22	0.5%	1,870	1,848	267,890	2030/10/22	SGB 1.5% 11/13/23	1.5	5,670	5,962	75,065	
UKT 0.5% 10/22/61	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	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625%	670	557	80,821	2061/10/22	SGB 3.5% 03/30/39	3.5	2,950	4,520	56,917	
UKT 0.625% 07/31/35	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	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625%	870	845	122,594	2035/7/31	<b>小 計</b>					478,712
UKT 0.75% 07/22/23	0.75%	1,200	1,060	153,648	2050/10/22	<b>(スウェーデン) 国債証券</b>					
UKT 0.875% 01/31/46	0.875%	940	957	138,721	2023/7/22	UKT 1.375% 08/19/30	1.375	2,800	2,845	35,170	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875%	1,450	1,495	216,735	2024/4/22	UKT 1.5% 02/19/26	1.5	3,110	3,219	39,787	
UKT 1% 04/22/24	1.0%	1,450	1,495	216,735	2024/4/22	UKT 1.75% 02/17/27	1.75	2,900	3,045	37,642	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25%	1,450	1,266	183,609	2027/7/22	UKT 1.75% 03/13/25	1.75	3,120	3,255	40,238	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25%	1,450	1,190	172,535	2041/10/22	UKT 1.75% 09/06/29	1.75	2,470	2,596	32,092	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5%	1,450	1,137	164,921	2026/7/22	UKB 2% 04/26/28	2.0	2,510	2,682	33,154	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5%	1,310	1,442	209,142	2027/7/22	UKB 2% 05/24/23	2.0	4,940	5,118	63,269	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625%	1,400	1,539	223,111	2028/10/22	UKB 3% 03/14/24	3.0	3,640	3,915	48,397	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625%	850	984	142,661	2054/10/22	<b>小 計</b>					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		
			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			%	千オースト ラリアドル	千オースト 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	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 2% 02/01/24	2.0	90	94	7,461	2024/2/1
小計				723,765		SIGB 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			SIGB 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	SIGB 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	SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	230	265	21,010	2039/7/1
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	780	779	22,059	2030/10/25	SIGB 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	SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	630	797	63,060	2036/3/1
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	2,860	3,068	86,848	2024/10/25	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 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	SIGB 3% 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						
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	1,500	1,640	46,422	2022/9/23						
小計				925,323							
(オーストラリア) 国債証券		千オースト ラリアドル	千オースト ラリアドル			(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		
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	1,730	1,733	140,327	2024/11/21	MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,220	1,249	32,446	2022/8/15
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	1,000	994	80,475	2025/11/21	MGS 3.48% 03/15/23	3.48	1,300	1,343	34,895	2023/3/15
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	1,540	1,536	124,404	2026/9/21	MGS 3.502% 05/31/27	3.502	100	106	2,766	2027/5/31
ACGB 1% 11/21/31	1.0	1,810	1,758	142,355	2031/11/21	MGS 3.733% 06/15/28	3.733	300	324	8,435	2028/6/15
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,220	2,180	176,517	2030/12/21	MGS 3.757% 05/22/40	3.757	150	153	3,974	2040/5/22
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	1,140	1,131	91,566	2032/5/21	MGS 3.795% 09/30/22	3.795	800	825	21,440	2022/9/30
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	1,190	1,220	98,829	2031/6/21	MGS 3.8% 08/17/23	3.8	550	575	14,948	2028/8/17
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	990	882	71,440	2051/6/21	MGS 3.844% 04/15/33	3.844	860	898	23,324	2033/4/15
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,260	2,487	201,327	2028/5/21	MGS 3.882% 03/10/22	3.882	930	950	24,695	2022/3/10
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	430	446	36,151	2022/11/21	MGS 3.882% 03/14/25	3.882	690	736	19,128	2025/3/14
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	2,480	2,783	225,326	2030/5/21	MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,530	1,663	43,197	2029/8/15
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,590	2,808	227,334	2024/4/21	MGS 3.892% 03/15/27	3.892	780	846	21,989	2027/3/15
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	810	910	73,711	2041/5/21	MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,160	1,263	32,815	2027/11/16
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	630	724	58,636	2035/6/21	MGS 3.9% 11/30/26	3.9	360	393	10,207	2026/11/30
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,400	1,586	128,430	2027/11/21	MGS 3.906% 07/15/26	3.906	1,010	1,094	28,416	2026/7/15
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,750	1,993	161,343	2028/11/21	MGS 3.955% 09/15/25	3.955	520	561	14,580	2025/9/15
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,640	1,873	151,679	2029/11/21	MGS 4.059% 09/30/24	4.059	750	803	20,860	2024/9/30
ACGB 3% 03/21/47	3.0	880	1,025	83,049	2047/3/21	MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,090	1,167	30,321	2024/7/15
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	1,750	1,967	159,298	2025/4/21	MGS 4.232% 06/30/31	4.232	850	947	24,604	2031/6/30
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,330	2,750	222,648	2029/4/21	MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,270	1,393	36,181	2035/5/31
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	650	787	63,711	2039/6/21	MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,160	1,280	33,265	2026/4/15
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	810	1,039	84,187	2037/4/21	MGS 4.498% 04/15/30	4.498	1,260	1,431	37,163	2030/4/15
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	2,600	3,109	251,724	2026/4/21	MGS 4.642% 11/07/33	4.642	1,160	1,305	33,911	2033/11/7
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,220	1,650	133,611	2033/4/21	MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,090	1,221	31,722	2046/3/15
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,230	2,788	225,754	2027/4/21	MGS 4.762% 04/07/37	4.762	1,160	1,333	34,639	2037/4/7
						MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,080	1,247	32,394	2038/6/8
						MGS 4.921% 07/06/48	4.921	900	1,039	26,989	2048/7/6
						MGS 4.935% 09/30/43	4.935	530	611	15,890	2043/9/30
						小計				695,207	

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	
(イスラエル) 国債証券	%	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル	千円	
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	460	464	14,905	2025/4/30
ILGOV 0.75% 07/31/22	0.75	3,180	3,213	103,091	2022/7/31
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

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	
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	%	千イスラエルシェケル	千円	
小 計			3,300	4,390	140,852
合 計					2026/10/30

(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	百万円	百万円
EURO-SCHATZ	185	—
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



## 外国債券マザーファンド 一第20期一

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。