

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投資／内外／資産複合	
信託期間	信託期間は2009年1月16日から無期限です。	
運用方針	主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通して、国内、先進国および新興国の公社債および株式（DR（預託証券）を含みます。）に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。	
主要運用対象	世界経済インデックスファンド	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。
	国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックスマザーファンド	新興国の債券を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
組入制限	世界経済インデックスファンド	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	国内債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
	国内株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式インデックスマザーファンド	株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）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割合には制限を設けません。
分配方針	年1回、毎決算時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。	

# 世界経済インデックスファンド

## 運用報告書（全体版）

第12期（決算日 2021年1月20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			株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 組入比率	資産総 額
	(分配落)	税金 分配金	期中 騰落率						
第8期(2017年1月20日)	円 20,148	円 0	% 10.2	% 48.4	% 0.7	% 47.8	% 0.1	% 0.9	百万円 22,647
第9期(2018年1月22日)	23,375	0	16.0	50.1	1.8	45.1	0.3	0.8	54,410
第10期(2019年1月21日)	21,463	0	△8.2	47.8	1.4	48.1	0.2	0.8	58,898
第11期(2020年1月20日)	24,407	0	13.7	49.8	1.7	45.2	0.3	0.9	68,600
第12期(2021年1月20日)	25,904	0	6.1	51.1	1.0	45.1	0.3	0.7	82,775

(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」で算出しております。

## 当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 組入比率
	騰落率						
(当期首) 2020年1月20日	円 24,407	% -	% 49.8	% 1.7	% 45.2	% 0.3	% 0.9
1月末	23,831	△2.4	48.6	1.6	46.1	0.3	0.9
2月末	23,008	△5.7	46.9	1.5	48.4	0.2	0.9
3月末	20,761	△14.9	45.6	2.6	48.5	0.2	0.8
4月末	21,627	△11.4	48.8	1.7	45.8	0.5	0.9
5月末	22,296	△8.6	48.3	2.0	45.6	0.6	0.8
6月末	22,815	△6.5	49.2	1.5	45.3	0.7	0.8
7月末	23,276	△4.6	49.7	1.5	45.4	0.4	0.8
8月末	24,074	△1.4	50.1	1.5	45.2	0.4	0.8
9月末	23,562	△3.5	49.3	1.6	46.3	0.4	0.8
10月末	23,343	△4.4	48.9	1.9	46.4	0.3	0.7
11月末	24,856	1.8	50.6	1.4	45.3	0.4	0.7
12月末	25,368	3.9	51.4	1.0	45.0	0.3	0.7
(当期末) 2021年1月20日	25,904	6.1	51.1	1.0	45.1	0.3	0.7

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

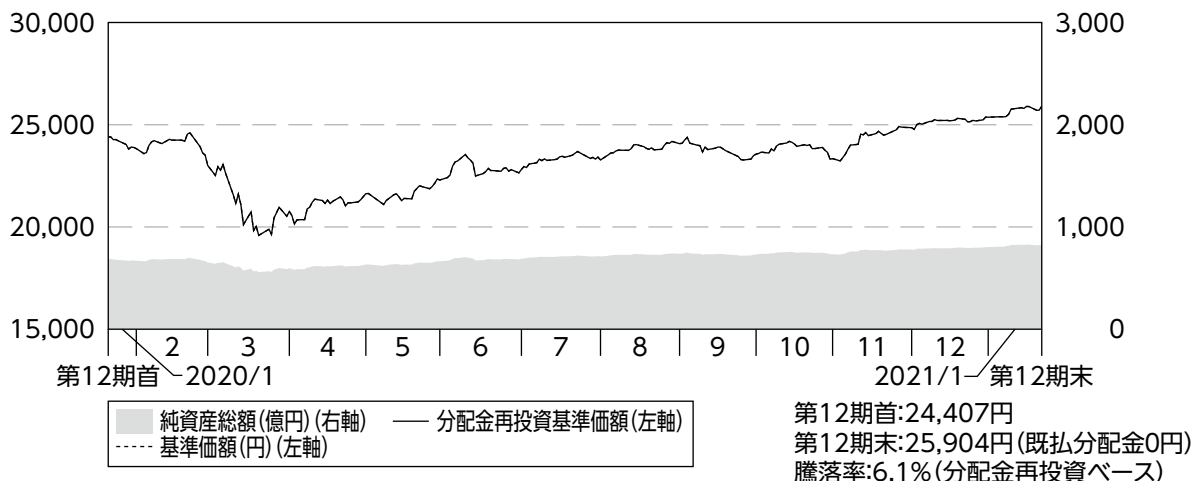
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

## 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は、2020年1月20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。当期初から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まったことやOPEC(石油輸出国機構)と非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことを受けて大幅に下落する展開となりましたが、その後は、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展や各国の経済対策、金融政策による下支えもあり、基準価額は上昇しました。

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
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	5.0%	3.7%	△0.6%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	5.0%	5.2%	8.7%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	30.0%	28.8%	3.9%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	30.0%	31.0%	8.4%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	15.0%	13.6%	△5.0%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	15.0%	16.7%	15.6%

## 投資環境

### 国内債券市場

期初から2020年3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済の減速懸念が高まり利回りは低下しましたが、その後、財政出動への期待の高まりによる国債増発への懸念などから、利回りは上昇しました。4月以降は、利回りは概ねレンジ内での推移となりました。

### 国内株式市場

期初から2020年3月にかけては、新型コロナウイルス感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まり大幅に下落する展開となりましたが、その後は、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展や各国の経済対策への期待の高まりなどを背景に反発しました。

### 先進国債券市場

期初から2020年3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済の減速懸念が高まり利回りは低下しました。3月中旬には国債増発懸念や米ドル需要の高まりを受けた米国債現金化の動きなどから利回りは一時上昇しましたが、7月にかけては新型コロナウイルス感染拡大への警戒感や世界各国が金融緩和や資金供給を強めたことなどを背景に利回りは低下基調で推移しました。その後は、新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などが金利上昇要因となった一方で、感染者数の増加や米国の金融緩和継続観測などが金利低下要因となり、全体ではレンジ内での推移となりました。

### 先進国株式市場

期初から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まったことやOPEC(石油輸出国機構)と非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことを受けて大幅に下落する展開となりましたが、その後、期末にかけては各国の大規模な経済対策や新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などを背景に上昇しました。

### 新興国債券市場

期初から2020年3月上旬にかけては、全体的には利回りは低下基調で推移しました。3月中旬には新型コロナウイルスの感染拡大や原油価格急落を受けた市場の混乱により、利回りは上昇しましたが、その後、世界各国が一斉に金融緩和や資金供給を強めたことやリスク選好の動きが強まる中、新興国債券市場に高利回りの獲得を狙った資金の流入が続いたことなどを背景に、利回りは低下基調で推移しました。

### 新興国株式市場

期初から2020年3月にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まったことやOPECと非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことを受けて大幅に下落する展開となりましたが、その後、期末にかけては、各国の大規模な経済対策や新型コロナウイルスのワクチン開発の進展などを背景に上昇しました。

### ○当ファンド

国内、先進国および新興国の株式・公社債へ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、概ね基本組入比率を維持する運用を行いました。

#### ・国内債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として、ベンチマークに合わせてデュレーション、債券種別や残存期間を調整しました。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、先物を含む国内債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ・国内株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)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、設定や解約による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。

#### ・外国債券インデックス 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。

#### ・外国株式インデックス 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(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。

#### ・新興国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)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。

#### ・新興国株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)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、先物を含む新興国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

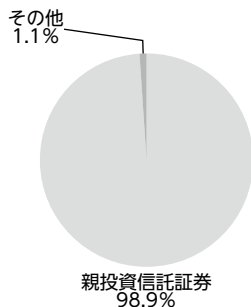
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

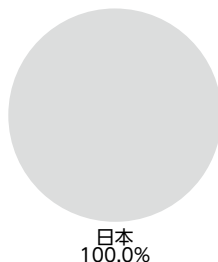
	当期末
	2021年1月20日
外国株式インデックス マザーファンド	31.0%
外国債券インデックス マザーファンド	28.8%
新興国株式インデックス マザーファンド	16.7%
新興国債券インデックス マザーファンド	13.6%
国内株式インデックス マザーファンド	5.2%
国内債券インデックス マザーファンド	3.7%
その他	1.1%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

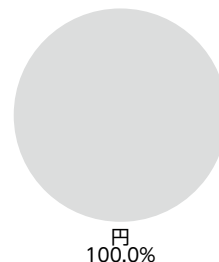
### ○資産別配分



### ○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

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第12期	
	2020年1月21日~2021年1月20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)	15,903	

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)－印は該当がないことを示します。

### ○当ファンド

主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国および新興国の公社債および株式(DR(預託証券)を含みます。)に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行うことを基本とします。株式(DR(預託証券)を含みます。)と債券の基本資産配分比率は、原則として株式50%、債券50%とします。

#### ・国内債券インデックス マザーファンド

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

#### ・国内株式インデックス マザーファンド

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

#### ・外国債券インデックス 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)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・外国株式インデックス マザーファンド

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・新興国債券インデックス マザーファンド

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・新興国株式インデックス マザーファンド

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年1月21日~2021年1月20日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	128円	0.550%	(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23,234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)	(51)	(0.220)	
(販売会社)	(64)	(0.275)	
(受託会社)	(13)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	1	0.006	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.004)	
(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)	
(c) 有価証券取引税	1	0.005	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(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	13	0.054	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(12)	(0.051)	
(監査費用)	(1)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	143	0.615	

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

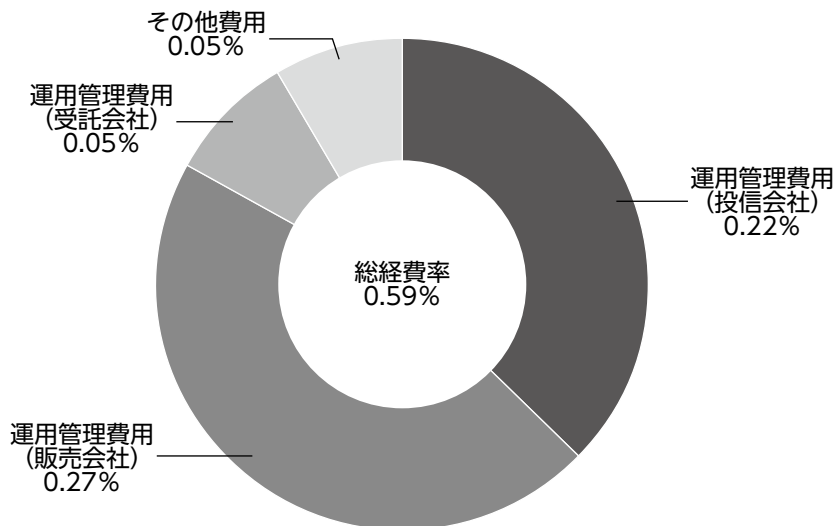
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## <参考情報>

### 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.59%です。



(注1)各費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
新興国株式インデックス マザーファンド	810,728	2,136,250	345,274	1,163,730
国内株式インデックス マザーファンド	414,593	618,670	67,191	107,880
外国株式インデックス マザーファンド	1,642,322	4,103,640	1,105,545	3,239,550
国内債券インデックス マザーファンド	350,059	494,990	68,677	97,080
外国債券インデックス マザーファンド	2,116,220	6,248,410	810,043	2,326,580
新興国債券インデックス マザーファンド	1,161,721	1,906,120	203,998	341,730

## 株式売買比率

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

#### <新興国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,438,804千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	67,966,650千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.30

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

#### <国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	142,838,514千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	319,705,002千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.44

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

#### <外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	93,109,975千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	386,847,911千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.24

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 183	百万円 183	% 100.0	百万円 183	百万円 183	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	233,631	21,107	9.0	233,619	21,107	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。

### <新興国株式インデックス 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 21	百万円 21	% 100.0	百万円 21	百万円 21	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	26,150	1,618	6.2	24,626	1,618	6.6

<平均保有割合 15.0%>

(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。

### <国内株式インデックス 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 735	百万円 735	% 100.0	百万円 735	百万円 735	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	882,193	78,394	8.9	882,143	78,394	8.9

<平均保有割合 1.1%>

(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。

### <外国株式インデックス 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 72,485	百万円 37	% 0.1	百万円 68,058	百万円 15	% 0.0
金 銭 信 託	142	142	100.0	142	142	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	204,421	20,061	9.8	205,035	20,061	9.8

<平均保有割合 5.4%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## <国内債券インデックス 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 510	百万円 510	% 100.0	百万円 510	百万円 510	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	331,516	25,748	7.8	330,924	25,748	7.8

<平均保有割合 0.5%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <外国債券インデックス 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 37,002	百万円 1,497	% 4.0	百万円 169,643	百万円 128	% 0.1
金 銭 信 託	878	878	100.0	878	878	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	993,952	114,905	11.6	996,275	114,905	11.5

<平均保有割合 6.6%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <新興国債券インデックス 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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 220	百万円 220	% 100.0	百万円 220	百万円 220	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	136,471	14,008	10.3	137,183	14,008	10.2

<平均保有割合 17.2%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## ■利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	207百万円	138百万円	867百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

	当 期 首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
新興国株式インデックス マザーファンド	3,341,714	3,807,169	13,804,414
国内株式インデックス マザーファンド	2,080,464	2,427,866	4,289,069
外国株式インデックス マザーファンド	7,440,741	7,977,519	25,649,319
国内債券インデックス マザーファンド	1,869,306	2,150,688	3,028,168
外国債券インデックス マザーファンド	6,689,763	7,995,940	23,833,500
新興国債券インデックス マザーファンド	5,567,807	6,525,530	11,259,802

(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。

新興国株式インデックス マザーファンド	25,006,661千口
国内株式インデックス マザーファンド	211,981,845千口
外国株式インデックス マザーファンド	146,425,163千口
国内債券インデックス マザーファンド	431,157,941千口
外国債券インデックス マザーファンド	94,925,048千口
新興国債券インデックス マザーファンド	36,785,091千口

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
新興国株式インデックス マザーファンド	13,804,414	16.6
国内株式インデックス マザーファンド	4,289,069	5.1
外国株式インデックス マザーファンド	25,649,319	30.8
国内債券インデックス マザーファンド	3,028,168	3.6
外国債券インデックス マザーファンド	23,833,500	28.6
新興国債券インデックス マザーファンド	11,259,802	13.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,427,533	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	83,291,805	100.0

(注1) 新興国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(90,855,116千円)の投資信託財産総額(92,483,385千円)に対する比率は98.2%です。

(注2) 外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(470,737,273千円)の投資信託財産総額(471,504,761千円)に対する比率は99.8%です。

(注3) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(280,142,927千円)の投資信託財産総額(283,185,012千円)に対する比率は98.9%です。

(注4) 新興国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(63,333,879千円)の投資信託財産総額(63,562,883千円)に対する比率は99.6%です。

(注5) 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=103.93円

1ブラジルリアル=19.41円

1ペルーヌエボソル=28.75円

1ユーロ=126.20円

1スウェーデンクローナ=12.46円

1トルコリラ=13.91円

1ポーランドズロチ=27.75円

1ニュージーランドドル=74.00円

1マレーシアリンギット=25.68円

1インドネシアルピア=0.0074円

1インドルピー=1.43円

1カタールリアル=28.44円

1サウジアラビアリアル=27.76円

1カナダドル=81.69円

1チリペソ=0.1411円

1ウルグアイペソ=2.46円

1イギリスポンド=141.76円

1ノルウェークローネ=12.18円

1チェココルナ=4.82円

1ロシアルーブル=1.41円

1香港ドル=13.41円

1タイバーツ=3.47円

1韓国ウォン=0.0945円

1イスラエルシェケル=31.91円

1南アフリカランド=6.94円

1クウェート・ディナール=343.57円

1メキシコペソ=5.29円

1コロンビアペソ=0.0298円

1ドミニカペソ=1.79円

1スイスフラン=117.05円

1デンマーククローネ=16.96円

1ハンガリーフォリント=0.3524円

1オーストラリアドル=80.10円

1シンガポールドル=78.28円

1フィリピンペソ=2.16円

1新台幣ドル=3.71円

1パキスタンルピー=0.65円

1アラブ首長国連邦ディルハム=28.34円

1香港・オフショア人民元=16.04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1月20日現在
(A)資 産	83,291,805,871円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,059,461,199
新 興 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	13,804,414,098
国 内 株 式 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	4,289,069,773
外 国 株 式 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	25,649,319,201
国 内 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	3,028,168,875
外 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	23,833,500,119
新 興 国 債 券 イ ン デ ッ ク ス マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	11,259,802,606
未 収 入 金	368,070,000
(B)負 債	516,352,656
未 払 解 約 金	304,937,633
未 払 信 託 報 酬	209,541,688
未 払 利 息	719
そ の 他 未 払 費 用	1,872,616
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	82,775,453,215
元 本	31,955,196,547
次 期 繰 越 損 益 金	50,820,256,668
(D)受 益 権 総 口 数	31,955,196,547口
1万口当たり基準価額(C/D)	25.904円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年1月21日 至 2021年1月20日
(A)配 当 等 収 益	△381,604円
受 取 利 息	6,118
支 払 利 息	△387,722
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	6,093,557,062
売 買 益	6,770,540,416
売 買 損	△676,983,354
(C)信 託 報 酬 等	△389,683,876
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	5,703,491,582
(E)前 期 繰 越 損 益 金	5,748,590,969
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	39,368,174,117
(配 当 等 相 当 額)	(30,865,986,793)
(売 買 損 益 相 当 額)	(8,502,187,324)
(G) 計 (D+E+F)	50,820,256,668
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	50,820,256,668
追 加 信 託 差 損 益 金	39,368,174,117
(配 当 等 相 当 額)	(30,889,847,073)
(売 買 損 益 相 当 額)	(8,478,327,044)
分 配 準 備 積 立 金	11,452,082,551

(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28,106,957,352円、期中追加設定元本額は10,639,014,321円、期中一部解約元本額は6,790,775,126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)		1,529,008,680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)		4,174,482,902円
(C)	収益調整金額		39,368,174,117円
(D)	分配準備積立金額		5,748,590,969円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		50,820,256,668円
(F)	期末残存口数		31,955,196,547口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		15,903円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第16期(2016年5月30日)	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	300,760
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382,463	0.8	99.9	379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390,052	2.0	99.7	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388,127	△0.5	100.5	540,159

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2019年 5月29日	14,211	—	390,052	—	99.7
5月末	14,221	0.1	390,322	0.1	99.7
6月末	14,306	0.7	392,695	0.7	99.8
7月末	14,322	0.8	393,155	0.8	99.7
8月末	14,514	2.1	398,496	2.2	99.7
9月末	14,359	1.0	394,271	1.1	99.8
10月末	14,301	0.6	392,608	0.7	99.7
11月末	14,251	0.3	391,325	0.3	99.7
12月末	14,208	△0.0	390,136	0.0	100.1
2020年 1月末	14,268	0.4	391,771	0.4	99.7
2月末	14,380	1.2	394,745	1.2	99.7
3月末	14,149	△0.4	388,450	△0.4	99.9
4月末	14,197	△0.1	389,790	△0.1	99.9
(当期末) 2020年 5月29日	14,136	△0.5	388,127	△0.5	100.5

(注1)騰落率は期首比です。

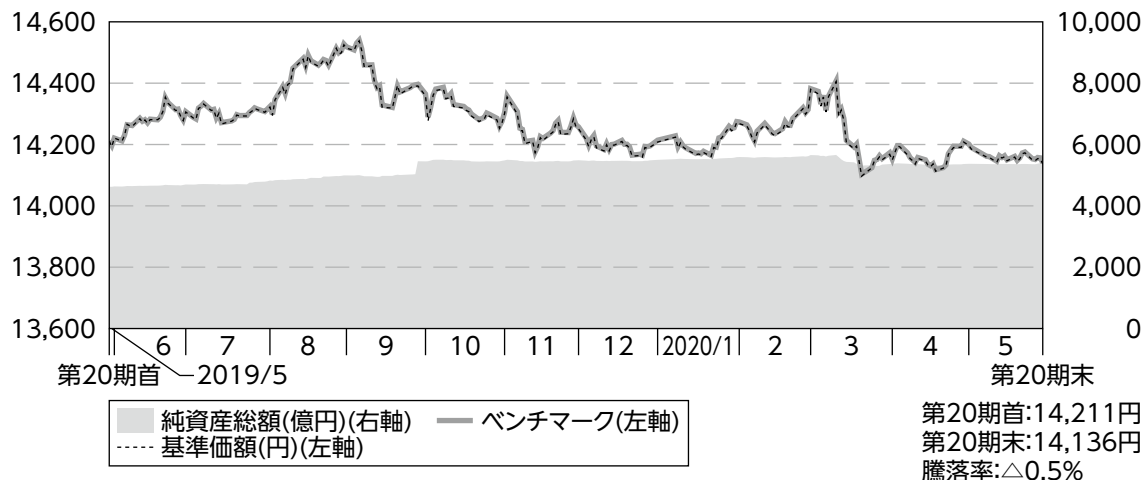
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

## 基準価額等の推移



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

## 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境



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

## 当ファンドのポートフォリオ

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

### (1) 債券組入比率

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

### (2) ポートフォリオ構成

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

## 当ファンドの組入資産の内容

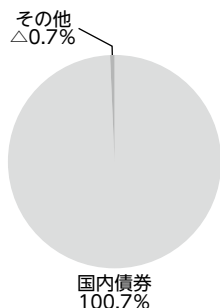
## ○上位10銘柄

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

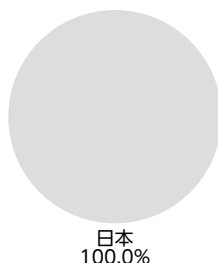
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第142回利付国債(5年)	日本	1.1%
8	第134回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第141回利付国債(5年)	日本	1.1%
10	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%
組入銘柄数		924	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

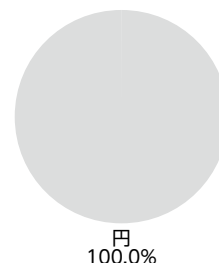
## ○資産別配分



## ○国別配分



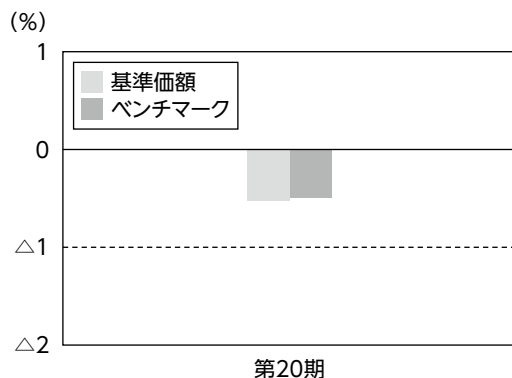
## ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

## 今後の運用方針

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

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日~2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	0  (-)  (-) (0)	0.000  (-)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(14,289円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	179,904,416	104,571,764
	地 方 債 証 券	8,327,272	4,426,367
	特 殊 債 券	13,007,698	6,598,900 (560,845)
	社債券(投資法人債券を含む)	7,754,408	3,325,991 (100,000)

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

### <先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 37,124	百万円 37,274	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 693	百万円 693	% 100.0	百万円 184	百万円 184	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	421,215	73,246	17.4	422,632	74,036	17.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

## &lt;国内(邦貨建)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 B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千 円	千 円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	418,120,000 (4,080,000)	454,188,617 (4,110,967)	84.1 (0.8)	— (—)	56.7 (—)	20.8 (0.8)	6.6 (—)
地 方 債 証 券	27,459,430 (27,459,430)	28,860,716 (28,860,716)	5.3 (5.3)	— (—)	3.5 (3.5)	1.3 (1.3)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	33,023,820 (33,023,820)	34,708,788 (34,708,788)	6.4 (6.4)	— (—)	4.1 (4.1)	1.6 (1.6)	0.7 (0.7)
金 融 債 証 券	2,300,000 (2,300,000)	2,301,003 (2,301,003)	0.4 (0.4)	— (—)	0.0 (0.0)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	22,366,000 (22,366,000)	22,648,161 (22,648,161)	4.2 (4.2)	— (—)	1.9 (1.9)	1.7 (1.7)	0.6 (0.6)
合 計	503,269,250 (89,229,250)	542,707,286 (92,629,636)	100.5 (17.1)	— (—)	66.1 (9.4)	25.7 (5.6)	8.7 (2.1)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ( )内は非上場債で内書きです。

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

## (B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期			末
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千 円)	評 価 額 (千 円)	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>				
第402回利付国債(2年)	0.1	500,000	501,435	2021/7/1
第403回利付国債(2年)	0.1	3,690,000	3,701,402	2021/8/1
第404回利付国債(2年)	0.1	460,000	461,527	2021/9/1
第405回利付国債(2年)	0.1	470,000	471,696	2021/10/1
第406回利付国債(2年)	0.1	780,000	782,995	2021/11/1
第407回利付国債(2年)	0.1	360,000	361,432	2021/12/1
第408回利付国債(2年)	0.1	690,000	692,904	2022/1/1
第409回利付国債(2年)	0.1	2,670,000	2,681,854	2022/2/1
第410回利付国債(2年)	0.1	390,000	391,809	2022/3/1
第412回利付国債(2年)	0.1	780,000	784,040	2022/5/1
第129回利付国債(5年)	0.1	3,340,000	3,351,322	2021/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	3,160,000	3,172,766	2021/12/20
第131回利付国債(5年)	0.1	4,990,000	5,013,403	2022/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	4,770,000	4,795,996	2022/6/20
第133回利付国債(5年)	0.1	4,380,000	4,406,805	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	6,050,000	6,091,079	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	4,080,000	4,110,967	2023/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	4,140,000	4,174,279	2023/6/20

銘 柄 名	当 期			末
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千 円)	評 価 額 (千 円)	償 還 年 月 日
第137回利付国債(5年)	0.1	6,900,000	6,959,547	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	9,420,000	9,505,816	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	4,380,000	4,421,829	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	7,300,000	7,372,854	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	6,020,000	6,082,547	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	6,050,000	6,115,098	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	2,000,000	2,022,200	2025/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	600,140	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,648,884	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	809,286	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,000,000	1,485,440	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	920,000	1,324,064	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,789,855	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	830,000	1,136,037	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	800,000	1,025,584	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	930,000	894,966	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	1,990,000	2,244,361	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,790,000	1,960,712	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,650,000	1,636,701	2059/3/20

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第13回利付国債(40年)	0.5	340,000	336,644	2060/3/20
第317回利付国債(10年)	1.1	890,000	904,649	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	2,260,000	2,294,239	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,710,000	1,743,687	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	4,570,000	4,652,899	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	2,470,000	2,521,721	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	764,347	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,930,000	1,972,305	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	2,740,000	2,794,416	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,920,000	2,985,145	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	3,120,000	3,188,764	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	3,190,000	3,268,505	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	3,400,000	3,473,134	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,250,000	2,316,600	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,690,000	1,743,877	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	922,716	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	3,110,000	3,193,876	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,330,000	2,396,777	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	1,790,000	1,844,344	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,450,000	2,518,428	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	510,000	524,953	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	3,330,000	3,396,333	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	3,060,000	3,139,070	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	5,230,000	5,372,308	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	6,320,000	6,498,856	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,160,000	2,211,948	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	6,380,000	6,463,833	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	3,250,000	3,294,590	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	6,940,000	7,039,172	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	2,290,000	2,323,273	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	5,200,000	5,276,596	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	2,000,000	2,029,840	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,840,000	4,912,987	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	3,130,000	3,177,638	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	5,790,000	5,878,702	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	3,590,000	3,643,814	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	4,190,000	4,251,257	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,470,000	4,531,462	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	3,780,000	3,828,421	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	4,940,000	5,000,515	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	2,420,000	2,447,055	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,698,061	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	3,680,000	3,716,064	2030/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	138,784	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	197,432	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	147,361	2030/5/20

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

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

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	434,249	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	671,280	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	326,081	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	525,850	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	327,697	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	210,000	239,750	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	550,000	624,706	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	481,962	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	399,500	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	722,843	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	519,174	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	1,008,708	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	469,269	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	702,360	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	714,224	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,839,073	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	467,692	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	511,222	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,150,000	1,342,038	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	566,342	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	854,846	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,513,234	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	477,152	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	360,000	423,601	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,393,875	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	452,048	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	308,149	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	770,880	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	609,086	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	950,000	1,129,531	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,166,337	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	942,730	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	1,450,000	1,736,534	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,800,124	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	847,931	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,811,244	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,302,264	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	791,887	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	625,267	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,820,666	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,789,050	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,111,474	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	830,000	1,010,209	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	736,032	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	820,000	1,009,920	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	883,380	2031/3/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,223,357	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,165,949	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	890,000	1,060,016	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,245,000	1,486,554	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,182,810	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	840,000	995,778	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,190,000	1,424,299	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	1,130,000	1,355,604	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	30,000	35,639	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,470,000	1,729,161	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,120,000	1,333,393	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	620,000	723,360	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	580,000	683,599	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	1,840,000	2,195,156	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	2,110,000	2,522,294	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	580,000	700,500	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,130,000	1,339,140	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,740,000	2,040,115	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	2,515,000	3,017,874	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,440,000	2,933,294	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,100,000	2,501,142	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,280,000	2,688,872	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	3,040,000	3,589,966	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	3,630,000	4,241,655	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,255,000	1,432,469	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	2,420,000	2,763,882	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,230,000	2,582,763	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,950,000	3,375,508	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,050,000	2,285,299	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	1,960,000	2,003,159	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,820,000	2,791,771	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,320,000	2,403,311	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,760,000	2,902,002	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	2,420,000	2,583,059	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,750,000	1,838,147	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	580,000	609,121	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	2,610,000	2,740,552	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,720,000	1,775,126	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	1,640,000	1,690,364	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	900,000	959,130	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,540,000	2,613,202	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	1,390,000	1,404,734	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	760,000	753,882	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,410,000	2,390,358	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,350,000	1,338,862	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	1,180,000	1,190,915	2040/3/20
小計		418,120,000	454,188,617	

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
<b>地方債証券</b>				
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	108,478	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	109,481	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	134,753	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	134,260	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	129,250	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	128,361	2044/6/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	116,797	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	117,966	2029/6/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	235,146	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	234,406	2032/12/20
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	101,290	2021/9/17
第702回東京都公募公債	1.04	100,000	101,577	2021/12/20
第7016回東京都公募公債	0.77	100,000	101,894	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,683	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	102,568	2023/6/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	102,206	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,661	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,811	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,566	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	301,197	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	198,940	2029/12/20
平成23年度第6回北海道公募公債	1.11	200,000	202,638	2021/8/31
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	102,034	2023/2/28
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,714	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	99,941	2026/4/28
平成28年度第4回北海道公募公債	0.24	100,000	100,836	2027/2/24
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	137,508	2038/3/19
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	117,174	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,666	2034/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	203,876	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,692	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	200,000	201,420	2027/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,560	2027/6/18
第243回神奈川県公募公債	0.075	200,000	198,846	2029/12/20
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	235,426	2031/9/26
第361回大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	101,807	2022/6/28
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	100,000	101,540	2023/4/26
第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	102,547	2023/8/29
第389回大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,139	2024/10/30
第395回大阪府公募公債(10年)	0.435	151,000	153,887	2025/4/28
第399回大阪府公募公債(10年)	0.529	100,000	102,327	2025/8/28
第402回大阪府公募公債(10年)	0.493	100,000	102,233	2025/11/27
第407回大阪府公募公債(10年)	0.09	156,000	156,045	2026/4/27
第410回大阪府公募公債(10年)	0.001	200,000	198,724	2026/7/28

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

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

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

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

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

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	106,686	2026/11/30
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.085	316,000	316,723	2026/12/28
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	205,000	205,885	2027/1/29
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,647	2027/3/31
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.14	200,000	201,240	2027/4/30
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	100,759	2027/8/31
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	120,000	121,380	2028/2/29
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	200,000	201,594	2028/5/31
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	300,000	312,294	2038/9/30
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	214,000	216,942	2028/10/31
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.576	110,000	110,896	2021/9/24
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.502	100,000	100,853	2021/12/24
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.46	100,000	100,873	2022/2/25
第29回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,445	2021/10/18
第32回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	300,000	304,686	2022/1/25
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	102,331	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	200,000	203,968	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	101,684	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	101,914	2023/5/16
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	102,631	2023/8/14
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	204,798	2024/2/16
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	101,930	2025/12/12
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,942	2026/3/13
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,228	2026/12/14
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	100,000	100,430	2027/1/19
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,548	2027/4/16
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,781	2027/7/16
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,754	2027/8/13
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	111,252	2028/2/15
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	157,964	2028/8/15
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,366	2028/10/16
第59回政府保証関西国際空港債券	0.9	500,000	508,565	2022/3/25
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	100,526	2027/1/18
第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.001	300,000	299,754	2023/3/20
第14回道路債券	1.91	100,000	104,813	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	103,865	2022/12/20
第21回道路債券	2.75	100,000	131,371	2033/6/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第28回道路債券	2.83	200,000	266,118	2033/12/20
第33回道路債券	2.91	200,000	269,884	2034/6/20
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	117,498	2028/3/17
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	156,495	2048/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	118,269	2028/6/20
第42回道路債券	2.22	100,000	110,442	2025/3/21
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	119,996	2029/4/20
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.03	100,000	101,578	2021/12/20
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	100,000	101,892	2022/3/18
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	118,246	2032/9/17
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	500,000	509,610	2023/3/20
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	102,828	2023/3/20
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	102,324	2023/9/20
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	115,129	2034/6/20
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,959	2024/12/20
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	136,918	2055/3/19
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	225,692	2035/6/20
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	619,752	2037/9/18
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	113,801	2058/3/19
第2回公営企業債券(30年)	2.39	300,000	381,705	2033/12/20
第3回公営企業債券(20年)	1.03	110,000	113,092	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	108,868	2029/1/26
第5回公営企業債券(30年)	2.72	300,000	399,126	2034/9/22
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	108,247	2024/3/22
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	133,671	2035/6/20
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	43,375	2024/3/22
第8回公営企業債券(30年)	2.5	100,000	131,557	2035/9/21
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.043	200,000	237,244	2030/6/28
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	200,000	236,584	2031/12/26
第21回地方公共団体金融機構債券(5年)	0.01	400,000	399,920	2022/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	117,369	2032/9/28
第38回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	508,700	2022/7/28
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,927	2022/11/28
第44回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	204,054	2023/1/27
第58回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,673	2024/3/28
第65回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	306,612	2024/10/28
F77回地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	108,949	2026/10/20
第88回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,748	2026/9/28
F116回地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	109,318	2027/4/23
F132回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	105,216	2025/7/30
F146回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	211,256	2025/10/28

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
F208回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	104,341	2026/2/4
F214回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	105,625	2027/4/28
第7回阪神高速道路債券	2.18	100,000	110,144	2025/3/21
第19回阪神高速道路株式会社債	0.02	100,000	100,000	2021/12/20
第22回阪神高速道路株式会社債	0.005	200,000	199,802	2023/3/20
第18回株式会社日本政策金融公庫債	2.157	100,000	121,117	2031/5/9
第81回株式会社日本政策金融公庫債	0.001	100,000	99,972	2021/11/8
第117回都市再生債券	0.804	200,000	212,890	2030/11/20
第159回都市再生債券	0.43	200,000	178,806	2059/3/19
第161回都市再生債券	0.687	100,000	98,098	2059/3/19
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	109,845	2024/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	104,378	2023/2/17
第346回東京交通債券	1.13	20,000	20,653	2023/6/20
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	0.001	100,000	99,925	2022/12/20
第1回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.13	12,945	13,340	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.08	13,434	13,977	2037/11/10
第2回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.27	13,750	14,363	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.18	216,330	216,433	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.16	152,482	152,661	2033/1/10
第4回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.29	13,623	14,167	2042/8/10
第4回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.03	14,591	15,258	2038/5/10
第4回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.08	276,201	275,742	2033/4/10
第5回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	1.76	11,864	12,077	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.26	24,558	25,299	2037/5/10
第6回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.94	14,300	14,860	2038/11/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	116,374	2027/6/18
第6回貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.06	291,057	290,003	2034/2/10
第8回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.15	12,971	13,417	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	15,129	15,913	2039/5/10
第9回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.19	12,925	13,388	2037/5/10
第10回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	15,110	15,894	2039/11/10
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	116,179	2027/12/20
第14回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.7	12,106	12,242	2032/5/10
第15回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.65	12,445	12,582	2032/5/10
第23回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.25	19,874	21,275	2044/4/10
第24回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.34	20,435	21,948	2044/5/10
第25回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.28	23,104	25,000	2044/6/10
第28回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.98	24,793	26,547	2044/9/10
第30回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.97	27,175	29,252	2044/11/10
第31回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.89	28,216	30,288	2044/12/10
第34回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.86	59,974	64,403	2045/3/10
第36回貸付債権担保宅金融公庫債券	1.88	13,179	13,634	2040/11/10
第36回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.81	28,700	30,426	2045/5/10
第39回貸付債権担保宅金融公庫債券	1.84	13,240	13,690	2041/2/10
第42回貸付債権担保宅金融公庫債券	2.34	13,043	13,621	2041/5/10

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	31,426	33,443	2046/2/10
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,243	12,640	2041/9/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	31,749	33,835	2046/3/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	29,745	31,648	2046/5/10
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,331	15,088	2041/12/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	60,800	64,381	2046/7/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,824	34,769	2046/8/10
第5回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	13,802	14,410	2042/4/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	43,219	45,705	2046/12/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	40,990	43,334	2047/1/10
第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	41,066	43,459	2047/2/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	87,658	92,452	2047/5/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	109,670	2025/12/19
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	94,810	99,200	2047/11/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	48,286	50,467	2047/12/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	48,406	51,005	2048/1/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,907	51,595	2048/2/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	42,874	45,045	2048/3/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	42,877	44,729	2048/5/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	48,352	51,043	2048/6/10
第7回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	180,336	2031/6/13
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	130,533	136,161	2048/11/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	176,092	183,672	2048/12/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	49,443	51,508	2049/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	51,116	53,288	2049/6/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	51,976	54,036	2049/8/10
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,456	2031/11/18
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	164,916	171,420	2049/10/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,382	2049/11/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	116,858	120,211	2050/1/10
第9回一般担保住宅金融支援機構債券	1.06	100,000	101,624	2021/12/20
第9回一般担保住宅金融支援機構債券	1.557	100,000	109,350	2026/12/18
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	65,841	67,949	2050/3/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	69,531	71,547	2050/5/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	68,891	71,233	2050/6/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	213,495	221,635	2050/7/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	142,638	147,931	2050/8/10
第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	70,047	72,523	2050/9/10
第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	74,650	77,370	2051/1/10
第10回8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	80,329	80,761	2051/5/10
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	1.404	100,000	108,985	2027/6/18
第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	84,682	85,350	2051/10/10
第11回4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	84,789	85,277	2051/11/10
第11回4回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	109,799	2027/9/17
第11回5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	84,869	85,727	2051/12/10
第11回6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	85,432	86,710	2052/1/10
第11回7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,903	87,060	2052/2/10

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第11回7回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	109,546	2027/9/17
第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	87,888	88,967	2052/7/10
第12回3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	88,681	89,878	2052/8/10
第12回4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,436	89,385	2052/9/10
第12回5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	88,850	89,800	2052/10/10
第12回6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	89,394	90,405	2052/11/10
第12回7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	179,914	181,562	2052/12/10
第12回8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	89,468	90,416	2053/1/10
第12回9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	180,984	183,383	2053/2/10
第13回0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	90,657	91,637	2053/3/10
第13回1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	182,278	183,958	2053/4/10
第13回3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	91,473	92,446	2053/6/10
第13回4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,300	186,836	2053/7/10
第13回5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	185,552	187,079	2053/8/10
第13回5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	132,731	2043/3/20
第13回7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	93,640	94,950	2053/10/10
第13回8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	94,239	95,761	2053/11/10
第14回0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	94,225	94,910	2054/1/10
第14回2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	191,012	191,514	2054/3/10
第14回3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	95,611	95,771	2054/4/10
第14回4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	95,873	96,175	2054/5/10
第14回5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	192,842	193,113	2054/6/10
第14回6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	97,147	96,525	2054/7/10
第14回8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	292,560	289,172	2054/9/10
第14回9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	195,718	193,420	2054/10/10
第15回3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	99,211	99,506	2055/2/10
第15回4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	99,521	99,486	2055/3/10
第16回1回一般担保住宅金融支援機構債券	0.713	100,000	104,149	2027/6/18
第16回8回一般担保住宅金融支援機構債券	0.495	100,000	102,194	2025/9/19
第16回9回一般担保住宅金融支援機構債券	0.617	200,000	207,198	2027/9/17
第19回2回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	96,561	2036/7/18
第19回4回一般担保住宅金融支援機構債券	0.075	100,000	99,745	2026/10/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	114,315	2027/3/19
第5回7回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,972	2021/11/19
第5回8回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,967	2022/2/18
第5回9回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,958	2022/6/20
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	109,907	2025/6/20
第2回1回国際協力機構債券	1.734	100,000	118,503	2033/9/20
第3回東日本高速道路株式会社社債	0.03	100,000	100,012	2021/9/17
第3回9回東日本高速道路株式会社社債	0.003	200,000	200,032	2021/12/20
第6回4回東日本高速道路株式会社社債	0.14	100,000	99,247	2029/11/29
第6回7回東日本高速道路株式会社社債	0.22	200,000	200,092	2030/1/31
第3回3回中日本高速道路株式会社社債	1.084	100,000	101,387	2021/9/17
第4回2回中日本高速道路株式会社社債	0.942	100,000	101,661	2022/3/18
第5回9回中日本高速道路株式会社社債	0.309	100,000	100,451	2021/12/20
第8回3回中日本高速道路株式会社社債	0.04	100,000	99,971	2023/4/20
第2回西日本高速道路株式会社社債	0.58	100,000	102,357	2025/9/2

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

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

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

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第1回三井住友FG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	100,892	2024/9/12
第111回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	100,000	101,401	2024/12/20
第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	300,000	302,340	2024/7/16
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,152	2026/6/19
第66回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.233	100,000	100,127	2021/9/17
第23回リコー株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,806	2021/9/24
第37回リコー株式会社無担保社債	0.02	300,000	298,416	2022/10/11
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	103,254	2026/9/18
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,719	2023/12/20
第193回オリックス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,723	2024/9/13
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.18	200,000	199,586	2023/11/27
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,765	2023/10/25
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	199,456	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,224	2028/1/18
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	99,062	2027/8/27
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,454	2023/9/4
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	199,406	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	198,292	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	96,927	2039/8/5
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,473	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	102,237	2024/9/9
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	102,570	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	104,131	2026/6/17
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	100,877	2046/9/26
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	103,343	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	97,408	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	97,535	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	99,841	2040/5/25
第511回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,876	2028/9/7
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.36	100,000	104,028	2022/2/25
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	114,222	2026/9/18
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	235,460	2028/12/12
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.06	100,000	99,298	2026/7/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	109,489	2047/7/26
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	112,454	2058/9/27
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	19,771	2022/3/25
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	116,836	2028/3/17

当 期	末			
	銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	106,198	2056/12/13
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.042	100,000	107,437	2047/8/30
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	20,836	2022/5/10
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	130,999	2039/12/16
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	126,557	2044/10/28
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	100,000	111,881	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	111,128	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	96,839	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	98,522	2070/1/31
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.878	200,000	196,448	2049/11/19
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,244	2025/9/4
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,640	2024/12/6
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	200,000	202,708	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,989	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,831	2028/11/22
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	101,729	2023/9/20
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	108,967	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	102,935	2023/12/20
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	99,799	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,283	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,525	2028/7/20
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	101,958	2023/6/20
第6回SCK株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,692	2022/7/21
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	100,000	100,702	2022/12/16
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	200,000	199,300	2028/6/6
第20回フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 円貨社債	0.16	100,000	99,346	2021/10/14

当 期	末			
	銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)
第24回フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 円貨社債	0.384	100,000	98,562	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 円貨社債	0.25	300,000	294,594	2024/10/10
第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.64	100,000	99,934	2022/1/27
第2回B・P・C・E・S・A円貨社債 (ソーシャルボンド)	0.367	100,000	99,294	2024/6/28
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	100,000	99,471	2023/7/12
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,258	2026/6/17
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,529	2024/1/26
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,478	2023/1/25
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	400,000	399,620	2021/7/9
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.202	200,000	199,688	2022/6/9
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	99,535	2024/6/7
第1回HSBC・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	0.45	100,000	99,821	2021/9/24
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク円貨社債	2.45	200,000	204,640	2021/12/28
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	398,256	2023/7/6
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,607	2023/6/2
小 計		22,366,000	22,648,161	
合 計		503,269,250	542,707,286	

## 投資信託財産の構成

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

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

## ■損益の状況

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

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

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

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

## 〈注記事項〉

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

※担保に供している資産

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

国債証券 101,532,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS 89,987,093,499円

FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用) 71,630,702,303円

DC日本債券インデックス・オープンP 68,684,918,633円

DCマイセクション50 21,921,808,610円

DCマイセクション25 20,736,719,257円

SMT 国内債券インデックス・オープン 18,108,334,758円

日本債券ファンド・シリーズ1 11,702,516,558円

分散投資コア戦略ファンドA 11,300,905,890円

分散投資コア戦略ファンドS 9,428,922,910円

DCマイセクションS50 9,381,437,203円

DCマイセクションS25 8,976,050,867円

DCマイセクション75 5,935,137,366円

グローバル・バランスファンド・シリーズ1 5,920,306,932円

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

## お知らせ

該当事項はありません。

# 国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	151,002
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	162,440
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2019年 5月29日	14,134	—	1,536.41	—	97.8	272,283
5月末	13,912	△1.6	1,512.28	△1.6	98.0	272,283
6月末	14,292	1.1	1,551.14	1.0	98.7	272,283
7月末	14,422	2.0	1,565.14	1.9	99.0	272,283
8月末	13,935	△1.4	1,511.86	△1.6	98.9	272,283
9月末	14,775	4.5	1,587.80	3.3	98.2	272,283
10月末	15,514	9.8	1,667.01	8.5	97.9	272,283
11月末	15,816	11.9	1,699.36	10.6	98.2	272,283
12月末	16,044	13.5	1,721.36	12.0	98.9	272,283
2020年 1月末	15,701	11.1	1,684.44	9.6	98.7	272,283
2月末	14,087	△0.3	1,510.87	△1.7	98.5	272,283
3月末	13,248	△6.3	1,403.04	△8.7	97.3	272,283
4月末	13,822	△2.2	1,464.03	△4.7	97.9	272,283
(当期末) 2020年 5月29日	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448

(注1) 騰落率は期首比です。

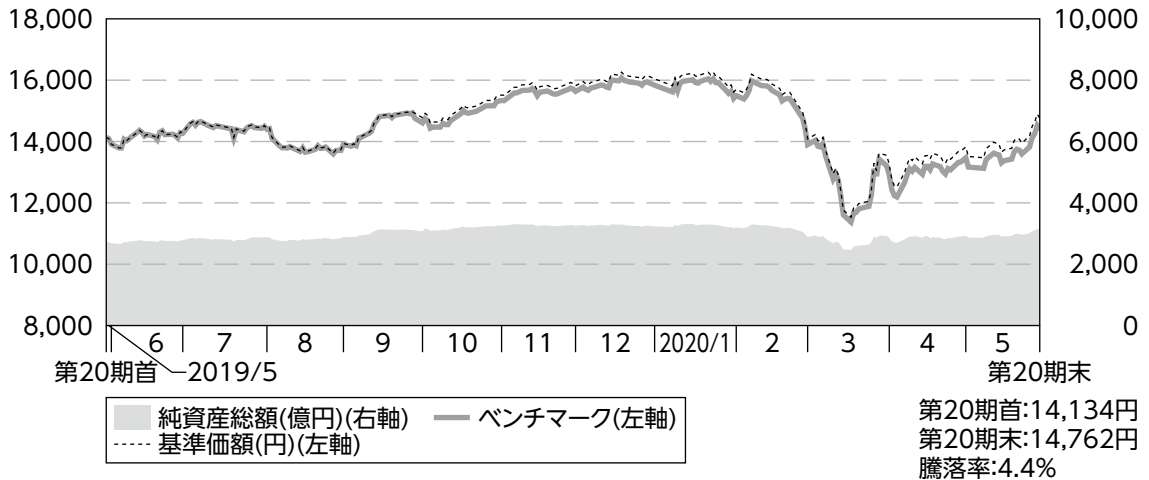
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



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

### 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

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

## 当ファンドのポートフォリオ

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

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

## 当ファンドの組入資産の内容

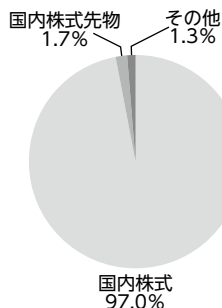
## ○上位10銘柄

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

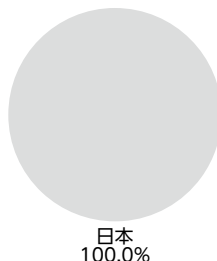
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本電信電話	日本	1.4%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	第一三共	日本	1.3%
10	任天堂	日本	1.2%
組入銘柄数		2,104	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

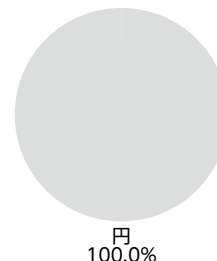
## ○資産別配分



## ○国別配分



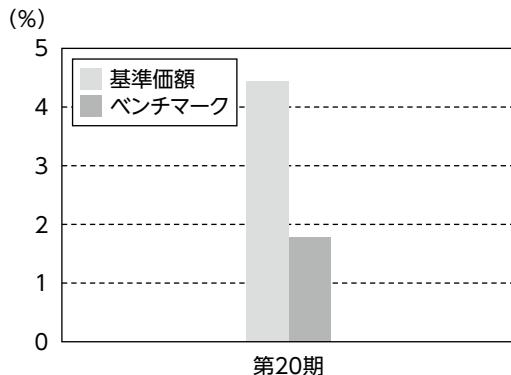
## ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

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

## 今後の運用方針

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

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日～2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (0) (-) (-) (-) (-) (0)	0.001% (0.000) (0.000) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	0  (-)  (-) (0)	0.000  (-)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## 売買および取引の状況

### <株 式>

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

### <新株予約権証券>

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

### <先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 48,977	百万円 49,910	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

## 株式売買比率

## ＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	125,812,141千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	295,160,588千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.42

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

## ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 998	百万円 998	% 100.0	百万円 276	百万円 276	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	867,507	151,128	17.4	868,693	152,069	17.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## ■ 利害関係人の発行する有価証券等

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

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

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

## 組入資産の明細

## &lt;国内株式(上場株式)&gt;

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	5.3	6.6	17,787
日本水産	164	188	93,812
マルハニチロ	23.7	27.2	63,403
カネコ種苗	5	5.7	8,128
サカタのタネ	20	22.4	82,880
ホクト	13.8	14.3	28,700
ホクリョウ	2.2	2.9	1,899
<b>鉱業(0.2%)</b>			
住石ホールディングス	35.2	38	4,332
日鉄鉱業	3.8	4.3	19,694
三井松島ホールディングス	6.9	7.3	6,336
国際石油開発帝石	658	754.3	566,403
石油資源開発	23.6	24.6	49,790
K&Oエナジーグループ	8	9.1	14,177
<b>建設業(2.6%)</b>			
ヒノキヤグループ	4.6	4.7	7,755
ショーボンドホールディングス	11.7	29.3	146,060
ミライト・ホールディングス	46.1	55.9	86,030
タマホーム	7.9	10.1	13,170
サンヨーホームズ	2.4	1.6	1,016
日本アクア	5.2	7.5	4,567
ファーストコーポレーション	5	5.7	3,060
ベステラ	3.1	3.2	3,260
TATERU	14.2	38.8	6,440
キャンディル	—	3.1	1,692
スペースバリューホールディングス	19.9	22.9	8,106
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.6	3,589
第一カッター興業	2	2.3	4,261
明豊ファシリティアークス	—	6	3,426
安藤・間	105.9	112	78,064
東急建設	48.6	55.1	32,398
コムシスホールディングス	58.2	66.7	200,100
ミサワホーム	13.6	—	—
ピーアールホールディングス	17.8	20.5	11,890
高松コンストラクショングループ	10.4	11.7	29,987
東建コーポレーション	5.1	5.8	42,862
ソネック	1.7	1.9	1,548
ヤマウラ	7	8.2	6,674
大成建設	134.8	144.8	541,552
大林組	406.3	434.2	432,897
清水建設	414.5	440.7	401,918
飛鳥建設	12	12.5	13,937

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
トルク	7.1	8.2	2,476	
阪和興業	20.6	25.5	50,643	
正栄食品工業	8.3	8.8	38,720	
カナデン	10.7	11.1	14,152	
菱電商事	9.4	9.8	13,847	
フルサト工業	6.6	7.5	10,837	
岩谷産業	26.4	30.3	115,140	
ナイス	5	5.8	4,825	
昭光通商	4.2	4.4	2,688	
ニチモウ	1.9	2.1	3,815	
極東貿易	3.7	3.9	5,772	
イワキ	14.2	17.9	8,771	
三菱石油	32	33.6	37,094	
稲畑産業	28.6	30	39,570	
G S I クレオス	3.2	3.4	3,937	
明和産業	11	12.6	6,186	
クワザワ	4.2	4.9	2,572	
ヤマエ久野	—	9.9	12,513	
ワキタ	25.4	29.1	30,031	
東邦ホールディングス	35.2	43.8	94,213	
サンゲツ	35.4	37.2	59,334	
ミツウロコグループホールディングス	15.7	20.1	24,200	
シナネンホールディングス	4.9	5.6	15,288	
伊藤忠エネクス	26.3	30.2	26,032	
サンリオ	36.7	38.3	69,169	
サンワテクノス	7.2	9.7	8,633	
リョーサン	13.1	15.1	36,844	
新光商事	11.2	21.4	19,388	
トーホー	5.4	6.2	11,742	
三信電気	8.2	7.3	12,074	
東陽テクニカ	13.7	14.6	15,271	
モスフードサービス	15.6	17.9	53,700	
加賀電子	11.8	13.6	31,756	
ソーダニッカ	12.2	14.1	7,402	
立花エレテック	8.8	10.1	17,856	
フォーバル	5.2	6	7,002	
P A L T A C	21.4	21.9	115,632	
三谷産業	13.9	18	7,038	
西本Wismettaホールディングス	2.7	2.5	4,797	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1	1.2	2,326	
国際紙パルプ商事	27.7	32.4	9,201	
ヤマタネ	6	6.8	8,384	
丸紅建材リース	1.2	1.3	2,024	
日鉄物産	8.5	9.7	36,181	
泉州電業	4	4.2	11,310	
トラスコ中山	24.8	28.4	70,545	
オートバックスセブン	47.3	50.6	66,893	
モリト	8.6	10	6,810	

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

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

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
JMホールディングス	6.1	10.4	28,558			
サツドラホールディングス	1.8	2.1	4,244			
デファクトスタンダード	0.9	—	—			
アレザホールディングス	6.6	7.1	6,184			
串カツ田中ホールディングス	—	2.9	5,109			
パロックジャパンリミテッド	9.8	9.8	6,370			
クスリのアオキホールディングス	11.8	12.2	108,580			
力の源ホールディングス	4.6	6.5	5,044			
スノーグローバルホールディングス	13.1	74.9	170,772			
L I X I L ビバ	10.2	13.5	32,575			
メディカルシステムネットワーク	12.8	13.6	6,405			
はるやまホールディングス	5.7	6.7	4,991			
ノジマ	21.2	24.3	60,968			
カッパ・クリエイト	16.7	19.1	28,917			
ライトオン	9	10.2	5,610			
良品計画	16.9	181.2	295,174			
三城ホールディングス	15	15.2	4,620			
アドヴァン	18.3	21	25,410			
アルビス	4.6	5.3	11,267			
コナカ	14.2	16.7	5,494			
ハウス オブ ローゼ	1.5	1.8	2,896			
G-7ホールディングス	3.5	8.1	19,083			
イオン北海道	12.1	18.2	14,232			
コジマ	20.6	23.9	11,878			
ヒマラヤ	4.3	5	4,105			
コーナン商事	15.7	19.5	61,327			
エコス	4.5	5.1	9,715			
ワタミ	15.7	16.3	17,147			
マルシェ	3.3	3.9	2,519			
バン・バンフィック・インター ナショナルホールディングス	71.2	299.8	650,865			
西松屋チェーン	26.2	30.1	27,812			
ゼンショーホールディングス	56.2	65.4	150,093			
幸楽苑ホールディングス	7.6	8.8	15,716			
ハークスレイ	2.6	3	3,000			
サイゼリヤ	19.7	20.3	46,568			
VTホールディングス	54	57.1	21,812			
魚力	3.4	3.9	6,165			
フジ・コーポレーション	3.2	3.7	7,429			
ユナイテッドアローズ	13.6	14.4	26,654			
ハイデイ日高	17.2	19.8	37,818			
京都きもの友禅	7.9	9.5	2,251			
コロワイド	39.6	45.3	73,023			
ピーンデポコーポレーション	16	18.4	11,592			
壱番屋	8.4	9.6	53,568			
PLANT	3.2	3.8	2,276			
スギホールディングス	26.1	27.3	190,008			
薬王堂ホールディングス	—	6	16,152			
スクロール	18.6	21.5	8,019			

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <国内新株予約権証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
千葉興業銀行第7回新株予約権	—	38,100	—	—
合 計	証 券 数・金 額	—	38,100	—
	銘柄数<比率>	—	1	<—%>

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別	当 期 末		
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)	
国内	T O P I X	5,440	—

## 投資信託財産の構成

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

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

## ■損益の状況

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

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

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

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

## 〈注記事項〉

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

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7	436.679	△8.5	97.9	0.9	212,962
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440.540	0.9	97.3	1.4	219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441.246	0.2	98.0	0.8	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454.282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481.049	5.9	97.3	2.1	276,169

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1)騰落率は期首比です。

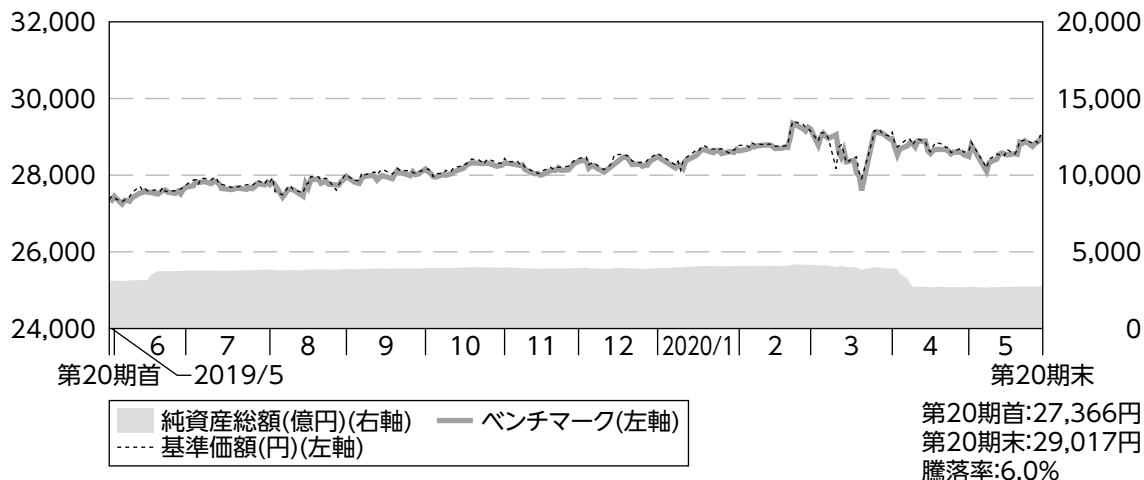
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

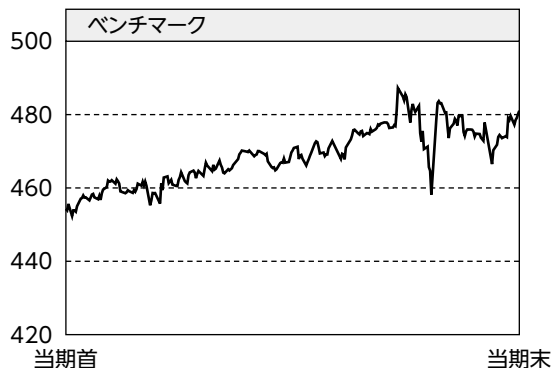


(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境



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

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

## 当ファンドのポートフォリオ

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

### (1) 債券組入比率

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

### (2) ポートフォリオ構成

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

## 当ファンドの組入資産の内容

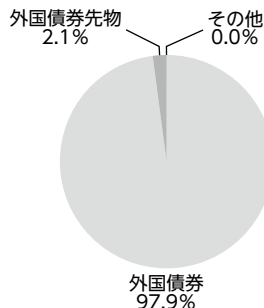
### ○上位10銘柄

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

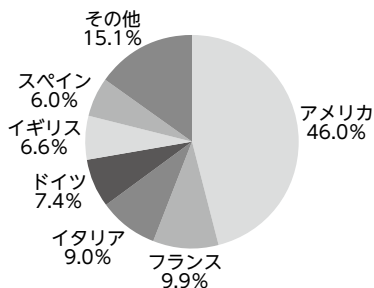
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.75% 09/15/21	アメリカ	0.5%
8	T 2.5% 05/15/46	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.5%
10	T 2.25% 08/15/49	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		718	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

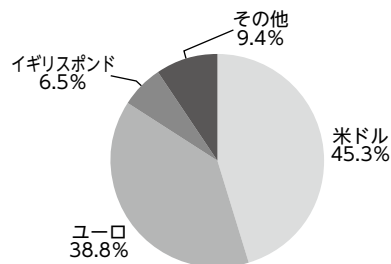
### ○資産別配分



### ○国別配分



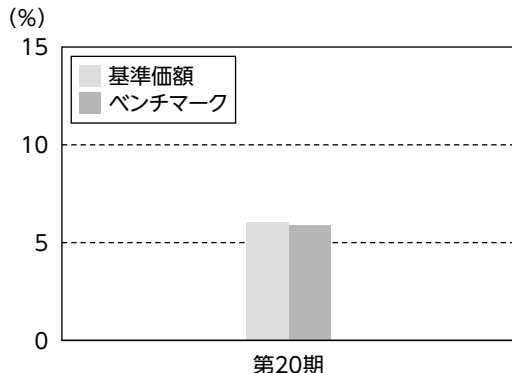
### ○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。  
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.1%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

## 今後の運用方針

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

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日~2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	6	0.022	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(6)	(0.021)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	6	0.023	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<公社債>

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

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 55,242	百万円 54,007	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>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 直 物 取 引	百万円 106,567	百万円 1,239	% 1.2	百万円 162,547	百万円 675	% 0.4
金 銭 信 託	1,095	1,095	100.0	225	225	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,101,321	199,145	18.1	1,102,823	200,295	18.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### <外国(外貨建)公社債>

#### (A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
ア メ リ カ	1,029,250	1,151,242	123,793,130	44.8	—	19.8	16.3	8.7
カ ナ ダ	58,080	67,421	5,259,580	1.9	—	0.9	0.6	0.4
メ キ シ コ	408,420	445,600	2,156,705	0.8	—	0.4	0.2	0.1
ド イ ツ	135,890	165,647	19,733,645	7.1	—	4.2	2.0	0.9
イ タ リ ア	177,870	202,782	24,157,538	8.7	—	5.1	2.5	1.1
フ ラ ン ス	187,210	224,321	26,723,420	9.7	—	6.3	2.2	1.1
オ ラ ン ダ	35,710	43,203	5,146,805	1.9	—	1.2	0.5	0.2
ス ペ イ ン	112,110	133,586	15,914,219	5.8	—	3.8	1.3	0.6
ベ ル ギ ー	45,730	56,383	6,716,910	2.4	—	1.9	0.4	0.2
オーストリア	28,080	34,170	4,070,753	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	11,650	12,896	1,536,409	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	15,080	17,098	2,036,942	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	96,200	134,378	17,809,166	6.4	—	5.2	1.0	0.3
スウェーデン	61,110	68,936	778,291	0.3	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	57,620	61,814	679,335	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	67,500	85,645	1,368,613	0.5	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	56,380	61,735	1,650,199	0.6	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	67,390	77,797	5,550,816	2.0	—	1.3	0.6	0.1
シンガポール	14,210	16,152	1,225,821	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	49,750	54,058	1,336,319	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	27,680	33,945	1,039,070	0.4	—	0.2	0.1	0.0
合 計	—	—	268,683,695	97.3	—	53.7	29.3	14.3

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 1.125% 06/30/21	1.125	9,800	9,899	1,064,537	2021/6/30
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	5,055	543,604	2021/7/31
T 1.125% 09/30/21	1.125	2,800	2,835	304,876	2021/9/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,697	505,086	2023/7/31
T 1.25% 10/31/21	1.25	10,000	10,151	1,091,618	2021/10/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	5,177	556,761	2023/6/30
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,592	278,779	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	4,151	446,434	2023/9/30
T 1.375% 10/15/22	1.375	5,000	5,140	552,771	2022/10/15
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,599	494,555	2022/1/31
T 1.5% 02/28/23	1.5	7,800	8,077	868,581	2023/2/28
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	4,146	445,913	2023/3/31
T 1.5% 08/15/22	1.5	10,000	10,291	1,106,592	2022/8/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	8,400	8,927	960,022	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,939	961,276	2024/9/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	8,648	929,989	2026/2/15
T 1.625% 04/30/23	1.625	3,500	3,643	391,835	2023/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	8,841	950,723	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	1,042	112,053	2023/5/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,579	277,414	2022/8/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	14,650	15,929	1,712,908	2029/8/15
T 1.625% 08/31/22	1.625	5,000	5,161	555,039	2022/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	5,000	5,236	563,083	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	7,300	7,824	841,419	2026/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	12,150	12,576	1,352,369	2022/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	8,780	9,416	1,012,561	2026/11/30
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,861	845,340	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,568	276,212	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,825	1,056,495	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,500	5,666	609,319	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,916	421,175	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,856	414,718	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,849	1,059,162	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	7,228	777,290	2022/6/30
T 1.75% 06/30/24	1.75	7,600	8,053	866,038	2024/6/30
T 1.75% 07/15/22	1.75	8,320	8,596	924,389	2022/7/15
T 1.75% 07/31/21	1.75	6,700	6,822	733,663	2021/7/31
T 1.75% 09/30/22	1.75	5,150	5,337	573,940	2022/9/30
T 1.75% 11/30/21	1.75	6,050	6,192	665,930	2021/11/30
T 1.875% 01/31/22	1.875	7,000	7,197	773,997	2022/1/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,574	276,800	2022/2/28
T 1.875% 03/31/22	1.875	5,500	5,670	609,792	2022/3/31
T 1.875% 04/30/22	1.875	4,450	4,594	494,041	2022/4/30
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	9,329	1,003,191	2022/7/31
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,634	605,888	2026/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,152	446,467	2022/8/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	6,399	688,149	2024/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	7,450	7,752	833,674	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,538	595,507	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,578	277,220	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	5,000	5,242	563,755	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	9,120	980,738	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	5,669	609,602	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,649	715,052	2024/4/30
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,868	416,012	2021/5/31
T 2% 05/31/24	2.0	8,000	8,549	919,280	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,883	632,698	2024/6/30
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,118	335,317	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	7,467	802,959	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	3,740	3,824	411,297	2021/8/31
T 2% 10/31/21	2.0	5,650	5,796	623,278	2021/10/31
T 2% 10/31/22	2.0	10,000	10,436	1,122,260	2022/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,464	264,987	2021/11/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	11,200	1,204,430	2026/11/15
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,090	224,754	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,263	243,404	2021/12/31
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,454	586,512	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,924	852,168	2024/3/31
T 2.125% 05/15/22	2.125	3,790	3,934	423,044	2022/5/15
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,608	280,542	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	8,600	9,452	1,016,475	2026/5/31
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,657	823,455	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	6,000	6,243	671,390	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	5,165	555,439	2024/7/31
T 2.125% 08/15/21	2.125	5,370	5,496	591,037	2021/8/15
T 2.125% 09/30/21	2.125	10,300	10,567	1,136,329	2021/9/30
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,627	927,715	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	5,680	6,052	650,828	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	3,500	3,607	387,961	2021/12/31
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,584	600,528	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,291	461,488	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	9,982	1,073,444	2027/2/15
T 2.25% 04/15/22	2.25	4,000	4,155	446,795	2022/4/15
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	7,540	810,780	2024/4/30
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	3,072	330,396	2021/7/31
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	9,590	1,031,287	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	10,790	12,684	1,363,926	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	10,200	12,139	1,305,370	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,836	735,127	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	11,021	1,185,096	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,839	520,371	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	8,603	925,108	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,821	518,418	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	8,400	9,136	982,462	2024/12/31
T 2.375% 01/31/23	2.375	5,000	5,289	568,795	2023/1/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	6,214	668,245	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	7,600	8,458	909,549	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	10,750	12,116	1,302,879	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	15,010	17,276	1,857,768	2029/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	12,500	13,589	1,461,315	2024/8/15
T 2.5% 01/15/22	2.5	6,500	6,745	725,305	2022/1/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	6,300	6,816	732,983	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	5,503	591,835	2025/1/31
T 2.5% 02/15/22	2.5	7,800	8,109	871,972	2022/2/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	4,410	5,394	580,088	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	8,100	10,439	1,122,512	2046/2/15
T 2.5% 03/31/23	2.5	4,050	4,312	463,718	2023/3/31
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	8,592	923,916	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	10,050	12,357	1,328,809	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,881	524,866	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	5,270	566,705	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	9,990	11,682	1,256,171	2029/2/15
T 2.625% 02/28/23	2.625	1,400	1,493	160,550	2023/2/28
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	8,044	865,012	2025/3/31
T 2.625% 06/15/21	2.625	10,000	10,254	1,102,686	2021/6/15
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	5,262	565,837	2023/6/30
T 2.625% 07/15/21	2.625	3,350	3,442	370,124	2021/7/15
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,797	408,301	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	6,531	702,316	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,275	352,227	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	4,000	4,660	501,157	2028/2/15
T 2.75% 04/30/23	2.75	3,600	3,865	415,667	2023/4/30
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	4,173	448,784	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	6,161	662,523	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,079	116,107	2023/7/31
T 2.75% 08/15/21	2.75	11,000	11,342	1,219,631	2021/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	3,807	409,412	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,950	6,409	689,211	2047/8/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	7,751	833,513	2025/8/31
T 2.75% 09/15/21	2.75	12,000	12,398	1,333,254	2021/9/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,120	6,649	715,048	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	5,329	573,071	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	4,550	5,900	634,434	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,493	483,145	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	8,557	920,212	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	5,150	6,672	717,533	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	7,461	802,301	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	4,296	462,045	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	6,160	662,452	2025/7/31
T 2.875% 08/15/28	2.875	8,920	10,549	1,134,365	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	9,300	12,156	1,307,147	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	5,166	555,599	2023/9/30
T 2.875% 10/15/21	2.875	7,250	7,519	808,598	2021/10/15
T 2.875% 10/31/23	2.875	5,500	5,993	644,503	2023/10/31
T 2.875% 11/15/21	2.875	8,350	8,678	933,246	2021/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,388	471,934	2023/11/30
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	6,039	649,388	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	7,000	9,569	1,029,036	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	2,138	229,969	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	4,661	501,287	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	5,710	7,715	829,662	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	7,425	798,477	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,780	514,024	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,698	612,731	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	6,050	8,037	864,223	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	2,350	3,160	339,816	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,500	4,706	506,079	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,700	6,528	702,059	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	2,490	3,369	362,340	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	10,140	1,090,394	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	2,349	252,628	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	4,510	6,328	680,535	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	7,300	10,628	1,142,865	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	1,084	116,564	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	3,487	375,010	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,898	311,685	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,922	314,239	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	5,500	8,127	874,000	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	2,145	230,735	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,384	148,885	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	3,648	392,368	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,546	166,285	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,987	321,192	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	3,079	331,119	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	1,260	1,971	211,985	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,590	2,423	260,613	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,600	2,510	269,940	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,692	289,525	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	2,380	3,839	412,893	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	1,234	132,784	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,797	193,272	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	1,250	1,743	187,473	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,800	193,618	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,896	311,511	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,674	180,005	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,236	240,447	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	2,045	219,991	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,617	173,946	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,969	211,793	2023/8/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	1,894	203,765	2021/11/15
小 計				123,793,130	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	4,030	4,046	315,653	2022/3/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	700	703	54,843	2025/9/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	2,700	2,717	211,971	2021/9/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	500	518	40,469	2027/6/1
CAN 1% 09/01/22	1.0	1,500	1,524	118,894	2022/9/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,730	1,846	144,015	2030/6/1
CAN 1.25% 11/01/21	1.25	1,840	1,906	148,709	2021/11/1
CAN 1.5% 02/01/22	1.5	1,210	1,234	96,313	2022/2/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,109	86,532	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,447	112,913	2026/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	600	628	48,993	2024/9/1
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	3,620	3,765	293,717	2023/3/1
CAN 1.75% 05/01/21	1.75	2,700	2,737	213,541	2021/5/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,465	114,360	2028/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	2,110	2,223	173,489	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	1,970	2,418	188,632	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,461	192,059	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,966	153,424	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	2,190	2,525	197,007	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	4,560	4,950	386,161	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	3,670	3,853	300,621	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,980	2,756	215,048	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	560	877	68,416	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,840	1,895	147,857	2021/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	2,140	3,266	254,844	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,850	2,874	224,208	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,580	2,590	202,074	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,706	133,133	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,600	2,597	202,630	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	1,850	2,807	219,404	2027/6/1
小 計				5,259,580	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	11,303	54,709	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	25,860	30,593	148,073	2024/12/5
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	25,630	25,781	124,780	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	26,230	26,923	130,309	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	39,660	40,226	194,696	2021/6/10
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	10,400	10,813	52,335	2023/3/9
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	30,180	31,112	150,584	2021/12/9
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	41,630	45,458	220,021	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	16,780	18,574	89,901	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,190	25,966	125,676	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	15,580	17,256	83,522	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	37,957	183,712	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	18,770	20,739	100,377	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	30,620	33,286	161,104	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	37,670	43,717	211,591	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	22,200	25,889	125,306	2038/11/18
小 計				2,156,705	
(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0% 03/11/22	-	3,100	3,135	373,549	2022/3/11
BKO 0% 06/11/21	-	2,640	2,656	316,547	2021/6/11
DBR 0% 02/15/30	-	3,570	3,719	443,103	2030/2/15
DBR 0% 08/15/26	-	4,470	4,639	552,648	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	-	2,140	2,617	311,824	2029/8/15
DBR 0% 08/15/50	-	860	853	101,630	2050/8/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	4,140	4,375	521,224	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,890	4,145	493,822	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,180	2,318	276,255	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,000	3,163	376,848	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,194	380,550	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,390	2,584	307,841	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	3,160	3,405	405,738	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,139	254,907	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	4,120	4,474	533,042	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,050	4,122	491,064	2048/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,960	3,133	373,346	2023/2/15

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,180	2,319	276,307	2023/5/15	
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,486	296,269	2024/5/15	
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,800	2,936	349,866	2022/9/4	
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,798	214,288	2024/2/15	
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,090	2,194	261,469	2022/7/4	
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,300	3,440	409,809	2022/1/4	
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	3,106	370,031	2023/8/15	
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	1,950	2,020	240,674	2021/9/4	
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,320	5,394	642,649	2044/7/4	
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	4,020	6,693	797,360	2046/8/15	
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	4,100	4,272	508,986	2021/7/4	
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,940	5,143	612,753	2042/7/4	
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	5,005	596,339	2037/1/4	
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	3,010	5,574	664,092	2039/7/4	
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,650	434,898	2028/7/4	
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	3,720	6,413	763,998	2034/7/4	
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,830	5,651	673,269	2040/7/4	
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,140	3,503	417,382	2031/1/4	
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	4,360	6,429	765,984	2028/1/4	
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	5,440	6,801	810,288	2024/1/4	
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	2,069	246,546	2030/1/4	
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,478	176,102	2027/7/4	
OBL 0% 04/05/24	—	2,900	2,973	354,177	2024/4/5	
OBL 0% 04/08/22	—	2,650	2,680	319,334	2022/4/8	
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,864	460,405	2025/4/11	
OBL 0% 04/14/23	—	2,220	2,261	269,435	2023/4/14	
OBL 0% 10/07/22	—	4,160	4,223	503,123	2022/10/7	
OBL 0% 10/08/21	—	2,600	2,621	312,253	2021/10/8	
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,543	183,899	2023/10/13	
OBL 0% 10/18/24	—	2,350	2,415	287,788	2024/10/18	
<b>(イタリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
BTPS 0.05% 01/15/23	0.05	2,030	2,011	239,633	2023/1/15	
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	566	67,543	2025/2/1	
BTPS 0.35% 11/01/21	0.35	2,580	2,584	307,897	2021/11/1	
BTPS 0.45% 06/01/21	0.45	1,400	1,404	167,291	2021/6/1	
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	2,170	2,177	259,418	2023/10/15	
BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	3,180	3,218	383,477	2022/8/1	
BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	2,000	2,027	241,477	2023/3/1	
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	2,580	2,615	311,626	2023/3/15	
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	650	619	73,767	2030/8/1	
BTPS 1% 07/15/22	1.0	2,160	2,191	261,015	2022/7/15	
BTPS 1.2% 04/01/22	1.2	2,010	2,042	243,323	2022/4/1	
BTPS 1.25% 10/12/26	1.25	1,950	1,967	234,341	2026/12/1	
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,000	993	118,390	2030/4/1	
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	2,900	2,955	352,063	2022/4/15	
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	550	521	62,149	2036/3/1	
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,359	281,122	2025/5/15	
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,050	1,076	128,213	2022/9/15	
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,467	293,964	2024/11/15	
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,478	295,239	2025/6/1	
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	3,180	3,282	391,007	2026/6/1	
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	3,036	361,702	2032/3/1	
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,600	1,663	198,186	2024/7/1	
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,000	2,087	248,714	2024/5/15	
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,817	335,604	2025/7/1	
BTPS 2% 02/01/28	2.0	1,650	1,739	207,191	2028/2/1	
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,203	262,507	2025/12/1	
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,740	1,838	219,042	2027/8/1	
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,388	403,614	2026/7/15	
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,573	306,546	2021/12/15	
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	3,680	3,923	467,891	2027/6/1	
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,390	1,459	173,903	2036/9/1	
BTPS 2.3% 10/15/21	2.3	2,700	2,776	330,787	2021/10/15	
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,500	2,717	323,787	2033/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	870	888	105,870	2050/9/1	
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,960	3,143	374,468	2023/10/1	

当		期			末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,184	379,407	2025/11/15	
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,165	377,130	2024/12/1	
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,510	2,713	323,302	2047/3/1	
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,320	1,421	169,358	2067/3/1	
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,890	2,113	251,753	2028/12/1	
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,750	3,126	372,429	2038/9/1	
BTPS 3% 08/01/29	3.0	4,960	5,648	672,855	2029/8/1	
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,644	195,906	2040/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	2,306	274,723	2046/9/1	
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,210	1,443	171,924	2035/3/1	
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,592	308,864	2048/3/1	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,694	559,305	2030/3/1	
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	3,220	3,353	399,473	2021/8/1	
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,413	287,560	2024/9/1	
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	2,590	3,387	403,577	2049/9/1	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	4,210	5,401	643,449	2037/2/1	
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	3,135	373,554	2024/3/1	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,480	295,473	2026/3/1	
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,994	475,876	2023/5/1	
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	5,790	6,555	781,004	2023/8/1	
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,950	4,173	497,227	2021/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	3,630	4,597	547,707	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,200	3,192	380,263	2044/9/1	
BTPS 5% 03/01/22	5.0	3,250	3,516	418,957	2022/3/1	
BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,400	5,241	624,474	2025/3/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,420	4,760	567,151	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,190	4,663	555,571	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,800	4,078	485,825	2039/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,959	566,987	2029/11/1	
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,250	1,393	166,031	2022/9/1	
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,450	3,871	461,175	2022/11/1	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,080	4,486	534,481	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,940	5,678	676,529	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,520	4,811	573,152	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,929	229,896	2026/11/1	
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,027	122,385	2023/11/1	
<b>(フランス)</b>						
<b>国債証券</b>						
FRTR 0% 02/25/22	—	2,000	2,018	240,512	2022/2/25	
FRTR 0% 03/25/23	—	5,290	5,376	639,776	2023/3/25	
FRTR 0% 03/25/24	—	5,950	6,065	722,574	2024/3/25	
FRTR 0% 03/25/25	—	5,090	5,196	619,053	2025/3/25	
FRTR 0% 05/25/21	—	4,100	4,120	490,894	2021/5/25	
FRTR 0% 05/25/22	—	4,050	4,094	487,781	2022/5/25	
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	5,920	630,295	2029/11/25	
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,530	4,687	558,457	2026/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,980	6,259	745,709	2025/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	5,090	5,347	637,090	2026/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	4,000	4,219	502,635	2029/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,640	6,060	721,949	2028/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,550	1,568	186,809	2052/5/25	
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	4,570	4,918	585,909	2028/11/25	
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	5,056	602,408	2027/5/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,480	5,897	702,604	2025/11/25	
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	5,110	5,843	696,134	2034/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,430	5,081	605,313	2036/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,420	6,301	750,643	2031/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,330	4,065	484,360	2050/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	4,590	4,906	584,550	2023/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	2,459	292,979	2066/5/25	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,460	4,311	513,598	2039/6/25	
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	5,810	6,394	761,788	2024/11/25	
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,460	4,651	554,886	2048/5/25	
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,554	542,585	2024/5/25	
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	5,740	6,129	730,154	2022/10/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,160	6,475	771,412	2030/5/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,700	5,749	684,986	2027/10/25	

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

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,720	4,094	487,818	2037/1/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	3,490	4,045	481,996	2023/10/31
SPGB 4.6% 07/30/25	4.65	2,840	3,526	420,145	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,640	4,410	525,374	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,843	338,699	2024/1/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,590	4,374	521,177	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,630	6,462	769,864	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,850	3,372	401,731	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,900	3,341	398,122	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,390	3,572	425,559	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,730	4,358	519,179	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	4,280	4,724	562,839	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,715	561,755	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,550	184,717	2029/1/31
<b>(ベルギー)</b>					
<b>国債証券</b>					
BGB 0% 10/22/27	—	2,310	2,338	278,529	2027/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,060	1,071	127,595	2030/6/22
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,510	1,546	184,225	2023/10/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	690	670	79,915	2040/6/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	970	1,009	120,293	2024/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,180	2,310	275,201	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,810	215,642	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,560	1,679	200,069	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,550	1,686	200,932	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,380	2,565	305,677	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,490	1,642	195,706	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	850	969	115,452	2033/4/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	530	620	73,952	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,480	1,819	216,760	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	630	798	95,127	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,280	1,602	190,943	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	940	1,424	169,705	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,450	1,574	187,518	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	680	1,005	119,733	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,440	2,747	327,251	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,424	169,684	2034/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,300	2,241	267,032	2045/6/22
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,220	1,322	157,496	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,573	187,429	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,140	3,688	439,420	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,350	2,499	297,722	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,100	2,336	278,775	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,462	174,248	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,920	4,919	586,026	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	4,022	479,239	2028/3/28
<b>(オーストリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
RAGB 0% 02/20/30	—	470	475	56,591	2030/2/20
RAGB 0% 07/15/23	—	1,500	1,524	181,657	2023/7/15
RAGB 0% 07/15/24	—	920	938	111,760	2024/7/15
RAGB 0% 09/20/22	—	320	324	38,625	2022/9/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,170	1,237	147,436	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	890	939	111,921	2027/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,620	1,742	207,547	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	560	619	73,857	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,140	2,288	272,618	2026/10/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,660	1,803	214,855	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	830	1,079	128,626	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	450	657	78,315	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,083	129,076	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,433	170,766	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	760	1,452	173,409	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,030	1,362	162,345	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,391	165,826	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	2,990	3,286	391,565	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,730	1,820	216,914	2021/9/15

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

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,820	4,442	588,772	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,030	5,013	664,426	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,140	4,883	647,220	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,090	4,027	533,810	2052/7/22	
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,820	2,953	367,367	2021/9/7	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,920	4,310	571,990	2060/1/22	
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,950	2,089	276,890	2022/3/7	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,790	4,395	582,480	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,950	2,854	378,527	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,880	3,151	417,640	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	670	880	116,670	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,270	3,880	514,304	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,180	4,101	543,585	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,890	3,738	495,496	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,310	5,048	669,046	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,770	2,775	367,851	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,460	4,481	593,920	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,900	4,270	565,917	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	3,317	439,621	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,980	2,452	324,984	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,873	248,352	2028/12/7	
UKT 8% 06/07/21	8.0	740	800	106,068	2021/6/7	
<b>小計</b>				17,809,166		
<b>(スウェーデン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,150	6,575	74,241	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,700	7,197	81,264	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,640	9,304	105,047	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	13,277	149,897	2023/11/13	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	8,370	9,517	107,456	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,900	9,231	104,228	2039/3/30	
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	12,850	13,831	156,155	2022/6/1	
<b>小計</b>				778,291		
<b>(ノルウェー)</b>						
<b>国債証券</b>						
NOB 1.375% 08/19/30	1.375	3,610	3,880	42,643	2030/8/19	
NOB 1.5% 02/19/26	1.5	4,910	5,233	57,513	2026/2/19	
NOB 1.75% 02/17/27	1.75	4,120	4,484	49,280	2027/2/17	
NOB 1.75% 03/13/25	1.75	5,190	5,554	61,039	2025/3/13	
NOB 1.75% 09/06/29	1.75	5,420	5,998	65,919	2029/9/6	
NOB 2% 04/26/28	2.0	4,900	5,473	60,154	2028/4/26	
NOB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,866	130,414	2023/5/24	
NOB 3% 03/14/24	3.0	6,830	7,542	82,887	2024/3/14	
NOB 3.75% 05/25/21	3.75	11,380	11,781	129,481	2021/5/25	
<b>小計</b>				679,335		
<b>(デンマーク)</b>						
<b>国債証券</b>						
DGB 0.25% 11/15/22	0.25	3,140	3,199	51,123	2022/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	10,730	11,425	182,576	2022/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,460	13,360	213,501	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,380	7,893	126,139	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	8,930	10,013	160,019	2025/11/15	
DGB 3% 11/15/21	3.0	8,330	8,759	139,970	2021/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,530	30,994	495,285	2039/11/15	
<b>小計</b>				1,368,613		
<b>(ポーランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	4,550	4,636	123,934	2021/7/25	
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	4,710	4,895	130,866	2022/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	4,218	112,757	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,860	6,209	165,968	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,760	4,055	108,392	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,750	5,226	139,711	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,200	3,543	94,718	2027/7/25	

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

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

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

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

## 投資信託財産の構成

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

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

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

1米ドル=107.53円

1カナダドル=78.01円

1メキシコペソ=4.84円

1ユーロ=119.13円

1イギリスポンド=132.53円

1スウェーデンクローナ=11.29円

1ノルウェークローネ=10.99円

1デンマーククローネ=15.98円

1ポーランドズロチ=26.73円

1オーストラリアドル=71.35円

1シンガポールドル=75.89円

1マレーシアリングギット=24.72円

1イスラエルシケル=30.61円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

### ■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

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

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の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割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率				
第16期(2016年5月30日)	18,911	△13.9%	516.33	△16.9%	91.4%	5.9%	2.6%	266,540
第17期(2017年5月29日)	22,222	17.5%	596.68	15.6%	95.1%	2.5%	2.5%	306,484
第18期(2018年5月29日)	24,481	10.2%	644.41	8.0%	92.8%	4.9%	2.2%	336,874
第19期(2019年5月29日)	25,011	2.2%	644.69	0.0%	95.0%	2.5%	2.7%	345,116
第20期(2020年5月29日)	25,857	3.4%	652.38	1.2%	92.9%	4.2%	2.5%	399,725

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2019年5月29日	25,011	—	644.69	—	95.0%	2.5%	2.7%
5月末	24,841	△0.7%	641.25	△0.5%	94.7%	2.6%	2.7%
6月末	25,739	2.9%	660.42	2.4%	95.7%	1.6%	2.6%
7月末	26,441	5.7%	677.74	5.1%	94.8%	2.5%	2.6%
8月末	25,126	0.5%	642.81	△0.3%	94.4%	2.8%	2.8%
9月末	25,933	3.7%	663.94	3.0%	95.6%	2.7%	2.8%
10月末	26,960	7.8%	687.28	6.6%	93.9%	3.6%	2.7%
11月末	27,963	11.8%	711.98	10.4%	94.8%	2.4%	2.7%
12月末	28,811	15.2%	732.76	13.7%	96.5%	3.0%	2.7%
2020年1月末	28,845	15.3%	730.36	13.3%	94.5%	2.7%	2.7%
2月末	26,575	6.3%	677.62	5.1%	94.1%	3.1%	2.8%
3月末	22,580	△9.7%	568.35	△11.8%	92.6%	4.8%	2.6%
4月末	24,792	△0.9%	624.92	△3.1%	93.7%	3.8%	2.5%
(当期末) 2020年5月29日	25,857	3.4%	652.38	1.2%	92.9%	4.2%	2.5%

(注1) 騰落率は期首比です。

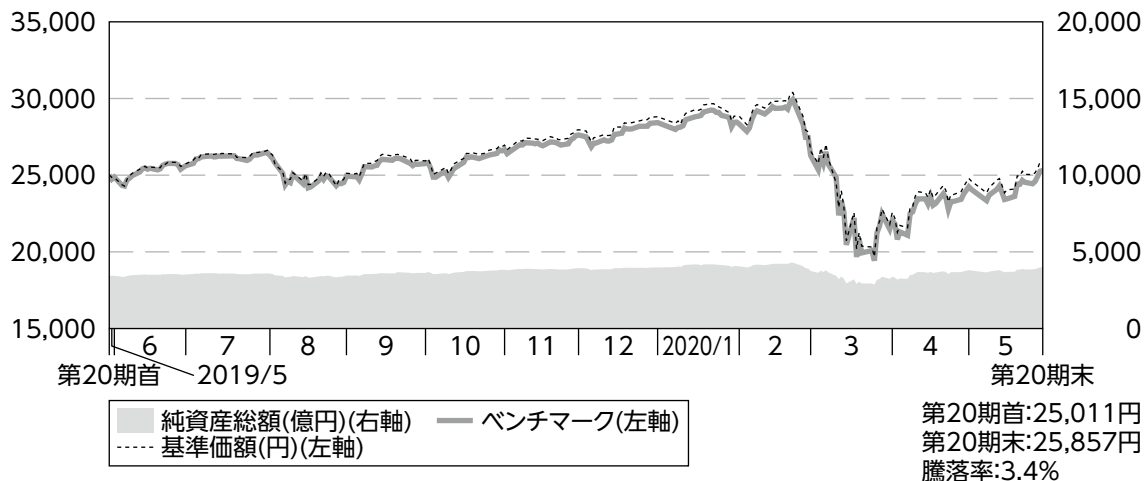
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(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。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

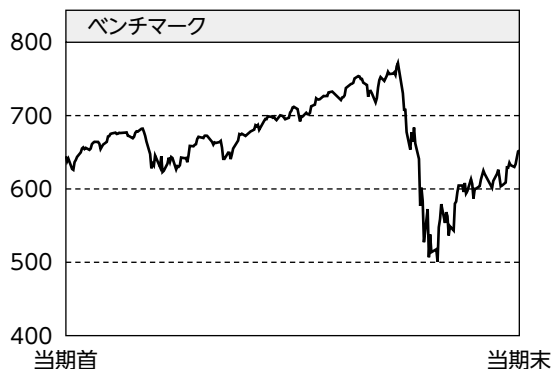


(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(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、米中通商協議の進展期待や概ね堅調な企業業績、良好な経済指標などを背景に、2020年2月中旬まで堅調に推移しました。しかしその後は、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や、OPEC(石油輸出国機構)と非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことなどを背景に、3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、各国の大型経済対策への期待や世界的な金融緩和政策、米欧各地で感染拡大ペースの鈍化を示す兆候が見られ段階的に経済活動再開を探る動きが始まったことなどを背景に急速に値を戻し、前期末の水準を上回って期末を迎えました。

## 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(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) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

### (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

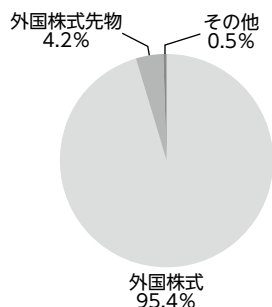
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	3.6%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.4%
3	S&P 500 EMIN 2006	アメリカ	2.9%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.6%
5	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.4%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.1%

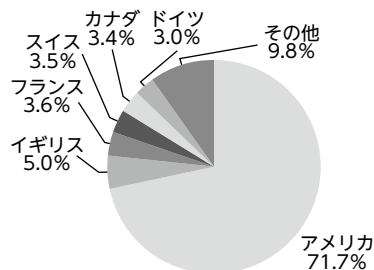
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	0.9%
10	NESTLE SA - REGISTERED	スイス	0.8%
組入銘柄数		1,325	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

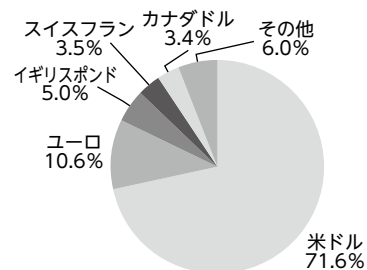
### ○資産別配分



### ○国別配分



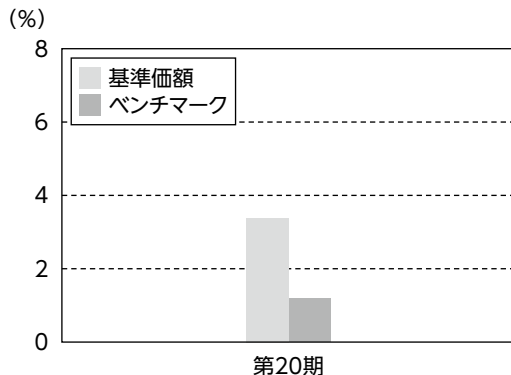
### ○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。  
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して4.2%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、配当要因\*1、為替評価差要因\*2 (いずれもプラス要因) です。

\*1 ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる差異要因です。

\*2 ファンドとベンチマークと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要因です。

## 今後の運用方針

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日~2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(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)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(1)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	1	0.005	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.005)	
(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)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	8	0.030	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(8)	(0.029)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	10	0.039	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(26,217円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 37,706 (3,446)	千米ドル 286,007 (16,739)	百株 10,496 (1,808)	千米ドル 69,891 (25,545)
	カ ナ ダ	5,121 (△224)	千カナダドル 23,619 (634)	2,863 (536)	千カナダドル 4,402 (1,333)
	ド イ ツ	2,842 (69)	千ユーロ 11,452 (△39)	439	千ユーロ 2,414
	イ タ リ ア	4,493	2,622	739	645
	フ ラ ン ス	3,001 (38)	14,213 (△11)	552	2,349
	オ ラ ン ダ	3,658	10,310	241	905
	ス ペ イ ン	5,688 (9,718)	3,704 (342)	6,061 (3,582)	808 (205)
	ベ ル ギ ー	230	1,861	33	201
	オ ー ス ト リ ア	71	166	—	—
	ル ク セ ン ブ ル ク	645	604	35	148
	フ ィ ン ラ ン ド	966 (34)	1,315 (20)	51 (34)	197 (40)
	ア イ ル ラ ン ド	138 (1)	556 (—)	—	—
	ポ ル ト ガ ル	139	165	—	—
国	イ ギ リ ス	33,773 (2,665)	千イギリスポンド 18,524 (96)	8,037 (95)	千イギリスポンド 4,249 (249)
	ス イ ス	2,175 (—)	千スイスフラン 14,489 (△215)	631	千スイスフラン 2,948
	ス ウ ェ ー デ ン	2,764 (422)	千スウェーデンクローナ 36,750 (1,131)	848 (181)	千スウェーデンクローナ 9,469 (915)
	ノ ル ウ ェ ー	438	千ノルウェークローネ 7,423	—	千ノルウェークローネ —
	デ ン マ ー ク	489	千デンマーククローネ 23,590	49	千デンマーククローネ 3,054
	オ ー ス ト ラ リ ア	9,671 (△9)	千オーストラリアドル 16,086 (△63)	1,219 (1,052)	千オーストラリアドル 3,099 (1,705)
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,474	千ニューージーランドドル 881	—	千ニューージーランドドル —
	香 港	11,307 (929)	千香港ドル 42,023 (—)	4,219	千香港ドル 13,360
	シ ン ガ ポ ー ル	5,789 (2,578)	千シンガポールドル 2,650 (404)	4,355 (1,928)	千シンガポールドル 518 (209)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外国	イスラエル	205 (48)	千イスラエルシェケル 1,793 (56)	48 (-)	千イスラエルシェケル 47 (56)

(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。

<投資信託受益証券、投資証券>

外 国		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ		千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	137	-	-
	BOSTON PROPERTIES	1	111	-	-
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20	842	-	-
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	12	105	-	-
	PROLOGIS INC	9 (11)	726 (797)	3	255
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	311	-	-
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	70	-	-
	DUKE REALTY CORP	5	145	-	-
	CROWN CASTLE INTL CORP	4	682	-	-
	ESSEX PROPERTY TRUST	0.629	135	-	-
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	4	321	-	-
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	92	-	-
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6	133	-	-
	WELLTOWER INC	6	412	-	-
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4 (△16)	231 (△797)	-	-
	IRON MOUNTAIN INC	2	70	-	-
	MACERICH CO/THE	-	-	10	270
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1 (7)	114 (-)	-	-
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.678	70	-	-
	REALTY INCOME CORP	5	415	-	-
	UDR INC	3	116	-	-
	SIMON PROPERTY GROUP	3	354	-	-
	PUBLIC STORAGE	2	443	0.782	187
	SUN COMMUNITIES INC	1	259	-	-
	VENTAS INC	3	214	-	-
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2	218	-	-
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8	1,076	-	-
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50	999	-	-
	VEREIT INC	28	270	-	-
	AMERICAN TOWER CORPORATION	5	1,114	-	-
	WP CAREY INC	3	253	-	-

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	INVITATION HOMES INC	27	733	—	—
	EQUINIX INC	1	704	—	—
	VICI PROPERTIES INC	44	1,025	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1	351	—	—
	小 計	278 (1)	13,267 (—)	13	712
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	446	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	— (12)	— (261)	—	—
	小 計	8 (12)	446 (261)	—	—
	フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	COVIVIO (FP)	1	89	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2	236	1	149
	小 計	4	325	1	149
	ユ ー ロ 計	4	325	1	149
	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	SEGRO PLC	24	194	20	153
	小 計	24	194	20	153
	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	MIRVAC GROUP	86	263	—	—
	APA GROUP	24	264	—	—
	GPT GROUP	31	199	—	—
	GOODMAN GROUP	22	258	—	—
	LENLEASE GROUP	11	119	—	—
	小 計	177	1,105	—	—
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	19	1,306	—	—
	小 計	19	1,306	—	—
	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	44 (31)	129 (88)	— (—)	— (8)
	SUNTEC REIT	— (—)	— (△1)	—	—
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220 (—)	534 (△0.066)	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	— (31)	— (8)	— (31)	— (8)
	小 計	264 (63)	664 (94)	— (31)	— (16)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 124,324	百万円 117,556	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

<株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	55,575,383千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	351,538,499千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.15

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 84,605	百万円 67	% 0.1	百万円 49,908	百万円 12	% 0.0
金 銭 信 託	237	237	100.0	97	97	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	194,147	29,137	15.0	193,796	29,195	15.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当期末(前期末)	当 期		末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)				千米ドル		
ABBOTT LABORATORIES	1,487	1,686	15,534	1,670,435	ヘルスケア機器・サービス	
AES CORP	526	617	796	85,604	公益事業	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	767	844	10,520	1,131,260	ソフトウェア・サービス	
CHUBB LTD	386	432	5,350	575,321	保険	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	190	210	5,063	544,470	素材	
ALLEGHANY CORP	12	12	674	72,488	保険	
RALPH LAUREN CORPORATION	45	45	366	39,371	耐久消費財・アパレル	
ALLSTATE CORP	301	309	3,039	326,824	保険	
HONEYWELL INTL INC	624	694	10,241	1,101,273	資本財	
HESS CORP	220	248	1,203	129,406	エネルギー	
AMERICAN EXPRESS	611	663	6,508	699,831	各種金融	
AMERICAN ELECTRIC POWER	414	471	4,012	431,460	公益事業	
AFLAC	652	686	2,512	270,207	保険	
AMERICAN INT'L GROUP	769	831	2,587	278,180	保険	
ANADARKO PETROLEUM CORP	443	—	—	—	エネルギー	
JONES LANG LASALLE INC	36	44	467	50,241	不動産	
VALERO ENERGY CORP	353	392	2,634	283,304	エネルギー	
APACHE CORP	342	642	762	82,036	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	86	101	772	83,117	素材	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	477	521	2,035	218,863	食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	94	107	827	89,016	公益事業	
AMEREN CORPORATION	210	231	1,709	183,821	公益事業	
ARROW ELECTRONICS INC	66	78	531	57,184	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AUTOLIV INC	66	101	650	69,906	自動車・自動車部品	
AUTOZONE INC	20	22	2,622	281,959	小売	
AVERY DENNISON CORP	74	74	836	89,959	素材	
BALL CORP	271	291	2,055	221,017	素材	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,096	1,258	23,296	2,505,112	各種金融	
BANK NEW YORK CO	716	792	2,978	320,324	各種金融	
BAXTER INTERNATIONAL	440	462	4,083	439,049	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	225	258	6,231	670,117	ヘルスケア機器・サービス	
AMETEK INC	190	222	2,044	219,797	資本財	
VERIZON COMMUNICATIONS	3,497	3,944	21,977	2,363,189	電気通信サービス	
WR BERKLEY CORP	139	140	818	88,041	保険	
BEST BUY COMPANY INC	218	227	1,736	186,724	小売	
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	21	1,021	109,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YUM BRANDS INC	273	291	2,649	284,925	消費者サービス	
FIRSTENERGY CORP	432	505	2,158	232,088	公益事業	
BLOCK H & R INC	169	—	—	—	消費者サービス	
BOEING CO	456	519	7,781	836,777	資本財	
ROBERT HALF INTL INC	95	95	491	52,902	商業・専門サービス	
BORGWARNER INC	159	198	638	68,654	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,162	1,330	4,984	535,961	ヘルスケア機器・サービス	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	22	1,791	192,652	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,403	2,235	13,372	1,437,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	44	—	—	—	各種金融	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ONEOK INC	340	369	1,377	148,150	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	70	70	446	48,006	保険
UNITED RENTALS INC	64	64	887	95,389	資本財
SEMPRA ENERGY	232	269	3,428	368,674	公益事業
FEDEX CORP	216	241	3,160	339,871	運輸
AMPHENOL CORPORATION	262	276	2,639	283,792	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	220	290	1,914	205,852	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	358	358	693	74,537	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	140	158	785	84,500	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	140	159	2,806	301,822	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	252	279	1,520	163,512	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	496	536	6,482	697,092	資本財
CENTURYLINK INC	833	939	955	102,754	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,767	3,001	29,969	3,222,586	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	212	234	1,736	186,729	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	327	356	7,146	768,421	ヘルスケア機器・サービス
CLOROX COMPANY	109	119	2,457	264,207	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,420	3,881	18,279	1,965,629	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	710	776	5,600	602,232	家庭用品・パーソナル用品
AON PLC	201	—	—	—	保険
COMERICA INC	143	143	539	58,028	銀行
NRG ENERGY INC	267	230	840	90,428	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	399	459	1,559	167,702	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	274	317	2,322	249,700	公益事業
CMS ENERGY CORP	245	267	1,549	166,581	公益事業
THE COOPER COS INC	41	46	1,484	159,613	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	662	723	1,668	179,445	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	146	146	472	50,796	素材
HEICO CORP-CLASS A	64	64	571	61,489	資本財
CUMMINS INC	125	136	2,317	249,251	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	69	—	—	—	資本財
DR HORTON INC	289	321	1,798	193,412	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	542	597	9,789	1,052,665	ヘルスケア機器・サービス
MOODY'S CORP	150	162	4,294	461,829	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	418	484	5,735	616,719	小売
DEERE&CO	263	290	4,452	478,778	資本財
MORGAN STANLEY	1,081	1,158	5,144	553,154	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	184	217	1,845	198,465	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,521	1,719	20,069	2,158,054	メディア・娯楽
DOVER CORP	120	138	1,346	144,735	資本財
OMNICOM GROUP	190	208	1,149	123,602	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	156	183	1,978	212,745	公益事業
DUKE ENERGY CORP	598	699	6,001	645,312	公益事業
FLOWSERVE CORP	108	108	290	31,221	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	100	112	895	96,308	消費者サービス
BANK OF AMERICA CORP	7,894	8,211	20,414	2,195,156	銀行
CITIGROUP	1,974	2,082	10,238	1,100,941	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	118	118	811	87,279	素材
EATON CORP	376	401	3,421	367,900	資本財
EATON VANCE CORP	100	100	381	41,013	各種金融
ECOLAB INC	217	247	5,234	562,889	素材

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PERKINELMER INC	94	106	1,057	113,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SALESFORCE.COM INC	645	794	14,391	1,547,554	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	534	592	3,614	388,673	資本財
ATMOS ENERGY CORP	93	114	1,161	124,851	公益事業
ENTERGY CORP	156	186	1,926	207,209	公益事業
EOG RESOURCES INC	498	555	2,869	308,538	エネルギー
EQUIFAX INC	107	117	1,815	195,254	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER CO-CL A	189	212	4,089	439,695	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	3,587	4,035	18,175	1,954,381	エネルギー
FMC CORP	121	121	1,183	127,242	素材
NEXTERA ENERGY INC	409	466	11,718	1,260,133	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	32	36	1,100	118,368	各種金融
ASSURANT INC	47	58	602	64,755	保険
M & T BANK CORP	117	117	1,280	137,713	銀行
MACY'S INC	259	—	—	—	小売
FRANKLIN RESOURCES INC	260	260	492	53,010	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	1,124	1,389	1,262	135,793	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	149	178	1,676	180,252	保険
GAP	218	218	209	22,574	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	210	239	3,549	381,710	資本財
GENERAL MILLS INC	502	576	3,571	384,079	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	127	139	1,175	126,350	小売
GARTNER INC	81	85	1,043	112,183	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	166	154	2,422	260,479	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	7,457	8,485	5,753	618,620	資本財
GRAINGER (WW) INC	39	44	1,379	148,325	資本財
HALLIBURTON CO	766	976	1,182	127,119	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	281	304	6,119	658,008	各種金融
HARLEY-DAVIDSON	146	146	344	37,009	自動車・自動車部品
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	97	214	4,226	454,501	資本財
HEICO CORP	36	36	378	40,675	資本財
HELMERICH & PAYNE	83	—	—	—	エネルギー
HERSHEY FOODS CORPORATION	125	138	1,889	203,186	食品・飲料・タバコ
HP INC	1,340	1,415	2,124	228,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	103	129	863	92,874	素材
JUNIPER NETWORKS INC	313	313	742	79,844	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP	141	141	444	47,747	エネルギー
UNUM GROUP	185	185	295	31,796	保険
HOME DEPOT	955	1,046	25,664	2,759,723	小売
HORMEL FOODS CORP	234	271	1,300	139,818	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	427	481	867	93,323	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	28	28	618	66,496	資本財
HUMANA INC	119	126	5,104	548,850	ヘルスケア機器・サービス
RED HAT INC	150	—	—	—	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	69	69	1,089	117,106	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	280	312	5,400	580,715	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	86	97	1,303	140,210	素材
INT'L PAPER CO	338	338	1,186	127,546	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	338	338	590	63,449	メディア・娯楽
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	120	120	1,013	109,000	資本財
JOHNSON & JOHNSON	2,277	2,512	36,927	3,970,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価 額		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	317	344	1,352	145,454	保険
DEVON ENERGY CORPORATION	378	378	441	47,470	エネルギー
KELLOGG CO	210	240	1,576	169,477	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	870	943	1,140	122,622	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	294	327	4,606	495,312	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	99	145	7,809	839,803	各種金融
KOHL'S CORP	146	146	294	31,684	小売
KROGER CO	681	765	2,454	263,895	食品・生活必需品小売り
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	35	1,295	139,264	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	88	88	904	97,219	素材
LEGGETT & PLATT INC	105	105	340	36,613	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	235	285	1,718	184,749	耐久消費財・アパレル
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	257	257	383	41,241	各種金融
LILLY (ELI) & CO	755	824	12,416	1,335,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
L BRANDS INC	194	—	—	—	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	177	177	699	75,198	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	595	680	6,788	730,014	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	273	295	2,562	275,551	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	220	246	9,825	1,056,496	資本財
LOEWS CORP	220	257	868	93,377	保険
CARNIVAL CORPORATION	351	461	734	79,011	消費者サービス
LOWES COMPANIES	679	733	9,401	1,010,951	小売
DOMINION ENERGY INC	681	785	6,573	706,844	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	446	586	1,010	108,674	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	99	118	2,036	219,038	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	651	720	13,598	1,462,294	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	217	233	7,434	799,388	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	33	39	802	86,336	保険
MANPOWER GROUP	51	51	387	41,618	商業・専門サービス
MARKEL CORP	11	13	1,220	131,288	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	178	199	4,422	475,534	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	425	481	5,134	552,071	保険
MASCO CORP	245	276	1,297	139,476	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	49	59	1,180	126,987	素材
METLIFE INC	715	746	2,722	292,735	保険
MEDTRONIC PLC	1,136	1,278	12,547	1,349,189	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP	1,110	1,241	8,261	888,308	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	2,205	2,428	19,191	2,063,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	88	88	1,550	166,730	ヘルスケア機器・サービス
3 M COMPANY	491	558	8,760	941,992	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	50	50	471	50,708	耐久消費財・アパレル
MOTOROLA SOLUTIONS INC	139	163	2,223	239,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	87	96	1,469	157,966	運輸
FORD MOTOR COMPANY	3,155	3,751	2,194	235,986	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC	303	371	480	51,668	エネルギー
NEWMONT CORPORATION	694	782	4,594	494,089	素材
NVR INC	2	3	1,085	116,699	耐久消費財・アパレル
NIKE B	1,073	1,192	11,738	1,262,262	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	382	—	—	—	エネルギー
NORDSTROM INC	100	100	182	19,667	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	228	253	4,568	491,232	運輸

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
EVERSOURCE ENERGY	281	309	2,501	268,945	公益事業
NISOURCE INC	323	357	859	92,417	公益事業
TAPESTRY INC	259	259	363	39,096	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	142	155	5,331	573,333	資本財
WELLS FARGO & CO	3,634	3,867	10,526	1,131,916	銀行
NUCOR CORP	278	290	1,234	132,755	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	395	444	3,049	327,925	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	644	854	1,165	125,346	エネルギー
OGE ENERGY CORP	156	192	613	65,925	公益事業
ORACLE CORP	2,107	2,191	11,751	1,263,675	ソフトウェア・サービス
EXELON CORP	809	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	113	125	2,236	240,452	資本財
PPL CORPORATION	596	691	1,896	203,920	公益事業
PENTAIR PLC	135	135	534	57,430	資本財
PERRIGO CO PLC	113	113	623	67,061	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	4,674	5,277	20,151	2,166,859	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	208	895	96,264	公益事業
CONOCOPHILLIPS	968	1,047	4,504	484,399	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES	144	158	1,466	157,660	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,584	1,782	6,916	743,779	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	391	418	4,843	520,778	銀行
BROWN & BROWN INC	—	229	923	99,307	保険
POLARIS INC	46	46	416	44,807	耐久消費財・アパレル
FLUOR CORP	112	—	—	—	資本財
PPG INDUSTRIES INC	199	221	2,270	244,113	素材
QUEST DIAGNOSTICS	122	128	1,522	163,703	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,109	2,378	27,601	2,967,977	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	486	557	4,273	459,503	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	445	472	2,413	259,492	公益事業
PULTE GROUP INC	219	219	755	81,250	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	139	286	5,104	548,893	ソフトウェア・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	118	119	846	90,972	各種金融
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	32	51	865	93,118	保険
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	54	54	504	54,270	保険
RESMED INC	123	134	2,142	230,398	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,291	1,415	5,169	555,898	銀行
ROLLINS INC	105	145	583	62,776	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	87	101	3,861	415,235	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	105	112	2,433	261,642	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	138	152	790	85,007	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	—	124	922	99,242	素材
RAYTHEON COMPANY	246	—	—	—	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	40	40	196	21,160	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	538	605	12,216	1,313,668	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	220	240	2,587	278,226	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	272	586	8,113	872,425	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	1,190	1,322	2,485	267,229	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,018	1,101	3,966	426,517	各種金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	173	196	2,515	270,465	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	117	136	528	56,868	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	218	241	7,049	758,085	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMERISOURCEBERGEN CORP	128	146	1,378	148,242	ヘルスケア機器・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	72	79	4,678	503,109	素材
CENTENE CORP	359	557	3,728	400,965	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A. O.) CORP	121	121	565	60,849	資本財
ACUITY BRANDS INC	35	35	311	33,490	資本財
SNAP-ON INC	49	49	655	70,472	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	352	376	2,331	250,666	保険
ADVANCE AUTO PARTS	61	61	856	92,087	小売
EDISON INTL	289	336	1,950	209,705	公益事業
SOUTHERN CO	885	1,000	5,695	612,387	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	641	1,280	4,883	525,172	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	203	233	2,104	226,329	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	114	114	373	40,128	運輸
AT&T INC	6,160	6,966	21,638	2,326,812	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,617	1,803	16,388	1,762,206	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	132	147	1,871	201,274	資本財
STATE STREET CORP	323	347	2,169	233,338	各種金融
STRYKER CORP	290	321	6,281	675,426	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS	383	—	—	—	銀行
SYSCO CORP	428	454	2,542	273,362	食品・生活必需品小売り
TELEFLEX INC	36	44	1,586	170,558	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	806	1,084	1,401	150,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON	218	215	667	71,828	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	345	382	13,109	1,409,623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	93	104	1,332	143,299	小売
GLOBE LIFE INC	84	98	760	81,781	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	142	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	118	90	719	77,387	ヘルスケア機器・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	37	1,375	147,905	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	243	282	1,767	190,101	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	139	180	581	62,487	公益事業
MARATHON OIL CORP	745	745	424	45,685	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	621	674	11,497	1,236,325	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	701	1,470	9,889	1,063,374	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	816	903	27,464	2,953,268	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	72	72	777	83,588	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	82	82	1,021	109,874	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	287	324	1,910	205,397	耐久消費財・アパレル
VIACOMCBS INC-CLASS B	286	—	—	—	メディア・娯楽
VULCAN MATERIALS CO	107	126	1,396	150,214	素材
WALMART INC	1,227	1,356	16,776	1,803,984	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	367	412	4,391	472,198	商業・専門サービス
WATERS CORP	65	63	1,259	135,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	293	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	70	1,458	156,831	ヘルスケア機器・サービス
JM SMUCKER CO	94	108	1,203	129,465	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	35	35	713	76,681	消費者サービス
WABTEC CORP	111	177	1,092	117,436	資本財
WEYERHAEUSER CO	621	696	1,492	160,474	不動産
WHIRLPOOL CORP	53	60	739	79,532	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS	1,051	1,142	2,279	245,137	エネルギー

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WEC ENERGY GROUP INC	279	301	2,679	288,156	公益事業
CARMAX INC	142	157	1,399	150,445	小売
XEROX CORP	167	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIMAREX ENERGY CO	75	—	—	—	エネルギー
TJX COMPANIES INC	1,068	1,155	6,247	671,832	小売
CBRE GROUP INC-A	268	302	1,332	143,313	不動産
WELLCARE HEALTH PLANS INC	44	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
REGIONS FINL CORP	838	924	1,062	114,303	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	34	37	1,360	146,263	消費者サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	34	34	164	17,721	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	323	331	1,607	172,801	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	319	319	389	41,862	素材
CELANESE CORP-SERIES A	110	110	1,020	109,748	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	151	182	698	75,065	食品・飲料・タバコ
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	210	190	557	59,962	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	118	118	1,702	183,030	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	495	531	5,041	542,121	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	159	159	144	15,521	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT	126	126	619	66,597	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	20	25	2,564	275,744	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	40	46	2,023	217,564	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	777	856	25,880	2,782,963	ソフトウェア・サービス
HANESBRANDS INC	311	311	317	34,183	耐久消費財・アパレル
WESTERN UNION CO	387	387	789	84,934	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	79	104	547	58,903	資本財
LEIDOS HOLDINGS	109	128	1,338	143,964	ソフトウェア・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	113	113	367	39,509	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	84	84	194	20,911	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	96	109	1,308	140,692	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	150	150	387	41,650	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	76	100	10,854	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	295	290	1,438	154,680	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	284	319	2,645	284,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	174	192	1,057	113,693	エネルギー
WABCO HOLDINGS INC	38	49	679	73,088	資本財
VMWARE INC-CLASS A	67	78	1,120	120,495	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	309	309	251	27,050	各種金融
MSCI INC	79	79	2,552	274,424	各種金融
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,331	1,484	10,909	1,173,071	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,490	1,633	31,728	3,411,764	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	161	169	2,093	225,123	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	577	620	2,184	234,907	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	128	128	783	84,204	資本財
KINDER MORGAN INC	1,672	1,946	3,059	329,020	エネルギー
XYLEM INC	160	175	1,195	128,591	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	251	255	1,643	176,675	素材
PVH CORP	72	72	359	38,647	耐久消費財・アパレル
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	35	706	76,001	資本財
EPAM SYSTEMS INC	46	52	1,201	129,145	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	229	259	2,845	305,924	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	72	80	1,992	214,250	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	141	158	1,728	185,827	銀行
CIT GROUP INC	107	—	—	—	銀行
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	134	1,058	113,778	ソフトウェア・サービス
TARGA RESOURCES CORP	200	200	366	39,402	エネルギー
LEAR CORP	52	52	569	61,188	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	223	245	4,523	486,420	小売
GENERAL MOTORS CO	1,063	1,209	3,226	346,924	自動車・自動車部品
WORLDPAY INC-CLASS A	257	—	—	—	ソフトウェア・サービス
XPO LOGISTICS INC	100	80	628	67,580	運輸
ALLY FINANCIAL INC	360	360	661	71,167	各種金融
CAPRI HOLDINGS LTD	115	115	189	20,325	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	232	244	1,801	193,676	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	381	424	3,334	358,522	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	79	799	85,962	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	58	58	490	52,723	食品・飲料・タバコ
IQVIA HOLDINGS INC	142	157	2,304	247,792	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SERVICENOW INC	149	179	6,802	731,514	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	80	93	2,147	230,950	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	67	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,272	1,681	15,141	1,628,167	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC	417	454	6,276	674,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	178	178	286	30,824	消費者サービス
COTY INC-CL A	305	305	127	13,757	家庭用品・パーソナル用品
SPRINT CORP	648	—	—	—	電気通信サービス
IHS MARKIT LTD	—	356	2,465	265,092	商業・専門サービス
HOWMET AEROSPACE INC	365	365	485	52,193	資本財
TWILIO INC - A	80	112	2,159	232,197	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	579	673	1,228	132,137	メディア・娯楽
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	162	162	132	14,217	耐久消費財・アパレル
BLACK KNIGHT INC	—	144	1,084	116,640	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	444	576	944	101,592	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	129	129	770	82,854	食品・飲料・タバコ
ALTICE USA INC- A	124	124	314	33,768	メディア・娯楽
TECHNIPFC PLC	360	550	422	45,424	エネルギー
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	70	1,829	196,731	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	107	107	439	47,242	運輸
BURLINGTON STORES INC	60	60	1,281	137,786	小売
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	236	360	770	82,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	102	123	2,516	270,627	ヘルスケア機器・サービス
TWITTER INC	613	704	2,227	239,500	メディア・娯楽
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	138	508	54,703	資本財
EVERGY INC	213	213	1,329	142,915	公益事業
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	98	—	—	—	エネルギー
ALLEGION PLC	74	89	895	96,292	資本財
STERIS PLC	72	81	1,320	141,998	ヘルスケア機器・サービス
KKR & CO INC	448	474	1,340	144,099	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	235	256	2,068	222,465	消費者サービス
ARAMARK	199	240	644	69,261	消費者サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	138	155	709	76,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOW INC	657	708	2,741	294,845	素材
AMCOR PLC	—	1,534	1,534	165,013	素材

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PINTEREST INC- CLASS A	—	321	637	68,535	メディア・娯楽	
XEROX HOLDINGS CORP	—	167	281	30,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KONTOOR BRANDS INC	41	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CARRIER GLOBAL CORP	—	755	1,480	159,230	資本財	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	377	1,925	206,996	資本財	
UBER TECHNOLOGIES INC	157	384	1,313	141,190	運輸	
CORTEVA INC	—	701	1,894	203,678	素材	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	629	3,567	383,581	各種金融	
VOYA FINANCIAL INC	140	125	570	61,303	各種金融	
GRUBHUB INC	82	82	436	46,929	小売	
INGERSOLL-RAND INC	—	315	907	97,573	資本財	
PAYCOM SOFTWARE INC	42	47	1,365	146,851	ソフトウェア・サービス	
AON PLC	—	223	4,440	477,489	保険	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	204	—	—	—	エネルギー	
ARISTA NETWORKS INC	43	49	1,101	118,414	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FNF GROUP	249	249	755	81,219	保険	
SYNCHRONY FINANCIAL	530	530	1,127	121,265	各種金融	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	400	400	986	106,094	銀行	
WAYFAIR INC- CLASS A	53	—	—	—	小売	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	158	176	1,826	196,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	152	—	—	—	電気通信サービス	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	176	176	410	44,148	素材	
GODADDY INC - CLASS A	149	163	1,250	134,504	ソフトウェア・サービス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	275	348	509	54,748	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	693	750	2,366	254,434	資本財	
TRANSUNION	153	169	1,448	155,780	商業・専門サービス	
SQUARE INC - A	279	331	2,642	284,123	ソフトウェア・サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,932	707	3,572	384,202	素材	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	170	226	890	95,775	食品・飲料・タバコ	
WESTROCK CO	212	247	714	76,784	素材	
FORTIVE CORP	258	285	1,754	188,615	資本財	
WASTE CONNECTIONS INC	230	246	2,319	249,448	商業・専門サービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,297	1,237	1,187	127,642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EQUITABLE HOLDINGS INC	226	402	790	84,972	各種金融	
FIRST DATA CORP- CLASS A	476	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	234	234	389	41,868	ソフトウェア・サービス	
CHEMOURS CO/THE	154	—	—	—	素材	
LINDE PLC	472	512	10,250	1,102,252	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	133	133	391	42,137	保険	
VISTRA ENERGY CORP	295	350	730	78,514	公益事業	
CHENIERE ENERGY INC	184	219	973	104,637	エネルギー	
AMAZON.COM	355	403	96,797	10,408,683	小売	
ABIOMED INC	35	44	960	103,330	ヘルスケア機器・サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	784	1,009	5,223	561,717	半導体・半導体製造装置	
ADOBE INC	412	461	17,536	1,885,726	ソフトウェア・サービス	
AMGEN	539	566	12,702	1,365,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMERCO	6	6	198	21,396	運輸	
ANALOG DEVICES	322	351	3,901	419,524	半導体・半導体製造装置	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	190	207	2,371	255,004	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COMCAST CORP-CL A	3,839	4,329	17,124	1,841,399	メディア・娯楽	
ANSYS INC	68	80	2,212	237,953	ソフトウェア・サービス	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
APPLE INC	4,025	4,242	135,029	14,519,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	807	881	4,820	518,310	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	182	209	4,247	456,780	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	367	412	5,978	642,852	ソフトウェア・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	114	131	1,066	114,650	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	95	107	1,441	154,992	メディア・娯楽
VERISIGN INC	95	100	2,148	230,998	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,295	1,484	843	90,670	メディア・娯楽
CSX CORP	685	717	5,115	550,050	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	228	228	1,172	126,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	108	119	1,291	138,876	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	594	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	113	124	1,756	188,911	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	257	300	2,126	228,688	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	124	148	899	96,725	保険
CINTAS CORP	79	82	2,082	223,901	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	3,746	4,045	18,447	1,983,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COPART INC	175	197	1,763	189,591	商業・専門サービス
COGNEX CORP	162	162	1,023	110,018	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARRIOTT INTL A	250	265	2,437	262,098	消費者サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	483	522	2,808	301,975	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	30	35	2,306	247,988	商業・専門サービス
DOLLAR TREE INC	196	226	2,211	237,818	小売
EBAY	786	739	3,269	351,586	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	211	211	963	103,613	各種金融
CADENCE DESIGN SYSTEMS	252	263	2,322	249,690	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	182	241	751	80,825	メディア・娯楽
ELECTRONIC ARTS INC	268	278	3,382	363,747	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	378	40,649	保険
EXPEDITORS INTL WASH INC	138	158	1,200	129,097	運輸
FASTENAL CO	469	558	2,253	242,317	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	582	679	1,367	147,063	銀行
FISERV INC	337	551	5,856	629,702	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	116	116	524	56,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	404	489	486	52,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	178	201	948	102,006	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,113	1,206	9,089	977,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP	489	554	18,824	2,024,235	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	106	124	915	98,486	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	124	140	866	93,142	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	53	53	761	81,834	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	244	244	1,279	137,605	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	161	171	1,813	194,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	71	83	988	106,343	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	856	990	901	96,938	銀行
NEKTAR THERAPEUTICS	135	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	172	172	5,174	556,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	221	248	7,050	758,138	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	72	81	2,508	269,764	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	112	128	723	77,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	3,864	4,148	25,595	2,752,337	半導体・半導体製造装置

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	価 額		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	72	73	1,309	140,762	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	161	175	1,760	189,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP	138	150	2,632	283,045	半導体・半導体製造装置
EAST WEST BANCORP INC	138	138	504	54,239	銀行
LAM RESEARCH CORP	128	138	3,695	397,372	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	141	154	1,589	170,935	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	246	258	1,462	157,276	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC	613	733	5,148	553,591	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	359	359	578	62,162	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	6,186	6,920	125,541	13,499,477	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	952	1,056	4,909	527,914	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	43	43	306	32,904	資本財
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	207	228	2,180	234,415	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	547	605	1,815	195,239	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	426	494	853	91,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	127	140	5,233	562,780	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	449	500	3,204	344,597	公益事業
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	84	1,018	109,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	205	205	908	97,730	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	375	375	510	54,851	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	—	672	639	68,812	エネルギー
NORTHERN TRUST CORP	173	195	1,560	167,750	各種金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE	52	91	1,509	162,326	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	70	72	2,989	321,495	小売
PACCAR INC	300	323	2,397	257,791	資本財
EXELON CORP	—	928	3,550	381,804	公益事業
PAYCHEX INC	276	302	2,177	234,181	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	62	71	1,772	190,588	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	1,193	1,329	17,593	1,891,816	食品・飲料・タバコ
GARMIN LTD	95	127	1,159	124,716	耐久消費財・アパレル
IPG PHOTONICS CORP	32	32	488	52,475	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	375	421	13,043	1,402,613	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	200	218	2,631	282,949	各種金融
QUALCOMM	1,026	1,089	8,508	914,946	半導体・半導体製造装置
EXACT SCIENCES CORP	107	132	1,113	119,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGENERON PHARMACEUTICALS	69	77	4,467	480,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEATTLE GENETICS INC	96	114	1,738	186,933	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	345	387	1,126	121,147	保険
ROSS STORES INC	318	343	3,373	362,732	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,222	1,373	7,061	759,347	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	109	120	2,471	265,716	保険
BOOKING HOLDINGS INC	39	40	6,595	709,263	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	108	122	661	71,102	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	231	266	1,085	116,765	保険
SVB FINANCIAL GROUP	43	49	1,065	114,595	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	63	78	2,120	228,068	メディア・娯楽
STARBUCKS CORP	1,045	1,133	8,902	957,329	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	182	182	492	52,973	素材
NETFLIX INC	368	417	17,280	1,858,222	メディア・娯楽
NORTONLIFELOCK INC	583	596	1,248	134,263	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	122	143	2,499	268,737	ソフトウェア・サービス

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価 額		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
INTUITIVE SURGICAL INC	98	110	6,312	678,763	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	—	160	1,036	111,407	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS	810	891	10,332	1,111,001	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	113	112	1,334	143,445	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS	206	238	1,002	107,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VIACOMCBS INC-CLASS B	—	539	1,144	123,045	メディア・娯楽
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	216	245	6,805	731,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	674	724	3,029	325,784	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	235	284	1,241	133,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	145	161	1,859	199,992	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	80	93	773	83,220	消費者サービス
NASDAQ INC	90	109	1,277	137,383	各種金融
CME GROUP INC	307	341	6,171	663,581	各種金融
LKQ CORP	246	293	813	87,455	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION	192	241	1,180	126,913	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	234	258	974	104,818	各種金融
XILINX INC	221	235	2,098	225,690	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	46	51	1,328	142,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION	151	151	516	55,552	銀行
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	73	106	1,419	152,640	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	43	52	556	59,841	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-A	155	155	327	35,237	メディア・娯楽
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32	35	1,737	186,806	各種金融
DEXCOM INC	78	85	3,096	332,971	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY INC - A	128	128	281	30,241	メディア・娯楽
EXPEDIA GROUP INC	111	133	1,054	113,370	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-C	462	421	866	93,133	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B	318	—	—	—	メディア・娯楽
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	60	60	173	18,648	運輸
QURATE RETAIL INC	350	—	—	—	小売
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	176	176	282	30,406	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	367	367	427	45,921	銀行
INSULET CORP	—	59	1,093	117,559	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	84	105	3,013	324,064	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC	37	42	3,540	380,682	小売
ULTA BEAUTY INC	49	53	1,304	140,286	小売
DISCOVERY INC-C	236	311	620	66,752	メディア・娯楽
ALKERMES PLC	125	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC	131	147	2,655	285,530	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	134	145	2,451	263,559	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	590	63,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	250	270	2,686	288,897	半導体・半導体製造装置
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	206	217	1,258	135,336	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC	129	138	1,871	201,257	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	108	129	10,407	1,119,155	自動車・自動車部品
TRIPADVISOR INC	103	103	219	23,625	メディア・娯楽
FACEBOOK INC-A	2,036	2,297	51,802	5,570,284	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	134	204	881	94,771	エネルギー
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	71	1,093	117,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORKDAY INC-CLASS A	125	156	2,860	307,593	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	282	410	4,070	437,732	電気通信サービス

銘柄	当 期 首 (前 期 末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PTC INC	99	99	747	80,411	ソフトウェア・サービス	
NEWS CORP-CLASS A	334	334	397	42,749	メディア・娯楽	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	152	152	487	52,392	資本財	
CDW CORP/DE	124	137	1,506	162,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	99	99	108	11,712	運輸	
IHS MARKIT LTD	327	—	—	—	商業・専門サービス	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	186	186	638	68,703	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	63	229	24,630	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	152	152	546	58,804	メディア・娯楽	
OKTA INC	86	100	1,854	199,410	ソフトウェア・サービス	
BROADCOM INC	337	378	10,713	1,152,047	半導体・半導体製造装置	
MONGODB INC	26	46	996	107,177	ソフトウェア・サービス	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	104	—	—	—	保険	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	149	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DOCUSIGN INC	86	101	1,292	139,017	ソフトウェア・サービス	
WIX.COM LTD	39	50	1,039	111,731	ソフトウェア・サービス	
DROPBOX INC-CLASS A	162	242	547	58,825	ソフトウェア・サービス	
FOX CORP - CLASS A	302	339	982	105,669	メディア・娯楽	
FOX CORP- CLASS B	121	150	432	46,510	メディア・娯楽	
SABRE CORP	241	241	177	19,136	ソフトウェア・サービス	
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT	—	20	21	2,317	メディア・娯楽	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	316	34,060	ソフトウェア・サービス	
CDK GLOBAL INC	106	106	423	45,553	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	106	106	1,069	114,956	半導体・半導体製造装置	
LIBERTY BROADBAND-C	86	102	1,357	145,933	メディア・娯楽	
KRAFT HEINZ CO/THE	530	641	1,950	209,752	食品・飲料・タバコ	
MATCH GROUP INC	—	46	409	43,988	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL A	252	285	40,523	4,357,478	メディア・娯楽	
PAYPAL HOLDINGS INC	944	1,064	15,831	1,702,366	ソフトウェア・サービス	
ZILLOW GROUP INC-C	99	123	709	76,298	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL C	266	294	41,773	4,491,926	メディア・娯楽	
BEIGENE LTD-ADR	23	38	626	67,372	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONSTER BEVERAGE CORP	349	376	2,667	286,826	食品・飲料・タバコ	
ROKU INC	—	83	912	98,106	メディア・娯楽	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	136	143	7,669	824,680	メディア・娯楽	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	339	339	145	15,674	食品・生活必需品小売り	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	987	987	362	38,950	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	201	201	804	86,454	資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	205	205	410	44,109	資本財	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	94	106	1,089	117,111	各種金融	
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	258,018 616	286,867 608	2,465,787 —	265,146,182 <66.3%>
(カナダ)					千カナダドル	
AGNICO EAGLE MINES	214	234	2,049	159,900	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	361	841	3,606	281,324	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	1,490	1,709	5,642	440,173	素材	
ATCO LTD -CLASS I	52	52	204	15,928	公益事業	
BANK MONTREAL	553	615	4,269	333,090	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	1,060	1,169	6,705	523,080	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	282	332	2,053	160,166	銀行	
BCE INC	125	153	875	68,277	電気通信サービス	

銘柄	当 期 首 (前 期 末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	733	1,265	5,549	432,924	各種金融
BAUSCH HEALTH COS INC	—	278	711	55,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER B	1,513	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	204	244	840	65,602	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LIMITED	394	394	249	19,425	ソフトウェア・サービス
CGI INC - CL A	211	233	2,068	161,395	ソフトウェア・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	131	593	46,328	素材
CAE INC	259	259	559	43,626	資本財
CAMECO CORP	287	410	598	46,671	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	320	350	2,016	157,294	電気通信サービス
CANADIAN IMPERIAL BANK	379	429	3,863	301,353	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,033	1,223	3,083	240,574	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A	54	54	640	49,968	小売
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	341	26,633	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	611	698	8,311	648,352	運輸
FIRST CAPITAL REALTY INC	124	—	—	—	不動産
GILDAN ACTIVEWEAR INC	176	176	342	26,752	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	246	246	1,388	108,288	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	114	152	473	36,910	食品・生活必需品小売り
VERMILION ENERGY INC	100	—	—	—	エネルギー
FORTIS INC	384	426	2,274	177,431	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	569	569	467	36,486	素材
TELUS CORP	164	329	778	60,738	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	237	237	534	41,697	保険
IMPERIAL OIL	247	247	547	42,672	エネルギー
ENBRIDGE	1,738	1,939	8,642	674,206	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	250	19,531	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,729	1,901	3,294	257,018	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	156	179	1,221	95,270	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	279	279	1,624	126,741	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	539	569	2,740	213,756	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23	26	1,023	79,843	保険
METRO INC	191	249	1,423	111,020	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	314	314	131	10,276	エネルギー
EMERA INC	40	237	1,303	101,684	公益事業
METHANEX CORP	70	70	166	12,991	素材
ONEX CORP	66	66	430	33,610	各種金融
TC ENERGY CORP	763	885	5,436	424,092	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	297	515	1,170	91,328	保険
POWER FINANCIAL CORP	207	—	—	—	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	452	35,287	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA	1,234	1,372	12,533	977,730	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	147	—	—	—	資本財
CP RAILWAY LIMITED	118	131	4,551	355,084	運輸
ENCANA CORP	1,386	—	—	—	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	359	450	1,048	81,775	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY	1,344	1,473	3,538	276,065	エネルギー
LUNDIN MINING CORP	622	622	407	31,755	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B	456	456	606	47,320	素材
THOMSON REUTERS CORP	161	187	1,750	136,532	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	1,543	1,734	10,457	815,769	銀行

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
WEST FRASER TIMBER CO LTD	43	43	169	13,252	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	68	68	680	53,114	食品・生活必需品小売り	
KINROSS GOLD CORP	1,076	1,253	1,136	88,684	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	111	130	1,735	135,355	保険	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	368	455	2,708	211,273	素材	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	17	19	3,044	237,498	ソフトウェア・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	167	182	3,549	276,900	素材	
CI FINANCIAL CORP	186	186	307	23,959	各種金融	
TOURMALINE OIL CORP	199	—	—	—	エネルギー	
KEYERA CORP	149	186	396	30,932	エネルギー	
PARKLAND CORP	—	110	415	32,445	エネルギー	
ALTAGAS INCOME LTD	314	243	379	29,592	公益事業	
PEMBINA PIPELINE CORP	422	538	1,859	145,089	エネルギー	
DOLLARAMA INC	267	267	1,237	96,520	小売	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	518	1,005	78,421	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	966	966	582	45,471	エネルギー	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	170	268	1,400	109,223	素材	
INTER PIPELINE LTD	303	354	439	34,296	エネルギー	
STARS GROUP INC/THE	118	—	—	—	消費者サービス	
NUTRIEN LTD	514	555	2,633	205,452	素材	
CRONOS GROUP INC	159	159	148	11,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WSP GLOBAL INC	94	94	840	65,593	資本財	
IA FINANCIAL CORP INC	82	82	366	28,595	保険	
OVINTIV INC	—	234	270	21,069	エネルギー	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	183	183	169	13,198	エネルギー	
AIR CANADA	—	115	185	14,467	運輸	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	213	254	1,903	148,490	消費者サービス	
AURORA CANNABIS INC	530	44	93	7,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SHOPIFY INC - CLASS A	83	98	10,081	786,475	ソフトウェア・サービス	
CANOPY GROWTH CORP	164	164	501	39,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYDRO ONE LTD	322	322	844	65,913	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	34,068	35,565	164,934	12,866,555	<3.2%>
(ドイツ)		85	82	—	—	
ADIDAS AG	150	172	4,133	492,395	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	804	804	302	36,084	銀行	
FRESENTIUS SE&CO KGAA	367	404	1,743	207,710	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	95	350	41,795	電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	57	209	24,958	素材	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	47	57	851	101,446	保険	
GEA GROUP AG	133	133	362	43,170	資本財	
CONTINENTAL AG	99	99	919	109,520	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	849	917	2,655	316,344	運輸	
AXEL SPRINGER SE	38	—	—	—	メディア・娯楽	
MERCK KGAA	104	120	1,277	152,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE STAMM	428	564	1,704	203,029	公益事業	
SAP SE	842	938	10,572	1,259,537	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	1,832	2,161	2,183	260,064	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	86	101	735	87,646	家庭用品・パーソナル用品	
PUMA SE	7	77	498	59,393	耐久消費財・アパレル	
BAYER	783	941	5,926	706,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	157	172	1,371	163,422	家庭用品・パーソナル用品		
BASF SE	772	880	4,448	529,953	素材		
BEIERSDORF AG	91	91	878	104,597	家庭用品・パーソナル用品		
HOCHTIEF AG	13	22	184	21,930	資本財		
HEIDELBERGCEMENT AG	138	148	683	81,478	素材		
FRESENTIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	179	199	1,511	180,037	ヘルスケア機器・サービス		
ALLIANZ SE-REG	357	398	6,651	792,448	保険		
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	232	232	227	27,086	運輸		
MUENCHENER RUECKVERSICH.	126	138	2,881	343,255	保険		
VOLKSWAGEN STAMM	25	32	483	57,590	自動車・自動車部品		
VOLKSWAGEN AG-PFD	159	179	2,469	294,229	自動車・自動車部品		
DAIMLER AG	785	874	3,064	365,118	自動車・自動車部品		
THYSSEN KRUPP	330	330	206	24,626	素材		
SIEMENS	656	731	7,251	863,860	資本財		
I&I DRILLISCH AG	37	—	—	—	電気通信サービス		
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,611	1,905	1,491	177,728	各種金融		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	289	319	1,726	205,682	自動車・自動車部品		
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	210	25,103	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE TELEKOM	2,794	3,193	4,576	545,181	電気通信サービス		
SARTORIUS AG-VORZUG	32	32	1,012	120,649	ヘルスケア機器・サービス		
INFINEON TECHNOLOGIES	998	1,222	2,365	281,815	半導体・半導体製造装置		
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	313	37,367	ヘルスケア機器・サービス		
DEUTSCHE BOERSE	156	182	2,738	326,206	各種金融		
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	140	140	712	84,861	自動車・自動車部品		
FRAPORT AG	35	35	163	19,488	運輸		
WIRECARD AG	98	113	1,068	127,271	ソフトウェア・サービス		
LANXESS	72	72	352	41,937	素材		
MTU AERO ENGINES AG	47	47	723	86,179	資本財		
DEUTSCHE WOHNEN SE	290	337	1,364	162,520	不動産		
SYMRISE AG	115	124	1,220	145,416	素材		
BRENTAG AG	116	152	731	87,189	資本財		
EVONIK INDUSTRIES AG	134	197	452	53,937	素材		
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	669	669	190	22,688	電気通信サービス		
HUGO BOSS AG	48	—	—	—	耐久消費財・アパレル		
KION GROUP AG	58	58	305	36,412	資本財		
VONOVIA SE	439	495	2,573	306,559	不動産		
KNORR-BREMSE AG	41	41	394	47,039	資本財		
SIEMENS HEALTHINEERS AG	125	148	684	81,541	ヘルスケア機器・サービス		
METRO AG	137	137	119	14,201	食品・生活必需品小売り		
INNOGY SE	110	—	—	—	公益事業		
ZALANDO SE	91	139	845	100,761	小売		
COVESTRO AG	161	150	528	62,969	素材		
UNIPER SE	147	201	579	69,085	公益事業		
DELIVERY HERO SE	86	114	986	117,467	小売		
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	19,932	22,405	95,175	11,338,246	
(イタリア)			61	57	—	<2.8%>	
ASSICURAZIONI GENERALI	896	1,093	1,396	166,352	保険		
INTESA SANPAOLO	12,867	14,606	2,276	271,212	銀行		
UNICREDIT SPA	1,771	1,853	1,420	169,247	銀行		
MEDIOBANCA	539	539	319	38,089	銀行		

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
LEONARDO SPA	354	354	206	24,603	資本財	
ENEL	6,812	7,846	5,329	634,861	公益事業	
ENI	2,162	2,484	2,110	251,383	エネルギー	
SNAM SPA	2,053	2,036	853	101,626	公益事業	
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	285	34,044	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA RNC	4,701	4,701	162	19,322	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	420	514	766	91,284	運輸	
TERNA SPA	1,302	1,302	779	92,868	公益事業	
RECORDATI SPA	74	114	479	57,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PRYSMIAN SPA	256	211	406	48,387	資本財	
MONCLER SPA	157	157	548	65,368	耐久消費財・アパレル	
FINECOBANK SPA	441	531	562	67,047	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	460	460	362	43,215	保険	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	425	644	476	56,784	食品・飲料・タバコ	
PIRELLI & C SPA	390	390	161	19,259	自動車・自動車部品	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	44,615	48,369	18,904	2,252,059	
(フランス)		19	19	—	<0.6%>	
BOUYGUES ORD	168	193	537	64,024	資本財	
AIR LIQUIDE	362	453	5,456	650,033	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	457	526	1,053	125,484	公益事業	
LOREAL	211	240	6,255	745,244	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH	234	265	10,279	1,224,608	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT AVIATION SA	2	2	161	19,259	資本財	
THALES SA	96	96	686	81,748	資本財	
CAPGEMINI SA	132	154	1,435	171,024	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	36	58	198	23,678	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	46	62	774	92,297	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PUBLICIS GROUPE	176	214	575	68,543	メディア・娯楽	
FAURECIA	59	59	215	25,722	自動車・自動車部品	
BOLLORE	618	618	167	19,923	メディア・娯楽	
MICHELIN	153	164	1,550	184,664	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	184	199	2,855	340,145	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	173	173	380	45,296	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	15	23	263	31,384	食品・飲料・タバコ	
SEB SA	20	20	254	30,281	耐久消費財・アパレル	
VINCI S. A.	430	494	4,148	494,196	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	477	530	4,693	559,148	資本財	
VIVENDI	773	773	1,591	189,625	メディア・娯楽	
TOTAL SA	2,039	2,295	7,877	938,426	エネルギー	
VALEO SA	193	193	421	50,252	自動車・自動車部品	
ORANGE	1,768	1,881	2,027	241,568	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	26	30	2,282	271,897	耐久消費財・アパレル	
SOCIETE BIC SA	24	—	—	—	商業・専門サービス	
DASSAULT SYSTEMES SA	117	125	1,872	223,114	ソフトウェア・サービス	
KERING	63	72	3,498	416,825	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	118	118	122	14,558	保険	
CARREFOUR	537	592	790	94,206	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	76	97	655	78,146	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	966	1,079	9,553	1,138,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR	179	179	469	55,966	消費者サービス	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
SOCIETE GENERALE	637	790	1,100	131,093	銀行		
TELEPERFORMANCE	45	57	1,286	153,300	商業・専門サービス		
EURAZEO SA	33	33	153	18,300	各種金融		
SODEXO	81	81	509	60,744	消費者サービス		
AXA	1,656	1,859	3,148	375,079	保険		
PEUGEOT SA	528	528	710	84,608	自動車・自動車部品		
JC DECAUX SA	46	95	177	21,178	メディア・娯楽		
ESSILORLUXOTTICA	250	272	3,264	388,946	耐久消費財・アパレル		
CREDIT AGRICOLE SA	928	1,074	859	102,365	銀行		
BNP PARIBAS	943	1,101	3,712	442,320	銀行		
SAINT-GOBAIN	407	453	1,308	155,833	資本財		
WENDEL	20	20	174	20,750	各種金融		
ILIAD SA	20	12	196	23,353	電気通信サービス		
IMERYS SA	30	—	—	—	素材		
DANONE (GROUPE)	523	592	3,687	439,272	食品・飲料・タバコ		
SAFRAN SA	289	315	2,805	334,250	資本財		
ENGIE	1,620	1,710	1,856	221,199	公益事業		
ALSTOM	138	187	736	87,741	資本財		
EUTELSAT COMMUNICATIONS	119	119	114	13,653	メディア・娯楽		
ELECTRICITE DE FRANCE	497	613	489	58,366	公益事業		
IPSEN	27	27	196	23,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ARKEMA	53	75	596	71,021	素材		
LEGRAND SA	217	245	1,494	178,064	資本財		
EIFPAGE	60	72	594	70,851	資本財		
ADP	23	23	225	26,844	運輸		
NATIXIS	699	699	148	17,677	各種金融		
UBISOFT ENTERTAINMENT	68	93	631	75,205	メディア・娯楽		
SCOR SE	133	133	315	37,576	保険		
BUREAU VERITAS SA	195	250	470	56,005	商業・専門サービス		
GETLINK	364	441	568	67,720	運輸		
SUEZ	280	280	287	34,192	公益事業		
EDENRED	189	227	868	103,503	ソフトウェア・サービス		
BIOMERIEUX	32	41	519	61,872	ヘルスケア機器・サービス		
WORLDLINE SA	70	127	825	98,357	ソフトウェア・サービス		
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	30	30	693	82,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
AMUNDI SA	47	62	420	50,139	各種金融		
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	22,257	24,744	108,258	12,896,893	<3.2%>
(オランダ)							
AIRBUS SE	489	561	3,373	401,843	資本財		
RANDSTAD NV	95	123	484	57,772	商業・専門サービス		
KONINKLIJKE AHOLD NV	982	1,032	2,342	279,005	食品・生活必需品小売り		
AKZO NOBEL	197	195	1,476	175,903	素材		
UNILEVER NV-CVA	1,231	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品		
WOLTERS KLUWER	228	257	1,783	212,429	商業・専門サービス		
QIAGEN N.V.	218	218	859	102,431	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
KONINKLIJKE DSM NV	152	171	1,986	236,707	素材		
VOPAK	63	63	310	36,936	エネルギー		
AEGON	1,662	1,662	418	49,914	保険		
ASML HOLDING NV	352	407	12,006	1,430,341	半導体・半導体製造装置		
KPN (KON.)	2,615	3,543	778	92,738	電気通信サービス		

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
STMICROELECTRONICS	575	662	1,471	175,254	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	806	872	3,573	425,753	ヘルスケア機器・サービス	
ING GROEP NV-CVA	3,320	3,778	2,283	272,090	銀行	
HEINEKEN NV	226	243	2,049	244,213	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	107	107	814	97,076	食品・飲料・タバコ	
UNILEVER NV	—	1,405	6,499	774,243	家庭用品・パーソナル用品	
FERRARI NV	99	112	1,710	203,769	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	930	930	538	64,143	資本財	
PROSUS	—	458	3,417	407,172	小売	
NN GROUP NV	276	276	791	94,240	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	963	1,113	918	109,465	自動車・自動車部品	
JUST EAT TAKEAWAY	—	113	1,101	131,247	小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	331	531	395	47,117	銀行	
EXOR NV	103	103	510	60,794	各種金融	
ALTICE NV -A	—	500	182	21,681	メディア・娯楽	
ADYEN NV	8	10	1,170	139,382	ソフトウェア・サービス	
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	16,040	19,456	53,250	6,343,674
(スペイン)	24	27	—	<1.6%>		
IBERDROLA SA	5,208	5,905	5,679	676,599	公益事業	
ENDESA	247	317	688	81,964	公益事業	
BANKINTER SA	588	588	234	27,917	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA	5,561	6,474	1,897	226,064	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	322	301	506	60,357	公益事業	
REPSOL SA	1,246	1,330	1,179	140,551	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	13,663	15,998	3,411	406,425	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	396	396	633	75,470	公益事業	
TELEFONICA	4,100	4,381	1,900	226,455	電気通信サービス	
INDITEX	938	1,019	2,585	307,974	小売	
ENAGAS	182	252	529	63,020	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	174	251	372	44,407	資本財	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	208	220	522	62,217	資本財	
GRIFOLS SA	276	276	759	90,467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERROVIAL SA	390	460	1,143	136,199	資本財	
MAPFRE SA	909	909	150	17,962	保険	
BANCO DE SABADELL SA	4,429	4,496	133	15,925	銀行	
CAIXABANK	2,863	3,286	580	69,172	銀行	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	365	418	2,025	241,348	ソフトウェア・サービス	
BANKIA SA	1,100	1,100	91	10,949	銀行	
FERROVIAL SA-RTS	—	460	15	1,828	資本財	
AENA SME SA	56	65	863	102,873	運輸	
CELLNEX TELECOM SA	165	246	1,220	145,340	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	43,396	49,159	27,125	3,231,493
(ベルギー)	22	23	—	<0.8%>		
UMICORE	176	176	711	84,730	素材	
KBC GROEP NV	227	240	1,202	143,253	銀行	
SOLVAY SA	69	69	503	60,008	素材	
UCB (GROUPE)	104	124	1,098	130,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	41	54	291	34,737	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	62	82	605	72,168	各種金融	

銘柄	銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AGEAS		160	160	513	61,146	保険
PROXIMUS		131	131	253	30,206	電気通信サービス
GALAPAGOS NV		—	43	815	97,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELENET GROUP HOLDING NV		49	49	185	22,089	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		640	728	3,160	376,460	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,662	1,860	9,340	1,112,714	
(オーストリア)						
OMV AG		121	149	468	55,800	エネルギー
VERBUND AG		74	74	294	35,135	公益事業
VOESTALPINE AG		81	124	226	27,006	素材
ERSTE GROUP BANK AG		275	275	569	67,798	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		124	124	206	24,550	銀行
ANDRITZ AG		52	52	169	20,245	資本財
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	730	801	1,935	230,538	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		9	11	692	82,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		406	406	237	28,260	エネルギー
SES		313	313	210	25,037	メディア・娯楽
ARCELORMITTAL		539	662	592	70,622	素材
RTL GROUP		35	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		592	1,113	580	69,108	不動産
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,897	2,507	2,312	275,469	
(フィンランド)						
WARTSILA OYJ		343	343	253	30,231	資本財
UPM KYMMENE OYJ		439	506	1,319	157,220	素材
STORA ENSO OYJ R		472	547	598	71,311	素材
SAMPO OYJ-A SHS		399	430	1,432	170,623	保険
FORTUM OYJ		383	419	719	85,656	公益事業
ELISA A		117	155	847	100,967	電気通信サービス
METSO OYJ		95	95	282	33,623	資本財
NOKIA OYJ		4,898	5,456	1,952	232,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		332	401	1,472	175,394	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ		102	102	229	27,353	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B		301	322	1,999	238,235	資本財
ORION OYJ-CLASS B		79	98	462	55,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,966	8,880	11,569	1,378,313	
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC		118	153	846	100,834	資本財
CRH PLC		711	800	2,356	280,776	素材
KERRY GROUP PLC-A		131	146	1,601	190,813	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		195	195	575	68,571	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC		840	840	143	17,071	銀行
AIB GROUP PLC		702	702	73	8,764	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		71	72	859	102,343	消費者サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,769	2,909	6,456	769,175	
		7	7	—	<0.2%>	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,359	2,359	987	117,672	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	398	491	542	64,582	エネルギー
JERONIMO MARTINS	202	249	384	45,831	食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	2,960 3	3,100 3	1,914 -	228,087 <0.1%>
ユ ー ロ 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	164,230 239	184,195 237	336,243 -	40,056,666 <10.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC	358	358	315	41,846	素材
ASHTAD GROUP PLC	420	420	1,038	137,666	資本財
SEVERN TRENT PLC	181	250	608	80,578	公益事業
BHP GROUP PLC	1,796	2,028	3,224	427,395	素材
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	964	964	513	68,016	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	277	332	640	84,823	資本財
AVIVA PIC	3,480	3,812	998	132,337	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	99	134	699	92,689	素材
DIAGEO	2,046	2,245	6,632	878,946	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	86	117	353	46,813	各種金融
DCC PLC	91	91	610	80,922	資本財
BAE SYSTEMS PLC	2,820	3,087	1,577	209,091	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,972	2,193	7,180	951,569	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	323	371	864	114,548	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	2,335	2,547	998	132,386	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	832	914	1,375	182,275	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	181	168	370	49,056	素材
ANGLO AMERICAN PLC	874	960	1,644	217,915	素材
COMPASS GROUP PLC	1,363	1,517	1,941	257,296	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	16,939	19,413	7,461	988,905	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	4,900	5,501	1,145	151,809	保険
UNILEVER PLC	932	1,062	4,598	609,485	家庭用品・パーソナル用品
MEGGITT PLC	662	662	195	25,908	資本財
MORRISON SUPERMARKETS	1,681	2,093	389	51,610	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	588	671	604	80,096	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	865	865	349	46,334	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	288	367	688	91,283	食品・飲料・タバコ
PEARSON	663	663	305	40,483	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	263	315	737	97,706	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL	2,173	2,468	2,671	354,091	保険
RIO TINTO PLC REG	971	1,078	4,624	612,896	素材
VODAFONE GROUP PLC	23,093	25,147	3,373	447,058	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC	609	679	4,847	642,474	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,713	1,859	3,594	476,444	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,577	1,810	895	118,615	商業・専門サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND	3,955	4,790	565	74,953	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	447	447	424	56,282	各種金融
SSE PLC	932	1,003	1,234	163,588	公益事業
BP PLC	16,948	19,381	6,084	806,407	エネルギー
SAGE GROUP PLC	893	1,113	771	102,240	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	371	371	497	65,967	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	59,687	66,371	2,082	276,023	銀行

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
TAYLOR WIMPEY PLC	2,705	2,705	418	55,496	耐久消費財・アパレル	
TESCO	8,563	9,196	2,152	285,308	食品・生活必需品小売り	
3I GROUP PLC	792	881	736	97,563	各種金融	
SMITH & NEPHEW PLC	710	830	1,414	187,444	ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE	4,254	4,775	8,039	1,065,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC/THE	185	185	185	24,602	資本財	
WPP PLC	1,130	1,130	712	94,432	メディア・娯楽	
ASTRAZENECA	1,086	1,255	10,915	1,446,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	7,302	8,172	970	128,614	電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	137	267	316	41,929	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	2,831	3,340	3,097	410,479	公益事業	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,352	2,052	206	27,389	小売	
BARCLAYS	14,716	16,694	2,047	271,300	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	147	154	873	115,752	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	353	404	639	84,804	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	112	132	672	89,160	小売	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,490	1,490	475	63,003	資本財	
KINGFISHER PLC	1,709	1,709	331	43,997	小売	
ITV PLC	2,954	2,954	248	32,975	メディア・娯楽	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	262	302	2,491	330,187	各種金融	
SAINSBURY (J) PLC	1,483	1,483	285	37,784	食品・生活必需品小売り	
G4S PLC	1,325	1,325	122	16,274	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	386	51,185	保険	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	105	105	443	58,715	耐久消費財・アパレル	
CENTRICA PLC	4,405	4,405	172	22,800	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,807	3,998	5,268	698,204	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,208	3,573	4,517	598,764	エネルギー	
INTERCONTINENTAL HOTELS	160	160	652	86,482	消費者サービス	
WHITBREAD PLC	146	116	297	39,480	消費者サービス	
TUI AG-DI	379	379	197	26,180	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,934	2,333	616	81,729	各種金融	
INVESTEC PLC	542	—	—	—	各種金融	
EXPERIAN PLC	812	874	2,508	332,395	商業・専門サービス	
MONDI PLC	340	477	734	97,390	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	270	330	612	81,147	各種金融	
FRESNILLO PLC	177	—	—	—	素材	
OCADO GROUP PLC	387	446	937	124,279	小売	
GLENCORE PLC	9,416	10,330	1,624	215,267	素材	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	540	—	—	—	エネルギー	
GVC HOLDINGS PLC	425	592	482	63,970	消費者サービス	
EVRAZ PLC	430	430	125	16,566	素材	
NMC HEALTH PLC	95	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
EASYJET PLC	116	116	86	11,408	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,137	1,137	307	40,690	保険	
COCA-COLA HBC AG-CDI	179	179	373	49,508	食品・飲料・タバコ	
AVEVA GROUP PLC	—	67	271	35,937	ソフトウェア・サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	290	290	130	17,303	ソフトウェア・サービス	
MERLIN ENTERTAINME	650	—	—	—	消費者サービス	
FERGUSON PLC	192	222	1,431	189,694	資本財	
M&G PLC	—	2,291	343	45,545	各種金融	
INFORMA PLC	1,008	1,179	566	75,133	メディア・娯楽	

銘	柄	当	期		業	種	
		期首(前期末)	当	末			
		株数 (百株)	株数 (百株)	評 価			額
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)				
WHITBREAD PLC-NIL		—	58	61	8,167	消費者サービス	
AUTO TRADER GROUP PLC		800	973	531	70,474	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		62	72	724	96,035	資本財	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		—	46	489	64,832	消費者サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC		4,084	4,084	514	68,130	資本財	
JD SPORTS FASHION PLC		—	320	212	28,151	小売	
小 計	株数・金額 銘柄数 <比率>	253,548 94	281,854 94	142,707 —	18,913,057 <4.7%>		
(スイス)				千スイスフラン			
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1	2	533	59,453	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		1	1	815	90,928	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.08	0.1	833	92,896	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG - REG		38	48	668	74,537	保険	
STRAUMANN HOLDING AG-REG		7	10	807	90,057	ヘルスケア機器・サービス	
SWATCH GROUP AG/THE-REG		39	39	149	16,644	耐久消費財・アパレル	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		6	8	579	64,644	素材	
SWISS PRIME SITE-REG		62	74	683	76,226	不動産	
PARGESA HOLDING SA-BR		33	33	247	27,654	各種金融	
DUFREY AG-REG		25	38	113	12,639	小売	
SCHINDLER HOLDING AG-REG		14	21	476	53,135	資本財	
SIKA AG-BR		105	122	2,061	229,846	素材	
SGS SA		4	5	1,317	146,908	商業・専門サービス	
SWISSCOM		20	24	1,202	134,150	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG		30	34	1,619	180,597	資本財	
GIVAUDAN-REG		8	8	2,963	330,491	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG		126	143	4,501	502,047	保険	
NOVARTIS		1,841	2,053	17,119	1,909,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD		1,534	1,768	3,411	380,432	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS		594	671	22,908	2,554,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG		132	132	617	68,826	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD		403	475	1,898	211,668	素材	
CLARIANT AG-REG		173	173	315	35,234	素材	
NESTLE SA - REGISTERED		2,618	2,839	29,201	3,256,542	食品・飲料・タバコ	
TEMENOS AG - REG		52	65	957	106,737	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG-REG		51	51	1,051	117,254	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		50	50	719	80,183	運輸	
CREDIT SUISSE GROUP AG		2,242	2,416	2,206	246,028	各種金融	
SWATCH GROUP AG(BEARER)		24	24	484	54,065	耐久消費財・アパレル	
LONZA GROUP AG-REG		65	69	3,338	372,346	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		29	32	1,123	125,291	保険	
VIFOR PHARMA AG		36	44	672	74,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARTNERS GROUP HOLDING AG		14	18	1,439	160,519	各種金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		37	37	849	94,756	資本財	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)		447	487	2,770	308,962	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD		211	211	882	98,410	各種金融	
SWISS RE LTD		262	283	1,905	212,548	保険	
ALCON INC		375	393	2,399	267,631	ヘルスケア機器・サービス	
UBS GROUP AG		3,349	3,701	3,884	433,224	各種金融	
小 計	株数・金額 銘柄数 <比率>	15,076 39	16,620 39	119,731 —	13,352,432 <3.3%>		

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ATLAS COPCO A	596	636	24,340	274,798	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	3,274	36,969	各種金融	
SKF AB-B	283	354	6,100	68,872	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,387	1,557	12,973	146,473	銀行	
SWEDBANK AB-A	802	867	10,546	119,068	銀行	
VOLVO B	1,259	1,530	20,963	236,680	資本財	
SWEDISH MATCH AB	151	160	10,582	119,471	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	380	500	6,291	71,031	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	181	181	2,848	32,155	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	228	228	2,952	33,334	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	404	439	22,012	248,526	各種金融	
HENNES & MAURITZ B	739	773	11,319	127,797	小売	
ASSA ABLOY AB-B	888	1,017	20,110	227,047	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	1,363	1,503	13,754	155,286	銀行	
ERICSSON (LM) B	2,687	2,987	25,675	289,870	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	1,007	1,007	16,011	180,764	資本財	
TELIA CO AB	2,354	2,578	8,461	95,532	電気通信サービス	
SKANSKA B	285	285	5,373	60,668	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	141	172	3,959	44,700	エネルギー	
BOLIDEN AB	263	239	4,928	55,646	素材	
ALFA LAVAL AB	256	256	5,018	56,662	資本財	
KINNEVIK AB - B	181	236	5,520	62,331	各種金融	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	61	86	2,026	22,884	電気通信サービス	
ICA GRUPPEN AB	57	79	3,439	38,827	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	2,710	30,602	耐久消費財・アパレル	
ATLAS COPCO B	365	365	12,598	142,234	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	127	167	3,541	39,982	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	215	265	13,670	154,342	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EPIROC AB-A	538	538	5,743	64,849	資本財	
EPIROC AB-B	299	299	3,218	36,342	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	549	570	17,707	199,920	家庭用品・パーソナル用品	
BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	263	—	—	—	素材	
NORDEA BANK ABP	2,505	3,099	20,307	229,267	銀行	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	21,287	23,444	327,984	3,702,946
	33	32	—	—	—	<0.9%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	802	968	12,917	141,965	銀行	
NORSK HYDRO	1,061	1,061	2,703	29,713	素材	
TELENOR ASA	608	718	10,564	116,107	電気通信サービス	
ORKLA	698	698	5,979	65,713	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	809	921	13,630	149,795	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	134	184	6,311	69,360	素材	
MOWI ASA	409	409	7,538	82,843	食品・飲料・タバコ	
AKER BP ASA	103	103	1,708	18,771	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,309	36,375	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	69	69	1,625	17,865	メディア・娯楽	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	4,881	5,320	66,288	728,511
	10	10	—	—	—	<0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	96	103	9,237	147,607	食品・飲料・タバコ	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	5	6	4,270	68,241	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	1,873	29,934	運輸
DANSKE BANK A/S	593	593	5,055	80,785	銀行
GENMAB A/S	48	63	13,101	209,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S	176	218	7,901	126,272	素材
DSV PANALPINA A S	168	204	14,768	236,007	運輸
DEMANT A/S	74	116	2,180	34,842	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSYEMS	177	176	11,753	187,814	資本財
NOVO NORDISK A/S-B	1,449	1,692	74,322	1,187,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S	48	48	1,264	20,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B	94	112	12,407	198,264	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S	98	98	1,850	29,572	保険
PANDORA A/S	84	84	2,848	45,524	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	90	103	6,644	106,184	素材
ISS A/S	142	142	1,718	27,468	商業・専門サービス
ORSTED A/S	159	184	14,073	224,887	公益事業
小 計	3,512	3,952	185,271	2,960,638	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	17	17	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	122	162	1,134	80,930	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD	513	642	1,093	78,005	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,481	2,715	5,088	363,029	銀行
AMCOR PLC-CDI	1,052	—	—	—	素材
WESTPAC BANKING	2,883	3,383	6,222	443,997	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	356	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,346	1,346	1,820	129,915	素材
TELSTRA CORP	3,423	4,031	1,306	93,192	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	424	424	277	19,831	銀行
BRAMBLES LTD	1,292	1,603	1,849	131,994	商業・専門サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED	461	461	409	29,227	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	158	202	1,795	128,124	各種金融
BHP GROUP LTD	2,534	2,815	9,898	706,259	素材
AMPOL LTD	206	206	551	39,372	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	451	451	152	10,859	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	599	42,744	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	380	433	12,460	889,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	35	52	533	38,035	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	2,385	2,623	3,822	272,722	運輸
COCHLEAR LIMITED	48	62	1,203	85,856	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,655	1,655	985	70,300	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,510	1,691	11,115	793,126	銀行
BORAL LIMITED	817	817	255	18,194	素材
RIO TINTO LTD	325	355	3,325	237,304	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	527	527	1,415	101,021	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	2,093	2,093	1,289	92,014	保険
TPG TELECOM LTD	314	314	268	19,133	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32	32	43	3,136	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	373	432	1,157	82,567	素材
ORICA LTD	292	442	780	55,707	素材
CIMIC GROUP LIMITED	92	92	231	16,538	資本財
BLUESCOPE STEEL LTD	493	493	572	40,826	素材

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MACQUARIE GROUP LIMITED	268	329	3,717	265,228	各種金融
WORLEY LTD	345	345	309	22,092	エネルギー
SUNCORP GROUP LIMITED	1,029	1,193	1,117	79,708	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,377	2,756	5,179	369,592	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	703	740	2,208	157,549	素材
OIL SEARCH LTD	1,187	1,187	407	29,069	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	1,505	1,505	310	22,135	素材
AMP LTD	2,442	3,436	582	41,560	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	850	347	24,804	運輸
QBE INSURANCE GROUP	1,130	1,271	1,129	80,567	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	440	440	231	16,538	各種金融
SANTOS	1,564	1,564	851	60,720	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	326	389	1,138	81,258	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	128	128	249	17,781	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD	1,668	1,668	552	39,403	消費者サービス
WESFARMERS LTD	1,002	1,093	4,454	317,855	小売
ALUMINA LIMITED	1,704	1,704	265	18,972	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	835	908	2,095	149,508	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,136	1,208	4,201	299,776	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	109	648	46,278	各種金融
SEEK LTD	263	263	534	38,158	メディア・娯楽
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	55	—	—	—	消費者サービス
AUSNET SERVICES	1,202	1,871	326	23,300	公益事業
CROWN RESORTS LTD	303	303	296	21,184	消費者サービス
AURIZON HOLDINGS LTD	1,594	1,914	907	64,762	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	583	705	703	50,177	食品・飲料・タバコ
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,145	2,698	761	54,297	保険
SOUTH32 LTD	4,081	4,818	939	67,039	素材
COLES GROUP LTD	932	1,284	1,965	140,268	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	—	180	379	27,047	ソフトウェア・サービス
小 計	60,492	67,883	108,474	7,739,679	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	59	59	—	<1.9%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	849	849	543	36,214	運輸
RYMAN HEALTHCARE LTD	363	363	469	31,254	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	668	668	1,243	82,828	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	455	545	1,605	106,949	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	766	766	263	17,562	素材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,454	1,989	881	58,701	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	—	850	402	26,780	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	541	36,080	公益事業
小 計	5,662	7,137	5,950	396,371	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7	8	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	237	237	1,641	22,763	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	2,851	39,543	不動産
BANK EAST ASIA	1,091	1,091	1,565	21,711	銀行
CLP HOLDINGS	1,480	1,570	11,971	166,041	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	500	675	2,639	36,606	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,030	1,150	31,004	430,025	各種金融
MTR CORP	1,420	1,510	5,564	77,177	運輸

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HANG SENG BANK	680	742	9,015	125,042	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,138	1,252	3,525	48,894	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,110	1,375	5,912	82,006	公益事業
WHARF HOLDINGS	910	—	—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS	8,159	9,815	12,602	174,796	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO	590	—	—	—	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,980	2,110	11,056	153,352	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD	645	645	1,237	17,158	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	3,100	3,605	7,876	109,252	銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,630	1,630	1,007	13,971	資本財
PCCW LTD	3,570	3,570	1,513	20,994	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	685	685	805	11,173	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,915	6,215	4,940	68,530	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD	980	—	—	—	消費者サービス
SINO LAND CO	3,154	3,154	2,807	38,933	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,285	1,510	13,846	192,053	不動産
SWIRE PACIFIC A	405	405	1,646	22,834	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	640	640	1,939	26,896	食品・飲料・タバコ
WHEELOCK & CO LTD	650	820	4,247	58,914	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,190	1,345	9,119	126,481	資本財
SJM HOLDINGS LTD	1,320	1,320	1,148	15,928	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	1,408	1,408	1,850	25,661	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD	672	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD	10,354	11,552	74,741	1,036,663	保険
SANDS CHINA LTD	2,028	2,428	7,417	102,881	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	1,671	23,190	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	950	1,400	4,025	55,826	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	1,045	2,220	30,800	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	6,990	9,365	6,002	83,261	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,339	2,564	12,375	171,654	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,159	2,579	10,771	149,398	不動産
小 計	74,089	82,106	272,561	3,780,423	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	37	34	—	<0.9%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,090	2,046	644	48,910	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	4,190	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP	1,563	1,748	3,433	260,535	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	312	428	328	24,912	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	99	99	211	16,017	小売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	512	512	144	10,957	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	623	783	638	48,428	各種金融
CAPITALAND LTD	1,871	2,235	645	49,018	不動産
GENTING SINGAPORE LTD	4,250	6,150	476	36,171	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD	1,123	1,699	1,014	76,975	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,665	1,665	249	18,953	運輸
OCBC BANK	2,642	3,156	2,729	207,175	銀行
SINGAPORE AIRLINES	433	1,083	413	31,405	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	1,198	1,203	2,386	181,130	銀行
UOL GROUP LIMITED	475	475	318	24,151	不動産
VENTURE CORP LTD	257	257	395	30,016	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,271	1,271	185	14,082	メディア・娯楽

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,674	7,522	1,888	143,290	電気通信サービス	
SEMCORP INDUSTRIES LTD	1,070	1,070	161	12,261	資本財	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	703	53,402	食品・飲料・タバコ	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,999	1,999	186	14,184	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	35,103 21	37,187 20	17,156 —	1,301,982 <0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
BANK HAOALIM BM	840	983	2,114	64,729	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,406	1,406	2,607	79,823	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	14	21	1,047	32,056	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	995	995	1,105	33,837	銀行	
ICL LTD	677	677	821	25,157	素材	
NICE LTD	48	61	3,909	119,683	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	82	125	857	26,262	銀行	
AZRIELI GROUP	43	43	794	24,334	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	4,108 8	4,313 8	13,259 —	405,885 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	934,079 1,265	1,036,450 1,248	— —	371,351,334 <92.9%>	

(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		期末	
	口	数 (千口)	口	数 (千口)	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)					千米ドル	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		9		10	1,682	180,935
BOSTON PROPERTIES		13		14	1,297	139,551
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		—		20	650	69,981
SL GREEN REALTY CORP		8		8	354	38,089
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		112		125	794	85,440
PROLOGIS INC		53		70	6,546	703,958
AVALONBAY COMMUNITIES INC		11		13	2,122	228,206
CAMDEN PROPERTY TRUST		8		8	813	87,457
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		14		16	537	57,786
DUKE REALTY CORP		29		35	1,220	131,234
CROWN CASTLE INTL CORP		34		39	6,695	719,991
ESSEX PROPERTY TRUST		5		6	1,572	169,122
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		31		35	2,159	232,209
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6		7	583	62,770
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		41		47	1,205	129,607
WELLTOWER INC		31		38	1,952	209,953
KIMCO REALTY CORP		35		35	414	44,583
LIBERTY PROPERTY TRUST		11		—	—	—
IRON MOUNTAIN INC		24		27	707	76,123
MACERICH CO/THE		10		—	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		7		16	1,035	111,320
HOST HOTELS AND RESORTS INC		67		67	814	87,587
MID-AMERICA APARTMENT COMM		10		10	1,284	138,096
REALTY INCOME CORP		24		30	1,679	180,557
REGENCY CENTERS CORP		14		14	637	68,579
UDR INC		24		28	1,078	116,010
SIMON PROPERTY GROUP		25		29	1,752	188,494
PUBLIC STORAGE		13		15	3,019	324,704
SUN COMMUNITIES INC		7		9	1,255	135,033
VENTAS INC		30		34	1,264	135,988
VORNADO REALTY TRUST		15		15	583	62,720
EXTRA SPACE STORAGE INC		10		12	1,198	128,867
DIGITAL REALTY TRUST INC		17		25	3,664	394,048
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		—		50	908	97,653
AGNC INVESTMENT CORP		46		46	605	65,114
VEREIT INC		77		105	589	63,366

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMERICAN TOWER CORPORATION	37	42	10,905	1,172,703	
WP CAREY INC	13	16	1,027	110,499	
INVITATION HOMES INC	24	51	1,348	144,971	
EQUINIX INC	6	8	5,641	606,661	
VICI PROPERTIES INC	—	44	857	92,159	
SBA COMMUNICATIONS CORP	9	10	3,340	359,174	
小 計	口 数 ・ 金 額	977	1,244	75,805	8,151,318
	銘柄 数 <比 率>	39	40	—	<2.0%>
(カナダ)			千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5	5	117	9,128	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	8	419	32,757	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9	9	97	7,641	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	15	228	17,823	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	12	172	13,448	
小 計	口 数 ・ 金 額	30	51	1,035	80,798
	銘柄 数 <比 率>	3	5	—	<0.0%>
(フランス)			千ユーロ		
ICADE	2	2	187	22,385	
KLEPIERRE	17	17	304	36,228	
GECINA SA	4	4	512	61,034	
COVIVIO(FP)	3	4	272	32,452	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	12	13	698	83,205	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	40	43	1,975	235,307
	銘柄 数 <比 率>	5	5	—	<0.1%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	79	79	315	41,804	
SEGRO PLC	102	106	907	120,251	
LAND SECURITIES GROUP PLC	58	58	351	46,635	
小 計	口 数 ・ 金 額	240	244	1,574	208,690
	銘柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	306	392	939	67,003	
APA GROUP	89	114	1,323	94,450	
GPT GROUP	136	167	693	49,471	
SYDNEY AIRPORT	89	89	542	38,725	
STOCKLAND	207	207	748	53,423	
DEXUS	94	94	853	60,889	
GOODMAN GROUP	140	162	2,500	178,417	

銘柄	口数 (千口)	当期首(前期末)	当期 末		
		口数 (千口)	口数 (千口)	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
VICINITY CENTERS	291	291	475	33,960	
LENDLEASE GROUP	44	55	725	51,776	
SCENTRE GROUP	486	486	1,158	82,641	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,885 10	2,062 10	9,961 — <0.2%>	
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	179	199	11,343	157,327	
HKT TRUST AND HKT LTD	375	375	4,237	58,774	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220	220	1,693	23,488	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	775 3	794 3	17,273 — <0.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST	200	200	386	29,337	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	197	274	832	63,213	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	243	243	403	30,612	
SUNTEC REIT	173	173	252	19,168	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	220	431	32,723	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	813 4	1,110 5	2,306 — <0.0%>	
合計	口数・金額 銘柄数<比率>	4,762 67	5,551 71	— — 9,801,520 <2.5%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄	別	当期 末	
		買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
外	S&P 500 EMIN	11,662	—
	S&P/TSE 60	617	—
	SWISS MKT IX	642	—
	DJ EURO STOXX	2,073	—
国	SPI 200 FUTU	584	—
	FTSE 100	1,022	—

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	371,351,334	92.8
投 資 信 託 受 益 証 券	267,214	0.1
投 資 証 券	9,534,306	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,823,253	4.7
投 資 信 託 財 産 総 額	399,976,107	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(399,219,015千円)の投資信託財産総額(399,976,107千円)に対する比率は99.8%です。

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

1米ドル=107.53円	1カナダドル=78.01円	1ユーロ=119.13円
1イギリスポンド=132.53円	1スイスフラン=111.52円	1スウェーデンクローナ=11.29円
1ノルウェークローネ=10.99円	1デンマーククローネ=15.98円	1オーストラリアドル=71.35円
1ニュージーランドドル=66.61円	1香港ドル=13.87円	1シンガポールドル=75.89円
1イスラエルシェケル=30.61円		

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年5月29日現在
(A) 資 産	402,195,345,012円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,894,244,271
株 式(評価額)	371,351,334,199
投資信託受益証券(評価額)	267,214,149
投資証券(評価額)	9,534,306,488
未 収 入 金	3,852,666,128
未 収 配 当 金	591,109,903
差 入 委 託 証 拠	5,704,469,874
(B) 負 債	2,470,278,214
未 払 金	2,220,284,050
未 払 解 約 金	249,992,491
未 払 利 息	1,673
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	399,725,066,798
元 本	154,591,953,075
次 期 繰 越 損 益 金	245,133,113,723
(D) 受 益 権 総 口 数	154,591,953,075口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,857円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	7,290,542,790円
受 取 配 当 金	7,248,829,634
受 取 利 息	33,535,852
そ の 他 収 益 金	18,881,038
支 払 利 息	△10,703,734
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,624,586,067
売 買 益	49,060,780,330
売 買 損	△40,436,194,263
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,634,186,238
取 引 益	5,651,157,190
取 引 損	△4,016,970,952
(D) そ の 他 費 用	△112,036,334
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	17,437,278,761
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	207,130,884,261
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	63,398,090,856
(H) 解 約 差 損 益 金	△42,833,140,155
(I) 計 (E+F+G+H)	245,133,113,723
次 期 繰 越 損 益 金(I)	245,133,113,723

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は137,985,205,997円、期中追加設定元本額は42,423,393,809円、期中一部解約元本額は25,816,646,731円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	37,420,761,750円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	27,044,464,309円
DC世界経済インデックスファンド	10,665,752,729円
DC外国株式インデックス・オープン	9,537,913,014円
世界経済インデックスファンド	8,312,169,752円
分散投資コア戦略ファンドS	6,179,969,248円
DCマイセレクション50	5,187,086,692円
DCマイセレクション75	5,058,962,760円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,503,070,291円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,390,972,142円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,327,586,550円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,264,957,748円
DCマイセレクションS50	2,218,627,505円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	2,179,602,892円
分散投資コア戦略ファンドA	2,163,193,200円
FOFs用 外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	2,050,262,713円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,831,169,460円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,785,124,825円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,784,023,314円
DCマイセレクションS75	1,610,296,090円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,292,706,846円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,251,074,322円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,232,594,809円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,178,678,308円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,169,273,352円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,148,728,270円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,043,837,929円
グローバル経済コア	1,001,463,806円
DCマイセレクション25	1,000,534,355円
SMTAMバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	822,817,503円
外国株式インデックス・オープン	809,534,821円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	745,043,764円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	662,558,161円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	475,028,107円
DCマイセレクションS25	432,611,322円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	404,388,381円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	402,638,376円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	399,488,655円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	340,736,198円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	335,306,185円
SMT インデックスバランス・オープン	240,558,752円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	201,852,207円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	167,156,979円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	152,906,563円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	145,758,315円

DCターゲット・イヤー ファンド2045	134,582,718円
SMT 世界経済インデックス・オープン バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	122,636,450円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	106,366,419円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	91,763,771円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	79,463,450円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	78,721,853円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	78,716,759円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	67,823,626円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	61,516,677円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	43,038,653円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	42,090,277円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	37,622,795円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	31,616,644円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	11,500,216円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,163,979円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,327,323円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	8,055,290円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,862,004円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,234,272円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,032,367円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	673,604円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	422,278円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	260,858円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	217,522円

## お知らせ

該当事項はありません。

# 新興国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日 2020年11月10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2008年12月11日から無期限です。
運用方針	新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	新興国の債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	債券率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率					
第8期(2016年11月10日)	14,906	△5.4	27,964.08	△5.3	96.4	—	—	百万円	22,824
第9期(2017年11月10日)	17,081	14.6	32,201.21	15.2	96.8	—	—	31,411	
第10期(2018年11月12日)	16,292	△4.6	30,698.89	△4.7	95.9	—	—	45,550	
第11期(2019年11月11日)	17,520	7.5	33,355.04	8.7	96.7	—	—	53,734	
第12期(2020年11月10日)	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—	—	61,667	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2019年11月11日	17,520	—	33,355.04	—	96.7	—
11月末	17,376	△0.8	32,946.41	△1.2	96.6	—
12月末	18,038	3.0	34,229.08	2.6	96.9	—
2020年1月末	17,799	1.6	33,847.00	1.5	94.3	—
2月末	17,440	△0.5	33,243.73	△0.3	95.4	—
3月末	15,028	△14.2	28,753.19	△13.8	95.5	—
4月末	15,355	△12.4	29,315.07	△12.1	94.4	—
5月末	16,317	△6.9	31,237.36	△6.3	92.3	—
6月末	16,517	△5.7	31,553.01	△5.4	91.9	—
7月末	16,479	△5.9	31,502.50	△5.6	94.4	—
8月末	16,514	△5.7	31,592.84	△5.3	94.9	—
9月末	16,094	△8.1	30,913.68	△7.3	96.7	—
10月末	16,082	△8.2	30,873.66	△7.4	97.3	—
(当期末) 2020年11月10日	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—

(注1)騰落率は期首比です。

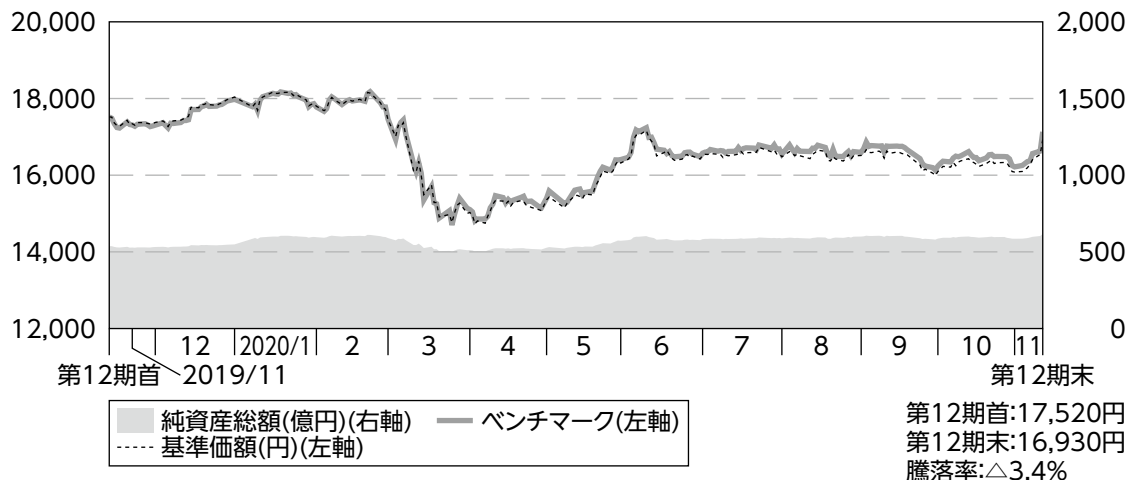
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)です。

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイドとは、新興国の現地通貨債市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

## 基準価額等の推移



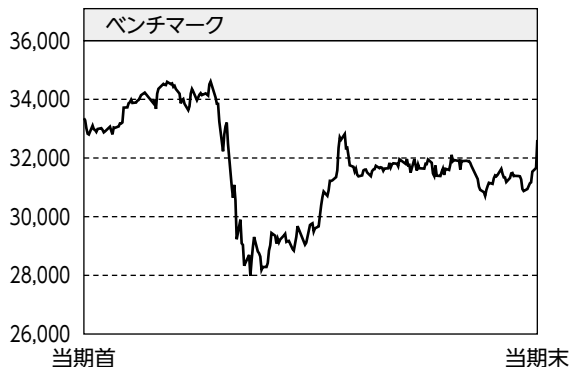
(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は下落しました。

2020年2月下旬にかけて、新興国通貨が概ねレンジ内の動きとなった一方、新興国金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は緩やかな上昇推移となりました。3月には、新型コロナウイルス感染の世界的拡大を背景に市場の不安心理が高まり、新興国通貨が対円で下落するとともに新興国金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は大幅に下落しました。4月以降6月上旬にかけては、市場の不安心理が和らぎリスク回避姿勢が後退したことから、新興国通貨が対円で上昇するとともに、新興国金利が再び低下し、基準価額は上昇しました。その後6月下旬にかけては、欧米株式市場の下落を受けたリスク回避の動きを受けて、新興国通貨が対円で下落し、基準価額は下落しました。7月以降期末にかけては、新型コロナウイルスのワクチン開発進展への期待が高まった一方で、欧州を中心に新型コロナウイルスの感染が再拡大したことなどを背景に、新興国金利に加え新興国通貨も対円でレンジ内推移となり、基準価額は概ねもみ合いで推移しました。

## 投資環境



新興国為替市場では、2020年2月下旬にかけて、新興国通貨は対円で概ねレンジ内で推移しました。3月に新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、新興国通貨は大幅に下落しましたが、4月以降6月上旬にかけては、市場の不安心理が和らいだことから、上昇しました。7月以降は、レンジ内推移が続きました。

新興国債券市場では、2020年2月にかけて金利は緩やかな低下推移となりましたが、3月にはリスク資産を現金化する動きが強まり、大幅に上昇しました。その後は、世界各国が一斉に金融緩和や資金供給を強めたことで市場の不安心理が和らぎ、金利は低下に転じ、6月以降は緩やかな低下推移となりました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)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

期を通じて高位を維持しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの投資国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

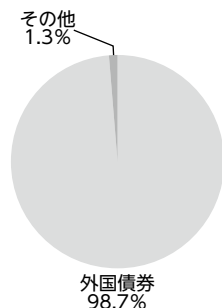
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	5.6%
2	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	1.6%
3	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.6%
4	BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	1.4%
5	BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	1.4%
6	BNTNF 10% 01/01/25	ブラジル	1.3%

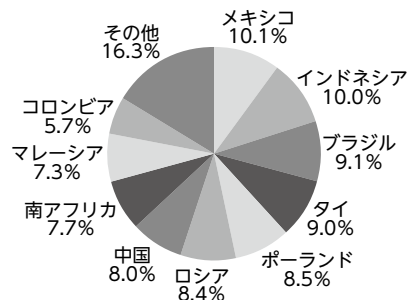
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MGS 3.885% 08/15/29	マレーシア	1.1%
8	CGB 2.94% 10/17/24	中国	1.1%
9	THAIGB 3.3% 06/17/38	タイ	1.1%
10	MBONO 7.5% 06/03/27	メキシコ	1.0%
組入銘柄数		202	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

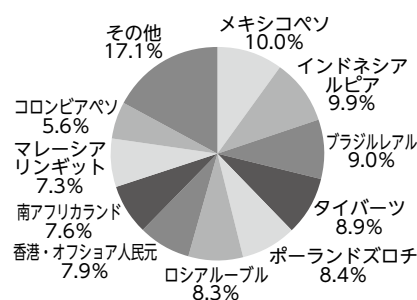
### ○資産別配分



### ○国別配分



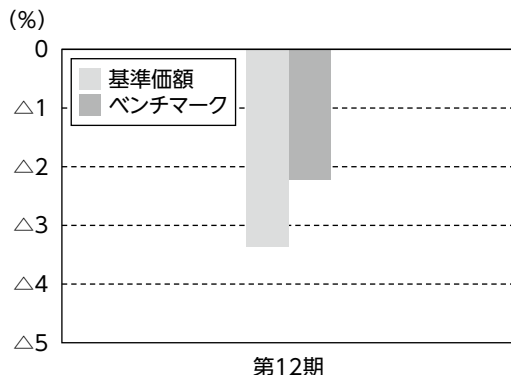
### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

取引コスト、カストディコスト、キャッシュ保有などが主なマイナス要因となりました。

## 今後の運用方針

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	16  (16)  (-) (0)	0.095  (0.095)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	16	0.095	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(16,586円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

## ＜公社債＞

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 327,855	千メキシコペソ 154,652
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルレアル 145,246	千ブラジルレアル 66,749
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 3,556,334	千チリペソ 3,082,730
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 64,181,840	千コロンビアペソ 57,269,000
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルーヌエボソル 10,458	千ペルーヌエボソル 13,299
	ド ミ ニ カ 共 和 国	国 債 証 券	千ドミニカペソ 8,295	千ドミニカペソ 8,222
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 17,491	千トルコリラ 27,682
	チ ェ コ	国 債 証 券	千チェココルナ 191,655	千チェココルナ 115,184
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 2,190,127	千ハンガリーフォリント 1,378,860
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 52,506	千ポーランドズロチ 41,530
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 1,347,851	千ロシアルーブル 431,588
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 101,807	千マレーシアリンギット 64,438
	タ イ	国 債 証 券	千タイバーツ 439,013	千タイバーツ 261,514
	国	フ ィ リ ピ ン	国 債 証 券	千フィリピンペソ 12,290
イ ン ド ネ シ ア		国 債 証 券	千インドネシアルピア 252,540,680	千インドネシアルピア 177,289,190
南 ア フ リ カ		国 債 証 券	千南アフリカランド 140,781	千南アフリカランド 87,956
中 国 オ フ シ ョ ア		国 債 証 券	千香港・オフショア人民元 306,254	千香港・オフショア人民元 -

(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。)

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

## ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 231	百万円 231	100.0	百万円 231	百万円 231	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	144,906	16,578	11.4	145,280	16,724	11.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	額 面 金 額	当 期		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	未		
		評 価 額				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
メ キ シ コ	千メキシコペソ 1,039,450	千メキシコペソ 1,157,194	千円 5,971,123	% 9.7	% —	% 5.3	% 2.9	% 1.6
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 283,550	千ブラジルレアル 279,488	5,461,204	8.9	8.9	1.6	5.7	1.5
チ リ	千チリペソ 10,145,000	千チリペソ 11,849,908	1,648,322	2.7	—	1.8	0.8	—
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 90,300,000	千コロンビアペソ 116,813,886	3,364,239	5.5	—	5.5	—	—
ペ ル ー	千ペルーヌエボソル 52,000	千ペルーヌエボソル 62,290	1,828,211	3.0	—	2.8	0.2	—
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 32,950	千ウルグアイペソ 34,391	84,946	0.1	—	0.1	—	0.1
ドミニカ共和国	千ドミニカペソ 45,400	千ドミニカペソ 46,962	84,533	0.1	0.1	0.1	0.1	—
ト ル コ	千トルコリラ 97,100	千トルコリラ 89,448	1,158,354	1.9	1.9	0.6	0.8	0.5
チ ェ コ	千チェココルナ 502,400	千チェココルナ 534,269	2,500,380	4.1	—	2.7	1.0	0.3
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 6,268,500	千ハンガリーフォリント 6,878,419	2,379,245	3.9	—	1.9	1.5	0.4
ポーランド	千ポーランドズロチ 168,700	千ポーランドズロチ 185,027	5,123,416	8.3	—	3.4	3.8	1.1
ロ シ ア	千ロシアルーブル 3,355,650	千ロシアルーブル 3,669,136	5,026,716	8.2	—	5.1	2.2	0.8
マレーシア	千マレーシアリンギット 158,200	千マレーシアリンギット 170,972	4,373,475	7.1	—	3.8	3.3	—
タ イ	千タイバーツ 1,388,400	千タイバーツ 1,574,452	5,447,604	8.8	—	6.2	1.9	0.8
フィリピン	千フィリピンペソ 45,000	千フィリピンペソ 54,199	118,696	0.2	—	0.1	0.1	—
インドネシア	千インドネシアルピア 731,000,000	千インドネシアルピア 796,262,765	5,971,970	9.7	—	6.7	2.5	0.5
南アフリカ	千南アフリカランド 736,600	千南アフリカランド 670,237	4,577,723	7.4	7.4	6.9	0.5	—
中国オフショア	千香港・オフショア人民元 304,800	千香港・オフショア人民元 302,417	4,808,433	7.8	—	4.8	3.0	—
合 計	—	—	59,928,600	97.2	18.3	59.4	30.3	7.5

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(メキシコ)</b>						
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
MBONO 10% 11/20/36	10.0	30,800	41,158	212,377	2036/11/20	
MBONO 10% 12/05/24	10.0	82,250	97,906	505,196	2024/12/5	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	61,800	63,506	327,692	2026/3/5	
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	108,200	111,786	576,820	2022/6/9	
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	51,950	54,608	281,778	2023/3/9	
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	72,300	74,576	384,815	2021/12/9	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	108,650	121,019	624,462	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	46,200	52,338	270,067	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	61,500	67,443	348,007	2042/11/13	
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	29,200	32,821	169,361	2034/11/23	
MBONO 8% 09/05/24	8.0	73,900	82,280	424,566	2024/9/5	
MBONO 8% 11/07/47	8.0	63,700	71,173	367,254	2047/11/7	
MBONO 8% 12/07/23	8.0	97,950	107,556	554,993	2023/12/7	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	93,600	111,010	572,814	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	57,450	68,007	350,916	2038/11/18	
小計				5,971,123		
<b>(ブラジル)</b>						
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル			
BLTN 0% 01/01/22	—	28,550	27,502	537,389	2022/1/1	
BLTN 0% 01/01/24	—	61,500	51,130	999,081	2024/1/1	
BLTN 0% 07/01/22	—	22,300	20,818	406,795	2022/7/1	
BLTN 0% 07/01/23	—	51,200	44,303	865,689	2023/7/1	
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	37,750	41,530	811,506	2023/1/1	
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	35,250	39,902	779,704	2025/1/1	
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	26,850	30,827	602,374	2027/1/1	
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	13,200	15,437	301,645	2029/1/1	
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	3,200	3,765	73,569	2031/1/1	
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,677	32,775	2028/1/10	
BRAZIL 12.5% 01/05/22	12.5	405,050	500	9,787	2022/1/5	
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	1,900	2,092	40,885	2024/1/5	
小計				5,461,204		
<b>(チリ)</b>						
国債証券		千チリペソ	千チリペソ			
BTPLC 2.5% 03/01/25	2.5	2,535,000	2,662,270	370,321	2025/3/1	
BTPLC 4% 03/01/23	4.0	945,000	1,021,364	142,071	2023/3/1	
BTPLC 4.5% 03/01/26	4.5	1,690,000	1,949,617	271,191	2026/3/1	
BTPLC 4.7% 09/01/30	4.7	1,480,000	1,751,515	243,635	2030/9/1	
BTPLC 5% 03/01/35	5.0	1,930,000	2,309,381	321,235	2035/3/1	
BTPLC 6% 01/01/43	6.0	1,565,000	2,155,758	299,865	2043/1/1	
小計				1,648,322		
<b>(コロンビア)</b>						
国債証券		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	90,300,000	116,813,886	3,364,239	2027/6/28	
<b>(ペルー)</b>						
国債証券		千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル			
PERUGB 5.35% 08/12/40	5.35	3,950	3,962	116,284	2040/8/12	
PERUGB 5.4% 08/12/34	5.4	5,400	5,799	170,226	2034/8/12	
PERUGB 5.7% 08/12/44	5.7	3,650	4,298	126,162	2044/8/12	
PERUGB 5.94% 02/12/29	5.94	7,150	8,670	254,481	2029/2/12	
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	6,050	7,100	208,412	2032/8/12	
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	6,450	7,983	234,326	2028/8/12	
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	6,950	8,347	244,999	2037/8/12	
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	6,750	8,503	249,584	2031/8/12	
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	5,650	7,622	223,732	2026/8/12	
小計				1,828,211		
<b>(ウルグアイ)</b>						
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
URUGUA 8.5% 03/15/28	8.5	15,600	16,368	40,430	2028/3/15	
URUGUA 9.875% 06/20/22	9.875	17,350	18,022	44,515	2022/6/20	
小計				84,946		
<b>(ドミニカ共和国)</b>						
国債証券		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ			
DOMREP 8.9% 02/15/23	8.9	20,400	20,714	37,285	2023/2/15	
DOMREP 9.75% 06/05/26	9.75	25,000	26,248	47,247	2026/6/5	
小計				84,533		

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(トルコ)</b>						
国債証券		千トルコリラ	千トルコリラ			
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	3,950	3,595	46,555	2024/3/20	
TURKGB 10.5% 08/11/27	10.5	8,650	7,755	100,433	2027/8/11	
TURKGB 10.6% 02/11/26	10.6	9,950	9,113	118,019	2026/2/11	
TURKGB 10.7% 08/17/22	10.7	8,150	7,661	99,209	2022/8/17	
TURKGB 11% 02/24/27	11.0	9,150	8,363	108,308	2027/2/24	
TURKGB 11% 03/02/22	11.0	6,550	6,264	81,127	2022/3/2	
TURKGB 12.2% 01/18/23	12.2	9,900	9,547	123,635	2023/1/18	
TURKGB 12.4% 03/08/28	12.4	4,700	4,558	59,306	2028/3/8	
TURKGB 16.2% 06/14/23	16.2	6,000	6,249	80,924	2023/6/14	
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	6,200	5,346	69,235	2023/3/8	
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	7,100	5,748	74,446	2025/3/12	
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	3,750	3,420	44,300	2022/9/14	
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	7,250	6,344	82,163	2024/7/24	
TURKGB 9.5% 01/12/22	9.5	5,800	5,479	70,955	2022/1/12	
小計				1,158,354		
<b>(チェコ)</b>						
国債証券		千チェココロン	千チェココロン			
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	48,700	47,032	220,112	2027/2/10	
CZGB 0.45% 10/25/23	0.45	50,000	50,226	235,057	2023/10/25	
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	46,900	46,501	217,628	2030/5/15	
CZGB 1% 06/26/26	1.0	67,200	68,382	320,227	2026/6/26	
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	30,900	31,257	146,285	2031/3/13	
CZGB 2% 10/13/33	2.0	49,200	54,234	253,818	2033/10/13	
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	39,500	42,921	200,870	2025/9/17	
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	47,800	53,661	251,136	2028/8/25	
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	48,700	56,160	262,830	2029/7/23	
CZGB 4.7% 09/12/22	4.7	35,800	38,932	182,202	2022/9/12	
CZGB 5.7% 05/25/24	5.7	37,700	44,959	210,410	2024/5/25	
小計				2,500,380		
<b>(ハンガリー)</b>						
国債証券		千ハンガリーフォロント	千ハンガリーフォロント			
HGB 1% 11/26/25	1.0	475,000	467,039	161,548	2025/11/26	
HGB 1.5% 08/23/23	1.5	322,500	325,660	112,645	2023/8/23	
HGB 1.75% 10/26/22	1.75	462,000	470,246	162,658	2022/10/26	
HGB 2.5% 10/24/24	2.5	548,000	575,361	199,017	2024/10/24	
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	470,500	503,547	174,177	2026/12/22	
HGB 3% 06/26/24	3.0	402,500	428,328	148,158	2024/6/26	
HGB 3% 08/21/30	3.0	555,000	602,702	208,474	2030/8/21	
HGB 3% 10/27/27	3.0	592,000	643,344	222,532	2027/10/27	
HGB 3% 10/27/38	3.0	186,000	204,797	70,839	2038/10/27	
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	452,000	501,453	173,452	2031/10/22	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	660,000	785,089	271,562	2025/6/24	
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	531,000	607,671	210,193	2023/11/24	
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	332,000	454,328	157,152	2028/10/22	
HGB 7% 06/24/22	7.0	280,000	308,848	106,830	2022/6/24	
小計				2,379,245		
<b>(ポーランド)</b>						
国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,350	4,353	120,557	2030/10/25	
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	12,000	12,390	343,082	2022/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	10,850	11,729	324,789	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	19,900	20,981	580,979	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	19,850	21,496	595,234	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	19,400	21,483	594,885	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	14,950	16,635	460,635	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	14,200	16,071	445,025	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	15,050	17,158	475,114	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	13,250	15,027	416,114	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	14,050	15,688	434,410	2023/10/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	10,850	12,011	332,586	2022/9/23	
小計				5,123,416		
<b>(ロシア)</b>						
国債証券		千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
RFLB 4.5% 07/16/25	4.5	82,500	80,642	110,480	2025/7/16	

銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
RFLB 6% 10/06/27	6.0	213,500	220,210	301,688	2027/10/6
RFLB 6.5% 02/28/24	6.5	163,100	171,401	234,820	2024/2/28
RFLB 6.9% 05/23/29	6.9	158,000	171,257	234,623	2029/5/23
RFLB 7% 01/25/23	7.0	71,200	74,893	102,604	2023/1/25
RFLB 7% 08/16/23	7.0	107,200	113,522	155,526	2023/8/16
RFLB 7% 12/15/21	7.0	132,500	136,198	186,591	2021/12/15
RFLB 7.05% 01/19/28	7.05	146,000	159,296	218,235	2028/1/19
RFLB 7.1% 10/16/24	7.1	164,100	176,620	241,970	2024/10/16
RFLB 7.15% 11/12/25	7.15	210,400	229,100	313,867	2025/11/12
RFLB 7.25% 05/10/34	7.25	160,500	177,418	243,063	2034/5/10
RFLB 7.4% 07/17/24	7.4	202,200	219,178	300,274	2024/7/17
RFLB 7.4% 12/07/22	7.4	165,100	174,698	239,337	2022/12/7
RFLB 7.6% 07/20/22	7.6	198,700	208,879	286,164	2022/7/20
RFLB 7.65% 04/10/30	7.65	226,500	257,795	353,179	2030/4/10
RFLB 7.7% 03/16/39	7.7	146,500	171,286	234,662	2039/3/16
RFLB 7.7% 03/23/33	7.7	158,000	180,034	246,647	2033/3/23
RFLB 7.75% 09/16/26	7.75	180,500	202,898	277,970	2026/9/16
RFLB 7.95% 10/07/26	7.95	181,000	205,424	281,431	2026/10/7
RFLB 8.15% 02/03/27	8.15	156,000	179,025	245,265	2027/2/3
RFLB 8.5% 09/17/31	8.5	132,150	159,351	218,311	2031/9/17
小計				5,026,716	
(マレーシア)		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券					
MCS 3.478% 06/14/24	3.478	5,150	5,415	138,529	2024/6/14
MCS 3.48% 03/15/23	3.48	22,850	23,747	607,456	2023/3/15
MCS 3.502% 05/31/27	3.502	9,450	10,151	259,667	2027/5/31
MCS 3.733% 06/15/28	3.733	6,950	7,555	193,274	2028/6/15
MCS 3.757% 04/20/23	3.757	4,850	5,069	129,673	2023/4/20
MCS 3.8% 08/17/23	3.8	8,650	9,103	232,856	2023/8/17
MCS 3.828% 07/05/34	3.828	7,500	8,239	210,777	2034/7/5
MCS 3.885% 08/15/29	3.885	24,350	26,802	685,602	2029/8/15
MCS 3.899% 11/16/27	3.899	13,500	14,805	378,713	2027/11/16
MCS 3.9% 11/30/26	3.9	8,050	8,790	224,851	2026/11/30
MCS 3.906% 07/15/26	3.906	8,400	9,153	234,156	2026/7/15
MCS 3.955% 09/15/25	3.955	9,400	10,234	261,799	2025/9/15
MCS 4.059% 09/30/24	4.059	13,800	14,863	380,210	2024/9/30
MCS 4.181% 07/15/24	4.181	9,450	10,185	260,552	2024/7/15
MCS 4.762% 04/07/37	4.762	5,850	6,855	175,354	2037/4/7
小計				4,373,475	
(タイ)		千タイバート	千タイバート		
国債証券					
THAIGB 1.45% 12/17/24	1.45	86,000	88,333	305,632	2024/12/17
THAIGB 1.6% 06/17/35	1.6	37,400	37,638	130,228	2035/6/17
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	80,200	82,253	284,598	2029/12/17
THAIGB 1.875% 06/17/22	1.875	67,300	68,724	237,785	2022/6/17
THAIGB 2% 12/17/22	2.0	53,500	55,076	190,563	2022/12/17
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	96,100	102,495	354,634	2026/12/17
THAIGB 2.4% 12/17/23	2.4	101,000	106,389	368,107	2023/12/17
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	65,400	73,644	254,809	2028/12/17
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	157,100	192,412	665,748	2038/6/17
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	126,700	156,980	543,150	2036/6/17
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	84,000	90,499	313,129	2023/6/16
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	114,300	139,499	482,669	2031/6/20
THAIGB 3.65% 12/17/21	3.65	63,100	65,257	225,790	2021/12/17
THAIGB 3.775% 06/25/32	3.775	80,400	100,293	347,015	2032/6/25
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	82,400	94,544	327,125	2025/12/12
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	93,500	120,409	416,616	2029/6/22
小計				5,447,604	
(フィリピン)		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
国債証券					
PHILIP 3.9% 11/26/22	3.9	15,000	15,326	33,564	2022/11/26
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	30,000	38,873	85,132	2036/1/14
小計				118,696	
(インドネシア)		千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
国債証券					
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,300,000	9,353,052	70,147	2030/8/15
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	16,200,000	19,959,534	149,696	2025/9/15
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	47,700,000	48,980,745	367,355	2023/5/15

銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	25,000,000	24,837,500	186,281	2028/5/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	7,000,000	7,133,140	53,498	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	44,100,000	46,323,963	347,429	2025/6/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	24,000,000	23,660,640	177,545	2033/5/15
INDOGB 7% 05/15/22	7.0	85,900,000	37,534,168	281,506	2022/5/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	86,800,000	38,770,272	290,777	2027/5/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	54,000,000	57,208,140	429,601	2030/9/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	13,000,000	13,534,560	101,509	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	19,300,000	19,966,815	149,751	2038/5/15
INDOGB 7.5% 06/15/35	7.5	20,200,000	21,633,998	162,254	2035/6/15
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	21,900,000	23,133,846	173,503	2032/8/15
INDOGB 8.125% 05/15/24	8.125	35,600,000	39,168,900	293,766	2024/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	31,700,000	35,839,069	268,979	2029/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	33,200,000	36,785,600	275,892	2036/5/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	30,400,000	33,697,488	252,731	2032/6/15
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	46,600,000	51,435,216	385,764	2024/3/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	52,000,000	59,043,920	442,829	2034/3/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	21,200,000	23,633,548	177,251	2039/4/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	44,100,000	49,806,099	373,545	2026/9/15
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	18,700,000	21,711,448	162,835	2031/5/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	33,700,000	39,371,710	295,287	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	13,739,394	103,045	2031/7/15
小計				5,971,970	
(南アフリカ)		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券					
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	115,000	135,855	927,891	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	34,700	24,283	165,853	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	34,100	22,507	153,722	2041/2/28
SAGB 7% 02/28/31	7.0	41,800	35,598	243,140	2031/2/28
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	45,000	48,770	333,102	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	93,900	89,529	611,489	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	49,200	44,117	301,323	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	68,700	57,054	389,683	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	68,200	55,728	380,624	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	89,300	72,358	494,211	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	61,700	54,646	373,235	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	35,000	29,787	203,445	2040/1/31
小計				4,577,723	
(中国オフショア)		千香港・オフショア人民元	千香港・オフショア人民元		
国債証券					
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	20,000	19,102	303,721	2025/4/9
CGB 2.36% 07/02/23	2.36	28,900	24,121	383,272	2023/7/2
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	24,500	27,616	439,103	2030/5/21
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	24,500	23,909	380,157	2027/6/4
CGB 2.94% 10/17/24	2.94	43,000	43,006	683,809	2024/10/17
CGB 3.12% 12/05/26	3.12	20,000	19,987	317,802	2026/12/5
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	20,700	20,535	326,513	2029/11/21
CGB 3.19% 04/11/24	3.19	14,000	14,116	224,447	2024/4/11
CGB 3.22% 12/06/25	3.22	12,000	12,126	192,818	2025/12/6
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	35,000	35,345	561,998	2026/6/6
CGB 3.25% 11/22/28	3.25	20,200	20,224	321,565	2028/11/22
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	26,000	26,134	415,545	2029/5/23
CGB 3.29% 10/18/23	3.29	16,000	16,190	257,422	2023/10/18
小計				4,808,433	
合計				59,928,600	

(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。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 59,928,600	% 96.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,521,363	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	62,449,963	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(61,533,810千円)の投資信託財産総額(62,449,963千円)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=105.21円	1メキシコペソ=5.16円	1ブラジルレアル=19.54円
1チリペソ=0.1391円	1コロンビアペソ=0.0288円	1ペルーヌエボソル=29.35円
1ウルグアイペソ=2.47円	1ドミニカペソ=1.80円	1トルコリラ=12.95円
1チェココルナ=4.68円	1ハンガリーフォリント=0.3459円	1ポーランドズロチ=27.69円
1ロシアルーブル=1.37円	1マレーシアリンギット=25.58円	1タイバーツ=3.46円
1フィリピンペソ=2.19円	1インドネシアルピア=0.0075円	1南アフリカランド=6.83円
1香港・オフショア人民元=15.90円		

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年11月10日現在
(A) 資 産	62,591,485,008円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,537,995,092
公 社 債 (評価額)	59,928,600,984
未 収 入 金	186,858,417
未 収 利 息	880,175,773
前 払 費 用	57,854,742
(B) 負 債	924,413,785
未 払 金	828,301,240
未 払 解 約 金	96,112,220
未 払 利 息	325
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	61,667,071,223
元 本	36,424,298,034
次 期 繰 越 損 益 金	25,242,773,189
(D) 受 益 権 総 口 数	36,424,298,034口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,930円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	2,973,671,838円
受 取 利 息	2,973,959,363
支 払 利 息	△287,525
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,844,744,754
売 買 益	1,706,839,507
売 買 損	△6,551,584,261
(C) そ の 他 費 用	△53,655,997
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△1,924,728,913
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,064,467,283
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,926,264,600
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,823,229,781
(H) 計 (D+E+F+G)	25,242,773,189
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	25,242,773,189

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は30,670,496,451円、期中追加設定元本額は8,460,500,886円、期中一部解約元本額は2,706,699,303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世界経済インデックスファンド	8,171,516,227円
世界経済インデックスファンド	6,455,802,300円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,706,190,913円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,289,994,117円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	3,345,935,872円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,804,193,380円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,812,756,551円
グローバル経済コア	672,487,025円
分散投資コア戦略ファンドS	592,208,542円
コア投資戦略ファンド(成長型)	407,214,225円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	316,039,597円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	307,965,962円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	305,373,086円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	303,324,436円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	286,557,897円
分散投資コア戦略ファンドA	251,578,523円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	189,767,663円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	181,716,909円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	169,236,557円
SMT 世界経済インデックス・オープン	168,625,526円
SMT インデックスバランス・オープン	163,144,126円
コア投資戦略ファンド(安定型)	138,847,350円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	89,126,174円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	87,578,065円
コア投資戦略ファンド(切替型)	86,647,214円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	84,097,021円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	28,048,658円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,101,480円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	2,598,606円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	520,047円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	445,927円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	414,883円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	243,175円

## お知らせ

該当事項はありません。

# 新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第12期（決算日 2020年11月10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2008年12月12日から無期限です。
運用方針	主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)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割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

**【本運用報告書の記載について】**

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
第8期(2016年11月10日)	円	%		%	%	%	百万円
	21,467	△8.2	18,491	△10.5	98.6	0.7	29,752
第9期(2017年11月10日)	30,310	41.2	25,570	38.3	98.5	1.0	47,713
第10期(2018年11月12日)	26,828	△11.5	22,122	△13.5	96.2	3.2	49,931
第11期(2019年11月11日)	28,752	7.2	23,119	4.5	96.3	3.0	62,222
第12期(2020年11月10日)	31,648	10.1	24,951	7.9	95.8	3.8	82,503

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2019年11月11日	円	%		%	%	%
	28,752	－	23,119	－	96.3	3.0
11月末	28,549	△0.7	22,889	△1.0	96.9	2.4
12月末	30,415	5.8	24,376	5.4	97.5	8.6
2020年1月末	29,045	1.0	23,271	0.7	94.4	4.9
2月末	28,000	△2.6	22,433	△3.0	96.4	3.1
3月末	22,550	△21.6	18,010	△22.1	92.5	7.0
4月末	24,539	△14.7	19,548	△15.4	97.3	2.5
5月末	24,822	△13.7	19,790	△14.4	95.5	4.2
6月末	26,859	△6.6	21,300	△7.9	95.1	4.6
7月末	28,550	△0.7	22,512	△2.6	93.8	5.8
8月末	29,844	3.8	23,504	1.7	93.7	6.0
9月末	28,549	△0.7	22,491	△2.7	96.3	3.5
10月末	29,598	2.9	23,303	0.8	95.3	4.4
(当期末) 2020年11月10日	31,648	10.1	24,951	7.9	95.8	3.8

(注1)騰落率は期首比です。

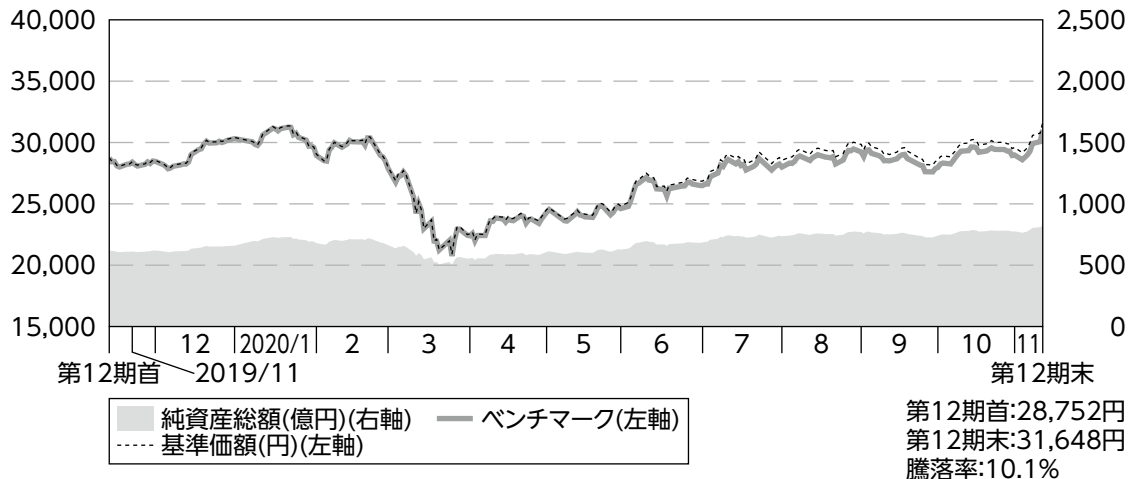
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国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。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

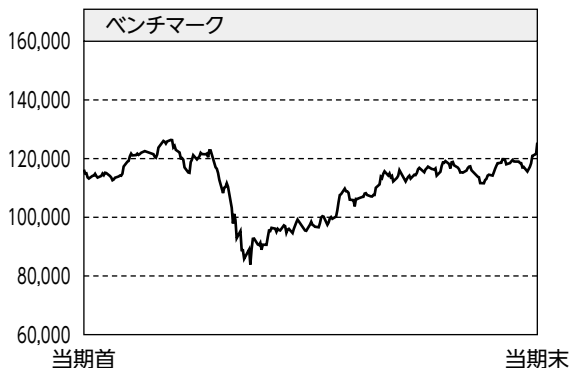


(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



新興国株式市場は上昇しました。

2020年1月中旬までは、米中両政府が通商協議の第1段階の合意に達するなど米中関係改善への期待から概ね堅調に推移しました。しかし、1月下旬から3月中旬にかけては中国湖北省武漢市で発生した新型コロナウイルスの世界的な感染急拡大を受けて景気減速懸念が強まったことを背景に大幅に下落しました。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が高まったことから急速に値を戻し、その後も中国の堅調な経済指標が好感されたことなどから上昇して期末を迎えました。

外国為替市場では、ブラジル・リアルやインド・ルピーなどの新興国通貨に対して円高が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 組入比率

資金の流出入などには、コスト抑制の観点から海外の株価指数先物を利用し、DR(預託証券)および先物を含む株式の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

DRを含むベンチマーク構成銘柄に分散投資し、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

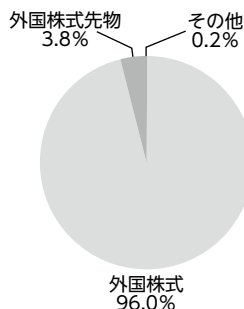
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン諸島	7.5%
2	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	6.3%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	5.4%
4	MSCI EMERG M 2012	ー	3.8%
5	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.5%

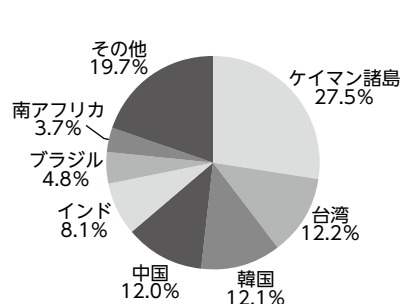
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
6	MEITUAN-CLASS B	ケイマン諸島	2.1%
7	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.3%
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.1%
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.0%
10	JD.COM INC-ADR	ケイマン諸島	1.0%
組入銘柄数			1,189

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

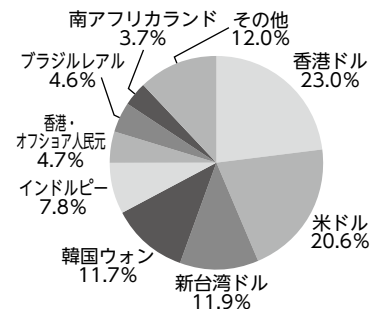
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

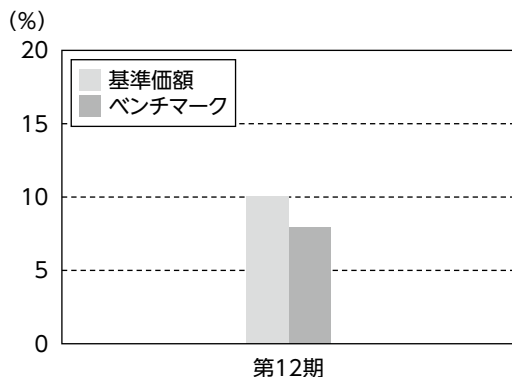


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.8%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概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当要因\* (プラス要因)です。

\*ベンチマークは配当金を除いた指数である一方、当ファンドでは税引き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

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	9円	0.031%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(6)	(0.021)	
(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)	(3)	(0.009)	
(b) 有価証券取引税	4	0.016	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(4)	(0.016)	
(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	42	0.150	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(42)	(0.150)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	55	0.197	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(27,610円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 8,211 (351)	千米ドル 28,030 (-)	百株 2,091	千米ドル 2,604
	メ キ シ コ	12,274 (-)	千メキシコペソ 33,314 (△70)	6,331	千メキシコペソ 10,656
	ブ ラ ジ ル	12,296 (5,608)	千ブラジルリアル 35,749 (1,054)	2,646 (612)	千ブラジルリアル 4,168 (709)
	チ リ	19,256 (2)	千チリペソ 382,468 (-)	167,850	千チリペソ 155,222
	コ ロ ン ビ ア	160	千コロンビアペソ 293,715	3,820	千コロンビアペソ 1,069,816
	ギ リ シ ャ	122 (-)	千ユーロ 173 (△0.8716)	4,809	千ユーロ 365
	ト ル コ	3,665 (497)	千トルコリラ 2,927 (-)	1,144	千トルコリラ 1,748
	チ ェ コ	44	千チェココルナ 2,028	-	千チェココルナ -
	ハ ン ガ リ ー	147	千ハンガリーフォリント 84,931	-	千ハンガリーフォリント -
	ポ ー ラ ン ド	2,018	千ポーランドズロチ 5,422	1,233	千ポーランドズロチ 958
国	香 港	155,245 (14,601)	千香港ドル 222,530 (435)	74,325 (4,350)	千香港ドル 25,534 (0.00004)
	マ レ ー シ ア	12,132 (5,365)	千マレーシアリングgit 9,366 (41)	7,450	千マレーシアリングgit 1,545
	タ イ	49,842 (3,303)	千タイバーツ 86,675 (3,819)	4,701 (348)	千タイバーツ 9,435 (2,701)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フィリピン	百株 8,090 (157)	千フィリピンペソ 47,316 (34)	百株 9,681 (-)	千フィリピンペソ 11,485 (49)
	インドネシア	42,506 (4,744)	千インドネシアルピア 19,479,143 (-)	62,734	千インドネシアルピア 8,488,211
	韓 国	3,072 (136)	千韓国ウォン 14,483,013 (174,763)	2,143 (50)	千韓国ウォン 4,367,672 (77,412)
	台 湾	44,060 (5,007)	千新台幣ドル 317,767 (595)	12,193	千新台幣ドル 72,727
	イ ン ド	12,083 (906)	千インドルピー 828,271 (2,885)	10,781 (30)	千インドルピー 111,677 (480)
	カ タ ー ル	2,098	千カタールリアル 2,588	2,064	千カタールリアル 678
	南 ア フ リ カ	8,397 (2,056)	千南アフリカランド 79,971 (3,454)	5,696 (-)	千南アフリカランド 24,357 (3,454)
	アラブ首長国連邦	5,543	千アラブ首長国連邦ディルハム 4,451	1,583	千アラブ首長国連邦ディルハム 392
	サウジアラビア	5,673 (274)	千サウジアラビアリアル 23,481 (-)	-	千サウジアラビアリアル -
	中国 オ フ シ ョ ア	75,688 (2,298)	千香港・オフショア人民元 122,102 (168)	29,996	千香港・オフショア人民元 45,148

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	イ タ	証券 — (66,650)	千タイバーツ — (358)	証券 66,650	千タイバーツ 227

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	— (—)	— (△301)	—	—
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	15,100	1,720	—	—
	小 計	15,100 (—)	1,720 (△301)	—	—
	ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
	SUL AMERICA SA-UNITS	10,400	659	—	—
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	18,700	485	—	—
	KLABIN SA-UNIT	—	—	18,400	321
	小 計	29,100	1,144	18,400	321
	南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
	REDEFINE PROPERTIES LTD	—	—	547,985	1,051
	FORTRESS REIT LTD-A	—	—	189,245 (—)	2,099 (185)
	RESILIENT REIT LTD	— (2,789)	— (185)	2,425 (364)	82 (12)
	小 計	— (2,789)	— (185)	739,655 (364)	3,233 (197)

(注1)金額は受渡代金です。

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

## ＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 23,074	百万円 22,185	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

## 株式売買比率

## ＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	17,990,951千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	64,551,209千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.27

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

## ■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 24	百万円 24	% 100.0	百万円 24	百万円 24	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	25,766	2,194	8.5	25,806	2,207	8.6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当期末(前期末)	当期			業種
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)				千米ドル	
BBVA ARGENTINA SA-ADR	312	—	—	—	銀行
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	218	22,995	素材
CREDICORP LTD	64	73	1,008	106,067	銀行
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	398	398	333	35,095	電気通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP	54	113	621	65,369	素材
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	63	147	106	11,178	電気通信サービス
TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	73	—	—	—	エネルギー
YPF S. A.-SPONSORED ADR	155	155	64	6,756	エネルギー
BANCO MACRO SA-ADR	40	—	—	—	銀行
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	134	151	2,658	279,697	消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	474	474	1,016	106,918	小売
PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	56	—	—	—	公益事業
TAL EDUCATION GROUP- ADR	387	409	2,922	307,481	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	20	20	59	6,249	各種金融
BEST INC - ADR	—	141	38	4,012	運輸
HUYA INC-ADR	—	82	172	18,158	メディア・娯楽
NIO INC - ADR	538	963	4,240	446,155	自動車・自動車部品
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	90	390	591	62,183	メディア・娯楽
58.COM INC-ADR	94	—	—	—	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR	52	65	678	71,366	メディア・娯楽
GSX TECHEDU INC- ADR	—	78	543	57,147	消費者サービス
KE HOLDINGS INC	—	100	720	75,751	不動産
GLOBANT SA	31	38	788	82,982	ソフトウェア・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	1,374	2,020	58,707	6,176,635	小売
YUM CHINA HOLDINGS INC	333	380	2,184	229,786	消費者サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	299	389	1,205	126,794	運輸
TRIP.COM GROUP LTD	454	524	1,916	201,633	小売
SINA CORP	57	57	244	25,761	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR	68	439	3,860	406,124	メディア・娯楽
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	87	—	—	—	銀行
51JOB INC-ADR	16	27	196	20,625	商業・専門サービス
BAIDU INC - SPON ADR	267	293	4,232	445,352	メディア・娯楽
YANDEX NV-A	—	321	2,093	220,210	メディア・娯楽
HUAZHU GROUP LTD-ADR	139	139	626	65,864	消費者サービス
JOYY INC	61	61	616	64,870	メディア・娯楽
GDS HOLDINGS LTD - ADR	44	76	699	73,556	ソフトウェア・サービス
ZAI LAB LTD-ADR	—	51	453	47,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	—	121	559	58,848	メディア・娯楽
WEIBO CORP-SPON ADR	52	52	239	25,182	メディア・娯楽

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
JD.COM INC-ADR	719	912	7,741	814,458	小売	
MOMO INC-SPON ADR	129	155	232	24,507	メディア・娯楽	
BAOZUN INC-SPN ADR	35	35	142	14,999	小売	
PINDUODUO INC-ADR	177	289	3,076	323,630	小売	
IQIYI INC-ADR	119	212	572	60,265	メディア・娯楽	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	36	72	232	24,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,040	1,040	68	7,166	エネルギー	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	544	544	45	4,781	不動産	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	367	432	2,728	287,099	エネルギー	
GAZPROM OAO-SPON ADR	5,238	6,573	2,905	305,690	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	1,472	1,738	700	73,693	銀行	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	1,604	1,232	592	62,349	エネルギー	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	92	108	1,688	177,604	エネルギー	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	155	195	495	52,124	素材	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	664	704	1,906	200,581	素材	
ROSNEFT OJSC-GDR	1,335	1,465	762	80,248	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	387	387	557	58,619	素材	
TATNEFT-SPONSORED ADR	261	269	1,028	108,210	エネルギー	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	2,059	3,780	325	34,205	銀行	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	398	472	708	74,524	食品・生活必需品小売り	
SBERBANK-SPONSORED ADR	2,537	2,969	3,655	384,569	銀行	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	268	268	344	36,284	素材	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	71	79	830	87,357	素材	
DP WORLD PLC	211	—	—	—	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	26,398	32,869	125,957	13,251,972	
(メキシコ)		56	56	—	<16.1%>	
ALFA S. A. B. -A	3,599	3,599	5,304	27,373	資本財	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,791	2,156	28,641	147,789	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	109	—	—	—	小売	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,580	2,233	7,001	36,125	メディア・娯楽	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,324	1,818	7,484	38,621	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S. A. B. -B	259	259	5,661	29,212	食品・飲料・タバコ	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	169	169	2,627	13,558	運輸	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	375	1,603	8,275	資本財	
CEMEX SAB-SPONS	14,556	15,451	13,458	69,445	素材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,476	2,892	29,778	153,659	銀行	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	968	968	3,682	19,000	素材	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	145	145	4,551	23,487	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,818	1,818	5,661	29,212	家庭用品・パーソナル用品	
ALSEA SAB DE CV	343	—	—	—	消費者サービス	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	233	233	7,126	36,773	運輸	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,812	3,503	22,225	114,682	素材	
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	33,042	36,254	50,937	262,837	電気通信サービス	

銘柄	株数 (百株)	当	期		業	種	
		期首(前期末)	当	末			
		株数 (百株)	株数 (百株)	評 価			額
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)			
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,525	2,525	4,214	21,745	銀行		
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	336	504	4,666	24,078	食品・飲料・タバコ		
WALMART DE MEXICO-SER V	5,102	5,798	30,913	159,513	食品・生活必需品小売り		
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	310	436	8,963	46,252	運輸		
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	314	314	2,125	10,967	メディア・娯楽		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	377	575	4,177	21,555	公益事業		
BECE SAB DE CV	—	481	2,261	11,667	食品・飲料・タバコ		
小 計	76,570	82,513	253,068	1,305,834			
株数・金額 銘柄数<比率>	23	22	—	<1.6%>			
(ブラジル)			千ブラジルリアル				
BRF SA	525	525	971	18,978	食品・飲料・タバコ		
VALE SA	3,024	3,957	25,009	488,679	素材		
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	—	79	548	10,725	公益事業		
TIM PARTICIPACOES SA	729	—	—	—	電気通信サービス		
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	177	334	1,132	22,124	公益事業		
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	241	336	1,136	22,210	公益事業		
BANCO DO BRASIL S.A.	811	883	2,887	56,419	銀行		
ITAUSA SA	4,435	5,058	5,276	103,096	銀行		
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	637	957	2,418	47,262	小売		
GERDAU SA-PREF	870	1,050	2,310	45,137	素材		
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	—	197	1,298	25,367	食品・生活必需品小売り		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,927	4,230	9,263	181,012	エネルギー		
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	760	760	1,662	32,477	小売		
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,024	4,846	10,473	204,643	エネルギー		
COGNA EDUCACAO	1,381	1,812	891	17,428	消費者サービス		
CCR SA	1,256	1,256	1,561	30,506	運輸		
WEG SA	848	928	7,627	149,042	資本財		
BANCO BRADESCO SA-PREF	3,834	4,839	11,101	216,928	銀行		
BANCO BRADESCO S.A.	1,163	1,466	3,041	59,422	銀行		
NATURA COSMETICOS SA	414	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品		
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	630	630	1,319	25,789	素材		
SUZANO SA	506	626	3,051	59,620	素材		
CPFL ENERGIA SA	—	338	1,036	20,256	公益事業		
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4,669	5,293	14,626	285,807	銀行		
PORTO SEGURO SA	73	73	373	7,303	保険		
BRASKEM SA-PREF A	148	148	357	6,989	素材		
ENGIE BRASIL SA	167	292	1,284	25,090	公益事業		
LOCALIZA RENT A CAR	590	619	4,095	80,016	運輸		
LOJAS RENNER S.A.	829	829	3,977	77,727	小売		
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	1,512	29,559	エネルギー		
COSAN SA	184	184	1,356	26,497	エネルギー		
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	130	1,104	2,423	47,350	公益事業		
EMBRAER SA	697	—	—	—	資本財		
M DIAS BRANCO SA	63	—	—	—	食品・飲料・タバコ		

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
B2W CIA DIGITAL	269	223	1,780	34,800	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA	859	—	—	—	不動産
JBS SA	1,186	1,286	2,604	50,885	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	980	1,021	1,168	22,829	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	347	347	1,611	31,494	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	454	454	1,113	21,752	不動産
HYPERA SA	353	353	1,122	21,934	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,905	2,227	11,992	234,334	各種金融
TELEFONICA BRASIL S.A.	484	523	2,326	45,455	電気通信サービス
MAGAZINE LUIZA SA	568	3,336	8,823	172,415	小売
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	148	—	—	—	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	992	992	367	7,176	ソフトウェア・サービス
RAIA DROGASIL SA	211	1,225	3,083	60,248	食品・生活必需品小売り
VIA VAREJO SA	—	1,359	2,519	49,232	小売
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	690	1,836	35,890	保険
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	336	544	3,922	76,640	ヘルスケア機器・サービス
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	—	201	1,403	27,422	ヘルスケア機器・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	415	827	16,161	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA	4,620	5,177	7,361	143,847	食品・飲料・タバコ
NATURA &CO HOLDING SA	—	809	3,976	77,703	家庭用品・パーソナル用品
TIM SA	—	961	1,226	23,960	電気通信サービス
RUMO SA	977	1,142	2,335	45,633	運輸
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	691	939	624	12,205	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	53,992 50	68,638 51	186,054 —	3,635,500 <4.4%>
(チリ)				千チリペソ	
BANCO SANTANDER CHILE	62,798	62,798	196,872	27,384	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	51	54	149,494	20,794	銀行
BANCO DE CHILE	37,356	48,626	340,384	47,347	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	231,643	32,221	素材
EMPRESAS COPEC SA	447	447	290,695	40,435	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	93	225	110,563	15,379	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	185	185	96,466	13,418	電気通信サービス
ENEL AMERICAS SA	39,900	39,900	438,422	60,984	公益事業
COLBUN SA	4,758	12,156	155,607	21,644	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	2,862	2,862	60,641	8,435	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	152	26,012	3,618	食品・飲料・タバコ
LATAM AIRLINES GROUP SA	325	—	—	—	運輸
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	98	105	338,319	47,060	素材
FALABELLA SA	708	708	171,354	23,835	小売
ITAU CORPBANCA	167,491	—	—	—	銀行
CENCOSUD SA	1,379	1,379	163,515	22,745	食品・生活必需品小売り
CENCOSUD SHOPPING SA	—	416	51,958	7,227	不動産
ENEL CHILE SA	25,612	25,612	140,537	19,548	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	345,582 17	196,991 16	2,962,490 —	412,082 <0.5%>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(コロンビア)			千コロンビアペソ			
INTERCONEXION ELECTRICA SA	505	505	1,151,650	33,167	公益事業	
ECOPETROL SA	4,889	4,889	947,641	27,292	エネルギー	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	125	—	—	—	各種金融	
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	3,037	—	—	—	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA	320	—	—	—	素材	
GRUPO ARGOS SA	177	—	—	—	素材	
BANCOLOMBIA SA	293	293	786,689	22,656	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	382	382	1,019,725	29,368	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	208	208	449,503	12,945	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	9,939 9	6,279 5	4,355,211 —	125,430 <0.2%>	
(ギリシャ)			千ユーロ			
ALPHA BANK AE	1,291	—	—	—	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	531	—	—	—	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	202	262	343	42,663	電気通信サービス	
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	2,910	—	—	—	銀行	
MOTOR OIL (HELLAS) SA	90	57	52	6,555	エネルギー	
OPAP SA	176	176	141	17,641	消費者サービス	
JUMBO SA	85	148	222	27,605	小売	
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	43	—	—	—	素材	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,332 8	645 4	760 —	94,466 <0.1%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	267	267	442	61,357	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	267 1	267 1	442 —	61,357 <0.1%>	
(トルコ)			千トルコリラ			
AKBANK T. A. S.	2,763	2,763	1,486	19,251	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	417	215	461	5,975	食品・飲料・タバコ	
ARCELIK AS	153	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	238	995	1,782	23,079	資本財	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,167	1,167	1,321	17,115	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	132	65	778	10,085	自動車・自動車部品	
KOC HOLDING AS	624	898	1,466	18,996	資本財	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	431	—	—	—	資本財	
TURK HAVA YOLLARI AO	621	621	664	8,601	運輸	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	950	1,430	2,340	30,315	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	2,399	2,399	1,795	23,247	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	1,730	1,730	1,015	13,151	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	116	116	954	12,366	エネルギー	
YAPI VE KREDI BANKASI	—	2,460	607	7,870	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,143	1,143	1,085	14,056	各種金融	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	428	428	3,014	39,041	食品・生活必需品小売り	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	98	—	—	—	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	13,417 16	16,436 14	18,776 —	243,155 <0.3%>
(チェコ)			千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS	74	74	3,933	18,406	銀行
CEZ AS	137	181	8,618	40,336	公益事業
MONETA MONEY BANK AS	687	687	4,076	19,079	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	899 3	943 3	16,628 —	77,821 <0.1%>
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	151	151	106,094	36,697	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	328	423	72,850	25,199	エネルギー
OTP BANK NYRT	195	248	291,551	100,847	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	675 3	823 3	470,495 —	162,744 <0.2%>
(ポーランド)			千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA	993	—	—	—	銀行
M BANK SA	16	16	255	7,068	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	131	131	1,804	49,980	素材
BANK PEKAO SA	155	225	1,094	30,296	銀行
ORANGE POLSKA SA	556	556	356	9,863	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	264	307	1,386	38,388	エネルギー
LPP SA	1	1	933	25,854	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA	36	36	579	16,045	銀行
CD PROJEKT SA	67	67	2,489	68,944	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA	765	1,042	2,376	65,817	銀行
CCC SA	31	—	—	—	耐久消費財・アパレル
GRUPA LOTOS SA	110	110	358	9,925	エネルギー
POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	1,464	2,598	1,241	34,377	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA	235	360	986	27,327	メディア・娯楽
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	634	634	375	10,383	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	620	620	1,492	41,335	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	41	—	—	—	素材
ALIOR BANK SA	88	—	—	—	銀行
DINO POLSKA SA	44	59	1,545	42,800	食品・生活必需品小売り
ALLEGRO. EU SA	—	273	2,479	68,651	小売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	6,258 19	7,043 16	19,756 —	547,061 <0.7%>
(香港)			千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	830	830	849	11,533	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	680	1,560	1,322	17,951	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	1,760	804	10,914	運輸
ANGANG STEEL CO LTD-H	754	—	—	—	素材
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	5,945	6,675	33,775	458,333	電気通信サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,100	1,240	6,429	87,246	素材
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	1,380	—	—	—	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	390	595	1,487	20,185	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H	3,700	3,700	1,117	15,163	公益事業
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,860	3,580	8,234	111,735	ヘルスケア機器・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,420	1,420	823	11,176	エネルギー
HENGAN INTL GROUP CO LTD	665	785	4,254	57,736	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,840	—	—	—	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,680	3,080	1,010	13,708	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	2,500	3,680	2,734	37,103	自動車・自動車部品
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	4,520	9,561	7,830	106,265	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	3,810	4,090	8,283	112,401	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	2,651	3,471	12,287	166,744	不動産
CITIC LTD	5,850	6,770	4,143	56,223	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	2,480	1,267	17,196	運輸
LENOVO GROUP LTD	7,320	7,320	3,960	53,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	19,760	23,820	5,550	75,314	エネルギー
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	7,000	7,340	3,802	51,594	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,418	1,840	2,303	31,265	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	25,574	27,394	8,848	120,070	エネルギー
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	370	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	1,343	18,224	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,420	2,420	6,050	82,098	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	751	847	8,470	114,937	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	2,580	3,600	2,070	28,089	公益事業
TOWNGAS CHINA CO LTD	460	—	—	—	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,043	2,507	1,386	18,818	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	5,780	5,780	919	12,471	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,655	1,655	1,592	21,611	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	680	9,227	素材
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	800	—	—	—	各種金融
WHARF HOLDINGS	—	1,000	1,660	22,526	不動産
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	1,279	1,279	1,632	22,150	運輸
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	1,340	1,340	1,500	20,365	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,722	2,862	7,641	103,695	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	1,725	23,411	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,710	6,090	12,819	173,959	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,360	3,360	833	11,307	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	860	1,060	3,794	51,495	公益事業
BYD CO LTD-H	685	825	16,170	219,426	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	13,560	13,560	3,484	47,290	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,920	1,920	948	12,870	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	14,500	1,580	21,447	メディア・娯楽
SINOTRANS LIMITED-H	1,100	—	—	—	運輸

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	2,920	—	—	—	素材
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	3,850	3,850	1,578	21,424	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,660	1,660	1,039	14,101	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	6,132	6,892	3,970	53,876	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,240	2,750	1,155	15,673	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,754	1,754	1,431	19,422	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	3,527	3,527	4,818	65,387	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	7,100	8,710	15,503	210,386	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	7,290	5,030	68,258	素材
MMG LIMITED	1,680	—	—	—	素材
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	1,440	—	—	—	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,440	2,440	3,660	49,666	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,650	3,735	9,225	125,189	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	2,118	3,596	48,802	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	860	860	287	3,897	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,990	5,570	841	11,413	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	380	380	406	5,517	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	—	640	462	6,279	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	2,280	3,173	43,067	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	460	460	2,953	40,074	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	2,720	3,200	4,044	54,887	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,660	1,660	537	7,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,420	1,620	8,237	111,785	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	497	6,747	運輸
CNOOC LTD-R	17,120	18,830	13,896	188,576	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	7,260	11,130	9,082	123,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,570	2,810	11,324	153,670	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	5,517	6,162	383,584	5,205,241	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,255	6,325	53,066	720,115	保険
LI NING CO LTD	1,940	2,170	9,862	133,836	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,884	25,578	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	5,939	12,069	1,146	15,559	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	1,032	14,008	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	1,180	2,140	1,138	15,449	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,848	25,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	1,680	1,680	378	5,129	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	3,440	3,925	5,447	73,928	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	1,465	4,740	3,024	41,037	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	9,474	10,984	4,591	62,308	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	1,700	929	12,618	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	91,176	102,476	60,563	821,845	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	700	848	11,914	161,678	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	2,159	29,310	自動車・自動車部品
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,420	1,420	1,641	22,275	不動産

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,290	1,290	1,465	19,886	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,300	4,120	4,177	56,691	素材
BANK OF CHINA LTD-H	77,262	86,352	23,055	312,869	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,095	—	—	—	不動産
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	1,325	3,981	54,030	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,352	1,352	1,408	19,117	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,764	4,369	20,491	278,072	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	62,625	64,645	30,383	412,300	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	905	905	1,042	14,147	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	801	10,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	3,120	1,960	915	12,420	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,950	5,190	2,195	29,791	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	980	—	—	—	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	350	780	1,688	22,915	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	1,573	21,346	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,160	1,420	4,955	67,250	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,030	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	7,702	8,979	9,895	134,282	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	3,360	6,420	2,099	28,488	素材
CHINA CITIC BANK-H	9,512	9,512	3,167	42,982	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	890	1,525	1,765	23,963	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	743	755	11,996	162,798	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,110	1,110	11,188	151,832	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	—	250	562	7,633	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	2,903	39,394	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	5,780	2,369	32,158	不動産
CHINA AOYUAN GROUP LTD	690	1,260	1,040	14,123	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	5,285	5,285	845	11,476	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,940	1,940	717	9,740	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	1,130	2,915	629	8,544	不動産
KINGSOFT CORP LTD	660	920	4,163	56,491	ソフトウェア・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	425	975	1,907	25,879	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,740	4,740	1,810	24,570	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	544	7,382	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	850	850	3,298	44,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,915	1,915	1,011	13,720	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,600	2,850	38,679	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,708	2,966	7,919	107,463	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,860	1,860	3,132	42,504	不動産
CRRC CORP LTD-H	5,110	5,110	1,609	21,845	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,950	2,590	2,175	29,522	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	1,310	—	—	—	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	796	—	—	—	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	996	1,252	2,303	31,260	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA RESOURCES CEMENT	2,100	2,880	3,012	40,879	素材
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	1,430	—	—	—	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2,523	3,583	3,225	43,764	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,015	1,015	603	8,195	素材
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,510	1,510	498	6,761	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,530	4,310	2,586	35,092	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,679	22,790	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,060	—	—	—	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HDGS	3,210	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,340	2,510	7,969	108,142	不動産
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	1,040	3,566	1,141	15,485	不動産
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	—	1,162	859	11,668	資本財
LONGFOR PROPERTIES	1,785	1,970	9,426	127,916	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1,156	964	3,118	42,318	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	5,514	6,744	2,953	40,084	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,560	1,560	595	8,086	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	314	314	370	5,030	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	6,850	6,850	1,959	26,584	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	29,290	31,520	9,077	123,185	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	420	680	4,012	54,442	小売
FAR EAST HORIZON LTD	1,410	2,400	1,893	25,696	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,990	2,485	4,517	61,305	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	1,280	2,040	1,336	18,132	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,000	1,000	844	11,453	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,768	3,572	2,493	33,833	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	3,292	44,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	6,920	9,390	2,272	30,836	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	555	555	1,814	24,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,760	2,760	1,614	21,910	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	715	715	218	2,959	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	3,285	4,830	2,318	31,460	各種金融
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	920	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	—	1,280	1,694	22,997	資本財
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,350	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	1,800	1,537	20,859	商業・専門サービス
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	592	1,094	1,209	16,419	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	7,300	10,590	4,373	59,350	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	340	480	4,459	60,511	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	820	820	1,031	13,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	—	225	617	8,381	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,360	1,360	6,779	91,999	商業・専門サービス
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	—	1,310	649	8,817	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	—	401	4,146	56,265	ヘルスケア機器・サービス
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	2,500	—	—	—	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	270	700	931	12,633	消費者サービス
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	—	300	493	6,692	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	—	415	1,504	20,414	商業・専門サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	41,560	45,660	6,301	85,505	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	8,238	11,096	28,350	384,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTEC CO LTD-H	276	267	3,668	49,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	1,027	3,827	128,281	1,740,773	小売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	—	684	930	12,623	小売
HAIDLIAO INTERNATIONAL HOLDI	370	850	4,730	64,189	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,244	3,862	5,600	76,005	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	—	940	5,207	70,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	8,320	8,320	1,272	17,274	各種金融
LOGAN GROUP CO LTD	940	1,500	1,917	26,013	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,595	1,595	5,861	79,542	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	—	80	461	6,258	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	—	450	702	9,526	消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	—	58	940	12,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	—	1,140	1,285	17,449	小売
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	—	1,220	4,361	59,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	—	1,440	2,548	34,587	食品・飲料・タバコ
CHINA VANKE CO LTD-H	1,740	1,784	4,852	65,848	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	815	1,925	864	11,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	450	450	1,568	21,281	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H	13,420	13,420	2,254	30,594	公益事業
BAIC MOTOR CORP LTD-H	1,170	1,170	373	5,064	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	886	886	1,025	13,922	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	272	272	1,009	13,693	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,588	2,092	2,673	36,280	各種金融
3SBIO INC	1,190	1,190	875	11,885	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGEND HOLDINGS CORP-H	211	905	1,004	13,631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,575	1,575	653	8,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	9,270	9,270	806	10,944	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	322	322	1,932	26,217	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD	1,140	1,140	502	6,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,205	2,460	1,195	16,223	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	2,360	2,360	660	8,967	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	—	960	617	8,376	消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	—	800	434	5,894	不動産
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	2,390	2,390	179	2,432	保険
MEITU INC	1,430	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOC AVIATION LTD	325	325	1,729	23,462	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	457	457	1,937	26,294	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	1,320	1,320	2,597	35,251	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	545	1,080	25,963	352,320	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	期末		業種
		株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	16,560	—	—	—	小売
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	—	152	1,427	19,368	食品・飲料・タバコ
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	—	4,350	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	6,500	6,500	—	—	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	888,643 207	979,813 206	1,393,132 —	18,904,813 <22.9%>
(マレーシア)			千マレーシアリングgit		
AMMB HOLDINGS BHD	1,302	2,656	802	20,518	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	138	3,545	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	4,446	6,351	1,943	49,713	銀行
DIGI.COM BERHAD	3,117	3,117	1,281	32,770	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	535	1,065	461	11,806	運輸
RHB BANK BHD	2,064	2,064	904	23,127	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	382	297	7,621	資本財
GAMUDA BHD	1,392	1,415	523	13,394	資本財
YTL CORPORATION BERHAD	2,523	2,607	202	5,169	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	149	460	669	17,121	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	612	900	23,047	銀行
IJM CORP BHD	1,981	—	—	—	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	548	556	1,267	32,425	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	85	213	687	17,598	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	3,598	4,040	2,876	73,581	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	706	—	—	—	銀行
MISC BHD	1,250	1,250	867	22,197	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	69	69	972	24,886	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	526	734	1,393	35,637	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	251	476	12,199	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	755	755	1,215	31,093	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	109	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	306	7,832	電気通信サービス
SP SETIA BHD	1,851	—	—	—	不動産
TENAGA NATIONAL BHD	2,944	2,751	2,823	72,219	公益事業
QL RESOURCES BHD	832	1,248	811	20,750	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	1,567	40,104	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	2,985	3,244	4,963	126,969	銀行
AIRASIA GROUP BHD	648	—	—	—	運輸
TOP GLOVE CORP BHD	984	5,049	4,281	109,522	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	—	132	260	6,672	食品・飲料・タバコ
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	—	1,282	961	24,595	ヘルスケア機器・サービス
SUPERMAX CORP BHD	—	1,582	1,523	38,970	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	2,053	3,072	918	23,495	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	783	20,048	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	1,796	2,703	1,208	30,911	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	1,672	3,363	827	21,165	資本財

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HARTELEGA HOLDINGS BHD	1,586	1,813	3,303	84,498	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,816	2,852	901	23,060	電気通信サービス
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,419	36,320	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,101	2,699	1,719	43,978	素材
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	2,293	1,238	31,673	ヘルスケア機器・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	700	700	279	7,144	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,443	1,443	864	22,110	素材
SIME DARBY PROPERTY BHD	1,672	—	—	—	不動産
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	1,269	32,481	食品・飲料・タバコ
小 計	68,612	78,659	50,116	1,281,981	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	43	40	—	<1.6%>
(タイ)			千タイバーツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	519	519	5,553	19,214	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,027	1,776	5,860	20,278	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	4,079	14,114	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	543	543	2,823	9,769	公益事業
ROBINSON PCL-NVDR	348	—	—	—	小売
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,475	1,274	9,045	31,297	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	9,614	2,845	9,846	電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	783	783	6,303	21,808	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	13,365	31,473	2,926	10,127	銀行
IRPC PCL - NVDR	8,295	8,295	1,858	6,428	エネルギー
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,648	—	—	—	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	232	360	6,714	23,230	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	2,437	2,437	13,159	45,532	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	3,407	4,582	12,600	43,597	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,059	1,197	21,426	74,134	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	4,712	7,435	10,706	37,045	小売
PTT PCL-NVDR	10,978	12,532	43,548	150,678	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	2,400	4,497	7,150	24,739	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	—	1,015	4,288	14,837	各種金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	6,060	20,968	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR	734	810	29,241	101,173	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	4,281	4,281	24,508	84,800	運輸
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	1,264	1,264	10,206	35,315	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,725	2,263	9,957	34,451	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	8,196	10,837	20,048	69,367	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	328	328	3,157	10,923	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,233	3,627	6,638	22,967	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	1,201	1,201	4,623	15,998	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	5,668	6,571	39,590	136,982	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,711	8,095	7,852	27,168	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,247	1,344	11,289	39,062	エネルギー
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	660	660	2,211	7,650	電気通信サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,064	2,064	5,314	18,389	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,249	2,249	10,403	35,995	素材	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	1,855	1,855	8,162	28,240	公益事業	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	8,170	8,170	7,230	25,017	運輸	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	—	534	2,563	8,868	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	524	2,882	9,726	33,654	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	—	660	2,376	8,220	食品・飲料・タバコ	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	—	1,651	3,714	12,853	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	—	8,103	2,755	9,532	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	—	1,822	5,192	17,966	小売	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	—	763	4,024	13,925	各種金融	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	898	898	5,028	17,399	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	—	682	4,398	15,220	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	126,957 37	175,053 43	407,167 —	1,408,798 <1.7%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	6,370	9,429	32,718	71,653	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,379	2,379	11,409	24,986	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	598	598	4,667	10,222	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	5,906	—	—	—	資本財	
DMCI HOLDINGS INC	3,454	—	—	—	資本財	
GLOBE TELECOM INC	46	46	9,849	21,569	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,445	1,445	18,062	39,556	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,303	3,035	21,367	46,794	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	610	610	12,134	26,575	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,612	1,612	6,757	14,799	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,737	2,199	20,374	44,620	銀行	
MEGAWORLD CORP	6,380	6,380	2,073	4,540	不動産	
PLDT INC	62	104	14,623	32,024	電気通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	930	930	1,514	3,315	不動産	
SECURITY BANK CORP	308	—	—	—	銀行	
SM PRIME HOLDINGS INC	8,875	11,561	41,447	90,771	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	633	955	13,751	30,114	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	228	228	22,576	49,443	資本財	
AYALA CORPORATION	223	282	22,312	48,865	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	23,557	23,557	9,893	21,667	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	895	895	2,541	5,566	公益事業	
MANILA ELECTRIC COMPANY	291	291	9,111	19,954	公益事業	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	—	873	3,566	7,809	食品・生活必需品小売り	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	68	68	3,497	7,659	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	68,917 23	67,483 21	284,252 —	622,513 <0.8%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
BARITO PACIFIC TBK PT	41,347	28,825	2,680,725	20,105	素材	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
UNITED TRACTORS TBK PT	2,009	2,009	4,193,787	31,453	エネルギー	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	4,291	4,291	3,089,520	23,171	食品・飲料・タバコ	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	21,527	21,527	12,055,120	90,413	自動車・自動車部品	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,923	7,923	5,070,720	38,030	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	596	596	2,467,440	18,505	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	9,179	9,179	1,312,597	9,844	食品・飲料・タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,900	1,900	2,503,250	18,774	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,442	2,442	2,362,635	17,719	素材	
BUKIT ASAM TBK PT	4,473	—	—	—	エネルギー	
BANK MANDIRI	18,180	20,475	12,592,715	94,445	銀行	
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	867	—	—	—	素材	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,186	7,464	5,933,880	44,504	家庭用品・パーソナル用品	
PT BANK RAKYAT INDONESIA	52,460	58,996	21,769,524	163,271	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	7,915	7,915	890,437	6,678	公益事業	
BANK NEGARA INDONESIA PT	8,102	8,102	4,132,020	30,990	銀行	
KALBE FARMA TBK PT	27,559	27,559	4,078,732	30,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,346	3,456	3,533,760	26,503	素材	
BANK CENTRAL ASIA PT	9,150	10,510	33,027,675	247,707	銀行	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	45,431	53,497	15,407,136	115,553	電気通信サービス	
XL AXIATA TBK PT	—	3,870	824,310	6,182	電気通信サービス	
ACE HARDWARE INDONESIA	—	9,057	1,476,291	11,072	小売	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,235	—	—	—	運輸	
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,834	—	—	—	不動産	
ADARO ENERGY PT	14,393	14,393	1,626,409	12,198	エネルギー	
PAKUWON JATI TBK PT	16,104	—	—	—	不動産	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	1,610	1,569,750	11,773	食品・飲料・タバコ	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	6,691	—	—	—	銀行	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,330	—	—	—	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	321,080 27	305,596 22	142,598,434 —	1,069,488 <1.3%>	
(韓国)			千韓国ウォン			
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50	50	107,484	10,124	メディア・娯楽	
HANMI SCIENCE CO LTD	6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	28	42	356,595	33,591	自動車・自動車部品	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	31	31	573,426	54,016	保険	
DB INSURANCE CO LTD	42	42	193,614	18,238	保険	
COWAY CO LTD	50	50	375,303	35,353	耐久消費財・アパレル	
KT&G CORP	106	132	1,101,975	103,806	食品・飲料・タバコ	
S-1 CORPORATION	9	23	200,138	18,853	商業・専門サービス	
KOREA GAS CORPORATION	45	45	132,509	12,482	公益事業	
CJ CORP	12	12	97,785	9,211	資本財	
KAKAO CORP	59	60	2,259,091	212,806	メディア・娯楽	
SK TELECOM	21	42	956,796	90,130	電気通信サービス	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	41	32	262,185	24,697	資本財	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	310	310	282,236	26,586	各種金融
NCSOFT CORPORATION	16	17	1,509,916	142,234	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	141	221	261,075	24,593	電気通信サービス
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	82	—	—	—	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	59	59	81,436	7,671	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	9	9	1,459,812	137,514	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	44	48	3,537,146	333,199	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	11	404,182	38,073	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	1	2	195,434	18,409	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	454	518	1,647,793	155,222	銀行
S-OIL CORPORATION	58	44	257,481	24,254	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	107	107	558,853	52,643	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	479	479	166,945	15,726	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	57	193,207	18,200	各種金融
POSCO CHEMICAL CO LTD	11	33	278,038	26,191	素材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	14	19	526,890	49,633	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	30	30	230,960	21,756	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	33	43	392,295	36,954	資本財
HYUNDAI MOBIS	64	69	1,607,970	151,470	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	521	590	5,074,344	478,003	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	63	92	293,338	27,632	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	30	30	249,249	23,479	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	143	156	2,705,145	254,824	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	72	72	221,243	20,841	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	283	283	244,487	23,030	銀行
KCC CORP	8	—	—	—	素材
KIA MOTORS CORPORATION	253	294	1,540,235	145,090	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	7	7	308,502	29,060	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	244	303	619,819	58,386	公益事業
HANWHA CORPORATION	28	28	74,015	6,972	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	55	91	199,361	18,779	運輸
OCI COMPANY LTD	11	—	—	—	素材
CJ LOGISTICS	8	8	139,644	13,154	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10	25	384,336	36,204	素材
DOUZONE BIZON CO LTD	—	14	157,433	14,830	ソフトウェア・サービス
LG ELECTRONICS INC	110	110	961,958	90,616	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	23	23	71,811	6,764	資本財
LG CORP	83	99	721,855	67,998	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	112	121	123,491	11,632	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	67	67	199,758	18,817	資本財
NAVER CORP	131	130	3,888,602	366,306	メディア・娯楽
HYUNDAI DEPT STORE CO	12	—	—	—	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	333,184	31,386	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.68	0.68	37,400	3,523	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
PACIFIC CORP	21	33	158,792	14,958	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	132	132	283,972	26,750	消費者サービス
POSCO	78	79	1,871,532	176,298	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	185	185	212,008	19,971	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	52	60	3,202,264	301,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	56	56	781,618	73,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,610	5,138	30,932,445	2,913,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	371	593	332,113	31,285	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	796	889	4,893,900	461,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	5	8	190,296	17,925	小売
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	—	30	408,566	38,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORPORATION	6	55	360,100	33,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	190	190	235,600	22,193	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	91	91	222,064	20,918	保険
GS HOLDINGS CORP	42	65	227,458	21,426	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	240	240	365,879	34,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	91	102	2,934,360	276,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANA FINANCIAL GROUP	332	325	1,075,734	101,334	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	14	23	424,488	39,986	運輸
LOTTE SHOPPING CO	10	10	93,060	8,766	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	74	74	477,654	44,995	保険
AMOREPACIFIC CORP	28	28	474,045	44,655	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7	21	111,930	10,543	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	18	60,483	5,697	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	55	55	877,002	82,613	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	7	7	306,125	28,836	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	125,485	11,820	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	14	217,202	20,460	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK HOLDINGS CO LTD	38	39	772,258	72,746	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	381	441	1,894,223	178,435	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	51	106	244,237	23,007	資本財
BNK FINANCIAL GROUP INC	232	481	284,584	26,807	銀行
HANMI PHARM CO LTD	4	4	140,140	13,201	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANWHA LIFE INSURANCE	833	—	—	—	保険
FILA HOLDINGS CORPORATION	40	40	175,848	16,564	耐久消費財・アパレル
EMART	27	18	278,668	26,250	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	13	40	135,604	12,773	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	70	70	228,585	21,532	自動車・自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	22	—	—	—	資本財
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	8	13	314,084	29,586	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	5	5	71,370	6,723	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	19	29	356,160	33,550	食品・飲料・タバコ
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	39	—	—	—	保険
NETMARBLE CORP	24	24	317,985	29,954	メディア・娯楽

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
WOORI FINANCIAL GROUP INC	556	594	570,891	53,777	銀行	
SAMSUNG SDS CO LTD	31	37	651,875	61,406	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG C&T CORP	77	87	1,003,605	94,539	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	15	18	1,372,083	129,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOOSAN BOBCAT INC	43	43	131,178	12,357	資本財	
CJ ENM CO LTD	8	8	111,469	10,500	小売	
KMW CO LTD	—	19	131,929	12,427	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HLB INC	23	50	472,566	44,515	耐久消費財・アパレル	
HELIXMITH CO LTD	16	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION PHARM INC	11	12	143,078	13,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDY-TOX INC	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEEGENE INC	—	19	527,916	49,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALTEOGEN INC	—	18	319,896	30,134	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP	3	9	186,870	17,603	メディア・娯楽	
SILLAJEN INC	56	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	60	75	694,834	65,453	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	15,374	16,389	102,145,916	9,622,145	
(台湾)		112	106	—	<11.7%>	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	—	480	10,440	38,523	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACER INC	2,558	2,558	6,024	22,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	630	760	19,099	70,475	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	609	509	18,441	68,049	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	2,341	2,341	9,835	36,292	素材	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	270	270	4,927	18,182	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN BUSINESS BANK	4,766	5,004	4,884	18,023	銀行	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	600	600	7,200	26,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	287	617	5,351	19,745	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	2,422	2,862	21,183	78,168	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	421	1,134	4,764	17,579	不動産	
EVA AIRWAYS CORP	1,641	1,641	1,813	6,693	運輸	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	577	697	12,929	47,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,204	5,818	10,356	38,216	銀行	
CHINA AIRLINES LTD	1,302	—	—	—	運輸	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	6,834	25,219	自動車・自動車部品	
CHINA STEEL	11,202	12,662	26,211	96,720	素材	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,077	3,262	6,362	23,475	保険	
ADVANTECH CO LTD	284	433	12,784	47,173	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COMPAL ELECTRONICS	4,317	4,317	8,181	30,191	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	1,869	2,099	41,455	152,972	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,030	1,540	9,301	34,322	半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,473	3,973	43,704	161,270	電気通信サービス	
AU OPTRONICS CORP	9,450	9,450	10,915	40,279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,522	1,782	17,909	66,084	電気通信サービス	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
EVERGREEN MARINE	1,329	3,590	7,791	28,749	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,480	9,257	34,160	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	362	434	7,820	28,858	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	199	8,164	30,125	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	530	580	17,007	62,756	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,528	4,138	33,850	124,909	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	400	1,210	3,763	13,885	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	3,540	3,960	28,476	105,079	素材
GIANT MANUFACTURING	254	344	10,080	37,197	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,388	1,608	112,884	416,543	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	6,490	7,100	30,320	111,882	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	7,579	9,640	17,305	63,857	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	260	300	19,470	71,844	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,570	1,570	9,561	35,281	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,451	11,701	21,472	79,233	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,319	8,941	35,407	130,652	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,567	12,567	10,833	39,975	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	9,785	12,609	32,091	118,418	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	11,962	13,332	108,259	399,478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	10,753	11,733	33,733	124,476	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	100	110	36,045	133,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	9,647	12,295	16,045	59,209	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	11,664	11,955	9,779	36,086	保険
INVENTEC CO LTD	2,805	2,805	6,241	23,030	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,254	2,254	10,686	39,432	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,568	11,568	12,783	47,171	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	18,712	18,992	35,420	130,702	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	10,040	11,662	24,548	90,585	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	1,237	997	8,679	32,029	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,677	5,487	34,077	125,745	素材
WISTRON CORP	2,426	3,556	10,493	38,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	2,737	2,737	7,159	26,417	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	4,463	5,263	33,320	122,953	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	665	595	15,421	56,906	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,092	1,122	9,192	33,920	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	334	1,476	5,935	21,903	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	221	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	928	928	4,800	17,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	357	357	2,241	8,272	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,281	1,281	5,495	20,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	4,694	5,675	23,353	86,172	素材
TATUNG CO LTD	2,100	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	23,783	26,523	1,216,120	4,487,484	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	12,100	12,100	38,478	141,983	半導体・半導体製造装置

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WINBOND ELECTRONICS CORP	2,040	3,490	6,072	22,407	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	227	387	15,040	55,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,770	2,640	8,131	30,004	運輸
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	7,750	7,750	7,750	28,597	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	1,436	1,436	5,718	21,102	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	212	218	5,982	22,075	資本財
PEGATRON CORP	1,594	2,004	12,208	45,050	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	120	120	9,360	34,538	資本財
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,320	1,373	21,213	78,276	各種金融
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	—	30	4,830	17,822	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	759	599	7,610	28,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	7,696	10,872	21,745	80,241	銀行
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	3,308	3,308	12,853	47,431	銀行
WIWYNN CORP	—	80	6,240	23,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	3,793	3,493	24,521	90,485	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	—	70	15,785	58,246	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	160	160	5,664	20,900	耐久消費財・アパレル
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	890	9,167	33,826	半導体・半導体製造装置
PHISON ELECTRONICS CORP	115	115	3,711	13,696	半導体・半導体製造装置
TAIMED BIOLOGICS INC	130	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	320	10,272	37,903	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD	180	240	10,236	37,770	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	318,108 87	354,982 87	2,668,902 —	9,848,248 <11.9%>
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,753	3,066	628,812	899,201	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	661	661	24,831	35,508	エネルギー
ASIAN PAINTS LTD	249	322	71,675	102,496	素材
EICHER MOTORS LTD	12	125	27,498	39,322	自動車・自動車部品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	756	756	46,638	66,693	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	9	9	20,366	29,124	素材
ICICI BANK LTD	2,223	5,417	250,645	358,423	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	594	594	12,363	17,679	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	1,674	1,875	41,157	58,854	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	264	264	10,063	14,390	運輸
LIC HOUSING FINANCE LTD	279	279	8,511	12,171	銀行
TATA STEEL LTD	258	397	17,404	24,888	素材
JSW STEEL LTD	802	802	26,742	38,241	素材
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	—	438	22,379	32,003	食品・飲料・タバコ
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	51	51	18,124	25,918	食品・飲料・タバコ
NESTLE INDIA LIMITED	23	23	41,510	59,359	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD	1,747	1,747	15,117	21,617	公益事業
VEDANTA LTD	1,987	1,987	19,638	28,083	素材
TITAN INDUSTRIES LTD	278	328	42,265	60,439	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,527	2,527	17,297	24,736	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	—	52	7,925	11,333	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	265	265	24,373	34,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAJAJ FINANCE LTD	167	180	69,879	99,927	各種金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,585	1,774	381,875	546,081	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	794	794	15,231	21,780	メディア・娯楽
INFOSYS LTD	3,265	3,655	415,435	594,072	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	1,187	1,187	41,780	59,746	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	1,937	1,937	15,733	22,499	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	596	871	185,934	265,886	家庭用品・パーソナル用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	527	1,220	104,372	149,252	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	581	581	30,656	43,838	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	103	103	30,603	43,762	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	104	126	61,698	88,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	1,994	1,532	72,286	103,369	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	324	324	18,054	25,817	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	829	829	42,316	60,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	90	90	31,012	44,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	105	131	90,623	129,590	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	160	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	203	288	22,688	32,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	—	176	7,357	10,521	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	768	768	9,454	13,520	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	190	212	17,721	25,342	各種金融
PETRONET LNG LTD	494	837	19,951	28,531	エネルギー
CIPLA LTD	313	378	28,918	41,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	445	497	48,031	68,685	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	92	124	57,672	82,471	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	1,436	—	—	—	資本財
BOSCH LTD	9	9	11,289	16,144	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	865	966	263,564	376,896	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	2,600	2,600	23,258	33,259	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	67	117	16,205	23,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YES BANK LTD	1,529	—	—	—	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	735	735	18,331	26,214	素材
BHARAT FORGE LTD	303	303	14,971	21,409	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,213	1,213	23,628	33,788	素材
ITC LTD	3,471	3,884	67,121	95,984	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	81	122	19,570	27,985	素材
UNITED PHOSPHORUS LTD	542	542	23,131	33,078	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	—	61	15,593	22,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS INDIA LTD	—	59	7,995	11,434	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	—	64	23,348	33,388	メディア・娯楽
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	384	384	26,476	37,861	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
TECH MAHINDRA LTD	480	480	41,940	59,974	ソフトウェア・サービス	
IDEA CELLULAR LTD	4,679	—	—	—	電気通信サービス	
MARICO LTD	424	424	16,155	23,102	家庭用品・パーソナル用品	
PAGE INDUSTRIES LTD	6	6	13,187	18,858	耐久消費財・アパレル	
DLF LTD	—	564	9,749	13,941	不動産	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,667	2,013	37,061	52,997	公益事業	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	625	625	22,950	32,818	運輸	
REC LTD	481	481	5,262	7,525	各種金融	
BAJAJ FINSERV LTD	31	38	24,429	34,934	保険	
BAJAJ AUTO LTD	83	83	25,102	35,896	自動車・自動車部品	
JUBILANT FOODWORKS LTD	—	87	20,520	29,344	消費者サービス	
COAL INDIA LTD	1,473	1,473	17,937	25,650	エネルギー	
TATA MOTORS LTD	1,470	1,900	26,801	38,326	自動車・自動車部品	
TATA POWER CO LTD	932	—	—	—	公益事業	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	279	—	—	—	各種金融	
BHARTI INFRATEL LTD	358	358	6,398	9,149	電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	269	—	—	—	銀行	
INDRAPRASTHA GAS LTD	—	132	5,594	8,000	公益事業	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	388	740	43,928	62,817	保険	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	40	10,273	14,690	各種金融	
BANDHAN BANK LTD	360	748	25,443	36,383	銀行	
AXIS BANK LTD	2,000	2,447	138,285	197,748	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	234	234	19,344	27,662	資本財	
BERGER PAINTS INDIA LTD	—	294	19,244	27,520	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	273	417	33,090	47,319	素材	
AVENUE SUPERMARTS LTD	110	175	40,758	58,284	食品・生活必需品小売り	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	91	235	29,939	42,812	保険	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	—	317	13,392	19,151	保険	
INTERGLOBE AVIATION LTD	83	83	12,465	17,825	運輸	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	—	414	33,476	47,871	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	64,329 80	66,506 86	4,461,854 —	6,380,451 <7.7%>	
(パキスタン)				千パキスタンルピー		
MCB BANK LTD	533	533	9,104	6,100	銀行	
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	730	730	6,859	4,595	エネルギー	
HABIB BANK LTD	665	665	8,658	5,801	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,928 3	1,928 3	24,622 —	16,497 <0.0%>	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR INSURANCE CO	1,896	—	—	—	保険	
QATAR NATIONAL BANK	4,325	4,897	8,912	253,747	銀行	
COMMERCIAL BANK QSC	2,039	2,039	875	24,914	銀行	
OOREDOO QSC	728	728	495	14,093	電気通信サービス	
QATAR FUEL QSC	573	573	1,006	28,658	エネルギー	

銘柄	株数 (百株)	当	期		業	種	
		期首(前期末)	末	評 価 額			
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	外貨建金額			邦貨換算金額 (千円)
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	624	624	1,073	30,566	公益事業		
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	—	985	837	23,850	銀行		
INDUSTRIES QATAR	1,594	1,967	2,024	57,650	資本財		
QATAR ISLAMIC BANK	1,142	1,142	1,919	54,635	銀行		
MASRAF AL RAYAN	4,065	4,065	1,752	49,896	銀行		
BARWA REAL ESTATE CO	2,074	2,074	708	20,173	不動産		
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,439	4,439	910	25,934	素材		
小 計	株 数 ・ 金 額	23,504	23,538	20,517	584,121		
	銘柄数 <比率>	11	11	—	<0.7%>		
(南アフリカ)				千南アフリカランド			
BIDVEST GROUP LTD	277	277	4,155	28,382	資本財		
CLICKS GROUP LTD	269	269	6,972	47,622	食品・生活必需品小売り		
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	473	—	—	—	小売		
DISCOVERY LIMITED	349	484	6,089	41,592	保険		
GOLD FIELDS LTD	835	971	16,376	111,849	素材		
REMGRO LTD	554	554	5,362	36,624	各種金融		
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	240	—	—	—	小売		
NORTHAM PLATINUM LTD	—	339	5,902	40,312	素材		
HARMONY GOLD MINING CO LTD	—	563	4,366	29,820	素材		
EXXARO RESOURCES LTD	196	349	4,495	30,706	エネルギー		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	43	69	9,131	62,369	銀行		
LIBERTY HOLDINGS LTD	62	—	—	—	保険		
MTN GROUP LTD	1,565	1,730	11,492	78,493	電気通信サービス		
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	384	447	16,729	114,260	素材		
TELKOM SA LTD	113	—	—	—	電気通信サービス		
FIRSTRAND LTD	3,126	5,258	23,530	160,710	各種金融		
PSG GROUP LTD	184	—	—	—	各種金融		
NASPERS LTD-N SHS	424	468	157,818	1,077,899	小売		
NEDBANK GROUP LTD	380	380	4,488	30,655	銀行		
NETCARE LTD	991	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス		
PICK N PAY STORES LTD	622	—	—	—	食品・生活必需品小売り		
RMB HOLDINGS LTD	743	—	—	—	各種金融		
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	52	73	8,408	57,432	素材		
SAPPI LIMITED	499	—	—	—	素材		
SASOL LTD	570	572	6,440	43,991	素材		
SHOPRITE HOLDINGS LTD	447	584	8,335	56,934	食品・生活必需品小売り		
MR PRICE GROUP LTD	212	285	4,274	29,192	小売		
STANDARD BANK GROUP LTD	1,260	1,426	17,115	116,898	銀行		
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	232	4,336	29,620	食品・生活必需品小売り		
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	836	1,104	4,249	29,025	小売		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	372	372	4,711	32,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ABSA GROUP LTD	709	732	7,236	49,425	銀行		
TIGER BRANDS LTD	130	130	2,778	18,979	食品・飲料・タバコ		
SANLAM LTD	1,724	2,210	12,167	83,100	保険		

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種			
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額					
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)				
INVESTEC LTD	288	—	—	—	各種金融			
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	—	882	14,302	97,684	素材			
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,888	19,726	素材			
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	1,565	1,565	2,798	19,117	ヘルスケア機器・サービス			
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	680	680	981	6,704	保険			
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	1,360	1,012	3,237	22,112	保険			
VODACOM GROUP	589	623	8,066	55,092	電気通信サービス			
NEPI ROCKCASTLE PLC	321	334	2,314	15,809	不動産			
OLD MUTUAL LTD	4,896	4,896	5,718	39,058	保険			
REINET INVESTMENTS SCA	116	171	4,670	31,896	各種金融			
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	830	1,160	7,923	小売			
MULTICHOICE GROUP LTD	405	405	5,448	37,214	メディア・娯楽			
SIBANYE STILLWATER LTD	—	2,520	13,237	90,410	素材			
BID CORP LTD	330	392	10,540	71,992	食品・生活必需品小売り			
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	29,500	34,258	432,331	2,952,824	—	<3.6%>
(アラブ首長国連邦)					千アラブ首長国 連邦ディルハム			
DUBAI ISLAMIC BANK	1,285	2,159	898	25,773	銀行			
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,006	3,850	1,085	31,151	不動産			
EMIRATES NBD PJSC	—	2,652	2,626	75,352	銀行			
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	305	—	—	—	不動産			
EMAAR MALLS PJSC	1,796	1,796	262	7,524	不動産			
EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,682	2,004	3,407	97,747	電気通信サービス			
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2,694	3,311	1,987	57,007	銀行			
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,598	2,832	3,331	95,571	銀行			
ALDAR PROPERTIES PJSC	6,372	5,094	1,370	39,315	不動産			
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	19,742	23,701	14,968	429,443	—	<0.5%>
(サウジアラビア)					千サウジアラビアリアル			
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	198	265	1,537	43,190	素材			
JARIR MARKETING CO	50	71	1,339	37,612	小売			
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	66	66	569	15,993	保険			
ETIHAD ETISALAT CO	344	344	1,004	28,227	電気通信サービス			
SAUDI BRITISH BANK	322	717	1,708	47,996	銀行			
AL RAJHI BANK	1,204	1,350	9,453	265,546	銀行			
ARAB NATIONAL BANK	—	576	1,152	32,381	銀行			
BANK ALBILAD	323	458	1,127	31,663	銀行			
BANK AL-JAZIRA	358	358	484	13,600	銀行			
BANQUE SAUDI FRANSI	483	690	2,161	60,719	銀行			
RIYAD BANK	1,065	1,389	2,595	72,906	銀行			
SAMBA FINANCIAL GROUP	1,016	1,016	3,111	87,402	銀行			
SAUDI TELECOM CO	393	652	6,905	193,971	電気通信サービス			
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	145	239	1,901	53,410	素材			
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	734	975	9,368	263,173	素材			
SAUDI CEMENT	74	74	423	11,906	素材			

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SAUDI ELECTRICITY CO	747	922	1,883	52,897	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	210	210	476	13,380	素材
SAVOLA	253	253	1,165	32,737	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	319	319	392	11,013	素材
ALMARAI CO	229	301	1,654	46,464	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY	461	461	442	12,441	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	322	322	499	14,037	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	98	98	593	16,661	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	661	661	707	19,871	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	470	470	398	11,191	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE	235	235	315	8,867	エネルギー
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	16	60	744	20,914	保険
ALINMA BANK	824	1,099	1,754	49,295	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	—	37	489	13,749	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO	368	449	1,736	48,774	素材
SAUDI AIRLINES CATERING CO	44	44	337	9,474	消費者サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	—	2,398	8,514	239,173	エネルギー
NATIONAL COMMERCIAL BANK	1,194	1,593	6,531	183,467	銀行
小 計	13,240	19,189	73,482	2,064,117	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	31	34	—	<2.5%>	
(中国オフショア)			千香港・オフショア人民元		
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	—	373	1,006	16,001	商業・専門サービス
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	—	103	562	8,951	食品・飲料・タバコ
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	—	154	409	6,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	—	80	611	9,728	素材
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	—	183	449	7,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	—	134	706	11,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	—	80	1,024	16,281	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	—	22	779	12,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	—	471	1,264	20,108	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	—	261	601	9,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	—	163	1,284	20,422	メディア・娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	—	235	539	8,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	—	285	836	13,295	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	—	41	65	1,035	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	—	301	921	14,654	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	—	337	1,285	20,434	素材
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	858	13,650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	—	615	516	8,213	メディア・娯楽
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	—	210	795	12,649	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	—	1,033	568	9,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	—	703	640	10,191	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	—	242	729	11,593	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	—	134	793	12,619	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	—	274	654	10,407	食品・飲料・タバコ
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	—	136	663	10,552	資本財
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	—	250	928	14,767	資本財
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	—	288	581	9,245	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAIID GROUP CO-A	—	170	1,034	16,450	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	—	264	757	12,047	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	82	239	1,717	27,307	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	99	1,504	23,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	—	53	92	1,463	食品・飲料・タバコ
ADDSINO CO LTD -A	—	347	717	11,404	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	—	228	385	6,122	メディア・娯楽
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	—	348	580	9,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	—	470	715	11,381	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	—	922	503	8,004	素材
NAVINFO CO LTD-A	—	332	516	8,208	耐久消費財・アパレル
BY-HEALTH CO LTD-A	—	297	787	12,523	家庭用品・パーソナル用品
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	—	378	725	11,542	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	264	4,211	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	—	188	872	13,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	—	323	739	11,760	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	282	4,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	—	197	607	9,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	—	313	531	8,450	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	137	179	1,230	19,559	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	—	280	957	15,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	204	3,258	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	—	148	437	6,948	ヘルスケア機器・サービス
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	—	153	679	10,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	928	14,756	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	97	97	313	4,982	ヘルスケア機器・サービス
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	—	245	726	11,554	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	98	1,822	28,974	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	—	204	1,686	26,811	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	—	595	498	7,927	食品・飲料・タバコ
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	—	295	716	11,397	半導体・半導体製造装置
SONGCHEG PERFORMANCE DEVE-A	—	334	573	9,118	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	—	135	488	7,774	ソフトウェア・サービス
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	—	385	561	8,929	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	799	12,718	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	2,983	2,983	1,193	18,971	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	—	536	652	10,380	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,683	594	3,543	56,337	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	226	226	236	3,765	資本財
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	1,370	21,787	メディア・娯楽

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	727	11,573	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	—	303	722	11,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	—	557	526	8,378	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	450	7,160	ソフトウェア・サービス
GOERTEK INC -A	—	269	1,257	19,995	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	—	806	671	10,675	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	240	240	830	13,203	銀行
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	—	1,020	693	11,028	耐久消費財・アパレル
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	1,845	199	168	2,679	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	—	793	558	8,876	消費者サービス
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	324	12	60	954	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	—	71	730	11,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	170	170	425	6,757	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	1,288	152	409	6,506	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,628	25,898	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	164	212	5,724	91,011	食品・飲料・タバコ
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	—	341	586	9,320	メディア・娯楽
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	—	641	546	8,683	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNING.COM CO LTD-A	458	458	449	7,151	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	613	9,748	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	250	547	805	12,802	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	185	185	1,249	19,869	耐久消費財・アパレル
MIDEA GROUP CO LTD-A	206	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	424	585	2,831	45,019	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PING AN BANK CO LTD-A	851	1,194	2,130	33,868	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	639	381	722	11,491	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	1,114	17,724	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	1,587	25,247	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	758	—	—	—	資本財
ZTE CORP-A	—	126	479	7,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	—	801	608	9,679	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	—	432	727	11,567	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	1,070	17,025	各種金融
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	201	201	243	3,878	資本財
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	—	500	704	11,193	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	—	436	617	9,823	半導体・半導体製造装置
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	—	165	310	4,934	メディア・娯楽
CHACHA FOOD CO LTD-A	—	100	543	8,641	食品・飲料・タバコ
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	—	31	633	10,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JIANGXI ZHENGHANG TECH -A	—	277	478	7,601	食品・飲料・タバコ
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	—	224	631	10,034	半導体・半導体製造装置
PERFECT WORLD CO LTD-A	—	228	686	10,908	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	—	48	1,080	17,179	食品・飲料・タバコ
GUOCHENG MINING CO LTD-A	—	311	344	5,483	資本財

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	—	80	590	9,389	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	—	185	565	8,995	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	—	690	478	7,602	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	—	218	413	6,577	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	—	825	309	4,919	半導体・半導体製造装置
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	—	38	1,095	17,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	248	248	309	4,925	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	—	137	1,142	18,162	運輸
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	—	602	646	10,280	各種金融
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	—	236	950	15,114	素材
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	455	455	361	5,751	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	—	269	426	6,787	ソフトウェア・サービス
CSC FINANCIAL CO LTD-A	—	241	1,097	17,442	各種金融
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	—	111	592	9,426	資本財
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	—	40	456	7,254	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	—	163	658	10,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	371	371	846	13,467	素材
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	—	437	711	11,311	各種金融
CHONGQING FULING ZHACAI-A	—	211	899	14,298	食品・飲料・タバコ
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	—	112	759	12,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	—	104	1,072	17,048	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	—	70	726	11,545	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OPPEIN HOME GROUP INC-A	—	77	1,013	16,113	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	—	156	721	11,474	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	—	87	473	7,522	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	—	47	594	9,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	—	97	588	9,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	—	123	875	13,914	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	—	55	791	12,577	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	—	92	680	10,821	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	68	68	1,164	18,514	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	—	441	587	9,346	各種金融
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	—	28	287	4,575	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	—	427	564	8,982	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	—	451	649	10,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	—	53	2,013	32,021	ヘルスケア機器・サービス
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	—	50	225	3,587	素材
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	—	30	604	9,611	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	—	139	956	15,215	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	—	14	473	7,527	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	63	134	3,570	56,765	資本財
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	—	44	1,008	16,033	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD-A	—	88	1,053	16,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BATC BLUEPARK NEW ENERGY -A	—	1,047	755	12,006	自動車・自動車部品
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	—	42	486	7,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	—	18	1,028	16,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	—	29	694	11,041	半導体・半導体製造装置
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	—	946	586	9,325	各種金融
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	—	2,201	460	7,314	素材
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	—	467	617	9,823	各種金融
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	—	1,067	610	9,704	運輸
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	—	1,415	673	10,709	銀行
PETROCHINA CO LTD-A	—	1,000	418	6,646	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,612	2,612	1,300	20,682	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	3,536	1,135	18,047	銀行
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	—	200	358	5,698	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	855	1,049	4,513	71,770	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	504	668	5,543	88,134	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	952	952	1,712	27,231	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,383	1,383	1,304	20,736	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	2,736	2,736	1,428	22,708	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	1,209	19,236	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	51	76	13,243	210,572	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	—	989	454	7,233	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	432	432	1,307	20,791	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	182	182	608	9,679	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	444	444	217	3,452	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,040	1,340	2,728	43,379	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,223	1,223	797	12,678	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	—	1,289	525	8,362	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,109	2,109	1,119	17,806	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	4,943	1,102	477	7,586	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,194	1,194	747	11,884	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	343	343	1,355	21,548	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	580	580	278	4,426	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	7,492	1,664	820	13,043	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	387	387	253	4,024	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	294	294	1,628	25,899	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	562	730	1,624	25,823	各種金融
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	439	818	1,324	21,057	不動産
CRRC CORP LTD-A	—	790	442	7,034	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	207	317	2,837	45,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	—	534	612	9,738	素材
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	—	632	535	8,521	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	—	315	628	9,996	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	—	816	623	9,912	資本財
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	260	738	11,744	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	1,153	18,347	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	799	12,709	銀行
GEMDALE CORP-A	—	455	653	10,395	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	406	406	1,021	16,248	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	475	175	1,529	24,319	素材

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	140	182	258	4,112	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	210	823	780	12,414	メディア・娯楽
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	—	828	789	12,546	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	—	676	642	10,210	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	486	486	1,125	17,888	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	148	148	2,952	46,946	小売
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	539	8,575	素材
AVIC CAPITAL CO LTD -A	—	1,225	563	8,959	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	—	1,643	540	8,594	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	—	28	65	1,037	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-A	259	259	186	2,965	運輸
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	649	10,327	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	373	5,937	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	—	160	498	7,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	—	1,140	611	9,715	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	1,197	19,033	自動車・自動車部品
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	236	236	329	5,234	素材
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	435	6,927	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	505	505	411	6,544	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	573	104	192	3,055	ヘルスケア機器・サービス
ZHONGJIN GOLD CORP-A	340	340	340	5,406	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	—	879	774	12,312	各種金融
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	149	72	187	2,986	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	1,017	16,178	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	409	409	245	3,901	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	405	405	328	5,215	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	612	577	9,185	エネルギー
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	—	443	806	12,819	資本財
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	1,500	1,500	819	13,022	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	191	3,040	運輸
CHINA SPACESAT CO LTD -A	—	161	529	8,419	資本財
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	170	170	402	6,403	小売
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	—	1,400	459	7,301	不動産
SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	—	878	532	8,459	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	—	966	681	10,828	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	—	91	856	13,615	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	572	388	1,881	29,912	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	3,746	3,746	1,060	16,855	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	373	373	1,566	24,908	自動車・自動車部品
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	633	—	—	—	運輸
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	—	600	381	6,067	素材
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	39	39	902	14,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	195	195	293	4,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	67	67	1,577	25,086	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	—	208	547	8,704	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	909	562	8,946	エネルギー

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	—	85	165	2,625	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	67	506	8,049	ソフトウェア・サービス
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	—	234	833	13,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	—	115	763	12,144	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG HUAAHAI PHARMACEUT-A	—	90	305	4,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	—	310	409	6,506	運輸
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	—	243	678	10,791	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	1,017	16,178	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	—	47	306	4,874	ソフトウェア・サービス
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	—	356	586	9,328	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	—	79	834	13,261	食品・飲料・タバコ
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	—	100	252	4,014	素材
ANXIN TRUST CO LTD-A	319	—	—	—	各種金融
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	—	180	1,581	25,143	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	—	432	700	11,141	素材
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	163	163	1,176	18,704	半導体・半導体製造装置
HLA CORP LTD-A	214	—	—	—	小売
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	383	383	378	6,016	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	118	141	2,391	38,020	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	—	173	856	13,624	食品・飲料・タバコ
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	—	293	763	12,140	自動車・自動車部品
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	816	12,988	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	—	22	132	2,112	食品・飲料・タバコ
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	434	434	366	5,824	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	578	578	351	5,587	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	170	170	218	3,467	メディア・娯楽
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	—	50	822	13,080	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	—	26	500	7,964	半導体・半導体製造装置
SDIC CAPITAL CO LTD-A	—	458	683	10,872	各種金融
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	—	47	1,109	17,634	ヘルスケア機器・サービス
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	—	78	812	12,924	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	—	82	808	12,856	資本財
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	—	86	618	9,832	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	317	317	372	5,922	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A	83	83	381	6,060	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	1,018	36	71	1,129	各種金融
DAWNING INFORMATION INDUST-A	—	56	209	3,338	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	—	110	928	14,756	商業・専門サービス
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	—	1,176	752	11,966	不動産
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	128	128	437	6,950	不動産
小 計	株 数	83,906	131,897	245,922	3,910,161
	銘 柄 数 <比 率>	114	284	—	<4.7%>
合 計	株 数	2,583,182	2,692,452	—	79,013,034
	銘 柄 数 <比 率>	1,031	1,180	—	<95.8%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		邦貨換算金額 (千円)
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	308,400	5,353		27,625
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	43,300	58,400	5,074		26,186
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	351,700 2	366,800 2	10,428 -	53,812 <0.1%>
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	26,962	1,118		21,858
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	39,900	58,600	2,005		39,183
ENERGISA SA-UNITS	16,500	16,500	763		14,924
KLABIN SA-UNIT	83,000	64,600	1,520		29,714
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	25,400	1,993		38,960
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	181,362 5	192,062 5	7,402 -	144,641 <0.2%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	-	-		-
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	295,047	3,693		25,229
FORTRESS REIT LTD-A	189,245	-	-		-
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,032,277 3	295,047 1	3,693 -	25,229 <0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,565,339 10	853,909 8	- -	223,683 <0.3%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	MSCI EMERG M	3,138	-

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	79,013,034	94.9%
投 資 信 託 受 益 証 券	170,828	0.2
投 資 証 券	52,855	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,019,447	4.8
投 資 信 託 財 産 総 額	83,256,164	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(83,240,253千円)の投資信託財産総額(83,256,164千円)に対する比率は100.0%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=105.21円	1メキシコペソ=5.16円	1ブラジルレアル=19.54円
1チリペソ=0.1391円	1コロンビアペソ=0.0288円	1ユーロ=124.27円
1イギリスポンド=138.52円	1トルコリラ=12.95円	1チェココルナ=4.68円
1ハンガリーフォリント=0.3459円	1ポーランドズロチ=27.69円	1香港ドル=13.57円
1マレーシアリンギット=25.58円	1タイバーツ=3.46円	1フィリピンペソ=2.19円
1インドネシアルピア=0.0075円	1韓国ウォン=0.0942円	1新台幣ドル=3.69円
1インドルピー=1.43円	1パキスタンルピー=0.67円	1カタールリアル=28.47円
1南アフリカランド=6.83円	1アラブ首長国連邦ディルハム=28.69円	1サウジアラビアリアル=28.09円
1香港・オフショア人民元=15.90円		

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年11月10日現在
(A)資 産	84,084,278,293円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,566,848,225
株 式(評価額)	79,013,034,918
投資信託受益証券(評価額)	170,828,015
投 資 証 券(評価額)	52,855,672
未 収 入 金	1,081,124,886
未 収 配 当 金	61,787,807
差 入 委 託 証 拠 金	1,137,798,770
(B)負 債	1,580,518,713
未 払 金	841,743,101
未 払 解 約 金	738,775,590
未 払 利 息	22
(C)純 資 産 総 額(A-B)	82,503,759,580
元 本	26,069,398,222
次 期 繰 越 損 益 金	56,434,361,358
(D)受 益 権 総 口 数	26,069,398,222口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,648円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日
(A)配 当 等 収 益	1,424,778,246円
受 取 配 当 金	1,419,032,488
受 取 利 息	4,885,414
そ の 他 収 益 金	1,011,228
支 払 利 息	△150,884
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	6,399,152,581
売 買 益	16,825,994,012
売 買 損	△10,426,841,431
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	537,134,581
取 引 益	1,462,096,216
取 引 損	△924,961,635
(D)そ の 他 費 用	△99,855,318
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	8,261,210,090
(F)前 期 繰 越 損 益 金	40,581,859,847
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	10,682,933,655
(H)解 約 差 損 益 金	△3,091,642,234
(I)計 (E+F+G+H)	56,434,361,358
次 期 繰 越 損 益 金(I)	56,434,361,358

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は21,641,099,794円、期中追加設定元本額は6,101,145,339円、期中一部解約元本額は1,672,846,911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。

SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,527,649,401円
DC世界経済インデックスファンド	5,089,165,939円
DC新興国株式インデックス・オープン	4,620,749,680円
世界経済インデックスファンド	4,032,144,151円
分散投資コア戦略ファンドS	1,286,691,180円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	630,188,596円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	571,145,613円
グローバル経済コア	420,561,727円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	343,620,707円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	326,426,791円
分散投資コア戦略ファンドA	323,155,672円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	306,692,520円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	192,442,399円
SMT インデックスバランス・オープン	105,988,335円
SMT 世界経済インデックス・オープン	103,644,788円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	82,225,009円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	60,827,041円
i-SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	22,536,881円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	19,028,469円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,570,105円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	609,917円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	531,321円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	492,755円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	309,225円

## お知らせ

該当事項はありません。