

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／資産複合	
信 託 期 間	信託期間は2001年10月1日から無期限です。	
運 用 方 針	確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。	
主要運用対象	DCマイセクション50	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	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。
	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。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組 入 制 限	DCマイセクション50	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は、投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	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。
	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。
	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。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分 配 方 針	原則として、毎年9月30日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、収益の分配を行います。 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等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

DCマイセクション50

運 用 報 告 書（全 体 版）

第19期（決算日 2020年9月30日）

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			参 考 指 数		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	投資信託 証券 組入比率	純資産 総 額
	(分配落)	税 込 分配金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
第15期(2016年 9月30日)	16,527	0	△0.4	14,735	△1.0	48.5	1.0	44.9	0.0	0.4	57,594
第16期(2017年10月 2日)	18,853	0	14.1	16,626	12.8	50.6	1.2	43.3	0.1	0.4	68,580
第17期(2018年10月 1日)	19,890	0	5.5	17,385	4.6	49.1	1.3	44.2	0.0	0.3	79,209
第18期(2019年 9月30日)	19,401	0	△2.5	16,833	△3.2	50.0	1.1	43.8	0.1	0.4	80,635
第19期(2020年 9月30日)	20,018	0	3.2	17,154	1.9	49.4	1.1	44.1	0.1	0.4	86,015

(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。

参考指数は、TOPIX(東証株価指数)35%、NOMURA-BPI総合40%、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)15%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)5%および短期金融資産(有担保コール翌日物)5%を当社で独自に合成した指数で、設定日を10,000として指数化しております。

TOPIX(東証株価指数)

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。

NOMURA-BPI総合

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。

MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 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
		騰落率		騰落率					
(当 期 首) 2019年 9月30日	円 19,401	% —	16,833	% —	% 50.0	% 1.1	% 43.8	% 0.1	% 0.4
10月末	19,840	2.3	17,192	2.1	50.5	1.2	43.0	0.0	0.4
11月末	20,066	3.4	17,380	3.3	51.0	1.0	42.8	0.0	0.4
12月末	20,245	4.4	17,518	4.1	51.6	0.9	43.0	0.1	0.4
2020年 1月末	20,126	3.7	17,412	3.4	50.4	0.9	43.6	0.0	0.4
2月末	19,207	△1.0	16,665	△1.0	47.5	1.0	46.3	0.0	0.4
3月末	18,309	△5.6	15,732	△6.5	48.2	1.7	44.6	0.0	0.4
4月末	18,869	△2.7	16,216	△3.7	49.9	1.4	43.4	0.1	0.4
5月末	19,428	0.1	16,695	△0.8	50.5	1.3	42.7	0.1	0.4
6月末	19,452	0.3	16,705	△0.8	48.9	0.8	44.8	0.1	0.4
7月末	19,311	△0.5	16,590	△1.4	48.4	0.7	45.3	0.1	0.4
8月末	20,032	3.3	17,208	2.2	50.2	0.6	43.8	0.1	0.4
(当 期 末) 2020年 9月30日	20,018	3.2	17,154	1.9	49.4	1.1	44.1	0.1	0.4

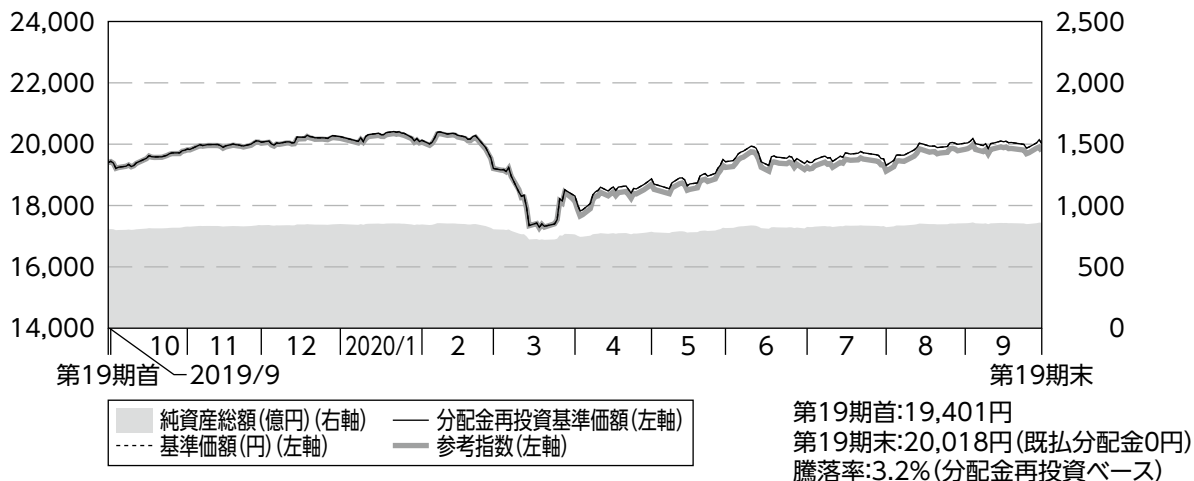
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及び参考指数は、2019年9月30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1月にかけては、米中通商協議の進展期待や各国中央銀行の金融緩和期待などを背景に底堅く推移しました。2月から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財政出動や金融緩和策への期待などを背景に上昇しました。

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
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	35.0%	35.3%	4.9%
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	40.0%	39.2%	△1.8%
外国株式インデックス マザーファンド	外国株式	15.0%	15.5%	8.6%
外国債券インデックス マザーファンド	外国債券	5.0%	5.0%	6.1%

投資環境

国内株式市場

期初から2020年1月にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景に底堅く推移しました。1月下旬以降は、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への期待や各国の経済対策への期待の高まりなどをきっかけに反発しました。

国内債券市場

期初から2019年12月にかけては、米中通商協議の進展期待の高まりによる米国長期金利上昇の影響などから、利回りは上昇しました。2020年1月から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。

外国株式市場

期初から2020年1月にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景に底堅く推移しました。1月下旬以降は、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が打ち出した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への期待感などを背景に上昇しました。

外国債券市場

期初から2019年12月にかけては、主要国の利回りは上昇しました。2020年1月から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、その後は、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。

○当ファンド

国内外の公社債および株式へ分散投資することにより、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行いました。当期中の各資産への配分は、基本組入比率を概ね維持する運用を行いました。

・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。

・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。

・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。

・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。

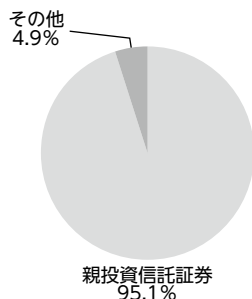
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

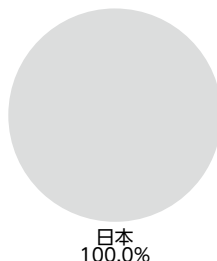
	当期末
	2020年9月30日
国内債券インデックス マザーファンド	39.2%
国内株式インデックス マザーファンド	35.3%
外国株式インデックス マザーファンド	15.5%
外国債券インデックス マザーファンド	5.0%
その他	4.9%
組入ファンド数	4

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

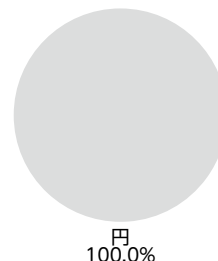
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

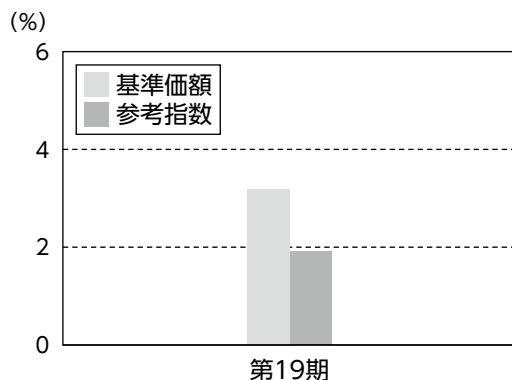


(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

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



分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、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19期
		2019年10月1日～2020年9月30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)	10,166

(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して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。

基準ポートフォリオは、国内株式35%、国内債券40%、外国株式15%、外国債券5%および短期金融資産5%の比率で基準配分します。

・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。

・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。

・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。

・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。

1万口当たりの費用明細

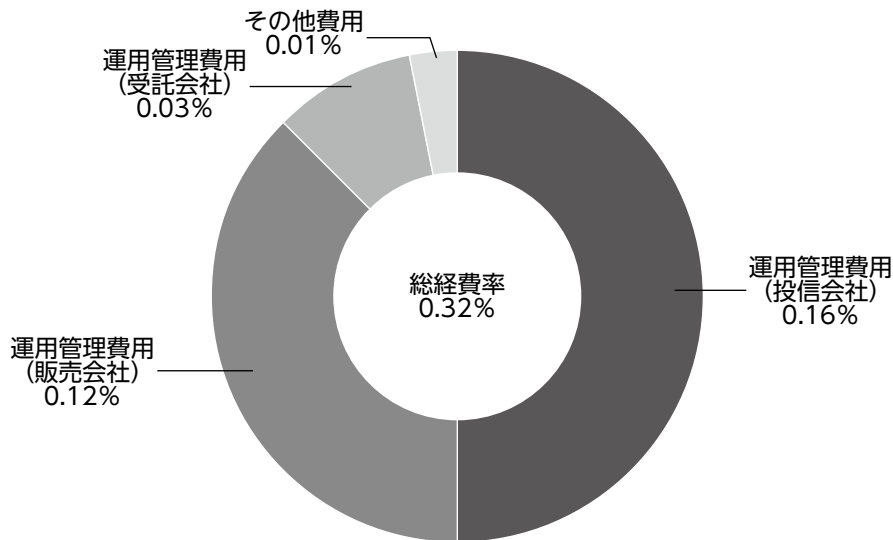
項目	当期		項目の概要
	(2019年10月1日~2020年9月30日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	62円	0.319%	(a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は19,523円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(32)	(0.165)	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(販売会社)	(24)	(0.121)	
(受託会社)	(6)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	
(株式)	(0)	(0.001)	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(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	2	0.008	
(保管費用)	(1)	(0.006)	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	64	0.329	

- (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0.32%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
国内株式インデックス マザーファンド	3, 374, 035	4, 366, 560	3, 266, 225	4, 594, 900
外国株式インデックス マザーファンド	907, 803	2, 103, 910	1, 025, 251	2, 687, 040
国内債券インデックス マザーファンド	5, 135, 242	7, 274, 010	3, 355, 685	4, 788, 770
外国債券インデックス マザーファンド	259, 935	750, 360	114, 142	325, 940

株式売買比率

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	143, 177, 455千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	310, 829, 120千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 46

(注1) (b) 当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	82, 034, 528千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	373, 919, 944千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 21

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 815	百万円 815	% 100.0	百万円 815	百万円 815	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	944,269	134,122	14.2	943,824	135,006	14.3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			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 833	百万円 833	% 100.0	百万円 833	百万円 833	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	892,843	123,279	13.8	892,841	124,081	13.9

<平均保有割合 9.2%>

(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。

<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	$\frac{B}{A}$	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 82,467	百万円 37	% 0.0	百万円 66,773	百万円 —	% —
金 銭 信 託	159	159	100.0	159	159	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	212,626	27,204	12.8	212,358	27,426	12.9

<平均保有割合 3.3%>

(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	$\frac{B}{A}$	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 526	百万円 526	% 100.0	百万円 526	百万円 526	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	324,718	40,523	12.5	365,775	50,719	13.9

＜平均保有割合 5.9％＞
(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜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	$\frac{B}{A}$	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 41,135	百万円 1,357	% 3.3	百万円 166,122	百万円 648	% 0.4
金 銭 信 託	947	947	100.0	947	947	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,030,122	158,917	15.4	1,031,587	160,065	15.5

＜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。

■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	230百万円	149百万円	799百万円		

(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
国内株式インデックス マザーファンド	19,478,609	19,586,419	30,355,032
外国株式インデックス マザーファンド	4,863,364	4,745,915	13,368,295
国内債券インデックス マザーファンド	22,149,547	23,929,104	33,752,001
外国債券インデックス マザーファンド	1,294,876	1,440,668	4,301,260

(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。

国内株式インデックス マザーファンド	229,881,049千口
外国株式インデックス マザーファンド	150,010,636千口
国内債券インデックス マザーファンド	409,009,122千口
外国債券インデックス マザーファンド	95,980,753千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式インデックス マザーファンド	30,355,032	35.2
外国株式インデックス マザーファンド	13,368,295	15.5
国内債券インデックス マザーファンド	33,752,001	39.2
外国債券インデックス マザーファンド	4,301,260	5.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,432,877	5.1
投 資 信 託 財 産 総 額	86,209,465	100.0

(注1)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(421,351,634千円)の投資信託財産総額(422,833,635千円)に対する比率は99.6%です。

(注2)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(283,101,642千円)の投資信託財産総額(286,668,404千円)に対する比率は98.8%です。

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

1米ドル=105.80円	1カナダドル=79.03円	1メキシコペソ=4.72円
1ユーロ=124.17円	1イギリスポンド=136.09円	1スイスフラン=115.04円
1スウェーデンクローナ=11.81円	1ノルウェークローネ=11.23円	1デンマーククローネ=16.68円
1ポーランドズロチ=27.40円	1オーストラリアドル=75.49円	1ニュージーランドドル=69.79円
1香港ドル=13.65円	1シンガポールドル=77.30円	1マレーシアリングgit=25.45円
1イスラエルシェケル=30.71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9月30日現在
(A)資 産	86,209,465,684円
コール・ローン等	4,308,585,561
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	30,355,032,206
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	13,368,295,724
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	33,752,001,365
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,301,260,828
未 収 入 金	124,290,000
(B)負 債	193,981,779
未 払 解 約 金	61,477,464
未 払 信 託 報 酬	130,558,162
未 払 利 息	9,954
そ の 他 未 払 費 用	1,936,199
(C)純 資 産 総 額(A-B)	86,015,483,905
元 本	42,968,567,527
次 期 繰 越 損 益 金	43,046,916,378
(D)受 益 権 総 口 数	42,968,567,527口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,018円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年10月 1日 至 2020年 9月30日
(A)配 当 等 収 益	△1,847,874円
受 取 利 息	16,877
支 払 利 息	△1,864,751
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,843,679,006
売 買 益	3,827,356,262
売 買 損	△983,677,256
(C)信 託 報 酬 等	△263,747,377
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	2,578,083,755
(E)前 期 繰 越 損 益 金	15,712,108,193
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	24,756,724,430
(配 当 等 相 当 額)	(25,393,335,355)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△636,610,925)
(G) 計 (D+E+F)	43,046,916,378
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	43,046,916,378
追 加 信 託 差 損 益 金	24,756,724,430
(配 当 等 相 当 額)	(25,393,335,355)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△636,610,925)
分 配 準 備 積 立 金	18,292,039,822
繰 越 損 益 金	△1,847,874

- (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41,562,770,646円、期中追加設定元本額は5,348,337,046円、期中一部解約元本額は3,942,540,165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)	－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)	1,103,379,933円
(C) 収益調整金額	25,393,335,355円
(D) 分配準備積立金額	17,188,659,889円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	43,685,375,177円
(F) 期末残存口数	42,968,567,527口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	10,166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。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
第16期(2016年5月30日)	円 11,755	% △16.7	1,366.01	% △18.4	% 97.9	百万円 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 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率		
(当 期 首) 2019年 5月29日	円 14,134	% －	1,536.41	% －	% 97.8	% 2.2
5月末	13,912	△1.6	1,512.28	△1.6	98.0	2.1
6月末	14,292	1.1	1,551.14	1.0	98.7	1.5
7月末	14,422	2.0	1,565.14	1.9	99.0	1.0
8月末	13,935	△1.4	1,511.86	△1.6	98.9	1.1
9月末	14,775	4.5	1,587.80	3.3	98.2	1.9
10月末	15,514	9.8	1,667.01	8.5	97.9	1.9
11月末	15,816	11.9	1,699.36	10.6	98.2	1.8
12月末	16,044	13.5	1,721.36	12.0	98.9	1.1
2020年 1月末	15,701	11.1	1,684.44	9.6	98.7	1.3
2月末	14,087	△0.3	1,510.87	△1.7	98.5	1.5
3月末	13,248	△6.3	1,403.04	△8.7	97.3	2.6
4月末	13,822	△2.2	1,464.03	△4.7	97.9	2.1
(当 期 末) 2020年 5月29日	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7

(注1) 騰落率は期首比です。

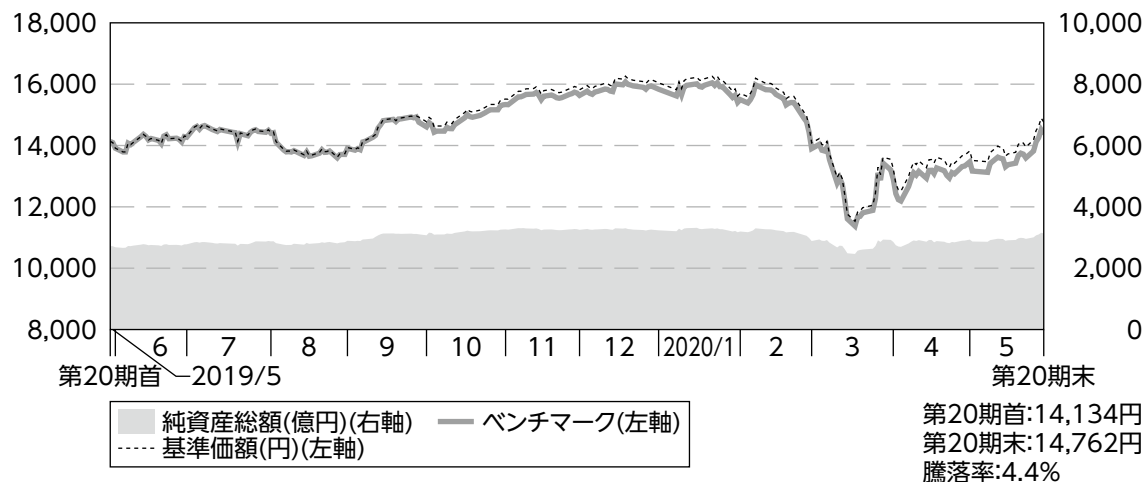
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

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

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

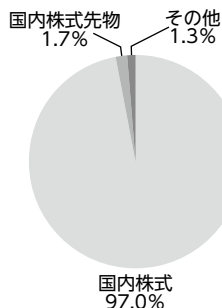
○上位10銘柄

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

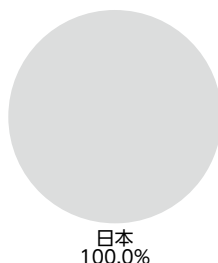
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本電信電話	日本	1.4%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	第一三共	日本	1.3%
10	任天堂	日本	1.2%
組入銘柄数			2,104

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

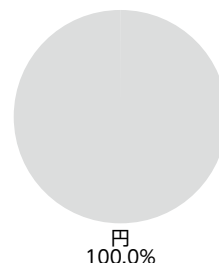
○資産別配分



○国別配分



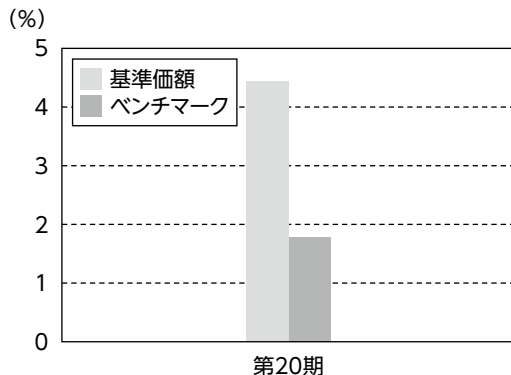
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日～2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (0) (－) (－) (－) (－) (0)	0.001% (0.000) (0.000) (－) (－) (－) (－) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(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＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(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＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

＜株 式＞

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

＜新株予約権証券＞

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 48,977	百万円 49,910	百万円 －	百万円 －

(注) 金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

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

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

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

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■ 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	221百万円	144百万円	818百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。
(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
中村屋	3.1	3.6	14,634	
江崎グリコ	36.4	41.2	214,652	
名糖産業	5.8	6.7	8,723	
井村屋グループ	5.2	7.9	16,163	
不二家	6.8	7.8	16,941	
山崎製パン	99.1	104.2	201,210	
第一屋製パン	2.1	2.4	2,287	
モロゾフ	2.1	2.4	14,304	
亀田製菓	7.5	7.9	42,818	
寿スビリッツ	12.8	13.4	70,350	
カルビー	55.2	63.3	197,179	
森永乳業	24.3	25.7	116,421	
六甲バター	8.8	9.2	14,646	
ヤクルト本社	89.8	95.6	630,960	
明治ホールディングス	85.9	91.9	745,309	
雪印メグミルク	29.2	33.5	88,607	
ブリマハム	17	21.7	57,266	
日本ハム	50.2	53.1	211,338	
林兼産業	4	4.6	2,658	
丸大食品	12.9	14.8	28,786	
S F o o d s	10.9	11.1	28,338	
柿安本店	—	4.8	12,566	
伊藤ハム米久ホールディングス	78	89.5	59,965	
サッポロホールディングス	44.3	47.4	102,147	
アサヒグループホールディングス	253.8	291	1,180,878	
キリンホールディングス	548.3	589.4	1,301,100	
宝ホールディングス	90.8	103	89,507	
オエノンホールディングス	34.3	36.7	14,496	
養命酒製造	3.7	4.3	8,105	
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	92.8	97.5	208,650	
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	
かじや製油	1.3	1.5	5,572	
Jーオイルミルズ	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	
ビックスコーポレーション	2.9	3	6,897	
北の達人コーポレーション	47.6	48.5	25,268	
ユウグレナ	51.7	59.9	44,565	
ミヨシ油脂	4.6	5.3	6,163	
理研ビタミン	5.7	13.1	29,606	
繊維製品(0.5%)				
片倉工業	14.6	20.1	24,321	
グンゼ	8	10.1	38,733	
東洋紡	50.2	53.9	81,335	
ユニチカ	34.7	41	14,514	
富士紡ホールディングス	6.2	6.7	21,607	
倉敷紡績	11.3	13.7	33,236	
シキボウ	6.2	7.1	7,518	
日本毛織	39	45.1	45,370	
トーア紡コーポレーション	5	5.4	2,770	
ダイドーリミテッド	14.4	—	—	
帝国繊維	13.3	15.5	35,495	
帝人	96.5	110.9	195,627	
東レ	917.7	982.7	514,836	
サカイオーベックス	3	3.8	8,230	
住江織物	3.5	3	5,790	
日本フェルト	6.9	8.6	4,110	
イチカワ	1.8	2.3	3,153	
日東製網	1.4	1.6	2,289	
アツギ	9.9	11.3	6,983	
ダイニツク	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	—	—	
クラウドシアホールディングス	3.1	3.6	1,551	
T S I ホールディングス	43.8	45.7	21,113	
マツオカコーポレーション	3.8	3.9	9,426	
ワールド	15.5	19.3	30,243	
三陽商会	7.2	7.2	6,523	
ナイガイ	4.5	5.2	1,872	
オンワードホールディングス	71.3	81.7	30,229	
ルックホールディングス	4.4	4.7	4,037	
ゴールドウイン	10.7	24.6	169,494	
デサント	28.9	26.5	42,479	
キング	6.4	6.6	3,399	
ヤマトインターナショナル	7.8	12.2	4,318	
パルプ・紙(0.2%)				
特種東海製紙	7.5	8.6	37,238	
王子ホールディングス	532.5	566.9	306,692	
日本製紙	56.7	60	95,460	
三菱製紙	19.2	15.4	5,852	
北越コーポレーション	78.5	80.8	32,804	
中越パルプ工業	5	5.7	8,396	
巴川製紙所	3.9	4	3,528	
大王製紙	57.6	59.8	87,128	
阿波製紙	3	3.5	1,928	
レンゴー	122	128.2	109,226	
トーモク	7.3	8.3	14,292	
ザ・バック	9	10.3	32,136	
化学(7.2%)				
クラレ	199.6	213.6	241,795	
旭化成	841.5	898.8	763,980	
共和レザー	7.4	7.4	4,995	
昭和電工	78.6	96.5	248,487	
住友化学	931.1	996.3	332,764	
住友精化	5.8	6	18,240	
日産化学	72.6	75.3	358,051	
ラサ工業	4.2	4.8	7,123	
クレハ	10.9	11.6	55,042	
多木化学	3.5	5.3	38,160	
テイカ	9.6	9.9	15,592	
石原産業	22.7	24.3	18,516	
片倉コープアグリ	3.4	3.5	4,189	
日東エフシー	7.4	—	—	
日本曹達	18.7	20.1	60,119	
東ソー	182.8	209.6	313,980	
トクヤマ	34.1	39.1	100,721	
セントラル硝子	25.8	27.7	54,402	
東亜合成	74.2	85.1	87,738	
大阪ソーダ	12.7	13.8	36,156	

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
日本化薬	75.3	83.9	90,779	
カーリットホールディングス	12.7	14.5	8,018	
日本精化	9.5	10.9	16,088	
扶桑化学工業	12	13.7	55,005	
トリケミカル研究所	2.6	3	32,070	
ADEKA	58.3	62.4	93,537	
日油	44.6	51.1	195,713	
新日本理化	—	22.4	4,032	
ハリマ化成グループ	9.8	11.2	11,144	
花王	293.2	331.5	2,866,480	
第一工業製薬	4.4	5.1	24,046	
石原ケミカル	3	3.7	7,211	
日華化学	4.1	4.6	4,324	
ニイタカ	1.9	2.8	10,262	
三洋化成工業	8	8.1	40,014	
有機合成薬品工業	9.3	10.4	3,983	
大日本塗料	13.4	15.3	15,055	
日本ペイントホールディングス	97.6	111.9	840,369	
関西ペイント	132.9	152.4	340,156	
神東塗料	9.6	10.7	1,926	
中国塗料	38.8	38.6	31,574	
日本特殊塗料	8.9	10.1	9,120	
藤倉化成	15.9	18.3	9,150	
太陽ホールディングス	9.7	10	50,600	
D I C	53.5	57.3	161,070	
サカタインクス	25.8	29.6	31,760	
東洋インキSCホールディングス	25	28.7	59,724	
T&K TOKA	9.2	10.5	8,379	
富士フイルムホールディングス	250.9	265.5	1,322,455	
資生堂	240	275.1	1,807,407	
ライオン	168.3	180	443,700	
高砂香料工業	8.3	8.7	21,523	
マンダム	27.2	31.1	67,704	
ミルボン	14.9	18.5	98,235	
ファンケル	53.8	56	171,360	
コーセー	20.5	26	350,740	
コタ	6.4	8	9,632	
シーボン	1.5	1.8	3,855	
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	
アジュパンコスメジャパン	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	額 (千円)
メック	8.3	9.5	19,826	
日本高純度化学	3.3	3.8	10,199	
タカラバイオ	31.6	36.2	104,038	
J C U	15.7	16.8	54,600	
新田ゼラチン	7.6	8.7	6,298	
O A T アグリオ	1.7	2.4	2,733	
デクセリアルズ	31.2	35.8	30,716	
アース製薬	9.1	10.4	74,048	
北興化学工業	12.3	14.2	8,676	
大成ラミック	4	4.5	12,078	
クミアイ化学工業	49.9	57.3	49,851	
日本農薬	21.4	24.7	12,177	
アキレス	8.8	9.5	16,102	
有沢製作所	18.9	21.9	17,760	
日東電工	83.3	95.5	556,765	
レック	12.9	14.8	23,650	
三光合成	13.9	15.8	5,024	
きもと	20.9	23.5	3,689	
藤森工業	10.9	12.4	43,586	
前澤化成工業	8.3	8.8	9,160	
未来工業	6.5	7.4	14,481	
ウェーブブロックホールディングス	3.4	4.8	3,758	
J S P	7.1	8.1	11,979	
エフピコ	13.3	15.2	120,232	
天馬	8.4	9.2	16,790	
信越ポリマー	21.6	24.9	23,655	
東リ	30.2	34.5	9,004	
ニフコ	48.4	50.8	119,786	
バルカー	9.8	11.2	23,307	
ユニ・チャーム	256.1	266.9	1,070,269	
ショーエイコーポレーション	1	2.1	1,852	
医薬品 (7.2%)				
協和キリン	141.7	139.3	407,034	
武田薬品工業	1,054.4	1,152	4,828,032	
アステラス製薬	1,113.5	1,200.5	2,298,357	
大日本住友製薬	89.5	102.6	156,259	
塩野義製薬	154.4	174.1	1,107,450	
田辺三菱製薬	126.3	—	—	
わかもと製薬	14.3	16.5	4,158	
あすか製薬	14.9	15.8	18,644	
日本新薬	31.6	36.2	335,936	
バイオフェルミン製薬	2.1	2.4	5,481	
中外製薬	125.9	144.4	2,294,516	
科研製薬	21.8	23.7	140,304	
エーザイ	144.6	165.7	1,398,176	
ロート製薬	61.9	71.1	235,341	
小野薬品工業	285.2	318	978,486	
久光製薬	35.7	36.6	198,738	

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

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

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	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	
電気機器 (14.5%)				
日清紡ホールディングス	67.2	92.4	74,012	
イビデン	74.1	84.9	242,134	
コニカミノルタ	264.2	303.7	121,176	
ブラザー工業	157.5	169.3	343,509	
ミネベアミツミ	224.4	257.3	486,554	
日立製作所	543.7	665.3	2,298,611	
三菱電機	1,207.7	1,384.6	1,964,055	
富士電機	78.4	83.5	240,396	
東洋電機製造	4.9	5.1	6,456	
安川電機	140	149.1	577,017	
シンフォニアテクノロジー	16.9	18	19,638	
明電舎	24	25.5	46,461	
オリジン	3.4	3.8	5,700	
山洋電気	5.9	6.8	33,320	
デンヨー	11.2	11.9	22,848	
東芝テック	15.2	17.4	65,163	
芝浦メカトロニクス	2.2	2.6	7,077	
マブチモーター	33.5	38.5	137,060	
日本電産	145.3	333.3	2,207,112	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.8	—	—	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43.6	46.5	88,629	
サクサホールディングス	3.1	3.3	5,765	
メルコホールディングス	5.1	5	13,485	
テクノメディカ	1.8	3.4	6,160	
日本電気	156.3	168	812,280	
富士通	116.4	133.5	1,481,850	
沖電気工業	52.4	56.4	60,122	
岩崎通信機	5.6	6.1	5,203	
電気興業	6.4	6.7	17,728	
サンケン電気	14.2	15.2	37,878	
ナカヨ	2.5	2.8	3,928	
アイホン	6.9	7.9	12,521	
ルネサスエレクトロニクス	125.7	663.2	370,728	
セイコーエプソン	149.9	171.9	208,686	
ワコム	88.3	94.1	45,732	
アルバック	24.1	25.5	82,492	
アクセル	5.6	6.4	5,408	
E I Z O	11.1	10.8	43,416	
日本信号	30.9	35.4	42,940	
京三製作所	26.2	32.7	17,363	
能美防災	16.1	18.6	37,460	
ホーチキ	7.9	10.4	14,206	
星和電機	7.1	7.6	5,479	
エレコム	11.5	15.4	78,694	
パナソニック	1,379.8	1,582.1	1,523,562	
シャープ	119.9	160.3	187,070	
アンリツ	77.8	89.2	189,371	
富士通ゼネラル	37	37.6	79,148	
ソニー	810.3	867.4	5,962,507	
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	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	
輸送用機器 (7.3%)				
トヨタ紡織	42.3	40.4	61,327	
芦森工業	2.6	2.9	2,650	
ユニプレス	23.4	26.9	28,083	
豊田自動織機	97.8	112.1	617,671	
モリタホールディングス	21.2	24.2	43,874	
三機工業	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	
レンプホールディングス	4.3	5.4	3,202	
GMB	2.4	2.6	1,781	
ファルテック	2.2	2.5	1,825	
武蔵精密工業	29.4	30.9	30,003	
日産車体	23.6	27	27,378	
新明和工業	50.6	37.3	39,799	
極東開発工業	24	25.7	35,388	
日信工業	22.1	28.2	62,322	
トビー工業	10	11.4	15,162	
ティラド	4.4	5.1	7,206	
曙ブレーキ工業	65.1	76	14,516	
タチエス	19.9	22.8	20,383	
NOK	65	74.5	102,735	
フタバ産業	33.6	38.6	20,187	
KYB	12.1	15.5	33,092	
大同メタル工業	19.6	26.7	15,219	
プレス工業	60	68.9	18,327	
ミクニ	15.5	17.8	5,251	
太平洋工業	25.3	29.1	28,721	
ケーヒン	27.8	31.8	80,899	
河西工業	14.8	18.8	9,719	
アイシン精機	99.5	114	387,030	
マツダ	379	407.4	280,698	
今仙電機製作所	11.3	12.9	9,636	
本田技研工業	1,018.8	1,090.2	3,035,116	
スズキ	220.9	274.4	1,027,902	
SUBARU	374.9	429.8	1,022,279	
安永	5.9	6.7	6,827	
ヤマハ発動機	170.6	180.6	280,833	
ショーワ	28.6	32.7	73,542	
TBK	14.5	16.6	7,719	
エクセディ	16.4	18.8	32,580	
豊田合成	39	44.7	102,944	
愛三工業	18.9	21.8	12,644	
盟和産業	1.9	2.2	2,127	
日本プラス	9.5	11	5,159	
ヨロズ	11.3	13	15,080	
エフ・シー・シー	21.7	22.7	41,541	
シマノ	48.7	51.8	1,026,158	

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	
ユーザーローカル	—	1.4	4,508	
テモナ	—	3.3	2,554	
ニーズウェル	—	3	2,115	
サインポスト	—	3	5,133	
ソルクシーズ	5.2	6.2	4,451	
フェイス	4.9	5.2	3,452	
プロトコーポレーション	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	
F I G	11	15.7	4,286	
システムサポート	—	3.2	6,304	
イーソル	—	6.7	9,849	
アルテリア・ネットワークス	13.3	15.2	30,141	
東海ソフト	—	1.2	1,632	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.8	2.6	2,875	
トピラシステムズ	—	1.8	3,214	
フォーカスシステムズ	8.1	8.7	8,021	
クレスコ	3.7	8.4	13,112	
フジ・メディア・ホールディングス	123.1	131.1	141,850	
オービック	41.1	47.1	879,828	
ジャストシステム	16.9	22.1	163,540	
TDCソフト	10.5	12.2	11,565	
Zホールディングス	773.3	1,866.4	821,216	
トレンドマイクロ	63.2	60.5	358,160	
IDホールディングス	4.7	5.4	8,218	
日本オラクル	24	27.6	347,208	
アルファシステムズ	3.8	4.3	17,028	
フューチャー	16.2	16.6	29,697	
CAC Holdings	8.6	9.1	11,811	
SBテクノロジー	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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	
ソフトブレーン	9.7	8.5	4,496	
電通国際情報サービス	7.4	8.5	42,755	
ACCESS	—	13	12,454	
デジタルガレージ	23.1	24.5	93,712	
EMシステムズ	9.7	19.4	16,296	
ウェザーニューズ	4.1	4.7	17,742	
C I J	9.4	9.6	9,081	
ビジネスエンジニアリング	1.3	1.7	4,576	
日本エンタープライズ	13.3	14.8	4,114	
WOWOW	5.8	6.6	16,896	
スカラ	8.4	9.4	6,645	
インテリジェント ウェイブ	4.7	8.3	6,415	
IMAGICA GROUP	10.3	12.3	5,190	
ネットワンシステムズ	42	51.8	168,868	
システムソフト	29.8	32.7	2,746	
アルゴグラフィックス	10.1	11.6	43,094	
マーベラス	18.3	21.1	16,458	
エイベックス	20.5	23.6	22,490	
日本ユニシス	37.1	42.5	141,525	
兼松エレクトロニクス	6.5	7.5	29,775	
東京放送ホールディングス	78.7	82.8	140,180	
日本テレビホールディングス	108.9	113.6	141,318	
朝日放送グループホールディングス	12	13.9	10,216	
テレビ朝日ホールディングス	32.7	37.5	63,450	
スカパーJ SATホールディングス	90.9	90	39,510	
テレビ東京ホールディングス	9.8	11.3	27,707	
日本BS放送	4.2	4.8	5,414	
ビジョン	3.7	13	11,063	
スマートバリュー	3.7	3.8	4,503	
ワイヤレスゲート	5.6	6.9	3,891	
コネクシオ	8.5	7.9	11,707	
クロップス	2.4	2.9	2,061	
日本電信電話	810.6	1,816.3	4,439,037	
KDDI	1,044.4	1,012.6	3,175,513	
ソフトバンク	1,256.6	1,234.9	1,686,873	
光通信	14	14	330,540	
NTTドコモ	750.4	971.6	2,867,677	
エムティーアイ	11.7	13.6	8,173	
GMOインターネット	43.3	53.7	146,493	
ファイバーゲート	—	4.6	6,375	
アイドマ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	価 額 (千円)
学研ホールディングス	4	18.4	30,562	
ゼンリン	23.7	27.3	37,237	
昭文社ホールディングス	5.9	7	2,828	
インプレスホールディングス	9.8	11.2	1,702	
アイネット	6.9	7.2	11,066	
松竹	7.9	9	126,900	
東宝	78	80.2	317,592	
東映	5	5.1	74,919	
エヌ・ティ・ティ・データ	315.7	362	450,690	
ビー・シー・エー	1.6	2.4	10,080	
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	2.4	6,376	
D T S	13.3	30.5	69,997	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55.2	58	303,340	
シーイーシー	12.8	14.7	27,489	
カプコン	50.9	64.1	243,900	
アイ・エス・ビー	2.4	2.8	5,966	
ジャステック	7.1	8.9	10,101	
S C S K	31.3	31.4	165,478	
日本システムウエア	4	4.6	10,842	
アイネス	15.2	13.6	19,067	
T K C	10.1	11.5	64,860	
富士ソフト	17.7	17.4	78,996	
NSD	19.5	43.8	73,759	
コナミホールディングス	48.5	49.4	186,979	
福井コンピュータホールディングス	4	5.4	16,956	
J B C Cホールディングス	9.5	9.3	15,205	
ミロク情報サービス	11.8	12.1	30,322	
ソフトバンクグループ	495.2	1,078.1	5,209,379	
卸売業(4.7%)				
ハウスイ	1	1.1	1,013	
高千穂交易	4.6	5.3	5,199	
カワニシホールディングス	—	1.6	2,142	
伊藤忠食品	2.9	3.4	15,946	
エレマテック	11.2	12.8	11,392	
J A L U X	3.4	3.9	7,070	
あらた	8.8	10.9	49,649	
トーマンデバイス	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	
ハイパー	—	2.1	1,220	

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	
OUGホールディングス	1.9	2.2	5,904	
スターゼン	4.4	5	23,150	
山善	46.5	53.3	49,888	
椿本興業	2.7	2.5	8,162	
住友商事	703.5	860.4	1,116,799	
内田洋行	5.1	5.4	30,456	
三菱商事	834.7	957	2,406,855	
第一実業	5.4	6.7	25,292	
キャノンマーケティングジャパン	34	33.8	74,224	
西華産業	6.7	7.7	9,301	
佐藤商事	10.6	11.3	10,203	
菱洋エレクトロ	12.1	13.8	36,873	
東京産業	11.8	12.4	6,931	
ユアサ商事	12.2	12.9	40,699	
神鋼商事	2.7	3.4	6,630	

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 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	
ブロンコビリー	6.3	7.2	17,496	
Z O Z O	128.6	93.9	186,297	
トレジャー・ファクトリー	3.6	4.3	3,160	
物語コーポレーション	2.9	3.7	29,045	
ココカラファイン	13.4	14.3	77,792	
三越伊勢丹ホールディングス	222.7	238.7	172,102	
H a m e e	3.8	5	6,420	
ウエルシアホールディングス	31.5	40.6	367,430	
クリエイトSDホールディングス	17.6	23	78,430	
丸善CH Iホールディングス	13.8	15.9	6,105	
ティーライフ	1.7	2.2	2,552	
エー・ピーカンパニー	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	
すかいらくホールディングス	110.9	152.9	267,116	
S F Pホールディングス	5.1	7.9	13,335	
綿半ホールディングス	4.5	5.2	9,770	
ヨシックス	2	2.3	5,694	
ユナイテッド・スーパーマー ケット・ホールディングス	34.7	39.8	44,894	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	6.6	3,907	
BEENOS	4.2	6.5	7,013	
あさひ	9.9	10.3	15,965	
日本調剤	4.2	8.4	14,523	
コスモス薬品	5.3	12.1	187,187	
トーエル	5.9	6.9	4,954	
オンリー	2.2	2.7	1,630	
セブン&アイ・ホールディングス	498.6	533.5	1,967,014	
薬王堂	5.2	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32.1	73.5	61,152	
ツルハホールディングス	25.9	29.7	472,824	
サンマルクホールディングス	9.4	10.9	20,383	
フェリシモ	2.8	3.2	3,376	
トリドールホールディングス	14.7	33.9	41,391	
T O K Y O B A S E	10.8	12.9	4,579	
ウィルプラスホールディングス	2	2	1,494	

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アークランドサカモト	20.3	21.5	25,585	
ニトリホールディングス	51.5	59	1,152,565	
グルメ杵屋	8.6	9.9	10,226	
愛眼	9.4	10.9	2,376	
ケ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	
銀行業(5.1%)				
島根銀行	3.8	3.6	1,868	
じもとホールディングス	80.1	92.3	8,860	
めびきフィナンシャルグループ	622	709.6	173,142	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16.6	18.4	19,908	
九州フィナンシャルグループ	197.4	298.8	136,850	
ゆうちょ銀行	338.2	386.9	344,341	
富山第一銀行	30.8	32.6	8,704	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	749.2	780	274,560	
西日本フィナンシャルホールディングス	76	90.9	67,447	
関西みらいフィナンシャルグループ	57.1	80.1	31,239	
三十三フィナンシャルグループ	10.9	12.7	19,583	
第四北越フィナンシャルグループ	21	23.7	53,609	
新生銀行	87.4	100.2	137,775	
あおぞら銀行	66.5	81.4	162,962	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,199.5	9,341.8	4,149,627	
りそなホールディングス	1,307.1	1,498.6	581,157	
三井住友トラスト・ホールディングス	234.1	258.1	818,435	
三井住友フィナンシャルグループ	839.5	944.5	2,945,895	
千葉銀行	411.3	455.7	233,318	
群馬銀行	240.4	262.3	88,395	
武蔵野銀行	18.1	20.3	30,795	
千葉興業銀行	36.4	37.4	9,387	
筑波銀行	49.3	56.8	10,508	
七十七銀行	37.9	46.1	70,855	
青森銀行	9.5	10.6	23,139	

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アルヒ	10.8	21.7	32,419	
プレミアグループ	6.8	7.4	14,467	
クレディセゾン	83.4	95.7	122,783	
芙蓉総合リース	13.6	14.3	88,374	
みずほリース	22.4	21.1	50,133	
東京センチュリー	24	27.5	128,837	
日本証券金融	52.5	60.2	30,401	
アイフル	181.7	208.3	55,616	
リコーリース	9.4	10.7	33,544	
イオンフィナンシャルサービス	76.1	83.6	101,406	
アコム	239.4	274.5	120,505	
ジャックス	13.2	15.1	28,508	
オリエントコーポレーション	322.2	369.4	47,283	
日立キャピタル	28.1	32.2	73,222	
アプラスフィナンシャル	56.9	65.5	4,519	
オリックス	794.7	854.1	1,220,508	
三菱UFJリース	268.7	346.6	182,311	
九州リースサービス	5.8	6.7	3,283	
日本取引所グループ	321.8	392	908,264	
イー・ギャランティ	11.2	14.6	31,886	
アサックス	4.9	7.1	4,529	
NECキャピタルソリューション	4.8	5.6	11,379	
不動産業(2.1%)				
いちご	155.2	180.3	55,352	
日本駐車場開発	138	149.1	21,023	
スター・マイカ・ホールディングス	—	8.3	12,433	
ADワークスグループ	—	25.3	4,705	
ヒューリック	250	293.5	319,915	
三栄建築設計	5.6	7.1	8,548	
スター・マイカ	6.4	—	—	
野村不動産ホールディングス	79.9	83.9	167,296	
三重交通グループホールディングス	26.2	31.7	15,120	
サムティ	17.4	20.8	30,534	
ディア・ライフ	18.3	23.6	11,210	
コーセーアールイー	5.2	—	—	
エー・ディー・ワークス	115	—	—	
日本商業開発	8.3	10	15,280	
プレサンスコーポレーション	19.8	—	—	
ユニゾホールディングス	18.7	—	—	
ハウスコム	—	3.8	5,099	
日本管理センター	9	10.7	12,936	
サンセイランディック	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	—	—	
ハウズドゥ	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	
サービス業(5.4%)				
日本工営	7.8	8.9	29,325	
LIFULL	40.5	46.5	19,762	
ジェイエシールルートメント	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	
カクコム	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	価 額 (千円)
ビジネス・ブレイクスルー	5.2	5.9	2,236	
エスブルー	—	34.1	25,745	
WDBホールディングス	5.3	6.1	16,463	
時間いらず	—	0.9	4,279	
ティア	6.9	8	4,296	
CDG	1.2	1.5	2,320	
バリューコマース	7.8	7.5	20,205	
インフオマート	63.3	145.1	131,170	
J Pホールディングス	33.3	42	11,886	
エコナックホールディングス	21.9	25.2	2,520	
E P Sホールディングス	17.4	18	19,944	
レッグス	3	3.4	3,532	
プレステージ・インターナショナル	21.7	49.7	47,314	
アミューズ	7	7.3	17,541	
ドリームインキュベータ	3.6	4.1	6,338	
クイック	7.2	8.3	10,391	
T A C	7	8.7	1,609	
ケネディクス	101.6	123.5	72,371	
電通グループ	140.6	136.4	393,514	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.5	5.2	3,536	
びあ	3.3	3.8	14,421	
イオンファンタジー	3.8	5.2	9,906	
シーティーエス	13.2	15.1	10,690	
ネクシィーズグループ	4.1	4.2	4,548	
みらかホールディングス	32.3	37.1	92,972	
アルプス技研	10.2	11.8	22,939	
ダイオーズ	2.8	2.7	3,061	
日本空調サービス	13.2	14	10,164	
オリエンタルランド	136.4	140.7	2,197,030	
ダスキン	29.7	32.9	97,055	
明光ネットワークジャパン	13.7	16.9	14,534	
ファルコホールディングス	6.4	7.4	12,321	
ラウンドワン	35.9	37.1	34,020	
リゾートトラスト	48.9	60.7	82,066	
ビー・エム・エル	14.9	17.1	51,898	
ワタベウェディング	2.1	2.5	1,070	
りらいあコミュニケーションズ	21	24	29,400	
リソー教育	58.9	60.9	18,574	
早稲田アカデミー	3.5	5.9	5,782	
ユー・エス・エス	141	148.2	278,319	
東京個別指導学院	4.2	4.9	2,979	
サイバーエージェント	66.4	81.5	442,545	
楽天	538	616.8	601,996	
クリーク・アンド・リバー社	6.9	7	7,420	
テー・オー・ダブリュー	10.2	21.4	7,597	
山田コンサルティンググループ	5.7	8.7	11,449	
セントラルスポーツ	4.3	5	13,000	
フルキャストホールディングス	11.6	13.3	21,027	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	
アビスト	1.8	2.1	5,142	
シグマクシス	5.6	9.1	17,371	
ウィルグループ	7.7	8.8	6,406	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16.3	18.9	3,855	
日本ビューホテル	3.8	—	—	
リクルートホールディングス	826.7	947.9	3,516,709	
エラン	8	7.9	14,212	
土木管理総合試験所	5.3	6.1	2,360	
ネットマーケティング	—	5.3	3,614	
日本郵政	946	1,084.6	850,434	
ベルシステム24ホールディングス	19.4	22.3	30,261	
鎌倉新書	8.5	10.1	12,089	
SMN	1.6	3	2,739	
一蔵	1.5	1.8	770	
L I T A L I C O	2.7	4.6	12,939	
グローバルキッズCOMPANY	1.9	2.6	1,622	
エアトリ	5	6.9	8,659	
アトラエ	3	4	12,860	
ストライク	4.4	5	24,000	
ソラスト	28.4	36.6	45,676	
セラク	3.8	4.3	4,205	
インソース	4.5	5.5	15,994	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	
ソウルドアウト	1.2	2.8	6,210	
MS&Consulting	2	2.7	1,746	
ミダック	—	1.8	2,959	
日総工産	7.7	9	6,345	
キュービーネットホールディングス	7	5.5	11,792	
RPAホールディングス	2.3	10.2	9,353	
スプリックス	3.9	3.9	3,494	
マネジメントソリューションズ	—	5.9	6,372	
プロレド・パートナーズ	—	1.8	9,432	
and factory	—	1.4	1,759	
ギークス	—	1.5	2,040	
カープスホールディングス	—	36.5	24,126	
フォーラムエンジニアリング	—	7	6,426	
アドバンテッジリスクマネジメント	4.7	6.8	6,140	
リログループ	63.1	72.4	178,176	
東祥	7.2	8.3	11,769	
エイチ・アイ・エス	20.6	20.6	40,726	
ラックランド	2.4	3.1	6,513	
共立メンテナンス	17.7	22	75,680	
イチネンホールディングス	12.1	14.9	18,222	
建設技術研究所	8.1	9.2	16,173	
スペース	7.6	8.7	8,813	
長大	4.8	5.4	5,562	
燦ホールディングス	2.6	5.9	6,962	
スバル興業	0.8	0.8	6,296	
東京テアトル	4.6	5.3	6,752	
タナベ経営	2.3	2.6	3,335	
ナガワ	3.2	4.2	33,600	
よみうりランド	2.5	2.9	10,875	
東京都競馬	7.6	8.7	30,841	
カナモト	17.3	21.7	50,387	
東京ドーム	43.3	53.7	48,330	
西尾レントオール	11.8	12.3	29,151	
トランス・コスモス	12.9	12.6	31,941	
乃村工藝社	54	56.8	55,436	
藤田観光	4.6	5.8	10,950	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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 銘柄数<比率>	140,334 2,078	162,264 2,102	304,033,610 <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)
千葉興業銀行第7回新株予約権	—	38,100	—	
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘柄数<比率>	— 1	38,100 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S0	20,076,868,336円
DCマイセクション75	18,038,129,668円
分散投資コア戦略ファンドS	15,498,874,548円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	13,556,829,429円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,597,759,896円
DCマイセクションS50	8,608,682,819円
DCマイセクション25	7,529,986,081円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,030,044,149円
DC日本株式インデックス・オープン	5,859,526,247円
分散投資コア戦略ファンドA	5,599,750,637円
DCマイセクションS75	5,385,777,867円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,930,460,291円
日本株式インデックス・オープン	4,272,449,559円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,086,047,882円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,052,532,100円
DCマイセクションS25	3,227,803,983円
DC世界経済インデックスファンド	2,894,315,806円
世界経済インデックスファンド	2,238,030,171円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,083,123,000円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,672,213,786円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,064,693,052円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	856,763,230円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	774,615,025円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,749,358円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	685,206,125円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	631,511,562円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	584,094,810円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	573,894,818円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	557,996,502円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	468,469,284円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	449,394,641円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	345,589,296円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	342,138,642円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	322,645,065円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	295,806,428円
グローバル経済コア	269,825,330円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	262,532,624円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	262,426,915円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	239,188,128円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,812,783円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	76,211,965円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	74,781,332円
SMT インデックスバランス・オープン	67,960,476円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	55,956,109円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,628,155円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	49,383,233円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,561,470円

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

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
第16期(2016年5月30日)	円	%		%	%	%	百万円
	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4	0.2	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	—	300,760
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382,463	0.8	99.9	—	379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390,052	2.0	99.7	0.0	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388,127	△0.5	100.5	—	540,159

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

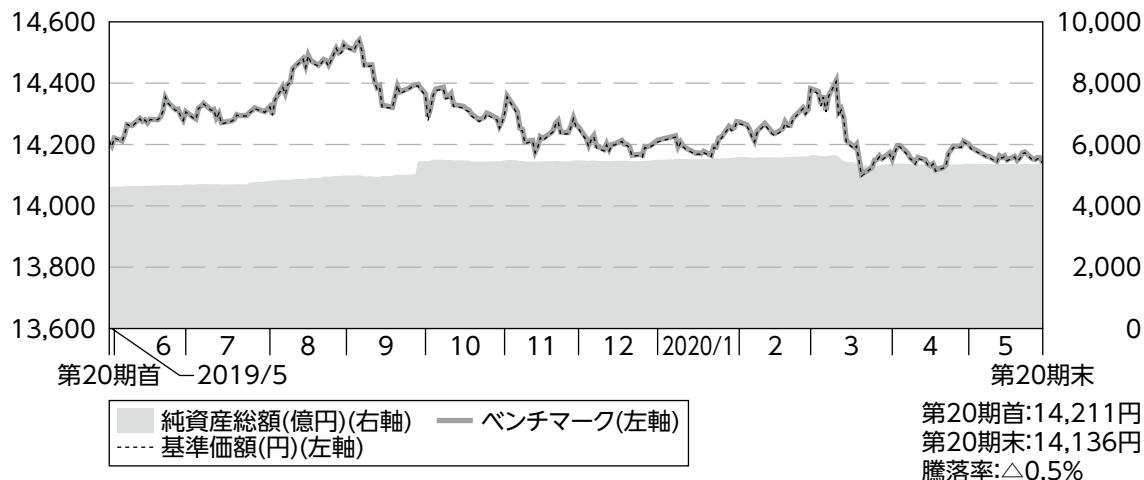
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

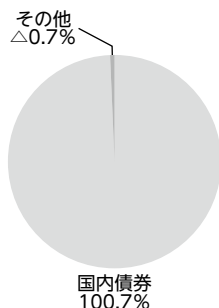
○上位10銘柄

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

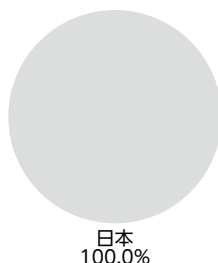
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第142回利付国債(5年)	日本	1.1%
8	第134回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第141回利付国債(5年)	日本	1.1%
10	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%
組入銘柄数		924	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

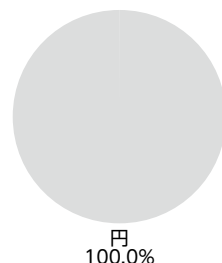
○資産別配分



○国別配分



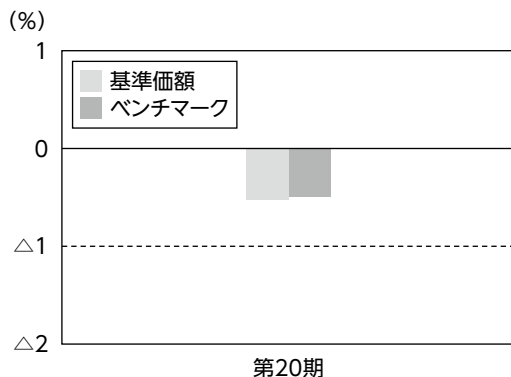
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

＜公社債＞

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

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

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

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	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

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

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

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) () 内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
国債証券				
第402回利付国債(2年)	0.1	500,000	501,435	2021/7/1
第403回利付国債(2年)	0.1	3,690,000	3,701,402	2021/8/1
第404回利付国債(2年)	0.1	460,000	461,527	2021/9/1
第405回利付国債(2年)	0.1	470,000	471,696	2021/10/1
第406回利付国債(2年)	0.1	780,000	782,995	2021/11/1
第407回利付国債(2年)	0.1	360,000	361,432	2021/12/1
第408回利付国債(2年)	0.1	690,000	692,904	2022/1/1
第409回利付国債(2年)	0.1	2,670,000	2,681,854	2022/2/1
第410回利付国債(2年)	0.1	390,000	391,809	2022/3/1
第412回利付国債(2年)	0.1	780,000	784,040	2022/5/1
第129回利付国債(5年)	0.1	3,340,000	3,351,322	2021/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	3,160,000	3,172,766	2021/12/20
第131回利付国債(5年)	0.1	4,990,000	5,013,403	2022/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	4,770,000	4,795,996	2022/6/20
第133回利付国債(5年)	0.1	4,380,000	4,406,805	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	6,050,000	6,091,079	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	4,080,000	4,110,967	2023/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	4,140,000	4,174,279	2023/6/20

銘 柄 名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第137回利付国債(5年)	0.1	6,900,000	6,959,547	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	9,420,000	9,505,816	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	4,380,000	4,421,829	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	7,300,000	7,372,854	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	6,020,000	6,082,547	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	6,050,000	6,115,098	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	2,000,000	2,022,200	2025/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	600,140	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,648,884	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	809,286	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,000,000	1,485,440	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	920,000	1,324,064	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,789,855	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	830,000	1,136,037	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	800,000	1,025,584	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	930,000	894,966	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	1,990,000	2,244,361	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,790,000	1,960,712	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,650,000	1,636,701	2059/3/20

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第13回利付国債(40年)	0.5	340,000	336,644	2060/3/20
第317回利付国債(10年)	1.1	890,000	904,649	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	2,260,000	2,294,239	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	1,710,000	1,743,687	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	4,570,000	4,652,899	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	2,470,000	2,521,721	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	764,347	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	1,930,000	1,972,305	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	2,740,000	2,794,416	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,920,000	2,985,145	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	3,120,000	3,188,764	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	3,190,000	3,268,505	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	3,400,000	3,473,134	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,250,000	2,316,600	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,690,000	1,743,877	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	922,716	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	3,110,000	3,193,876	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,330,000	2,396,777	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	1,790,000	1,844,344	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,450,000	2,518,428	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	510,000	524,953	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	3,330,000	3,396,333	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	3,060,000	3,139,070	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	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

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

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

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

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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
地方債証券				
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	108,478	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	109,481	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	134,753	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	134,260	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	129,250	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	128,361	2044/6/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	116,797	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	117,966	2029/6/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	235,146	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	234,406	2032/12/20
第700回東京都公募公債	1.02	100,000	101,290	2021/9/17
第702回東京都公募公債	1.04	100,000	101,577	2021/12/20
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	101,894	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,683	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	102,568	2023/6/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	102,206	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,661	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,811	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,560	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	301,197	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	198,940	2029/12/20
平成23年度第6回北海道公募公債	1.11	200,000	202,638	2021/8/31
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	102,034	2023/2/28
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,714	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	99,941	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	100,836	2027/2/24
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	137,508	2038/3/19
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	117,174	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,666	2034/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	203,876	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,692	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	200,000	201,420	2027/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,560	2027/6/18
第243回神奈川県公募公債	0.075	200,000	198,846	2029/12/20
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	235,426	2031/9/26
第361回大阪府公募公債(10年)	0.92	100,000	101,807	2022/6/28
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	100,000	101,540	2023/4/26
第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	102,547	2023/8/29
第389回大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,139	2024/10/30
第395回大阪府公募公債(10年)	0.435	151,000	153,887	2025/4/28
第399回大阪府公募公債(10年)	0.529	100,000	102,327	2025/8/28
第402回大阪府公募公債(10年)	0.493	100,000	102,233	2025/11/27
第407回大阪府公募公債(10年)	0.09	156,000	156,045	2026/4/27
第410回大阪府公募公債(10年)	0.001	200,000	198,724	2026/7/28

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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成24年度第1回埼玉県公債券	1.05	100,000	101,946	2022/4/26
平成24年度第9回埼玉県公債券	0.844	100,000	102,177	2023/1/31
平成25年度第11回埼玉県公債券	0.655	100,000	102,388	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公債券	0.469	100,000	102,216	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公債券	0.085	100,000	99,968	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公債券	0.249	100,000	101,065	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公債券	0.19	100,000	100,631	2027/6/22
平成19年度第1回福岡県公債券(20年)	2.38	100,000	116,365	2027/8/20
平成20年度第2回福岡県公債券(20年)	2.05	100,000	116,457	2028/12/20
平成22年度第1回福岡県公債券(15年)	1.67	100,000	108,740	2025/11/21
平成23年度第1回福岡県公債券(20年)	2.008	100,000	119,383	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債券(15年)	1.491	100,000	109,054	2026/11/27
平成24年度第1回福岡県公債券(30年)	2.12	100,000	133,596	2042/9/19
平成26年度第4回福岡県公債券(20年)	1.249	100,000	112,674	2035/2/23
平成27年度第7回福岡県公債券	0.464	100,000	102,188	2025/12/25
平成30年度第1回福岡県公債券(30年)	0.777	100,000	105,012	2048/6/19
平成30年度第1回福岡県公債券(20年)	0.639	100,000	103,673	2038/8/20
第5回千葉県公債券(20年)	2.26	200,000	235,436	2028/9/21
第6回千葉県公債券(20年)	2.26	100,000	118,938	2029/4/20
第13回千葉県公債券(20年)	1.701	100,000	117,351	2032/10/15
平成25年度第5回千葉県公債券	0.84	100,000	102,622	2023/8/25
平成26年度第7回千葉県公債券	0.429	100,000	101,914	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公債券	0.549	100,000	102,608	2025/5/23
平成28年度第4回千葉県公債券	0.085	100,000	99,968	2026/9/25
平成28年度第6回千葉県公債券	0.18	120,000	120,714	2027/1/25
令和元年度第7回千葉県公債券	0.08	300,000	298,281	2030/2/25
平成29年度第1回岐阜県公債券(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回山梨県公募債(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		
特殊債券(除く金融債)					
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	200,000	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	101,368	2028/10/16	
第59回政府保証関西国際空港債券	0.9	500,000	508,565	2022/3/25	
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	100,526	2027/1/18	
第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.001	300,000	299,754	2023/3/20	
第14回道路債券	1.91	100,000	104,813	2022/12/20	
第17回道路債券	1.54	100,000	103,865	2022/12/20	
第21回道路債券	2.75	100,000	131,371	2033/6/20	

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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19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

当 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社債	2.157	100,000	121,117	2031/5/9
第81回株式会社日本政策金融公庫社債	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	13,044	13,621	2041/5/10

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第4 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	31,426	33,443	2046/2/10
第4 6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,243	12,640	2041/9/10
第4 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	31,749	33,835	2046/3/10
第4 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	29,745	31,648	2046/5/10
第4 9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,331	15,088	2041/12/10
第5 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	60,800	64,381	2046/7/10
第5 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	32,824	34,769	2046/8/10
第5 3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	13,802	14,410	2042/4/10
第5 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	43,219	45,705	2046/12/10
第5 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	40,990	43,334	2047/1/10
第5 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	41,066	43,459	2047/2/10
第6 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	87,658	92,452	2047/5/10
第6 4回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	109,670	2025/12/19
第6 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	94,810	99,200	2047/11/10
第6 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	48,286	50,467	2047/12/10
第6 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	48,406	51,005	2048/1/10
第6 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,907	51,595	2048/2/10
第7 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	42,874	45,045	2048/3/10
第7 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	42,877	44,729	2048/5/10
第7 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	48,352	51,043	2048/6/10
第7 5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	180,336	2031/6/13
第7 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	130,533	136,161	2048/11/10
第7 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	176,092	183,672	2048/12/10
第8 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	49,443	51,508	2049/5/10
第8 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	51,116	53,288	2049/6/10
第8 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	51,976	54,036	2049/8/10
第8 8回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,456	2031/11/18
第8 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	164,916	171,420	2049/10/10
第9 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,382	2049/11/10
第9 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	116,858	120,211	2050/1/10
第9 2回一般担保住宅金融支援機構債券	1.06	100,000	101,624	2021/12/20
第9 3回一般担保住宅金融支援機構債券	1.557	100,000	109,350	2026/12/18
第9 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	65,841	67,949	2050/3/10
第9 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	69,531	71,547	2050/5/10
第9 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	68,891	71,233	2050/6/10
第9 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	213,495	221,635	2050/7/10
第9 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	142,638	147,931	2050/8/10
第1 0 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	70,047	72,523	2050/9/10
第1 0 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	74,650	77,370	2051/1/10
第1 0 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	80,329	80,761	2051/5/10
第1 1 1回一般担保住宅金融支援機構債券	1.404	100,000	108,985	2027/6/18
第1 1 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	84,682	85,350	2051/10/10
第1 1 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	84,789	85,277	2051/11/10
第1 1 4回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	109,799	2027/9/17
第1 1 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	84,869	85,727	2051/12/10
第1 1 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	85,432	86,710	2052/1/10
第1 1 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,903	87,060	2052/2/10

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

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	100,252	2026/10/19
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	102,149	2023/9/20
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	99,690	2026/8/19
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	198,682	2034/5/30
小 計		33,023,820	34,708,788	
金融債券				
い第795号商工債	0.03	200,000	199,924	2021/8/27
い第800号商工債	0.05	200,000	199,950	2022/1/27
い第802号商工債	0.06	100,000	99,990	2022/3/25
い第804号商工債	0.06	300,000	299,964	2022/5/27
い第832号商工債	0.06	200,000	199,352	2024/9/27
い第795号農林債	0.03	100,000	99,975	2021/8/27
い第796号農林債	0.03	200,000	199,946	2021/9/27
第337回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,102	2022/12/27
第338回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,106	2023/1/27
第339回信金中金債(5年)	0.11	200,000	200,218	2023/2/27
第342回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,119	2023/5/26
第350回信金中金債(5年)	0.08	100,000	99,890	2024/1/26
第236号商工債(3年)	0.02	300,000	299,511	2022/9/27
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	101,956	2025/9/26
小 計		2,300,000	2,301,003	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第499回中部電力株式会社債	1.194	100,000	103,331	2023/6/23
第503回中部電力株式会社債	0.584	100,000	101,907	2025/3/25
第507回中部電力株式会社債	0.605	100,000	102,093	2026/1/23
第511回中部電力株式会社債	0.21	100,000	99,696	2026/7/24
第519回中部電力株式会社債	0.84	100,000	103,236	2037/1/23
第540回中部電力株式会社債	0.53	100,000	97,212	2040/2/24
第505回関西電力株式会社債	0.24	100,000	100,289	2023/8/25
第508回関西電力株式会社債	0.455	100,000	100,469	2027/4/23
第510回関西電力株式会社債	0.49	200,000	201,248	2027/7/23
第511回関西電力株式会社債	0.41	100,000	100,034	2027/9/17
第385回中国電力株式会社債	0.728	100,000	102,580	2025/7/25
第398回中国電力株式会社債	0.425	100,000	100,663	2027/7/23
第400回中国電力株式会社債	0.34	100,000	100,034	2027/9/24
第402回中国電力株式会社債	0.25	100,000	100,327	2024/10/25
第307回北陸電力株式会社債	1.055	100,000	104,598	2026/6/25
第322回北陸電力株式会社債	0.38	100,000	100,345	2027/6/25
第330回北陸電力株式会社債	0.34	100,000	99,608	2029/5/25
第471回東北電力株式会社債	1.168	126,000	130,585	2023/12/25
第481回東北電力株式会社債	0.803	100,000	102,883	2025/7/25
第487回東北電力株式会社債	0.17	100,000	100,097	2023/9/25
第496回東北電力株式会社債	0.355	100,000	100,070	2027/9/24
第521回東北電力株式会社債	0.45	100,000	100,337	2030/5/24
第253回四国電力株式会社債	1.0	100,000	102,737	2023/6/23
第426回九州電力株式会社債	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債	0.43	200,000	201,144	2027/4/23
第465回九州電力株式会社債	0.38	100,000	99,920	2028/7/25
第468回九州電力株式会社債	0.435	100,000	100,318	2028/8/25
第484回九州電力株式会社債	0.375	200,000	199,164	2029/11/22
第317回北海道電力株式会社債	1.139	200,000	206,616	2023/11/24
第320回北海道電力株式会社債	0.585	201,000	202,435	2021/12/24
第326回北海道電力株式会社債	0.789	100,000	102,625	2025/12/25
第340回北海道電力株式会社債	0.48	100,000	100,638	2027/4/23
第344回北海道電力株式会社債	0.18	200,000	200,138	2022/9/22
第351回北海道電力株式会社債	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回アイサ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12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	102,541	2024/6/19
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,784	2024/9/13
第9回イビデン株式会社無担保社債	0.03	100,000	99,580	2022/9/12
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	99,797	2028/8/31
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	99,850	2028/2/25
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	200,000	198,238	2027/2/26
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	99,508	2028/3/23
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.005	400,000	398,244	2022/9/27
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,760	2026/3/6
第42回DIC株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,887	2023/4/17
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	96,749	2029/7/31
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,454	2023/3/3
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	102,781	2024/10/23

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

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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
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SCSK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（BFCM）円貨社債	0.16	100,000	99,346	2021/10/14

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第24回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.384	100,000	98,562	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行（BFCM）円貨社債	0.25	300,000	294,594	2024/10/10
第1回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.64	100,000	99,934	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・ビー・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・ビー・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・ビー・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・ビー・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回ウェストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	398,256	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	542,707,286	97.6
投 資 信 託 財 産 総 額	13,366,250	2.4	13,366,250	2.4
	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 ファンド2035	1, 416, 155, 589円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	1, 286, 276, 502円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	1, 098, 470, 542円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1, 086, 514, 202円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	920, 502, 175円
バランスB (37. 5) VA1 (適格機関投資家専用)	843, 330, 859円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	730, 622, 594円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	465, 060, 158円
DC日本債券インデックス・オープン	456, 085, 316円
グローバル経済コア	223, 606, 650円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	211, 159, 302円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	149, 555, 063円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	142, 110, 136円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	88, 530, 300円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	84, 956, 371円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	79, 661, 373円
日本債券インデックス・オープン (SMA専用)	66, 153, 693円
SMT インデックスバランス・オープン	56, 783, 488円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	51, 743, 667円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	46, 158, 857円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	40, 367, 643円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	38, 376, 812円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	31, 793, 697円
SMT 世界経済インデックス・オープン (株式シフト型)	26, 527, 460円
グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	25, 765, 905円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	15, 705, 048円
FOFs用 世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	14, 563, 891円
SMT 世界経済インデックス・オープン	13, 937, 840円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	13, 051, 579円
SBI資産設計オープン (分配型)	12, 235, 535円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	5, 739, 340円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3, 170, 615円
エマージング株式オープン	2, 227, 240円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1, 558, 964円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	894, 939円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	172, 959円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	140, 445円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	44, 295円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	17, 481円

お知らせ

該当事項はありません。

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 組 入 率	株 式 先 物 率	投資信託 証券 組入比率	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率				
第16期(2016年5月30日)	円	%		%	%	%	%	百万円
	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 組 入 率	株 式 先 物 率	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率			
(当 期 首) 2019年 5月29日	円	%		%	%	%	%
	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。

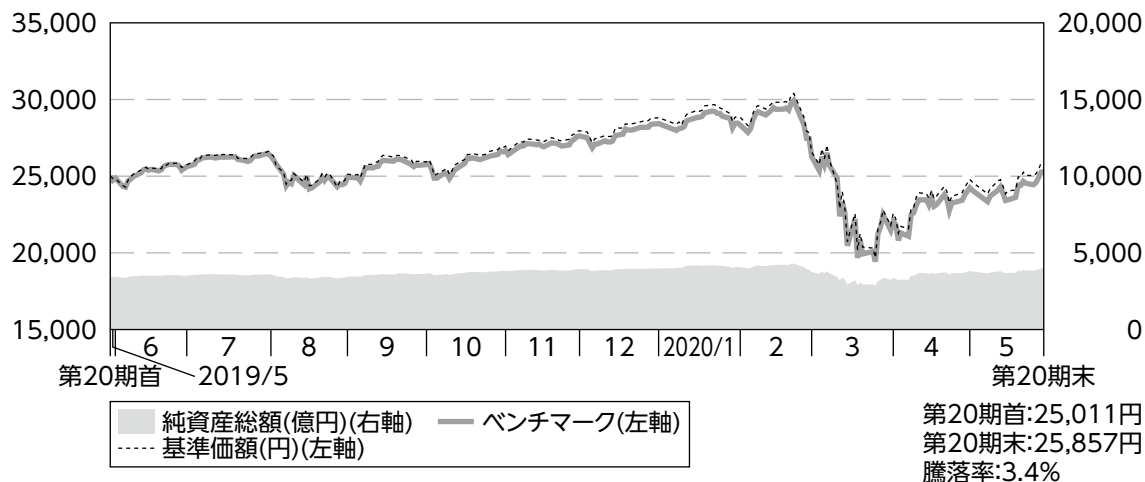
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

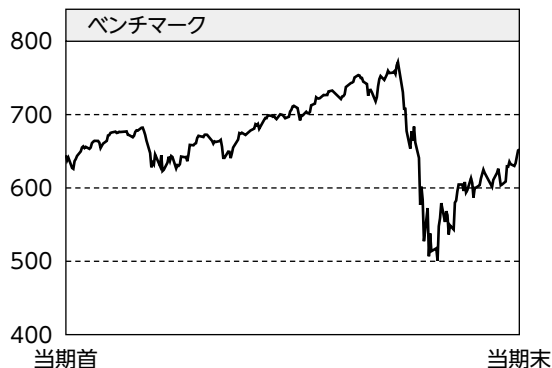


(注) ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

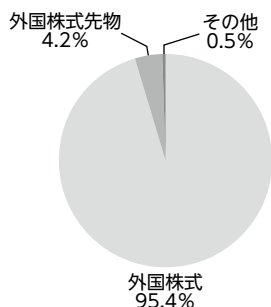
○上位10銘柄

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%

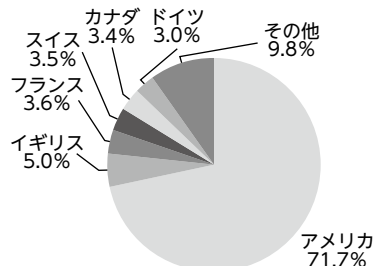
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	0.9%
10	NESTLE SA - REGISTERED	スイス	0.8%
組入銘柄数			1,325

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

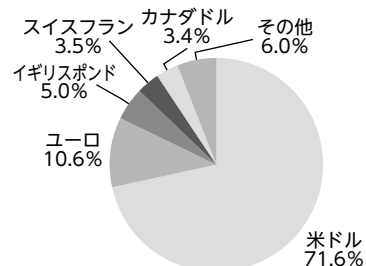
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

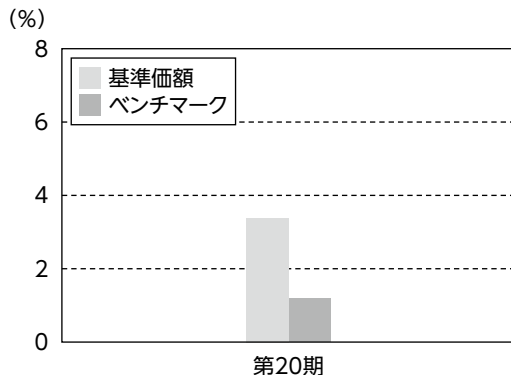


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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 (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)	1円 (0) (－) (－) (－) (0) (－) (1)	0.004% (0.001) (－) (－) (－) (0.000) (－) (0.002)	(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)	1 (1) (－) (－) (－) (－) (0)	0.005 (0.005) (－) (－) (－) (－) (0.000)	(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)	8 (8) (－) (0)	0.030 (0.029) (－) (0.001)	(c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	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	—	—
	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)
国	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 (一)	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>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
	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 (一)	—	—
	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※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	当期首(前期末)	当 期 末	業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額	業 種	
			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	株 数 (百株)	株 数 (百株)	期 末		業 種
			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	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)		
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)	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)		
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
RENAISSANCERE 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)	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)	
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	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	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)		
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	
TECHNIPFMC 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
FPF 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 INTERNATIONAL	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	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)	
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)	
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	当期首(前期末)	株数 (百株)	当期	期末	業種
			評価額	邦貨換算金額 (千円)	
			外貨建金額		
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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	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 LIFE CO 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 85	35,565 82	164,934 —	12,866,555 <3.2%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
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
FRESENIUS 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)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 (千円)		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
FRESENIUS 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
1&1 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
BRENNTAG 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 ・ 金 額	19,932	22,405	95,175	11,338,246	
	銘 柄 数 <比 率>	61	57	—	<2.8%>	
(イタリア)						
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 19	48,369 19	18,904 —	2,252,059 <0.6%>	
(フランス)						
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)
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
EIFFAGE		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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	22,257 69	24,744 67	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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	16,040 24	19,456 27	53,250 —	6,343,674 <1.6%>
(スペイン)						
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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	43,396 22	49,159 23	27,125 —	3,231,493 <0.8%>
(ベルギー)						
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		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 10	1,860 11	9,340 —	1,112,714 <0.3%>	
(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 6	801 6	1,935 —	230,538 <0.1%>	
(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 6	2,507 5	2,312 —	275,469 <0.1%>	
(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 12	8,880 12	11,569 —	1,378,313 <0.3%>	
(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 7	2,909 7	6,456 —	769,175 <0.2%>	

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)	
(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 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	2,960 3	3,100 3	1,914 —	228,087 <0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 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
ASHTHEAD 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)	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)	
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)		
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)
(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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	21,287 33	23,444 32	327,984 —	3,702,946 <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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,881 10	5,320 10	66,288 —	728,511 <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	株数 (百株)	当期首(前期末)	当	期	末	業	種
銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	外貨建金額	評価額	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			
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)	
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	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	60,492 59	67,883 59	108,474 —	7,739,679 <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	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,662 7	7,137 8	5,950 —	396,371 <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)	
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	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	74,089 37	82,106 34	272,561 —	3,780,423 <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
SEMBCORP 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
YANGZIJANG 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 HAPOALIM 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		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 PTY		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		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	1,885	2,062	9,961	710,759
	銘 柄 数 <比 率>	10	10	—	<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	775	794	17,273	239,589
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<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	813	1,110	2,306	175,055
	銘 柄 数 <比 率>	4	5	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	4,762	5,551	—	9,801,520
	銘 柄 数 <比 率>	67	71	—	<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 国	S&P 500 EMIN	11,662	—
	S&P/TSE 60	617	—
	SWISS MKT IX	642	—
	DJ EURO STOXX	2,073	—
	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 金	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 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マイセクション50	5,187,086,692円
DCマイセクション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 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 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)	69,716,759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
マイセレクション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
マイセレクション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。

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 総 額
	円	騰 落 率	円	騰 落 率			
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7%	436,679	△8.5%	97.9%	0.9%	百万円 212,962
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2%	440,540	0.9%	97.3%	1.4%	219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1%	441,246	0.2%	98.0%	0.8%	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8%	454,282	3.0%	97.3%	1.4%	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0%	481,049	5.9%	97.3%	2.1%	276,169

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

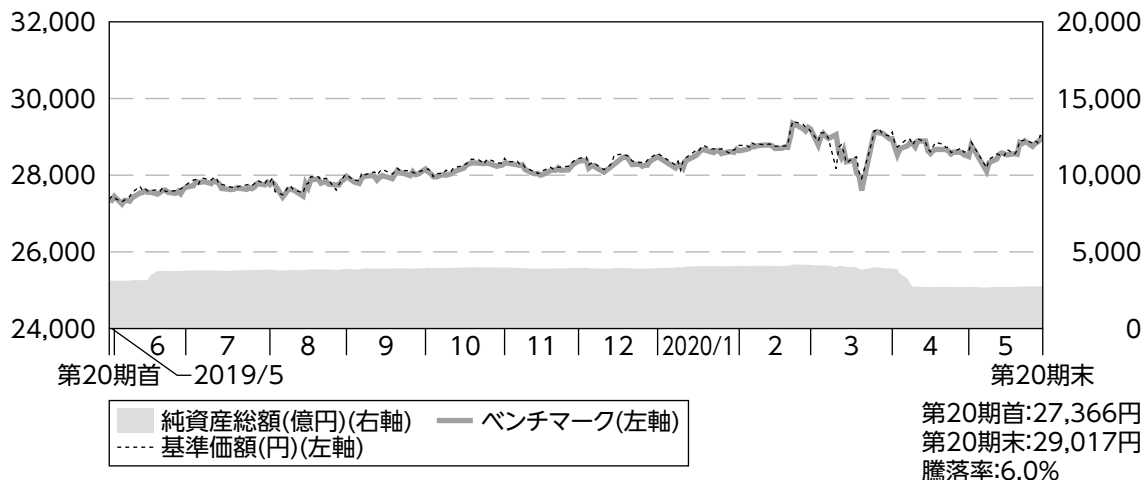
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

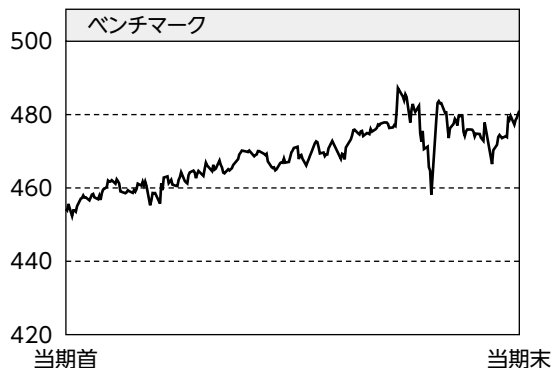


(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

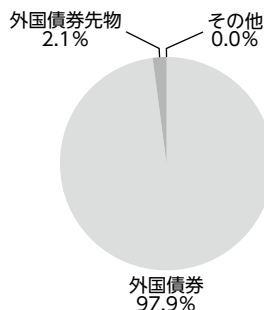
○上位10銘柄

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

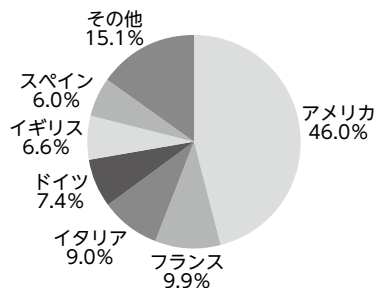
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.75% 09/15/21	アメリカ	0.5%
8	T 2.5% 05/15/46	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.5%
10	T 2.25% 08/15/49	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		718	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

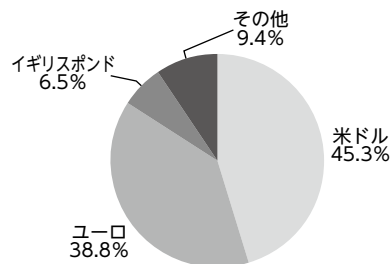
○資産別配分



○国別配分



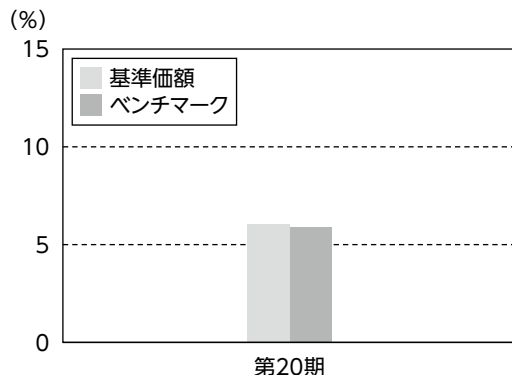
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

＜公社債＞

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

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

＜先物取引の種類別取引状況＞

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

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為 替 直 物 取 引	百万円 106,567	百万円 1,239	% 1.2	百万円 162,547	百万円 675	% 0.4
金 銭 信 託	1,095	1,095	100.0	225	225	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,101,321	199,145	18.1	1,102,823	200,295	18.2

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A) 債券種類別開示

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

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

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

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

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
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	

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	2,700	2,717	211,971	2021/9/1	
CAN 1% 06/01/27	1.0	500	518	40,469	2027/6/1	
CAN 1% 09/01/22	1.0	1,500	1,524	118,894	2022/9/1	
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	1,730	1,846	144,015	2030/6/1	
CAN 1.25% 11/01/21	1.25	1,880	1,906	148,709	2021/11/1	
CAN 1.5% 02/01/22	1.5	1,210	1,234	96,313	2022/2/1	
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,109	86,532	2023/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,447	112,913	2026/6/1	
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	600	628	48,993	2024/9/1	
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	3,620	3,765	293,717	2023/3/1	
CAN 1.75% 05/01/21	1.75	2,700	2,737	213,541	2021/5/1	
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,465	114,360	2028/6/1	
CAN 2% 09/01/23	2.0	2,110	2,223	173,489	2023/9/1	
CAN 2% 12/01/51	2.0	1,970	2,418	188,632	2051/12/1	
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,461	192,059	2024/3/1	
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,966	153,424	2025/6/1	
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	2,190	2,525	197,007	2029/6/1	
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	4,560	4,950	386,161	2024/6/1	
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	3,670	3,853	300,621	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	219,040	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	316,457	2021/6/11	
DBR 0% 02/15/30	—	3,570	3,719	443,103	2030/2/15	
DBR 0% 08/15/26	—	4,470	4,639	552,648	2026/8/15	
DBR 0% 08/15/29	—	2,510	2,617	311,824	2029/8/15	
DBR 0% 08/15/50	—	860	853	101,630	2050/8/15	
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	4,140	4,375	521,224	2027/2/15	
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,890	4,145	493,822	2029/2/15	
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,180	2,318	276,255	2028/8/15	
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,000	3,163	376,848	2025/2/15	
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,194	380,550	2026/2/15	
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,390	2,584	307,841	2028/2/15	
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	3,160	3,405	405,738	2027/8/15	
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,139	254,907	2024/8/15	
DBR 1% 08/15/25	1.0	4,120	4,474	533,042	2025/8/15	
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,050	4,122	491,064	2048/8/15	
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,960	3,133	373,346	2023/2/15	

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

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
				邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,184	379,407	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,165	377,130	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,510	2,713	323,302	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,320	1,421	169,358	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,890	2,113	251,753	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,750	3,126	372,429	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	4,960	5,648	672,855	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,644	195,906	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	2,306	274,723	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,210	1,443	171,924	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,592	308,864	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,694	559,305	2030/3/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	3,220	3,353	399,473	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,413	287,560	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	2,590	3,387	403,577	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	4,210	5,401	643,449	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	3,135	373,554	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,480	295,473	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,994	475,876	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	5,790	6,555	781,004	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	3,950	4,173	497,227	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	3,630	4,597	547,707	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,200	3,192	380,263	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/22	5.0	3,250	3,516	418,957	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,400	5,241	624,474	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,420	4,760	567,151	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,190	4,663	555,571	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,800	4,078	485,825	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,759	566,987	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,250	1,393	166,031	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,450	3,871	461,175	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,080	4,486	534,481	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,940	5,678	676,529	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,520	4,811	573,152	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,929	229,896	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,027	122,385	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/22	—	2,000	2,018	240,512	2022/2/25
FRTR 0% 03/25/23	—	5,290	5,370	639,776	2023/3/25
FRTR 0% 03/25/24	—	5,950	6,065	722,574	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	5,090	5,196	619,053	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/21	—	4,100	4,120	494,894	2021/5/25
FRTR 0% 05/25/22	—	4,050	4,094	487,781	2022/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	5,290	630,295	2029/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,530	4,687	558,457	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,980	6,259	745,709	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	5,090	5,347	637,090	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	4,000	4,219	502,635	2029/5/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,640	6,060	721,949	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	1,550	1,568	186,809	2052/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	4,570	4,918	585,909	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	5,056	602,408	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,480	5,897	702,604	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	5,110	5,843	696,134	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,430	5,081	605,313	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,420	6,301	750,643	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,330	4,065	484,360	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	4,590	4,906	584,550	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	2,459	2,927	359,979	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,460	4,311	513,598	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	5,810	6,394	761,788	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,460	4,651	554,086	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,554	542,585	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	5,740	6,129	730,154	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,160	6,475	771,412	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,700	5,749	684,986	2027/10/25

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価 外貨建金額	価額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
FRTR 3% 04/25/22	3.0	8,490	9,065	1,079,952	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,190	5,165	615,387	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,650	5,950	708,875	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	6,350	7,804	929,757	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,050	4,126	491,558	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,850	3,915	466,471	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	5,539	659,905	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,020	5,849	696,794	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,830	8,708	1,037,465	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,680	6,123	729,540	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	7,778	926,661	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	7,371	878,144	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,562	305,215	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,264	150,628	2023/4/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/22	—	980	988	117,819	2022/1/15
NETHER 0% 01/15/24	—	1,850	1,888	225,022	2024/1/15
NETHER 0% 07/15/30	—	1,610	1,646	196,135	2030/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,400	2,495	297,251	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,600	1,678	199,966	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	760	831	99,034	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,860	1,969	234,621	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	2,110	2,284	272,208	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,620	1,765	210,345	2028/7/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	3,060	3,284	391,282	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,202	262,379	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	660	700	83,412	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,650	2,205	262,792	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,130	3,629	432,328	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,740	2,857	340,399	2021/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	2,940	3,278	390,563	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,060	3,712	442,251	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,110	3,534	421,054	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,380	2,006	238,993	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	242	28,941	2023/1/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/25	—	870	872	103,947	2025/1/31
SPGB 0% 04/30/23	—	2,380	2,396	285,541	2023/4/30
SPGB 0.05% 10/31/21	0.05	1,930	1,940	231,224	2021/10/31
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,328	277,423	2024/7/30
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	1,440	1,466	174,707	2023/7/30
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	2,390	2,424	288,823	2022/4/30
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	2,210	2,251	268,233	2022/10/31
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	2,150	2,149	256,057	2030/4/30
SPGB 0.6% 01/31/29	0.6	2,780	2,816	335,544	2029/1/31
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

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価 外貨建金額	価額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,720	4,094	487,818	2037/1/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	3,490	4,045	481,996	2023/10/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,526	420,145	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,640	4,410	525,374	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,843	338,699	2024/1/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,590	4,374	521,177	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,630	6,462	769,864	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,850	3,372	401,731	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,900	3,341	398,122	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,390	3,572	425,559	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,730	4,358	519,179	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	4,280	4,724	562,839	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,715	561,755	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,550	184,717	2029/1/31
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	—	2,310	2,338	278,529	2027/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,060	1,071	127,595	2030/6/22
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,510	1,546	184,225	2023/10/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	690	670	79,915	2040/6/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	970	1,009	120,293	2024/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,180	2,310	275,201	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,810	215,642	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,560	1,679	200,069	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,550	1,686	200,932	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,380	2,565	305,677	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,490	1,642	195,706	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	850	969	115,452	2033/4/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	530	620	73,952	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,480	1,819	216,760	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	630	798	95,127	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,280	1,602	190,943	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	940	1,424	169,705	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,450	1,574	187,518	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	680	1,005	119,733	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,440	2,747	327,251	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,424	169,684	2034/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,300	2,241	267,032	2045/6/22
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,220	1,322	157,496	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,573	187,429	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,140	3,688	439,420	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,350	2,499	297,722	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,100	2,336	278,755	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,462	174,248	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,920	4,919	586,026	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	4,022	479,239	2028/3/28
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	—	470	475	56,591	2030/2/20
RAGB 0% 07/15/23	—	1,500	1,524	181,657	2023/7/15
RAGB 0% 07/15/24	—	920	938	111,760	2024/7/15
RAGB 0% 09/20/22	—	320	324	38,625	2022/9/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,170	1,237	147,436	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	890	939	111,921	2027/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,620	1,742	207,547	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	560	619	73,857	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,140	2,288	272,618	2026/10/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,660	1,803	214,855	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	830	1,079	128,626	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	450	657	78,315	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,083	129,076	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,433	170,766	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	760	1,452	173,049	2017/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,030	1,362	162,345	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,391	165,826	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	2,990	3,286	391,565	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,730	1,820	216,914	2021/9/15

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

当		期		末		
銘柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,820	4,442	588,772	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,030	5,013	664,426	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,140	4,883	647,220	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,090	4,027	533,810	2052/7/22	
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,820	2,953	391,367	2021/9/7	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,920	4,310	571,290	2060/1/22	
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,950	2,089	276,890	2022/3/7	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,790	4,395	582,480	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,950	2,854	378,257	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,880	3,151	417,640	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	670	880	116,670	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,270	3,880	514,304	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,180	4,101	543,585	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,890	3,738	495,496	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,310	5,048	669,046	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,770	2,775	367,851	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,460	4,481	593,920	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,900	4,270	565,917	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	3,317	439,621	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,980	2,452	324,984	2025/3/7	
UKT 6.0% 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	
小 計				17,809,166		
(スウェーデン)						
国債証券						
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,150	6,575	74,241	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,700	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	
小 計				778,291		
(ノルウェー)						
国債証券						
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	3,610	3,880	42,643	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,910	5,233	57,513	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,120	4,484	49,280	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,190	5,554	61,039	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	5,420	5,998	65,919	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	4,900	5,473	60,154	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,866	130,414	2023/5/24	
NGB 3% 03/14/24	3.0	6,830	7,542	82,887	2024/3/14	
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	11,380	11,781	129,481	2021/5/25	
小 計				679,335		
(デンマーク)						
国債証券						
DGB 0.25% 11/15/22	0.25	3,140	3,199	51,123	2022/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	10,730	11,425	182,576	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,460	13,360	213,501	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,380	7,893	126,139	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	8,930	10,013	160,016	2025/11/15	
DGB 3% 11/15/21	3.0	8,330	8,759	139,970	2021/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,530	30,994	495,285	2039/11/15	
小 計				1,368,613		
(ポーランド)						
国債証券						
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	4,550	4,636	123,934	2021/7/25	
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	4,710	4,895	130,866	2022/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	4,218	112,757	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,860	6,209	165,968	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,760	4,055	108,392	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,750	5,226	139,711	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,200	3,543	94,718	2027/7/25	

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

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

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

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

投資信託財産の構成

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

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

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

1米ドル=107.53円

1カナダドル=78.01円

1メキシコペソ=4.84円

1ユーロ=119.13円

1イギリスポンド=132.53円

1スウェーデンクローナ=11.29円

1ノルウェークローネ=10.99円

1デンマーククローネ=15.98円

1ポーランドズロチ=26.73円

1オーストラリアドル=71.35円

1シンガポールドル=75.89円

1マレーシアリングギット=24.72円

1イスラエルシェケル=30.61円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

<注記事項>

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

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。