

# アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40） 〈愛称 Aナビ40〉

## 償還 運用報告書（全体版）

第23期（償還）（償還日 2022年10月19日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

「アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）」は、信託約款の規定に基づき、2022年10月19日に信託期間が終了し、償還いたしました。

ここに、設定以来の運用状況と償還内容をご報告いたしますとともに、受益者のみなさまのご愛顧に對しまして、重ねてお礼申し上げます。

### 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	1999年10月29日から2022年10月19日までです。	
運用方針	主として投資信託の受益証券に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	海外株式インデックスMSCI-KOUSA1（ハッジなし）マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	海外株式インデックスMSCI-KOUSA1（ハッジあり）マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	日本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。
	海外債券インデックス（ハッジなし）マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。
	海外債券インデックス（ハッジあり）マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
	日本株式インデックスTOPIX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。
	海外株式インデックスMSCI-KOUSA1（ハッジなし）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。
	海外株式インデックスMSCI-KOUSA1（ハッジあり）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。
	日本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ないません。
	海外債券インデックス（ハッジなし）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。
	海外債券インデックス（ハッジあり）マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	

<953725>

## 日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号  
www.nikkoam.com/

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404  
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率					
	円 銭	円	%		%	%	%	%	%	百万円
19期(2018年10月26日)	14,719	10	△ 2.6	147.82	△ 2.7	37.2	0.6	56.7	0.2	355
20期(2019年10月28日)	15,407	10	4.7	154.21	4.3	39.7	0.7	54.1	0.3	386
21期(2020年10月26日)	15,567	10	1.1	155.53	0.9	38.9	0.8	54.7	0.2	301
22期(2021年10月26日)	17,216	10	10.7	172.02	10.6	39.0	0.7	54.9	0.2	309
(償還時)	(償還価額)									
23期(2022年10月19日)	16,284.08	—	△ 5.4	163.95	△ 4.7	—	—	—	—	231

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 合成インデックス(参考指数)は、投資先の親投資信託のそれぞれのベンチマークを標準組入比率で合成して算出しています。なお、2022年10月19日現在知りえた情報を基に弊社において日次で算出し、設定日を100として指数化しております。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 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」は実質比率を記載しております。

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

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

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		合 成 イ ン デ ッ ク ス (参考指数)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2021年10月26日	円 銭	%	(参考指数)	%	%	%	%	%
	17,216	—	172.02	—	39.0	0.7	54.9	0.2
10月末	17,203	△0.1	171.86	△0.1	38.9	0.7	55.1	0.2
11月末	17,024	△1.1	170.12	△1.1	37.8	0.8	55.7	0.2
12月末	17,227	0.1	172.24	0.1	39.5	0.5	54.6	0.2
2022年1月末	16,767	△2.6	167.74	△2.5	39.1	0.6	54.9	0.2
2月末	16,654	△3.3	166.72	△3.1	39.1	0.5	55.0	0.2
3月末	16,973	△1.4	169.41	△1.5	39.0	0.6	55.0	0.2
4月末	16,703	△3.0	166.74	△3.1	38.3	0.8	55.5	0.2
5月末	16,712	△2.9	166.84	△3.0	40.0	0.9	53.9	0.2
6月末	16,463	△4.4	164.18	△4.6	39.6	0.5	54.5	0.2
7月末	16,797	△2.4	167.54	△2.6	40.2	0.4	53.9	0.3
8月末	16,784	△2.5	167.47	△2.6	39.1	0.5	55.0	0.2
9月末	16,274	△5.5	161.77	△6.0	38.1	0.7	55.7	0.2
(償還時) 2022年10月19日	(償還価額) 16,284.08	△5.4	163.95	△4.7	—	—	—	—

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 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」は実質比率を記載しております。

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

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

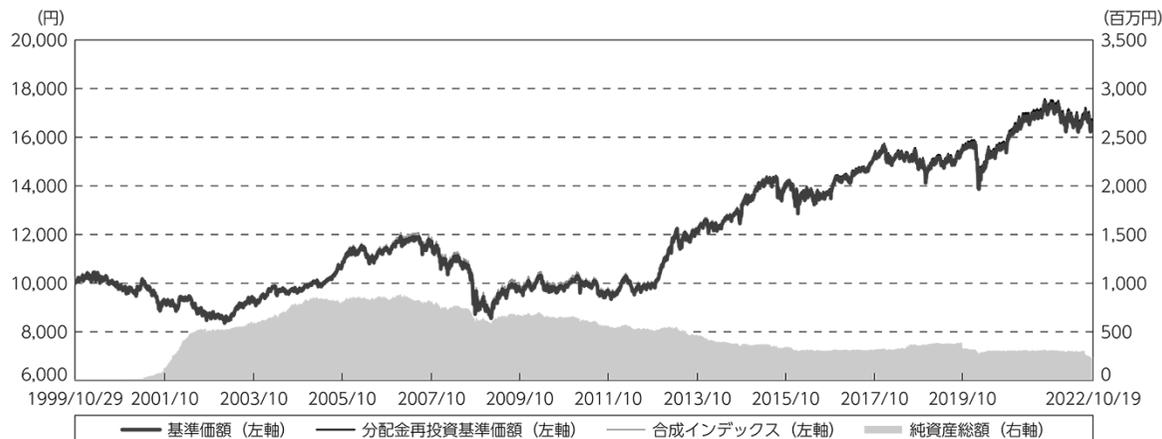
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○運用経過

(1999年10月29日～2022年10月19日)

設定以来の基準価額等の推移



設 定 日：10,000円

期末（償還日）：16,284円08銭（既払分配金（税込み）：120円）

騰 落 率： 64.3% （分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 合成インデックスは、設定時の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 合成インデックスは当ファンドの参考指数です。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、マザーファンドを通じて国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の4つの資産に実質的に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なってまいりました。各資産への投資配分は、株式に40%、債券などに60%をめどとしました。信託期間中における各マザーファンドの騰落率は以下の通りです。

マザーファンド	騰落率
日本株式インデックスTOP I Xマザーファンド	89.9%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド <sup>※1</sup>	401.3%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド <sup>※2</sup>	141.2%
日本債券インデックスマザーファンド	36.9%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	212.2%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	41.1%

※1：2000年5月16日までは「海外株式インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」

※2：2000年5月16日までは「海外株式インデックス（ヘッジあり）マザーファンド」

信託期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

- ・主要各国の中央銀行が概ね緩和的な金融政策をとっていたこと（2009年～2015年、2020年3月～2021年）、新型コロナウイルスのワクチン接種の普及により経済活動の正常化の進展が期待されたこと、企業業績が概ね好調だったことなどが国内外の株式に投資するマザーファンドの基準価額の値上がり要因となりました。
- ・全米同時多発テロの発生（2001年9月）の影響や、米国の低所得者層を対象にした住宅融資「サブプライムローン」問題（2007年）、米国の大手投資銀行リーマンブラザーズの経営破綻（リーマンショック）（2008年）、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大（2020年）などを背景に、景気の先行きに対する懸念が強まったことなどが国内外の債券に投資するマザーファンドの基準価額の値上がり要因となりました。
- ・「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」について、為替市場で円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高となったことが基準価額の値上がり要因となりました。

## 投資環境

### （国内株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて上昇しました。

期間の初めから2003年2月にかけては、米国のハイテク企業を中心とした業績悪化の進行や、国内における消費低迷の長期化や設備投資意欲の減退などによる企業業績の悪化懸念、金融機関の不良債権処理の遅れへの警戒などから、TOPIXは下落基調で推移しました。

2003年3月から2007年2月にかけては、中東情勢の緊迫化などの地政学的リスクの高まりなどから、株価が下落する局面があったものの、米国の景気回復期待から米国市場で株価が大きく上昇したことや、郵政民営化を巡る総選挙で自由民主党が大勝利構造改革の進展が期待されたこと、国内景気回復や企業業績の改善見通しが強まったことなどから、TOPIXは上昇しました。

2007年3月から2009年3月にかけては、米国の「サブプライムローン」関連損失の拡大懸念が高まったことや、円高／アメリカドル安の進行、原油価格の高値更新などから景気減速や企業業績の悪化懸念が広がったこと、米国の大手投資銀行が破綻し金融不安が世界的に拡大したことなどを背景に、TOPIXは下落しました。

2009年4月から2012年10月にかけては、金融不安の後退や政府の追加経済対策への期待、日本や米国での景気・企業業績の底入れ観測などが株価の上昇要因となる一方で、欧州債務問題の深刻化や、東日本大震災によるサプライチェーン（供給網）の寸断、タイの洪水による海外生産拠点の長期にわたる生産停止などが株価の下落要因となり、TOPIXは一進一退の展開が続きました。

2012年11月から期間末にかけては、米国と中国との間の貿易摩擦の激化が懸念されたことや、欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたことなどから株価が下落する局面があったものの、衆議院議員総選挙における自由民主党の圧倒的な勝利を受けて誕生した新政権による景気対策への期待や、日銀による大規模な追加金融緩和の実施、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて各国が経済対策を打ち出したこと、円安／アメリカドル高基調を受けて輸出企業の業績改善が期待されたことなどがけん引役となり、TOPIXは上昇基調を維持しました。

### （海外株式市況）

海外株式市場では、期間の初めと比べて米国や欧州各国などの株価は総じて上昇しました。

期間の初めから2003年3月にかけては、ITバブルの崩壊や、同時多発テロ、イラク戦争により地政学的リ

スクが高まったことなどを背景に、米国や欧州各国などの株価は総じて下落しました。

2003年4月から2007年9月にかけては、欧米各国の中央銀行による積極的な金融緩和などを背景に、米国や欧州各国などの株式市場は総じて上昇しました。

2007年10月から2009年3月にかけては、「サブプライムローン」危機が深刻化し、リーマンショックに至り、これを契機として世界的な信用収縮懸念が広がったことなどから、米国や欧州各国などの株価は総じて下落しました。

2009年4月から2020年1月にかけては、欧州債務問題が深刻化したことや、米国と中国との間の貿易摩擦が激化し、世界経済や企業業績に悪影響を及ぼすとの懸念が高まったことなどを受けて、株価が下落する局面があったものの、世界の金融システムが安定化の兆しを見せたことや、米中貿易協議での「第1段階」とされる原則合意への期待の高まりや実際の合意署名により、今後の貿易協議の進展が期待されたこと、英国の総選挙での与党保守党の勝利で、英国の欧州連合（EU）離脱を巡る政治的不透明感が解消したこと、企業業績が概ね好調だったことなどから、米国や欧州各国などの株価は総じて上昇しました。

2020年2月から2021年12月にかけては、新型コロナウイルスの感染が中国から世界中に拡大し世界経済の急激な停滞を招くとの警戒感が高まったことなどから株価が下落する局面があったものの、米国連邦準備制度理事会（FRB）が新型コロナウイルスの感染拡大による景気悪化を抑制するため米国国債などの資産購入を当面無制限とするなど緊急の金融緩和措置を決定したことや、新型コロナウイルスのワクチン接種の普及により経済活動の正常化の進展が期待されたことなどから、米国や欧州各国などの株価は総じて上昇しました。

2022年1月から期間末にかけては、ロシアによるウクライナ侵攻を受けたエネルギー価格の上昇やサプライチェーンの混乱などからインフレ高進が警戒されたこと、FRBが大幅な利上げを実施し、急激な金融引き締めによる景気後退への警戒感が強まったこと、欧州中央銀行（ECB）が政策金利の引き上げ開始や大幅な利上げの可能性を示唆したことなどを背景に、米国や欧州各国などの株価は総じて下落しました。

#### （国内債券市況）

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて低下（債券価格は上昇）しました。

期間の初めから2003年6月にかけては、景気低迷の長期化を背景に日銀が超低金利政策を継続し量的金融緩和の姿勢を鮮明にしたことや、金融機関の運用難を背景に国債が買い進まれたことなどから、10年国債利回りは低下しました。

2003年7月から2006年7月にかけては、世界的な債券価格の急落を受けて国内大手機関投資家のリスク管理による債券売りが増加したことや、量的緩和政策とゼロ金利政策が解除されたことなどから、10年国債利回りは上昇（債券価格は下落）しました。

2006年8月から2010年12月にかけては、世界的な信用不安や世界経済の先行き不透明感などを背景とした安全資産の選好や、日銀による金融緩和策の実施、一部のユーロ圏諸国の財政不安を背景とした投資家によるリスク回避姿勢の強まりなどを背景に、10年国債利回りは低下しました。

2011年1月から2012年11月にかけては、日本や米国における景気回復期待の高まりなどから、利回りが上昇する場面があったものの、東日本大震災の発生を受けた投資家のリスク回避姿勢や国内経済の低迷、欧州債務問題の深刻化による日本国債への逃避需要などを受けて、10年国債利回りは低下しました。

2012年12月から2016年6月にかけては、新総裁を迎えた日銀による金融緩和策の大幅な強化や買入れオペなど緩和姿勢の継続、原油価格の下落や対アメリカドルにおける中国人民元安、中国株安の進行などを背景とする世界経済の先行きに対する不透明感などから、10年国債利回りは低下しました。

2016年7月から2018年10月にかけては、米国や欧州において金融緩和策の縮小への動きが強まったことや、日銀が金融政策決定会合で国債買入れを弾力的に行なうこととし、長期金利の変動幅拡大を容認したことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

2018年11月から2019年8月にかけては、日銀による金融緩和政策の長期化観測や、FRBによる早期利下げ観測およびECBによる追加緩和期待を受けて世界的に金利低下圧力が強まったことなどから、10年国債利回りは低下しました。

2019年9月から期間末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済の減速を懸念した投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどが利回りの低下要因となったものの、米中間の貿易協議が部分的な合意に向けて進展し投資家のリスク回避姿勢が後退したことや、新型コロナウイルスの感染拡大を受けた政府の緊急経済対策に伴う国債の増発が懸念されたこと、米国において新型コロナウイルスのワクチンの普及や追加経済対策が成立すると観測などを背景に景気の回復期待が高まったこと、欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

#### (海外債券市況)

米国債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて低下しました。

期間の初めから2003年6月にかけては、景気の過熱を背景にFRBによる政策金利の引き上げが2000年5月まで継続し、10年国債利回りは上昇基調となったものの、2000年12月にFRBが利下げに転じた後は、2001年9月の全米同時多発テロの発生を受けて景気の先行きに対する懸念が強まったことなどを背景に、10年国債利回りは低下しました。2003年7月から2007年6月にかけては、米国景気の回復を背景に2004年6月にFRBが利上げに転じたことなどから、10年国債利回りは上昇しました。2007年7月から2012年7月にかけては、「サブプライムローン」問題や世界的な金融危機を背景にFRBによる利下げが継続したことや、その後の景気減速懸念からFRBが量的金融緩和策を実施したことなどにより、10年国債利回りは低下しました。2012年8月から2018年10月にかけては、ギリシャの信用懸念の再燃などが利回りの低下要因となったものの、米国の景気回復を受けてFRBによる利上げ観測が強まったことや、2015年12月に利上げが開始されたこと、米国連邦公開市場委員会(FOMC)において利上げ継続が示唆されたことなどから、10年国債利回りは上昇しました。2018年11月から2020年3月にかけては、通商政策などを巡って米国と中国との間の対立が激化したことや、米国の市場予想を下回るインフレ指標やFOMC声明を受けて利下げ観測が広がったこと、FRBが政策金利を引き下げたこと、新型コロナウイルスの感染拡大が世界経済に与える深刻な影響が懸念されたことなどを背景に、10年国債利回りは低下しました。2020年4月から期間末にかけては、南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大に対する警戒感や、ロシアによる軍事侵攻を受けたウクライナ情勢の緊迫化などが利回りの低下要因となったものの、米国大統領選挙での民主党候補の優勢などから大統領選挙後の財政支出の拡大観測が強まったことや、FRBやECBなど世界の主要中央銀行が政策金利を引き上げたこと、FRB議長が発言や市場予想を上回る米国の消費者物価指数(CPI)を受けてFRBによる金融引き締めの長期化観測が強まったことなどを背景に、10年国債利回りは上昇しました。

欧州債券市場では、各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて低下しました。

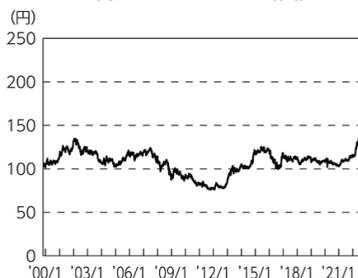
期間の初めから2005年9月にかけては、欧州のインフレ懸念を背景にECBによる利上げが2000年10月まで継続し、10年国債利回りは上昇基調となったものの、その後、欧州の景気減速感が強まったことや、インフレ率の鈍化から2001年5月にECBが利下げに転じた後は、2001年9月の全米同時多発テロの発生を受けて景気悲観論が強まったことなどから、10年国債利回りは低下を続けました。2005年10月から2007年6月にかけては、2005年12月にECBがインフレ懸念を受けて利上げを開始したことや、景況感の改善を受けて、各国の国債利回りは総じて上昇しました。2007年7月から2020年3月にかけては、サブプライムローン問題や世界的な金融危機を受けて、安全資産への逃避需要が強まったことやECBが利下げを継続したこと、ギリシャを中心とした欧州債務問題の深刻化を受けて、ECBが高債務国の国債の買い入れ計画やギリシャに対する金融支援を実施し金融緩和姿勢を強化したこと、通商政策や通貨政策を巡って米国と中国との間の対立が激化したこと、英国のEUからの「合意なき離脱」が警戒されたこと、新型コロナウイルスの感染拡大により世界経

済に与える影響が懸念されたことなどを背景に、各国の国債利回りは総じて低下しました。2020年4月から期間末にかけては、欧州における新型コロナウイルスの感染再拡大や、南アフリカで確認された新たな変異株の感染拡大に対する警戒感、ロシアによる軍事侵攻を受けたウクライナ情勢の緊迫化、市場予想を下回るユーロ圏の経済指標やロシア産ガスの供給不安を背景とした欧州景気の先行きに対する懸念などが利回りの低下要因となったものの、FRBやECBなど世界の主要中央銀行が政策金利を引き上げたことや、FRB議長の発言や市場予想を上回る米国のCPIを受けてFRBによる金融引き締め長期化観測が強まったこと、複数のECB高官が大幅な利上げの可能性を示唆したことなどを背景に、各国の利回りは総じて上昇しました。

（為替市況）

信託期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。

円／アメリカドルの推移



円／ユーロの推移



## 当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

各資産への投資配分は、実質的な標準組入比率（株式40%、債券および短期金融資産60%）をめどとしました。これらの組入比率の調整にあたっては、各親投資信託の受益証券および短期金融資産への投資比率を標準組入比率に修正（リバランス）することで行ないました。

標準組入比率

国内株式	海外株式		国内債券	海外債券		短期金融資産
	ヘッジなし	ヘッジあり		ヘッジなし	ヘッジあり	
30.0%	5.0%	5.0%	45.0%	5.0%	5.0%	5.0%

当ファンドは1999年10月29日の設定以来、約23年にわたり運用してまいりました。このたび、約款の規定に基づき、信託終了日を2022年10月19日として償還いたしました。

これまでのみなさまのご愛顧に対しまして、心より厚くお礼申し上げますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

### （投資先の各マザーファンド）

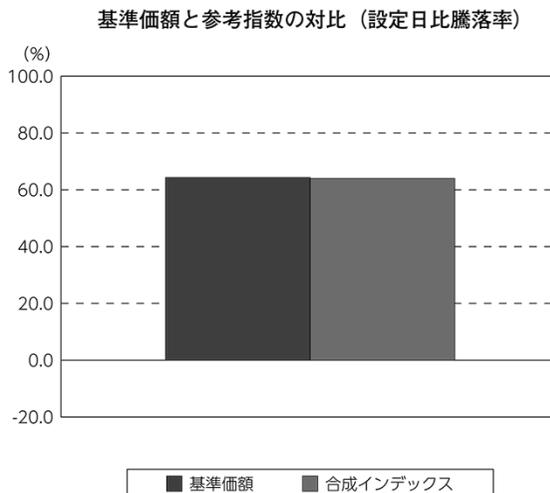
各マザーファンドの運用においては、各マザーファンドがそれぞれに定めるベンチマークへの連動をめざして運用を行ないました。各マザーファンドは、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。各マザーファンドが定めるベンチマークは以下の通りです。

マザーファンド	ベンチマーク
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	東証株価指数
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）
日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）

### 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金再投資ベースです。

（注）合成インデックスは当ファンドの参考指数です。

### 分配金

信託期間中における分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案して決定し、1万口当たりの累計は120円（税込み）となりました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたしました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	111	0.658	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	( 40 )	( 0.237 )	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	( 63 )	( 0.378 )	運用報告書など各種書類の送付、口内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	( 7 )	( 0.043 )	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	( 0.001 )	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	( 0.000 )	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	( 0.000 )	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0 )	( 0.000 )	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	( 0.000 )	
(d) そ の 他 費 用	2	0.009	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 1 )	( 0.006 )	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 1 )	( 0.004 )	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	( 0.000 )	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	113	0.668	
期中の平均基準価額は、16,798円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

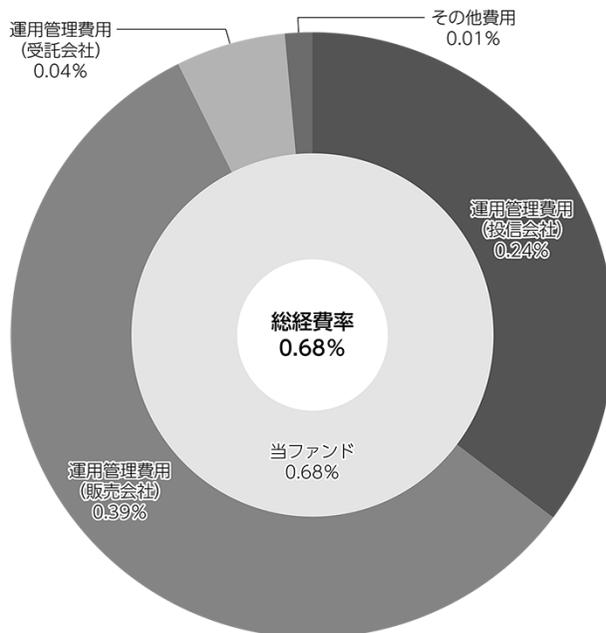
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

## (参考情報)

## ○総経費率

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、売買委託手数料およ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0.68%です。



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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年10月27日～2022年10月19日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	千口 6,901	千円 12,786	千口 53,331	千円 99,997
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	547	2,150	4,551	18,884
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	1,359	3,035	7,569	16,175
日本債券インデックスマザーファンド	8,772	12,154	107,777	147,388
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	167	430	6,274	16,194
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	1,551	2,316	11,149	15,208

## ○株式売買比率

(2021年10月27日～2022年10月19日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期		
	日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI （ヘッジなし）マザーファンド	海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI （ヘッジあり）マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	11,052,477千円	49,132,024千円	3,308,223千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	41,450,912千円	242,660,473千円	16,386,612千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.26	0.20	0.20

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月19日)

## 利害関係人の発行する有価証券等

&lt;アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）&gt;

該当事項はございません。

&lt;日本株式インデックスTOPIXマザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 11	百万円 6	百万円 122

&lt;海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド&gt;

該当事項はございません。

〈海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド〉

該当事項はございません。

〈日本債券インデックスマザーファンド〉

該当事項はございません。

〈海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド〉

該当事項はございません。

〈海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド〉

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2021年10月27日～2022年10月19日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2021年10月27日～2022年10月19日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2022年10月19日現在）

2022年10月19日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	
	口	数
日本株式インデックスTOPIXマザーファンド		千口 46,430
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド		4,003
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド		6,210
日本債券インデックスマザーファンド		99,004
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド		6,106
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド		9,597

○投資信託財産の構成

(2022年10月19日現在)

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
コール・ローン等、その他	千円 232,900	% 100.0
投資信託財産総額	232,900	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年10月19日現在)

項 目	償 還 時
	円
(A) 資産	232,900,152
コール・ローン等	232,900,152
(B) 負債	913,251
未払解約金	12
未払信託報酬	906,986
未払利息	366
その他未払費用	5,887
(C) 純資産総額(A-B)	231,986,901
元本	142,462,424
償還差益金	89,524,477
(D) 受益権総口数	142,462,424口
1万口当たり償還価額(C/D)	16,284円08銭

(注) 当ファンドの期首元本額は179,696,292円、期中追加設定元本額は11,534,454円、期中一部解約元本額は48,768,322円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.628408円です。

○損益の状況 (2021年10月27日～2022年10月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,883
支払利息	△ 2,883
(B) 有価証券売買損益	△11,127,177
売買益	1,991,110
売買損	△13,118,287
(C) 信託報酬等	△ 1,940,075
(D) 当期損益金(A+B+C)	△13,070,135
(E) 前期繰越損益金	63,226,719
(F) 追加信託差損益金	39,367,893
(配当等相当額)	( 50,503,102)
(売買損益相当額)	(△11,135,209)
償還差益金(D+E+F)	89,524,477

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

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

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

## ○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	1999年10月29日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年10月19日		資産総額	232,900,152円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	913,251円
				純資産総額	231,986,901円
受益権口数	10,000,000口	142,462,424口	132,462,424口	受益権口数	142,462,424口
元本額	10,000,000円	142,462,424円	132,462,424円	1万円当たり償還金	16,284円08銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万円当たり分配金	
				金額	分配率
第1期	10,098,528円	9,886,552円	9,790円	0円	0.0%
第2期	137,469,125	128,010,424	9,312	0	0.0
第3期	588,907,998	512,255,144	8,698	0	0.0
第4期	630,307,494	584,030,581	9,266	0	0.0
第5期	805,922,277	773,884,893	9,602	0	0.0
第6期	751,491,239	800,715,318	10,655	10	0.1
第7期	742,814,565	851,002,023	11,456	10	0.1
第8期	698,710,295	807,276,632	11,554	10	0.1
第9期	683,581,164	596,912,137	8,732	0	0.0
第10期	689,241,984	678,175,443	9,839	0	0.0
第11期	662,492,179	646,694,137	9,762	0	0.0
第12期	586,000,661	560,856,457	9,571	0	0.0
第13期	520,056,841	515,515,037	9,913	0	0.0
第14期	383,443,039	466,336,396	12,162	10	0.1
第15期	282,522,763	360,420,444	12,757	10	0.1
第16期	244,731,492	343,770,204	14,047	10	0.1
第17期	224,085,908	308,746,336	13,778	10	0.1
第18期	207,697,181	314,010,678	15,119	10	0.1
第19期	241,607,633	355,631,146	14,719	10	0.1
第20期	251,025,434	386,758,893	15,407	10	0.1
第21期	193,659,578	301,465,708	15,567	10	0.1
第22期	179,696,292	309,357,888	17,216	10	0.1

## ○償還金のお知らせ

---

1 万口当たり償還金（税込み）	16,284円08銭
-----------------	------------

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2021年10月27日から2022年10月19日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

# 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2021年10月26日）  
（2020年10月27日～2021年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1999年10月29日から原則無期限です。
運用方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「東証株価指数」に連動する投資成果をめざして運用を行いません。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場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。

## ファンド概要

主としてわが国の株式に投資し、「東証株価指数」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行いません。運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<935743>

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
18期(2017年10月26日)	15,511	29.6	1,753.90	26.8	98.6	1.2	29,028
19期(2018年10月26日)	14,423	△ 7.0	1,596.01	△ 9.0	98.9	1.1	27,865
20期(2019年10月28日)	15,279	5.9	1,648.43	3.3	98.9	1.1	32,975
21期(2020年10月26日)	15,382	0.7	1,618.98	△ 1.8	98.9	1.1	33,867
22期(2021年10月26日)	19,593	27.4	2,018.40	24.7	98.2	1.8	41,752

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2020年10月26日	円	%		%	%	%
	15,382	—	1,618.98	—	98.9	1.1
10月末	15,007	△ 2.4	1,579.33	△ 2.4	98.8	1.2
11月末	16,683	8.5	1,754.92	8.4	98.7	1.2
12月末	17,179	11.7	1,804.68	11.5	99.5	0.4
2021年1月末	17,219	11.9	1,808.78	11.7	99.5	0.5
2月末	17,758	15.4	1,864.49	15.2	99.5	0.5
3月末	18,772	22.0	1,954.00	20.7	98.7	1.2
4月末	18,242	18.6	1,898.24	17.2	98.6	1.5
5月末	18,494	20.2	1,922.98	18.8	98.4	1.6
6月末	18,712	21.6	1,943.57	20.0	98.7	1.3
7月末	18,304	19.0	1,901.08	17.4	99.4	0.6
8月末	18,883	22.8	1,960.70	21.1	99.5	0.4
9月末	19,707	28.1	2,030.16	25.4	98.9	1.1
(期末) 2021年10月26日	19,593	27.4	2,018.40	24.7	98.2	1.8

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 基準価額の推移

期間の初め15,382円の基準価額は、期間末に19,593円となり、騰落率は+27.4%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

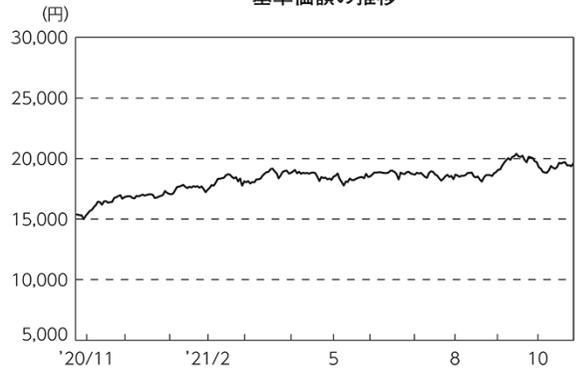
## &lt;値上がり要因&gt;

- ・米国で追加経済対策が成立し、景気の回復期待が高まったこと。
- ・新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化が期待されたこと。
- ・前首相の退陣表明を受けて次期政権による経済対策が期待されたこと。

## &lt;値下がり要因&gt;

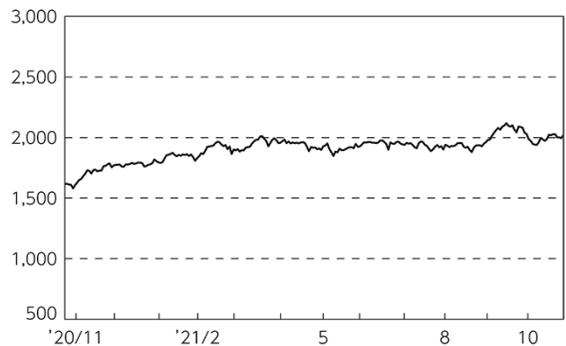
- ・新型コロナウイルスの感染再拡大を受けた緊急事態宣言の発出に伴う経済活動の制限強化への警戒感から、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）において資産購入の段階的縮小が示され、FOMC参加者による政策金利の見通しが引き上げられたこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2020/10/26	2021/09/14	2020/10/30	2021/10/26
15,382円	20,407円	15,007円	19,593円

東証株価指数の推移



**(株式市況)**

国内株式市場では、東証株価指数（TOPIX）は、期間の初めと比べて上昇しました。

新型コロナウイルスの感染再拡大を受けた緊急事態宣言の発出に伴う経済活動の制限強化への警戒感から、投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、中国の大手不動産会社の経営悪化が中国経済全体に影響を及ぼすことへの警戒感、FOMCにおいて資産購入の段階的縮小が示され、FOMC参加者による政策金利の見通しが引き上げられたことなどが株価の下落要因となったものの、米国大統領選挙にて民主党候補の当選が確実となり米国政治の先行き不透明感が後退したことや、米国における追加経済対策の成立により景気の回復期待が高まったこと、日本の2020年10-12月期国内総生産（GDP）速報値が市場予想を上回ったこと、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展による経済正常化が期待されたこと、米国企業の業績改善観測などを背景に米国株式市場が上昇したこと、前首相の退陣表明を受けて次期政権による経済対策が期待されたことなどが支援材料となり、TOPIXは上昇しました。

**ポートフォリオ**

TOPIXに連動する投資成果を目標とし、「バール日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

**当ファンドのベンチマークとの差異**

期間中における基準価額は、27.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「東証株価指数」の上昇率24.7%を概ね2.7%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

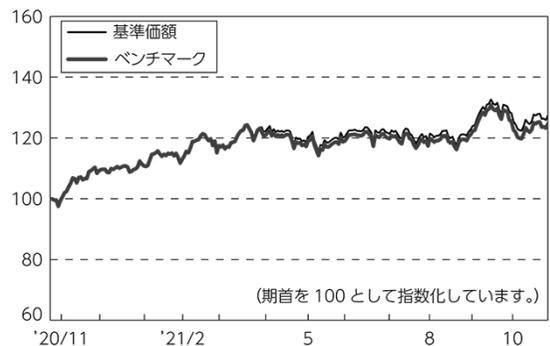
**<プラス要因>**

- ・株式配当金を受け取ったこと。

**<マイナス要因>**

- ・売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移

**○今後の運用方針**

引き続き、TOPIXとの連動をめざし、原則として「バール日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を継続します。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	0	0.001	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、17,913円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,865 ( 741)	千円 4,508,423 ( -)	千株 2,060	千円 5,201,224

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )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

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内		証券 -	千円 -	証券 -	千円 -
		(500)	(-)	(500)	(-)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は新株予約権の付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

## 先物取引の種類別取引状況

種類別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 4,358	百万円 4,034	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

## ○株式売買比率

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	9,709,648千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	37,604,052千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.25

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 7	百万円 7	百万円 106

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2021年10月26日現在)

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	0.7	0.7	2,094
日本水産	20	18.7	12,248
マルハニチロ	2.9	3.1	8,029
雪国まいたけ	—	1.6	2,310
カネコ種苗	0.6	0.6	875
サカタのタネ	2.4	2.4	8,160
ホクト	1.5	1.7	3,296
ホクリヨウ	0.3	0.3	225
<b>鉱業 (0.2%)</b>			
住石ホールディングス	4.3	3.4	547
日鉄鉱業	0.5	0.5	3,495
三井松島ホールディングス	0.8	0.8	1,388
I N P E X	73.7	80.7	79,650
石油資源開発	2.6	2.6	5,675
K&Oエナジーグループ	0.9	0.9	1,506
<b>建設業 (2.3%)</b>			
ヒノキヤグループ	0.5	0.5	1,132
ショーボンドホールディングス	3.1	2.9	13,485
ミライト・ホールディングス	6	7	15,561
サンヨーホームズ	0.2	0.3	218
日本アクア	0.9	0.9	508
ファーストコーポレーション	0.7	0.7	564
ベステラ	0.4	0.4	598
キャンディル	0.4	0.5	260
スペースバリューホールディングス	2.5	2.5	2,022
ダイセキ環境ソリューション	0.4	0.4	758
第一カッター興業	0.3	0.6	753
安藤・間	12	13	10,075
東急建設	6	5.9	4,820
コムシスホールディングス	7.1	7.1	20,483
ビーアールホールディングス	2.3	2.8	1,190
高松コンストラクショングループ	1.3	1.3	2,602
東建コーポレーション	0.6	0.6	5,670
ソネック	0.3	0.3	321
ヤマウラ	0.9	1	917
オリエンタル白石	—	7.1	1,945

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大成建設	15.4	14.5	52,997
大林組	46.3	46.5	45,244
清水建設	47	43.6	37,103
飛島建設	1.4	1.4	1,509
長谷工コーポレーション	17.9	15.2	22,860
松井建設	1.9	1.9	1,444
銭高組	0.2	0.2	810
鹿島建設	36.4	34.1	49,001
不動テトラ	1.2	1.2	2,192
大末建設	0.6	0.7	613
鉄建建設	1	1	1,815
西松建設	3.6	3.3	10,725
三井住友建設	11.2	11.3	5,548
大豊建設	1.1	1	3,875
前田建設工業	11.7	—	—
ナカノフドー建設	1.4	1.3	456
奥村組	2.2	2.6	7,683
東鉄工業	2	2	5,010
イチケン	0.4	0.4	772
富士ビー・エス	0.8	0.7	386
浅沼組	0.5	0.6	2,727
戸田建設	19.3	19.3	14,204
熊谷組	2.2	2.2	6,168
北野建設	0.3	0.3	649
植木組	0.2	0.5	731
矢作建設工業	2.1	2.1	1,631
ピーエス三菱	1.6	1.6	1,060
日本ハウスホールディングス	3.3	3.3	1,326
大東建託	5.1	5.1	69,411
新日本建設	2	2.1	1,757
N I P P O	3.8	3.9	15,736
東亜道路工業	0.3	0.3	1,515
前田道路	4.1	—	—
日本道路	0.5	0.5	4,165
東亜建設工業	1.5	1.3	3,233
日本国土開発	4.6	4.6	2,764
若築建設	0.9	0.9	1,820

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東洋建設	5.3	5.3	3,089	
五洋建設	18.4	19.8	15,681	
福田組	0.5	0.5	2,392	
住友林業	11.7	11.9	25,132	
日本基礎技術	1.7	1.5	790	
巴コーポレーション	2.2	2.2	987	
大和ハウス工業	45.8	42.9	161,904	
ライト工業	2.7	2.7	5,329	
積水ハウス	50.3	50.4	119,271	
日特建設	1.3	1.3	924	
北陸電気工事	0.8	0.9	1,066	
ユアテック	2.7	2.8	1,929	
日本リーテック	1	1	1,569	
四電工	0.3	0.6	998	
中電工	1.9	2.2	4,921	
関電工	6.6	7.6	6,893	
きんでん	11	9.5	18,012	
東京エネシス	1.6	1.6	1,764	
トーエネック	0.5	0.5	1,740	
住友電設	1.3	1.3	2,861	
日本電設工業	2.6	2.6	4,773	
エクシオグループ	7	7.1	18,857	
新日本空調	1.3	1.3	3,112	
九電工	3.3	3.3	11,748	
三機工業	3.3	3.3	4,689	
日揮ホールディングス	14.3	15.5	17,577	
中外炉工業	0.5	0.5	875	
ヤマト	1.5	1.6	1,297	
太平電業	1.1	1	2,745	
高砂熱学工業	3.9	4.2	8,677	
三晃金属工業	0.2	0.2	505	
朝日工業社	0.3	0.4	1,354	
明星工業	3.1	3.1	2,145	
大気社	2.3	2.3	7,532	
ダイダン	1.1	1.1	2,690	
日比谷総合設備	1.5	1.5	2,908	
フィル・カンパニー	0.3	0.3	824	
テスホールディングス	—	0.9	2,023	
インフロニア・ホールディングス	—	18.3	17,421	
OSJBホールディングス	7.5	—	—	
東洋エンジニアリング	2.1	2	1,774	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
レイズネクスト	2.5	2.5	3,097	
<b>食料品 (3.4%)</b>				
ニッポン	4.3	4.4	7,035	
日清製粉グループ本社	16.7	16.8	30,139	
日東富士製粉	0.1	0.2	634	
昭和産業	1.4	1.3	3,621	
鳥越製粉	1.3	1.3	988	
中部飼料	1.8	1.8	1,978	
フィード・ワン	2	2	1,490	
東洋精糖	0.3	0.2	233	
日本甜菜製糖	0.8	0.8	1,309	
DM三井製糖ホールディングス	1.3	1.2	2,418	
塩水港精糖	1.7	1.8	399	
日新製糖	0.7	0.7	1,193	
森永製菓	3.5	3.5	13,877	
中村屋	0.4	0.4	1,518	
江崎グリコ	4.1	4.1	16,789	
名糖産業	0.7	0.7	1,199	
井村屋グループ	0.8	0.9	2,061	
不二家	1	0.8	1,876	
山崎製パン	11.1	11.2	19,880	
第一屋製パン	0.3	0.3	223	
モロゾフ	0.3	0.2	1,078	
亀田製菓	0.8	0.9	4,041	
寿スピリッツ	1.4	1.4	10,388	
カルビー	6.7	6.8	18,502	
森永乳業	2.7	2.8	18,480	
六甲バター	1	1.1	1,802	
ヤクルト本社	10.2	10.2	58,548	
明治ホールディングス	9.8	9.8	69,188	
雪印メグミルク	3.6	3.6	7,909	
ブリマハム	2.3	2.1	5,705	
日本ハム	5.7	5.7	22,914	
林兼産業	0.5	0.5	308	
丸大食品	1.6	1.5	2,542	
S F o o d s	1.2	1.3	4,101	
柿安本店	0.5	0.5	1,333	
伊藤ハム米久ホールディングス	9.5	9.6	6,748	
サッポロホールディングス	5.1	5.1	12,530	
アサヒグループホールディングス	32.4	35	176,645	
キリンホールディングス	62.8	54.6	108,053	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宝ホールディングス	11	11	17,226
オエノンホールディングス	4.2	4.3	1,621
養命酒製造	0.5	0.5	909
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	11.3	10.4	15,891
サントリー食品インターナショナル	9.9	10	44,450
ダイドールグループホールディングス	0.8	0.8	4,336
伊藤園	4.5	4.5	32,625
キーコーヒー	1.5	1.5	3,357
ユニカフェ	0.5	0.5	546
ジャパンフーズ	0.2	0.2	246
日清オイリオグループ	1.9	1.9	5,719
不二製油グループ本社	3.6	3.6	9,630
J-オイルミルズ	0.8	1.4	2,563
キッコーマン	10.7	10.7	99,189
味の素	32.7	35.3	116,137
ブルドックソース	—	0.7	1,559
キュービー	8.2	8.3	20,667
ハウス食品グループ本社	5.5	5.6	18,144
カゴメ	6.1	5.6	15,954
焼津水産化学工業	0.7	0.8	784
アリアケジャパン	1.4	1.4	10,220
ビエトロ	0.2	0.2	358
エバラ食品工業	0.4	0.3	749
やまみ	0.1	0.2	401
ニチレイ	7.1	7.1	19,723
東洋水産	7.6	7.7	35,959
イトーアンドホールディングス	0.5	0.5	1,053
大冷	0.2	0.2	383
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.8	0.9	681
日清食品ホールディングス	6.3	5.8	48,894
永谷園ホールディングス	0.7	0.7	1,463
一正蒲鉾	0.6	0.6	547
フジッコ	1.6	1.6	3,052
ロック・フィールド	1.6	1.6	2,705
日本たばこ産業	79.5	79.7	179,603
ケンコーマヨネーズ	0.8	0.9	1,377
わらべや日洋ホールディングス	1	1	2,162
なとり	0.8	0.8	1,558
イフジ産業	0.3	0.2	182
ピックスコーポレーション	0.3	0.7	1,264
ファーマフーズ	—	1.4	3,609

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北の達人コーポレーション	5.2	—	—
ユーグレナ	6.4	7.6	6,262
紀文食品	—	0.9	1,089
ミヨシ油脂	0.5	0.6	788
理研ビタミン	1.4	1.4	2,513
<b>繊維製品 (0.5%)</b>			
片倉工業	2	1.6	2,785
グンゼ	1.1	1.1	4,757
東洋紡	5.7	5.7	7,814
ユニチカ	4.3	4.3	1,565
富士紡ホールディングス	0.7	0.7	2,835
倉敷紡績	1.5	1.2	2,269
シキボウ	0.8	0.9	842
日本毛織	4.7	4.4	4,070
ダイトウボウ	2.4	2.3	227
トーア紡コーポレーション	0.6	0.5	216
ダイドーリミテッド	2	1.9	323
帝国繊維	1.6	1.6	3,302
帝人	11.8	13.7	21,084
東レ	104.7	105.1	73,937
サカイオーベックス	0.4	—	—
住江織物	0.3	0.3	542
日本フェルト	0.8	0.8	355
イチカワ	0.2	0.2	265
日東製網	0.2	0.1	147
アツギ	1.2	1.2	775
ダイニック	0.6	0.6	456
セーレン	3.6	3.6	8,568
ソトー	0.6	0.6	526
東海染工	0.2	0.2	227
小松マテーレ	2.4	2.4	2,184
ワコールホールディングス	3.6	3.6	8,352
ホギメディカル	1.6	1.9	5,985
クラウディアホールディングス	0.4	0.3	84
T S I ホールディングス	4.4	4.5	1,597
マツオカコーポレーション	0.4	0.5	699
ワールド	2.1	1.9	2,667
三陽商会	0.8	0.8	731
ナイガイ	0.6	0.5	166
オンワードホールディングス	8.8	8.7	2,966
ルックホールディングス	0.5	0.4	557

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴールドウイン	2.6	2.4	16,032
デサント	2.8	2.5	10,450
キング	0.7	0.8	434
ヤマトインターナショナル	1.3	1.3	414
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			
特種東海製紙	0.9	0.9	3,987
玉子ホールディングス	60.3	65.3	37,221
日本製紙	6.4	6.4	7,552
三菱製紙	1.7	2.1	745
北越コーポレーション	8.7	10.4	8,184
中越パルプ工業	0.6	0.6	712
巴川製紙所	0.5	0.5	458
大王製紙	6.6	7	13,881
阿波製紙	0.4	0.4	152
レンゾー	13.6	14.9	12,992
トーモク	0.9	0.9	1,761
ザ・バック	1.1	1.1	3,273
<b>化学 (6.9%)</b>			
北の達人コーポレーション	—	5.2	2,204
クラレ	22.8	21.2	22,069
旭化成	95.9	96.1	115,800
共和レザー	0.8	0.8	545
昭和電工	11	12.6	36,792
住友化学	106.2	114.2	65,550
住友精化	0.6	0.7	2,310
日産化学	8	8	51,200
ラサ工業	0.5	0.5	925
クレハ	1.2	1.2	8,880
多木化学	0.6	0.6	3,828
テイカ	1.1	1.1	1,464
石原産業	2.6	2.6	3,185
片倉コープアグリ	0.4	0.4	472
日本曹達	2.1	2	6,880
東ソー	22.3	22.4	43,120
トクヤマ	4.2	4.3	8,591
セントラル硝子	2.9	2.8	5,980
東亜合成	9.1	8.3	10,541
大阪ソーダ	1.5	1.5	4,284
関東電化工業	3.5	3.5	3,577
デンカ	5.3	5.3	20,113
信越化学工業	24.8	26.8	522,064

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本カーバイド工業	0.5	0.6	832
堺化学工業	0.9	1	2,028
第一稀元素化学工業	1.6	1.5	2,211
エア・ウォーター	13.4	14.8	25,752
日本酸素ホールディングス	13.9	12	31,644
日本化学工業	0.5	0.4	1,153
東邦アセチレン	0.2	0.2	249
日本パーカライジング	7.3	7.3	8,438
高圧ガス工業	2.3	2.3	1,752
四国化成工業	2.1	1.9	2,701
戸田工業	0.3	0.3	936
ステラ ケミファ	0.8	0.8	2,303
保土谷化学工業	0.5	0.4	1,994
日本触媒	2.2	2.6	15,184
大日精化工業	1.3	1.2	3,136
カネカ	3.7	3.8	16,682
三菱瓦斯化学	13.4	14.5	33,872
三井化学	13.4	12.5	43,437
J S R	13.5	14.6	57,597
東京応化工業	2.5	2.5	17,525
大阪有機化学工業	1.3	1.2	4,110
三菱ケミカルホールディングス	96.6	96.9	92,306
KHネオケム	2.4	2.4	7,092
ダイセル	18.8	19.5	16,633
住友パークライト	2.3	2.3	11,040
積水化学工業	30.6	30.4	54,112
日本ゼオン	13	13.1	19,571
アイカ工業	4.3	4	14,120
宇部興産	7.3	7.3	15,527
積水樹脂	2.6	2.2	4,754
タキロンシーアイ	3.2	3.2	1,948
旭有機材	0.8	0.8	1,110
ニチバン	0.8	0.8	1,466
リケンテクノス	3.5	3.5	1,925
大倉工業	0.7	0.8	1,673
積水化成成品工業	2	1.9	1,100
群栄化学工業	0.3	0.3	964
タイガースポリマー	0.8	0.8	344
ミライアル	0.5	0.5	792
ダイキアクシス	0.6	0.6	554
ダイキョーニシカワ	3.1	3.1	2,123

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
竹本容器	0.6	0.5	455	
森六ホールディングス	0.8	0.8	1,593	
恵和	—	0.4	1,872	
日本化薬	9	9	10,836	
カーリットホールディングス	1.6	1.5	1,140	
日本精化	1.2	1.1	2,454	
扶桑化学工業	1.5	1.1	5,665	
トリケミカル研究所	0.3	1.3	4,452	
ADEKA	6.7	6.7	16,709	
日油	5.4	5.5	30,745	
新日本理化	2.4	2.5	807	
ハリマ化成グループ	1.2	1.1	957	
花王	35.3	32.8	208,706	
第一工業製薬	0.5	0.5	1,590	
石原ケミカル	0.4	0.8	1,141	
日華化学	0.5	0.5	483	
ニイタカ	0.3	0.3	694	
三洋化成工業	0.9	0.9	4,959	
有機合成薬品工業	1.1	1.2	385	
大日本塗料	1.7	1.7	1,445	
日本ペイントホールディングス	11.9	54.5	68,997	
関西ペイント	16.2	16.3	42,640	
神東塗料	1.2	1.3	248	
中国塗料	4.1	3.1	2,755	
日本特殊塗料	1.1	1.1	1,102	
藤倉化成	2	2	1,068	
太陽ホールディングス	1.1	2.2	6,512	
DIC	6.1	6.1	18,483	
サカタインクス	3.2	2.9	3,227	
東洋インキSCホールディングス	3.1	3.1	6,255	
T&K TOKA	1.1	1	807	
富士フィルムホールディングス	28.3	26	228,904	
資生堂	29.3	27.6	207,690	
ライオン	19.2	17.9	33,831	
高砂香料工業	0.9	0.9	2,629	
マンダム	3.3	3.1	5,074	
ミルボン	2	1.8	12,132	
ファンケル	6	5.4	19,008	
コーセー	2.8	2.8	38,584	
コタ	0.9	1	1,594	
ポーラ・オルビスホールディングス	6.3	6.3	15,699	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ノエビアホールディングス	1.2	1.3	7,293	
アジュバンホールディングス	0.3	0.3	364	
新日本製薬	—	0.4	684	
エステー	1	1	1,680	
アグロ カネショウ	0.6	0.5	706	
コニシ	2.5	2.4	4,231	
長谷川香料	2.5	2.6	7,280	
星光PMC	0.9	0.9	710	
小林製薬	4.1	4.2	35,826	
荒川化学工業	1.3	1.2	1,462	
メック	1	1.1	3,393	
日本高純度化学	0.4	0.4	1,156	
タカラバイオ	3.9	3.9	11,536	
JCU	1.8	1.7	7,624	
新田ゼラチン	1	1	623	
OATアグリオ	0.3	0.3	627	
デクセリアルズ	3.8	4.1	9,294	
アース製薬	1.1	1.2	8,268	
北興化学工業	1.4	1.4	1,401	
大成ラミック	0.5	0.5	1,395	
クミアイ化学工業	6.1	5.5	4,653	
日本農薬	2.7	2.7	1,444	
アキレス	1	1	1,355	
有沢製作所	2.4	2.1	1,862	
日東電工	10.2	9	73,080	
レック	1.6	1.8	1,900	
三光合成	1.8	1.6	665	
きもと	2.5	2.3	535	
藤森工業	1.3	1.3	6,019	
前澤化成工業	0.9	0.9	1,153	
未来工業	0.8	0.5	807	
ウェーブロックホールディングス	0.5	0.6	397	
JSP	0.9	0.9	1,427	
エフビコ	3.1	2.7	10,395	
天馬	1	1.1	3,083	
信越ポリマー	2.7	2.3	2,332	
東リ	3.7	3.8	896	
ニフコ	5.4	5.4	20,277	
バルカー	1.2	1.2	2,564	
ユニ・チャーム	31.3	28.5	125,200	
ショーエイコーポレーション	0.2	0.3	238	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>医薬品 (5.0%)</b>			
協和キリン	14.8	17.4	64,989
武田薬品工業	122.8	123.3	392,587
アステラス製薬	127.9	128.4	252,627
大日本住友製薬	10.9	11	21,846
塩野義製薬	18.6	18.6	139,221
わかもと製薬	1.9	1.8	612
あすか製薬	1.7	—	—
日本新薬	3.9	4.2	38,010
ピオフェルミン製薬	0.3	—	—
中外製薬	46.2	46.3	196,821
科研製薬	2.5	2.5	11,225
エーザイ	17.7	16.4	133,233
ロート製薬	7.6	7.1	23,856
小野薬品工業	33.9	34	83,385
久光製薬	3.9	4.3	17,178
持田製薬	2	2.1	6,846
参天製薬	27.5	25.8	41,228
扶桑薬品工業	0.5	0.5	1,306
日本ケミファ	0.2	0.2	431
ツムラ	4.6	5	17,625
日医工	4.2	4.2	3,641
キッセイ薬品工業	2.6	2.6	6,151
生化学工業	2.9	2.6	2,636
栄研化学	2.6	2.6	5,132
日水製薬	0.7	0.5	489
鳥居薬品	0.9	0.8	2,361
JCRファーマ	4.1	4.2	11,974
東和薬品	1.9	2.1	7,129
富士製薬工業	1	0.9	1,005
沢井製薬	3	—	—
ゼリア新薬工業	2.7	2.7	5,481
第一三共	126.7	116.4	332,322
キョーリン製薬ホールディングス	3.3	3.3	5,811
大幸薬品	1.8	2.2	1,771
ダイト	0.9	1	3,220
大塚ホールディングス	30.7	30.8	143,312
大正製薬ホールディングス	3.1	3.7	23,384
ペプチドリーム	7.5	7.8	21,481
あすか製薬ホールディングス	—	1.7	1,698
サワイグループホールディングス	—	3.2	16,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>			
日本コークス工業	12.7	12.5	1,937
ニチレキ	1.7	1.7	2,252
ユシロ化学工業	0.8	0.8	935
ビービー・カストロール	0.5	0.6	856
富士石油	4	3.7	1,061
MORESCO	0.6	0.5	610
出光興産	16.4	16.4	53,874
ENEOSホールディングス	222	222.7	104,000
コスモエネルギーホールディングス	4.3	4.7	11,834
<b>ゴム製品 (0.7%)</b>			
横浜ゴム	8.5	8.6	16,942
TOYO TIRE	7.7	7.8	14,445
ブリヂストン	39.3	42.7	216,702
住友ゴム工業	13.2	13.3	18,965
藤倉コンポジット	1.3	1.4	1,159
オカモト	0.9	0.9	3,591
フコク	0.6	0.7	703
ニッタ	1.7	1.5	3,966
住友理工	2.9	2.8	2,102
三ツ星ベルト	2	1.8	3,596
バンドー化学	2.6	2.6	2,311
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
日東紡績	2.2	2.2	7,942
AGC	13.5	13.6	77,520
日本板硝子	7.1	7.5	4,987
石塚硝子	0.3	0.3	656
日本山村硝子	0.7	0.6	553
日本電気硝子	5.5	5.9	16,986
オハラ	0.6	0.6	831
住友大阪セメント	2.8	2.7	8,856
太平洋セメント	9.3	8.4	20,512
日本ヒューム	1.5	1.3	981
日本コンクリート工業	3.2	3.2	963
三谷セキサン	0.7	0.7	4,998
アジアパイルホールディングス	2.1	2.3	1,071
東海カーボン	14.4	12.4	19,170
日本カーボン	0.8	0.8	3,528
東洋炭素	0.9	1	3,070
ノリタケカンパニーリミテド	0.8	0.8	3,928
TOTO	10.5	10.6	60,526

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本碍子	17.7	16.3	31,540
日本特殊陶業	11.2	11.3	19,503
ダントーホールディングス	0.9	1	253
MARUWA	0.6	0.5	5,640
品川リフラクトリーズ	0.4	0.3	1,201
黒崎播磨	0.3	0.3	1,398
ヨータイ	1.2	1	1,290
イソライト工業	0.8	0.7	640
東京窯業	1.9	1.9	615
ニッカトー	0.7	0.7	551
フジミインコーポレーテッド	1.3	1.2	8,316
クニミネ工業	0.6	0.5	575
エーアンドエーマテリアル	0.2	0.3	294
ニチアス	4	3.7	10,249
ニチハ	2	2	6,520
<b>鉄鋼 (0.8%)</b>			
日本製鉄	65.4	69.9	144,273
神戸製鋼所	26.7	26.9	18,668
合同製鐵	0.8	0.8	1,260
ジェイ エフ イー ホールディングス	39.4	42.4	76,828
東京製鐵	7.1	5.8	7,789
共英製鋼	1.7	1.7	2,419
大和工業	3.1	3.1	12,105
東京鐵鋼	0.6	0.6	918
大阪製鐵	0.8	0.8	963
淀川製鋼所	2	1.9	4,763
丸一鋼管	4.7	4.8	12,676
モリ工業	0.5	0.5	1,399
大同特殊鋼	2.4	2.4	11,580
日本高周波鋼業	0.6	0.6	247
日本冶金工業	1.2	1.2	3,380
山陽特殊製鋼	1	1.8	3,247
愛知製鋼	0.8	0.8	2,156
日立金属	15.7	13.8	29,835
日本金属	0.4	0.4	462
大平洋金属	1	1	2,160
新日本電工	9.6	9.7	3,744
栗本鐵工所	0.7	0.7	1,160
虹技	0.2	0.2	217
日本鑄鉄管	0.2	0.2	244
三菱製鋼	1.2	1.1	1,310

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日亜鋼業	2.3	2.3	676
日本精線	0.2	0.2	1,006
エンビプロ・ホールディングス	0.7	0.6	1,578
シンニッタン	2.5	1.9	440
新家工業	0.4	0.4	698
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	2.5	2.2	3,836
日本軽金属ホールディングス	3.7	4	7,804
三井金属鉱業	3.9	4	13,580
東邦亜鉛	0.8	0.8	2,700
三菱マテリアル	9.6	9.7	21,854
住友金属鉱山	18.7	18.7	84,430
DOWAホールディングス	3.7	3.7	18,000
古河機械金属	2.6	2.5	3,165
エス・サイエンス	6.9	7.6	243
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.6	1.6	1,296
東邦チタニウム	2.6	2.7	3,304
UACJ	2.2	2.2	5,977
CKサンエツ	0.3	0.3	1,048
古河電気工業	4.5	4.6	11,854
住友電気工業	54.6	51.2	78,873
フジクラ	17.7	17.7	11,894
昭和電線ホールディングス	1.7	1.4	3,136
タツタ電線	2.9	2.7	1,441
カナレ電気	0.3	0.3	516
平河ヒューテック	0.8	0.8	942
リョービ	1.8	1.8	2,223
アーレスティ	2	1.9	830
アサヒホールディングス	2.6	5.5	12,210
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
稲葉製作所	0.8	0.8	1,075
宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.5	1,304
トーカロ	4	3.8	5,171
アルファC o	0.6	0.5	646
SUMCO	18.7	22.6	49,268
川田テクノロジーズ	0.3	0.3	1,162
RS Technologies	0.5	0.5	3,015
ジェイテックコーポレーション	—	0.2	430
信和	0.9	0.8	579
東洋製罐グループホールディングス	9.3	9.3	12,322
ホッカンホールディングス	0.8	0.7	1,039

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロナ	0.8	0.8	731
横河ブリッジホールディングス	2.7	2.5	5,792
駒井ハルテック	0.3	0.3	498
高田機工	0.1	0.1	280
三和ホールディングス	13.8	13.8	19,651
文化シャッター	4.3	4.3	4,712
三協立山	1.9	1.9	1,417
アルインコ	1.1	1	998
東洋シャッター	0.3	0.3	201
L I X I L	21.5	20.2	62,620
日本フィルコン	1	1	552
ノーリツ	3	2.8	5,264
長府製作所	1.5	1.5	3,060
リンナイ	2.8	2.8	32,816
ダイニチ工業	0.8	0.7	556
日東精工	1.8	1.8	1,200
三洋工業	0.2	0.2	378
岡部	3	3	2,037
ジーテクト	1.8	1.8	2,604
東プレ	2.7	2.7	3,607
高周波熱錬	2.8	2.8	1,766
東京製綱	1.1	1	917
サンコール	1.2	1.2	547
モリテック スチール	1.2	1.1	485
バイオラックス	2.2	2.2	3,627
エイチワン	1.5	1.4	1,052
日本発條	15.7	14.6	12,687
中央発條	0.2	0.7	725
アドバネクス	0.2	0.2	242
立川ブラインド工業	0.7	0.6	747
三益半導体工業	1.1	1.1	2,680
<b>機械 (5.5%)</b>			
日本ドライケミカル	0.4	0.4	837
日本製鋼所	4.4	4.4	14,872
三浦工業	6.3	6.3	28,192
タクマ	5	5	7,715
ツガミ	3	3	4,776
オークマ	1.7	1.7	9,537
芝浦機械	1.7	1.5	4,029
アマダ	18.1	21.5	24,660
アイダエンジニアリング	3.9	3.8	3,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
滝澤鉄工所	0.5	0.4	448
F U J I	6.3	5.8	15,283
牧野フライス製作所	1.7	1.7	7,361
オーエスジー	7.2	6.8	12,729
ダイジェット工業	0.2	0.2	222
旭ダイヤモンド工業	3.9	3.8	2,709
DMG森精機	9.2	8.7	17,112
ソディック	3.2	3.2	2,851
ディスコ	2	2	62,000
日東工器	0.8	0.7	1,354
日進工具	0.6	1.1	1,607
パンチ工業	1.4	1.3	764
富士ダイス	0.7	0.7	451
豊和工業	0.8	0.8	653
OKK	0.4	0.7	214
東洋機械金属	1.1	1.1	603
津田駒工業	0.3	0.3	246
島精機製作所	2.3	2.1	4,412
オプトラン	1.8	1.8	4,138
NCホールディングス	0.4	0.5	736
イワキポンプ	0.9	0.9	901
フリュー	1.4	1.4	2,277
ヤマシンフィルタ	3.2	3	2,010
日阪製作所	1.8	1.8	1,513
やまびこ	2.8	2.8	3,404
野村マイクロ・サイエンス	—	0.3	1,464
平田機工	0.7	0.7	4,767
ベガサスミシン製造	1.5	1.5	682
マルマエ	0.6	0.6	1,375
タツモ	0.6	0.7	1,190
ナブテスコ	8.6	8.3	32,038
三井海洋開発	1.6	1.5	2,955
レオン自動機	1.5	1.4	1,951
SMC	4.6	4.4	302,368
ホソカワミクロン	0.5	1	3,235
ユニオンツール	0.6	0.5	1,927
オイレス工業	1.9	2.1	3,582
日精エー・エス・ビー機械	0.4	0.5	1,895
サトーホールディングス	2.1	1.9	5,112
技研製作所	1.3	1.3	5,642
日本エアーテック	0.5	0.7	867

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カワタ	0.4	0.4	399
日精樹脂工業	1.2	1.1	1,223
オカダアイオン	0.5	0.5	650
ワイエイシイホールディングス	0.6	0.6	567
小松製作所	66.9	67.1	196,099
住友重機械工業	8.5	8.5	25,372
日立建機	5.9	6.9	23,943
日工	2	2.2	1,467
巴工業	0.6	0.6	1,464
井関農機	1.5	1.4	2,331
TOWA	1.5	1.4	3,421
丸山製作所	0.3	0.3	471
北川鉄工所	0.7	0.7	1,108
ローツェ	0.6	0.6	6,564
タカキタ	0.5	0.5	350
クボタ	78.3	72.2	179,525
荏原実業	0.4	0.7	1,995
三菱化工機	0.5	0.5	1,191
月島機械	2.7	2.7	3,137
帝国電機製作所	1.2	1	1,450
新東工業	3.6	3.5	2,642
澁谷工業	1.3	1.3	3,958
アイチ コーポレーション	2.6	2.5	1,970
小森コーポレーション	3.8	3.8	2,853
鶴見製作所	1.1	1.1	1,928
住友精密工業	0.2	0.2	470
酒井重工業	0.3	0.3	743
荏原製作所	6.1	6.1	37,942
石井鐵工所	0.2	0.2	595
西島製作所	1.5	1.5	1,356
北越工業	1.5	1.5	1,408
ダイキン工業	18.8	18.9	483,745
オルガノ	0.5	0.5	3,515
トーヨーカネツ	0.7	0.6	1,534
栗田工業	8	8	43,600
椿本チエイン	2.1	2.1	7,087
大同工業	0.7	0.7	743
木村化工機	1.3	1.3	1,001
アネスト岩田	2.3	2.5	2,357
ダイフク	7.6	8.1	84,969
サムコ	0.4	0.4	1,146

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
加藤製作所	0.8	0.8	672
油研工業	0.3	0.3	526
タダノ	7.1	7.1	9,215
フジテック	5.4	5.1	12,826
CKD	4	3.4	7,633
キトー	1.1	1.2	1,905
平和	4.1	4.1	8,409
理想科学工業	1.3	1.1	2,706
SANKYO	3.3	3.5	9,628
日本金銭機械	1.7	1.6	1,321
マースグループホールディングス	0.9	0.9	1,473
フクシマガリレイ	0.9	1	4,530
オーイズミ	0.6	0.7	267
ダイコク電機	0.7	0.7	848
竹内製作所	2.5	2.5	7,362
アマノ	3.9	3.9	10,537
JUKI	2.1	2.1	1,782
サンデンホールディングス	2.1	2.1	602
ジャノメ	1.4	1.3	965
マックス	2.3	2	3,576
グローリー	3.8	3.8	9,283
新晃工業	1.4	1.4	2,884
大和冷機工業	2.4	2.1	2,698
セガサミーホールディングス	14.7	13.5	22,059
日本ビストンリング	0.6	0.5	668
リケン	0.7	0.7	1,907
TPR	2	2	2,920
ツバキ・ナカシマ	2.9	3.2	5,148
ホシザキ	4.7	4.3	42,226
大豊工業	1.2	1.2	1,002
日本精工	27.8	30.4	24,624
NTN	34.2	34.2	9,165
ジェイテクト	14.2	14.2	14,753
不二越	1.4	1.3	5,538
日本トムソン	4.4	4	2,328
THK	9.2	8.6	22,299
ユースン精機	1.2	1	771
前澤給装工業	0.5	1	1,057
イーグル工業	1.9	1.8	2,172
前澤工業	1.1	0.9	625
日本ビラー工業	1.5	1.5	3,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キッツ	6	5	3,840
マキタ	19.3	19.3	111,361
三井E&Sホールディングス	—	5.8	3,306
日立造船	11.7	11.7	10,600
三菱重工業	24.7	23.3	70,366
I H I	10.6	10	27,300
サノヤスホールディングス	—	2.2	297
スター精密	2.3	2.3	3,431
<b>電気機器 (18.8%)</b>			
日清紡ホールディングス	9	9	7,992
イビデン	9	7.1	44,588
コニカミノルタ	32.3	30	17,250
ブラザー工業	18	18.1	40,942
ミネベアミツミ	27.4	25.5	72,547
日立製作所	70.9	71.2	482,380
東芝	—	29.3	140,200
三菱電機	147.6	148.1	237,478
富士電機	8.9	8.9	45,212
東洋電機製造	0.6	0.6	651
安川電機	15.9	15.9	78,943
シンフォニアテクノロジー	1.9	1.9	2,509
明電舎	2.7	2.5	6,095
オリジン	0.4	0.4	526
山洋電気	0.7	0.7	4,571
デンヨー	1.3	1.3	2,598
東芝テック	1.8	1.6	7,304
芝浦メカトロニクス	0.3	0.3	2,193
マブチモーター	4.1	3.5	13,702
日本電産	35.5	35.7	449,463
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1	0.8	525
トレックス・セミコンダクター	0.9	0.8	2,082
東光高岳	0.8	0.8	1,170
ダブル・スコープ	—	4.3	4,003
ダイヘン	1.6	1.6	7,376
ヤーマン	2.4	2.5	2,935
JVCケンウッド	12.2	12.8	2,662
ミマキエンジニアリング	1.4	1.3	1,153
I-PEX	0.7	0.7	1,412
日新電機	3.5	3.5	4,851
大崎電気工業	3	3	1,683
オムロン	13.2	12.3	131,364

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日東工業	2.2	2.2	3,746
I D E C	2.1	2	4,654
正興電機製作所	0.4	0.5	710
不二電機工業	0.3	0.3	377
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4.9	5.3	13,520
サクサホールディングス	0.4	0.4	572
メルコホールディングス	0.5	0.5	2,412
テクノメディカ	0.4	0.3	477
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	0.4	0.4	872
日本電気	17.9	18.8	118,252
富士通	14.2	13.3	290,272
沖電気工業	6	6	5,706
岩崎通信機	0.7	0.7	625
電気興業	0.7	0.7	1,754
サンケン電気	1.6	1.7	9,605
ナカヨ	0.3	0.3	421
アイホン	0.8	0.9	2,144
ルネサスエレクトロニクス	63	79.9	112,019
セイコーエプソン	18.3	18.4	37,664
ワコム	9.9	10.7	7,725
アルバック	2.7	2.7	17,172
アクセル	0.6	0.6	426
E I Z O	1.1	1.3	5,661
日本信号	3.8	3.5	3,391
京三製作所	3.6	3.2	1,558
能美防災	2	2	4,142
ホーチキ	1.1	1.1	1,336
星和電機	0.8	0.7	364
エレコム	1.7	3.4	5,810
パナソニック	168.6	157.9	241,113
シャープ	17.1	19.7	27,264
アンリツ	9.5	8.9	18,805
富士通ゼネラル	4	4.5	12,393
ソニーグループ	92.5	92.8	1,244,448
T D K	7.1	21.3	88,182
帝国通信工業	0.7	0.7	924
タムラ製作所	5	5.3	4,229
アルプスアルパイン	13.1	12.1	14,205
池上通信機	0.5	0.5	391
日本電波工業	—	1.4	1,310
鈴木	0.8	0.7	619

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メイコー	—	1.1	3,410
日本トリム	0.2	0.3	1,044
ローランド ディー. ジー.	0.9	0.9	2,673
フォスター電機	1.6	1.5	1,281
SMK	0.4	0.4	911
ヨコオ	1	1.2	2,964
ホシデン	4.1	3.9	3,993
ヒロセ電機	2.3	2.3	42,343
日本航空電子工業	3.4	3.4	5,742
TOA	1.6	1.8	1,456
マクセル	3.2	2.9	3,770
古野電気	1.9	1.9	2,359
ユニデンホールディングス	0.4	0.4	1,288
スミダコーポレーション	1.3	1.4	1,873
アイコム	0.8	0.6	1,448
リオン	0.6	0.6	1,464
本多通信工業	1.3	1.2	558
船井電機	1.5	—	—
横河電機	13.5	14.8	34,202
新電元工業	0.5	0.6	2,409
アズビル	9.3	10	48,500
東亜ディーケーケー	0.8	0.8	720
日本光電工業	6.1	6.1	22,265
チノー	0.5	0.5	704
共和電業	1.6	1.5	607
日本電子材料	0.6	0.6	1,144
堀場製作所	2.9	2.7	20,088
アドバンテスト	11	11	101,200
小野測器	0.7	0.6	312
エスベック	1.3	1.3	2,966
キーエンス	13.4	14.6	974,696
日置電機	0.7	0.7	5,474
シスメックス	10.6	11.6	165,590
日本マイクロニクス	2.6	2.6	3,822
メガチップス	1.4	1.5	5,265
OBARA GROUP	0.9	0.7	2,562
澤藤電機	0.2	0.2	396
原田工業	0.7	0.6	571
コーセル	2	1.8	1,684
イリソ電子工業	1.2	1.2	5,898
オブテックスグループ	2.4	2.4	3,528

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
千代田インテグレ	0.6	0.6	1,321
アイ・オー・データ機器	0.5	0.6	550
レーザーテック	6.5	6.5	162,500
スタンレー電気	10.3	10.4	30,180
岩崎電気	0.6	0.5	1,063
ウシオ電機	8.1	7.6	15,504
岡谷電機産業	1.2	1.1	385
ヘリオス テクノ ホールディング	1.4	1.4	453
エノモト	0.5	0.4	760
日本セラミック	1.5	1.4	4,131
遠藤照明	0.8	0.8	981
古河電池	1.1	1.1	1,758
双信電機	0.8	0.8	633
山一電機	1.1	1	1,675
図研	1	1	4,315
日本電子	2.9	2.7	23,139
カシオ計算機	13	11.9	19,873
ファナック	13.9	13	319,280
日本シイエムケイ	3.6	3.2	1,360
エンプラス	0.8	0.7	2,194
大真空	0.6	0.5	2,017
ローム	6.1	6.2	63,922
浜松ホトニクス	10.6	10.6	70,808
三井ハイテック	1.6	1.5	12,210
新光電気工業	5	5	19,350
京セラ	20.8	22.6	152,572
太陽誘電	6.6	6.6	37,092
村田製作所	43.4	43.5	371,316
双葉電子工業	2.4	2.6	2,012
北陸電気工業	0.6	0.6	613
ニチコン	5	4.7	5,061
日本ケミコン	1.2	1.5	3,159
KOA	2.2	2.1	3,202
市光工業	2.3	1.8	1,033
小糸製作所	8.8	8.9	59,719
ミツバ	2.8	2.8	1,808
SCREENホールディングス	2.6	2.6	24,908
キヤノン電子	1.4	1.4	2,228
キヤノン	73.3	73.6	200,707
リコー	37.5	37.7	41,470
象印マホービン	4	4	6,308

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
MUTOHホールディングス	0.2	0.2	324
東京エレクトロン	9.4	8.7	446,397
<b>輸送用機器 (7.8%)</b>			
トヨタ紡織	4.3	4.3	9,232
芦森工業	0.3	0.3	301
ユニプレス	2.9	2.4	2,246
豊田自動織機	12	12	115,680
モリタホールディングス	2.6	2.4	3,441
三櫻工業	1.9	2	2,064
デンソー	32.5	32.6	263,408
東海理化電機製作所	3.9	3.9	6,427
三井E&Sホールディングス	5.4	—	—
川崎重工業	11.5	11.6	27,387
名村造船所	5	4.6	1,090
サノヤスホールディングス	1.9	—	—
日本車輛製造	0.6	0.6	1,254
三菱ロジスネクスト	2	2	2,256
近畿車輛	0.2	0.3	327
日産自動車	174.2	174.5	102,640
いすゞ自動車	42.8	39.4	60,873
トヨタ自動車	164.7	750.5	1,485,990
日野自動車	18.4	18.5	20,646
三菱自動車工業	54.6	54.8	19,892
エフテック	1.1	1.1	718
レシップホールディングス	0.6	0.6	345
GMB	0.3	0.3	261
ファルテック	0.3	0.3	215
武蔵精密工業	3.3	3.3	7,088
日産車体	2.9	2.2	1,744
新明和工業	4	4.2	3,948
極東開発工業	2.8	2.6	4,162
日信工業	3	—	—
トビー工業	1.2	1.2	1,434
ティラド	0.6	0.5	1,527
タチエス	2.5	2.3	3,183
NOK	7.9	7.2	9,504
フタバ産業	4.2	3.8	1,789
KYB	1.7	1.7	5,253
大同メタル工業	2.9	3.1	1,909
プレス工業	7.5	7.3	2,452
ミクニ	1.9	2	640

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
太平洋工業	3.1	3.1	3,785
ケーヒン	3.4	—	—
河西工業	2	2.2	728
アイシン	12.1	10.8	46,116
マツダ	43.4	46.5	48,592
今仙電機製作所	1.4	1.3	881
本田技研工業	116.2	116.6	397,722
スズキ	29.3	29.3	150,807
SUBARU	45.8	42.4	95,887
安永	0.7	0.7	814
ヤマハ発動機	20.8	19.3	61,856
ショーワ	3.5	—	—
TBK	1.9	1.9	790
エクセディ	2	2	3,448
豊田合成	4.8	4.8	11,184
愛三工業	2.4	2.4	2,018
盟和産業	0.2	0.3	302
日本プラスト	1.2	1.3	826
ヨロズ	1.4	1.3	1,527
エフ・シー・シー	2.4	2.5	3,970
シマノ	5.5	6	180,840
テイ・エス テック	3.4	6.9	10,626
ジャムコ	0.8	0.9	907
<b>精密機器 (2.9%)</b>			
テルモ	41.8	45.4	232,221
クリエートメディック	0.5	0.4	395
日機装	4.7	4.4	4,523
日本エム・ディ・エム	0.8	0.9	1,980
島津製作所	17.6	19.1	89,674
JMS	1.2	1.2	907
長野計器	1.1	1	1,349
ブイ・テクノロジー	0.7	0.7	3,003
東京計器	0.9	1	1,014
愛知時計電機	0.2	0.2	943
インターアクション	0.8	0.7	1,710
オーバル	1.3	1.3	328
東京精密	2.7	2.5	11,412
マニー	5.9	5.9	11,687
ニコン	22.4	22.6	28,204
トプコン	7.4	7.5	14,865
オリンパス	81.7	77.8	196,445

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
理研計器	1.3	1.3	4,108
タムロン	1.2	1.1	2,900
HOYA	29.3	28.9	499,392
シード	0.6	0.6	393
ノーリツ鋼機	1	1.3	3,139
エー・アンド・デイ	1.3	1.2	1,249
朝日インテック	16.7	16.2	48,454
シチズン時計	17.2	18.8	9,757
リズム	0.5	0.5	687
大研医器	1.1	1.2	696
メニコン	2.1	4.6	19,090
シンシア	0.2	0.2	120
松風	0.7	0.7	1,582
セイコーホールディングス	2.1	2.1	5,050
ニプロ	10.2	11	12,672
<b>その他製品 (2.1%)</b>			
中本パックス	0.3	0.3	519
スノーピーク	0.9	0.9	5,220
パラマウントベッドホールディングス	1.5	2.8	6,073
トランザクション	0.7	0.7	769
粧美堂	0.4	0.4	163
ニホンフラッシュ	1.3	1.2	1,326
前田工織	1.6	1.6	5,216
永大産業	1.8	1.6	470
アートネイチャー	1.5	1.3	960
バンダイナムコホールディングス	15.3	12.2	106,225
アイフィスジャパン	0.4	0.3	208
共立印刷	2.8	1.8	316
SHOEI	1.3	1.4	7,140
フランスベッドホールディングス	2.1	1.8	1,630
パイロットコーポレーション	2.6	2.5	10,487
萩原工業	0.8	0.9	1,367
トッパン・フォームズ	3.1	2.5	2,707
フジシールインターナショナル	3.3	3	7,581
タカラトミー	6.5	6.5	7,117
広済堂ホールディングス	0.9	1	1,029
エステールホールディングス	0.5	0.3	200
タカノ	0.7	0.4	306
プロネクサス	1.2	1.1	1,217
ホクシン	0.7	0.7	143
ウッドワン	0.5	0.4	459

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大建工業	1	0.9	2,223
凸版印刷	20.7	22.4	41,843
大日本印刷	19.3	17.5	49,192
共同印刷	0.4	0.4	1,046
N I S S H A	2.9	3	5,427
光村印刷	0.1	0.1	155
TAKARA & COMPANY	0.7	0.7	1,243
アシックス	13	13	37,258
ツツミ	0.4	0.3	658
ローランド	—	1	5,100
小松ウオール工業	0.4	0.4	771
ヤマハ	8.8	8.8	63,888
河合楽器製作所	0.4	0.4	1,454
クリナップ	1.3	1.2	654
ビジョン	9.5	8.9	22,659
オリバー	0.3	—	—
兼松サステック	0.1	0.1	180
キングジム	1.1	1.1	958
リントック	3.5	3.1	7,753
イトーキ	2.7	2.5	935
任天堂	9.1	8.6	422,690
三菱鉛筆	2.4	2.4	3,304
タカラスタンダード	3	3	4,641
コクヨ	7	7	12,194
ナカバヤシ	1.4	1.3	747
グローブライド	0.6	1.4	5,957
オカムラ	5.1	5	7,415
美津濃	1.3	1.4	3,725
<b>電気・ガス業 (1.1%)</b>			
東京電力ホールディングス	117.7	125.7	42,360
中部電力	45.1	45.3	58,391
関西電力	55.9	56.1	60,055
中国電力	21.3	21.4	21,186
北陸電力	13.5	13.5	7,857
東北電力	36.8	34.7	26,649
四国電力	13.3	12.3	9,446
九州電力	30.4	32.7	27,337
北海道電力	13.8	13.8	7,189
沖縄電力	2.9	2.9	4,115
電源開発	11.7	11.8	18,360
エフオン	0.8	0.9	773

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イーレックス	2.1	2.2	5,944
レノバ	2.5	2.5	12,000
東京瓦斯	28.4	28.5	53,309
大阪瓦斯	28.6	26.8	50,276
東邦瓦斯	7.3	7.3	25,805
北海道瓦斯	0.8	0.8	1,211
広島ガス	3	3.1	1,150
西部ガスホールディングス	1.7	1.7	3,938
静岡ガス	4.2	3.9	4,808
メタウォーター	1.4	1.7	3,063
<b>陸運業 (3.2%)</b>			
SBSホールディングス	1.1	1.1	4,444
東武鉄道	15.4	15.5	44,190
相鉄ホールディングス	4.7	5.1	11,281
東急	37.2	37.4	60,101
京浜急行電鉄	19	19	24,396
小田急電鉄	21.9	23.7	58,752
京王電鉄	7.7	8.3	47,974
京成電鉄	10.3	11.1	41,070
富士急行	2	2	9,170
東日本旅客鉄道	26	26.1	190,034
西日本旅客鉄道	13.2	16.5	88,489
東海旅客鉄道	12.3	12.3	209,223
西武ホールディングス	19.3	17.9	22,518
鴻池運輸	2.4	2.4	2,990
西日本鉄道	4.1	4.1	11,402
ハマキョウレックス	1.1	1.1	3,652
サカイ引越センター	0.8	0.7	3,314
近鉄グループホールディングス	14	14	50,330
阪急阪神ホールディングス	18.6	18.7	65,543
南海電気鉄道	6.6	6.7	15,255
京阪ホールディングス	6.2	6.3	19,215
神戸電鉄	0.3	0.3	1,033
名古屋鉄道	11.5	11.6	22,341
山陽電気鉄道	1	1	1,955
アルプス物流	—	1	1,042
日本通運	4.8	4.9	36,309
ヤマトホールディングス	24.5	19.7	56,302
山九	3.9	3.6	18,756
丸運	1	0.9	243
丸全昭和運輸	1.1	1.1	3,751

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
センコーグループホールディングス	7.7	7.8	8,010
トナミホールディングス	0.3	0.3	1,381
ニッコンホールディングス	5	4.7	10,565
日本石油輸送	0.2	0.2	540
福山通運	1.8	1.8	8,442
セイノーホールディングス	10.5	10.5	14,469
エスライン	0.5	0.4	360
神奈川中央交通	0.3	0.4	1,390
日立物流	2.6	2.9	14,108
丸和運輸機関	1.5	3	4,770
C&Fロジホールディングス	1.4	1.4	2,366
九州旅客鉄道	12.3	10.9	27,914
Sホールディングス	14.7	26.5	76,055
<b>海運業 (0.5%)</b>			
日本郵船	11.7	11.7	94,536
商船三井	8.8	8.4	57,708
川崎汽船	4.3	4.4	24,024
N Sユナイテッド海運	0.8	0.7	2,747
明治海運	1.6	—	—
飯野海運	6.7	6.9	3,808
共栄タンカー	0.2	—	—
乾汽船	0.8	1	2,347
<b>空運業 (0.5%)</b>			
日本航空	24.7	34.2	83,995
ANAホールディングス	25.6	37.9	101,572
バスコ	0.3	0.2	297
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
トランコム	0.4	0.4	3,228
日新	1.2	1.1	1,822
三菱倉庫	4.4	4.8	15,648
三井倉庫ホールディングス	1.6	1.5	3,460
住友倉庫	5	5	9,295
澁澤倉庫	0.8	0.8	1,706
東陽倉庫	2.5	2.3	754
日本トランスシティ	3.1	3	1,794
ケイヒン	0.3	0.3	427
中央倉庫	0.8	0.9	878
川西倉庫	0.3	0.3	350
安田倉庫	1.1	1.2	1,165
ファイズホールディングス	0.3	0.3	205
東洋埠頭	0.4	0.4	582

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宇徳	1.2	1	532
上組	7.8	7.7	17,994
サンリツ	0.3	0.4	322
キムラユニティー	0.4	0.4	555
キューソー流通システム	0.4	0.3	577
近鉄エクスプレス	2.9	2.7	7,465
東海運	0.8	0.8	265
エアイティー	1	0.9	1,017
内外トランスライン	0.5	0.5	1,136
日本コンセプト	0.4	0.5	877
<b>情報・通信業 (8.6%)</b>			
NECネットエスアイ	4.1	4.8	9,936
クロスキャット	0.4	0.4	506
システナ	5.2	5.2	10,987
デジタルアーツ	0.7	0.8	7,760
日鉄ソリューションズ	2.2	2.1	7,885
キューブシステム	0.8	0.8	804
WOW WORLD	0.3	0.2	366
コア	0.6	0.6	981
ラクーンホールディングス	0.7	1	1,555
ソリトンシステムズ	0.7	0.7	1,004
ソフトクリエイトホールディングス	0.6	0.6	2,304
T I S	14.5	14.5	44,732
J N Sホールディングス	0.6	0.8	420
電算システム	0.5	—	—
グリー	8.9	8.9	8,481
GMOベバボ	—	0.2	543
コーエーテックモホールディングス	3	3.9	20,787
三菱総合研究所	0.6	0.6	2,529
ボルテージ	0.4	0.4	184
電算	0.2	0.2	484
AGS	0.9	0.8	720
ファインデックス	1.3	1.2	1,144
ブレインパッド	0.4	0.4	2,160
K L a b	2.7	2.7	1,768
ポールトゥウィン・ピットクルーHD	1.8	2	2,054
イーブクイニシアティブジャパン	0.2	0.2	958
ネクソン	36.6	32.7	66,315
アイスタイル	4.2	4.5	1,854
エムアップホールディングス	0.4	0.4	1,428
エイチーム	1	1	1,608

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エニグモ	1.4	1.4	1,569
テクノスジャパン	1.2	1.2	704
e n i s h	—	0.9	378
コプロラ	4.8	4.8	3,878
ブロードリーフ	7.3	7.3	4,058
クロス・マーケティンググループ	0.7	0.6	510
デジタルハーツホールディングス	0.8	0.7	1,320
システム情報	1.1	1.1	1,021
メディアドゥ	0.5	0.6	2,580
じげん	3.7	3.6	1,436
ブイキューブ	0.8	1.5	2,701
エンカレッジ・テクノロジー	0.3	0.3	181
サイバーリンクス	0.3	0.5	639
フィックスターズ	1.6	1.6	1,219
CARTA HOLDINGS	0.6	0.6	1,464
オプティム	0.8	1	1,838
セレス	0.5	0.5	1,525
S H I F T	0.6	0.7	17,626
ティーガイア	1.3	1.6	3,297
セック	0.2	0.2	457
日本アジアグループ	1.6	—	—
テクマトリックス	2	2.2	4,050
プロシップ	0.5	0.5	841
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3.5	3.9	8,478
GMOペイメントゲートウェイ	3.1	2.8	40,376
ザッパラス	0.7	0.6	339
システムリサーチ	0.4	0.4	786
インターネットイニシアティブ	2.1	3.9	15,561
さくらインターネット	1.6	1.6	961
ヴィンクス	0.4	0.4	398
GMOグローバルサイン・ホールディングス	0.3	0.3	1,365
S R Aホールディングス	0.8	0.8	2,289
システムインテグレータ	0.5	0.4	247
朝日ネット	1.1	1.2	840
e B A S E	1.8	1.8	1,386
アバント	1.4	1.6	2,596
アドソル日進	0.5	0.5	1,059
ODKソリューションズ	—	0.3	212
フリービット	0.8	0.9	1,178
コムチュア	1.6	1.3	3,978
サイバーコム	0.3	0.2	251

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アステリア	1	1.1	781
アイル	0.8	0.8	1,355
マークラインズ	0.6	0.7	2,177
メディカル・データ・ビジョン	1.7	1.8	2,664
gumi	1.9	2	1,892
ショーケース	0.3	0.4	235
モバイルファクトリー	0.4	0.4	409
テラスカイ	0.5	0.5	1,060
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.6	0.6	1,023
PC Iホールディングス	0.6	0.7	731
パイブドHD	0.2	0.3	963
アイビーシー	0.2	0.3	275
ネオジャパン	0.3	0.3	393
PR TIMES	0.3	0.3	1,114
ラクス	—	4.4	15,356
ランドコンピュータ	0.2	0.3	247
ダブルスタンダード	0.2	0.4	1,506
オーブントア	0.7	0.9	2,247
マイネット	0.5	0.5	337
アカツキ	0.5	0.6	1,905
ベネフィットジャパン	0.1	0.1	270
Ubicomホールディングス	0.3	0.4	1,132
LINE	3.3	—	—
カナミックネットワーク	1.4	1.6	984
ノムラシステムコーポレーション	0.7	0.8	232
チェンジ	1	2.7	5,626
シンクロ・フード	0.7	0.9	355
オークネット	0.8	0.8	1,861
キャピタル・アセット・プランニング	—	0.3	267
セグエグループ	0.4	—	—
エイトレッド	0.3	0.3	735
AOI TYO Holdings	1.6	—	—
マクロミル	3	3	2,433
ビーグリー	0.3	0.4	632
オロ	0.5	0.5	1,855
ユーザーローカル	0.2	0.4	717
テモナ	0.3	0.3	224
マネーフォワード	—	2.2	16,764
サインポスト	0.3	0.4	747
電算システムホールディングス	—	0.6	1,511
ソルクシーズ	0.6	1.2	644

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フェイス	0.6	0.5	351
プロトコーポレーション	1.3	1.7	2,614
ハイマックス	0.4	0.4	484
野村総合研究所	20.6	25.2	105,210
サイバネットシステム	1.1	1.1	697
CEホールディングス	0.8	0.8	433
日本システム技術	0.2	0.3	618
インテージホールディングス	1.9	1.8	3,389
東邦システムサイエンス	0.4	0.4	411
ソースネクスト	7.1	7	1,435
インフォコム	1.6	1.3	3,100
HEROZ	0.2	0.4	722
ラクスル	1.2	1.6	9,904
IPS	—	0.4	765
FIG	1.7	1.7	537
システムサポート	0.3	0.4	537
イーソル	0.8	0.9	764
アルテリア・ネットワークス	1.6	1.6	2,585
Edulab	—	0.1	168
東海ソフト	0.1	0.2	240
ウイングアーク1st	—	0.8	1,649
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	0.3	0.3	663
サーバーワークス	—	0.1	463
東名	—	0.2	260
ヴィッツ	—	0.1	165
トビラシステムズ	0.1	0.3	337
Sansan	—	1.3	16,003
Link-U	—	0.3	381
ギフトィ	—	1.3	5,141
ベース	—	0.2	903
フォーカスシステムズ	0.9	1	1,022
クレスコ	0.9	1	2,017
フジ・メディア・ホールディングス	13.9	15.1	17,893
オービック	5	4.6	99,176
ジャストシステム	2.4	2.1	12,390
TDCソフト	1.3	1.3	1,696
Zホールディングス	199	199.6	137,344
トレンドマイクロ	7.7	7.8	50,310
IDホールディングス	0.6	0.9	839
日本オラクル	2.9	2.9	31,204
アルファシステムズ	0.5	0.4	1,676

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フューチャー	1.8	1.5	4,261
CAC Holdings	1	0.9	1,493
SBテクノロジ	0.5	0.5	1,433
トーセ	0.4	0.4	311
オービックビジネスコンサルタント	1.5	1.4	8,162
伊藤忠テクノソリューションズ	6.6	6.6	23,859
アイティフォー	1.8	1.9	1,700
東計電算	0.2	0.2	938
エクスネット	0.2	0.3	305
大塚商会	7.8	7.9	45,267
サイボウズ	1.7	1.9	4,993
ソフトブレイン	1.2	—	—
電通国際情報サービス	0.9	2.1	8,494
ACCESS	1.4	1.9	1,711
デジタルガレージ	2.6	2.4	12,168
EMシステムズ	2.1	2.4	1,797
ウェザーニューズ	0.5	0.4	3,340
C I J	1	1	851
ビジネスエン지니어リング	0.2	0.1	347
日本エンタープライズ	1.6	1.5	300
WOWOW	0.7	0.7	1,596
スカラ	1	1.3	912
インテリジェント ウェイブ	0.9	0.9	547
IMAGICA GROUP	1.3	1.3	663
ネットワンシステムズ	5.5	5.9	23,039
システムソフト	3.3	3.1	452
アルゴグラフィックス	1.2	1.1	3,443
マーベラス	2.3	2.3	1,642
エイベックス	2.5	2.5	3,820
日本ユニシス	4.5	5	15,875
兼松エレクトロニクス	0.8	0.8	2,940
都築電気	0.5	0.7	1,234
TBSホールディングス	8.8	9.6	17,385
日本テレビホールディングス	12.1	12.1	15,125
朝日放送グループホールディングス	1.5	1.5	1,072
テレビ朝日ホールディングス	4	4.5	7,866
スカパーJ SATホールディングス	9.5	9.7	4,190
テレビ東京ホールディングス	1.2	1	2,203
日本BS放送	0.5	0.5	552
ビジョン	1.9	2.5	3,660
スマートバリュー	0.4	0.4	245

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
USEN-NEXT HOLDINGS	0.6	1.4	4,697
コネクシオ	0.8	0.8	1,285
日本通信	—	12.9	2,605
クロップス	0.3	0.3	292
日本電信電話	193.6	170	555,390
KDDI	105.6	116.6	429,088
ソフトバンク	131.7	132.1	202,839
光通信	1.5	1.7	30,430
NTTドコモ	103.6	—	—
エムティーアイ	1.4	1.4	1,010
GMOインターネット	5.2	5.1	15,708
アイドママーケティングコミュニケーション	0.4	0.4	153
KADOKAWA	3.9	3.8	22,002
学研ホールディングス	2	2	2,248
ゼンリン	2.9	2.6	2,675
昭文社ホールディングス	0.7	0.6	295
インプレスホールディングス	1.3	1.2	315
アイネット	0.8	0.8	1,046
松竹	1	1	12,510
東宝	8.5	8.6	46,526
東映	0.5	0.5	11,440
エヌ・ティ・ティ・データ	38.6	38.7	87,191
ビー・シー・エー	0.3	0.6	1,061
ビジネスブレイン太田昭和	0.5	0.5	921
DTS	3.2	3	7,671
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6.2	6.2	40,672
シーイーシー	1.6	1.6	2,176
カブコン	6.8	12.5	43,312
アイ・エス・ピー	0.3	0.7	875
ジャステック	1	0.9	1,171
SCSK	3.3	10.2	23,470
日本システムウエア	0.5	0.5	1,240
アイネス	1.5	1.4	2,300
TKC	1.2	2.5	8,662
富士ソフト	1.5	1.6	9,104
NSD	4.7	4.7	9,635
コナミホールディングス	5.3	5.3	35,139
福井コンピュータホールディングス	0.6	0.7	2,877
JBCホールディングス	1	1	1,603
ミロク情報サービス	1.3	1.4	2,450
ソフトバンクグループ	114.9	115.4	750,100

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>卸売業 (4.9%)</b>			
ハウスイ	0.2	0.2	184
高千穂交易	0.6	0.6	720
オルパヘルスケアホールディングス	0.2	0.3	495
伊藤忠食品	0.4	0.4	2,092
エレマテック	1.4	1.2	1,369
JALUX	0.4	0.5	859
あらた	1.2	1.2	4,848
トーマンデバイス	0.2	0.2	1,124
東京エレクトロン デバイス	0.5	0.5	3,695
フィールズ	1.2	1.4	723
双日	80.4	16.1	30,718
アルフレッサ ホールディングス	16.2	15.2	24,304
横浜冷凍	3.9	4.1	3,554
神栄	0.3	0.2	203
ラサ商事	0.8	0.9	844
アルコニックス	1.6	1.6	2,755
神戸物産	5	11.3	42,205
ハイパー	0.3	0.5	276
あい ホールディングス	2.1	2.1	4,449
ディーブイエックス	0.6	0.5	556
ダイワボウホールディングス	1.2	6.7	13,339
マクニカ・富士エレホールディングス	3.5	3.5	9,166
ラクト・ジャパン	0.6	0.5	1,373
グリムス	—	0.4	1,086
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.8	2.6	1,996
八洲電機	1.2	1.2	1,146
メディアスホールディングス	0.9	0.9	801
レスターホールディングス	1.5	1.5	2,899
ジュアテックホールディングス	0.4	0.4	464
大光	0.7	0.6	424
OCHIホールディングス	0.5	0.5	629
TOKAIホールディングス	7.7	7.1	6,248
黒谷	0.5	0.5	350
Cominix	0.3	0.3	221
三洋貿易	1.5	1.5	1,663
ビューティガレージ	0.3	0.2	793
ウイン・パートナーズ	1.1	1.1	1,060
ミタチ産業	0.5	0.5	509
シップヘルスケアホールディングス	2.3	5.2	14,908
明治電機工業	0.5	0.6	813

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デリカフーズホールディングス	0.6	0.7	431
スターティアホールディングス	0.4	0.3	428
コマダホールディングス	3.2	3.2	6,544
ピーバンドットコム	0.2	0.3	204
アセンテック	0.4	0.4	533
富士興産	0.5	0.5	526
協栄産業	0.2	0.2	291
フルサト・マルカホールディングス	—	1.4	2,793
ヤマエグループホールディングス	—	1.1	1,222
小野建	1.3	1.3	2,185
南陽	0.4	0.3	605
佐島電機	1.1	1	1,018
エコートレーディング	0.4	0.4	255
伯東	0.9	0.9	1,716
コンドレーテック	1.2	1.2	1,182
中山福	0.9	1	407
ナガイレーバン	1.9	2	4,670
三菱食品	1.6	1.6	4,720
松田産業	1.1	1.1	3,943
第一興商	2.2	2.8	11,648
メディバルホールディングス	15.7	14.7	30,914
S PK	0.6	0.7	990
萩原電気ホールディングス	0.6	0.6	1,267
アズワン	0.9	1.1	17,127
スズデン	0.5	0.5	829
シモジマ	0.9	0.9	1,021
ドウシシャ	1.4	1.4	2,466
小津産業	0.3	0.3	578
高速	0.9	0.8	1,250
たけびし	0.5	0.5	750
リックス	0.4	0.4	595
丸文	1.4	1.3	1,015
ハビネット	1.3	1.3	1,926
橋本総業ホールディングス	0.3	0.3	643
日本ライフライン	4.3	4.7	5,893
タカショー	1	1	824
マルカ	0.5	—	—
IDOM	4	5	3,990
進和	0.9	0.9	1,969
エスケイジャパン	0.5	0.5	256
ダイトロン	0.6	0.6	1,367

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シークス	1.9	2.1	2,625
田中商事	0.5	0.5	330
オーハシテクニカ	0.8	0.8	1,197
白銅	0.6	0.5	1,490
ダイコー通産	0.1	0.2	231
伊藤忠商事	99.2	99.7	322,330
丸紅	151.5	143.9	139,712
高島	0.3	0.3	570
長瀬産業	8.2	8	15,312
蝶理	1	1	1,889
豊田通商	16.2	14.7	74,235
三共生興	2.3	2.3	1,331
兼松	5.4	5.9	7,929
ツカモトコーポレーション	0.3	0.3	410
三井物産	125.9	113.4	296,881
日本紙パルプ商事	0.8	0.8	3,020
カメイ	1.9	1.9	2,238
東都水産	0.2	0.2	1,392
OUGホールディングス	0.2	0.3	840
スターゼン	0.6	1.1	2,332
山善	5.7	5.7	6,053
椿本興業	0.3	0.3	1,167
住友商事	91.8	92.1	150,445
内田洋行	0.6	0.6	2,901
三菱商事	95.4	88.8	322,166
第一実業	0.7	0.7	3,661
キャノンマーケティングジャパン	3.6	3.6	8,265
西華産業	0.8	0.8	1,320
佐藤商事	1.2	1.2	1,425
菱洋エレクトロ	1.5	1.1	2,602
東京産業	1.4	1.4	1,002
ユアサ商事	1.4	1.5	4,590
神鋼商事	0.4	0.3	1,018
トルク	1	1	231
阪和興業	2.7	2.9	10,019
正栄食品工業	0.9	1	4,050
カナデン	1.2	1.2	1,226
菱電商事	1.1	1.1	1,981
フルサト工業	0.8	—	—
岩谷産業	3.3	3.5	23,485
ナイス	0.7	0.6	1,105

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
昭光通商	0.5	—	—
ニチモウ	0.2	0.3	597
極東貿易	0.4	0.4	1,028
アステナホールディングス	2	2.1	1,188
三愛石油	3.7	3.6	5,443
稲畑産業	3.2	3.5	5,904
G S Iクレオス	0.4	0.8	814
明和産業	1.5	1.4	1,183
クワザワホールディングス	0.6	0.6	379
ヤマエ久野	1.1	—	—
ワキタ	3.2	2.9	2,984
東邦ホールディングス	4.7	4.7	8,577
サンゲツ	3.9	3.9	6,165
ミツウロコグループホールディングス	2.2	2.2	3,229
シナネンホールディングス	0.6	0.6	2,088
伊藤忠エネクス	3.3	3.3	3,366
サンリオ	4.1	4.1	10,639
サンワテクノス	1.1	1	1,526
リョーサン	1.6	1.6	3,731
新光商事	2.2	2	1,800
トーホー	0.7	0.7	1,079
三信電気	0.8	0.8	1,316
東陽テクニカ	1.6	1.5	1,654
モスフードサービス	1.9	2.1	6,531
加賀電子	1.5	1.3	4,017
ソーダニッカ	1.6	1.5	948
立花エレテック	1.1	1.1	1,746
フォーバル	0.7	0.6	715
PALTAC	2.3	2.4	12,384
三谷産業	2.1	2.1	777
太平洋興発	0.6	0.7	480
西本Wismettacホールディングス	0.3	0.3	1,174
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.2	0.2	399
コア商事ホールディングス	0.1	1.2	811
国際紙パルプ商事	3.6	3.2	1,180
ヤマタネ	0.7	0.7	1,129
丸紅建材リース	0.2	0.2	374
日鉄物産	1.1	1	5,100
泉州電業	0.4	0.4	1,902
トラスコ中山	3.3	3.1	8,515
オートバックスセブン	5.4	5.3	8,103

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モリト	1.1	1.2	829
加藤産業	2.1	2.1	6,720
北恵	0.4	0.4	400
イノテック	0.8	0.9	1,257
イエローハット	2.8	2.8	5,412
J Kホールディングス	1.4	1.4	1,232
日伝	1.3	1.2	2,714
北沢産業	1.2	1.2	300
杉本商事	0.8	0.7	1,720
因幡電機産業	4.1	3.9	10,662
東テク	0.5	0.5	1,329
ミスミグループ本社	18.2	18.3	88,297
アルテック	1.1	1.2	382
タキヒヨー	0.5	0.5	885
蔵王産業	0.3	0.3	529
スズケン	6.2	6.2	19,654
ジェコス	1	1.1	960
グローセル	1.6	1.8	729
<b>小売業 (4.3%)</b>			
ローソン	3.7	3.7	20,091
サンエー	1.2	1.1	4,493
カワチ薬品	1.1	1	2,174
エービーシー・マート	2.3	2.3	12,627
ハードオフコーポレーション	0.6	0.7	543
アスクル	1.5	2.4	3,897
ゲオホールディングス	2.6	2	2,402
アダストリア	2	2	4,072
ジーフット	1	1	399
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	0.3	0.4	162
くら寿司	0.9	1.5	5,400
キャンドゥ	0.7	0.7	1,784
アイケイ	—	0.5	260
バルグループホールディングス	1.5	1.3	2,042
エディオン	6.7	6.2	6,683
サーラコーポレーション	3	3	1,848
ワッツ	0.7	0.8	600
ハローズ	0.6	0.6	1,638
フジオフードグループ本社	1.2	1.2	1,626
あみやき亭	0.3	0.3	921
ひらまつ	2.9	2.9	614
大黒天物産	0.4	0.5	3,160

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハニーズホールディングス	1.3	1.2	1,256
ファーマライズホールディングス	0.4	0.4	330
アルペン	1.1	1.1	3,096
ハブ	0.4	0.5	373
クオールホールディングス	2.2	2	3,396
ジンズホールディングス	0.8	1	7,230
ビックカメラ	8.6	8.7	8,578
DCMホールディングス	8.8	9	10,269
Monotaro	10.3	18.5	48,562
東京一番フーズ	0.4	0.5	293
きちりホールディングス	0.4	—	—
アークランドサービスホールディングス	1.2	1.1	2,475
J. フロント リテイリング	17.4	17.4	18,409
ドトール・日レスホールディングス	2.1	2.3	3,795
マツキヨココカラ&カンパニー	6	8.2	40,918
プロンコビリー	0.8	0.9	2,145
ZOZO	10	8.6	35,948
トレジャー・ファクトリー	0.4	0.5	442
物語コーポレーション	0.4	0.8	5,760
ココカラファイン	1.5	—	—
三越伊勢丹ホールディングス	25.5	25.5	21,241
Hamee	0.5	0.4	525
マーケットエンタープライズ	—	0.2	147
ウエルシアホールディングス	8.6	7.7	32,763
クリエイトSDホールディングス	2.5	2.2	7,865
丸善CHIホールディングス	1.8	1.9	716
ミサワ	0.3	0.4	268
ティールライフ	0.2	0.2	284
チムニー	0.5	—	—
シュッピン	1.1	1	1,315
オイシックス・ラ・大地	1.4	1.9	9,139
ネクステージ	2.5	2.9	6,240
ジョイフル本田	4.3	4.3	6,832
鳥貴族ホールディングス	0.4	0.6	1,158
キリン堂ホールディングス	0.6	—	—
ホットランド	1.1	1.1	1,491
すかいらーくホールディングス	16.3	18.8	28,632
SFPホールディングス	0.8	0.7	1,052
綿半ホールディングス	1.1	1.1	1,320
ヨシックスホールディングス	0.2	0.3	629
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4.2	4.2	4,363

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	0.8	1,030
BEENOS	0.7	0.7	2,299
あさひ	1.1	1.1	1,456
日本調剤	0.9	0.9	1,476
コスモス薬品	1.3	1.5	26,280
トーエル	0.7	0.7	571
オンリー	0.3	0.3	227
セブン&アイ・ホールディングス	56.9	57.1	273,965
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7.8	7.8	6,793
ツルハホールディングス	3.2	3.2	44,512
サンマルクホールディングス	1.2	1.2	1,814
フェリシモ	0.3	0.3	421
トリドールホールディングス	3.6	3.6	9,856
TOKYO BASE	1.4	1.4	1,024
ウイルプラスホールディングス	0.2	0.3	328
JMホールディングス	1.1	1	1,860
サツドラホールディングス	0.2	0.2	448
アレンザホールディングス	0.7	1.1	1,311
串カツ田中ホールディングス	0.4	0.4	888
パロックジャパンリミテッド	1	1	845
クスリのアオキホールディングス	1.3	1.5	11,250
力の源ホールディングス	0.7	—	—
FOOD & LIFE COMPANIES	8	8.5	41,692
メディカルシステムネットワーク	1.5	1.3	941
はるやまホールディングス	0.7	0.7	401
ノジマ	2.6	2.6	7,423
カッパ・クリエイト	2.1	2.1	2,866
ライトオン	1.1	1.2	840
ジーンズメイト	0.6	—	—
良品計画	19.3	16.8	37,699
三城ホールディングス	1.6	1.9	494
アドヴァングループ	2.3	1.5	1,420
アルビス	0.6	0.5	1,162
コナカ	1.9	1.8	599
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.2	331
G-7ホールディングス	0.9	1.4	3,067
イオン北海道	1.9	1.9	2,352
コジマ	2.6	2.5	1,457
ヒマラヤ	0.6	0.6	636
コーナン商事	2.1	2.1	7,644
エコス	0.5	0.6	1,120

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワタミ	1.7	—	—
マルシェ	0.4	—	—
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	32	29.2	69,671
西松屋チェーン	3.2	3.2	4,649
ゼンショーホールディングス	7	7.8	20,334
幸楽苑ホールディングス	0.9	0.9	1,307
ハークスレイ	0.3	0.8	379
サイゼリヤ	2.2	2.2	6,666
VTホールディングス	6.2	5.5	2,827
魚力	0.4	0.5	1,017
フジ・コーポレーション	0.4	0.8	970
ユナイテッドアローズ	1.5	1.7	3,932
ハイデイ日高	2.1	2.1	3,395
YU-WA Creation Holdings	1	1.2	294
コロワイド	4.8	4.9	8,006
ピーシーデポコーポレーション	1.9	1.9	855
壺番屋	1	1	4,515
P L A N T	0.4	0.5	361
スギホールディングス	2.9	2.9	23,722
薬王堂ホールディングス	0.6	0.6	1,501
スクロール	2.3	2.1	1,852
ヨンドシーホールディングス	1.5	1.3	2,264
ファミリーマート	11.6	—	—
木曽路	1.9	1.9	4,007
SRSホールディングス	1.7	2	1,512
千趣会	2.7	2.7	1,055
タカキュー	1.3	—	—
リテールパートナーズ	1.9	1.8	2,167
ケーヨー	3	2.7	2,216
上新電機	1.7	1.7	4,098
日本瓦斯	2.3	7.1	9,876
ロイヤルホールディングス	2.5	2.5	5,050
東天紅	0.1	0.2	218
いなげや	1.8	1.6	2,152
島忠	2.7	—	—
チヨダ	1.6	1.5	1,153
ライフコーポレーション	1.1	1.4	5,285
リンガーハット	1.8	1.8	3,929
M r M a x H D	2	2	1,210
テンアライド	1.5	—	—
A O K I ホールディングス	2.9	2.9	1,972

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オークワ	2.3	2.3	2,527
コメリ	2.3	2.3	6,258
青山商事	3	3.3	2,623
しまむら	1.7	1.7	16,558
はせがわ	0.4	1	263
高島屋	10.6	10.6	11,511
松屋	3	3.3	3,636
エイチ・ツー・オー リテイリング	6.9	6.9	6,354
近鉄百貨店	0.6	0.6	1,551
丸井グループ	13.3	12.3	27,822
アクシアル リテイリング	1.2	1.2	4,296
イオン	56	56.1	147,879
イズミ	3	3	10,755
平和堂	3	2.7	5,310
フジ	1.8	1.8	3,632
ヤオコー	1.7	1.7	11,237
ゼビオホールディングス	1.8	1.8	1,908
ケーズホールディングス	14	12.4	14,793
Olympicグループ	0.8	0.8	569
日産東京販売ホールディングス	2.3	2.3	570
シルバーライフ	0.2	0.3	423
Genky DrugStores	0.6	0.6	3,282
ナルミヤ・インターナショナル	0.4	0.3	327
ブックオフグループホールディングス	0.9	0.9	882
ギフト	—	0.2	542
アインホールディングス	1.8	2.1	14,154
元気寿司	0.4	0.4	1,079
ヤマダホールディングス	44.3	48.9	21,907
アークランドサカモト	2.3	2.3	3,946
ニトリホールディングス	6.3	5.8	120,292
愛眼	1.2	1.4	308
ケーユーホールディングス	0.8	0.8	828
吉野家ホールディングス	4.8	4.8	10,382
松屋フーズホールディングス	0.7	0.7	2,541
サガミホールディングス	2	2.2	2,189
関西スーパーマーケット	1.2	1.1	2,013
王将フードサービス	1.1	1	5,910
ブレナス	1.6	1.7	3,306
ミニストップ	1.1	1.1	1,510
アークス	3	2.8	6,129
パローホールディングス	3.2	3	7,224

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
藤久	0.4	0.4	311
ベルク	0.7	0.7	3,850
大庄	0.8	0.8	808
ファーストリテイリング	1.9	2	147,060
サンドラッグ	5.5	5.5	18,810
サックスパー ホールディングス	1.3	1.3	720
ヤマザワ	0.4	0.4	687
やまや	0.3	0.3	724
ペルーナ	3.2	3.2	2,592
<b>銀行業 (4.9%)</b>			
島根銀行	0.4	0.5	290
じもとホールディングス	1	1	641
めぶきフィナンシャルグループ	75.6	75.9	17,836
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2	1.8	2,653
九州フィナンシャルグループ	31.8	29.8	11,443
ゆうちょ銀行	41.2	41.4	37,301
富山第一銀行	3.5	3.5	1,039
コンコルディア・フィナンシャルグループ	83.1	89.1	41,431
西日本フィナンシャルホールディングス	9.6	9.5	6,526
関西みらいフィナンシャルグループ	8.6	—	—
三十三フィナンシャルグループ	1.3	1.3	1,788
第四北越フィナンシャルグループ	2.5	2.4	6,136
ひろぎんホールディングス	21.4	21.5	13,609
おきなわフィナンシャルグループ	—	1.3	3,200
十六フィナンシャルグループ	—	1.8	3,726
北國フィナンシャルホールディングス	—	1.4	2,776
新生銀行	10.7	11.9	22,788
あおぞら銀行	8.7	8.7	23,046
三菱UFJフィナンシャル・グループ	995.9	999.6	639,943
りそなホールディングス	158.2	162.9	71,447
三井住友トラスト・ホールディングス	27.5	27.6	106,039
三井住友フィナンシャルグループ	100.7	101.1	385,089
千葉銀行	48.6	48.8	35,575
群馬銀行	27.9	30.1	10,866
武蔵野銀行	2.2	2.2	3,905
千葉興業銀行	4	3.7	999
筑波銀行	6	6.1	1,061
七十七銀行	4.9	4.6	5,497
青森銀行	1.1	1.1	2,203
秋田銀行	0.9	0.9	1,282
山形銀行	1.6	1.7	1,405

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岩手銀行	1	1	1,648
東邦銀行	13.1	13.1	2,659
東北銀行	0.7	0.7	699
みちのく銀行	0.9	1	878
ふくおかフィナンシャルグループ	12.3	13.2	27,865
静岡銀行	35.4	35.6	33,179
十六銀行	1.8	—	—
スルガ銀行	14.8	12.8	5,452
八十二銀行	35.1	32.9	12,765
山梨中央銀行	1.7	1.7	1,402
大垣共立銀行	2.9	2.9	5,553
福井銀行	1.3	1.3	1,866
北國銀行	1.4	—	—
清水銀行	0.6	0.6	933
富山銀行	0.3	0.3	623
滋賀銀行	2.9	2.9	5,333
南都銀行	2.4	2.1	4,101
百五銀行	13	13.2	4,250
京都銀行	5.2	5.2	27,040
紀陽銀行	5.1	5.2	7,815
ほくほくフィナンシャルグループ	9.7	9.7	8,177
山陰合同銀行	8.6	9.2	5,253
中国銀行	12.5	12.6	10,508
鳥取銀行	0.5	0.5	558
伊予銀行	20.7	19.4	10,825
百十四銀行	1.6	1.6	2,360
四国銀行	2.3	2.1	1,543
阿波銀行	2.4	2.2	4,730
大分銀行	0.8	0.8	1,496
宮崎銀行	1	0.9	1,836
佐賀銀行	0.9	0.8	1,163
沖縄銀行	1.3	—	—
琉球銀行	3.4	3.2	2,444
セブン銀行	48.6	48.8	11,760
みずほフィナンシャルグループ	197.8	198.5	301,918
高知銀行	0.5	0.6	465
山口フィナンシャルグループ	18.1	18.3	11,949
長野銀行	0.5	0.5	552
名古屋銀行	1.1	1.2	3,026
北洋銀行	21.8	22	5,324
愛知銀行	0.5	0.5	1,747

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中京銀行	0.6	0.6	814
大光銀行	0.5	0.5	667
愛媛銀行	2	2.1	1,617
トマト銀行	0.6	0.6	649
京葉銀行	6.3	6.3	2,727
栃木銀行	7	7	1,246
北日本銀行	0.5	0.5	777
東和銀行	2.6	2.6	1,318
福島銀行	1.4	1.7	408
大東銀行	0.8	0.7	476
トモニホールディングス	11.3	11.3	3,469
フィデアホールディングス	14.2	1.4	1,668
池田泉州ホールディングス	16.8	16.9	2,737
<b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	4.6	5	3,555
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	1.1	1,416
マーキュリアインベストメント	0.6	—	—
マーキュリアホールディングス	—	0.5	369
S B I ホールディングス	16.5	18	53,748
ジャフコ グループ	2.2	1.9	14,478
大和証券グループ本社	116.8	109.5	73,069
野村ホールディングス	256.3	222.9	124,199
岡三証券グループ	12.4	12.5	4,950
丸三証券	4.4	4.4	2,701
東洋証券	5.5	5.1	861
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	16.8	15.6	6,286
光世証券	0.4	0.4	232
水戸証券	4.2	4	1,192
いちよし証券	2.8	2.9	1,960
松井証券	8.3	7.2	5,839
マネックスグループ	10.8	13.1	10,466
極東証券	2	2	1,570
岩井コスモホールディングス	1.4	1.5	2,022
アイザワ証券グループ	2.7	2.6	2,880
マネーパートナーズグループ	1.6	1.7	436
スパークス・グループ	6.9	6.9	2,042
<b>保険業 (2.0%)</b>			
かんぽ生命保険	5.1	18.1	33,104
S O M P O ホールディングス	27.4	25.8	127,555
アニコム ホールディングス	4.8	4.1	3,636
M S & A D インシュアランスグループ ホールディングス	38.1	35.5	131,634

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一生命ホールディングス	82.4	71.9	176,514
東京海上ホールディングス	51.5	48.1	289,465
T&Dホールディングス	43.4	43.7	66,030
アドバンスクリエイト	0.3	0.7	728
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			
全国保証	4.1	3.8	20,482
あんしん保証	—	0.5	156
ジェイリース	0.4	0.5	1,063
イントラスト	0.5	0.4	315
日本モーゲージサービス	0.6	0.8	849
C a s a	0.5	0.4	365
アルビ	2.3	2.2	2,926
プレミアグループ	0.8	0.7	2,212
クレディセゾン	10.2	8.5	12,350
芙蓉総合リース	1.5	1.5	11,205
みずほリース	2.2	2.3	8,107
東京センチュリー	2.9	3.4	22,372
日本証券金融	6.5	6.2	5,400
アイフル	22.3	24.6	9,249
リコーリース	1.2	1.2	4,356
イオンフィナンシャルサービス	8.9	9	13,482
アコム	29.3	28.9	11,184
ジャックス	1.6	1.6	4,944
オリエントコーポレーション	39.5	39.5	6,438
日立キャピタル	3.4	—	—
アプラスフィナンシャル	7.4	—	—
オリックス	90.4	88.7	198,998
三菱HCキャピタル	37	50.6	29,044
九州リースサービス	0.8	0.7	424
日本取引所グループ	41.8	39.4	112,171
イー・ギランティ	1.7	1.7	4,299
アサックス	0.8	0.7	497
NECキャピタルソリューション	0.6	0.6	1,224
<b>不動産業 (2.0%)</b>			
いちご	18.7	16.5	5,445
日本駐車場開発	15	16.5	2,425
スター・マイカ・ホールディングス	0.8	0.8	1,169
SREホールディングス	—	0.2	1,502
ADワークスグループ	3.2	3.4	550
ヒューリック	30.9	34.9	38,739
三栄建築設計	0.6	0.6	1,082

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
野村不動産ホールディングス	8.9	8.4	24,528
三重交通グループホールディングス	3.1	3.1	1,565
サムティ	2.1	2.1	5,199
ディア・ライフ	2.2	2.1	1,201
コーセーアールイー	0.6	0.6	398
日本商業開発	1	1	1,743
プレサンスコーポレーション	2.5	2.4	4,581
THEグローバル社	1	1.2	248
ハウスコム	0.3	0.3	387
日本管理センター	0.8	0.8	952
サンセイランディック	0.6	0.5	415
エストラスト	0.3	0.3	195
フージャースホールディングス	3	2.5	1,735
オープンハウス	4.6	4.7	33,981
東急不動産ホールディングス	39.7	39.8	26,785
飯田グループホールディングス	12.2	12.2	34,599
イーランド	0.3	0.3	471
ムゲンエステート	1	1.1	539
ビーロッド	0.8	1.1	608
ファーストブラザーズ	0.3	0.4	413
ハウスドゥ	0.8	0.8	765
シーアールイー	0.4	0.4	730
プロパティエージェント	0.3	0.3	835
ケイアイスター不動産	0.5	0.5	3,085
アグレ都市デザイン	0.4	0.4	547
グッドコムアセット	0.4	0.7	966
ジェイ・エス・ビー	0.3	0.3	897
テンポイノベーション	0.4	0.5	471
グローバル・リンク・マネジメント	0.4	0.3	312
フェイスネットワーク	—	0.2	254
パーク24	7.8	7.9	14,385
バラカ	0.4	0.4	646
三井不動産	70.8	66.6	174,558
三菱地所	102.1	96	167,664
平和不動産	2.7	2.5	8,962
東京建物	14.4	14.5	24,505
ダイビル	3.8	3.7	5,701
京阪神ビルディング	2.4	2.6	3,681
住友不動産	32.8	32.8	136,710
テオーシー	3	2.8	1,783
東京楽天地	0.3	0.3	1,206

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スタートコーポレーション	2	1.8	4,995
フジ住宅	1.9	1.8	1,236
空港施設	1.7	1.7	929
明和地所	1	0.8	488
ゴールドクレスト	1.2	1.4	2,298
エスリード	0.6	0.6	992
日神グループホールディングス	2.4	2.3	1,175
日本エスコン	2.7	2.8	2,279
タカラレーベン	6.9	6.5	2,021
AVANTIA	0.9	0.9	772
イオンモール	7.3	7.4	12,520
毎日コムネット	0.5	0.6	450
ファースト住建	0.7	0.6	757
カチタス	3.6	3.6	14,724
トーセイ	2.1	2.1	2,383
サンフロンティア不動産	2.1	1.9	2,063
FJネクストホールディングス	1.3	1.5	1,519
インテリックス	0.6	0.5	361
ランドビジネス	0.7	0.8	224
グランディハウス	1.3	1.2	592
日本空港ビルデング	4.7	5.1	27,795
<b>サービス業 (6.1%)</b>			
明豊ファシリティワークス	0.7	0.6	555
日本工営	1	0.8	2,748
LIFULL	4.9	4.4	1,575
ミクシィ	2.7	3.6	9,572
ジェイエイシーリクルートメント	0.9	1.2	2,691
日本M&Aセンターホールディングス	10.8	23.2	83,172
メンバーズ	0.4	0.4	1,308
中広	0.2	0.2	76
UTグループ	2.2	2	7,380
アイティメディア	0.6	0.5	1,134
タケエイ	1.4	—	—
E・Jホールディングス	0.3	0.8	1,001
夢真ビーネックスグループ	1.8	3.8	5,768
コシダカホールディングス	3.4	3.8	2,614
アルトナー	0.3	0.3	263
パソナグループ	1.5	1.5	5,010
CDS	0.4	0.4	614
リンクアンドモチベーション	2.6	3.2	3,846
GCA	1.8	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エス・エム・エス	4.4	4.8	21,240
サニーサイドアップグループ	0.5	0.5	382
パーソルホールディングス	14.1	14.2	41,790
リニカル	0.7	0.8	641
クックパッド	4.4	4.5	1,048
エスクリ	0.5	0.5	290
アイ・ケイ・ケイ	0.7	0.7	480
学情	0.5	0.6	709
スタジオアリス	0.7	0.7	1,488
シミックホールディングス	0.7	0.8	1,192
エブコ	0.3	0.3	252
NJS	0.3	0.3	606
総合警備保障	5.6	5.6	27,972
カカコム	10.4	10.5	37,747
アイロムグループ	0.5	0.5	988
セントケア・ホールディング	0.9	1.1	974
サイネックス	0.3	0.3	200
ルネサンス	0.8	0.9	1,064
ディップ	1.9	2.2	9,207
デジタルホールディングス	1	1	1,796
新日本科学	1.5	1.7	2,454
ツクイホールディングス	3.3	—	—
キャリアデザインセンター	0.3	0.4	450
ベネフィット・ワン	5.1	5.2	29,120
エムスリー	31.1	25	182,775
ツカダ・グローバルホールディング	1.1	0.9	306
プラス	0.2	0.2	149
アウトソーシング	8.1	8.1	16,856
ウエルネット	1.4	1.5	753
ワールドホールディングス	0.5	0.6	1,764
ディー・エヌ・エー	5.9	6	13,074
博報堂DYホールディングス	19.6	19.7	36,188
ぐるなび	2.5	2.5	1,342
タカミヤ	1.5	1.8	810
ジャパンバストレスキューシステム	1.1	1	1,078
ファンコムコミュニケーションズ	3.9	3.6	1,630
ライク	0.5	0.4	668
ビジネス・ブレークスルー	0.4	0.6	256
エスプール	3.6	4	5,036
WDBホールディングス	0.6	0.6	2,154
手間いらず	0.1	0.2	1,140

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティア	0.8	0.9	438
CDG	0.1	0.1	144
アドウェイズ	—	2.3	1,865
バリュエコマース	1	1.1	5,043
インフォマート	14.2	15.5	17,019
J Pホールディングス	4.4	4.1	1,037
エコナックホールディングス	2.4	2.8	274
E P Sホールディングス	1.9	—	—
レッグス	0.4	0.3	479
プレステージ・インターナショナル	5.2	5.3	4,160
アミューズ	0.8	0.8	1,781
ドリームインキュベータ	0.4	0.5	407
クイック	0.9	0.9	1,248
T A C	0.9	0.8	191
ケネディクス	12.1	—	—
電通グループ	15.8	14.6	59,203
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.5	0.7	882
びあ	0.4	0.4	1,568
イオンファンタジー	0.5	0.6	1,110
シーティーエス	1.6	1.6	1,281
ネクシィーズグループ	0.4	0.5	447
H. U. グループホールディングス	3.9	4	11,340
アルプス技研	1.2	1.3	2,692
ダイオーズ	0.3	0.3	302
日本空調サービス	1.5	1.5	1,195
オリエンタルランド	15	15.1	271,951
ダスキン	3.5	3.3	8,787
明光ネットワークジャパン	1.8	1.7	989
ファルコホールディングス	0.8	0.7	1,217
秀英予備校	0.3	0.3	125
ラウンドワン	4	4.8	6,681
リゾートトラスト	6.5	6.5	13,136
ビー・エム・エル	1.8	1.8	7,317
ワタベウェディング	0.2	—	—
りらいあコミュニケーションズ	2.5	2.2	2,640
リソー教育	6.6	7.2	3,542
早稲田アカデミー	0.6	0.6	600
ユー・エス・エス	15.8	15.8	28,424
東京個別指導学院	0.5	1.3	893
サイバーエージェント	8.7	34.9	69,136
楽天グループ	65.7	72.6	91,185

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クリーク・アンド・リバー社	0.7	0.7	1,400
モーニングスター	—	2.1	1,106
テー・オー・ダブリュー	2.4	2.6	868
山田コンサルティンググループ	0.9	0.8	924
セントラルスポーツ	0.5	0.5	1,210
フルキャストホールディングス	1.2	1.2	3,166
エン・ジャパン	2.5	2.5	11,600
リソルホールディングス	0.2	0.2	822
テクノプロ・ホールディングス	2.8	8.5	31,110
アトラグループ	0.4	0.4	122
インターワークス	0.3	0.5	202
アイ・アールジャパンホールディングス	0.6	0.6	6,594
Ke e P e r 技研	1	0.9	3,037
ファーストロジック	0.3	0.3	246
三機サービス	0.3	0.3	320
G u n o s y	0.9	0.9	580
デザインワン・ジャパン	0.5	0.4	96
イー・ガーディアン	0.6	0.6	1,902
リブセンス	0.8	0.9	225
ジャパンマテリアル	4.3	4.3	6,660
バクトル	1.8	1.8	2,205
ウチヤマホールディングス	0.7	0.7	258
チャーム・ケア・コーポレーション	1.2	1.1	1,958
キャリアリンク	0.5	0.5	806
I B J	1.1	1.2	1,336
アサンテ	0.6	0.5	877
N ・ フィールド	1	—	—
バリュエHR	0.6	0.6	1,094
M&Aキャピタルパートナーズ	1.1	1.2	7,764
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.5	0.6	847
E R I ホールディングス	0.4	0.4	634
アビスト	0.2	0.2	575
シグマクシス・ホールディングス	1	0.8	2,112
ウィルグループ	0.9	1.1	1,427
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.1	2.2	468
メドピア	—	1.1	3,850
レアジョブ	—	0.3	387
リクルートホールディングス	101	101.4	750,360
エラン	1	2	2,470
土木管理総合試験所	0.7	0.7	245
ネットマーケティング	0.6	0.7	382

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本郵政	115.6	107	94,010
ベルシステム24ホールディングス	2.3	2.4	3,679
鎌倉新書	1.1	1.5	1,371
SMN	0.3	0.3	210
一蔵	0.2	0.2	92
L I T A L I C O	0.5	—	—
グローバルキッズCOMPANY	0.3	0.3	268
エアトリ	0.7	0.9	3,528
ハイアス・アンド・カンパニー	0.9	—	—
アトラエ	0.4	1	2,476
ストライク	0.5	0.5	2,185
ソラスト	3.9	3.5	4,844
セラク	0.4	0.5	973
インソース	0.6	1.4	3,264
ベイカレント・コンサルティング	0.9	0.9	41,175
Orchestra Holdings	0.3	0.3	1,357
アイモバイル	0.5	0.4	615
キャリアインデックス	0.6	0.6	605
MS-Japan	0.5	0.6	607
船場	0.3	0.3	236
グレイステクノロジー	0.7	1.5	1,585
ジャパシエレベーターサービスホールディングス	1.6	4.1	9,967
フルテック	0.2	0.2	293
グリーンズ	0.4	—	—
ツナググループ・ホールディングス	0.3	0.4	139
GameWith	0.4	0.4	202
ソウルドアウト	0.3	0.3	449
MS&Consulting	0.3	0.3	219
ウェルビー	—	0.5	809
エル・ティール・エス	0.1	0.2	646
ミダックホールディングス	0.2	0.6	3,378
日総工産	1	1.1	806
キュービーネットホールディングス	0.6	0.7	1,302
RPAホールディングス	1.1	1.7	763
スプリックス	0.4	0.4	480
マネジメントソリューションズ	0.7	0.7	2,499
プロレド・パートナーズ	0.2	0.3	407
and factory	0.1	0.4	183
テノ・ホールディングス	—	0.2	165
フロンティア・マネジメント	—	0.4	381
ビアラ	—	0.3	213

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コプロ・ホールディングス	—	0.2	250
ギークス	0.1	0.3	446
カーブスホールディングス	3.9	3.9	3,486
フォーラムエン지니어リング	0.7	1	948
ダイレクトマーケティングミックス	—	0.8	3,640
ポピンズホールディングス	—	0.3	967
L I T A L I C O	—	1.2	3,912
アドバンテッジリスクマネジメント	0.7	0.7	664
リログループ	7.7	7.7	18,403
東祥	0.9	0.9	1,679
TREホールディングス	—	1.9	3,602
人・夢・技術グループ	—	0.6	1,182
エイチ・アイ・エス	2.2	3.1	7,728
ラックランド	0.4	0.4	1,152
共立メンテナンス	2.3	2.3	9,510
イチネンホールディングス	1.6	1.5	2,055
建設技術研究所	0.9	0.8	2,166
スペース	0.9	1	932
長大	0.6	—	—
燦ホールディングス	0.6	0.6	903
スバル興業	0.1	0.1	812
東京テアトル	0.6	0.6	744
タナベ経営	0.3	0.6	447
ナガワ	0.5	0.5	5,490
よみうりランド	0.3	—	—
東京都競馬	0.9	1.1	4,768
常磐興産	0.6	0.6	852
カナモト	2.5	2.5	6,095
東京ドーム	5.7	—	—
西尾レントオール	1.3	1.3	3,630
トランス・コスモス	1.3	1.3	4,537
乃村工藝社	6	6.1	6,807
藤田観光	0.6	0.6	1,414
KNT-CTホールディングス	0.9	0.8	1,308
日本管財	1.5	1.5	4,023
トーカイ	1.4	1.4	3,131
白洋舎	0.2	—	—
セコム	15	13.9	108,962
セントラル警備保障	0.7	0.7	1,986
丹青社	2.7	2.7	2,516
メイテック	1.7	1.7	11,373

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
応用地質	1.7	1.6	2,763
船井総研ホールディングス	2.9	2.9	9,178
進学会ホールディングス	0.2	0.6	248
オオバ	1.1	1	820
いであ	0.3	0.4	823
学究社	0.4	0.4	554
ベネッセホールディングス	4.7	5.2	13,551

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
イオンディライト	1.7	1.7	5,882	
ナック	0.8	0.7	683	
ダイセキ	2.4	2.8	15,288	
ステップ	0.5	0.5	939	
合 計	株 数 ・ 金 額	15,558	16,105	41,021,026
	銘柄数<比率>	2,116	2,123	<98.2%>

(注) 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。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX先物	百万円 747	百万円 -

### ○投資信託財産の構成

(2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 41,021,026	% 98.2
コール・ローン等、その他	743,914	1.8
投資信託財産総額	41,764,940	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	42,432,144,825	
コール・ローン等	386,683,019	
株式(評価額)	41,021,026,450	
未収配当金	338,895,356	
差入委託証拠金	685,540,000	
(B) 負債	680,117,218	
未払金	7,665,350	
未払解約金	3,366,714	
未払利息	154	
差入委託証拠金代用有価証券	669,085,000	
(C) 純資産総額(A-B)	41,752,027,607	
元本	21,309,131,563	
次期繰越損益金	20,442,896,044	
(D) 受益権総口数	21,309,131,563口	
1万口当たり基準価額(C/D)	19,593円	

(注) 当ファンドの期首元本額は22,017,538,384円、期中追加設定元本額は2,456,144,995円、期中一部解約元本額は3,164,551,816円です。

(注) 2021年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・DCインデックスバランス (株式80)	3,970,867,945円
・DCインデックスバランス (株式60)	3,596,095,059円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式) 毎月分配型	3,083,752,587円
・国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	2,907,194,622円
・DCインデックスバランス (株式40)	1,832,450,915円
・インデックスファンド日本株式 (DC専用)	1,406,433,104円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,045,621,245円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,025,137,528円
・DCインデックスバランス (株式20)	700,290,293円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	691,194,107円
・インデックス・アセットバランス・オープン (適格機関投資家向け)	636,617,068円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	243,584,625円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	46,430,665円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	43,960,093円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	40,636,155円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	38,865,552円

(注) 1口当たり純資産額は1,9593円です。

(注) 2021年10月26日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

・株式	630,570千円
-----	-----------

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

## ○損益の状況 (2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	832,849,536	
受取配当金	832,485,736	
その他収益金	391,842	
支払利息	△ 28,042	
(B) 有価証券売買損益	8,224,391,247	
売買益	9,029,896,464	
売買損	△ 805,505,217	
(C) 先物取引等取引損益	51,839,000	
取引益	83,757,700	
取引損	△ 31,918,700	
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,109,079,783	
(E) 前期繰越損益金	11,850,262,562	
(F) 追加信託差損益金	2,043,992,343	
(G) 解約差損益金	△ 2,560,438,644	
(H) 計(D+E+F+G)	20,442,896,044	
次期繰越損益金(H)	20,442,896,044	

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

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

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

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2020年10月27日から2021年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

# 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2021年10月26日）  
（2020年10月27日～2021年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2000年5月17日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場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。

## ファンド概要

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託 組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク) 騰落率	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
18期(2017年10月26日)	23,670	33.0	163.01	30.0	96.4	1.0	2.5	82,557
19期(2018年10月26日)	23,897	1.0	161.04	△ 1.2	95.9	1.7	2.4	90,718
20期(2019年10月28日)	26,268	9.9	173.01	7.4	95.7	2.0	2.8	185,690
21期(2020年10月26日)	28,388	8.1	183.11	5.8	96.4	1.3	2.3	231,675
22期(2021年10月26日)	41,177	45.1	261.23	42.7	96.5	1.3	2.3	254,055

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の(円ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2021年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株式組入比率	株式先物比率	投資信託 組入比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク) 騰落率	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2020年10月26日	28,388	—	183.11	—	96.4	1.3	2.3
10月末	26,970	△ 5.0	173.89	△ 5.0	96.4	1.3	2.3
11月末	30,081	6.0	193.75	5.8	94.8	1.6	2.2
12月末	30,959	9.1	199.11	8.7	96.9	0.9	2.2
2021年1月末	31,607	11.3	203.21	11.0	96.2	1.7	2.2
2月末	32,680	15.1	210.20	14.8	96.2	1.6	2.2
3月末	34,873	22.8	223.26	21.9	96.1	1.6	2.2
4月末	36,516	28.6	233.42	27.5	96.7	1.1	2.2
5月末	37,054	30.5	236.36	29.1	96.5	1.4	2.2
6月末	37,981	33.8	242.06	32.2	96.0	1.8	2.2
7月末	38,522	35.7	245.33	34.0	95.7	2.1	2.2
8月末	39,477	39.1	250.96	37.1	95.9	1.9	2.3
9月末	38,565	35.8	244.81	33.7	96.2	1.5	2.2
(期末)							
2021年10月26日	41,177	45.1	261.23	42.7	96.5	1.3	2.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○運用経過

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 基準価額の推移

期間の初め28,388円の基準価額は、期間末に41,177円となり、騰落率は+45.1%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

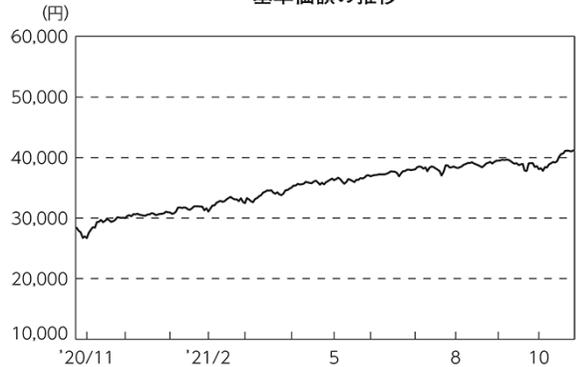
## &lt;値上がり要因&gt;

- ・米国での新政権の発足により大規模な追加経済対策やインフラ投資の拡大が期待されたこと。
- ・新型コロナウイルスのワクチン接種の普及により経済活動の正常化が進むとの期待が高まったこと。
- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が量的緩和の縮小を慎重に進める姿勢を示したこと。
- ・アメリカドル、ユーロ、イギリスポンドなどに対して円安となったこと。

## &lt;値下がり要因&gt;

- ・欧米における新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて行動制限が強化されたこと。
- ・欧米の長期金利の上昇が警戒されたこと。
- ・市場予想を上回る米国の消費者物価指数（CPI）の発表を受けてインフレ懸念が強まったこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2020/10/26	2021/10/26	2020/11/02	2021/10/26
28,388円	41,177円	26,709円	41,177円

MSCI-KOKUSAIインデックス  
(円ヘッジなし・円ベース) (指数化) の推移

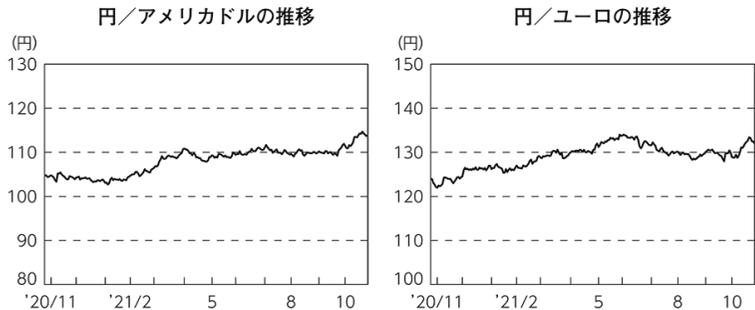
### （海外株式市況）

海外株式市場では、期間の初めと比べて欧米各国の株価は総じて上昇しました。

欧米における新型コロナウイルスの感染再拡大を受けた行動制限の強化や、欧米の長期金利の上昇への警戒感、市場予想を上回る米国のCPIの発表を受けたインフレ懸念の強まりなどが株価の重しとなったものの、米国大統領選挙が終了し政治的不透明感が後退したことや、米国での新政権の発足により大規模な追加経済対策やインフラ投資の拡大が期待されたこと、新型コロナウイルスのワクチン接種の普及により経済活動の正常化が進むとの期待が高まったこと、FRB議長が量的緩和の縮小を慎重に進める姿勢を示したことなどが株価の支援材料となり、欧米各国の株価は総じて上昇しました。

### （為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



## ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、45.1%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSA1インデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率42.7%を概ね2.4%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

### <プラス要因>

- ・株式先物の組入れに基づく要因が寄与したこと。
- ・株式配当金を受け取ったこと。

### <マイナス要因>

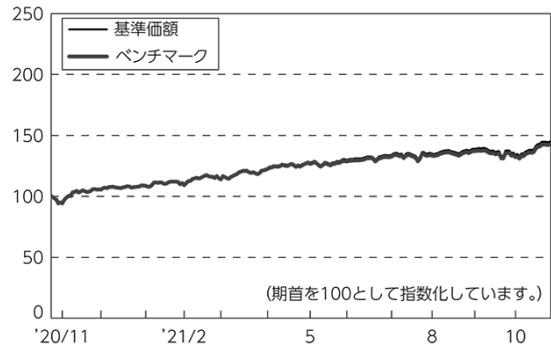
- ・海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

## ○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	2	0.005	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 2 )	(0.005)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.002	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 1 )	(0.002)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	11	0.031	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
（ 保 管 費 用 ）	( 7 )	(0.019)	
（ そ の 他 ）	( 4 )	(0.012)	
合 計	14	0.038	
期中の平均基準価額は、34,607円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 97 ( 830)	千デンマーククローネ 2,866 ( 8,845)	百株 1,023 ( 81)	千デンマーククローネ 32,166 ( 8,845)
	オーストラリア	664 ( 933)	千オーストラリアドル 2,448 ( 503)	10,423 ( 453)	千オーストラリアドル 18,232 ( 509)
	ニュージーランド	274	千ニュージーランドドル 284	871	千ニュージーランドドル 1,023
	香港	3,013 ( 225)	千香港ドル 10,619 ( -)	13,834 ( 1,882)	千香港ドル 51,080 ( 3,882)
国	シンガポール	- ( 2,311)	千シンガポールドル - ( 188)	4,957 ( 2,311)	千シンガポールドル 2,621 ( 321)
	イスラエル	-	千イスラエルシェケル -	551	千イスラエルシェケル 2,022

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )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

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外	スイス	証券 - (49,718)	千スイスフラン - ( 8)	証券 49,718	千スイスフラン 8
国					

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	—	—	1,290	220
PROLOGIS INC	950	126	9,870	1,054
AMERICAN TOWER CORP	430	127	5,440	1,264
AGNC INVESTMENT CORP	—	—	12,840	198
VEREIT INC	680	33	26,400	197
	(△ 30,372)	( — )		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	1,410	273
BOSTON PROPERTIES INC	—	—	2,480	238
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	1,290	132
CROWN CASTLE INTL CORP	290	56	4,820	809
DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	3,010	417
DUKE REALTY CORPORATION	—	—	4,880	207
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	—	3,690	219
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	—	—	4,140	265
EQUINIX INC	—	—	1,055	763
ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	—	660	177
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	1,990	225
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	—	—	3,945	344
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	—	7,680	240
WELLTOWER INC	—	—	3,130	207
HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	12,190	184
INVITATION HOMES INC	—	—	7,530	212
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	11,800	223
MID-AMERICA APARTMENT COMM	220	41	1,490	201
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	—	8,590	323
PUBLIC STORAGE	—	—	1,960	442
REALTY INCOME CORP	—	—	3,500	214
SBA COMMUNICATIONS CORP	150	52	1,520	424
SIMON PROPERTY GROUP INC	420	54	2,840	306
UDR INC	—	—	6,570	309
VENTAS INC	—	—	5,400	271
WEYERHAEUSER CO	1,130	38	8,910	326
WP CAREY INC	—	—	3,120	223
小計	4,270	530	175,440	11,120
	(△ 30,372)	( — )		
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	—	—	1,900	93
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	1,690	41
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	6,760	103
NORTHLAND POWER INCXXX	8,600	382	( 8,600)	( 382)
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	9,500	171
小計	8,600	382	19,850	409
			( 8,600)	( 382)
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
COVIVIO	—	—	730	55
GECINA SA	—	—	400	48
ICADE	—	—	1,965	128
KLEPIERRE	—	—	3,870	72
	( — )	(△ 6)		

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
フランス				
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	—	2,340	150
小 計	( — )	(△ 6)	9,305	455
ユ ー ロ 計	( — )	(△ 6)	9,305	455
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND COMPANY PLC	—	—	12,150	54
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	7,510	52
SEGRO PLC	—	—	17,200	161
小 計	—	—	36,860	268
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
VICINITY CENTRES	65,300	114	77,500	132
DEXUS	—	—	22,000	196
DEXUS/AU(N)	(△ 35,587)	(△ 328)	—	—
GOODMAN GROUP	16,700	322	29,200	534
GPT GROUP	—	—	49,100	224
MIRVAC GROUP	—	—	73,700	165
SCENTRE GROUP	—	—	43,500	107
STOCKLAND	—	—	54,700	218
小 計	82,000	436	349,700	1,580
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	—	—	14,300	960
小 計	—	—	14,300	960
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	—	—	50,000	153
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT(N)	( — )	(△ 3)	( — )	( 1)
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT(N)	( — )	( — )	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	—	—	( 5,931)	( 0.061)
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS(N)	( — )	( — )	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS(N)	( 5,931)	( 0.061)	—	—
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	(162,540)	( 268)
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	( — )	( — )	58,200	130
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	( 135,356)	( 245)	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	49,200	106
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	( — )	(△ 1)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	( — )	(△ 1)	( — )	( 0.509)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST(N)	( — )	( — )	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST(N)	( 2,599)	( 5)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST-R-RTS	—	—	( 2,599)	( 0.052)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST-R-RTS(N)	( — )	( — )	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST-R-RTS(N)	( 2,599)	( 0.052)	—	—
SUNTEC REIT	—	—	91,400	130
小 計	( 152,416)	( 263)	248,800	521
			(171,070)	( 270)

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は分割・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		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 29,106	百万円 30,024	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

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

## ○株式売買比率

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	77,689,607千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	223,733,948千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.34

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2021年10月26日現在)

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO	293	224	4,101	466,867	資本財
ABBVIE INC	901	682	7,401	842,505	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	909	687	8,699	990,245	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	327	245	8,764	997,622	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	239	173	3,256	370,679	保険
ADVANCE AUTO PARTS INC	32	24	572	65,174	小売
AES CORP	346	277	697	79,414	公益事業
AERCAP HOLDINGS NV	64	—	—	—	資本財
AFLAC INC	357	257	1,468	167,106	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	167	117	1,852	210,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	112	87	2,564	291,911	素材
ALLEGHANY CORP	8	5	339	38,635	保険
ALLSTATE CORP	165	116	1,500	170,819	保険
ALTRIA GROUP INC	945	717	3,438	391,392	食品・飲料・タバコ
ALLIANT ENERGY CORP	123	82	466	53,123	公益事業
ALBEMARLE CORP	57	46	1,101	125,375	素材
ALLEGION PLC	38	38	504	57,458	資本財
ALLY FINANCIAL INC	204	140	719	81,848	各種金融
ALTICE USA INC- A	167	106	191	21,767	メディア・娯楽
AMPHENOL CORP-CL A	159	231	1,828	208,133	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	65	41	1,248	142,130	各種金融
AMEREN CORPORATION	120	109	927	105,533	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	446	329	1,964	223,589	保険
AMERICAN EXPRESS CO	349	265	4,831	550,020	各種金融
AMETEK INC	126	89	1,166	132,836	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	257	198	1,682	191,487	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	93	67	1,172	133,450	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	69	57	707	80,579	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	48	29	399	45,459	保険
AMCOR PLC	864	632	763	86,917	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	181	666	75,881	メディア・娯楽
AON PLC	120	87	2,791	317,813	保険
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	95	72	577	65,715	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	141	91	432	49,187	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	289	213	1,424	162,179	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	33	27	331	37,689	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	100	81	1,338	152,377	保険
ARAMARK	107	78	286	32,620	消費者サービス
HOWMET AEROSPACE INC	208	146	443	50,482	資本財
ARISTA NETWORKS INC	28	21	841	95,795	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	33	23	378	43,088	保険
AT&T INC	3,639	2,756	7,068	804,620	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	70	48	459	52,327	公益事業
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	63	55	496	56,517	保険
AUTOLIV INC	42	25	237	27,071	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	11	8	1,542	175,578	小売
AVERY DENNISON CORP	46	32	697	79,415	素材
AVALARA INC	40	33	599	68,238	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	220	210	798	90,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	100	—	—	—	素材
EQUITABLE HOLDINGS INC	231	171	577	65,752	各種金融

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BALL CORP	174	126	1,108	126,165	素材
BANK OF AMERICA CORP	3,988	2,983	14,173	1,613,328	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	251	196	1,596	181,695	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	429	329	1,954	222,534	各種金融
BAKER HUGHES CO	407	281	708	80,634	エネルギー
TRUIST FINANCIAL CORP	684	518	3,347	381,097	銀行
BECTON DICKINSON AND CO	147	112	2,771	315,465	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	125	90	1,086	123,620	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	708	512	14,877	1,693,480	各種金融
BIO-RAD LABORATORIES-A	11	8	662	75,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	77	59	5,455	621,052	各種金融
BLACK KNIGHT INC	65	65	477	54,387	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	362	265	3,698	421,012	各種金融
BORGWARNER INC	98	98	449	51,211	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	715	529	2,357	268,346	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	274	214	4,555	518,591	資本財
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	74	55	465	53,043	商業・専門サービス
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	3	172	19,598	食品・飲料・タバコ
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,152	861	4,977	566,615	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	61	46	849	96,673	ソフトウェア・サービス
BROWN & BROWN INC	103	96	643	73,306	保険
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	152	116	810	92,216	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	54	54	481	54,861	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	31	24	673	76,617	小売
CARMAX INC	78	62	874	99,563	小売
CARDINAL HEALTH INC	135	113	553	62,985	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	276	212	4,298	489,261	資本財
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	237	174	2,947	335,534	各種金融
CARNIVAL CORP	230	310	684	77,876	消費者サービス
COTERRA ENERGY INC	230	268	604	68,822	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	89	68	274	31,276	食品・飲料・タバコ
CATALENT INC	86	65	853	97,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CABLE ONE INC	2	2	401	45,755	メディア・娯楽
CARRIER GLOBAL CORP	416	318	1,738	197,939	資本財
CARVANA CO	—	29	862	98,130	小売
CBRE GROUP INC - A	164	132	1,384	157,618	不動産
CENTENE CORP	309	229	1,561	177,696	ヘルスケア機器・サービス
CELANESE CORP	51	39	673	76,680	素材
CENTERPOINT ENERGY INC	249	222	595	67,837	公益事業
LUMEN TECHNOLOGIES INC	396	343	420	47,831	電気通信サービス
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	55	718	81,783	ソフトウェア・サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	121	80	476	54,249	素材
CHURCH & DWIGHT CO INC	117	96	810	92,292	家庭用品・パーソナル用品
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	14	11	1,961	223,260	消費者サービス
CHEVRON CORP	984	746	8,497	967,313	エネルギー
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	19	809	92,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEWY INC - CLASS A	—	34	231	26,375	小売
CITIGROUP INC	1,060	796	5,642	642,321	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	236	155	783	89,223	銀行
CIGNA CORP	187	131	2,835	322,753	ヘルスケア機器・サービス
CLOROX COMPANY	62	49	794	90,451	家庭用品・パーソナル用品
CLOUDFLARE INC-CLASS A	—	88	1,676	190,810	ソフトウェア・サービス
CLARIVATE PLC	—	124	283	32,294	商業・専門サービス
CMS ENERGY CORP	161	122	737	83,945	公益事業
CONCHO RESOURCES INC	111	—	—	—	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE CO	413	299	2,250	256,167	家庭用品・パーソナル用品
CONOCOPHILLIPS	532	523	4,003	455,686	エネルギー
COMERICA INC	78	—	—	—	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
CONAGRA BRANDS INC	277	194	640	72,893	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA CO/THE	2,086	1,580	8,571	975,655	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	160	128	978	111,388	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	87	66	1,456	165,775	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	364	328	1,267	144,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	106	82	430	49,005	食品・飲料・タバコ
CORTEVA INC	371	290	1,233	140,419	素材
CROWN HOLDINGS INC	57	52	529	60,221	素材
CSX CORP	389	881	3,150	358,636	運輸
CUMMINS INC	72	56	1,369	155,914	資本財
CVS HEALTH CORP	665	510	4,480	509,989	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	30	26	301	34,319	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	65	50	723	82,363	消費者サービス
DANAHER CORP	326	249	7,643	870,003	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	-	262	1,068	121,632	エネルギー
DEERE & CO	151	115	4,073	463,733	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	102	101	1,142	130,018	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	84	51	201	22,959	運輸
APTIV PLC	143	101	1,723	196,167	自動車・自動車部品
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	146	121	1,501	170,879	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	20	15	713	81,200	消費者サービス
DOMINION ENERGY INC	426	315	2,410	274,397	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	130	91	2,029	230,973	小売
DOVER CORP	81	53	902	102,700	資本財
DUPONT DE NEMOURS INC	389	203	1,466	166,965	素材
DOW INC	364	288	1,694	192,836	素材
DOORDASH INC - A	-	25	547	62,300	小売
DR HORTON INC	168	133	1,185	134,956	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	93	80	927	105,552	公益事業
DUKE ENERGY CORP	373	297	3,063	348,683	公益事業
DYNATRACE INC	66	66	515	58,722	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	81	50	554	63,094	素材
EATON CORP PLC	208	158	2,568	292,387	資本財
ECOLAB INC	131	100	2,228	253,714	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	311	240	2,819	320,988	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	208	148	908	103,414	公益事業
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	208	165	561	63,902	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	295	232	2,245	255,634	資本財
ENTERGY CORP	93	71	739	84,201	公益事業
EOG RESOURCES INC	300	226	2,131	242,587	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	30	22	1,438	163,714	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	60	46	1,278	145,568	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	113	91	3,006	342,269	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	23	13	391	44,527	保険
EVERGY INC	126	87	560	63,754	公益事業
EXXON MOBIL CORP	2,158	1,638	10,542	1,200,055	エネルギー
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	16	14	631	71,922	各種金融
FAIR ISAAC CORP	16	10	436	49,716	ソフトウェア・サービス
FEDEX CORP	127	98	2,328	265,088	運輸
FIRST REPUBLIC BANK/CA	84	67	1,455	165,641	銀行
FIRSTENERGY CORP	269	223	835	95,051	公益事業
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	314	240	2,939	334,607	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	45	30	854	97,227	ソフトウェア・サービス
FMC CORP	69	51	479	54,553	素材
FNF GROUP	151	115	575	65,496	保険
FORD MOTOR COMPANY	1,988	1,475	2,361	268,811	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	70	55	541	61,659	資本財
FORTIVE CORP	165	132	985	112,217	資本財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NEXTERA ENERGY INC	249	758	6,396	728,144	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	157	124	388	44,177	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	690	574	2,258	257,121	素材
INGERSOLL-RAND INC	161	152	832	94,805	資本財
GENERAL MOTORS CORP	640	515	2,974	338,636	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	78	56	749	85,292	小売
GENERAL ELECTRIC CO	4,454	425	4,484	510,460	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	129	94	1,965	223,694	資本財
GENERAL MILLS INC	297	234	1,451	165,196	食品・飲料・タバコ
GENERAC HOLDINGS INC	—	25	1,189	135,389	資本財
GLOBAL PAYMENTS INC	153	117	1,849	210,474	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	166	131	5,471	622,854	各種金融
GODADDY INC-CLASS A	92	70	492	56,087	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	21	16	700	79,724	資本財
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	43	28	359	40,937	ソフトウェア・サービス
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	154	138	1,025	116,701	保険
HALLIBURTON CO	478	346	909	103,527	エネルギー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	115	82	2,004	228,142	資本財
HCA HEALTHCARE INC	138	104	2,516	286,400	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	67	57	1,030	117,246	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	161	109	965	109,906	エネルギー
HP INC	785	473	1,449	164,969	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	711	506	780	88,854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEICO CORP	20	20	279	31,870	資本財
HEICO CORP-CLASS A	41	24	308	35,171	資本財
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	132	109	1,552	176,720	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	359	269	5,870	668,242	資本財
HOME DEPOT INC	551	410	15,251	1,736,062	小売
HORMEL FOODS CORP	138	115	482	54,914	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	68	49	2,305	262,436	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	22	18	382	43,535	資本財
HUBSPOT INC	—	17	1,389	158,204	ソフトウェア・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	452	346	4,428	504,049	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	38	28	625	71,253	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	161	121	2,750	313,043	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	37	96	1,411	160,665	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	234	135	489	55,700	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	284	216	2,881	328,017	各種金融
INVESCO LTD	221	135	334	38,109	各種金融
INTERNATIONAL PAPER CO	208	145	768	87,505	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	126	92	1,670	190,133	資本財
INGREDION INC	31	—	—	—	食品・飲料・タバコ
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	56	50	708	80,616	商業・専門サービス
JM SMUCKER CO/THE	63	47	586	66,721	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	1,348	1,017	16,701	1,901,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	28	—	—	—	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	1,557	1,170	20,008	2,277,570	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	184	126	350	39,841	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	50	36	1,100	125,288	運輸
KEYCORP	415	394	949	108,028	銀行
KELLOGG CO	147	105	649	73,977	食品・飲料・タバコ
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	95	72	1,284	146,163	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	173	130	1,694	192,876	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	1,086	803	1,434	163,321	エネルギー
KKR & CO INC -A	285	200	1,500	170,852	各種金融
KROGER CO	428	282	1,138	129,597	食品・生活必需品小売り
LAS VEGAS SANDS CORP	170	149	566	64,433	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	48	38	1,089	123,977	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
LAMB WESTON HOLDING INC	89	59	349	39,819	食品・飲料・タバコ	
LENNAR CORP-CL A	149	104	1,051	119,663	耐久消費財・アパレル	
LENNOX INTERNATIONAL INC	14	14	426	48,492	資本財	
LEAR CORP	27	27	457	52,086	自動車・自動車部品	
ELI LILLY & CO	442	315	7,732	880,168	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	78	60	609	69,339	メディア・娯楽	
LINCOLN NATIONAL CORP	82	75	570	64,928	保険	
BATH & BODY WORKS INC	—	106	756	86,161	小売	
LINDE PLC	269	202	6,403	728,884	素材	
LOCKHEED MARTIN CORP	128	96	3,618	411,926	資本財	
LOWE'S COS INC	387	274	6,366	724,669	小売	
LOEWS CORP	108	70	406	46,305	保険	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	130	100	980	111,665	素材	
M & T BANK CORP	72	52	830	94,530	銀行	
MASTERCARD INC	458	341	12,325	1,402,974	ソフトウェア・サービス	
MARSH & MCLENNAN COS	259	196	3,330	379,130	保険	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	28	24	954	108,700	素材	
MASCO CORP	116	89	552	62,868	資本財	
MARKEL CORP	7	5	698	79,513	保険	
MARATHON PETROLEUM CORP	349	257	1,758	200,150	エネルギー	
IHS MARKIT LTD	204	146	1,815	206,709	商業・専門サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	60	104	839	95,603	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	379	287	6,830	777,559	消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	122	92	4,159	473,441	各種金融	
MCKESSON CORP	78	62	1,303	148,390	ヘルスケア機器・サービス	
METLIFE INC	416	292	1,918	218,363	保険	
MERCK & CO. INC.	1,289	976	7,975	907,905	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDTRONIC PLC	684	519	6,423	731,202	ヘルスケア機器・サービス	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	12	9	1,367	155,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	220	128	619	70,539	消費者サービス	
MICRON TECHNOLOGY INC	585	433	2,979	339,118	半導体・半導体製造装置	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	115	83	364	41,493	食品・飲料・タバコ	
MOHAWK INDUSTRIES INC	32	24	475	54,165	耐久消費財・アパレル	
MOSAIC CO/THE	171	148	630	71,819	素材	
MORGAN STANLEY	689	542	5,523	628,777	各種金融	
MOODY'S CORP	82	64	2,496	284,144	各種金融	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	91	66	1,641	186,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOLINA HEALTHCARE INC	33	23	702	79,946	ヘルスケア機器・サービス	
MSCI INC	45	32	2,115	240,845	各種金融	
NOV INC	228	—	—	—	エネルギー	
NEWMONT CORP	393	310	1,797	204,625	素材	
NEWELL BRANDS INC	161	161	362	41,246	耐久消費財・アパレル	
NIKE INC -CL B	634	492	8,087	920,600	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	195	150	375	42,777	公益事業	
NIELSEN HOLDINGS PLC	209	—	—	—	商業・専門サービス	
NORTHROP GRUMMAN CORP	80	58	2,392	272,344	資本財	
NORFOLK SOUTHERN CORP	130	98	2,824	321,507	運輸	
EVERSOURCE ENERGY	179	134	1,155	131,486	公益事業	
NRG ENERGY INC	100	100	415	47,262	公益事業	
NUCOR CORP	174	117	1,281	145,838	素材	
OAK STREET HEALTH INC	—	34	158	18,012	ヘルスケア機器・サービス	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	512	362	1,276	145,333	エネルギー	
OGE ENERGY CORP	122	—	—	—	公益事業	
OMNICOM GROUP	117	83	585	66,600	メディア・娯楽	
ONEOK INC	227	170	1,122	127,765	エネルギー	
ORACLE CORP	1,052	728	7,131	811,787	ソフトウェア・サービス	
OTIS WORLDWIDE CORP	204	160	1,310	149,127	資本財	
OWENS CORNING	62	40	368	41,997	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
P G & E CORP	540	604	704	80,246	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	62	48	1,487	169,332	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	52	35	479	54,573	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	50	37	1,876	213,612	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	25	19	1,075	122,386	ソフトウェア・サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	594	1,510	171,954	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	708	533	8,488	966,209	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	84	55	429	48,933	資本財
PERKINELMER INC	64	45	806	91,771	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PERRIGO CO PLC	71	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	2,837	2,165	9,345	1,063,839	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	795	600	5,798	660,096	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	217	168	1,408	160,358	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	78	85	1,651	187,973	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	44	44	297	33,813	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	189	209	1,061	120,858	メディア・娯楽
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	226	164	3,564	405,755	銀行
RALPH LAUREN CORP	28	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PPL CORP	362	298	865	98,464	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	127	91	1,458	166,064	素材
PROCTER & GAMBLE CO	1,269	946	13,336	1,518,144	家庭用品・パーソナル用品
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	157	108	758	86,326	保険
PROGRESSIVE CORP	295	225	2,172	247,317	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	206	152	1,732	197,200	保険
PULTE GROUP INC	153	100	499	56,812	耐久消費財・アパレル
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	263	188	1,207	137,450	公益事業
QUEST DIAGNOSTICS	63	52	760	86,593	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	95	74	1,917	218,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	53	76	779	88,705	各種金融
REGIONS FINANCIAL CORP	410	370	897	102,128	銀行
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	24	18	276	31,490	保険
REPUBLIC SERVICES INC	102	81	1,067	121,472	商業・専門サービス
RESMED INC	72	56	1,508	171,738	ヘルスケア機器・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	36	—	—	—	保険
RINGCENTRAL INC-CLASS A	40	32	787	89,686	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	62	43	1,358	154,623	資本財
ROBERT HALF INTL INC	44	44	495	56,424	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	51	40	1,966	223,825	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	72	87	742	84,552	消費者サービス
WESTROCK CO	134	105	510	58,156	素材
ROLLINS INC	80	90	353	40,277	商業・専門サービス
RPM INTERNATIONAL INC	55	55	491	55,950	素材
SALESFORCE.COM INC	461	375	11,038	1,256,507	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	66	48	492	56,112	商業・専門サービス
SCHLUMBERGER LTD	680	545	1,875	213,477	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	764	560	4,648	529,163	各種金融
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	100	64	366	41,758	資本財
SEALED AIR CORP	71	63	378	43,031	素材
SEMPRA ENERGY	141	122	1,595	181,583	公益事業
SERVICENOW INC	98	77	5,304	603,770	ソフトウェア・サービス
SEA LTD-ADR	—	25	870	99,123	メディア・娯楽
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	42	98	3,044	346,596	素材
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	170	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SMITH (A.O.) CORP	79	47	318	36,281	資本財
SNAP-ON INC	30	18	382	43,538	資本財
SNAP INC - A	471	368	2,006	228,359	メディア・娯楽
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13	72	2,489	283,383	ソフトウェア・サービス
SOUTHWEST AIRLINES CO	81	54	259	29,563	運輸

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	当 期		額	
			株数	評 価		
株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
SOUTHERN CO	536	409	2,570	292,599	公益事業	
SQUARE INC - A	185	152	3,982	453,316	ソフトウェア・サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	79	61	1,160	132,071	資本財	
STRYKER CORP	172	130	3,569	406,325	ヘルスケア機器・サービス	
STATE STREET CORP	187	136	1,347	153,393	各種金融	
STERIS PLC	42	36	852	96,987	ヘルスケア機器・サービス	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	71	61	342	39,028	運輸	
SYSCO CORP	240	198	1,552	176,675	食品・生活必需品小売り	
SYNCHRONY FINANCIAL	283	228	1,114	126,885	各種金融	
TARGET CORP	256	192	4,998	569,004	小売	
TEXTRON INC	119	92	686	78,156	資本財	
TERADYNE INC	82	65	767	87,308	半導体・半導体製造装置	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	590	435	441	50,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELADOC HEALTH INC	39	51	735	83,717	ヘルスケア機器・サービス	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	16	17	778	88,659	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELEFLEX INC	26	17	663	75,508	ヘルスケア機器・サービス	
THE WALT DISNEY CO.	926	703	12,096	1,376,897	メディア・娯楽	
COOPER COS INC/THE	28	18	763	86,910	ヘルスケア機器・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	202	152	9,243	1,052,161	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIFFANY & CO	58	—	—	—	小売	
TJX COMPANIES INC	611	467	3,048	347,031	小売	
GLOBE LIFE INC	54	32	301	34,270	保険	
TRAVELERS COS INC/THE	136	98	1,590	181,057	保険	
TRANSDIGM GROUP INC	25	20	1,332	151,693	資本財	
TRANSUNION	84	71	843	96,050	商業・専門サービス	
TWITTER INC	407	308	1,916	218,108	メディア・娯楽	
TWILIO INC - A	62	62	2,247	255,834	ソフトウェア・サービス	
TYLER TECHNOLOGIES INC	20	15	819	93,330	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	143	112	934	106,337	食品・飲料・タバコ	
TE CONNECTIVITY LTD	158	125	1,854	211,069	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	386	278	2,057	234,214	資本財	
UBER TECHNOLOGIES INC	487	469	2,147	244,446	運輸	
UGI CORP	126	77	344	39,245	公益事業	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	361	279	5,706	649,576	運輸	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	770	588	5,371	611,463	資本財	
UNION PACIFIC CORP	347	256	6,155	700,625	運輸	
UNITEDHEALTH GROUP INC	485	364	16,377	1,864,213	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	44	30	403	45,958	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED RENTALS INC	35	28	1,032	117,569	資本財	
UNITY SOFTWARE INC	—	19	284	32,405	ソフトウェア・サービス	
US BANCORP	678	548	3,428	390,213	銀行	
VF CORP	174	136	963	109,657	耐久消費財・アパレル	
VALERO ENERGY CORP	222	156	1,292	147,137	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	49	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
VAIL RESORTS INC	22	15	535	60,931	消費者サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,111	1,594	8,384	954,379	電気通信サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	69	53	1,720	195,881	ヘルスケア機器・サービス	
VISA INC-CLASS A SHARES	863	653	15,284	1,739,837	ソフトウェア・サービス	
VISTRA CORP	209	182	355	40,487	公益事業	
VMWARE INC	44	32	524	59,743	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	55	55	383	43,648	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	63	53	1,027	116,954	素材	
WALMART INC	726	598	8,984	1,022,693	食品・生活必需品小売り	
WATERS CORP	30	23	856	97,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WASTE MANAGEMENT INC	212	167	2,698	307,146	商業・専門サービス	
WABTEC CORP	80	57	537	61,128	資本財	
WASTE CONNECTIONS INC	127	106	1,402	159,649	商業・専門サービス	
WAYFAIR INC- CLASS A	33	28	667	76,012	小売	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
WESTERN UNION CO	245	145	284	32,436	ソフトウェア・サービス	
WELLS FARGO & CO	1,987	1,607	8,136	926,195	銀行	
ANTHEM INC	128	94	4,096	466,266	ヘルスケア機器・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	36	29	1,218	138,746	ヘルスケア機器・サービス	
WHIRLPOOL CORP	28	26	550	62,712	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	564	483	1,392	158,486	エネルギー	
WEC ENERGY GROUP INC	153	120	1,088	123,866	公益事業	
WORKDAY INC-CLASS A	88	74	2,104	239,593	ソフトウェア・サービス	
WR BERKLEY CORP	72	53	441	50,311	保険	
XCEL ENERGY INC	263	200	1,293	147,234	公益事業	
XPO LOGISTICS INC	48	—	—	—	運輸	
XYLEM INC	80	63	814	92,663	資本財	
YUM! BRANDS INC	153	116	1,463	166,638	消費者サービス	
ZENDESK INC	—	45	601	68,480	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	110	79	1,200	136,708	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	241	183	3,879	441,578	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHENIERE ENERGY INC	123	97	1,056	120,231	エネルギー	
NVR INC	1	1	658	74,966	耐久消費財・アパレル	
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	27	467	53,208	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABIOMED INC	23	17	626	71,327	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	391	302	2,459	279,935	メディア・娯楽	
ADOBE INC	247	184	11,958	1,361,246	ソフトウェア・サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	601	471	5,772	657,134	半導体・半導体製造装置	
AIRBNB INC-CLASS A	—	45	761	86,690	消費者サービス	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	88	63	683	77,753	ソフトウェア・サービス	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	107	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	65	47	946	107,732	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	39	28	1,675	190,672	ヘルスケア機器・サービス	
AMAZON.COM INC	217	175	58,305	6,636,937	小売	
AMGEN INC	300	221	4,597	523,291	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMERCO	3	3	270	30,759	運輸	
ANALOG DEVICES INC	183	208	3,763	428,376	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	45	34	1,302	148,235	ソフトウェア・サービス	
APPLE INC	8,877	6,456	95,970	10,924,333	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	459	352	4,791	545,402	半導体・半導体製造装置	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	216	152	660	75,209	保険	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	218	164	3,596	409,354	ソフトウェア・サービス	
AUTODESK INC	111	85	2,672	304,158	ソフトウェア・サービス	
BEIGENE LTD-ADR	20	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	63	370	42,153	ソフトウェア・サービス	
BIOGEN INC	81	58	1,571	178,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	92	75	556	63,343	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADCOM INC	203	157	8,230	936,870	半導体・半導体製造装置	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	72	51	505	57,561	運輸	
CADENCE DESIGN SYS INC	139	109	1,824	207,663	ソフトウェア・サービス	
CARLYLE GROUP INC/THE	71	68	383	43,629	各種金融	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	79	894	101,809	消費者サービス	
VIACOMCBS INC - CLASS B	318	228	858	97,708	メディア・娯楽	
CDW CORP/DE	66	55	1,070	121,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CDK GLOBAL INC	58	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CERNER CORP	164	111	796	90,668	ヘルスケア機器・サービス	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	61	43	528	60,174	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATION-A	73	51	3,743	426,122	メディア・娯楽	
CINTAS CORP	44	35	1,524	173,533	商業・専門サービス	
CISCO SYSTEMS INC	2,156	1,628	8,981	1,022,393	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	89	62	769	87,538	保険	
CITRIX SYSTEMS INC	63	50	495	56,421	ソフトウェア・サービス	
CME GROUP INC	182	138	3,015	343,198	各種金融	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
COMCAST CORP-CLASS A	2,336	1,776	9,608	1,093,686	メディア・娯楽
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	279	208	1,646	187,382	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	225	171	8,412	957,546	食品・生活必需品小売り
COPART INC	114	81	1,247	142,025	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	19	149	1,478	168,345	商業・専門サービス
COGNEX CORP	89	70	604	68,825	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COUPA SOFTWARE INC	34	28	681	77,599	ソフトウェア・サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	56	71	2,008	228,606	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	20	14	255	29,072	ソフトウェア・サービス
DATADOG INC-CLASS A	57	72	1,169	133,162	ソフトウェア・サービス
DEXCOM INC	50	37	2,108	240,015	ヘルスケア機器・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	115	93	534	60,835	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	95	57	146	16,668	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	127	92	404	46,041	メディア・娯楽
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	124	124	302	34,468	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	68	-	-	-	エネルギー
DOLLAR TREE INC	119	92	976	111,128	小売
DOCUSIGN INC	88	73	2,039	232,155	ソフトウェア・サービス
KEURIG DR PEPPER INC	194	270	931	106,044	食品・飲料・タバコ
DROPBOX INC-CLASS A	107	107	331	37,707	ソフトウェア・サービス
DRAFTKINGS INC - CL A	-	114	535	60,969	消費者サービス
EAST WEST BANCORP INC	74	-	-	-	銀行
EBAY INC	375	263	2,124	241,819	小売
PAYPAL HOLDINGS INC	572	431	10,654	1,212,813	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	146	110	1,568	178,590	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	-	49	884	100,692	半導体・半導体製造装置
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	11	11	239	27,209	保険
ETSY INC	-	49	1,257	143,175	小売
EXPEDIA GROUP INC	74	54	875	99,638	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	75	65	805	91,652	運輸
EXELON CORP	520	383	1,980	225,421	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	85	69	654	74,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
F5 NETWORKS INC	23	23	496	56,544	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-CLASS A	1,232	926	30,462	3,467,602	メディア・娯楽
FASTENAL CO	282	216	1,213	138,159	資本財
FISERV INC	289	236	2,623	298,661	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	344	271	1,236	140,703	銀行
FLIR SYSTEMS INC	81	-	-	-	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORTINET INC	67	54	1,815	206,663	ソフトウェア・サービス
FOX CORP- CLASS B	74	54	212	24,222	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS A	175	144	605	68,870	メディア・娯楽
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	-	18	132	15,061	各種金融
GARMIN LTD	70	58	962	109,528	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	48	32	1,047	119,195	ソフトウェア・サービス
GILEAD SCIENCES INC	638	484	3,278	373,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	153	116	31,997	3,642,293	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	155	112	31,257	3,558,010	メディア・娯楽
HASBRO INC	66	52	468	53,371	耐久消費財・アパレル
HD SUPPLY HOLDINGS INC	89	-	-	-	資本財
HENRY SCHEIN INC	83	50	384	43,721	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	118	102	752	85,607	ヘルスケア機器・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	-	82	961	109,397	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	45	32	648	73,824	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	505	563	937	106,696	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	43	33	522	59,420	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	42	32	2,133	242,883	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	77	56	2,383	271,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	133	106	6,396	728,145	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数	当 株数	期 末		業 種 等
			評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
INTEL CORP	2,164	1,560	7,712	877,914	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	59	138	4,741	539,729	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	89	71	474	54,022	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	33	27	818	93,222	ヘルスケア機器・サービス
IPG PHOTONICS CORP	18	13	209	23,805	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IONIS PHARMACEUTICALS INC	50	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	31	22	318	36,218	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	42	28	494	56,266	ソフトウェア・サービス
KLA CORP	84	60	2,072	235,942	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	727	539	3,257	370,796	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	360	268	973	110,869	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	75	55	3,050	347,265	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	201	152	453	51,595	電気通信サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-A	75	52	156	17,819	電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND-A	12	7	127	14,534	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	49	58	1,031	117,392	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM A	55	33	162	18,519	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	92	66	323	36,871	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-LIBERTY-C	101	69	386	44,033	メディア・娯楽
LKQ CORP	168	108	611	69,634	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	62	46	1,989	226,512	耐久消費財・アパレル
LYFT INC-A	—	96	464	52,912	運輸
MASIMO CORP	28	20	576	65,640	ヘルスケア機器・サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	359	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	142	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	145	106	1,641	186,822	消費者サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	20	14	578	65,827	各種金融
MATCH GROUP INC	125	98	1,658	188,774	メディア・娯楽
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	309	2,096	238,665	半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	135	80	90	10,310	消費者サービス
T-MOBILE US INC	283	241	2,799	318,677	電気通信サービス
MERCADOLIBRE INC	22	17	2,673	304,327	小売
MICROSOFT CORP	3,690	2,768	85,294	9,709,095	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	118	206	1,566	178,329	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	203	156	1,316	149,837	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	24	22	1,141	129,938	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	151	132	4,619	525,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	18	954	108,608	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	262	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	58	44	903	102,871	各種金融
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	42	36	372	42,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	106	81	758	86,327	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	225	171	11,522	1,311,586	メディア・娯楽
NEWS CORP - CLASS A	186	165	400	45,597	メディア・娯楽
NORTHERN TRUST CORP	106	79	984	112,082	各種金融
NOVAVAX INC	—	26	351	40,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORDSON CORP	30	20	514	58,602	資本財
NOVOOCURE LTD	—	34	409	46,575	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	315	964	22,345	2,543,636	半導体・半導体製造装置
NXP SEMICONDUCTORS NV	149	106	2,136	243,197	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	36	26	1,782	202,880	小売
OKTA INC	59	49	1,302	148,279	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	45	39	1,297	147,657	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	210	166	769	87,546	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	183	140	1,225	139,547	資本財
PAYCHEX INC	173	125	1,548	176,279	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	163	—	—	—	銀行
PELTON INTERACTIVE INC-A	100	102	988	112,488	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	当期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
PLUG POWER INC	—	190	662	75,437	資本財	
POOL CORP	—	14	742	84,528	小売	
PPD INC	—	55	258	29,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOOKING HOLDINGS INC	20	15	3,819	434,801	消費者サービス	
PTC INC	59	46	606	69,060	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	60	46	769	87,611	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	576	438	5,781	658,100	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	51	40	2,339	266,290	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROSS STORES INC	174	137	1,552	176,690	小売	
ROKU INC	48	43	1,405	160,030	メディア・娯楽	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	64	243	27,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	37	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY	96	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SEI INVESTMENTS COMPANY	77	46	294	33,542	各種金融	
SEAGEN INC	60	51	902	102,694	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	79	706	80,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	472	472	285	32,479	メディア・娯楽	
SIGNATURE BANK	31	—	—	—	銀行	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	83	62	1,025	116,763	半導体・半導体製造装置	
SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	—	20	625	71,189	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	84	63	1,062	120,927	ソフトウェア・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	109	84	635	72,300	ソフトウェア・サービス	
STEEL DYNAMICS INC	122	75	503	57,352	素材	
STARBUCKS CORP	596	453	5,207	592,729	消費者サービス	
SUNRUN INC	60	71	388	44,198	資本財	
SVB FINANCIAL GROUP	24	22	1,659	188,943	銀行	
NORTONLIFELOCK INC	284	222	592	67,410	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSIS INC	72	58	1,884	214,536	ソフトウェア・サービス	
T ROWE PRICE GROUP INC	120	90	1,861	211,865	各種金融	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	57	44	814	92,692	メディア・娯楽	
TESLA INC	380	316	32,462	3,695,199	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	469	359	7,187	818,162	半導体・半導体製造装置	
BIO-TECHNE CORP	—	14	756	86,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRIMBLE INC	136	89	779	88,681	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	59	44	947	107,856	小売	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	43	43	376	42,880	各種金融	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	20	171	1,305	148,580	ソフトウェア・サービス	
ULTA BEAUTY INC	31	20	745	84,884	小売	
VERISIGN INC	48	39	856	97,453	ソフトウェア・サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	131	99	1,846	210,152	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISK ANALYTICS INC	83	59	1,259	143,357	商業・専門サービス	
VIATRIS INC	—	484	668	76,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	359	286	1,407	160,248	食品・生活必需品小売り	
WESTERN DIGITAL CORP	177	124	706	80,396	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WIX.COM LTD	27	22	454	51,763	ソフトウェア・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	69	49	1,216	138,441	保険	
WYNN RESORTS LTD	55	35	317	36,126	消費者サービス	
XILINX INC	116	94	1,657	188,679	半導体・半導体製造装置	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	29	21	1,158	131,826	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - A	—	27	261	29,725	メディア・娯楽	
ZIONS BANCORP NA	92	—	—	—	銀行	
ZILLOW GROUP INC - C	67	57	549	62,569	メディア・娯楽	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	81	81	2,288	260,520	ソフトウェア・サービス	
ZSCALER INC	36	31	970	110,522	ソフトウェア・サービス	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	492	492	253	28,898	不動産	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	132	—	—	—	資本財	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	113	93	532	60,603	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
COBE GLOBAL MARKETS INC	63	39	509	58,034		各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	157,899	121,991	1,570,599	178,781,385	
(カナダ)		590	598	千カナダドル	<70.4%>	
AGNICO EAGLE MINES LTD	116	97	700	64,387		素材
AIR CANADA	71	71	165	15,240		運輸
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	436	326	1,601	147,223		食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	117	90	238	21,906		公益事業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	270	270	503	46,323		公益事業
ATCO LTD -CLASS I	41	23	93	8,617		公益事業
B2GOLD CORP	557	420	231	21,272		素材
BARRICK GOLD CORP	941	667	1,616	148,609		素材
BANK OF MONTREAL	335	241	3,319	305,090		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	604	469	3,865	355,353		銀行
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	83	170	15,635		資本財
BCE INC	59	30	189	17,419		電気通信サービス
BAUSCH HEALTH COS INC	126	126	455	41,891		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	666	496	3,781	347,619		各種金融
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	54	269	24,764		公益事業
CAE INC	141	102	391	35,977		資本財
CAMECO CORP	198	142	468	43,082		エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	220	179	2,698	248,049		銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	573	470	2,483	228,300		エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	366	275	4,555	418,726		運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	31	19	361	33,223		小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	73	45	159	14,666		公益事業
CANOPY GROWTH CORP	117	91	153	14,131		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	80	57	389	35,829		素材
CENOVUS ENERGY INC	551	551	817	75,122		エネルギー
CGI INC	104	89	1,020	93,839		ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	99	—	—	—		各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	9	7	1,751	161,038		ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	69	258	2,400	220,685		運輸
CRONOS GROUP INC	72	—	—	—		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	155	117	668	61,449		小売
EMPIRE CO LTD 'A'	82	69	260	23,956		食品・生活必需品小売り
EMERA INC	120	75	447	41,102		公益事業
ENBRIDGE INC	1,029	784	4,147	381,262		エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	14	11	566	52,091		保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	—	226	696	64,021		素材
FIRSTSERVICE CORP	—	17	442	40,642		不動産
FORTIS INC	249	196	1,081	99,399		公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	97	76	1,366	125,574		素材
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	57	293	26,972		商業・専門サービス
GILDAN ACTIVEWEAR INC	99	64	291	26,774		耐久消費財・アパレル
GREAT-WEST LIFE CO INC	148	89	331	30,430		保険
HYDRO ONE LTD	198	117	353	32,501		公益事業
IA FINANCIAL CORP INC	65	38	293	26,941		保険
IGM FINANCIAL INC	33	33	162	14,913		各種金融
IMPERIAL OIL LTD	162	96	429	39,517		エネルギー
INTER PIPELINE LTD	245	—	—	—		エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	80	69	1,185	109,010		保険
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	210	205	18,917		素材
KEYERA CORP	122	84	270	24,837		エネルギー
KINROSS GOLD CORP	618	460	368	33,844		素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	125	106	603	55,469		素材
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	43	529	48,649		ソフトウェア・サービス
LOBLAW COMPANIES LTD	92	55	522	48,061		食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
LUNDIN MINING CORP	354	211	224	20,665	素材	
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,060	795	1,997	183,570	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	132	118	1,183	108,748	自動車・自動車部品	
METRO INC	125	77	489	44,959	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	182	126	1,313	120,750	銀行	
NORTHLAND POWER INC	—	86	344	31,620	公益事業	
NUTRIEN LTD	285	216	1,893	174,035	素材	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	22	359	33,084	ソフトウェア・サービス	
ONEX CORPORATION	46	27	270	24,844	各種金融	
OPEN TEXT CORP	137	109	684	62,890	ソフトウェア・サービス	
PAN AMERICAN SILVER CORP	111	87	288	26,544	素材	
PARKLAND CORP	73	61	228	21,046	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	289	224	938	86,238	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	232	232	989	90,916	保険	
QUEBECOR INC -CL B	102	61	192	17,657	メディア・娯楽	
BLACKBERRY LTD	278	222	304	27,946	ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	156	123	897	82,519	消費者サービス	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	58	40	343	31,531	商業・専門サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	155	115	654	60,167	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	725	554	7,348	675,445	銀行	
SAPUTO INC	96	96	296	27,288	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS-A	55	43	7,734	710,948	ソフトウェア・サービス	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	297	174	606	55,738	メディア・娯楽	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	249	185	955	87,844	素材	
SSR MINING INC	100	—	—	—	素材	
SUN LIFE FINANCIAL INC	322	232	1,642	150,968	保険	
SUNCOR ENERGY INC	802	599	1,745	160,439	エネルギー	
TELUS CORP	213	126	355	32,635	電気通信サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	253	179	635	58,390	素材	
THOMSON REUTERS CORP	85	65	964	88,685	商業・専門サービス	
TMX GROUP LTD	30	18	244	22,437	各種金融	
TORONTO-DOMINION BANK	923	705	6,313	580,333	銀行	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	37	406	37,355	資本財	
TC ENERGY CORP	496	387	2,629	241,746	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	37	389	35,816	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	49	33	465	42,768	食品・生活必需品小売り	
WSP GLOBAL INC	58	40	691	63,567	資本財	
YAMANA GOLD INC	507	328	178	16,401	素材	
小 計	株 数	金 額	19,847	15,668	97,573	8,968,924
銘柄 数 < 比 率 >	81	88	—	< 3.5% >		
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	96	73	2,033	268,491	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE-REG	212	158	3,147	415,584	保険	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	173	132	1,158	152,992	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	28	17	124	16,477	自動車・自動車部品	
BASF SE	466	353	2,234	295,057	素材	
BAYER AG-REG	510	363	1,762	232,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIERSDORF AG	54	38	363	47,963	家庭用品・パーソナル用品	
BECHTLE AG	—	36	239	31,642	ソフトウェア・サービス	
BRENNTAG SE	67	60	499	66,021	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	19	16	277	36,620	ヘルスケア機器・サービス	
COMMERZBANK AG	485	388	251	33,207	銀行	
CONTINENTAL AG	59	43	427	56,485	自動車・自動車部品	
COVESTRO AG	91	74	415	54,834	素材	
DAIMLER AG	427	332	2,752	363,526	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE BOERSE AG	103	72	1,045	138,099	各種金融	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	1,066	818	953	125,881	各種金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	508	383	2,040	269,432	運輸	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	1,762	1,293	2,105	278,077	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	161	123	638	84,296	不動産	
VONOVIA SE	276	221	1,185	156,585	不動産	
DELIVERY HERO SE	69	60	679	89,756	小売	
E.ON SE	1,194	863	932	123,088	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG	114	85	242	32,026	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & FRAPORT AG	114	82	512	67,622	ヘルスケア機器・サービス	
FRESENIUS SE & CO KGAA	27	—	—	—	運輸	
FUCHS PETROLUB SE-PRF	228	166	689	91,050	ヘルスケア機器・サービス	
GEA GROUP AG	29	29	124	16,397	素材	
HANNOVER RUECK SE-REG	66	66	271	35,839	資本財	
HEIDELBERGCEMENT AG	30	22	351	46,368	保険	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	75	57	366	48,358	素材	
HENKEL AG & CO KGAA	98	64	487	64,325	家庭用品・パーソナル用品	
HELLOFRESH SE	44	44	317	41,977	家庭用品・パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	—	60	483	63,818	小売	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	14	—	—	—	資本財	
KION GROUP AG	654	505	1,972	260,419	半導体・半導体製造装置	
KNORR-BREMSE AG	38	22	200	26,516	資本財	
LANXESS AG	29	29	272	36,002	資本財	
LEG IMMOBILIEN SE	51	31	183	24,285	素材	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	38	24	330	43,689	不動産	
MERCK KGAA	119	238	130	17,261	運輸	
METRO WHOLESAL & FOOD SPECI	60	51	1,042	137,651	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MTU AERO ENGINES AG	58	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	25	20	365	48,320	資本財	
NEMTSCHKE SE	68	55	1,374	181,469	保険	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	30	17	180	23,885	ソフトウェア・サービス	
PUMA SE	82	56	524	69,316	自動車・自動車部品	
QIAGEN N.V.	45	45	462	61,044	耐久消費財・アパレル	
RATIONAL AG	121	96	451	59,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE AG	—	2	196	25,961	資本財	
SAP SE	318	246	802	105,930	公益事業	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	532	402	4,983	658,039	ソフトウェア・サービス	
SCOUT24 SE	18	10	613	80,976	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	58	38	237	31,376	メディア・娯楽	
SIEMENS AG-REG	122	112	671	88,619	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS ENERGY AG	389	295	4,101	541,659	資本財	
SYMRISE AG	201	158	375	49,582	資本財	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	64	53	629	83,072	素材	
TEAMVIEWER AG	547	324	74	9,823	電気通信サービス	
THYSSENKRUPP AG	70	70	90	11,916	ソフトウェア・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	193	—	—	—	素材	
UNIPER SE	67	40	125	16,601	電気通信サービス	
VOLKSWAGEN AG	117	35	135	17,904	公益事業	
VOLKSWAGEN AG-PFD	19	12	357	47,256	自動車・自動車部品	
ZALANDO SE	91	71	1,474	194,682	自動車・自動車部品	
	73	82	660	87,258	小売	
小 計	株数・金額	12,991	9,759	52,138	6,884,903	
	銘柄数<比率>	62	61	—	<2.7%>	
(ユーロ…イタリア)						
AMPLIFON SPA	—	56	250	33,054	ヘルスケア機器・サービス	
ATLANTIA SPA	303	187	303	40,088	運輸	
DIASORIN SPA	13	9	177	23,462	ヘルスケア機器・サービス	
ENEL SPA	4,139	3,155	2,228	294,264	公益事業	
ENI SPA	1,398	968	1,189	157,033	エネルギー	
FINECOBANK SPA	261	261	438	57,893	銀行	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	220	—	—	—	資本財	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	490	387	724	95,630	保険
INTESA SANPAOLO	8,295	6,438	1,585	209,419	銀行
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	151	146	19,374	電気通信サービス
MEDIOBANCA SPA	339	200	208	27,521	銀行
MONCLER SPA	122	88	541	71,484	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	202	171	301	39,757	ソフトウェア・サービス
PIRELLI & C SPA	241	—	—	—	自動車・自動車部品
POSTE ITALIANE SPA	257	195	244	32,312	保険
PRYSMIAN SPA	131	95	311	41,125	資本財
RECORDATI SPA	65	39	206	27,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SNAM SPA	1,199	793	388	51,310	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	5,352	3,177	106	14,104	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	3,347	1,980	68	9,017	電気通信サービス
TERNA SPA	773	490	316	41,782	公益事業
UNICREDIT SPA	1,138	838	950	125,488	銀行
小 計	株 数	株 数	10,688	1,411,416	
銘柄数 < 比率 >	28,292	19,688	—	< 0.6% >	
(ユーロ…フランス)					
ACCOR SA	76	76	227	30,027	消費者サービス
ADP	17	10	119	15,782	運輸
ATR LIQUIDE SA	241	183	2,621	346,123	素材
ALSTOM	89	116	359	47,474	資本財
AMUNDI SA	33	21	166	21,957	各種金融
ARKEMA	30	22	259	34,299	素材
ATOS SE	52	38	178	23,629	ソフトウェア・サービス
AXA SA	1,032	742	1,775	234,506	保険
BIOMERIEUX	21	13	141	18,647	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS	594	434	2,526	333,615	銀行
BOLLORE	474	335	170	22,470	メディア・娯楽
BOUYGUES SA	119	94	324	42,859	資本財
BUREAU VERITAS SA	144	109	295	38,976	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	87	61	1,145	151,295	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	317	247	379	50,112	食品・生活必需品小売り
CNP ASSURANCES	103	60	94	12,514	保険
CREDIT AGRICOLE SA	702	407	531	70,241	銀行
DANONE	322	252	1,419	187,415	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SE	72	258	1,211	159,964	ソフトウェア・サービス
DASSAULT AVIATION SA	1	9	80	10,660	資本財
EDENRED	133	96	468	61,839	ソフトウェア・サービス
EIFFAGE	32	32	285	37,689	資本財
EDF	324	169	216	28,651	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	150	111	1,899	250,894	耐久消費財・アパレル
EURAZEO SE	18	18	152	20,188	各種金融
FAURECIA	46	42	180	23,789	自動車・自動車部品
ORANGE S. A.	1,115	769	739	97,654	電気通信サービス
ENGIE	898	701	848	111,978	公益事業
GETLINK	248	147	194	25,723	運輸
HERMES INTERNATIONAL	15	12	1,655	218,649	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	5	—	—	—	電気通信サービス
IPSEN	22	13	120	15,865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	51	—	—	—	メディア・娯楽
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	141	107	7,125	940,880	耐久消費財・アパレル
L'OREAL	128	99	3,806	502,616	家庭用品・パーソナル用品
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	39	39	169	22,391	消費者サービス
LEGRAND SA	138	105	980	129,540	資本財
MICHELIN (CGDE)-B	82	66	894	118,094	自動車・自動車部品
NATIXIS	495	—	—	—	各種金融
ORPEA	27	17	162	21,490	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額	額		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
PERNOD-RICARD SA	111	80	1,612	212,967	食品・飲料・タバコ	
PEUGEOT SA	278	—	—	—	自動車・自動車部品	
KERING	37	29	1,892	249,901	耐久消費財・アパレル	
PUBLICIS GROUPE	86	86	488	64,544	メディア・娯楽	
RENAULT SA	108	68	211	27,965	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	13	8	142	18,792	食品・飲料・タバコ	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	17	11	560	73,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAFRAN SA	168	135	1,460	192,812	資本財	
SANOFI	574	437	3,744	494,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	287	195	1,173	154,948	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	281	208	2,935	387,625	資本財	
SCOR SE	74	74	184	24,335	保険	
SEB SA	13	8	105	13,924	耐久消費財・アパレル	
SODEXO	40	40	310	40,981	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	410	313	901	119,000	銀行	
SUEZ	209	132	262	34,675	公益事業	
TELEPERFORMANCE	27	24	864	114,115	商業・専門サービス	
THALES SA	56	37	304	40,214	資本財	
TOTALENERGIES SE	1,259	964	4,238	559,653	エネルギー	
UBISOFT ENTERTAINMENT	48	35	162	21,520	メディア・娯楽	
VALEO SA	123	80	195	25,788	自動車・自動車部品	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	302	246	694	91,703	公益事業	
VINCI SA	260	204	1,840	243,021	資本財	
VIVENDI SE	458	277	311	41,194	メディア・娯楽	
WENDEL	16	10	113	14,948	各種金融	
WORLDDLINE SA	102	89	595	78,592	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数	金 額	14,021	9,848	59,236	7,822,142
銘 柄 数 < 比 率 >	66	62	—	—	—	< 3.1% >
(ユーロ…オランダ)						
ABN AMRO BANK NV-CVA	223	133	172	22,765	銀行	
ADYEN NV	9	7	2,076	274,165	ソフトウェア・サービス	
AEGON NV	779	779	353	46,669	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	574	422	1,197	158,113	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	106	68	660	87,211	素材	
ALTICE EUROPE NV	344	—	—	—	電気通信サービス	
ARGENX SE	22	18	459	60,645	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASM INTERNATIONAL NV	—	18	661	87,348	半導体・半導体製造装置	
ASML HOLDING NV	217	162	11,142	1,471,350	半導体・半導体製造装置	
CNH INDUSTRIAL NV	617	422	643	84,914	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	311	229	297	39,266	食品・飲料・タバコ	
AIRBUS GROUP SE	287	226	2,452	323,802	資本財	
EXOR NV	55	34	271	35,908	各種金融	
FERRARI NV	65	49	986	130,244	自動車・自動車部品	
STELLANTIS NV	606	753	1,319	174,254	自動車・自動車部品	
HEINEKEN NV	121	104	962	127,099	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	63	40	310	40,978	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV-CVA	1,931	1,516	1,993	263,297	銀行	
JDE PEET'S NV	—	24	61	8,163	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	90	65	1,226	161,920	素材	
KONINKLIJKE KPN NV	1,949	1,316	357	47,148	電気通信サービス	
NN GROUP NV	141	99	457	60,378	保険	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	462	360	1,487	196,393	ヘルスケア機器・サービス	
PROSUS	244	361	2,769	365,646	小売	
RANDSTAD NV	49	49	307	40,609	商業・専門サービス	
JUST EAT TAKEAWAY	65	65	434	57,426	小売	
UNILEVER PLC	743	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	—	277	691	91,287	メディア・娯楽	
VOPAK	35	25	86	11,464	エネルギー	

銘柄	株数	金額	当 期 末		業 種 等
			株数	金額	
			評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
			千ユーロ	千円	
(ユーロ…オランダ)	百株		百株		
WOLTERS KLUWER	131		103	954	126,066
小 計	10,250		7,736	34,793	4,594,541
	株数・金額 銘柄数<比率>		27	28	-
					<1.8%>
(ユーロ…スペイン)					
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	104		104	239	31,570
AENA SA	39		28	400	52,906
AMADEUS IT GROUP SA	231		170	942	124,391
BANKINTER SA	406		-	-	-
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,096		2,608	1,487	196,389
BANCO SANTANDER SA	8,440		6,827	2,265	299,186
CELLNEX TELECOM SA	154		203	1,097	144,913
CAIXABANK S.A	1,500		1,630	424	56,087
EDP RENOVAVEIS SA	-		104	247	32,657
ENDESA SA	163		107	203	26,892
ENAGAS SA	123		82	160	21,168
FERROVIAL SA	233		184	501	66,271
NATURGY ENERGY GROUP SA	151		90	199	26,283
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	117		102	221	29,270
GRIFOLS SA	165		99	202	26,748
IBERDROLA SA	3,023		2,280	2,200	290,615
INDITEX	522		421	1,295	171,070
MAPPRE SA	598		-	-	-
RED ELECTRICA CORPORACION SA	192		192	340	44,897
REPSOL SA	811		576	673	88,899
TELEFONICA SA	2,676		2,021	772	102,031
小 計	22,754		17,837	13,875	1,832,250
	株数・金額 銘柄数<比率>		20	19	-
					<0.7%>
(ユーロ…ベルギー)					
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	372		295	1,431	189,073
PROXIMUS	82		56	96	12,793
COLRUYT SA	23		23	99	13,109
ELIA GROUP SA/NV	16		9	95	12,664
AGEAS	91		67	286	37,895
GALAPAGOS NV	26		-	-	-
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	62		40	402	53,198
KBC GROEP NV	143		97	783	103,415
SOLVAY SA	32		32	340	44,990
SOFINA	8		4	181	24,009
TELENET GROUP HOLDING NV	21		-	-	-
UCB SA	68		49	499	65,920
UMICORE	103		79	396	52,335
小 計	1,051		755	4,614	609,405
	株数・金額 銘柄数<比率>		13	11	-
					<0.2%>
(ユーロ…オーストリア)					
ANDRITZ AG	38		-	-	-
ERSTE GROUP BANK AG	129		114	431	56,950
VERBUND AG	27		27	266	35,204
OMV AG	78		54	301	39,770
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	77		53	137	18,124
VOESTALPINE AG	71		42	136	18,044
小 計	422		293	1,272	168,095
	株数・金額 銘柄数<比率>		6	5	-
					<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)					
AROUNDTOWN SA	564		335	201	26,584
ARCELORMITTAL	359		288	819	108,183
EUROFINS SCIENTIFIC	5		54	561	74,190
SES	216		-	-	-

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	価 値		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円	
TENARIS SA	199	199	200	26,468	エネルギー
小 計	1,345	877	1,782	235,427	
	株数・金額 銘柄数<比率>	5	4	—	<0.1%>
(ユーロ…フィンランド)					
ELISA OYJ	54	54	289	38,290	電気通信サービス
FORTUM OYJ	272	164	445	58,785	公益事業
KESKO OYJ-B SHS	—	109	329	43,472	食品・生活必需品小売り
KONE OYJ-B	161	136	794	104,899	資本財
NESTE OYJ	228	163	836	110,509	エネルギー
NOKIA OYJ	3,015	2,080	1,036	136,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ORION OYJ-CLASS B	51	40	148	19,592	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ-A SHS	242	202	938	123,876	保険
STORA ENSO OYJ-R SHS	293	193	278	36,747	素材
UPM-KYMMENE OYJ	294	195	605	79,895	素材
WARTSILA OYJ ABP	211	211	225	29,842	資本財
小 計	4,826	3,552	5,927	782,790	
	株数・金額 銘柄数<比率>	10	11	—	<0.3%>
(ユーロ…アイルランド)					
CRH PLC	423	298	1,235	163,146	素材
KERRY GROUP PLC-A	84	58	693	91,543	食品・飲料・タバコ
KINGSPAN GROUP PLC	78	62	602	79,505	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	78	67	1,125	148,591	消費者サービス
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	118	84	370	48,930	素材
小 計	784	571	4,026	531,718	
	株数・金額 銘柄数<比率>	5	5	—	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	1,521	1,137	556	73,539	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	212	212	201	26,573	エネルギー
JERONIMO MARTINS	151	90	174	23,032	食品・生活必需品小売り
小 計	1,886	1,441	932	123,145	
	株数・金額 銘柄数<比率>	3	3	—	<0.0%>
(ユーロ…スイス)					
STMICROELECTRONICS NV	326	260	998	131,810	半導体・半導体製造装置
小 計	326	260	998	131,810	
	株数・金額 銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>
ユ ー ロ 計	98,953	72,621	190,288	25,127,649	
	株数・金額 銘柄数<比率>	238	230	—	<9.9%>
(イギリス)					
3I GROUP PLC	504	368	千イギリスポンド	488	各種金融
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	189	149	261	40,985	食品・飲料・タバコ
ADMIRAL GROUP PLC	108	65	197	30,890	保険
ANGLO AMERICAN PLC	622	506	1,425	223,259	素材
ANTOFAGASTA PLC	250	143	212	33,239	素材
ASTRAZENECA PLC	671	597	5,346	837,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHTED GROUP PLC	248	173	1,016	159,274	資本財
AUTO TRADER GROUP PLC	488	364	219	34,315	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC	34	45	164	25,761	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC	1,992	1,585	629	98,543	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,168	844	2,180	341,468	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC ORD	1,755	1,210	694	108,792	資本財
BARCLAYS PLC	8,818	6,684	1,340	210,013	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	407	407	263	41,199	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	66	45	192	30,138	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	1,058	810	1,617	253,407	素材
BP PLC	10,245	7,785	2,807	439,745	エネルギー
BT GROUP PLC	4,710	3,558	481	75,351	電気通信サービス
BUNZL PLC	138	138	357	56,038	資本財
BURBERRY GROUP PLC	231	141	267	41,856	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
COCA-COLA HBC AG-CDI	76	76	189	29,748	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	911	693	999	156,515	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	55	55	513	80,417	素材
DCC PLC	52	38	237	37,177	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	735	510	144	22,556	保険
DIAGEO PLC	1,190	900	3,259	510,576	食品・飲料・タバコ
EVRAZ PLC	271	217	139	21,907	素材
EXPERIAN PLC	442	354	1,164	182,331	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	5,407	3,852	1,432	224,374	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	2,554	1,935	2,757	431,808	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTAIN PLC	309	214	457	71,625	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	130	130	202	31,780	各種金融
HALMA PLC	164	146	432	67,688	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	76	76	189	29,616	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	10,372	7,870	3,487	546,145	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	512	374	586	91,808	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	92	78	383	60,054	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	84	60	295	46,294	商業・専門サービス
INFORMA PLC	728	565	292	45,885	メディア・娯楽
JD SPORTS FASHION PLC	225	194	207	32,460	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	110	65	179	28,038	素材
KINGFISHER PLC	1,149	883	303	47,524	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,292	2,375	670	105,008	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	36,352	27,374	1,335	209,116	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	169	127	947	148,461	各種金融
M&G PLC	1,343	995	195	30,652	各種金融
MELROSE INDUSTRIES PLC	2,227	1,629	260	40,788	資本財
MONDI PLC	209	183	328	51,428	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	1,299	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	1,880	1,408	1,284	201,101	公益事業
NEXT PLC	67	54	429	67,266	小売
NMC HEALTH PLC	80	80	0	0	ヘルスケア機器・サービス
OCADO GROUP PLC	246	200	366	57,400	食品・生活必需品小売り
PERSIMMON PLC	135	135	356	55,875	耐久消費財・アパレル
PEARSON PLC	440	262	165	25,885	メディア・娯楽
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	248	163	25,614	保険
PRUDENTIAL PLC	1,263	1,022	1,496	234,409	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	362	283	1,551	243,050	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,005	740	1,648	258,124	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	945	789	467	73,278	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	578	431	2,058	322,388	素材
NATWEST GROUP PLC	3,024	2,078	482	75,516	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,016	1,592	2,827	442,909	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	1,848	1,441	2,578	403,855	エネルギー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	980	3,210	425	66,640	資本財
RSA INSURANCE GROUP PLC	551	—	—	—	保険
SAINSBURY (J) PLC	978	595	176	27,575	食品・生活必需品小売り
SAGE GROUP PLC/THE	577	428	307	48,100	ソフトウェア・サービス
SCHRODERS PLC	69	41	147	23,058	各種金融
SSE PLC	509	398	643	100,795	公益事業
SEVERN TRENT PLC	115	115	306	48,012	公益事業
SMITHS GROUP PLC	211	154	214	33,619	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	457	350	454	71,164	ヘルスケア機器・サービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	39	26	402	62,975	資本財
ST JAMES'S PLACE PLC	326	192	299	46,876	各種金融
ABRDN PLC	1,243	885	227	35,614	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	1,314	1,097	536	84,056	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	2,071	1,240	185	29,045	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	金額	期末		
					株数	金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円			
TESCO PLC	4,628	3,045	833	130,537			食品・生活必需品小売り
UNILEVER PLC	594	1,009	3,916	613,452			家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	370	261	261	40,906			公益事業
VODAFONE GROUP PLC	13,007	10,974	1,215	190,304			電気通信サービス
WHITBREAD PLC	107	82	260	40,815			消費者サービス
FERGUSON PLC	112	87	945	148,027			資本財
WPP PLC	501	501	472	74,031			メディア・娯楽
小計	株数・銘柄数	金額	146,921	113,073	69,864	10,942,240	
		<比率>	84	83	-	<4.3%>	
(スイス)			千スイスフラン				
ABB LTD-REG	977	674	2,026	250,538			資本財
ADECCO GROUP AG-REG	89	54	258	31,978			商業・専門サービス
ALCON INC	252	188	1,425	176,244			ヘルスケア機器・サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	24	16	233	28,841			保険
CLARIANT AG-REG	126	75	135	16,717			素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,288	1,046	1,021	126,357			各種金融
VIFOR PHARMA AG	25	19	240	29,721			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEBERIT AG-REG	19	14	1,041	128,816			資本財
GIVAUDAN-REG	4	3	1,613	199,521			素材
HOLCIM LTD	265	216	980	121,287			素材
JULIUS BAER GROUP LTD	117	81	538	66,613			各種金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	25	19	581	71,875			運輸
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.06	0.04	437	54,109			食品・飲料・タバコ
LONZA GROUP AG-REG	36	28	2,174	268,896			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG	1,520	1,111	12,980	1,605,018			食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG	1,134	856	6,596	815,623			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	10	8	1,399	173,011			各種金融
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	281	202	2,266	280,245			耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	358	271	9,707	1,200,339			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	22	14	358	44,341			資本財
SGS SA-REG	3	2	713	88,208			商業・専門サービス
SIKA AG-REG	72	55	1,728	213,700			素材
SONOVA HOLDING AG-REG	31	22	847	104,745			ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	15	11	576	71,275			保険
SWISSCOM AG-REG	15	10	602	74,454			電気通信サービス
SWISS RE AG	151	122	1,001	123,832			保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	16	10	244	30,170			耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	1,871	1,423	2,329	288,026			各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG	78	56	2,233	276,132			保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG	1	1	262	32,427			食品・飲料・タバコ
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	15	8	62	7,769			銀行
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	4	2	251	31,148			素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.44	0.44	471	58,323			食品・飲料・タバコ
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	90	66	545	67,428			テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ROCHE HOLDING AG-BR	-	12	484	59,862			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING AG-REG	10	5	140	17,348			資本財
STRAUMANN HOLDING AG-REG	4	4	799	98,848			ヘルスケア機器・サービス
SWISS PRIME SITE-REG	42	25	239	29,634			不動産
TEMENOS AG	34	26	309	38,323			ソフトウェア・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	31	18	87	10,806			耐久消費財・アパレル
小計	株数・銘柄数	金額	9,073	6,793	59,947	7,412,566	
		<比率>	39	40	-	<2.9%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ				
ALFA LAVAL AB	178	105	3,498	46,283			資本財
ASSA ABLOY AB-B	513	385	9,520	125,955			資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	332	257	14,215	188,072			資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	191	153	7,237	95,757			資本財
BOLIDEN AB	146	108	3,344	44,245			素材

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
ELECTROLUX AB-B	135	80	1,605	21,237	耐久消費財・アパレル	
EMBRACER GROUP AB	—	186	1,530	20,254	メディア・娯楽	
EPIROC AB-A	389	275	5,900	78,062	資本財	
EPIROC AB-B	154	154	2,796	36,997	資本財	
EQT AB	124	106	4,769	63,102	各種金融	
ERICSSON LM-B SHS	1,468	1,154	11,098	146,828	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	342	210	5,835	77,197	家庭用品・パーソナル用品	
EVOLUTION AB	69	68	10,268	135,845	消費者サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	45	2,821	37,328	不動産	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	372	301	5,002	66,188	小売	
HEXAGON AB-B SHS	155	788	10,953	144,919	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUSQVARNA AB-B SHS	251	150	1,708	22,603	耐久消費財・アパレル	
ICA GRUPPEN AB	42	42	1,843	24,394	食品・生活必需品小売り	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	100	59	1,653	21,875	各種金融	
INVESTOR AB-B SHS	216	693	13,802	182,600	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	42	1,199	15,867	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS(N)	—	7	207	2,740	各種金融	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	68	68	2,116	28,005	資本財	
KINNEVIK AB - B	124	102	3,462	45,813	各種金融	
LUNDBERGS AB-B SHS	39	23	1,178	15,596	各種金融	
LUNDIN ENERGY AB	102	85	3,083	40,798	エネルギー	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	168	561	6,992	92,515	資本財	
NORDEA BANK ABP	1,710	1,284	14,295	189,130	銀行	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	780	624	8,655	114,513	銀行	
SANDVIK AB	578	457	10,101	133,642	資本財	
SECURITAS AB-B SHS	146	146	2,142	28,344	商業・専門サービス	
SINCH AB	—	188	3,229	42,719	ソフトウェア・サービス	
SKANSKA AB-B SHS	192	114	2,510	33,209	資本財	
SKF AB-B SHARES-B	199	140	3,053	40,400	資本財	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	329	223	3,069	40,614	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	919	477	4,754	62,905	銀行	
SWEDBANK AB - A SHARES	426	362	7,076	93,624	銀行	
SWEDISH MATCH AB	81	632	5,067	67,041	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	312	187	2,297	30,401	電気通信サービス	
TELIA CO AB	1,128	942	3,334	44,119	電気通信サービス	
VOLVO AB-B SHS-B	708	576	11,459	151,602	資本財	
VOLVO AB-A SHS	—	71	1,432	18,952	資本財	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,199	12,647	220,129	2,912,311	
(ノルウェー)		36	42	—	<1.1%>	
ADEVINTA ASA	114	114	1,741	23,734	メディア・娯楽	
DNB ASA	499	—	—	—	銀行	
DNB BANK ASA	—	397	8,501	115,878	銀行	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	114	68	1,428	19,473	保険	
MOWI ASA	257	153	3,799	51,790	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO A S	628	538	3,554	48,448	素材	
ORKLA ASA	381	226	1,773	24,169	食品・飲料・タバコ	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	24	1,103	15,040	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	51	38	1,521	20,734	メディア・娯楽	
EQUINOR ASA	503	374	8,808	120,062	エネルギー	
TELENOR ASA	431	239	3,276	44,656	電気通信サービス	
YARA INTERNATIONAL ASA	94	76	3,289	44,831	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,076	2,250	38,798	528,821	
(デンマーク)		10	11	—	<0.2%>	
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	3	2	4,124	73,207	運輸	
AP MOELLER - MAERSK A/S - A	1	1	2,452	43,537	運輸	
AMBU A/S-B	87	67	1,263	22,432	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	株数	株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	53	39	4,163	73,898	食品・飲料・タバコ	
CHR HANSEN HOLDING A/S	53	38	1,949	34,611	素材	
COLOPLAST-B	53	42	4,642	82,407	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	318	207	2,409	42,760	銀行	
ORSTED A/S	99	73	6,610	117,334	公益事業	
DSV A/S	108	76	11,650	206,804	運輸	
GENMAB A/S	31	25	7,641	135,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GN STORE NORD A/S	69	49	2,117	37,589	ヘルスケア機器・サービス	
H LUNDBECK A/S	42	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVO NORDISK A/S-B	878	652	44,465	789,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	116	79	3,634	64,513	素材	
PANDORA A/S	44	40	3,623	64,323	耐久消費財・アパレル	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	3	1,126	20,002	資本財	
TRYG A/S	60	154	2,379	42,232	保険	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	99	391	10,574	187,700	資本財	
DEMANT A/S	44	44	1,361	24,164	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株数・金額	2,167	1,991	116,192	2,062,413	
	銘柄数<比率>	18	18	—	<0.8%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
AFTERPAY LTD	115	82	1,010	86,192	ソフトウェア・サービス	
AGL ENERGY LTD	357	212	132	11,283	公益事業	
AMP LTD	1,566	—	—	—	各種金融	
AUST AND NZ BANKING GROUP	1,376	1,057	2,995	255,565	銀行	
APA GROUP	662	458	391	33,423	公益事業	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	279	252	1,196	102,125	消費者サービス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD-RTS(N)	—	12	6	563	消費者サービス	
ASX LTD	101	79	644	55,012	各種金融	
BHP GROUP LTD	1,510	1,141	4,328	369,268	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD	304	183	383	32,712	素材	
BRAMBLES LTD	786	624	642	54,816	商業・専門サービス	
AMPOL LTD	141	87	274	23,403	エネルギー	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	901	689	7,266	620,014	銀行	
COCA-COLA AMATIL LTD	305	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
COCHLEAR LTD	29	29	648	55,340	ヘルスケア機器・サービス	
COMPUTERSHARE LTD	250	158	286	24,469	ソフトウェア・サービス	
COLES GROUP LTD	625	520	928	79,234	食品・生活必需品小売り	
CROWN RESORTS LTD	190	113	110	9,391	消費者サービス	
CSL LTD	232	175	5,188	442,656	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	21	281	24,028	消費者サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	504	343	29,276	食品・生活必需品小売り	
EVOLUTION MINING LTD	874	690	263	22,488	素材	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	910	660	958	81,812	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,063	951	479	40,904	保険	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	230	178	932	79,571	素材	
CIMIC GROUP LTD	48	—	—	—	資本財	
SYDNEY AIRPORT	666	470	390	33,337	運輸	
MACQUARIE GROUP LTD	167	133	2,681	228,750	各種金融	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	76	48	173	14,763	各種金融	
MEDIBANK PRIVATE LTD	1,427	925	321	27,403	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	1,568	1,295	3,722	317,602	銀行	
NEWCREST MINING LTD	417	302	764	65,234	素材	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	402	421	407	34,772	素材	
OIL SEARCH LTD	776	776	347	29,662	エネルギー	
ORIGIN ENERGY LTD	898	535	287	24,566	公益事業	
ORICA LIMITED	203	121	182	15,540	素材	
QANTAS AIRWAYS LTD	440	440	244	20,835	運輸	
QBE INSURANCE GROUP LTD	683	450	536	45,816	保険	
AURIZON HOLDINGS LTD	735	735	258	22,095	運輸	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	89	63	442	37,715	ヘルスケア機器・サービス	
REA GROUP LTD	30	18	297	25,404	メディア・娯楽	
REECE LTD	—	102	184	15,699	資本財	
RIO TINTO LTD	205	141	1,363	116,331	素材	
SANTOS LTD	949	654	477	40,736	エネルギー	
SEEK LTD	179	107	351	29,962	メディア・娯楽	
SONIC HEALTHCARE LTD	267	176	701	59,818	ヘルスケア機器・サービス	
SOUTH32 LTD	2,553	2,057	781	66,706	素材	
AUSNET SERVICES	1,173	728	181	15,468	公益事業	
SUNCORP GROUP LTD	703	572	698	59,618	保険	
TABCORP HOLDINGS LTD	978	709	356	30,459	消費者サービス	
TELSTRA CORPORATION LTD	2,318	1,820	693	59,189	電気通信サービス	
TPG TELECOM LTD	214	—	—	—	電気通信サービス	
TRANSURBAN GROUP	1,347	1,270	1,746	148,970	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	362	257	304	25,964	食品・飲料・タバコ	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	—	66	225	19,252	エネルギー	
WESTPAC BANKING CORP	1,869	1,445	3,716	317,127	銀行	
WESFARMERS LTD	595	454	2,621	223,638	小売	
WISETECH GLOBAL LTD	85	51	277	23,670	ソフトウェア・サービス	
WOOLWORTHS GROUP LTD	683	504	2,058	175,617	食品・生活必需品小売り	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	523	383	924	78,918	エネルギー	
XERO LTD	—	54	831	70,969	ソフトウェア・サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	36,462 55	27,182 57	59,249 —	5,055,181 <2.0%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
A2 MILK CO LTD	388	351	252	20,568	食品・飲料・タバコ	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	565	565	456	37,202	運輸	
FISHB & PAYKEL HEALTHCARE C	313	212	654	53,348	ヘルスケア機器・サービス	
MERIDIAN ENERGY LTD	770	459	230	18,827	公益事業	
MERCURY NZ LTD	340	204	124	10,150	公益事業	
RYMAN HEALTHCARE LTD	199	188	278	22,711	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	765	765	348	28,421	電気通信サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,342 7	2,745 7	2,344 —	191,230 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	6,167	4,661	42,399	620,735	保険	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	178	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	760	—	—	—	銀行	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,075	1,500	3,735	54,680	銀行	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	679	679	1,261	18,469	食品・飲料・タバコ	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	420	250	1,120	16,396	公益事業	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,397	1,112	5,882	86,125	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,277	770	3,647	53,403	不動産	
CLP HOLDINGS LTD	755	595	4,456	65,243	公益事業	
ESR CAYMAN LTD	—	758	1,879	27,520	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,200	920	3,854	56,434	消費者サービス	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	780	780	1,427	20,897	不動産	
HANG SENG BANK LTD	447	291	4,245	62,156	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	729	579	1,884	27,591	不動産	
HKT TRUST AND HKT LTD	2,140	1,500	1,584	23,189	電気通信サービス	
POWER ASSETS HOLDINGS	550	550	2,513	36,797	公益事業	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	1,595	950	729	10,681	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	5,926	3,842	4,503	65,927	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	604	463	22,418	328,206	各種金融	
KERRY PROPERTIES LTD	319	—	—	—	不動産	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	300	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MTR CORP	820	575	2,417	35,397	運輸	
NEW WORLD DEVELOPMENT	726	726	2,467	36,117	不動産	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	価 額		
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
PCCW LTD	2,310	—	—	電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	1,306	1,114	1,913	消費者サービス	
SINO LAND CO	1,430	1,430	1,550	不動産	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	520	1,352	運輸	
SJM HOLDINGS LTD	910	910	530	消費者サービス	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	699	529	5,446	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	300	175	871	不動産	
SWIRE PROPERTIES LTD	660	416	879	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	765	550	8,756	資本財	
WH GROUP LTD	5,305	3,393	1,788	食品・飲料・タバコ	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	638	638	2,717	不動産	
WYNN MACAU LTD	938	630	447	消費者サービス	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	820	1,849	資本財	
小 計	株数・金額	45,109	32,630	140,533	2,057,409
	銘柄数<比率>	33	31	—	<0.8%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD	1,457	—	—	—	不動産
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	1,185	405	34,249	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	289	173	128	10,892	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	886	717	2,258	190,849	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	3,526	2,111	163	13,826	消費者サービス
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	60	—	—	—	小売
KEPPEL CORP LTD	898	533	292	24,711	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	1,672	1,377	1,651	139,568	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	539	539	284	24,005	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	397	297	286	24,246	各種金融
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,705	3,691	941	79,558	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	867	519	200	16,974	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	585	418	1,123	94,954	銀行
UOL GROUP LTD	261	155	112	9,527	不動産
VENTURE CORP LTD	166	99	191	16,155	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,202	739	323	27,314	食品・飲料・タバコ
小 計	株数・金額	17,513	12,556	8,363	706,832
	銘柄数<比率>	15	14	—	<0.3%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
AZRIELI GROUP LTD	27	13	397	14,120	不動産
BANK LEUMI LE-ISRAEL	570	570	1,694	60,274	銀行
BANK HAPUALIM BM	603	455	1,400	49,798	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	12	12	569	20,255	資本財
ICL GROUP LTD	368	260	722	25,702	素材
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	644	403	777	27,647	銀行
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	82	49	555	19,762	銀行
NICE LTD	33	25	2,322	82,613	ソフトウェア・サービス
小 計	株数・金額	2,341	1,789	8,440	300,174
	銘柄数<比率>	8	8	—	<0.1%>
合 計	株数・金額	555,905	423,944	—	245,047,142
	銘柄数<比率>	1,214	1,227	—	<96.5%>

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

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率	
	口 数	口 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円	%	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,530	5,240	1,094	124,626	0.0	
PROLOGIS INC	37,598	28,678	4,161	473,666	0.2	
AMERICAN TOWER CORP	22,659	17,649	5,022	571,717	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	31,970	19,130	316	36,016	0.0	
VEREIT INC	64,364	8,272	429	48,916	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	60,900	60,900	531	60,449	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,785	5,375	1,251	142,417	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	8,457	5,977	700	79,779	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	5,330	4,040	637	72,613	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	21,200	16,670	2,961	337,080	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,105	11,095	1,738	197,928	0.1	
DUKE REALTY CORPORATION	19,465	14,585	812	92,473	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,990	6,300	541	61,673	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	18,430	14,290	1,218	138,686	0.1	
EQUINIX INC	4,518	3,463	2,849	324,334	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,140	2,480	830	94,533	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,100	5,110	963	109,627	0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	3,945	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	28,055	20,375	701	79,876	0.0	
WELLTOWER INC	19,850	16,720	1,353	154,124	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	39,369	27,179	457	52,068	0.0	
INVITATION HOMES INC	30,340	22,810	935	106,532	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	11,725	11,725	539	61,380	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	31,900	20,100	407	46,331	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,520	4,250	855	97,374	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,590	—	—	—	—	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,160	11,160	333	37,957	0.0	
PUBLIC STORAGE	8,079	6,119	2,010	228,815	0.1	
REALTY INCOME CORP	18,530	15,030	1,110	126,381	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	6,695	6,695	471	53,651	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,620	4,250	1,484	168,944	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	15,394	12,974	1,904	216,843	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	4,380	4,380	884	100,712	0.0	
UDR INC	16,160	9,590	524	59,679	0.0	
VENTAS INC	20,225	14,825	808	92,004	0.0	
VICI PROPERTIES INC	21,340	21,340	644	73,335	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	6,851	6,851	306	34,898	0.0	
WEYERHAEUSER CO	36,698	28,918	1,091	124,197	0.0	
WP CAREY INC	9,580	6,460	501	57,106	0.0	
小 計	口 数・金 額	702,547	501,005	43,387	4,938,756	
	銘柄 数 < 比 率 >	39	37	—	< 1.9% >	
(カナダ)				千カナダドル		
CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	4,700	2,800	171	15,764	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	—	—	—	—	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	6,760	—	—	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額 千カナダドル	邦貨換算金額 千円	
(カナダ) RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	22,650 4	2,800 1	171 —	15,764 <0.0%>
(ユーロ…フランス)			千ユーロ		
COVIVIO	2,655	1,925	140	18,566	0.0
GECINA SA	2,350	1,950	235	31,054	0.0
ICADE	1,965	—	—	—	—
KLEPIERRE	10,512	6,642	136	18,058	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,700	5,360	355	46,883	0.0
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	25,182 5	15,877 4	867 —	114,563 <0.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND COMPANY PLC	49,131	36,981	179	28,085	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	34,134	26,624	179	28,179	0.0
SEGRO PLC	62,233	45,033	580	90,843	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	145,498 3	108,638 3	939 —	147,108 <0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
VICINITY CENTRES	191,002	178,802	321	27,459	0.0
DEXUS	57,587	—	—	—	—
DEXUS/AU	—	35,587	395	33,733	0.0
GOODMAN GROUP	76,082	63,582	1,434	122,383	0.0
GPT GROUP	120,435	71,335	377	32,196	0.0
LENLEASE GROUP	28,927	28,927	310	26,531	0.0
MIRVAC GROUP	208,775	135,075	399	34,112	0.0
SCENTRE GROUP	241,771	198,271	614	52,441	0.0
STOCKLAND	151,600	96,900	459	39,187	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,076,179 8	808,479 8	4,313 —	368,046 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	101,800	87,500	5,998	87,812	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	101,800 1	87,500 1	5,998 —	87,812 <0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	160,312	116,243	356	30,158	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	162,540	—	—	—	—
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	132,400	209,556	444	37,544	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	121,400	72,200	155	13,118	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	136,800	139,399	277	23,443	0.0
SUNTEC REIT	91,400	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	804,852 6	537,398 4	1,233 —	104,264 <0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,878,708 66	2,061,697 58	— —	5,776,317 <2.3%>

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引		百万円	百万円
		DJSTX5	503	—
		SP EMINI	2,723	—

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

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月26日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
	千円	%
株式	245,047,142	96.4
投資証券	5,776,317	2.3
コール・ローン等、その他	3,292,523	1.3
投資信託財産総額	254,115,982	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（252,828,303千円）の投資信託財産総額（254,115,982千円）に対する比率は99.5%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.83円、1カナダドル=91.92円、1ユーロ=132.05円、1イギリスポンド=156.62円、1スイスフラン=123.65円、1スウェーデンクローナ=13.23円、1ノルウェークローネ=13.63円、1デンマーククローネ=17.75円、1オーストラリアドル=85.32円、1ニュージーランドドル=81.57円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=84.51円、1イスラエルシェケル=35.5652円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	255,536,105,823	
コール・ローン等	2,371,479,428	
株式(評価額)	245,047,142,640	
投資証券(評価額)	5,776,317,242	
未収入金	1,571,198,176	
未収配当金	150,233,334	
差入委託証拠金	619,735,003	
(B) 負債	1,480,521,526	
未払金	1,420,533,813	
未払解約金	59,987,211	
未払利息	502	
(C) 純資産総額(A-B)	254,055,584,297	
元本	61,697,952,086	
次期繰越損益金	192,357,632,211	
(D) 受益権総口数	61,697,952,086口	
1万口当たり基準価額(C/D)	41,177円	

(注) 当ファンドの期首元本額は81,609,225,737円、期中追加設定元本額は5,464,327,155円、期中一部解約元本額は25,375,600,806円です。

(注) 2021年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	25,040,493,433円
・グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	16,508,539,257円
・インデックスファンド先進国株式(適格機関投資家向け)	6,102,747,886円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,101,619,144円
・日興五大陸株式ファンド	3,965,095,222円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	2,406,816,230円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	1,505,111,876円
・DCインデックスバランス(株式80)	652,726,376円
・DCインデックスバランス(株式60)	606,000,742円
・DCインデックスバランス(株式40)	306,565,733円
・DCインデックスバランス(株式20)	114,212,302円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	104,560,092円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	88,910,634円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	84,283,948円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	57,058,720円
・インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	19,546,879円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	19,521,661円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	4,003,307円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	3,671,912円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	3,267,649円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	3,199,083円

(注) 1口当たり純資産額は4,1177円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

## ○損益の状況（2020年10月27日～2021年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,902,717,487	
受取配当金	3,894,163,934	
受取利息	216	
その他収益金	10,692,898	
支払利息	△ 2,139,561	
(B) 有価証券売買損益	81,629,412,603	
売買益	85,193,646,693	
売買損	△ 3,564,234,090	
(C) 先物取引等取引損益	983,995,465	
取引益	1,061,079,546	
取引損	△ 77,084,081	
(D) 保管費用等	△ 73,061,335	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	86,443,064,220	
(F) 前期繰越損益金	150,066,236,266	
(G) 追加信託差損益金	13,926,608,928	
(H) 解約差損益金	△ 58,078,277,203	
(I) 計(E+F+G+H)	192,357,632,211	
次期繰越損益金(I)	192,357,632,211	

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

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

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

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2020年10月27日から2021年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

# 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2021年10月26日）  
（2020年10月27日～2021年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2000年5月17日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場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。

## ファンド概要

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジあり・円ベース)		株式組入比率	株先物比率	投資信託 組入比率	純資産額
	騰落	率	(ベンチマーク) 騰落	率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
18期(2017年10月26日)	15,480	18.3	106.32	15.6	92.7	5.4	2.4	5,537
19期(2018年10月26日)	15,732	1.6	105.75	△ 0.5	93.2	4.7	2.4	6,793
20期(2019年10月28日)	17,668	12.3	116.05	9.7	93.7	4.4	2.7	8,711
21期(2020年10月26日)	19,440	10.0	124.90	7.6	90.4	7.6	2.2	11,422
22期(2021年10月26日)	25,748	32.4	163.18	30.6	95.4	2.4	2.3	17,588

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。なお、2021年10月26日現在知りえた情報を基に弊社において日次で算出し、設定日を100として指数化しております。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジあり・円ベース)		株式組入比率	株先物比率	投資信託 組入比率
	騰落	率	(ベンチマーク) 騰落	率			
(期首) 2020年10月26日	円	%		%	%	%	%
	19,440	—	124.90	—	90.4	7.6	2.2
10月末	18,553	△ 4.6	119.18	△ 4.6	89.6	8.3	2.2
11月末	20,670	6.3	132.70	6.2	89.3	8.9	2.1
12月末	21,205	9.1	136.01	8.9	91.5	6.3	2.1
2021年1月末	21,466	10.4	137.54	10.1	90.4	7.9	2.1
2月末	21,777	12.0	139.36	11.6	91.9	6.2	2.1
3月末	22,467	15.6	143.58	14.9	95.4	3.1	2.2
4月末	23,713	22.0	151.31	21.1	93.2	4.9	2.2
5月末	23,818	22.5	151.69	21.4	94.0	3.8	2.2
6月末	24,389	25.5	155.20	24.3	91.8	5.6	2.1
7月末	24,985	28.5	158.79	27.1	92.4	5.3	2.2
8月末	25,565	31.5	162.22	29.9	91.8	6.2	2.2
9月末	24,627	26.7	155.98	24.9	94.2	3.8	2.2
(期末) 2021年10月26日	円	%		%	%	%	%
	25,748	32.4	163.18	30.6	95.4	2.4	2.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ○運用経過

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 基準価額の推移

期間の初め19,440円の基準価額は、期間末に25,748円となり、騰落率は+32.4%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

## &lt;値上がり要因&gt;

- ・米国での新政権の発足により大規模な追加経済対策やインフラ投資の拡大が期待されたこと。
- ・新型コロナウイルスのワクチン接種の普及により経済活動の正常化が進むとの期待が高まったこと。
- ・米国連邦準備制度理事会（FRB）議長が量的緩和の縮小を慎重に進める姿勢を示したこと。

## &lt;値下がり要因&gt;

- ・欧米における新型コロナウイルスの感染再拡大を受けて行動制限が強化されたこと。
- ・欧米の長期金利の上昇が警戒されたこと。
- ・市場予想を上回る米国の消費者物価指数（CPI）の発表を受けてインフレ懸念が強まったこと。

基準価額の推移

MSCI-KOKUSAIインデックス  
(円ヘッジあり・円ベース) (指数化) の推移

### （海外株式市況）

海外株式市場では、期間の初めと比べて欧米各国の株価は総じて上昇しました。

欧米における新型コロナウイルスの感染再拡大を受けた行動制限の強化や、欧米の長期金利の上昇への警戒感、市場予想を上回る米国のCPIの発表を受けたインフレ懸念の強まりなどが株価の重しとなったものの、米国大統領選挙が終了し政治的不透明感が後退したことや、米国での新政権の発足により大規模な追加経済対策やインフラ投資の拡大が期待されたこと、新型コロナウイルスのワクチン接種の普及により経済活動の正常化が進むとの期待が高まったこと、FRB議長が量的緩和の縮小を慎重に進める姿勢を示したことなどが株価の支援材料となり、欧米各国の株価は総じて上昇しました。

### ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、原則として100%程度の為替ヘッジを行ないました。

### 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は32.4%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）」の上昇率30.6%を概ね1.8%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

#### <プラス要因>

- ・株式配当金を受け取ったこと。
- ・株式先物の組入れに基づく要因が影響したこと。

#### <マイナス要因>

- ・海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

### ○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行ないます。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 4	% 0.016	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 3 )	(0.013)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.005	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 1 )	(0.005)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	16	0.072	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
（ 保 管 費 用 ）	(12)	(0.054)	
（ そ の 他 ）	( 4 )	(0.017)	
合 計	21	0.093	
期中の平均基準価額は、22,769円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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



		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	デンマーク	百株 18 ( 23)	千デンマーククローネ 914 ( 499)	百株 1 ( 4)	千デンマーククローネ 105 ( 499)
	オーストラリア	419 ( 60)	千オーストラリアドル 551 ( 32)	153 ( 15)	千オーストラリアドル 77 ( 21)
	ニュージーランド	67	千ニュージーランドドル 48	60	千ニュージーランドドル 27
国	香港	565 ( 15)	千香港ドル 1,943 ( ー)	143 ( 70)	千香港ドル 446 ( 263)
	シンガポール	70 ( 89)	千シンガポールドル 50 ( 14)	26 ( 89)	千シンガポールドル 25 ( 24)
	イスラエル	38	千イスラエルシェケル 79	—	千イスラエルシェケル —

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )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

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	スイス	証券 — (2,806)	千スイスフラン — (0.503)	証券 2,806	千スイスフラン 0.476

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	136	21	—	—
PROLOGIS INC	236	27	—	—
AMERICAN TOWER CORP	142	37	—	—
VEREIT INC	—	—	183	9
	( $\Delta$ 3,272)	( — )		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1,645	13	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	66	15	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	78	9
CROWN CASTLE INTL CORP	186	33	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	175	25	—	—
DUKE REALTY CORPORATION	286	14	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	—	133	11
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	—	—	140	10
EQUINIX INC	20	16	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST INC	30	9	—	—
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	—	—	194	16
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	477	17	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	980	21	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	—	652	24
PUBLIC STORAGE	45	14	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	51	14	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	95	10	—	—
SUN COMMUNITIES INC	87	16	—	—
VENTAS INC	205	10	—	—
VICI PROPERTIES INC	492	12	—	—
WEYERHAEUSER CO	319	11	—	—
小計	5,673	345	1,380	82
	( $\Delta$ 3,272)	( — )		
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
NORTHLAND POWER INCXXX	703	31	—	—
			( 703)	( 31)
小計	703	31	( 703)	( 31)
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
KLEPIERRE	—	—	—	—
	( — )	( $\Delta$ 0.588)	—	—
小計	( — )	( $\Delta$ 0.588)	—	—
ユーロ計	( — )	( $\Delta$ 0.588)	—	—
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
DEXUS	—	—	—	—
	( $\Delta$ 2,875)	( $\Delta$ 26)	—	—
DEXUS/AU(N)	—	—	—	—
	( 2,875)	( 26)	—	—

銘柄	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
外国	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	—	—	—	—
	( — )	( — )	( — )	( 0.104 )	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT (N)	—	—	—	—
	( 362 )	( 1 )			
	ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS	—	—	—	—
	( — )	( — )	( 362 )	( 0.003 )	
ASCENDAS REAL ESTATE IN-RTS (N)	—	—	—	—	
( 362 )	( 0.003 )				
CAPITALAND INTEGRATED COMMER	15,900	30	—	—	
( 1,378 )	( 1 )				
小計	15,900	30	—	—	
( 2,102 )	( 2 )	( 362 )	( 0.108 )		

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ( )内は分割・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	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	5,516	6,223	—	—

(注) 金額は受け渡し代金。

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

### ○株式売買比率

(2020年10月27日～2021年10月26日)

#### 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	2,171,764千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,401,092千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

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

### ○利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。

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

### ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2021年10月26日現在)

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO	13	15	282	32,182	資本財
ABBVIE INC	41	46	504	57,454	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	42	46	589	67,129	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	14	16	603	68,691	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	11	12	228	26,032	保険
ADVANCE AUTO PARTS INC	2	2	47	5,396	小売
AES CORP	13	19	49	5,581	公益事業
AERCAP HOLDINGS NV	3	—	—	—	資本財
AFLAC INC	18	18	102	11,707	保険
AGILENT TECHNOLOGIES INC	7	7	122	13,950	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	5	5	171	19,572	素材
ALLEGHANY CORP	0.27	0.5	33	3,863	保険
ALLSTATE CORP	6	7	103	11,732	保険
ALTRIA GROUP INC	45	48	231	26,324	食品・飲料・タバコ
ALLIANT ENERGY CORP	4	7	44	5,010	公益事業
ALBEMARLE CORP	2	3	73	8,367	素材
ALLEGION PLC	2	2	30	3,447	資本財
ALLY FINANCIAL INC	11	10	51	5,916	各種金融
ALTICE USA INC- A	7	7	13	1,519	メディア・娯楽
AMPHENOL CORP-CL A	6	15	121	13,851	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2	3	97	11,092	各種金融
AMEREN CORPORATION	5	7	61	7,040	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	18	22	132	15,118	保険
AMERICAN EXPRESS CO	16	18	330	37,665	各種金融
AMETEK INC	4	6	87	10,011	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	11	12	106	12,153	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3	4	83	9,454	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	3	3	43	4,926	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1	2	28	3,197	保険
AMCOR PLC	42	42	51	5,816	素材
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	13	49	5,580	メディア・娯楽
AON PLC	5	5	182	20,733	保険
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	3	3	30	3,458	各種金融
ESSENTIAL UTILITIES INC	4	7	35	4,094	公益事業
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	13	15	103	11,740	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	—	2	34	3,933	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4	5	89	10,170	保険
ARAMARK	6	6	23	2,701	消費者サービス
HOWMET AEROSPACE INC	7	11	34	3,961	資本財
ARISTA NETWORKS INC	1	1	59	6,767	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	1	1	27	3,128	保険
AT&T INC	170	188	484	55,103	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	2	2	27	3,152	公益事業
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	4	4	41	4,749	保険
AUTOLIV INC	1	3	28	3,271	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	0.53	0.58	105	12,023	小売
AVERY DENNISON CORP	1	2	53	6,129	素材
AVALARA INC	1	2	43	4,947	ソフトウェア・サービス
AVANTOR INC	8	14	55	6,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6	—	—	—	素材
EQUITABLE HOLDINGS INC	9	9	32	3,691	各種金融
BALL CORP	8	8	74	8,513	素材
BANK OF AMERICA CORP	184	203	967	110,146	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	12	12	102	11,696	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	20	23	137	15,619	各種金融	
BAKER HUGHES CO	19	19	49	5,642	エネルギー	
TRUIST FINANCIAL CORP	32	36	234	26,724	銀行	
BECTON DICKINSON AND CO	7	7	190	21,737	ヘルスケア機器・サービス	
BEST BUY CO INC	5	5	67	7,666	小売	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	33	35	1,024	116,665	各種金融	
BIO-RAD LABORATORIES-A	0.5	0.64	49	5,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKROCK INC	3	4	370	42,210	各種金融	
BLACK KNIGHT INC	3	3	27	3,164	ソフトウェア・サービス	
BLACKSTONE INC	16	18	254	28,978	各種金融	
BORGWARNER INC	6	6	27	3,179	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	35	38	169	19,310	ヘルスケア機器・サービス	
BOEING CO/THE	12	14	314	35,813	資本財	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	3	3	30	3,475	商業・専門サービス	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	0.28	14	1,613	食品・飲料・タバコ	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	54	60	346	39,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	2	2	51	5,825	ソフトウェア・サービス	
BROWN & BROWN INC	5	5	39	4,501	保険	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6	8	61	7,003	食品・飲料・タバコ	
BUNGE LTD	3	3	33	3,860	食品・飲料・タバコ	
BURLINGTON STORES INC	1	1	43	4,981	小売	
CARMAX INC	3	4	62	7,058	小売	
CARDINAL HEALTH INC	6	8	42	4,870	ヘルスケア機器・サービス	
CATERPILLAR INC	13	14	291	33,145	資本財	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11	11	195	22,292	各種金融	
CARNIVAL CORP	14	22	50	5,767	消費者サービス	
COTERRA ENERGY INC	8	21	47	5,392	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	3	6	24	2,827	食品・飲料・タバコ	
CATALENT INC	3	4	65	7,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CABLE ONE INC	0.1	0.17	30	3,457	メディア・娯楽	
CARRIER GLOBAL CORP	17	21	116	13,213	資本財	
CARVANA CO	—	1	56	6,386	小売	
CBRE GROUP INC - A	9	9	94	10,782	不動産	
CENTENE CORP	12	14	100	11,489	ヘルスケア機器・サービス	
CELANESE CORP	2	2	43	4,897	素材	
CENTERPOINT ENERGY INC	12	12	32	3,732	公益事業	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	23	23	29	3,337	電気通信サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	3	40	4,581	ソフトウェア・サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4	7	45	5,135	素材	
CHURCH & DWIGHT CO INC	5	7	60	6,855	家庭用品・パーソナル用品	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.74	0.74	131	14,951	消費者サービス	
CHEVRON CORP	44	51	588	66,936	エネルギー	
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	1	52	6,030	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHEWY INC - CLASS A	—	2	15	1,740	小売	
CITIGROUP INC	48	54	388	44,223	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	13	11	58	6,711	銀行	
CIGNA CORP	8	9	195	22,310	ヘルスケア機器・サービス	
CLOROX COMPANY	3	3	50	5,722	家庭用品・パーソナル用品	
CLOUDFLARE INC-CLASS A	—	5	103	11,836	ソフトウェア・サービス	
CLARIVATE PLC	—	10	23	2,638	商業・専門サービス	
CMS ENERGY CORP	6	6	39	4,499	公益事業	
CONCHO RESOURCES INC	5	—	—	—	エネルギー	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19	21	164	18,705	家庭用品・パーソナル用品	
CONOCOPHILLIPS	27	34	267	30,442	エネルギー	
COMERICA INC	3	—	—	—	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	11	11	37	4,268	食品・飲料・タバコ	
COCA-COLA CO/THE	96	109	592	67,427	食品・飲料・タバコ	
CONSOLIDATED EDISON INC	8	8	62	7,099	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3	4	93	10,655	食品・飲料・タバコ	
CORNING INC	20	20	77	8,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	5	5	30	3,429	食品・飲料・タバコ
CORTEVA INC	17	17	76	8,692	素材
CROWN HOLDINGS INC	2	3	39	4,486	素材
CSX CORP	18	61	218	24,817	運輸
CUMMINS INC	4	4	100	11,456	資本財
CVS HEALTH CORP	31	35	308	35,161	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	2	1	22	2,527	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	3	3	44	5,079	消費者サービス
DANAHER CORP	15	17	522	59,442	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	—	14	56	6,479	エネルギー
DEERE & CO	6	7	277	31,638	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	6	7	84	9,586	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	3	6	23	2,707	運輸
APTIV PLC	6	6	118	13,433	自動車・自動車部品
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	6	8	106	12,068	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	0.93	0.93	43	4,935	消費者サービス
DOMINION ENERGY INC	19	21	163	18,565	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	6	6	134	15,322	小売
DOVER CORP	3	3	59	6,795	資本財
DUPONT DE NEMOURS INC	17	14	104	11,880	素材
DOW INC	17	19	112	12,811	素材
DOORDASH INC - A	—	2	43	4,924	小売
DR HORTON INC	9	9	82	9,345	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	4	5	60	6,911	公益事業
DUKE ENERGY CORP	18	20	207	23,599	公益事業
DYNATRACE INC	—	5	43	5,004	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	2	4	46	5,287	素材
EATON CORP PLC	8	10	168	19,201	資本財
ECOLAB INC	5	6	147	16,771	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13	16	193	22,057	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	7	10	64	7,365	公益事業
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	8	8	29	3,402	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMERSON ELECTRIC CO	13	15	148	16,925	資本財
ENTERGY CORP	4	5	61	7,041	公益事業
EOG RESOURCES INC	13	16	155	17,705	エネルギー
EPAM SYSTEMS INC	1	1	103	11,805	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	2	3	92	10,478	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4	6	201	22,880	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	0.83	0.83	23	2,670	保険
EVERGY INC	4	7	46	5,242	公益事業
EXXON MOBIL CORP	100	112	722	82,237	エネルギー
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.86	0.86	37	4,236	各種金融
FAIR ISAAC CORP	0.6	0.86	35	4,052	ソフトウェア・サービス
FEDEX CORP	5	6	158	18,006	運輸
FIRST REPUBLIC BANK/CA	4	4	94	10,748	銀行
FIRSTENERGY CORP	12	14	55	6,299	公益事業
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	14	15	194	22,160	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	1	53	6,140	ソフトウェア・サービス
FMC CORP	2	4	41	4,680	素材
FNF GROUP	5	5	29	3,336	保険
FORD MOTOR COMPANY	81	103	166	18,908	自動車・自動車部品
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3	3	33	3,841	資本財
FORTIVE CORP	7	7	58	6,637	資本財
NEXTERA ENERGY INC	11	51	436	49,652	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	10	10	32	3,689	各種金融
FREEMPORT-MCMORAN INC	39	36	143	16,367	素材
INGERSOLL-RAND INC	9	9	51	5,861	資本財
GENERAL MOTORS CORP	30	33	190	21,703	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	3	4	59	6,764	小売
GENERAL ELECTRIC CO	201	29	305	34,784	資本財

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
GENERAL DYNAMICS CORP	5	6	136	15,548	資本財	
GENERAL MILLS INC	13	16	103	11,821	食品・飲料・タバコ	
GENERAC HOLDINGS INC	—	1	69	7,866	資本財	
GLOBAL PAYMENTS INC	6	7	119	13,577	ソフトウェア・サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	7	8	370	42,159	各種金融	
GODADDY INC-CLASS A	4	4	31	3,529	ソフトウェア・サービス	
WW GRAINGER INC	0.99	1	57	6,548	資本財	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1	1	21	2,496	ソフトウェア・サービス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	9	9	70	8,056	保険	
HALLIBURTON CO	28	28	74	8,443	エネルギー	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	4	5	140	16,043	資本財	
HCA HEALTHCARE INC	5	7	176	20,065	ヘルスケア機器・サービス	
HERSHEY CO/THE	3	4	75	8,575	食品・飲料・タバコ	
HESS CORP	6	8	71	8,190	エネルギー	
HP INC	30	32	98	11,265	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	27	38	58	6,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HEICO CORP-CLASS A	2	2	31	3,588	資本財	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5	7	107	12,218	消費者サービス	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16	18	402	45,835	資本財	
HOME DEPOT INC	25	28	1,051	119,724	小売	
HORMEL FOODS CORP	6	6	29	3,323	食品・飲料・タバコ	
HUMANA INC	3	3	152	17,302	ヘルスケア機器・サービス	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1	1	24	2,829	資本財	
HUBSPOT INC	—	1	99	11,280	ソフトウェア・サービス	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	21	24	306	34,884	ソフトウェア・サービス	
IDEX CORP	2	2	45	5,186	資本財	
ILLINOIS TOOL WORKS	7	8	182	20,741	資本財	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	6	89	10,144	素材	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7	12	44	5,119	メディア・娯楽	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	13	14	196	22,337	各種金融	
INVESCO LTD	9	9	24	2,789	各種金融	
INTERNATIONAL PAPER CO	7	10	56	6,452	素材	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	5	6	111	12,687	資本財	
INGREDION INC	2	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	3	3	41	4,751	商業・専門サービス	
JM SMUCKER CO/THE	2	2	34	3,938	食品・飲料・タバコ	
JOHNSON & JOHNSON	62	70	1,151	131,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JONES LANG LASALLE INC	1	—	—	—	不動産	
JPMORGAN CHASE & CO	72	79	1,365	155,489	銀行	
JUNIPER NETWORKS INC	8	8	22	2,523	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KANSAS CITY SOUTHERN	1	2	74	8,536	運輸	
KEYCORP	25	25	60	6,934	銀行	
KELLOGG CO	5	5	35	4,082	食品・飲料・タバコ	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	4	5	91	10,370	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KIMBERLY-CLARK CORP	8	8	113	12,914	家庭用品・パーソナル用品	
KINDER MORGAN INC	44	53	96	10,957	エネルギー	
KKR & CO INC -A	11	14	109	12,466	各種金融	
KROGER CO	21	21	85	9,727	食品・生活必需品小売り	
LAS VEGAS SANDS CORP	7	9	34	3,930	消費者サービス	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1	2	73	8,318	ヘルスケア機器・サービス	
LAMB WESTON HOLDING INC	3	3	21	2,452	食品・飲料・タバコ	
LENNAR CORP-CL A	7	7	78	8,940	耐久消費財・アパレル	
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.8	0.8	24	2,770	資本財	
LEAR CORP	1	1	28	3,209	自動車・自動車部品	
ELI LILLY & CO	20	21	525	59,832	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	3	3	33	3,867	メディア・娯楽	
LINCOLN NATIONAL CORP	4	4	30	3,508	保険	
BATH & BODY WORKS INC	—	5	42	4,788	小売	
LINDE PLC	12	13	442	50,322	素材	
LOCKHEED MARTIN CORP	5	6	250	28,529	資本財	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
LOWE'S COS INC	18	18	439	49,979	小売	
LOEWS CORP	5	5	33	3,773	保険	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	5	7	71	8,088	素材	
M & T BANK CORP	4	3	57	6,551	銀行	
MASTERCARD INC	21	23	849	96,735	ソフトウェア・サービス	
MARSH & MCLENNAN COS	12	13	229	26,086	保険	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1	1	56	6,454	素材	
MASCO CORP	6	6	41	4,768	資本財	
MARKEL CORP	0.34	0.34	45	5,149	保険	
MARATHON PETROLEUM CORP	15	17	117	13,399	エネルギー	
IHS MARKIT LTD	8	10	128	14,671	商業・専門サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	2	7	57	6,575	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	17	19	467	53,195	消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	5	6	289	32,947	各種金融	
MCKESSON CORP	3	3	82	9,421	ヘルスケア機器・サービス	
METLIFE INC	17	20	135	15,436	保険	
MERCK & CO. INC.	59	66	545	62,074	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDTRONIC PLC	31	35	443	50,464	ヘルスケア機器・サービス	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.51	0.65	95	10,881	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	11	11	55	6,319	消費者サービス	
MICRON TECHNOLOGY INC	25	29	204	23,269	半導体・半導体製造装置	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	3	3	17	1,937	食品・飲料・タバコ	
MOHAWK INDUSTRIES INC	1	1	35	4,054	耐久消費財・アパレル	
MOSAIC CO/THE	8	8	37	4,259	素材	
MORGAN STANLEY	32	36	372	42,364	各種金融	
MOODY'S CORP	4	4	177	20,252	各種金融	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3	4	114	13,044	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MOLINA HEALTHCARE INC	1	1	38	4,403	ヘルスケア機器・サービス	
MSCI INC	2	2	144	16,476	各種金融	
NOV INC	7	—	—	—	エネルギー	
NEWMONT CORP	21	20	119	13,599	素材	
NEWELL BRANDS INC	11	11	25	2,854	耐久消費財・アパレル	
NIKE INC -CL B	29	33	550	62,640	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	7	11	28	3,271	公益事業	
NIelsen HOLDINGS PLC	10	—	—	—	商業・専門サービス	
NORTHROP GRUMMAN CORP	3	4	167	19,069	資本財	
NORFOLK SOUTHERN CORP	5	6	183	20,866	運輸	
EVERSOURCE ENERGY	6	9	85	9,692	公益事業	
NRG ENERGY INC	6	6	28	3,194	公益事業	
NUCOR CORP	7	7	80	9,117	素材	
OAK STREET HEALTH INC	—	3	14	1,653	ヘルスケア機器・サービス	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	19	24	86	9,850	エネルギー	
OGE ENERGY CORP	4	—	—	—	公益事業	
OMNICOM GROUP	5	5	35	4,074	メディア・娯楽	
ONEOK INC	8	11	78	8,975	エネルギー	
ORACLE CORP	48	49	486	55,402	ソフトウェア・サービス	
OTIS WORLDWIDE CORP	8	10	88	10,035	資本財	
OWENS CORNING	3	3	31	3,543	資本財	
P G & E CORP	30	40	47	5,351	公益事業	
PARKER HANNIFIN CORP	2	3	106	12,072	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1	2	36	4,176	素材	
PALO ALTO NETWORKS INC	2	2	117	13,428	ソフトウェア・サービス	
PAYCOM SOFTWARE INC	1	1	77	8,772	ソフトウェア・サービス	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	41	104	11,861	ソフトウェア・サービス	
PEPSICO INC	33	36	585	66,678	食品・飲料・タバコ	
PENTAIR PLC	3	5	40	4,553	資本財	
PERKINELMER INC	2	2	51	5,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PERRIGO CO PLC	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PFIZER INC	131	149	643	73,239	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	37	41	396	45,088	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
PHILLIPS 66	10	11	98	11,237	エネルギー	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3	6	121	13,796	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	3	3	21	2,435	公益事業	
PINTEREST INC- CLASS A	10	13	66	7,591	メディア・娯楽	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	10	11	245	27,904	銀行	
PPL CORP	15	22	64	7,288	公益事業	
PPG INDUSTRIES INC	6	6	101	11,515	素材	
PROCTER & GAMBLE CO	58	65	919	104,711	家庭用品・パーソナル用品	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7	7	55	6,309	保険	
PROGRESSIVE CORP	12	14	142	16,264	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	9	10	124	14,172	保険	
PULTE GROUP INC	7	7	35	4,012	耐久消費財・アパレル	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	10	13	87	9,976	公益事業	
QUEST DIAGNOSTICS	3	3	44	5,100	ヘルスケア機器・サービス	
IQVIA HOLDINGS INC	4	4	126	14,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	3	4	50	5,782	各種金融	
REGIONS FINANCIAL CORP	29	27	66	7,515	銀行	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	1	1	17	2,028	保険	
REPUBLIC SERVICES INC	5	6	83	9,457	商業・専門サービス	
RESMED INC	4	4	107	12,262	ヘルスケア機器・サービス	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1	—	—	—	保険	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	2	2	49	5,598	ソフトウェア・サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	2	2	89	10,169	資本財	
ROBERT HALF INTL INC	2	2	32	3,714	商業・専門サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	2	2	138	15,773	資本財	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3	5	44	5,035	消費者サービス	
WESTROCK CO	5	5	27	3,107	素材	
ROLLINS INC	—	7	29	3,408	商業・専門サービス	
RPM INTERNATIONAL INC	3	3	33	3,853	素材	
SALESFORCE.COM INC	21	25	749	85,348	ソフトウェア・サービス	
LEIDOS HOLDINGS INC	3	3	31	3,582	商業・専門サービス	
SCHLUMBERGER LTD	32	36	123	14,080	エネルギー	
SCHWAB (CHARLES) CORP	32	37	310	35,373	各種金融	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3	3	20	2,310	資本財	
SEALED AIR CORP	3	3	17	2,024	素材	
SEMPRA ENERGY	6	8	111	12,642	公益事業	
SERVICENOW INC	4	5	354	40,303	ソフトウェア・サービス	
SEA LTD-ADR	—	1	64	7,295	メディア・娯楽	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1	6	211	24,044	素材	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	10	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SMITH (A.O.) CORP	—	4	31	3,612	資本財	
SNAP-ON INC	1	1	31	3,636	資本財	
SNAP INC - A	18	25	138	15,732	メディア・娯楽	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	5	176	20,058	ソフトウェア・サービス	
SOUTHWEST AIRLINES CO	4	4	22	2,518	運輸	
SOUTHERN CO	24	26	168	19,189	公益事業	
SQUARE INC - A	8	10	270	30,777	ソフトウェア・サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	3	4	79	9,061	資本財	
STRYKER CORP	8	8	239	27,289	ヘルスケア機器・サービス	
STATE STREET CORP	9	9	94	10,718	各種金融	
STERIS PLC	1	2	68	7,742	ヘルスケア機器・サービス	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	4	25	2,923	運輸	
SYSCO CORP	11	13	104	11,896	食品・生活必需品小売り	
SYNCHRONY FINANCIAL	13	15	76	8,742	各種金融	
TARGET CORP	11	13	343	39,148	小売	
TEXTRON INC	5	5	37	4,294	資本財	
TERADYNE INC	4	4	56	6,407	半導体・半導体製造装置	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	33	33	33	3,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TELDAC HEALTH INC	1	3	55	6,303	ヘルスケア機器・サービス	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	1	1	53	6,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
TELEFLEX INC	1	1	52	5,920	ヘルスケア機器・サービス	
THE WALT DISNEY CO.	43	48	830	94,590	メディア・娯楽	
COOPER COS INC/THE	1	1	57	6,518	ヘルスケア機器・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	9	10	629	71,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIFFANY & CO	2	—	—	—	小売	
TJX COMPANIES INC	28	32	210	24,016	小売	
GLOBE LIFE INC	2	2	19	2,269	保険	
TRAVELERS COS INC/THE	6	6	101	11,532	保険	
TRANSDIGM GROUP INC	1	1	90	10,354	資本財	
TRANSUNION	4	4	53	6,120	商業・専門サービス	
TWITTER INC	19	21	131	14,960	メディア・娯楽	
TWILIO INC - A	3	4	156	17,816	ソフトウェア・サービス	
TYLER TECHNOLOGIES INC	0.99	0.99	52	5,999	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	6	8	69	7,859	食品・飲料・タバコ	
TE CONNECTIVITY LTD	7	8	127	14,558	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	18	18	139	15,867	資本財	
UBER TECHNOLOGIES INC	22	32	148	16,898	運輸	
UGI CORP	5	5	24	2,780	公益事業	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	17	18	386	44,029	運輸	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	36	40	368	41,986	資本財	
UNION PACIFIC CORP	16	17	424	48,301	運輸	
UNITEDHEALTH GROUP INC	22	24	1,123	127,862	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1	1	24	2,800	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED RENTALS INC	1	1	71	8,088	資本財	
UNITY SOFTWARE INC	—	1	29	3,306	ソフトウェア・サービス	
US BANCORP	31	37	233	26,609	銀行	
VF CORP	8	8	56	6,440	耐久消費財・アパレル	
VALERO ENERGY CORP	9	10	86	9,807	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
VAIL RESORTS INC	0.76	1	42	4,890	消費者サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	98	109	575	65,465	電気通信サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	2	3	113	12,961	ヘルスケア機器・サービス	
VISA INC-CLASS A SHARES	39	44	1,051	119,721	ソフトウェア・サービス	
VISTRA CORP	9	9	17	2,044	公益事業	
VMWARE INC	1	2	38	4,385	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	3	3	21	2,471	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	3	3	63	7,278	素材	
WALMART INC	33	41	618	70,409	食品・生活必需品小売り	
WATERS CORP	1	1	63	7,177	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WASTE MANAGEMENT INC	9	11	177	20,251	商業・専門サービス	
WABTEC CORP	4	4	38	4,357	資本財	
WASTE CONNECTIONS INC	5	7	99	11,298	商業・専門サービス	
WAYFAIR INC- CLASS A	1	1	46	5,299	小売	
WESTERN UNION CO	10	10	20	2,327	ソフトウェア・サービス	
WELLS FARGO & CO	93	109	554	63,083	銀行	
ANTHEM INC	5	6	283	32,301	ヘルスケア機器・サービス	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1	1	83	9,455	ヘルスケア機器・サービス	
WHIRLPOOL CORP	1	1	36	4,174	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	31	31	91	10,454	エネルギー	
WEC ENERGY GROUP INC	6	8	77	8,827	公益事業	
WORKDAY INC-CLASS A	3	5	144	16,476	ソフトウェア・サービス	
WR BERKLEY CORP	3	3	25	2,947	保険	
XCEL ENERGY INC	11	14	90	10,311	公益事業	
XPO LOGISTICS INC	2	—	—	—	運輸	
XYLEM INC	3	5	68	7,770	資本財	
YUM! BRANDS INC	6	7	100	11,439	消費者サービス	
ZENDESK INC	—	2	35	4,078	ソフトウェア・サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5	5	81	9,317	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	11	12	261	29,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHENIERE ENERGY INC	4	6	74	8,433	エネルギー	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
NVR INC	0.1	0.1	48	5,553	耐久消費財・アパレル	
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	2	33	3,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABIOMED INC	1	1	35	4,070	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	18	20	162	18,502	メディア・娯楽	
ADOBE INC	11	12	821	93,454	ソフトウェア・サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	27	31	389	44,333	半導体・半導体製造装置	
AIRBNB INC-CLASS A	—	3	57	6,569	消費者サービス	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	3	4	50	5,706	ソフトウェア・サービス	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2	2	57	6,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	1	111	12,689	ヘルスケア機器・サービス	
AMAZON.COM INC	10	12	4,001	455,439	小売	
AMGEN INC	13	15	314	35,759	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ANALOG DEVICES INC	8	14	256	29,240	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	2	2	89	10,180	ソフトウェア・サービス	
APPLE INC	411	442	6,581	749,170	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	20	24	336	38,278	半導体・半導体製造装置	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	8	11	51	5,890	保険	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	10	11	242	27,603	ソフトウェア・サービス	
AUTODESK INC	5	5	184	20,975	ソフトウェア・サービス	
BEIGENE LTD-ADR	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	5	30	3,450	ソフトウェア・サービス	
BIOGEN INC	3	3	107	12,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	4	4	35	4,083	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADCOM INC	9	10	561	63,943	半導体・半導体製造装置	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	3	37	4,224	運輸	
CADENCE DESIGN SYS INC	6	7	125	14,326	ソフトウェア・サービス	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	5	58	6,638	消費者サービス	
VIACOMCBS INC - CLASS B	13	16	60	6,866	メディア・娯楽	
CDW CORP/DE	3	3	64	7,304	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CDK GLOBAL INC	3	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CERNER CORP	7	8	63	7,191	ヘルスケア機器・サービス	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	2	2	35	4,053	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATION-A	3	3	256	29,207	メディア・娯楽	
CINTAS CORP	1	2	102	11,708	商業・専門サービス	
CISCO SYSTEMS INC	100	112	618	70,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	3	3	47	5,367	保険	
CITRIX SYSTEMS INC	3	3	31	3,568	ソフトウェア・サービス	
CME GROUP INC	8	9	202	22,995	各種金融	
COMCAST CORP-CLASS A	109	121	658	74,979	メディア・娯楽	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	13	13	103	11,756	ソフトウェア・サービス	
COSTCO WHOLESALE CORP	10	11	578	65,885	食品・生活必需品小売り	
COPART INC	4	5	88	10,067	商業・専門サービス	
COSTAR GROUP INC	1	10	106	12,081	商業・専門サービス	
COGNEX CORP	4	4	36	4,147	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COUPA SOFTWARE INC	1	1	45	5,210	ソフトウェア・サービス	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3	5	140	16,005	ソフトウェア・サービス	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	1	22	2,512	ソフトウェア・サービス	
DATADOG INC-CLASS A	2	2	81	9,288	ソフトウェア・サービス	
DEXCOR INC	2	2	147	16,755	ヘルスケア機器・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	4	6	37	4,243	ヘルスケア機器・サービス	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	—	3	9	1,076	メディア・娯楽	
DISH NETWORK CORP-A	5	5	25	2,952	メディア・娯楽	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	12	9	24	2,771	メディア・娯楽	
DIAMONDBACK ENERGY INC	3	—	—	—	エネルギー	
DOLLAR TREE INC	5	5	60	6,885	小売	
DOCUSIGN INC	4	5	139	15,846	ソフトウェア・サービス	
KEURIG DR PEPPER INC	7	20	70	8,052	食品・飲料・タバコ	
DROPBOX INC-CLASS A	—	10	32	3,679	ソフトウェア・サービス	
DRAFTKINGS INC - CL A	—	8	41	4,673	消費者サービス	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
EAST WEST BANCORP INC	3	—	—	—	銀行
EBAY INC	17	17	142	16,205	小売
PAYPAL HOLDINGS INC	26	29	731	83,211	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	6	7	110	12,608	メディア・娯楽
ENPHASE ENERGY INC	—	3	62	7,107	半導体・半導体製造装置
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	0.87	17	1,989	保険
ETSY INC	—	3	87	10,005	小売
EXPEDIA GROUP INC	2	3	64	7,295	消費者サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	4	4	52	5,995	運輸
EXELON CORP	22	24	128	14,593	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	2	4	39	4,542	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
F5 NETWORKS INC	1	1	34	3,959	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-CLASS A	56	63	2,090	237,995	メディア・娯楽
FASTENAL CO	14	14	81	9,223	資本財
FISERV INC	13	16	178	20,350	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	15	20	95	10,880	銀行
FLIR SYSTEMS INC	3	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORTINET INC	3	3	113	12,958	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A	12	12	52	5,966	メディア・娯楽
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	1	10	1,163	各種金融
GARMIN LTD	2	4	76	8,702	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	2	2	79	9,050	ソフトウェア・サービス
GILEAD SCIENCES INC	30	32	220	25,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL A	7	7	2,182	248,452	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C	7	7	2,159	245,794	メディア・娯楽
HASBRO INC	2	2	24	2,820	耐久消費財・アパレル
HD SUPPLY HOLDINGS INC	4	—	—	—	資本財
HENRY SCHEIN INC	4	4	31	3,591	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	7	7	53	6,043	ヘルスケア機器・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	5	60	6,857	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	1	2	51	5,829	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	23	43	72	8,256	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	1	1	26	2,997	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	2	2	151	17,232	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	3	3	162	18,536	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	6	7	429	48,904	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	100	106	526	59,876	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	2	9	317	36,138	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	4	4	28	3,274	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSULET CORP	1	1	55	6,295	ヘルスケア機器・サービス
IPG PHOTONICS CORP	—	1	19	2,180	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IONIS PHARMACEUTICALS INC	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1	1	17	2,030	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	2	2	34	3,982	ソフトウェア・サービス
KLA CORP	3	4	137	15,627	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	34	37	223	25,489	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	14	17	63	7,276	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	3	3	210	24,001	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13	13	39	4,465	電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND-C	2	5	88	10,099	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	6	6	30	3,472	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	5	5	28	3,247	メディア・娯楽
LKQ CORP	7	7	40	4,605	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	3	3	131	14,954	耐久消費財・アパレル
LYFT INC-A	—	6	30	3,511	運輸
MASIMO CORP	1	1	45	5,134	ヘルスケア機器・サービス
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	17	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	7	7	111	12,739	消費者サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.94	0.94	38	4,357	各種金融

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
MATCH GROUP INC	6	6	114	13,015	メディア・娯楽	
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	21	142	16,245	半導体・半導体製造装置	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	—	6	7	817	消費者サービス	
T-MOBILE US INC	13	16	191	21,853	電気通信サービス	
MERCADOLIBRE INC	1	1	184	20,988	小売	
MICROSOFT CORP	170	189	5,850	665,993	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5	16	121	13,805	半導体・半導体製造装置	
MONSTER BEVERAGE CORP	9	10	91	10,392	食品・飲料・タバコ	
MONGODB INC	1	1	75	8,564	ソフトウェア・サービス	
MODERNA INC	6	9	317	36,089	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	1	—	5,951	半導体・半導体製造装置	
MYLAN NV	14	—	52	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NASDAQ INC	2	3	68	7,752	各種金融	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	2	2	22	2,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NETAPP INC	4	6	57	6,506	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	10	11	780	88,840	メディア・娯楽	
NEWS CORP - CLASS A	—	13	32	3,660	メディア・娯楽	
NORTHERN TRUST CORP	4	5	71	8,132	各種金融	
NOVAVAX INC	—	1	26	3,050	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NORDSON CORP	1	1	30	3,498	資本財	
NOVOCURE LTD	—	2	24	2,742	ヘルスケア機器・サービス	
NVIDIA CORP	14	66	1,535	174,832	半導体・半導体製造装置	
NXP SEMICONDUCTORS NV	7	7	142	16,255	半導体・半導体製造装置	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1	1	117	13,399	小売	
OKTA INC	3	3	82	9,419	ソフトウェア・サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	2	2	94	10,718	運輸	
ON SEMICONDUCTOR CORP	10	10	48	5,576	半導体・半導体製造装置	
PACCAR INC	7	9	84	9,591	資本財	
PAYCHEX INC	6	8	107	12,226	ソフトウェア・サービス	
PELTON INTERACTIVE INC-A	4	6	61	7,037	耐久消費財・アパレル	
PLUG POWER INC	—	11	40	4,558	資本財	
POOL CORP	—	0.94	47	5,442	小売	
PPD INC	—	3	18	2,053	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BOOKING HOLDINGS INC	0.98	1	265	30,213	消費者サービス	
PTC INC	3	3	42	4,800	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	3	3	52	6,018	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	26	29	392	44,707	半導体・半導体製造装置	
REGENERON PHARMACEUTICALS	2	2	162	18,496	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROSS STORES INC	7	9	105	12,039	小売	
ROKU INC	2	3	98	11,257	メディア・娯楽	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	5	21	2,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY	6	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SEI INVESTMENTS COMPANY	3	3	22	2,527	各種金融	
SEAGEN INC	2	3	67	7,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	6	54	6,170	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	33	33	20	2,317	メディア・娯楽	
SIGNATURE BANK	1	—	—	—	銀行	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	3	4	72	8,216	半導体・半導体製造装置	
SOLAREDEGE TECHNOLOGIES INC	—	1	36	4,189	半導体・半導体製造装置	
SPLUNK INC	3	4	75	8,643	ソフトウェア・サービス	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	6	6	45	5,147	ソフトウェア・サービス	
STEEL DYNAMICS INC	4	5	39	4,452	素材	
STARBUCKS CORP	27	31	360	41,039	消費者サービス	
SUNRUN INC	2	2	15	1,728	資本財	
SVB FINANCIAL GROUP	1	1	106	12,143	銀行	
NORTONLIFELOCK INC	14	14	37	4,271	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSYS INC	4	4	137	15,600	ソフトウェア・サービス	
T ROWE PRICE GROUP INC	5	6	128	14,610	各種金融	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2	2	52	5,978	メディア・娯楽	

銘柄	株数	期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
TESLA INC	17	21	2,228	253,618	自動車・自動車部品	
TEXAS INSTRUMENTS INC	21	24	483	55,057	半導体・半導体製造装置	
BIO-TECHNE CORP	—	0.97	49	5,640	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRIMBLE INC	4	7	63	7,264	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2	2	60	6,918	小売	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	3	28	3,275	各種金融	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	0.9	10	82	9,443	ソフトウェア・サービス	
ULTA BEAUTY INC	1	1	42	4,856	小売	
VERISIGN INC	2	2	54	6,246	ソフトウェア・サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	6	6	128	14,592	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VERISK ANALYTICS INC	3	4	91	10,450	商業・専門サービス	
VIATRIS INC	—	31	42	4,886	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	17	21	103	11,771	食品・生活必需品小売り	
WESTERN DIGITAL CORP	6	8	45	5,220	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WIX.COM LTD	1	1	29	3,405	ソフトウェア・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2	3	82	9,418	保険	
WYNN RESORTS LTD	2	3	31	3,633	消費者サービス	
XILINX INC	5	6	114	12,991	半導体・半導体製造装置	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	1	1	77	8,849	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - A	—	1	11	1,360	メディア・娯楽	
ZIONS BANCORP NA	5	—	—	—	銀行	
ZILLOW GROUP INC - C	2	4	45	5,192	メディア・娯楽	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	4	5	158	18,058	ソフトウェア・サービス	
ZSCALER INC	1	2	70	8,041	ソフトウェア・サービス	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6	6	34	3,880	資本財	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3	3	39	4,507	各種金融	
小計	株数・金額	7,277	8,341	107,582	12,246,066	
	銘柄数<比率>	565	590	—	<69.6%>	
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES LTD	7	7	51	4,775	素材	
AIR CANADA	—	5	12	1,165	運輸	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	20	24	117	10,843	食品・生活必需品小売り	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	19	19	35	3,275	公益事業	
BARRICK GOLD CORP	45	53	128	11,839	素材	
BANK OF MONTREAL	14	17	245	22,546	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	27	32	271	24,937	銀行	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	6	13	1,238	資本財	
BCE INC	4	—	—	—	電気通信サービス	
BAUSCH HEALTH COS INC	9	9	35	3,220	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	33	33	253	23,308	各種金融	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	4	20	1,869	公益事業	
CAE INC	7	7	28	2,639	資本財	
CAMECO CORP	—	12	41	3,803	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	10	12	190	17,542	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	31	31	163	15,071	エネルギー	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17	18	303	27,886	運輸	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1	1	25	2,344	小売	
CANOPY GROWTH CORP	3	6	11	1,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	5	35	3,302	素材	
CENOVUS ENERGY INC	24	38	57	5,247	エネルギー	
CGI INC	6	6	69	6,357	ソフトウェア・サービス	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.57	0.57	128	11,768	ソフトウェア・サービス	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3	18	168	15,461	運輸	
DOLLARAMA INC	6	6	38	3,505	小売	
EMERA INC	6	6	39	3,665	公益事業	
ENBRIDGE INC	49	52	277	25,470	エネルギー	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.78	0.78	39	3,660	保険	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	—	13	42	3,926	素材	
FIRSTSERVICE CORP	—	1	34	3,145	不動産	
FORTIS INC	13	13	75	6,907	公益事業	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
FRANCO-NEVADA CORP	5	5	90	8,338	素材	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	5	25	2,367	商業・専門サービス	
GILDAN ACTIVWEAR INC	6	6	29	2,752	耐久消費財・アパレル	
GREAT-WEST LIFE CO INC	9	9	34	3,133	保険	
HYDRO ONE LTD	9	9	28	2,618	公益事業	
IA FINANCIAL CORP INC	2	—	—	—	保険	
IMPERIAL OIL LTD	8	7	34	3,174	エネルギー	
INTER PIPELINE LTD	12	—	—	—	エネルギー	
INTACT FINANCIAL CORP	4	4	80	7,371	保険	
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	18	18	1,694	素材	
KEYERA CORP	6	6	21	1,937	エネルギー	
KINROSS GOLD CORP	45	45	36	3,338	素材	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	8	8	48	4,479	素材	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	3	37	3,435	ソフトウェア・サービス	
LOBLOW COMPANIES LTD	5	5	55	5,138	食品・生活必需品小売り	
LUNDIN MINING CORP	—	19	21	1,944	素材	
MANULIFE FINANCIAL CORP	48	56	142	13,089	保険	
MAGNA INTERNATIONAL INC	6	6	67	6,181	自動車・自動車部品	
METRO INC	7	7	48	4,495	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	8	8	88	8,142	銀行	
NORTHLAND POWER INC	—	7	28	2,584	公益事業	
NUTRIEN LTD	14	14	130	12,018	素材	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTC	—	1	23	2,205	ソフトウェア・サービス	
ONEX CORPORATION	2	—	—	—	各種金融	
OPEN TEXT CORP	9	9	60	5,593	ソフトウェア・サービス	
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	6	20	1,847	素材	
PARKLAND CORP	—	5	18	1,705	エネルギー	
PEMBINA PIPELINE CORP	15	15	66	6,140	エネルギー	
POWER CORP OF CANADA	15	15	65	5,996	保険	
BLACKBERRY LTD	—	16	22	2,044	ソフトウェア・サービス	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	7	7	51	4,742	消費者サービス	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	—	3	32	2,981	商業・専門サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	9	9	54	5,047	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	33	37	501	46,057	銀行	
SAPUTO INC	7	7	23	2,121	食品・飲料・タバコ	
SHOPIFY INC - CLASS-A	2	2	524	48,208	ソフトウェア・サービス	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	12	12	42	3,903	メディア・娯楽	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13	10	55	5,123	素材	
SUN LIFE FINANCIAL INC	13	17	121	11,159	保険	
SUNCOR ENERGY INC	36	41	120	11,038	エネルギー	
TELUS CORP	12	12	34	3,144	電気通信サービス	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	—	12	45	4,219	素材	
THOMSON REUTERS CORP	4	5	80	7,356	商業・専門サービス	
TORONTO-DOMINION BANK	42	48	432	39,786	銀行	
TC ENERGY CORP	21	26	180	16,627	エネルギー	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	2	24	2,255	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	2	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
WSP GLOBAL INC	3	3	66	6,072	資本財	
小 計	株数	株数	金額	金額		
	843	1,057	6,694	615,358		
	銘柄数 < 比率 >	60	74	< 3.5% >		
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	4	5	142	18,788	耐久消費財・アパレル	
ALLIANZ SE-REG	9	11	224	29,613	保険	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	8	9	81	10,750	自動車・自動車部品	
BASF SE	23	23	148	19,595	素材	
BAYER AG-REG	24	27	132	17,480	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIERSDORF AG	2	2	23	3,075	家庭用品・パーソナル用品	
BRENNTAG SE	4	4	33	4,368	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	1	23	3,070	ヘルスケア機器・サービス	
COMMERZBANK AG	35	35	22	3,034	銀行	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
CONTINENTAL AG	2	2	26	3,452	自動車・自動車部品	
COVESTRO AG	5	5	30	4,018	素材	
DAIMLER AG	21	23	195	25,820	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE BOERSE AG	5	5	72	9,524	各種金融	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	44	54	63	8,444	各種金融	
DEUTSCHE POST AG-REG	23	26	142	18,841	運輸	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	77	86	140	18,561	電気通信サービス	
DEUTSCHE WOHNEN SE	9	10	51	6,853	不動産	
VONOVIA SE	14	14	76	10,110	不動産	
DELIVERY HERO SE	3	3	43	5,741	小売	
E.ON SE	52	59	64	8,490	公益事業	
EVONIK INDUSTRIES AG	6	6	19	2,512	素材	
FRESENTIUS MEDICAL CARE AG &	6	5	36	4,781	ヘルスケア機器・サービス	
FRESENTIUS SE & CO KGAA	9	12	51	6,855	ヘルスケア機器・サービス	
GEA GROUP AG	—	4	19	2,607	資本財	
HANNOVER RUECK SE-REG	1	1	22	3,016	保険	
HEIDELBERGCEMENT AG	3	3	21	2,817	素材	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	4	4	30	4,052	家庭用品・パーソナル用品	
HENKEL AG & CO KGAA	3	3	26	3,487	家庭用品・パーソナル用品	
HELLOFRESH SE	—	4	35	4,647	小売	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	29	33	129	17,160	半導体・半導体製造装置	
KION GROUP AG	—	2	22	3,030	資本財	
KNORR-BREMSE AG	—	2	20	2,727	資本財	
LANXESS AG	2	3	18	2,448	素材	
LEG IMMOBILIEN SE	2	2	33	4,422	不動産	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	—	19	10	1,423	運輸	
MERCK KGAA	3	3	62	8,264	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MTU AERO ENGINES AG	1	1	21	2,774	資本財	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3	3	94	12,421	保険	
NEMETSCHKE SE	—	1	17	2,375	ソフトウェア・サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5	4	37	4,938	自動車・自動車部品	
PUMA SE	2	2	26	3,503	耐久消費財・アパレル	
QIAGEN N.V.	7	7	35	4,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RATIONAL AG	—	0.15	12	1,693	資本財	
RWE AG	12	17	55	7,315	公益事業	
SAP SE	24	27	342	45,179	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1	0.79	44	5,923	ヘルスケア機器・サービス	
SCOUT24 SE	2	2	14	1,940	メディア・娯楽	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	5	7	43	5,705	ヘルスケア機器・サービス	
SIEMENS AG-REG	17	20	285	37,669	資本財	
SIEMENS ENERGY AG	8	8	21	2,788	資本財	
SYMRISE AG	4	4	47	6,296	素材	
TEAMVIEWER AG	—	4	5	780	ソフトウェア・サービス	
THYSSENKRUPP AG	8	—	—	—	素材	
UNIPER SE	6	—	—	—	公益事業	
VOLKSWAGEN AG	—	0.84	23	3,147	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	4	5	104	13,795	自動車・自動車部品	
ZALANDO SE	3	6	48	6,348	小売	
小 計	株数 銘柄数	金額 <比率>	567 47	652 55	3,583 —	473,207 <2.7%>
(ユーロ…イタリア)						
AMPLIFON SPA	—	3	16	2,234	ヘルスケア機器・サービス	
ATLANTIA SPA	14	14	23	3,118	運輸	
DIASORIN SPA	—	0.9	17	2,270	ヘルスケア機器・サービス	
ENEL SPA	198	211	149	19,684	公益事業	
ENI SPA	64	64	79	10,450	エネルギー	
FINECOBANK SPA	14	14	25	3,313	銀行	
ASSICURAZIONI GENERALI	35	35	66	8,741	保険	
INTESA SANPAOLO	452	452	111	14,705	銀行	
MEDIOBANCA SPA	16	22	23	3,050	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MONCLER SPA	5	5	32	4,292	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA	—	13	23	3,091	ソフトウェア・サービス
POSTE ITALIANE SPA	14	—	—	—	保険
PRYSMIAN SPA	6	6	22	2,966	資本財
SNAM SPA	72	72	35	4,696	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	—	221	7	981	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	—	230	7	1,047	電気通信サービス
TERNA SPA	42	42	27	3,637	公益事業
UNICREDIT SPA	52	52	59	7,829	銀行
小 計	株 数	株 数	727	96,113	
銘 柄 数 < 比 率 >	990	1,463	—	<0.5%>	
(ユーロ…フランス)					
ACCOR SA	5	5	16	2,124	消費者サービス
ADP	1	0.93	10	1,346	運輸
AIR LIQUIDE SA	11	12	176	23,251	素材
ALSTOM	5	8	27	3,570	資本財
ARKEMA	2	2	24	3,235	素材
ATOS SE	2	2	9	1,299	ソフトウェア・サービス
AXA SA	50	50	120	15,904	保険
BIOMERIEUX	—	1	15	2,078	ヘルスケア機器・サービス
BNP PARIBAS	28	28	167	22,091	銀行
BOUYGUES SA	5	5	17	2,274	資本財
BUREAU VERITAS SA	10	10	27	3,694	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	4	4	84	11,119	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	17	17	26	3,472	食品・生活必需品小売り
CREDIT AGRICOLE SA	25	31	40	5,382	銀行
DANONE	14	16	94	12,512	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SE	3	18	88	11,708	ソフトウェア・サービス
EDENRED	6	6	32	4,227	ソフトウェア・サービス
EIFFAGE	2	2	22	3,015	資本財
EDF	17	17	22	2,984	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	6	7	131	17,426	耐久消費財・アパレル
FAURECIA	—	3	12	1,676	自動車・自動車部品
ORANGE S. A.	45	52	50	6,663	電気通信サービス
ENGIE	43	53	64	8,501	公益事業
GETLINK	16	16	21	2,802	運輸
HERMES INTERNATIONAL	0.87	0.87	116	15,440	耐久消費財・アパレル
IPSEN	—	1	10	1,410	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6	7	486	64,299	耐久消費財・アパレル
L'OREAL	6	6	256	33,909	家庭用品・パーソナル用品
LEGRAND SA	7	7	72	9,622	資本財
MICHELIN (CGDE)-B	4	4	56	7,508	自動車・自動車部品
ORPEA	—	1	17	2,281	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD SA	5	5	106	14,029	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	19	—	—	—	自動車・自動車部品
KERING	1	2	129	17,155	耐久消費財・アパレル
PUBLICIS GROUPE	5	5	31	4,195	メディア・娯楽
RENAULT SA	3	3	11	1,550	自動車・自動車部品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1	0.76	36	4,847	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAFRAN SA	7	8	94	12,465	資本財
SANOPI	27	30	261	34,481	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14	12	75	10,018	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	13	14	205	27,162	資本財
SCOR SE	5	5	13	1,766	保険
SODEXO	2	2	20	2,735	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	20	20	59	7,805	銀行
SUEZ	—	12	24	3,199	公益事業
TELEPERFORMANCE	1	1	57	7,544	商業・専門サービス
THALES SA	2	3	31	4,220	資本財
TOTALENERGIES SE	59	67	295	39,001	エネルギー

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	金額			
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UBISOFT ENTERTAINMENT	2	2	11	1,514	メディア・娯楽	
VALEO SA	8	6	16	2,194	自動車・自動車部品	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	14	14	40	5,304	公益事業	
VINCI SA	12	14	133	17,650	資本財	
VIVENDI SE	20	20	23	3,094	メディア・娯楽	
WORLDDLINE SA	7	7	46	6,182	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	608	669	4,051	534,955	
		49	53	—	<3.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
ABN AMRO BANK NV-CVA	8	8	10	1,378	銀行	
ADYEN NV	0.46	0.54	144	19,103	ソフトウェア・サービス	
AEGON NV	44	44	20	2,653	保険	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	27	30	86	11,408	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	4	4	45	5,978	素材	
ARGENX SE	1	1	24	3,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASM INTERNATIONAL NV	—	1	41	5,506	半導体・半導体製造装置	
ASML HOLDING NV	10	11	761	100,582	半導体・半導体製造装置	
CNH INDUSTRIAL NV	32	27	41	5,539	資本財	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	20	25	3,419	食品・飲料・タバコ	
AIRBUS GROUP SE	13	15	171	22,635	資本財	
EXOR NV	2	3	27	3,607	各種金融	
FERRARI NV	3	3	64	8,561	自動車・自動車部品	
STELLANTIS NV	27	53	92	12,278	自動車・自動車部品	
HEINEKEN NV	7	7	69	9,119	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	2	2	22	2,972	食品・飲料・タバコ	
ING GROEP NV-CVA	87	104	136	18,071	銀行	
KONINKLIJKE DSM NV	4	4	89	11,862	素材	
KONINKLIJKE KPN NV	97	97	26	3,507	電気通信サービス	
NN GROUP NV	9	9	41	5,503	保険	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21	23	98	12,971	ヘルスケア機器・サービス	
PROSUS	11	24	190	25,209	小売	
RANDSTAD NV	4	4	25	3,410	商業・専門サービス	
JUST EAT TAKEAWAY	2	5	35	4,729	小売	
UNILEVER PLC	35	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	—	20	51	6,857	メディア・娯楽	
WOLTERS KLUWER	6	6	61	8,127	商業・専門サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	466	536	2,410	318,291	
		24	26	—	<1.8%>	
(ユーロ…スペイン)						
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7	7	17	2,330	資本財	
AENA SA	1	2	34	4,553	運輸	
AMADEUS IT GROUP SA	10	11	64	8,508	ソフトウェア・サービス	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	158	183	104	13,799	銀行	
BANCO SANTANDER SA	400	457	151	20,027	銀行	
CELLNEX TELECOM SA	6	14	76	10,100	電気通信サービス	
CAIXABANK S.A	79	118	30	4,091	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	—	8	19	2,631	公益事業	
ENDESA SA	8	8	15	2,063	公益事業	
ENAGAS SA	6	—	—	—	公益事業	
FERROVIAL SA	14	14	39	5,277	資本財	
NATURGY ENERGY GROUP SA	7	7	15	2,085	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE	—	7	16	2,173	資本財	
GRIFOLS SA	7	7	14	1,924	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IBERDROLA SA	144	156	150	19,923	公益事業	
INDITEX	26	30	94	12,465	小売	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	9	9	17	2,310	公益事業	
REPSOL SA	48	40	47	6,226	エネルギー	
TELEFONICA SA	114	150	57	7,604	電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,053	1,236	970	128,099	
		17	18	—	<0.7%>	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等
		株数	価 値	
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	18	21	102	13,471
AGEAS	4	4	17	2,309
GALAPAGOS NV	1	—	—	—
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	2	3	38	5,094
KBC GROEP NV	5	7	59	7,905
SOLVAY SA	1	1	20	2,673
UCB SA	2	2	28	3,825
UMICORE	6	6	30	3,971
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	42 8	47 7	297 — <0.2%>
(ユーロ…オーストリア)				
ERSTE GROUP BANK AG	8	8	31	4,165
VERBUND AG	—	1	14	1,924
OMV AG	3	5	30	4,035
VOESTALPINE AG	—	3	11	1,477
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	11 2	18 4	87 — <0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルク)				
AROUNDTOWN SA	41	32	19	2,575
ARCELORMITTAL	16	16	47	6,302
EUROFINS SCIENTIFIC	0.3	3	37	4,918
SES	6	—	—	—
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	64 4	52 3	104 — <0.1%>
(ユーロ…フィンランド)				
ELISA OYJ	2	5	26	3,545
FORTUM OYJ	10	10	27	3,674
KESKO OYJ-B SHS	—	6	19	2,557
KONE OYJ-B	7	8	52	6,906
NESTE OYJ	8	10	54	7,254
NOKIA OYJ	151	151	75	9,938
SAMPO OYJ-A SHS	11	13	62	8,189
STORA ENSO OYJ-R SHS	19	15	22	2,965
UPM-KYMMENE OYJ	11	14	44	5,871
WARTSILA OYJ ABP	—	12	13	1,816
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	222 8	248 10	399 — <0.3%>
(ユーロ…アイルランド)				
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	27	—	—	—
CRH PLC	16	19	82	10,865
KERRY GROUP PLC-A	3	3	45	6,071
KINGSPAN GROUP PLC	4	4	43	5,715
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	3	4	74	9,815
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	7	7	32	4,274
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	64 6	40 5	278 — <0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)				
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	67	87	42	5,657
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16	—	—	—
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	84 2	87 1	42 — <0.0%>
(ユーロ…スイス)				
STMICROELECTRONICS NV	15	17	67	8,936
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	15 1	17 1	67 — <0.1%>
ユ ー ロ 計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,192 181	5,072 200	13,020 — <9.8%>
(イギリス)				
3I GROUP PLC	20	28	37	5,856
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	8	8	15	2,350

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ADMIRAL GROUP PLC	—	7	21	3,347	保険
ANGLO AMERICAN PLC	32	32	92	14,461	素材
ANTOFAGASTA PLC	—	11	17	2,744	素材
ASTRAZENECA PLC	31	41	369	57,910	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHTREAD GROUP PLC	9	12	70	11,110	資本財
AUTO TRADER GROUP PLC	29	29	17	2,742	メディア・娯楽
AVEVA GROUP PLC	—	3	13	2,151	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC	80	116	46	7,266	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53	57	149	23,435	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC ORD	76	96	55	8,635	資本財
BARCLAYS PLC	369	447	89	14,073	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	23	23	15	2,383	耐久消費財・アパレル
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	3	2	12	1,935	耐久消費財・アパレル
BHP GROUP PLC	49	57	114	17,944	素材
BP PLC	472	537	193	30,337	エネルギー
BT GROUP PLC	214	214	29	4,552	電気通信サービス
BUNZL PLC	8	8	22	3,503	資本財
BURBERRY GROUP PLC	9	9	18	2,938	耐久消費財・アパレル
COCA-COLA HBC AG-CDI	5	5	13	2,150	食品・飲料・タバコ
COMPASS GROUP PLC	51	47	69	10,812	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	2	3	35	5,607	素材
DCC PLC	2	2	13	2,111	資本財
DIAGEO PLC	56	61	223	35,071	食品・飲料・タバコ
EVRAZ PLC	—	19	12	1,935	素材
EXPERIAN PLC	24	24	79	12,516	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	250	250	93	14,597	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	121	130	185	29,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ENTAIN PLC	10	16	35	5,545	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	9	9	14	2,228	各種金融
HALMA PLC	10	10	32	5,045	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	6	15	2,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	493	540	239	37,520	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	21	25	40	6,342	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3	3	19	2,990	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	3	3	19	2,988	商業・専門サービス
INFORMA PLC	53	43	22	3,562	メディア・娯楽
JD SPORTS FASHION PLC	—	17	18	2,840	小売
JOHNSON MATTHEY PLC	5	5	13	2,191	素材
KINGFISHER PLC	61	61	21	3,330	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	125	157	44	6,974	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,055	1,814	88	13,864	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	7	8	61	9,647	各種金融
M&G PLC	50	92	18	2,838	各種金融
MELROSE INDUSTRIES PLC	113	101	16	2,547	資本財
MONDI PLC	13	13	24	3,860	素材
NATIONAL GRID PLC	79	96	88	13,806	公益事業
NEXT PLC	2	4	33	5,216	小売
OCADO GROUP PLC	12	12	23	3,628	食品・生活必需品小売り
PERSIMMON PLC	6	9	26	4,092	耐久消費財・アパレル
PEARSON PLC	27	27	17	2,665	メディア・娯楽
PRUDENTIAL PLC	59	65	96	15,094	保険
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	17	19	106	16,657	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	44	50	111	17,530	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	41	41	24	3,874	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	27	29	142	22,283	素材
NATWEST GROUP PLC	95	139	32	5,073	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	100	113	200	31,456	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	83	91	162	25,505	エネルギー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	35	235	31	4,878	資本財
RSA INSURANCE GROUP PLC	25	—	—	—	保険

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円		
SAGE GROUP PLC/THE	31	31	22	3,490	ソフトウェア・サービス	
SSE PLC	23	30	49	7,752	公益事業	
SEVERN TRENT PLC	4	6	18	2,846	公益事業	
SMITHS GROUP PLC	8	8	11	1,839	資本財	
SMITH & NEPHEW PLC	19	19	25	4,010	ヘルスケア機器・サービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	2	2	36	5,692	資本財	
ST JAMES'S PLACE PLC	16	16	24	3,911	各種金融	
ABRDN PLC	64	64	16	2,593	各種金融	
STANDARD CHARTERED PLC	57	81	39	6,237	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	68	68	10	1,593	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	225	243	66	10,441	食品・生活必需品小売り	
UNILEVER PLC	27	69	268	42,125	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	16	16	16	2,551	公益事業	
VODAFONE GROUP PLC	630	707	78	12,275	電気通信サービス	
WHITBREAD PLC	6	6	20	3,157	消費者サービス	
FERGUSON PLC	5	6	68	10,657	資本財	
WPP PLC	26	33	31	4,903	メディア・娯楽	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,942	7,576	4,776	748,118	
		73	78		<4.3%>	
(スイス)			千スイスフラン			
ABB LTD-REG	42	45	137	16,956	資本財	
ADECCO GROUP AG-REG	4	4	19	2,446	商業・専門サービス	
ALCON INC	12	12	95	11,825	ヘルスケア機器・サービス	
BALOISE HOLDING AG - REG	1	1	22	2,831	保険	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	57	73	71	8,850	各種金融	
VIFOR PHARMA AG	1	1	17	2,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GEBERIT AG-REG	0.81	0.96	68	8,499	資本財	
GIVAUDAN-REG	0.22	0.26	112	13,907	素材	
HOLCIM LTD	10	13	61	7,622	素材	
JULIUS BAER GROUP LTD	5	5	38	4,720	各種金融	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	1	1	47	5,923	運輸	
LONZA GROUP AG-REG	1	2	152	18,835	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA-REG	70	76	892	110,310	食品・飲料・タバコ	
NOVARTIS AG-REG	52	58	452	55,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	0.44	0.63	100	12,386	各種金融	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	14	14	157	19,455	耐久消費財・アパレル	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16	18	659	81,500	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1	1	35	4,344	資本財	
SGS SA-REG	0.14	0.17	47	5,812	商業・専門サービス	
SIKA AG-REG	3	3	121	14,978	素材	
SONOVA HOLDING AG-REG	1	1	58	7,183	ヘルスケア機器・サービス	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.63	0.87	42	5,255	保険	
SWISSCOM AG-REG	0.56	0.8	44	5,444	電気通信サービス	
SWISS RE AG	6	7	62	7,784	保険	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	0.95	0.95	23	2,866	耐久消費財・アパレル	
UBS GROUP AG-REG	83	93	153	18,940	各種金融	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3	4	164	20,374	保険	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.1	0.1	20	2,594	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	-	0.22	20	2,538	素材	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.04	0.04	42	5,302	食品・飲料・タバコ	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	3	4	39	4,900	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ROCHE HOLDING AG-BR	-	1	47	5,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.29	0.29	54	6,744	ヘルスケア機器・サービス	
SWISS PRIME SITE-REG	2	2	20	2,497	不動産	
TEMENOS AG	1	1	18	2,250	ソフトウェア・サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	406	456	4,123	509,834	
		33	35	-	<2.9%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ALFA LAVAL AB	9	9	315	4,167	資本財	
ASSA ABLOY AB-B	27	27	669	8,861	資本財	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)	百株	百株		千スウェーデンクローナ	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	14	16		908	12,019	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	10	12		593	7,852	資本財
BOLIDEN AB	9	6		190	2,519	素材
ELECTROLUX AB-B	4	4		85	1,128	耐久消費財・アパレル
EMBRACER GROUP AB	—	18		149	1,979	メディア・娯楽
EPIROC AB-A	25	15		329	4,358	資本財
EPIROC AB-B	6	13		239	3,165	資本財
EQT AB	—	7		320	4,242	各種金融
ERICSSON LM-B SHS	77	77		744	9,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESSITY AKTIEBOLAG-B	13	17		473	6,259	家庭用品・パーソナル用品
EVOLUTION AB	2	4		691	9,149	消費者サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	3		230	3,046	不動産
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	15	22		373	4,937	小売
HEXAGON AB-B SHS	8	53		737	9,759	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS	—	11		128	1,696	耐久消費財・アパレル
INVESTOR AB-B SHS	9	47		952	12,606	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	10		294	3,901	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS(N)	—	0.67		18	250	各種金融
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	3		108	1,437	資本財
KINNEVIK AB - B	5	5		186	2,466	各種金融
LUNDIN ENERGY AB	6	6		234	3,105	エネルギー
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	7	39		487	6,444	資本財
NORDEA BANK ABP	71	85		950	12,579	銀行
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	38	44		615	8,148	銀行
SANDVIK AB	33	30		673	8,911	資本財
SINCH AB	—	14		244	3,240	ソフトウェア・サービス
SKANSKA AB-B SHS	10	10		232	3,073	資本財
SKF AB-B SHARES-B	11	11		244	3,228	資本財
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	—	18		249	3,298	素材
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	31	43		434	5,749	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	20	20		405	5,366	銀行
SWEDISH MATCH AB	3	37		303	4,020	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	14	14		179	2,372	電気通信サービス
TELIA CO AB	81	81		288	3,813	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS-B	33	43		865	11,448	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	604 28	889 37	15,151 —	200,455 <1.1%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
ADEVINTA ASA	—	7		118	1,619	メディア・娯楽
DNB ASA	20	—		—	—	銀行
DNB BANK ASA	—	28		613	8,363	銀行
MOWI ASA	14	14		363	4,949	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO A S	—	40		267	3,648	素材
ORKLA ASA	19	19		150	2,051	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	3		147	2,013	メディア・娯楽
EQUINOR ASA	24	24		571	7,794	エネルギー
TELENOR ASA	20	20		274	3,734	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	4	4		184	2,510	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	103 6	163 9	2,691 —	36,687 <0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	0.22	0.22		406	7,222	運輸
AMBU A/S-B	—	5		102	1,826	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG AS-B	3	2		308	5,481	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	3	3		162	2,884	素材
COLOPLAST-B	3	3		327	5,821	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	20	20		241	4,293	銀行
ORSTED A/S	4	5		475	8,440	公益事業
DSV A/S	4	5		858	15,246	運輸
GENMAB A/S	1	1		585	10,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
GN STORE NORD A/S	2	2	123	2,193		ヘルスケア機器・サービス
NOVO NORDISK A/S-B	41	44	3,028	53,753		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	7	6	276	4,906		素材
PANDORA A/S	2	3	276	4,903		耐久消費財・アパレル
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	4	27	730	12,963		資本財
DEMANT A/S	—	3	93	1,654		ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	98	135	7,998	141,977	
		13	15	—	<0.8%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
AFTERPAY LTD	4	4	60	5,125		ソフトウェア・サービス
AGL ENERGY LTD	22	22	13	1,183		公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	71	78	221	18,892		銀行
APA GROUP	44	44	38	3,265		公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	15	15	75	6,412		消費者サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD-RTS(N)	—	0.77	0.413	35		消費者サービス
ASX LTD	5	5	41	3,568		各種金融
BHP GROUP LTD	70	78	298	25,497		素材
BLUESCOPE STEEL LTD	16	16	34	2,965		素材
BRAMBLES LTD	38	38	39	3,383		商業・専門サービス
AMPOL LTD	7	7	22	1,946		エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	42	46	495	42,271		銀行
COCHLEAR LTD	2	2	50	4,306		ヘルスケア機器・サービス
COMPUTERSHARE LTD	15	—	—	—		ソフトウェア・サービス
COLES GROUP LTD	33	41	73	6,301		食品・生活必需品小売り
CSL LTD	10	12	356	30,440		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	1	22	1,906		消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	—	42	16	1,370		素材
FORTESCUE METALS GROUP LTD	38	45	65	5,595		素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	81	81	41	3,507		保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	13	13	68	5,836		素材
CIMIC GROUP LTD	1	—	—	—		資本財
SYDNEY AIRPORT	33	33	27	2,359		運輸
MACQUARIE GROUP LTD	8	9	182	15,581		各種金融
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	3	3	11	1,010		各種金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	76	84	242	20,730		銀行
NEWCREST MINING LTD	22	22	57	4,886		素材
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	33	32	2,789		素材
OIL SEARCH LTD	—	58	26	2,252		エネルギー
ORIGIN ENERGY LTD	61	61	33	2,820		公益事業
QBE INSURANCE GROUP LTD	38	38	46	3,939		保険
AURIZON HOLDINGS LTD	53	53	18	1,597		運輸
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6	6	45	3,852		ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD	—	1	32	2,777		メディア・娯楽
REECE LTD	—	8	16	1,377		資本財
RIO TINTO LTD	9	9	92	7,866		素材
SANTOS LTD	39	39	28	2,435		エネルギー
SEEK LTD	10	10	35	3,052		メディア・娯楽
SONIC HEALTHCARE LTD	11	11	47	4,023		ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	162	162	61	5,255		素材
SUNCORP GROUP LTD	40	40	49	4,256		保険
TABCORP HOLDINGS LTD	—	79	39	3,399		消費者サービス
TELSTRA CORPORATION LTD	109	109	41	3,553		電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP	70	78	107	9,184		運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	—	23	27	2,334		食品・飲料・タバコ
WESTPAC BANKING CORP	87	99	255	21,834		銀行
WESFARMERS LTD	29	29	172	14,694		小売
WISETECH GLOBAL LTD	—	4	26	2,237		ソフトウェア・サービス
WOOLWORTHS GROUP LTD	30	36	147	12,619		食品・生活必需品小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD	26	26	63	5,459		エネルギー

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価	価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
XERO LTD	—	2	43	3,703		ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,469 40	1,780 49	4,051 —	345,704 <2.0%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
A2 MILK CO LTD	21	21	15	1,252		食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	31	31	25	2,099		運輸
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	14	14	45	3,744		ヘルスケア機器・サービス
MERIDIAN ENERGY LTD	—	34	17	1,395		公益事業
MERCURY NZ LTD	—	22	13	1,125		公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	11	16	1,357		ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	60	—	—	—		電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	128 4	136 6	134 —	10,976 <0.1%>	
(香港)			千香港ドル			
AIA GROUP LTD	280	320	2,916	42,692		保険
BANK OF EAST ASIA	30	—	—	—		銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	130	137	341	5,005		銀行
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	51	51	94	1,387		食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	75	75	401	5,884		資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	75	50	240	3,516		不動産
CLP HOLDINGS LTD	46	46	351	5,147		公益事業
ESR CAYMAN LTD	—	54	133	1,960		不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	70	51	216	3,165		消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	—	80	146	2,143		不動産
HANG SENG BANK LTD	21	21	313	4,592		銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	42	—	—	—		不動産
POWER ASSETS HOLDINGS	40	40	182	2,676		公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	312	327	384	5,622		公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	29	31	1,535	22,478		各種金融
MTR CORP	55	55	231	3,385		運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	47	47	161	2,360		不動産
SANDS CHINA LTD	70	70	120	1,760		消費者サービス
SINO LAND CO	—	80	86	1,269		不動産
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	30	78	1,141		運輸
SUN HUNG KAI PROPERTIES	34	44	455	6,671		不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	—	10	49	728		不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	40	40	636	9,322		資本財
WH GROUP LTD	320	320	168	2,468		食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	50	213	3,118		不動産
WYNN MACAU LTD	—	44	31	457		消費者サービス
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	60	135	1,980		資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,772 19	2,139 25	9,626 —	140,938 <0.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND LTD	89	—	—	—		不動産
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	89	30	2,575		不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD	48	48	151	12,779		銀行
KEPPEL CORP LTD	52	52	28	2,446		資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	91	91	109	9,228		銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD	—	41	21	1,826		運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	26	29	28	2,429		各種金融
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	242	242	61	5,215		電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD	35	35	95	8,046		銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	63	63	27	2,326		食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	647 8	692 9	554 —	46,873 <0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェケル			
BANK LEUMI LE-ISRAEL	34	53	159	5,670		銀行
BANK HAPUALIM BM	43	43	132	4,711		銀行
ICL GROUP LTD	—	18	52	1,865		素材

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエルシェケル	千円	
NICE LTD	1	1	155	5,539	
小 計	株数・金額	78	117	500	17,787
	銘柄数<比率>	3	4	—	<0.1%>
合 計	株数・金額	24,565	28,559	—	16,780,154
	銘柄数<比率>	1,033	1,131	—	<95.4%>

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

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
	口	口	千アメリカドル	千円	%	
(アメリカ)						
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	273	409	85	9,727	0.1	
PROLOGIS INC	1,736	1,972	286	32,570	0.2	
AMERICAN TOWER CORP	1,070	1,212	344	39,261	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	1,361	1,361	22	2,562	0.0	
VEREIT INC	4,089	634	32	3,749	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	3,008	4,653	40	4,618	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	316	382	88	10,121	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	326	326	38	4,351	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	369	291	45	5,230	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	972	1,158	205	23,415	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	588	763	119	13,611	0.1	
DUKE REALTY CORPORATION	777	1,063	59	6,739	0.0	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	630	497	42	4,865	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	1,097	957	81	9,287	0.1	
EQUINIX INC	216	236	194	22,103	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	145	175	58	6,670	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	323	323	60	6,929	0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	194	—	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1,109	1,586	54	6,217	0.0	
WELLTOWER INC	1,068	1,068	86	9,844	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	1,967	1,967	33	3,768	0.0	
INVITATION HOMES INC	1,378	1,378	56	6,435	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	818	818	37	4,282	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	1,010	1,990	40	4,587	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	270	270	54	6,186	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	652	—	—	—	—	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	620	620	18	2,108	0.0	
PUBLIC STORAGE	377	422	138	15,780	0.1	
REALTY INCOME CORP	957	957	70	8,047	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	482	482	33	3,862	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	240	291	101	11,567	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	749	844	123	14,106	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	230	317	64	7,288	0.0	
UDR INC	680	680	37	4,231	0.0	
VENTAS INC	800	1,005	54	6,237	0.0	
VICI PROPERTIES INC	1,035	1,527	46	5,247	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	436	436	19	2,220	0.0	
WEYERHAEUSER CO	1,733	2,052	77	8,812	0.1	
WP CAREY INC	594	594	46	5,250	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	34,695	35,716	3,003	341,901	
	銘柄 数 < 比 率 >	39	37	—	< 1.9% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
GECINA SA	150	150	18	2,388	0.0	
KLEPIERRE	588	588	12	1,598	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	351	351	23	3,070	0.0	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1,089	1,089	53	7,057	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.0% >	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数		評 価 額		比 率
	口 数		外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	口	口	千イギリスポンド	千円	%
BRITISH LAND COMPANY PLC	3,140	3,140	15	2,384	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	1,694	1,694	11	1,792	0.0
SEGRO PLC	3,361	3,361	43	6,780	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	8,195	8,195	69	10,957
	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		
VICINITY CENTRES	10,480	10,480	18	1,609	0.0
DEXUS	2,875	—	—	—	—
DEXUS/AU	—	2,875	31	2,725	0.0
GOODMAN GROUP	4,311	4,311	97	8,297	0.0
GPT GROUP	5,900	5,900	31	2,662	0.0
LENDLEASE GROUP	1,550	1,550	16	1,421	0.0
MIRVAC GROUP	11,628	11,628	34	2,936	0.0
SCENTRE GROUP	11,481	11,481	35	3,036	0.0
STOCKLAND	5,114	5,114	24	2,068	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	53,339	53,339	290	24,758
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	5,967	5,967	409	5,988	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	5,967	5,967	409	5,988
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	9,800	10,162	31	2,636	0.0
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	—	17,278	36	3,095	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	9,800	27,440	67	5,732
	銘柄 数 < 比 率 >	1	2	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	113,085	131,746	—	396,395
	銘柄 数 < 比 率 >	55	54	—	<2.3%>

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

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	DJSTX5	百万円	百万円
			67	—
		SP EMINI	363	—

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

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	16,780,154	93.2
投資証券	396,395	2.2
コール・ローン等、その他	822,219	4.6
投資信託財産総額	17,998,768	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（17,606,513千円）の投資信託財産総額（17,998,768千円）に対する比率は97.8%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.83円、1カナダドル=91.92円、1ユーロ=132.05円、1イギリスポンド=156.62円、1スイスフラン=123.65円、1スウェーデンクローナ=13.23円、1ノルウェークローネ=13.63円、1デンマーククローネ=17.75円、1オーストラリアドル=85.32円、1ニュージーランドドル=81.57円、1香港ドル=14.64円、1シンガポールドル=84.51円、1イスラエルシケル=35.5652円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	35,200,337,288	
コール・ローン等	440,216,101	
株式(評価額)	16,780,154,292	
投資証券(評価額)	396,395,818	
未収入金	17,215,397,886	
未収配当金	10,209,550	
差入委託証拠金	357,963,641	
(B) 負債	17,611,743,177	
未払金	17,608,865,038	
未払解約金	2,877,983	
未払利息	156	
(C) 純資産総額(A-B)	17,588,594,111	
元本	6,831,162,629	
次期繰越損益金	10,757,431,482	
(D) 受益権総口数	6,831,162,629口	
1万口当たり基準価額(C/D)	25,748円	

(注) 当ファンドの期首元本額は5,875,608,160円、期中追加設定元本額は1,363,175,797円、期中一部解約元本額は407,621,328円です。

(注) 2021年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド海外株式ヘッジあり(DC専用)	5,349,584,556円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジあり)	742,161,219円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	324,670,953円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	138,338,781円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	132,630,704円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	90,331,157円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	31,207,983円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	6,210,213円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,734,203円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	5,202,286円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	5,090,574円

(注) 1口当たり純資産額は2.5748円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

## ○損益の状況（2020年10月27日～2021年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	238,288,389	
受取配当金	238,169,226	
受取利息	12	
その他収益金	178,622	
支払利息	△ 59,471	
(B) 有価証券売買損益	3,534,156,946	
売買益	5,214,326,859	
売買損	△ 1,680,169,913	
(C) 先物取引等取引損益	211,577,646	
取引益	222,243,466	
取引損	△ 10,665,820	
(D) 保管費用等	△ 10,376,841	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	3,973,646,140	
(F) 前期繰越損益金	5,546,584,592	
(G) 追加信託差損益金	1,761,401,849	
(H) 解約差損益金	△ 524,201,099	
(I) 計(E+F+G+H)	10,757,431,482	
次期繰越損益金(I)	10,757,431,482	

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

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

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

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2020年10月27日から2021年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書

第23期（決算日 2021年10月26日）  
（2020年10月27日～2021年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
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ないません。

## ファンド概要

主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI総合」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
19期(2017年10月26日)	13,839	△1.5	545.42	△1.5	99.7	36,674
20期(2018年10月26日)	13,870	0.2	546.64	0.2	99.6	38,466
21期(2019年10月28日)	14,315	3.2	564.07	3.2	99.4	41,390
22期(2020年10月26日)	14,128	△1.3	556.49	△1.3	99.4	43,807
23期(2021年10月26日)	14,100	△0.2	555.54	△0.2	99.6	48,618

(注) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2020年10月26日	14,128	—	556.49	—	99.4
10月末	14,119	△0.1	556.21	△0.1	99.7
11月末	14,139	0.1	556.91	0.1	99.7
12月末	14,141	0.1	557.03	0.1	99.8
2021年1月末	14,105	△0.2	555.66	△0.1	99.8
2月末	13,986	△1.0	551.07	△1.0	99.7
3月末	14,083	△0.3	554.90	△0.3	99.8
4月末	14,109	△0.1	555.93	△0.1	99.8
5月末	14,116	△0.1	556.19	△0.1	99.7
6月末	14,124	△0.0	556.60	0.0	99.8
7月末	14,194	0.5	559.34	0.5	99.8
8月末	14,184	0.4	558.84	0.4	99.7
9月末	14,135	0.0	556.91	0.1	99.8
(期末) 2021年10月26日	14,100	△0.2	555.54	△0.2	99.6

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 基準価額の推移

期間の初め14,128円の基準価額は、期間末に14,100円となり、騰落率は△0.2%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

## &lt;値上がり要因&gt;

- ・世界で新型コロナウイルスの感染拡大に歯止めがかからず、経済活動の制限強化による景気悪化への警戒感が高まったこと。
- ・日銀が金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を明確化した一方、導入した「連続指値オベ制度」が過度な金利上昇を抑制する意図と理解されたこと。
- ・政府が東京都に4回目となる緊急事態宣言を適用し、景気の先行き不透明感から投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。

## &lt;値下がり要因&gt;

- ・米国において、新型コロナウイルスのワクチンの普及や追加経済対策が成立するとの観測などを背景に景気の回復期待が高まったこと。
- ・前首相の退陣表明を受けて新政権による経済対策への期待から国内株式市場が上昇したこと。
- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）において量的金融緩和縮小の2021年内開始と利上げ時期の前倒しが示唆され、米国長期金利が上昇したこと（2021年8月下旬～期間末）。

## (国内債券市況)

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

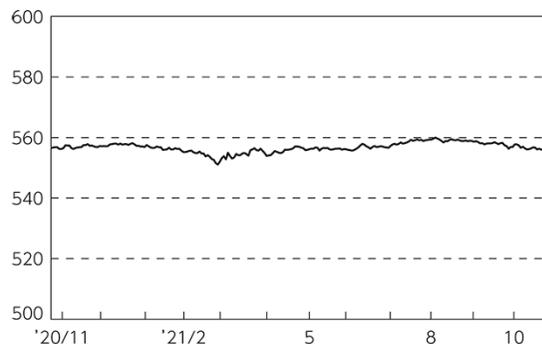
期間の初めから2021年2月下旬にかけては、世界で新型コロナウイルスの感染拡大に歯止めがかからず、経済活動の制限強化による景気悪化への警戒感が高まったことなどが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、英国と欧州連合（EU）との間の貿易交渉の進展を受けて投資家のリスク回避姿勢が後退したことや、米国において新型コロナウイルスのワクチンの普及や追加経済対策が成立するとの観測などを背景に景気の回復期待が高まったことなどから、10年国債利回りは上昇しました。3月上旬から8月中旬にかけて

基準価額の推移



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2020/10/26	2021/08/04	2021/02/26	2021/10/26
14,128円	14,213円	13,986円	14,100円

NOMURA - BPI総合の推移



は、日銀が金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を明確化した一方、導入した「連続指値オペ制度」が過度な金利上昇を抑制する意図と理解されたことや、米国連邦準備制度理事会（FRB）による金融緩和政策が当面は継続するとの見方などから米国長期金利が低下したこと、政府が東京都に4回目となる緊急事態宣言を適用し、景気の先行き不透明感から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから、10年国債利回りは低下しました。8月下旬から期間末にかけては、前首相の退陣表明を受けて新政権による経済対策への期待から国内株式市場が上昇したことや、FOMCにおいて量的金融緩和と縮小の年内開始と利上げ時期の前倒しが示唆され、米国長期金利が上昇したことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

## ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルを利用して国債、政府保証債、地方債、金融債、電力債、事業債などによりポートフォリオを構築し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。また、「NOMURA-BPI総合」採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しを行ない、債券組入比率を高位に維持しました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、0.2%の値下がりとなり、ベンチマークである「NOMURA-BPI総合」の下落率0.2%と概ね同水準となりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

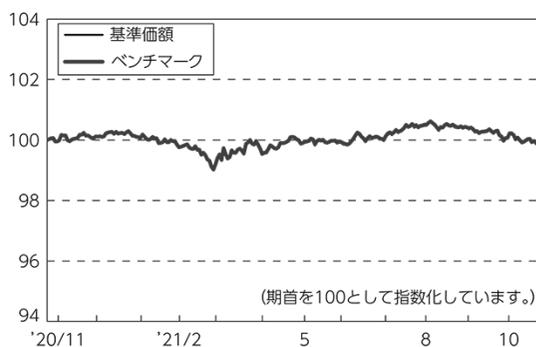
### <プラス要因>

- ・債券種別効果。
- ・売買要因。

### <マイナス要因>

- ・金利効果。
- ・個別銘柄効果。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



## ○今後の運用方針

引き続き、原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度や残存期間別構成比率などを「NOMURA-BPI総合」と同程度に保つことで連動性を高めるよう努めます。また、ベンチマークの採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行ない、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2020年10月27日～2021年10月26日)

公社債
-----

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	6,680,618	2,772,527
	地方債証券	2,186,683	604,108 ( 5,000)
内	特殊債券	1,829,786	1,106,390
	社債券(投資法人債券を含む)	101,690	909,465

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )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。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2021年10月26日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	33,789,000 (14,259,000)	36,703,224 (15,040,661)	75.5 (30.9)	— (—)	61.7 (25.0)	10.5 (5.2)	3.3 (0.8)
地方債証券	4,740,000 (4,740,000)	4,809,141 (4,809,141)	9.9 (9.9)	— (—)	0.6 (0.6)	7.2 (7.2)	2.1 (2.1)
特殊債券 (除く金融債)	5,000,000 (5,000,000)	5,097,006 (5,097,006)	10.5 (10.5)	— (—)	2.7 (2.7)	5.3 (5.3)	2.5 (2.5)
金融債券	200,000 (200,000)	199,856 (199,856)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	— (—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,600,000 (1,600,000)	1,617,886 (1,617,886)	3.3 (3.3)	— (—)	— (—)	1.2 (1.2)	2.1 (2.1)
合 計	45,329,000 (25,799,000)	48,427,115 (26,764,552)	99.6 (55.1)	— (—)	65.1 (28.3)	24.6 (19.3)	9.9 (7.4)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第1回利付国債(40年)	2.4	70,000	99,962	2048/3/20	第360回利付国債(10年)	0.1	200,000	200,974	2030/9/20
第2回利付国債(40年)	2.2	140,000	193,841	2049/3/20	第361回利付国債(10年)	0.1	70,000	70,254	2030/12/20
第3回利付国債(40年)	2.2	85,000	118,425	2050/3/20	第362回利付国債(10年)	0.1	250,000	250,582	2031/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	95,000	133,313	2051/3/20	第363回利付国債(10年)	0.1	200,000	200,190	2031/6/20
第5回利付国債(40年)	2.0	75,000	101,599	2052/3/20	第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	60,961	2029/9/20
第6回利付国債(40年)	1.9	110,000	146,808	2053/3/20	第3回利付国債(30年)	2.3	70,000	83,569	2030/5/20
第7回利付国債(40年)	1.7	80,000	102,752	2054/3/20	第5回利付国債(30年)	2.2	80,000	96,092	2031/5/20
第8回利付国債(40年)	1.4	95,000	114,235	2055/3/20	第6回利付国債(30年)	2.4	50,000	61,460	2031/11/20
第9回利付国債(40年)	0.4	130,000	117,399	2056/3/20	第8回利付国債(30年)	1.8	80,000	94,529	2032/11/22
第10回利付国債(40年)	0.9	125,000	131,903	2057/3/20	第14回利付国債(30年)	2.4	108,000	136,985	2034/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	140,000	143,229	2058/3/20	第15回利付国債(30年)	2.5	147,000	188,936	2034/6/20
第12回利付国債(40年)	0.5	175,000	161,750	2059/3/20	第16回利付国債(30年)	2.5	35,000	45,122	2034/9/20
第13回利付国債(40年)	0.5	180,000	165,843	2060/3/20	第17回利付国債(30年)	2.4	50,000	64,010	2034/12/20
第14回利付国債(40年)	0.7	90,000	88,631	2061/3/20	第18回利付国債(30年)	2.3	110,000	139,769	2035/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	45,000	45,295	2022/6/20	第19回利付国債(30年)	2.3	40,000	50,989	2035/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	210,000	211,729	2022/9/20	第20回利付国債(30年)	2.5	40,000	52,228	2035/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	30,000	30,277	2022/12/20	第21回利付国債(30年)	2.3	70,000	89,730	2035/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	65,000	65,676	2022/12/20	第22回利付国債(30年)	2.5	70,000	91,947	2036/3/20
第328回利付国債(10年)	0.6	115,000	116,131	2023/3/20	第23回利付国債(30年)	2.5	55,000	72,433	2036/6/20
第329回利付国債(10年)	0.8	230,000	233,431	2023/6/20	第24回利付国債(30年)	2.5	68,000	89,782	2036/9/20
第330回利付国債(10年)	0.8	210,000	213,614	2023/9/20	第25回利付国債(30年)	2.3	60,000	77,611	2036/12/20
第331回利付国債(10年)	0.6	80,000	81,072	2023/9/20	第26回利付国債(30年)	2.4	170,000	223,023	2037/3/20
第333回利付国債(10年)	0.6	210,000	213,500	2024/3/20	第27回利付国債(30年)	2.5	89,000	118,711	2037/9/20
第334回利付国債(10年)	0.6	120,000	122,212	2024/6/20	第28回利付国債(30年)	2.5	144,000	193,049	2038/3/20
第335回利付国債(10年)	0.5	490,000	498,472	2024/9/20	第29回利付国債(30年)	2.4	176,000	234,125	2038/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	80,000	81,489	2024/12/20	第30回利付国債(30年)	2.3	147,000	193,840	2039/3/20
第337回利付国債(10年)	0.3	30,000	30,369	2024/12/20	第31回利付国債(30年)	2.2	120,000	156,732	2039/9/20
第338回利付国債(10年)	0.4	390,000	396,438	2025/3/20	第32回利付国債(30年)	2.3	160,000	212,449	2040/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	370,000	376,563	2025/6/20	第33回利付国債(30年)	2.0	135,000	172,647	2040/9/20
第340回利付国債(10年)	0.4	420,000	428,051	2025/9/20	第34回利付国債(30年)	2.2	180,000	237,457	2041/3/20
第341回利付国債(10年)	0.3	700,000	711,214	2025/12/20	第35回利付国債(30年)	2.0	168,000	215,950	2041/9/20
第342回利付国債(10年)	0.1	130,000	131,002	2026/3/20	第36回利付国債(30年)	2.0	135,000	174,087	2042/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	245,000	246,940	2026/6/20	第37回利付国債(30年)	1.9	161,000	205,006	2042/9/20
第344回利付国債(10年)	0.1	50,000	50,405	2026/9/20	第38回利付国債(30年)	1.8	95,000	119,445	2043/3/20
第345回利付国債(10年)	0.1	610,000	615,197	2026/12/20	第39回利付国債(30年)	1.9	115,000	147,165	2043/6/20
第346回利付国債(10年)	0.1	690,000	696,161	2027/3/20	第40回利付国債(30年)	1.8	90,000	113,540	2043/9/20
第347回利付国債(10年)	0.1	160,000	161,449	2027/6/20	第41回利付国債(30年)	1.7	90,000	111,757	2043/12/20
第348回利付国債(10年)	0.1	90,000	90,825	2027/9/20	第42回利付国債(30年)	1.7	135,000	167,794	2044/3/20
第349回利付国債(10年)	0.1	590,000	595,457	2027/12/20	第43回利付国債(30年)	1.7	155,000	192,837	2044/6/20
第350回利付国債(10年)	0.1	680,000	686,099	2028/3/20	第44回利付国債(30年)	1.7	150,000	186,790	2044/9/20
第351回利付国債(10年)	0.1	535,000	539,627	2028/6/20	第45回利付国債(30年)	1.5	160,000	192,595	2044/12/20
第352回利付国債(10年)	0.1	590,000	595,091	2028/9/20	第46回利付国債(30年)	1.5	160,000	192,704	2045/3/20
第353回利付国債(10年)	0.1	300,000	302,466	2028/12/20	第47回利付国債(30年)	1.6	165,000	202,522	2045/6/20
第354回利付国債(10年)	0.1	325,000	327,642	2029/3/20	第48回利付国債(30年)	1.4	85,000	100,685	2045/9/20
第355回利付国債(10年)	0.1	250,000	251,910	2029/6/20	第49回利付国債(30年)	1.4	140,000	165,897	2045/12/20
第356回利付国債(10年)	0.1	200,000	201,420	2029/9/20	第50回利付国債(30年)	0.8	95,000	99,678	2046/3/20
第357回利付国債(10年)	0.1	720,000	724,975	2029/12/20	第51回利付国債(30年)	0.3	90,000	84,022	2046/6/20
第358回利付国債(10年)	0.1	660,000	664,144	2030/3/20	第52回利付国債(30年)	0.5	130,000	127,045	2046/9/20
第359回利付国債(10年)	0.1	550,000	553,080	2030/6/20	第53回利付国債(30年)	0.6	105,000	104,884	2046/12/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第54回利付国債 (30年)	0.8	110,000	114,847	2047/3/20	第101回利付国債 (20年)	2.4	66,000	76,299	2028/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	110,000	114,761	2047/6/20	第102回利付国債 (20年)	2.4	81,000	94,108	2028/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	90,000	93,824	2047/9/20	第103回利付国債 (20年)	2.3	11,000	12,706	2028/6/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	100,000	104,167	2047/12/20	第104回利付国債 (20年)	2.1	33,000	37,681	2028/6/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	100,000	103,964	2048/3/20	第105回利付国債 (20年)	2.1	77,000	88,306	2028/9/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	170,000	172,517	2048/6/20	第106回利付国債 (20年)	2.2	2,000	2,307	2028/9/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	120,000	127,452	2048/9/20	第107回利付国債 (20年)	2.1	130,000	149,674	2028/12/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	100,000	101,153	2048/12/20	第108回利付国債 (20年)	1.9	134,000	152,362	2028/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	120,000	115,144	2049/3/20	第109回利付国債 (20年)	1.9	27,000	30,815	2029/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	90,000	83,939	2049/6/20	第110回利付国債 (20年)	2.1	98,000	113,300	2029/3/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	100,000	93,106	2049/9/20	第111回利付国債 (20年)	2.2	25,000	29,205	2029/6/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	110,000	102,239	2049/12/20	第112回利付国債 (20年)	2.1	80,000	92,845	2029/6/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	180,000	167,209	2050/3/20	第113回利付国債 (20年)	2.1	290,000	337,835	2029/9/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	110,000	107,631	2050/6/20	第114回利付国債 (20年)	2.1	52,000	60,822	2029/12/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	140,000	136,963	2050/9/20	第115回利付国債 (20年)	2.2	125,000	147,226	2029/12/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	110,000	110,400	2050/12/20	第116回利付国債 (20年)	2.2	55,000	65,020	2030/3/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	110,000	110,403	2051/3/20	第117回利付国債 (20年)	2.1	343,000	402,620	2030/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	120,000	120,295	2051/6/20	第118回利付国債 (20年)	2.0	10,000	11,693	2030/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	135,000	137,448	2022/9/20	第119回利付国債 (20年)	1.8	30,000	34,564	2030/6/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	33,000	33,684	2022/12/20	第120回利付国債 (20年)	1.6	170,000	192,934	2030/6/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	295,000	300,100	2022/12/20	第121回利付国債 (20年)	1.9	22,000	25,617	2030/9/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	27,000	27,416	2023/3/20	第122回利付国債 (20年)	1.8	17,000	19,644	2030/9/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	31,000	31,974	2023/6/20	第123回利付国債 (20年)	2.1	195,000	231,295	2030/12/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	54,000	56,059	2023/9/20	第124回利付国債 (20年)	2.0	90,000	105,932	2030/12/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	100,000	104,293	2023/12/20	第125回利付国債 (20年)	2.2	50,000	59,939	2031/3/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	34,000	35,386	2023/12/20	第126回利付国債 (20年)	2.0	105,000	123,912	2031/3/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	34,000	35,623	2024/3/20	第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	58,539	2031/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	78,000	82,286	2024/3/20	第128回利付国債 (20年)	1.9	65,000	76,287	2031/6/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	104,000	110,883	2024/6/20	第129回利付国債 (20年)	1.8	85,000	98,947	2031/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	112,000	119,127	2024/9/20	第130回利付国債 (20年)	1.8	150,000	175,078	2031/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	113,000	120,436	2024/12/20	第131回利付国債 (20年)	1.7	12,000	13,888	2031/9/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	118,000	126,137	2024/12/20	第132回利付国債 (20年)	1.7	75,000	87,011	2031/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	10,000	10,742	2025/3/20	第133回利付国債 (20年)	1.8	30,000	35,105	2031/12/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	21,000	22,415	2025/3/20	第134回利付国債 (20年)	1.8	50,000	58,653	2032/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	40,000	42,831	2025/3/20	第135回利付国債 (20年)	1.7	30,000	34,884	2032/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	160,000	172,171	2025/6/20	第136回利付国債 (20年)	1.6	220,000	253,556	2032/3/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	60,000	65,115	2025/9/20	第137回利付国債 (20年)	1.7	200,000	233,096	2032/6/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	130,000	143,039	2026/3/20	第138回利付国債 (20年)	1.5	120,000	137,335	2032/6/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	300,000	333,144	2026/6/20	第139回利付国債 (20年)	1.6	230,000	265,643	2032/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	16,000	17,785	2026/9/20	第140回利付国債 (20年)	1.7	358,000	418,398	2032/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	250,000	279,122	2026/9/20	第141回利付国債 (20年)	1.7	195,000	228,389	2032/12/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	60,000	66,709	2026/12/20	第142回利付国債 (20年)	1.8	125,000	147,776	2032/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	60,000	66,706	2027/3/20	第143回利付国債 (20年)	1.6	94,000	109,269	2033/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	50,000	55,860	2027/3/20	第144回利付国債 (20年)	1.5	430,000	495,033	2033/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	82,000	92,964	2027/6/20	第145回利付国債 (20年)	1.7	355,000	417,504	2033/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	98,000	109,993	2027/6/20	第146回利付国債 (20年)	1.7	135,000	159,088	2033/9/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	45,000	50,989	2027/9/20	第147回利付国債 (20年)	1.6	98,000	114,542	2033/12/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	94,000	105,955	2027/9/20	第148回利付国債 (20年)	1.5	90,000	104,276	2034/3/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	117,000	132,470	2027/12/20	第149回利付国債 (20年)	1.5	115,000	133,439	2034/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	30,000	34,296	2028/3/20	第150回利付国債 (20年)	1.4	140,000	160,921	2034/9/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円		<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第151回利付国債 (20年)	1.2	140,000	157,530	2034/12/20	第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,525	2024/11/25
第152回利付国債 (20年)	1.2	300,000	337,812	2035/3/20	第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	202,174	2025/1/24
第153回利付国債 (20年)	1.3	270,000	308,021	2035/6/20	第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	101,568	2025/3/25
第154回利付国債 (20年)	1.2	160,000	180,537	2035/9/20	第147回共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	101,971	2025/6/25
第155回利付国債 (20年)	1.0	270,000	297,467	2035/12/20	第165回共同発行市場公募地方債	0.145	200,000	201,134	2026/12/25
第156回利付国債 (20年)	0.4	160,000	162,768	2036/3/20	平成24年度第1回長崎県公募公債	0.82	100,000	100,753	2022/9/28
第157回利付国債 (20年)	0.2	150,000	148,102	2036/6/20	平成28年度第1回長崎県公募公債	0.105	100,000	100,446	2026/9/30
第158回利付国債 (20年)	0.5	170,000	174,972	2036/9/20	平成27年度第1回佐賀県公募公債	0.476	100,000	101,910	2025/11/28
第159回利付国債 (20年)	0.6	150,000	156,406	2036/12/20	平成29年度第1回滋賀県公募公債	0.19	100,000	100,759	2027/11/30
第160回利付国債 (20年)	0.7	140,000	147,912	2037/3/20	平成27年度第2回熊本県公募公債 (10年)	0.476	100,000	101,880	2025/10/30
第161回利付国債 (20年)	0.6	120,000	124,912	2037/6/20	第2回名古屋市定時償還公募公債 (10年)	0.275	40,000	40,178	2025/7/17
第162回利付国債 (20年)	0.6	150,000	156,000	2037/9/20	第486回名古屋市公募公債 (10年)	0.694	200,000	203,274	2024/3/19
第163回利付国債 (20年)	0.6	165,000	171,435	2037/12/20	平成27年度第5回札幌市公募公債 (10年)	0.47	100,000	101,813	2025/9/19
第164回利付国債 (20年)	0.5	255,000	260,727	2038/3/20	第51回川崎市公募公債 (5年)	0.02	100,000	100,014	2022/9/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	170,000	173,600	2038/6/20	第53回川崎市公募公債 (5年)	0.03	100,000	100,041	2023/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	100,000	105,248	2038/9/20	令和元年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,972	2024/10/31
第167回利付国債 (20年)	0.5	160,000	162,958	2038/12/20	令和2年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.02	100,000	100,051	2025/10/30
第168回利付国債 (20年)	0.4	100,000	100,000	2039/3/20	平成25年度第2回福井県公募公債	0.68	200,000	202,698	2023/10/25
第169回利付国債 (20年)	0.3	160,000	156,974	2039/6/20					
第170回利付国債 (20年)	0.3	140,000	137,088	2039/9/20	<b>小 計</b>		4,740,000	4,809,141	
第171回利付国債 (20年)	0.3	170,000	166,139	2039/12/20	<b>特殊債券 (除く金融債)</b>				
第172回利付国債 (20年)	0.4	230,000	228,433	2040/3/20	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	112,067	2027/2/26
第173回利付国債 (20年)	0.4	150,000	148,708	2040/6/20	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	113,481	2027/10/29
第174回利付国債 (20年)	0.4	200,000	197,912	2040/9/20	第20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	101,679	2024/6/28
第175回利付国債 (20年)	0.5	140,000	140,861	2040/12/20	第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	100,012	2026/4/30
第176回利付国債 (20年)	0.5	160,000	160,708	2041/3/20	第32回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.09	200,000	200,472	2027/9/30
第177回利付国債 (20年)	0.4	150,000	147,712	2041/6/20	第30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	100,464	2028/6/30
<b>小 計</b>		33,789,000	36,703,224		第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.819	100,000	100,752	2022/9/20
<b>地方債証券</b>					第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.693	100,000	101,464	2023/12/18
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	106,754	2025/3/19	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.01	200,000	199,902	2026/9/14
第712回東京都公募公債	0.77	200,000	201,381	2022/9/20	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	99,821	2027/1/29
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	101,565	2024/3/19	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.11	200,000	200,776	2027/5/21
第731回東京都公募公債	0.635	100,000	101,496	2024/3/19	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	100,000	100,505	2027/6/14
第736回東京都公募公債	0.505	100,000	101,435	2024/9/20	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	200,000	201,696	2028/2/15
第739回東京都公募公債	0.29	100,000	100,882	2024/12/20	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	0.13	100,000	100,365	2028/7/19
第744回東京都公募公債	0.577	100,000	102,068	2025/6/20	第1回政府保証新聞西国際空港債券	0.803	100,000	100,687	2022/8/29
令和3年度第6回北海道公募公債 (5年)	0.005	100,000	99,928	2026/7/30	第2回政府保証新聞西国際空港債券	0.882	100,000	101,496	2023/6/27
第214回神奈川県公募公債	0.563	100,000	102,017	2025/6/20	第5回政府保証新聞西国際空港債券	0.145	100,000	100,568	2027/3/30
平成25年度第10回静岡県公募公債	0.669	200,000	203,180	2024/3/26	第5回新聞西国際空港株式会社社債 (一般担保)	0.9	100,000	101,660	2023/9/15
平成27年度第10回静岡県公募公債	0.461	200,000	203,554	2025/9/19	第11回新聞西国際空港株式会社社債 (一般担保)	0.506	200,000	202,900	2024/12/20
平成28年度第12回愛知県公募公債 (10年)	0.515	200,000	203,026	2024/10/25	第50回株式会社日本政策投資銀行社債 (社債償還元金控除)	0.781	100,000	100,695	2022/9/20
平成24年度第10回埼玉県公募公債	0.825	100,000	101,099	2023/2/27	第17回道路債券	1.54	100,000	101,762	2022/12/20
平成25年度第3回埼玉県公募公債	0.67	200,000	203,384	2024/5/20	第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	100,985	2023/3/20
平成22年度第1回福岡県公募公債 (15年)	1.67	100,000	106,764	2025/11/21	第129回新聞西国際空港債券 (一般担保)	0.69	100,000	101,591	2024/3/19
平成24年度第9回福岡県公募公債	0.71	100,000	100,825	2022/12/26	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	101,334	2024/6/20
平成26年度第2回新潟県公募公債	0.429	100,000	101,399	2025/2/27	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.5	100,000	101,377	2024/9/20
第10回群馬県公募公債 (10年)	0.67	100,000	101,383	2023/11/24	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,419	2024/12/20
平成25年度第1回岐阜県公募公債 (10年)	0.81	100,000	101,551	2023/9/29	第11回公営企業債券 (20年)	2.11	100,000	107,119	2025/3/24
平成26年度第1回岐阜県公募公債 (10年)	0.554	100,000	101,593	2024/9/30	第13回公営企業債券 (20年)	2.16	100,000	107,804	2025/6/20
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	101,694	2024/4/25	第45回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	202,098	2023/2/28
					F54回地方公共団体金融機構債券	1.588	100,000	103,753	2024/3/19

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円		<b>金融債券</b>	%	千円	千円	
第56回地方公共団体金融機構債券	0.783	100,000	101,724	2024/1/26	第363回信金中金債(5年)	0.01	100,000	99,899	2025/2/27
第60回地方公共団体金融機構債券	0.729	100,000	101,833	2024/5/28	小 計		200,000	199,856	
第62回地方公共団体金融機構債券	0.631	100,000	101,678	2024/7/26	<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
F63回地方公共団体金融機構債券	1.579	100,000	105,686	2025/6/20	第15回成田国際空港株式会社債(一般担保付)	0.739	100,000	101,624	2024/2/20
第74回地方公共団体金融機構債券	0.519	100,000	101,879	2025/7/28	第25回西日本高速道路株式会社債(一般担保付、独立行政法人 日本高速道路保有・債務返済機構重慶の債務引受済み)	0.524	100,000	101,507	2024/12/20
第81回地方公共団体金融機構債券	0.19	100,000	100,737	2026/2/27	第5回不二製油グループ株式会社社債担保社債(社債間限定同順位特付)	0.456	100,000	100,211	2022/12/9
F101回地方公共団体金融機構債券	1.22	200,000	205,662	2024/3/6	第21回味の素株式会社社債担保社債(特定社債間限定同順位特付)	0.2	200,000	200,390	2023/3/2
F290回地方公共団体金融機構債券	0.353	100,000	100,659	2023/9/28	第11回株式会社セブン銀行無担保社債(社債間限定同順位特付)	0.536	100,000	101,330	2024/12/20
第35回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	0.62	100,000	100,934	2023/5/8	第24回東日本旅客鉄道株式会社社債担保社債(社債間限定同順位特付)	1.71	100,000	101,515	2022/9/20
第39回独立行政法人福祉医療機構債券	0.674	100,000	101,718	2024/6/20	第29回東日本旅客鉄道株式会社社債担保社債(社債間限定同順位特付)	2.01	100,000	103,713	2023/9/20
第19回沖縄振興開発金融公庫債券	0.868	100,000	101,415	2023/6/20	第7回東日本旅客鉄道株式会社社債担保普通社債(社債間限定同順位特付)	0.869	200,000	201,544	2022/9/27
第29回国際協力機構債券	0.583	100,000	102,034	2025/6/20	第9回東日本旅客鉄道株式会社社債担保普通社債(社債間限定同順位特付)	0.757	100,000	101,547	2024/1/30
第37回国際協力機構債券	0.1	100,000	100,342	2026/9/18	第63回日本電信電話株式会社社債電話債券(一般担保付)	0.69	200,000	201,744	2023/3/20
小 計		5,000,000	5,097,006		第20回KDDI株式会社社債担保社債(社債間限定同順位特付)	0.803	100,000	101,469	2023/12/20
<b>金融債券</b>					第26回KDDI株式会社社債担保社債(社債間限定同順位特付)	0.13	100,000	100,006	2024/4/26
第357回信金中金債(5年)	0.02	100,000	99,957	2024/8/27	第19回NTTファイナンス株式会社社債担保社債(社債間限定同順位特付)	0.73	100,000	101,286	2023/9/20
					小 計		1,600,000	1,617,886	
					合 計		45,329,000	48,427,115	

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	48,427,115	99.6
コール・ローン等、その他	215,000	0.4
投資信託財産総額	48,642,115	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	48,642,115,700	
コール・ローン等	71,007,193	
公社債(評価額)	48,427,115,343	
未収入金	57,033,800	
未収利息	84,374,456	
前払費用	2,584,908	
(B) 負債	24,088,512	
未払解約金	24,088,484	
未払利息	28	
(C) 純資産総額(A-B)	48,618,027,188	
元本	34,479,945,047	
次期繰越損益金	14,138,082,141	
(D) 受益権総口数	34,479,945,047口	
1万口当たり基準価額(C/D)	14,100円	

(注) 当ファンドの期首元本額は31,007,104,895円、期中追加設定元本額は5,127,924,648円、期中一部解約元本額は1,655,084,496円です。

(注) 2021年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,607,446,677円
・DCインデックスバランス(株式20)	4,165,088,588円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,120,607,198円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	4,024,703,763円
・DCインデックスバランス(株式40)	3,824,408,447円
・DCインデックスバランス(株式60)	2,792,330,713円
・インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,228,428,435円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,703,336,062円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,457,917,809円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,449,114,415円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	816,461,795円
・DCインデックスバランス(株式80)	453,495,710円
・日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	341,534,237円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	244,385,579円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式30)	116,490,805円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	99,004,620円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	30,178,231円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	5,011,963円

(注) 1口当たり純資産額は1.4100円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

## ○損益の状況 (2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	409,480,810	
受取利息	409,504,257	
支払利息	△ 23,447	
(B) 有価証券売買損益	△ 508,136,822	
売買益	7,254,717	
売買損	△ 515,391,539	
(C) 当期損益金(A+B)	△ 98,656,012	
(D) 前期繰越損益金	12,800,117,753	
(E) 追加信託差損益金	2,116,947,382	
(F) 解約差損益金	△ 680,326,982	
(G) 計(C+D+E+F)	14,138,082,141	
次期繰越損益金(G)	14,138,082,141	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(E)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) 損益の状況の中で(F)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。

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2020年10月27日から2021年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

# 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

## 運用報告書

第23期（決算日 2021年10月26日）  
（2020年10月27日～2021年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	内外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。

## ファンド概要

主として世界各国の債券に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	期騰	期中率	期騰	期中率		
	円	%		%	%	百万円
19期(2017年10月26日)	23,039	11.8	229.54	11.9	98.9	158,578
20期(2018年10月26日)	22,220	△ 3.6	221.52	△ 3.5	98.9	147,033
21期(2019年10月28日)	23,455	5.6	233.74	5.5	99.1	154,835
22期(2020年10月26日)	24,530	4.6	244.04	4.4	99.2	152,834
23期(2021年10月26日)	25,816	5.2	257.16	5.4	99.3	159,216

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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指数です。なお、設定時を100として2021年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	券率
	騰落	率	騰落	率		
(期首) 2020年10月26日	円	%		%		%
	24,530	—	244.04	—	—	99.2
10月末	24,405	△0.5	242.69	△0.6		99.2
11月末	24,656	0.5	245.21	0.5		99.4
12月末	24,862	1.4	247.28	1.3		99.2
2021年1月末	24,828	1.2	247.38	1.4		99.2
2月末	24,607	0.3	245.92	0.8		99.3
3月末	25,150	2.5	250.34	2.6		99.2
4月末	25,141	2.5	250.29	2.6		99.1
5月末	25,470	3.8	253.57	3.9		99.3
6月末	25,439	3.7	253.35	3.8		99.2
7月末	25,613	4.4	255.08	4.5		99.2
8月末	25,610	4.4	254.97	4.5		99.3
9月末	25,433	3.7	253.35	3.8		99.2
(期末) 2021年10月26日						
	25,816	5.2	257.16	5.4		99.3

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

（2020年10月27日～2021年10月26日）

## 基準価額の推移

期間の初め24,530円の基準価額は、期間末に25,816円となり、騰落率は+5.2%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

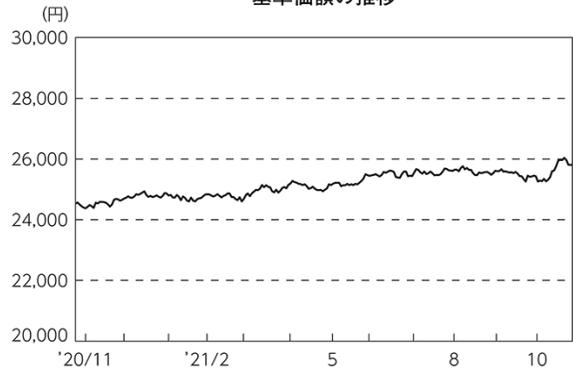
## &lt;値上がり要因&gt;

- ・新型コロナウイルスや同変異株の感染拡大により景気の先行きが懸念されたこと。
- ・政策金利を据え置いた欧州中央銀行（ECB）がパンデミック緊急購入プログラム（PEPP）における資産購入ペースを維持したこと。
- ・中国当局によるインターネット企業や教育産業などへの規制強化、中国景気の減速懸念などを受けて、投資家がリスク回避姿勢を強めたこと。
- ・円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高、円安／イギリスポンド高となったこと。

## &lt;値下がり要因&gt;

- ・新型コロナウイルスのワクチンや治療薬の開発進展およびワクチン接種の普及から感染収束期待が高まったこと。
- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）による金融緩和と政策の転換観測が広がったこと。
- ・原油価格や天然ガス価格の上昇などを背景にインフレが懸念されたこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2020/10/26	2021/10/20	2020/11/02	2021/10/26
24,530円	26,039円	24,378円	25,816円

FTSE世界国債インデックス  
（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移

## （海外債券市況）

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など、各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2021年5月前半にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済の先行きが懸念されたことや、米国による中国大手半導体企業への制裁など米中対立が激化したことなどが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、英国と欧州連合（EU）が自由貿易協定（FTA）の締結交渉で合意したことや、米国新政権下で大型財政支出実施の可能性が高まったこと、新型コロナウイルスのワクチンや治療薬の開発進展およびワクチン接種の普及から感染収束期待が高まり、投資家のリスク選好姿勢が強まったことなどから、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。5月後半から7月下旬にかけては、新型コロナウイルス変異株の感染拡大により景気の先行きが懸念されたことや、政策金利を据え置いたECBがPEPPにおける資産購入ペースを維持したこと、ECBが利上げ時期に関するガイダンスを変更し金融緩和政策の継続を示したこと、中国当局によるインターネット企業や教育産業などへの規制強化、中国景気の減速懸念などを背景とした投資家のリスク回避姿勢などから、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。8月上旬から期間末にかけては、失業率や非農業部門雇用者数など米国の雇用統計の指標が概ね良好な結果となったことや、複数のECB幹部が経済の先行きについて楽観的見通しを示したこと、FOMCを受けてFRBによる金融緩和政策の転換観測が広がったこと、原油価格や天然ガス価格の上昇などを背景にインフレが懸念されたことなどから、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

## （為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。



## ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマークが採用している国の債券の中からポートフォリオを構築し、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、債券の組入比率を高位に維持してベンチマークとの連動性を保つように努めました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、5.2%の値上がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」の上昇率5.4%を概ね0.1%下回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

### <プラス要因>

- ・ 投資銘柄の選択による効果が寄与したこと。
- ・ 投資国の選択による効果が寄与したこと。

### <マイナス要因>

- ・ 投資通貨の選択が影響したこと。
- ・ 外国口座の管理費用を支払ったこと。

## ○今後の運用方針

引き続き、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )	円 3 (3)	% 0.013 (0.013)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
合 計	3	0.013	
期中の平均基準価額は、25,101円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 187,245	千アメリカドル 145,593
	カナダ	国債証券	千カナダドル 10,985	千カナダドル 10,354
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 35,193	千メキシコペソ 52,071
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	19,562	21,977
	イタリア	国債証券	18,087	19,595
	フランス	国債証券	18,619	18,723
	オランダ	国債証券	3,689	4,111
	スペイン	国債証券	10,394	10,575
	ベルギー	国債証券	2,857	4,613
	オーストリア	国債証券	2,819	2,287
	フィンランド	国債証券	1,058	1,202
	アイルランド	国債証券	1,473	1,305
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 7,011	千イギリスポンド 12,062
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 8,867	千スウェーデンクローナ 10,742
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 3,549	千ノルウェークローネ 499
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 5,794	千デンマーククローネ 8,497
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 5,798	千ポーランドズロチ 9,540
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 5,474	千オーストラリアドル 20,452
シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,468	千シンガポールドル 1,924	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリングット 4,175	千マレーシアリングット 4,119	
イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 4,897	千イスラエルシェケル 3,374	

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2020年10月27日～2021年10月26日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2021年10月26日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 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	千アメリカドル 621,190	千アメリカドル 645,875	千円 73,520,058	% 46.2	% —	% 20.9	% 16.8	% 8.5
カナダ	千カナダドル 32,657	千カナダドル 34,111	3,135,554	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メキシコ	千メキシコペソ 195,640	千メキシコペソ 199,397	1,124,858	0.7	—	0.4	0.3	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	75,782	88,368	11,669,001	7.3	—	4.6	1.8	1.0
イタリア	95,789	110,938	14,649,463	9.2	—	5.7	2.4	1.1
フランス	105,161	122,451	16,169,694	10.2	—	6.6	2.4	1.1
オランダ	19,070	22,423	2,961,075	1.9	—	1.3	0.4	0.2
スペイン	61,831	71,790	9,479,919	6.0	—	3.9	1.6	0.5
ベルギー	22,640	27,213	3,593,540	2.3	—	1.7	0.4	0.1
オーストリア	15,160	17,655	2,331,429	1.5	—	0.9	0.4	0.2
フィンランド	6,722	7,237	955,708	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,941	9,868	1,303,186	0.8	—	0.6	0.2	0.1
イギリス	千イギリスポンド 50,207	千イギリスポンド 60,960	9,547,576	6.0	—	4.7	0.8	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 33,515	千スウェーデンクローナ 36,604	484,275	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 29,740	千ノルウェークローネ 29,957	408,324	0.3	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 36,180	千デンマーククローネ 45,491	807,468	0.5	—	0.3	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 29,215	千ポーランドズロチ 29,178	835,250	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 32,745	千オーストラリアドル 34,096	2,909,134	1.8	—	1.2	0.4	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 7,536	千シンガポールドル 7,935	670,633	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 27,570	千マレーシアリンギット 28,125	771,357	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 18,625	千イスラエルシェケル 20,453	727,444	0.5	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	158,054,958	99.3	—	55.3	29.7	14.3

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
(アメリカ) 国債証券					
US TREASURY N/B	1.75	3,550	3,603	410,240	2022/9/30
US TREASURY N/B	1.875	2,040	2,073	236,015	2022/9/30
US TREASURY N/B	1.375	3,000	3,036	345,615	2022/10/15
US TREASURY N/B	1.875	3,000	3,053	347,536	2022/10/31
US TREASURY N/B	2.0	2,400	2,445	278,328	2022/10/31
US TREASURY N/B	0.125	8,000	8,000	910,650	2022/10/31
US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,031	231,220	2022/11/15
US TREASURY N/B	2.0	3,410	3,478	396,014	2022/11/30
US TREASURY N/B	1.625	2,040	2,073	236,013	2022/12/15
US TREASURY N/B	2.125	3,900	3,988	454,020	2022/12/31
US TREASURY N/B	1.5	3,000	3,047	346,912	2023/1/15
US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,038	232,030	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.375	1,580	1,622	184,741	2023/1/31
US TREASURY N/B	0.125	3,000	2,996	341,049	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.0	2,300	2,352	267,832	2023/2/15
US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,522	173,286	2023/2/15
US TREASURY N/B	1.5	3,100	3,151	358,745	2023/2/28
US TREASURY N/B	2.625	880	907	103,355	2023/2/28
US TREASURY N/B	0.5	2,000	2,006	228,371	2023/3/15
US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,034	231,608	2023/3/31
US TREASURY N/B	2.5	2,130	2,196	250,063	2023/3/31
US TREASURY N/B	0.25	3,500	3,497	398,078	2023/4/15
US TREASURY N/B	1.625	1,160	1,182	134,644	2023/4/30
US TREASURY N/B	2.75	3,600	3,731	424,778	2023/4/30
US TREASURY N/B	1.75	2,650	2,708	308,306	2023/5/15
US TREASURY N/B	0.125	2,970	2,960	337,045	2023/5/15
US TREASURY N/B	1.625	1,500	1,530	174,219	2023/5/31
US TREASURY N/B	2.75	1,300	1,349	153,652	2023/5/31
US TREASURY N/B	0.25	2,500	2,495	284,063	2023/6/15
US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,525	173,636	2023/6/30
US TREASURY N/B	2.625	2,350	2,438	277,568	2023/6/30
US TREASURY N/B	0.125	2,680	2,667	303,693	2023/7/15
US TREASURY N/B	1.25	3,000	3,045	346,619	2023/7/31
US TREASURY N/B	2.75	3,000	3,123	355,576	2023/7/31
US TREASURY N/B	0.125	7,000	6,966	792,966	2023/7/31
US TREASURY N/B	2.5	5,300	5,499	626,040	2023/8/15
US TREASURY N/B	0.125	3,860	3,840	437,118	2023/8/15
US TREASURY N/B	1.375	4,550	4,629	526,919	2023/8/31
US TREASURY N/B	0.125	3,000	2,982	339,449	2023/9/15
US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,544	289,649	2023/9/30
US TREASURY N/B	2.875	660	690	78,627	2023/9/30
US TREASURY N/B	0.125	1,400	1,390	158,328	2023/10/15
US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,739	197,982	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.875	900	943	107,371	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	4,185	476,467	2023/11/15
US TREASURY N/B	0.25	8,000	7,962	906,335	2023/11/15
US TREASURY N/B	2.125	2,680	2,771	315,449	2023/11/30
US TREASURY N/B	2.875	1,810	1,899	216,249	2023/11/30
US TREASURY N/B	0.125	3,000	2,975	338,688	2023/12/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
(アメリカ) 国債証券					
US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,074	236,175	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.625	2,470	2,582	293,916	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,076	236,423	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.5	2,520	2,630	299,451	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.75	3,300	3,466	394,604	2024/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,554	176,944	2024/2/29
US TREASURY N/B	2.375	1,630	1,698	193,301	2024/2/29
US TREASURY N/B	0.25	5,000	4,959	564,525	2024/3/15
US TREASURY N/B	2.125	3,860	4,001	455,465	2024/3/31
US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,069	235,525	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,121	355,343	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.5	3,380	3,540	403,005	2024/5/15
US TREASURY N/B	0.25	2,600	2,574	293,009	2024/5/15
US TREASURY N/B	2.0	3,870	4,004	455,828	2024/5/31
US TREASURY N/B	0.25	4,700	4,648	529,128	2024/6/15
US TREASURY N/B	2.0	2,300	2,381	271,100	2024/6/30
US TREASURY N/B	1.75	2,660	2,736	311,439	2024/6/30
US TREASURY N/B	2.125	2,490	2,588	294,646	2024/7/31
US TREASURY N/B	1.75	2,640	2,717	309,332	2024/7/31
US TREASURY N/B	2.375	4,620	4,836	550,484	2024/8/15
US TREASURY N/B	0.375	5,000	4,955	564,036	2024/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,420	1,466	166,970	2024/8/31
US TREASURY N/B	1.25	2,300	2,335	265,812	2024/8/31
US TREASURY N/B	2.125	2,015	2,096	238,591	2024/9/30
US TREASURY N/B	1.5	2,200	2,248	255,996	2024/9/30
US TREASURY N/B	2.25	1,090	1,138	129,631	2024/10/31
US TREASURY N/B	1.5	1,860	1,901	216,458	2024/10/31
US TREASURY N/B	2.25	1,650	1,724	196,275	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.125	1,400	1,457	165,960	2024/11/30
US TREASURY N/B	1.5	3,470	3,547	403,807	2024/11/30
US TREASURY N/B	2.25	1,900	1,987	226,191	2024/12/31
US TREASURY N/B	1.75	1,300	1,339	152,455	2024/12/31
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,581	180,052	2025/1/31
US TREASURY N/B	1.375	3,670	3,736	425,319	2025/1/31
US TREASURY N/B	2.0	4,870	5,056	575,595	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.75	2,060	2,190	249,319	2025/2/28
US TREASURY N/B	1.125	1,540	1,554	176,945	2025/2/28
US TREASURY N/B	2.625	4,400	4,662	530,727	2025/3/31
US TREASURY N/B	0.5	1,570	1,551	176,552	2025/3/31
US TREASURY N/B	2.875	2,200	2,351	267,716	2025/4/30
US TREASURY N/B	0.375	2,150	2,111	240,389	2025/4/30
US TREASURY N/B	2.125	4,800	5,006	569,914	2025/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,150	1,230	140,055	2025/5/31
US TREASURY N/B	0.25	2,020	1,972	224,578	2025/5/31
US TREASURY N/B	2.75	1,370	1,460	166,275	2025/6/30
US TREASURY N/B	2.875	1,440	1,543	175,680	2025/7/31
US TREASURY N/B	0.25	3,000	2,923	332,732	2025/7/31
US TREASURY N/B	2.0	5,020	5,217	593,915	2025/8/15
US TREASURY N/B	2.75	3,000	3,203	364,627	2025/8/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
(アメリカ) 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	3.0	4,700	5,067	576,787	2025/9/30
US TREASURY N/B	0.25	320	311	35,402	2025/9/30
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,510	171,952	2025/10/31
US TREASURY N/B	0.25	3,800	3,686	419,670	2025/10/31
US TREASURY N/B	2.25	5,140	5,393	613,917	2025/11/15
US TREASURY N/B	2.875	1,320	1,418	161,463	2025/11/30
US TREASURY N/B	0.375	3,420	3,330	379,056	2025/11/30
US TREASURY N/B	2.625	2,000	2,129	242,444	2025/12/31
US TREASURY N/B	2.625	1,850	1,971	224,384	2026/1/31
US TREASURY N/B	0.375	5,000	4,854	552,631	2026/1/31
US TREASURY N/B	6.0	1,800	2,175	247,641	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	3,310	3,387	385,556	2026/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,790	1,898	216,112	2026/2/28
US TREASURY N/B	0.5	3,650	3,559	405,181	2026/2/28
US TREASURY N/B	2.25	2,070	2,173	247,404	2026/3/31
US TREASURY N/B	0.75	2,400	2,363	269,024	2026/3/31
US TREASURY N/B	2.375	6,100	6,441	733,190	2026/4/30
US TREASURY N/B	0.75	2,740	2,695	306,819	2026/4/30
US TREASURY N/B	1.625	4,840	4,948	563,268	2026/5/15
US TREASURY N/B	2.125	2,740	2,863	325,935	2026/5/31
US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,067	235,365	2026/6/30
US TREASURY N/B	1.875	2,960	3,060	348,341	2026/7/31
US TREASURY N/B	0.625	3,260	3,179	361,895	2026/7/31
US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,063	462,585	2026/8/15
US TREASURY N/B	0.75	3,000	2,941	334,780	2026/8/31
US TREASURY N/B	1.625	1,620	1,655	188,463	2026/9/30
US TREASURY N/B	1.625	2,450	2,503	284,978	2026/10/31
US TREASURY N/B	2.0	3,040	3,160	359,790	2026/11/15
US TREASURY N/B	1.625	2,870	2,931	333,698	2026/11/30
US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,055	233,938	2026/12/31
US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,029	230,977	2027/1/31
US TREASURY N/B	2.25	360	378	43,124	2027/2/15
US TREASURY N/B	1.125	1,000	994	113,196	2027/2/28
US TREASURY N/B	0.625	1,210	1,170	133,220	2027/3/31
US TREASURY N/B	0.5	1,000	959	109,163	2027/4/30
US TREASURY N/B	2.375	3,530	3,738	425,591	2027/5/15
US TREASURY N/B	0.5	1,600	1,532	174,412	2027/5/31
US TREASURY N/B	0.5	3,500	3,349	381,254	2027/6/30
US TREASURY N/B	0.375	2,000	1,897	215,992	2027/7/31
US TREASURY N/B	2.25	2,960	3,115	354,632	2027/8/15
US TREASURY N/B	0.5	2,100	2,002	227,987	2027/8/31
US TREASURY N/B	0.375	4,590	4,341	494,171	2027/9/30
US TREASURY N/B	0.5	5,000	4,756	541,426	2027/10/31
US TREASURY N/B	6.125	2,860	3,662	416,937	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	3,020	3,178	361,814	2027/11/15
US TREASURY N/B	0.625	3,960	3,785	430,869	2027/12/31
US TREASURY N/B	0.75	5,000	4,809	547,428	2028/1/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	4,332	493,123	2028/2/15
US TREASURY N/B	1.125	3,210	3,160	359,727	2028/2/29
US TREASURY N/B	1.25	3,960	3,922	446,496	2028/3/31
US TREASURY N/B	1.25	3,370	3,335	379,718	2028/4/30

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
(アメリカ) 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	2.875	4,940	5,395	614,191	2028/5/15
US TREASURY N/B	1.25	4,300	4,252	484,105	2028/5/31
US TREASURY N/B	1.25	3,300	3,260	371,141	2028/6/30
US TREASURY N/B	5.5	500	632	71,959	2028/8/15
US TREASURY N/B	2.875	4,200	4,593	522,906	2028/8/15
US TREASURY N/B	1.125	3,900	3,815	434,295	2028/8/31
US TREASURY N/B	5.25	1,070	1,345	153,104	2028/11/15
US TREASURY N/B	3.125	4,510	5,014	570,836	2028/11/15
US TREASURY N/B	2.625	1,870	2,018	229,749	2029/2/15
US TREASURY N/B	2.375	3,880	4,122	469,264	2029/5/15
US TREASURY N/B	1.625	3,140	3,167	360,525	2029/8/15
US TREASURY N/B	1.75	2,890	2,941	334,886	2029/11/15
US TREASURY N/B	1.5	4,340	4,326	492,536	2030/2/15
US TREASURY N/B	6.25	1,060	1,462	166,458	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	4,590	4,245	483,212	2030/5/15
US TREASURY N/B	0.625	5,090	4,692	534,174	2030/8/15
US TREASURY N/B	0.875	6,110	5,745	653,988	2030/11/15
US TREASURY N/B	5.375	660	878	100,049	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.125	8,400	8,057	917,178	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.625	7,480	7,490	852,645	2031/5/15
US TREASURY N/B	1.25	4,650	4,489	510,990	2031/8/15
US TREASURY N/B	4.5	800	1,086	123,646	2036/2/15
US TREASURY N/B	5.0	750	1,077	122,689	2037/5/15
US TREASURY N/B	4.375	670	909	103,525	2038/2/15
US TREASURY N/B	4.5	720	992	112,931	2038/5/15
US TREASURY N/B	3.5	800	989	112,581	2039/2/15
US TREASURY N/B	4.25	1,450	1,960	223,131	2039/5/15
US TREASURY N/B	4.5	1,420	1,977	225,141	2039/8/15
US TREASURY N/B	4.375	750	1,031	117,383	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.625	680	964	109,776	2040/2/15
US TREASURY N/B	4.375	1,590	2,195	249,914	2040/5/15
US TREASURY N/B	1.125	3,700	3,171	360,981	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	1,440	1,872	213,179	2040/8/15
US TREASURY N/B	1.125	1,700	1,451	165,221	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.25	1,010	1,375	156,617	2040/11/15
US TREASURY N/B	1.375	3,100	2,763	314,566	2040/11/15
US TREASURY N/B	4.75	1,500	2,172	247,290	2041/2/15
US TREASURY N/B	4.375	870	1,208	137,546	2041/5/15
US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,095	352,321	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	960	1,234	140,553	2041/8/15
US TREASURY N/B	3.125	500	592	67,419	2042/2/15
US TREASURY N/B	2.75	800	894	101,874	2042/8/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	2,236	254,530	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	1,765	2,090	238,015	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	2,050	2,339	266,285	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	1,950	2,489	283,365	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	2,090	2,719	309,564	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	1,080	1,382	157,425	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	2,400	2,968	337,872	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.125	2,150	2,561	291,559	2044/8/15
US TREASURY N/B	3.0	2,300	2,688	306,081	2044/11/15

銘柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千アメリカドル	千アメリカドル 外貨建金額 邦貨換算金額	千円
<b>(アメリカ)</b> <b>国債証券</b>				
US TREASURY N/B	2.5	3,300	3,550	404,178
US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,641	186,851
US TREASURY N/B	2.875	3,400	3,907	444,833
US TREASURY N/B	3.0	2,700	3,172	361,125
US TREASURY N/B	2.5	2,800	3,019	343,698
US TREASURY N/B	2.5	2,500	2,697	307,085
US TREASURY N/B	2.25	2,150	2,215	252,191
US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,310	263,045
US TREASURY N/B	3.0	2,800	3,309	376,710
US TREASURY N/B	3.0	2,680	3,171	361,060
US TREASURY N/B	2.75	2,000	2,265	257,824
US TREASURY N/B	2.75	2,840	3,219	366,458
US TREASURY N/B	3.0	2,750	3,262	371,389
US TREASURY N/B	3.125	2,400	2,914	331,730
US TREASURY N/B	3.0	4,100	4,874	554,856
US TREASURY N/B	3.375	2,950	3,749	426,785
US TREASURY N/B	3.0	3,300	3,936	448,118
US TREASURY N/B	2.875	3,000	3,503	398,749
US TREASURY N/B	2.25	2,950	3,054	347,662
US TREASURY N/B	2.375	3,100	3,295	375,086
US TREASURY N/B	2.0	3,700	3,631	413,380
US TREASURY N/B	1.25	2,450	2,004	228,134
US TREASURY N/B	1.375	2,570	2,168	246,838
US TREASURY N/B	1.625	3,000	2,693	306,560
US TREASURY N/B	1.875	4,750	4,526	515,263
US TREASURY N/B	2.375	4,100	4,370	497,439
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,962	223,426
小 計				73,520,058
<b>(カナダ)</b> <b>国債証券</b>		千カナダドル	千カナダドル	
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	1,440	1,435	131,974
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	770	766	70,449
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	2,210	2,242	206,149
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	740	735	67,568
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,020	1,033	94,953
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	810	802	73,769
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,470	1,501	138,055
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	790	814	74,882
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	950	934	85,895
CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,120	1,164	107,058
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	795	805	74,080
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	610	613	56,390
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	950	988	90,819
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,165	2,108	193,857
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	995	952	87,560
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	770	778	71,518
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,440	1,417	130,305
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	650	636	58,538
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	707	731	67,260
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	720	939	86,329
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	574	605	55,662

銘柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千カナダドル	千カナダドル 外貨建金額 邦貨換算金額	千円
<b>(カナダ)</b> <b>国債証券</b>				
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	2,198	2,143	197,040
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,005	911	83,763
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	420	414	38,109
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	785	1,112	102,238
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	600	854	78,567
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	820	1,093	100,496
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	990	1,269	116,735
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	945	1,086	99,858
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	2,703	2,677	246,085
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	160	147	13,567
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	335	391	36,013
小 計				3,135,554
<b>(メキシコ)</b> <b>国債証券</b>		千メキシコペソ	千メキシコペソ	
MEX BONOS DESARR FIX RT	6.75	13,100	13,202	74,478
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	16,200	16,615	93,730
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	17,900	18,347	103,503
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	16,700	18,093	102,070
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	24,250	22,908	129,234
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,100	20,156	113,709
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	19,870	20,993	118,432
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	16,900	17,116	96,559
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	6,300	6,349	35,817
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	4,100	4,920	27,755
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	14,150	14,888	83,990
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	12,500	12,222	68,951
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	13,570	13,582	76,624
小 計				1,124,858
<b>(ユーロ…ドイツ)</b> <b>国債証券</b>		千ユーロ	千ユーロ	
BUNDES OblIGATION	—	1,000	1,006	132,937
BUNDES OblIGATION	—	1,750	1,768	233,493
BUNDES OblIGATION	—	1,105	1,120	147,977
BUNDES OblIGATION	—	1,300	1,321	174,521
BUNDES OblIGATION	—	1,360	1,385	182,979
BUNDES OblIGATION	—	1,550	1,580	208,739
BUNDES OblIGATION	—	550	561	74,202
BUNDES OblIGATION	—	1,600	1,636	216,078
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.5	1,900	1,954	258,122
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.5	1,720	1,779	234,976
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	2.0	1,850	1,942	256,449
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	6.25	790	911	120,317
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.75	1,230	1,300	171,729
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.5	1,875	1,980	261,495
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.0	1,830	1,915	252,963
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.5	1,770	1,835	242,345
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	1.0	1,740	1,843	243,448
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.5	2,685	2,803	370,242
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	—	2,320	2,374	313,500
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	0.25	2,125	2,203	291,031
BUNDESREP. DEUTSCHLAND	6.5	1,130	1,584	209,231

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ) 国債証券					
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,165	2,280	301,190	2027/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,150	1,176	155,395	2027/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	1,150	1,587	209,636	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,845	1,948	257,251	2028/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	970	1,308	172,747	2028/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,670	1,737	229,477	2028/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,080	1,103	145,689	2028/11/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,055	2,139	282,522	2029/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,830	1,867	246,657	2029/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	1,280	1,977	261,184	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,410	1,438	189,899	2030/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,700	1,730	228,457	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	420	429	56,741	2030/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,110	1,706	225,393	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	2,420	2,455	324,276	2031/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	406	53,625	2031/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,475	2,393	316,046	2034/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,200	1,196	158,042	2035/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	988	130,589	2036/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,790	2,886	381,189	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,235	2,160	285,281	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,680	3,161	417,506	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	955	1,581	208,798	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	2,325	3,578	472,556	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	2,692	4,238	559,711	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	2,040	2,599	343,309	2048/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,230	1,148	151,677	2050/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	360	340	44,971	2050/8/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	650	655	86,519	2022/12/15
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,315	1,331	175,868	2023/9/15
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.5	2,000	2,121	280,103	2022/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.05	600	603	79,736	2023/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	910	927	122,423	2023/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,200	1,223	161,509	2023/3/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,025	1,101	145,513	2023/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.6	1,000	1,017	134,300	2023/6/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,700	1,854	244,933	2023/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.3	1,640	1,659	219,154	2023/8/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,310	1,381	182,406	2023/10/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,160	1,182	156,149	2023/10/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	9.0	860	1,021	134,846	2023/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,110	1,116	147,379	2024/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,650	1,833	242,116	2024/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,360	1,366	180,413	2024/4/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,075	1,130	149,343	2024/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.75	1,360	1,429	188,781	2024/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	200	200	26,494	2024/8/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,450	1,611	212,783	2024/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,260	1,319	174,285	2024/11/15

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,080	1,167	154,124	2024/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,485	1,505	198,789	2025/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,540	1,800	237,810	2025/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,175	1,236	163,325	2025/5/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,300	1,370	181,032	2025/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	1,067	140,990	2025/7/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,300	1,428	188,687	2025/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,480	1,597	210,922	2025/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	1,150	1,168	154,279	2026/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,730	2,059	271,974	2026/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	—	1,220	1,211	160,015	2026/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.6	1,230	1,310	173,072	2026/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.1	1,220	1,329	175,624	2026/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	7.25	720	973	128,503	2026/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,565	1,644	217,170	2026/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.85	1,180	1,214	160,368	2027/1/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.2	1,160	1,280	169,101	2027/6/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.05	1,395	1,529	201,918	2027/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,145	1,182	156,131	2027/9/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.5	2,060	2,805	370,401	2027/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,785	1,957	258,473	2028/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.25	1,230	1,212	160,101	2028/3/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.5	500	498	65,872	2028/7/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,330	1,706	225,353	2028/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,255	1,450	191,589	2028/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.0	1,380	1,626	214,786	2029/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.25	2,050	2,790	368,448	2029/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.5	1,740	2,132	281,658	2030/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,200	1,259	166,319	2030/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,167	1,181	156,071	2030/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,452	1,554	205,323	2030/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.9	1,375	1,377	181,922	2031/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.0	2,230	3,284	433,699	2031/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.6	1,245	1,208	159,599	2031/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.95	780	778	102,821	2031/12/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,610	1,717	226,733	2032/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,630	2,448	323,269	2033/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,140	1,308	172,785	2033/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,580	2,296	303,271	2034/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.35	1,050	1,323	174,735	2035/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.45	900	920	121,597	2036/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.25	1,100	1,241	163,965	2036/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	2,205	3,010	397,536	2037/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.95	1,200	1,477	195,086	2038/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,600	2,489	328,705	2039/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.1	610	766	101,249	2040/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,720	2,709	357,731	2040/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.8	830	864	114,164	2041/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,345	2,143	283,006	2044/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	1.5	260	252	33,374	2045/4/30
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.25	1,120	1,469	194,102	2046/9/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
<b>(ユーロ…イタリア) 国債証券</b>					
BONDI POLIENNALI DEL TES	2.7	1,270	1,525	201,411	2047/3/1
BONDI POLIENNALI DEL TES	3.45	1,135	1,545	204,041	2048/3/1
BONDI POLIENNALI DEL TES	3.85	850	1,240	163,774	2049/9/1
BONDI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,180	1,353	178,732	2050/9/1
BONDI POLIENNALI DEL TES	1.7	750	731	96,536	2051/9/1
BONDI POLIENNALI DEL TES	2.8	680	799	105,600	2067/3/1
BONDI POLIENNALI DEL TES	2.15	300	296	39,089	2072/3/1
<b>(ユーロ…フランス) 国債証券</b>					
FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,540	2,614	345,289	2022/10/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,830	2,857	377,309	2023/3/25
FRANCE (GOVT OF)	8.5	960	1,092	144,274	2023/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	3,160	3,281	433,313	2023/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.25	3,630	3,989	526,758	2023/10/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,140	1,156	152,657	2024/2/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,390	2,425	320,244	2024/3/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,824	3,033	400,595	2024/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,758	2,954	390,177	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,475	2,516	332,308	2025/3/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,610	2,702	356,924	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	2,550	3,215	424,644	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,770	2,932	387,225	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,829	241,616	2026/2/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	3,070	3,609	476,598	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,275	2,365	312,358	2026/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.25	3,010	3,096	408,842	2026/11/25
FRANCE (GOVT OF)	—	360	364	48,185	2027/2/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,615	2,799	369,724	2027/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	3,350	3,956	522,439	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,250	3,443	454,724	2028/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	3,030	3,212	424,214	2028/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	2,745	3,897	514,657	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,780	2,893	382,059	2029/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	2,780	2,775	366,454	2029/11/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	3,175	3,845	507,835	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	3,169	3,136	414,115	2030/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	3,560	4,017	530,504	2031/5/25
FRANCE (GOVT OF)	—	1,865	1,824	240,911	2031/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	2,540	4,074	538,071	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,745	3,043	401,914	2034/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	1,735	2,744	362,419	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,825	3,139	414,525	2036/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,810	2,846	375,875	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,340	2,828	373,498	2039/6/25
FRANCE (GOVT OF)	4.5	3,035	5,220	689,356	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	960	919	121,464	2044/6/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	1,630	2,534	334,736	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,830	2,362	311,945	2048/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	2,090	2,437	321,892	2050/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,370	2,277	300,755	2052/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,300	2,465	325,605	2055/4/25

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
<b>(ユーロ…フランス) 国債証券</b>					
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,140	2,263	298,897	2060/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	825	1,047	138,323	2066/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	515	404	53,445	2072/5/25
<b>(ユーロ…オランダ) 国債証券</b>					
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	355	374	49,453	2023/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	525	578	76,325	2023/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,070	1,115	147,340	2023/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	980	994	131,314	2024/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,085	1,163	153,605	2024/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,305	1,342	177,304	2025/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,240	1,295	171,024	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	968	986	130,217	2027/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,125	1,195	157,911	2027/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	825	1,125	148,616	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	961	1,026	135,504	2028/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	765	788	104,131	2029/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	875	879	116,194	2030/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	580	579	76,487	2031/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	1,025	1,305	172,404	2033/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	1,150	1,814	239,559	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	96	12,692	2038/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,073	1,127	148,851	2040/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	1,240	2,107	278,339	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,248	2,008	265,286	2047/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	575	518	68,509	2052/1/15
<b>(ユーロ…スペイン) 国債証券</b>					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	1,420	1,435	189,525	2022/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	1,425	1,533	202,438	2023/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,313	1,325	174,978	2023/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	1,290	1,311	173,164	2023/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,540	1,695	223,829	2023/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	1,185	1,328	175,453	2024/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,340	1,484	196,071	2024/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	1,010	133,467	2024/5/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	1,180	1,202	158,738	2024/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,520	1,667	220,143	2024/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,430	1,447	191,157	2025/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	1,450	1,550	204,770	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,490	1,771	233,911	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	1,745	1,917	253,151	2025/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,270	1,281	169,251	2026/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,335	1,465	193,490	2026/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	1,490	1,924	254,079	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,720	1,846	243,846	2026/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,475	1,604	211,874	2027/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	1,315	1,377	181,901	2027/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,600	1,740	229,865	2027/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	910	906	119,729	2028/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,470	1,596	210,866	2028/4/30

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…スペイン)</b> <b>国債証券</b>					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,475	1,606	212,103	2028/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,155	1,562	206,276	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	1,745	2,488	328,670	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,345	1,472	194,400	2029/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	1,470	1,511	199,586	2029/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	1,420	1,443	190,560	2030/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,430	1,630	215,327	2030/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	1,660	1,789	236,355	2030/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1	1,455	1,408	186,041	2031/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	730	729	96,293	2031/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	1,500	2,324	306,962	2032/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,370	1,638	216,299	2033/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,415	1,612	212,892	2035/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	1,400	2,085	275,329	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.85	670	661	87,344	2037/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,260	2,120	280,072	2040/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	1,000	1,024	135,340	2040/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,400	2,328	307,530	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	300	295	39,011	2042/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	990	1,808	238,793	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,170	1,604	211,928	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	985	1,314	173,558	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	1,170	1,080	142,615	2050/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	848	1,322	174,614	2066/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	555	502	66,301	2071/10/31
<b>(ユーロ…ベルギー)</b> <b>国債証券</b>					
BELGIUM KINGDOM	2.25	855	897	118,450	2023/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.2	615	625	82,650	2023/10/22
BELGIUM KINGDOM	2.6	975	1,059	139,882	2024/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.5	840	867	114,568	2024/10/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	1,395	1,462	193,075	2025/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.5	670	818	108,144	2026/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.0	1,132	1,205	159,179	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	930	987	130,432	2027/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	495	502	66,320	2027/10/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	1,320	1,814	239,539	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.8	965	1,028	135,806	2028/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.9	1,120	1,203	158,907	2029/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.1	800	804	106,193	2030/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,085	143,398	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	—	390	382	50,536	2031/10/22
BELGIUM KINGDOM	4.0	660	923	121,890	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.25	910	1,016	134,171	2033/4/22
BELGIUM KINGDOM	3.0	543	724	95,646	2034/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.0	1,305	2,105	278,070	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.45	425	486	64,193	2037/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.9	535	651	86,053	2038/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.4	330	315	41,723	2040/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,187	1,975	260,875	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	665	1,100	145,325	2045/6/22

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…ベルギー)</b> <b>国債証券</b>					
BELGIUM KINGDOM	1.6	770	908	119,966	2047/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.7	640	774	102,268	2050/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.25	412	574	75,890	2057/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	486	684	90,435	2066/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.65	270	226	29,944	2071/6/22
<b>(ユーロ…オーストリア)</b> <b>国債証券</b>					
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	720	751	99,233	2022/11/22
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	430	434	57,368	2023/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	570	576	76,179	2023/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	950	996	131,604	2023/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	555	564	74,524	2024/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	855	913	120,580	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	200	203	26,881	2025/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	710	758	100,201	2025/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	600	742	97,999	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	1,003	1,059	139,924	2026/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	685	715	94,527	2027/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	680	938	123,987	2027/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	660	700	92,485	2028/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	640	667	88,165	2029/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	740	738	97,578	2030/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	665	658	86,936	2031/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	610	773	102,085	2034/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	215	209	27,686	2036/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	1,030	1,623	214,427	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	260	236	31,191	2040/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	464	734	96,966	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	503	615	81,323	2047/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	335	345	45,677	2051/3/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	312	646	85,365	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	173	223	29,529	2086/11/2
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	403	652	86,165	2117/9/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.85	192	172	22,833	2120/6/30
<b>(ユーロ…フィンランド)</b> <b>国債証券</b>					
FINNISH GOVERNMENT	1.5	330	340	45,006	2023/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	370	374	49,465	2023/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.0	390	415	54,904	2024/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	285	289	38,265	2024/9/15
FINNISH GOVERNMENT	4.0	425	497	65,635	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.875	320	337	44,507	2025/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	535	557	73,592	2026/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	100	101	13,441	2026/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	400	418	55,287	2027/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.75	380	456	60,277	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	270	282	37,311	2028/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	460	480	63,498	2029/9/15
FINNISH GOVERNMENT	—	112	111	14,757	2030/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.75	525	559	73,936	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	1.125	365	405	53,511	2034/4/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外債建金額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千ユーロ	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b> <b>国債証券</b>					
FINNISH GOVERNMENT	0.125	400	387	51,205	2036/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.25	220	212	28,109	2040/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.625	325	468	61,902	2042/7/4
FINNISH GOVERNMENT	1.375	260	317	41,951	2047/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.125	250	220	29,141	2052/4/15
<b>(ユーロ…アイルランド)</b> <b>国債証券</b>					
IRISH TREASURY	—	135	135	17,936	2022/10/18
IRISH TREASURY	3.9	570	606	80,059	2023/3/20
IRISH TREASURY	3.4	550	603	79,646	2024/3/18
IRISH TREASURY	5.4	760	911	120,388	2025/3/13
IRISH TREASURY	1.0	775	822	108,639	2026/5/15
IRISH TREASURY	0.2	490	501	66,192	2027/5/15
IRISH TREASURY	0.9	520	554	73,235	2028/5/15
IRISH TREASURY	1.1	700	758	100,173	2029/5/15
IRISH TREASURY	2.4	651	780	103,027	2030/5/15
IRISH TREASURY	0.2	177	177	23,489	2030/10/18
IRISH TREASURY	1.35	720	801	105,804	2031/3/18
IRISH TREASURY	—	555	540	71,415	2031/10/18
IRISH TREASURY	1.3	355	393	52,020	2033/5/15
IRISH TREASURY	0.4	310	308	40,711	2035/5/15
IRISH TREASURY	1.7	390	459	60,658	2037/5/15
IRISH TREASURY	0.55	250	244	32,287	2041/4/22
IRISH TREASURY	2.0	589	752	99,355	2045/2/18
IRISH TREASURY	1.5	444	516	68,143	2050/5/15
ユーロ計				63,113,020	
<b>(イギリス)</b> <b>国債証券</b>					
UK TREASURY	0.125	1,710	1,701	266,467	2023/1/31
UK TREASURY	2.25	1,310	1,350	211,477	2023/9/7
UK TREASURY	0.125	1,530	1,512	236,878	2024/1/31
UK TREASURY	1.0	1,130	1,141	178,707	2024/4/22
UK TREASURY	2.75	875	927	145,265	2024/9/7
UK TREASURY	5.0	1,205	1,378	215,923	2025/3/7
UK TREASURY	0.625	813	811	127,171	2025/6/7
UK TREASURY	0.125	1,110	1,081	169,342	2026/1/30
UK TREASURY	1.5	820	849	133,000	2026/7/22
UK TREASURY	1.25	1,590	1,628	255,124	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	910	1,094	171,414	2027/12/7
UK TREASURY	0.125	845	806	126,292	2028/1/31
UK TREASURY	1.625	890	934	146,294	2028/10/22
UK TREASURY	6.0	710	958	150,136	2028/12/7
UK TREASURY	0.875	856	848	132,963	2029/10/22
UK TREASURY	0.375	1,220	1,147	179,655	2030/10/22
UK TREASURY	4.75	1,075	1,419	222,344	2030/12/7
UK TREASURY	0.25	1,260	1,156	181,141	2031/7/31
UK TREASURY	4.25	1,370	1,791	280,531	2032/6/7
UK TREASURY	0.875	120	115	18,161	2033/7/31
UK TREASURY	4.5	949	1,315	206,036	2034/9/7
UK TREASURY	0.625	1,057	964	151,017	2035/7/31
UK TREASURY	4.25	1,370	1,903	298,156	2036/3/7

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外債建金額	
	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千イギリスポンド	
<b>(イギリス)</b> <b>国債証券</b>					
UK TREASURY	1.75	1,435	1,517	237,697	2037/9/7
UK TREASURY	4.75	1,010	1,540	241,329	2038/12/7
UK TREASURY	4.25	970	1,417	222,061	2039/9/7
UK TREASURY	4.25	935	1,388	217,443	2040/12/7
UK TREASURY	1.25	525	511	80,113	2041/10/22
UK TREASURY	4.5	1,410	2,218	347,433	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	1,615	2,190	343,105	2044/1/22
UK TREASURY	3.5	1,450	2,060	322,657	2045/1/22
UK TREASURY	0.875	435	387	60,741	2046/1/31
UK TREASURY	4.25	1,275	2,046	320,592	2046/12/7
UK TREASURY	1.5	1,460	1,496	234,357	2047/7/22
UK TREASURY	1.75	675	732	114,674	2049/1/22
UK TREASURY	4.25	895	1,497	234,568	2049/12/7
UK TREASURY	0.625	540	444	69,644	2050/10/22
UK TREASURY	3.75	1,107	1,772	277,658	2052/7/22
UK TREASURY	1.625	635	682	106,817	2054/10/22
UK TREASURY	4.25	1,062	1,918	300,552	2055/12/7
UK TREASURY	1.75	1,075	1,216	190,605	2057/7/22
UK TREASURY	4.0	926	1,701	266,425	2060/1/22
UK TREASURY	0.5	730	563	88,239	2061/10/22
UK TREASURY	3.5	980	1,789	280,348	2068/7/22
UK TREASURY	1.625	650	773	121,193	2071/10/22
UNITED KINGDOM GILT	0.75	1,625	1,630	255,337	2023/7/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	885	929	145,561	2025/9/7
UNITED KINGDOM GILT	2.5	1,177	1,691	264,909	2065/7/22
小 計				9,547,576	
<b>(スウェーデン)</b> <b>国債証券</b>					
SWEDISH GOVERNMENT	1.5	6,960	7,207	95,349	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	5,220	5,696	75,362	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	5,200	5,440	71,977	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,950	4,086	54,068	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,400	4,552	60,234	2029/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.125	2,600	2,531	33,493	2031/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	2.25	1,800	2,138	28,288	2032/6/1
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,385	4,950	65,501	2039/3/30
小 計				484,275	
<b>(ノルウェー)</b> <b>国債証券</b>					
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	5,520	5,604	76,384	2023/5/24
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	4,340	4,513	61,524	2024/3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	3,390	3,424	46,674	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	2,750	2,746	37,431	2026/2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,640	2,663	36,298	2027/2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	2,740	2,802	38,204	2028/4/26
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,770	2,784	37,945	2029/9/6
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	3,550	3,459	47,155	2030/8/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.25	2,040	1,959	26,705	2031/9/17
小 計				408,324	

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
	%	千円	千円	千円	
<b>(デンマーク)</b> <b>国債証券</b>					
KINGDOM OF DENMARK	0.25	4,400	4,440	78,812	2022/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.5	4,240	4,424	78,532	2023/11/15
KINGDOM OF DENMARK	—	1,260	1,278	22,695	2024/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.75	5,310	5,773	102,480	2025/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	4,510	4,696	83,360	2027/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,830	2,952	52,402	2029/11/15
KINGDOM OF DENMARK	—	1,150	1,135	20,148	2031/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	11,180	19,567	347,324	2039/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,300	1,223	21,711	2052/11/15
小 計				807,468	
<b>(ポーランド)</b> <b>国債証券</b>					
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,100	2,124	60,812	2023/1/25
POLAND GOVERNMENT BOND	—	1,430	1,393	39,875	2023/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,750	1,825	52,253	2023/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,110	2,142	61,326	2024/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	2,430	2,450	70,141	2024/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	0.75	1,440	1,377	39,438	2025/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,690	2,795	80,026	2025/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	3,090	3,126	89,510	2026/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	0.25	1,750	1,578	45,192	2026/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,340	2,350	67,295	2027/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,260	2,294	65,689	2028/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	555	677	19,383	2029/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	3,145	3,165	90,612	2029/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.25	2,125	1,875	53,693	2030/10/25
小 計				835,250	
<b>(オーストラリア)</b> <b>国債証券</b>					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,360	1,391	118,683	2022/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	1,650	1,781	151,978	2023/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	855	910	77,681	2024/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,685	1,660	141,631	2024/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,220	1,318	112,509	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,230	1,191	101,697	2025/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	1,280	1,456	124,279	2026/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.5	1,340	1,296	110,616	2026/9/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	1,270	1,505	128,445	2027/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,160	1,254	107,041	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,050	1,104	94,270	2028/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	840	912	77,849	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,130	1,268	108,252	2029/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,200	1,305	111,427	2029/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,850	1,976	168,639	2030/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,900	1,785	152,329	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	1,678	1,641	140,064	2031/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	1,920	1,781	152,004	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	1,580	1,494	127,484	2032/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	790	782	66,744	2032/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,035	1,320	112,684	2033/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	530	576	49,173	2035/6/21

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 債 建 金 額	
	%	千円	千円	千円	
<b>(オーストラリア)</b> <b>国債証券</b>					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	750	905	77,228	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	662	749	63,968	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	890	933	79,621	2041/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	870	942	80,431	2047/3/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	1,020	848	72,395	2051/6/21
小 計				2,909,134	
<b>(シンガポール)</b> <b>国債証券</b>					
SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	630	639	54,029	2023/2/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	545	564	47,674	2023/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	190	195	16,512	2024/2/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	540	572	48,355	2024/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	410	430	36,364	2025/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	0.5	349	341	28,833	2025/11/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	470	488	41,294	2026/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	475	526	44,453	2027/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	290	308	26,105	2028/5/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	500	543	45,952	2029/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	540	589	49,788	2030/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	210	208	17,581	2031/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	405	464	39,285	2033/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	501	513	43,358	2036/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	220	228	19,317	2039/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	372	409	34,639	2042/4/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	457	505	42,714	2046/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	432	406	34,372	2050/3/1
小 計				670,633	
<b>(マレーシア)</b> <b>国債証券</b>					
MALAYSIA GOVERNMENT	3.795	760	773	21,217	2022/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.757	630	645	17,692	2023/4/20
MALAYSIA GOVERNMENT	3.8	700	720	19,753	2023/8/17
MALAYSIA GOVERNMENT	3.478	775	791	21,706	2024/6/14
MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	830	862	23,651	2024/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	320	330	9,074	2025/3/14
MALAYSIA GOVERNMENT	3.955	1,650	1,711	46,927	2025/9/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.906	780	804	22,061	2026/7/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.9	750	775	21,279	2026/11/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	1,100	1,132	31,058	2027/11/16
MALAYSIA GOVERNMENT	3.885	1,320	1,343	36,835	2029/8/15
MALAYSIA GOVERNMENT	2.632	780	719	19,723	2031/4/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	700	739	20,290	2033/11/7
MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	1,100	1,064	29,203	2034/7/5
MALAYSIA GOVERNMENT	4.254	850	865	23,743	2035/5/31
MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	890	943	25,873	2037/4/7
MALAYSIA GOVERNMENT	4.893	590	637	17,481	2038/6/8
MALAYSIA GOVERNMENT	3.757	1,270	1,191	32,688	2040/5/22
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	570	610	16,753	2043/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	4.736	720	741	20,338	2046/3/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.921	790	840	23,038	2048/7/6
MALAYSIA GOVERNMENT	4.065	1,010	956	26,219	2050/6/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 貨 建 立 金 額	
(マレーシア) 国債証券	%	千円	千円	千円	
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	1,130	1,151	31,569	2023/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	940	977	26,803	2024/7/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	1,070	1,125	30,865	2026/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	450	464	12,742	2027/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	950	958	26,276	2027/5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,220	1,239	33,994	2028/6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	910	966	26,507	2030/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	1,035	1,073	29,439	2031/6/30
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	980	967	26,543	2033/4/15
小 計				771,357	
(イスラエル) 国債証券		千円	千円		
ISRAEL FIXED BOND	1.25	1,000	1,012	36,025	2022/11/30
ISRAEL FIXED BOND	4.25	1,320	1,398	49,740	2023/3/31
ISRAEL FIXED BOND	0.15	1,160	1,160	41,269	2023/7/31
ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,250	1,285	45,711	2023/11/30
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,420	1,539	54,756	2024/3/31

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	外 貨 建 立 金 額	
(イスラエル) 国債証券	%	千円	千円	千円	
ISRAEL FIXED BOND	0.5	1,360	1,359	48,334	2025/4/30
ISRAEL FIXED BOND	1.75	1,240	1,304	46,394	2025/8/31
ISRAEL FIXED BOND	0.5	530	525	18,673	2026/2/27
ISRAEL FIXED BOND	6.25	1,100	1,397	49,700	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND	2.0	1,270	1,347	47,918	2027/3/31
ISRAEL FIXED BOND	2.25	1,250	1,349	47,992	2028/9/28
ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,615	1,581	56,250	2030/3/31
ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,160	1,086	38,626	2037/5/31
ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,330	2,077	73,881	2042/1/31
ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,620	2,029	72,168	2047/3/31
小 計				727,444	
合 計				158,054,958	

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

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 158,054,958	% 99.2
コール・ローン等、その他	1,290,872	0.8
投資信託財産総額	159,345,830	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（159,324,283千円）の投資信託財産総額（159,345,830千円）に対する比率は100.0%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.83円、1カナダドル=91.92円、1メキシコペソ=5.6413円、1ユーロ=132.05円、1イギリスポンド=156.62円、1スウェーデンクローナ=13.23円、1ノルウェークローネ=13.63円、1デンマーククローネ=17.75円、1ポーランドズロチ=28.6252円、1オーストラリアドル=85.32円、1シンガポールドル=84.51円、1マレーシアリングギット=27.4259円、1イスラエルシェケル=35.5652円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	159,507,792,227	
コール・ローン等	184,581,806	
公社債（評価額）	158,054,958,026	
未収入金	256,437,791	
未収利息	986,017,043	
前払費用	25,797,561	
(B) 負債	291,486,462	
未払金	162,038,798	
未払解約金	129,447,656	
未払利息	8	
(C) 純資産総額（A－B）	159,216,305,765	
元本	61,672,878,643	
次期繰越損益金	97,543,427,122	
(D) 受益権総口数	61,672,878,643口	
1万口当たり基準価額（C/D）	25,816円	

(注) 当ファンドの期首元本額は62,305,294,771円、期中追加設定元本額は5,092,447,058円、期中一部解約元本額は5,724,863,186円です。

(注) 2021年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	20,225,218,218円
・インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	14,821,148,270円
・日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	14,500,797,808円
・インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	3,711,173,590円
・世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,289,399,731円
・世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	1,750,402,022円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	900,317,948円
・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	741,844,896円
・DCインデックスバランス（株式60）	619,099,493円
・DCインデックスバランス（株式80）	500,890,063円
・DCインデックスバランス（株式40）	470,603,500円
・DCインデックスバランス（株式20）	353,037,161円
・海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	279,864,972円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	157,019,480円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	90,547,305円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	88,314,261円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	64,570,825円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	61,212,474円
・財産3分法（適格機関投資家専用）	24,920,544円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	10,297,506円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	6,106,515円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,295,953円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,796,108円

(注) 1口当たり純資産額は2,5816円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

## ○損益の状況（2020年10月27日～2021年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	3,108,706,037	
受取利息	3,109,066,020	
支払利息	△ 359,983	
(B) 有価証券売買損益	4,857,468,573	
売買益	13,069,811,537	
売買損	△ 8,212,342,964	
(C) 保管費用等	△ 20,467,501	
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	7,945,707,109	
(E) 前期繰越損益金	90,529,586,110	
(F) 追加信託差損益金	7,779,269,663	
(G) 解約差損益金	△ 8,711,135,760	
(H) 計（D＋E＋F＋G）	97,543,427,122	
次期繰越損益金（H）	97,543,427,122	

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

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

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2020年10月27日から2021年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

# 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

## 運用報告書

第23期（決算日 2021年10月26日）  
（2020年10月27日～2021年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	内外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。

## ファンド概要

主として世界各国の債券に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジあり・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率	純資産額
	期騰	期中率	期騰	期中率		
	円	%		%	%	百万円
19期(2017年10月26日)	14,881	△2.7	153.81	△2.7	98.9	25,323
20期(2018年10月26日)	14,628	△1.7	151.39	△1.6	97.6	24,608
21期(2019年10月28日)	15,812	8.1	164.01	8.3	99.4	24,109
22期(2020年10月26日)	16,535	4.6	171.77	4.7	96.4	25,342
23期(2021年10月26日)	16,005	△3.2	166.28	△3.2	99.4	25,224

(注) FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く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指数です。なお、設定時を100として2021年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジあり・円ベース) (ベンチマーク)		債組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2020年10月26日	円	%		%	%
	16,535	—	171.77	—	96.4
10月末	16,593	0.4	172.40	0.4	95.6
11月末	16,610	0.5	172.55	0.5	96.3
12月末	16,598	0.4	172.44	0.4	96.7
2021年1月末	16,496	△0.2	171.43	△0.2	97.2
2月末	16,015	△3.1	166.28	△3.2	99.7
3月末	15,986	△3.3	166.02	△3.3	99.9
4月末	15,966	△3.4	165.90	△3.4	99.2
5月末	15,995	△3.3	166.17	△3.3	99.8
6月末	16,063	△2.9	166.87	△2.8	98.6
7月末	16,340	△1.2	169.78	△1.2	97.3
8月末	16,346	△1.1	169.83	△1.1	97.3
9月末	16,092	△2.7	167.15	△2.7	97.9
(期末) 2021年10月26日	円	%		%	%
	16,005	△3.2	166.28	△3.2	99.4

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 基準価額の推移

期間の初め16,535円の基準価額は、期間末に16,005円となり、騰落率は△3.2%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

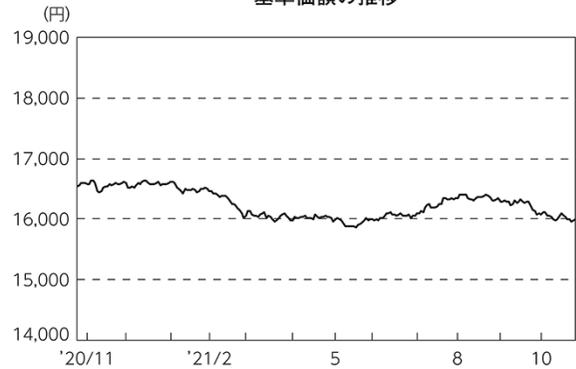
## &lt;値上がり要因&gt;

- ・新型コロナウイルスや同変異株の感染拡大により景気の先行きが懸念されたこと。
- ・政策金利を据え置いた欧州中央銀行（ECB）がパンデミック緊急購入プログラム（PEPP）における資産購入ペースを維持したこと。
- ・中国当局によるインターネット企業や教育産業などへの規制強化、中国景気の減速懸念などを受けて、投資家がリスク回避姿勢を強めたこと。

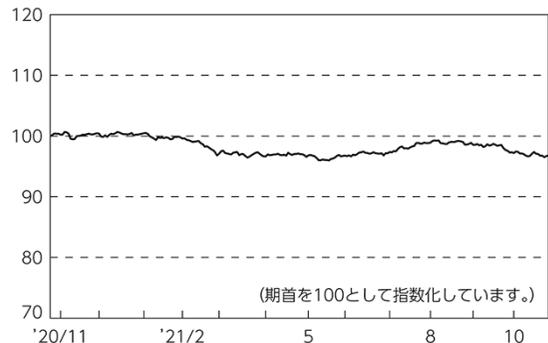
## &lt;値下がり要因&gt;

- ・新型コロナウイルスのワクチンや治療薬の開発進展およびワクチン接種の普及から感染収束期待が高まったこと。
- ・米国連邦公開市場委員会（FOMC）を受けて米国連邦準備制度理事会（FRB）による金融緩和と政策の転換観測が広がったこと。
- ・原油価格や天然ガス価格の上昇などを背景にインフレが懸念されたこと。

基準価額の推移



期首	期中高値	期中安値	期末
2020/10/26	2020/12/14	2021/05/20	2021/10/26
16,535円	16,642円	15,873円	16,005円

FTSE世界国債インデックス  
(除く日本、ヘッジあり・円ベース) (指数化) の推移

### （海外債券市況）

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など、各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて総じて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2021年5月前半にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済の先行きが懸念されたことや、米国による中国大手半導体企業への制裁など米中対立が激化したことなどが利回りの低下（債券価格は上昇）要因となったものの、英国と欧州連合（EU）が自由貿易協定（FTA）の締結交渉で合意したことや、米国新政権下で大型財政政策の実施の可能性が高まったこと、新型コロナウイルスのワクチンや治療薬の開発進展およびワクチン接種の普及から感染収束期待が高まり、投資家のリスク選好姿勢が強まったことなどから、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。5月後半から7月下旬にかけては、新型コロナウイルス変異株の感染拡大により景気の先行きが懸念されたことや、政策金利を据え置いたECBがPEPPにおける資産購入ペースを維持したこと、ECBが利上げ時期に関するガイダンスを変更し金融緩和政策の継続を示したこと、中国当局によるインターネット企業や教育産業などへの規制強化、中国景気の減速懸念などを背景とした投資家のリスク回避姿勢などから、投資対象国の10年国債利回りは総じて低下しました。8月上旬から期間末にかけては、失業率や非農業部門雇用者数など米国の雇用関連の指標が概ね良好な結果となったことや、複数のECB幹部が経済の先行きについて楽観的見通しを示したこと、FOMCを受けてFRBによる金融緩和政策の転換観測が広がったこと、原油価格や天然ガス価格の上昇などを背景にインフレが懸念されたことなどから、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

## ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマーク採用国の債券の中からポートフォリオを構築し、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、債券の組入比率を高位に維持し、ベンチマークとの連動性を保つように努めました。外貨建資産は、原則として100%程度の為替ヘッジを行ないました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、3.2%の値下がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）」の下落率3.2%と概ね同水準となりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

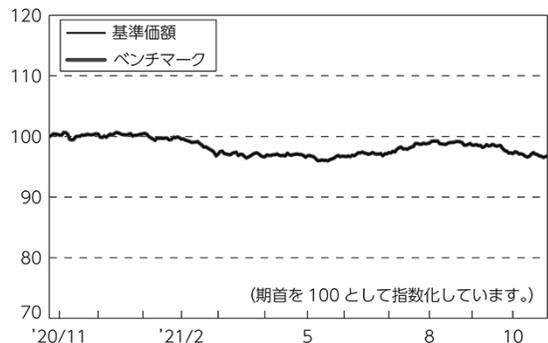
### <プラス要因>

- ・ 国別配分効果。
- ・ 銘柄選択効果。
- ・ 債券取引に関する要因。

### <マイナス要因>

- ・ 為替取引に関する諸費用。
- ・ 外国口座の管理費用。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



## ○今後の運用方針

引き続き、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券組入比率を高位に維持する方針です。外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行いません。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2020年10月27日～2021年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 )	円 2 (2)	% 0.014 (0.014)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
合 計	2	0.014	
期中の平均基準価額は、16,258円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2020年10月27日～2021年10月26日)

## 公社債

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 36,204	千アメリカドル 30,551
	カナダ	国債証券	千カナダドル 2,760	千カナダドル 3,341
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 5,624	千メキシコペソ 5,051
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	2,534	2,128
	イタリア	国債証券	1,300	2,807
	フランス	国債証券	3,070	2,993
	オランダ	国債証券	1,712	1,106
	スペイン	国債証券	973	1,264
	ベルギー	国債証券	402	1,195
	オーストリア	国債証券	515	519
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 718	千イギリスポンド 1,847
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 2,101	千スウェーデンクローナ 2,017
	国	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ -
ポーランド		国債証券	千ポーランドズロチ 2,174	千ポーランドズロチ 1,054
オーストラリア		国債証券	千オーストラリアドル 508	千オーストラリアドル 3,163
シンガポール		国債証券	千シンガポールドル 217	千シンガポールドル 205
マレーシア		国債証券	千マレーシアリンギット 2,157	千マレーシアリンギット 1,022
イスラエル		国債証券	千イスラエルシェケル 1,301	千イスラエルシェケル 1,049

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

○利害関係人との取引状況等

(2020年10月27日～2021年10月26日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2020年10月27日～2021年10月26日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2021年10月26日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 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	千アメリカドル 99,110	千アメリカドル 102,698	千円 11,690,178	% 46.3	% —	% 21.3	% 15.4	% 9.6
カナダ	千カナダドル 4,790	千カナダドル 5,276	484,978	1.9	—	0.9	0.6	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 33,000	千メキシコペソ 34,150	192,652	0.8	—	0.5	0.3	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	9,780	12,549	1,657,175	6.6	—	4.4	1.7	0.5
イタリア	13,440	16,889	2,230,224	8.8	—	6.1	1.9	0.8
フランス	15,670	19,400	2,561,784	10.2	—	6.7	2.2	1.2
オランダ	3,040	3,953	522,053	2.1	—	1.6	0.2	0.2
スペイン	9,110	11,299	1,492,052	5.9	—	3.9	2.1	—
ベルギー	3,680	4,661	615,598	2.4	—	2.1	0.2	0.1
オーストリア	2,430	3,228	426,300	1.7	—	1.4	0.2	0.1
フィンランド	850	1,008	133,150	0.5	—	0.4	0.1	0.1
アイルランド	1,500	1,741	229,988	0.9	—	0.4	0.4	0.1
イギリス	千イギリスポンド 7,260	千イギリスポンド 9,630	1,508,374	6.0	—	5.1	0.7	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 8,300	千スウェーデンクローナ 9,279	122,768	0.5	—	0.2	0.2	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 5,150	千ノルウェークローネ 5,228	71,258	0.3	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 2,800	千デンマーククローネ 4,569	81,102	0.3	—	0.3	0.0	—
ポーランド	千ポーランドズロチ 5,200	千ポーランドズロチ 5,315	152,148	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 4,880	千オーストラリアドル 5,357	457,102	1.8	—	1.3	0.4	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 1,140	千シンガポールドル 1,254	106,056	0.4	—	0.4	—	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 8,750	千マレーシアリンギット 9,017	247,301	1.0	—	0.4	0.5	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 2,320	千イスラエルシェケル 2,875	102,250	0.4	—	0.2	—	0.2
合 計	—	—	25,084,499	99.4	—	57.8	27.6	14.1

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
<b>(アメリカ)</b> <b>国債証券</b>					
US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,016	115,693	2022/9/30
US TREASURY N/B	1.875	700	712	81,091	2022/10/31
US TREASURY N/B	2.0	1,100	1,122	127,746	2022/11/30
US TREASURY N/B	2.125	1,400	1,431	162,981	2022/12/31
US TREASURY N/B	1.5	1,000	1,015	115,637	2023/1/15
US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,630	185,624	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.375	1,500	1,540	175,387	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.0	700	716	81,514	2023/2/15
US TREASURY N/B	1.5	2,400	2,441	277,930	2023/3/31
US TREASURY N/B	1.75	3,550	3,628	413,015	2023/5/15
US TREASURY N/B	1.375	600	610	69,454	2023/6/30
US TREASURY N/B	2.625	800	830	94,491	2023/6/30
US TREASURY N/B	6.25	580	641	72,992	2023/8/15
US TREASURY N/B	2.5	2,000	2,075	236,241	2023/8/15
US TREASURY N/B	2.75	300	312	35,604	2023/8/31
US TREASURY N/B	0.125	500	497	56,603	2023/8/31
US TREASURY N/B	2.875	1,000	1,046	119,132	2023/9/30
US TREASURY N/B	2.75	1,440	1,506	171,528	2023/11/15
US TREASURY N/B	2.875	1,000	1,049	119,474	2023/11/30
US TREASURY N/B	2.75	1,080	1,134	129,143	2024/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,300	1,347	153,395	2024/3/31
US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,256	143,078	2024/5/15
US TREASURY N/B	2.0	2,400	2,485	282,887	2024/6/30
US TREASURY N/B	2.375	3,830	4,009	456,353	2024/8/15
US TREASURY N/B	1.5	1,000	1,022	116,362	2024/9/30
US TREASURY N/B	2.25	3,800	3,971	452,027	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.0	1,650	1,713	195,016	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,564	178,098	2025/5/15
US TREASURY N/B	2.75	700	746	84,958	2025/6/30
US TREASURY N/B	2.0	2,300	2,390	272,112	2025/8/15
US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,098	238,878	2025/11/15
US TREASURY N/B	0.375	1,500	1,460	166,252	2025/11/30
US TREASURY N/B	2.625	900	958	109,100	2025/12/31
US TREASURY N/B	1.625	1,600	1,637	186,371	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	2,400	2,453	279,306	2026/5/15
US TREASURY N/B	1.5	900	914	104,081	2026/8/15
US TREASURY N/B	1.375	500	505	57,496	2026/8/31
US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,158	473,408	2026/11/15
US TREASURY N/B	2.25	1,100	1,157	131,769	2027/2/15
US TREASURY N/B	0.5	3,000	2,853	324,855	2027/10/31
US TREASURY N/B	6.125	530	678	77,264	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	2,900	3,052	347,437	2027/11/15
US TREASURY N/B	1.25	1,000	989	112,676	2028/4/30
US TREASURY N/B	1.25	1,000	988	112,467	2028/6/30
US TREASURY N/B	1.0	400	388	44,208	2028/7/31
US TREASURY N/B	2.875	1,500	1,640	186,752	2028/8/15
US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,369	155,900	2028/8/31
US TREASURY N/B	5.25	210	263	30,048	2028/11/15
US TREASURY N/B	2.625	900	971	110,574	2029/2/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
<b>(アメリカ)</b> <b>国債証券</b>					
US TREASURY N/B	1.625	600	605	68,890	2029/8/15
US TREASURY N/B	1.75	500	508	57,938	2029/11/15
US TREASURY N/B	1.5	1,200	1,196	136,185	2030/2/15
US TREASURY N/B	0.875	2,700	2,538	288,996	2030/11/15
US TREASURY N/B	5.375	400	532	60,635	2031/2/15
US TREASURY N/B	1.625	600	600	68,394	2031/5/15
US TREASURY N/B	1.25	1,000	965	109,890	2031/8/15
US TREASURY N/B	4.5	390	529	60,277	2036/2/15
US TREASURY N/B	4.375	170	230	26,267	2038/2/15
US TREASURY N/B	3.75	390	482	54,883	2039/2/15
US TREASURY N/B	4.375	100	137	15,651	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.375	230	317	36,151	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	350	455	51,814	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.375	200	277	31,619	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	200	257	29,281	2041/8/15
US TREASURY N/B	3.125	350	414	47,126	2041/11/15
US TREASURY N/B	2.75	300	335	38,179	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	100	118	13,485	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	250	285	32,473	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	140	178	20,344	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	200	260	29,623	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	550	704	80,170	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	120	148	16,893	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.0	600	701	79,847	2044/11/15
US TREASURY N/B	2.5	1,400	1,506	171,469	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	450	527	60,059	2045/5/15
US TREASURY N/B	2.875	700	804	91,583	2045/8/15
US TREASURY N/B	3.0	200	235	26,750	2045/11/15
US TREASURY N/B	2.5	1,350	1,455	165,712	2046/2/15
US TREASURY N/B	2.5	150	161	18,425	2046/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,750	2,833	322,570	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	300	346	39,456	2046/11/15
US TREASURY N/B	2.75	1,550	1,755	199,814	2047/8/15
US TREASURY N/B	2.75	1,050	1,190	135,486	2047/11/15
US TREASURY N/B	2.25	1,000	1,035	117,851	2049/8/15
US TREASURY N/B	1.25	3,100	2,535	288,659	2050/5/15
US TREASURY N/B	1.375	1,800	1,518	172,883	2050/8/15
小 計					11,690,178
<b>(カナダ)</b> <b>国債証券</b>					
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	400	398	36,659	2022/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	600	608	55,968	2023/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	200	204	18,783	2023/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	450	446	41,074	2023/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	400	393	36,166	2024/4/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	400	402	36,977	2025/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.25	400	382	35,200	2026/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	480	626	57,553	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	510	726	66,782	2037/6/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
<b>(カナダ)</b> <b>国債証券</b>					
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	200	266	24,511	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	200	256	23,582	2045/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	450	445	40,968	2051/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	100	116	10,750	2064/12/1
小 計				484,978	
<b>(メキシコ)</b> <b>国債証券</b>					
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	7,000	7,179	40,501	2023/12/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	5,000	5,417	30,559	2024/12/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	5,000	5,014	28,285	2027/6/3
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	6,000	6,339	35,762	2029/5/31
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	2,500	2,532	14,283	2031/5/29
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	4,500	4,734	26,710	2038/11/18
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,000	2,933	16,548	2042/11/13
小 計				192,652	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b> <b>国債証券</b>					
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	300	308	40,756	2023/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	500	517	68,307	2023/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	200	209	27,724	2023/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	570	657	86,811	2024/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	500	528	69,732	2024/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	250	261	34,557	2024/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	500	518	68,459	2025/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	500	529	69,956	2025/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	650	678	89,630	2026/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	400	414	54,782	2027/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	560	773	102,084	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	200	269	35,618	2028/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	350	540	71,417	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	470	722	95,436	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	300	486	64,280	2034/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	900	897	118,531	2035/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	260	419	55,368	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	150	262	34,649	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	470	884	116,802	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	650	1,076	142,113	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	350	538	71,137	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	550	865	114,354	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	200	186	24,663	2050/8/15
<b>(ユーロ…イタリア)</b> <b>国債証券</b>					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	850	913	120,669	2023/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	600	654	86,447	2023/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	9.0	430	510	67,423	2023/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	700	777	102,716	2024/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.75	200	222	29,349	2024/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	450	526	69,490	2025/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.5	500	549	72,572	2025/11/15
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.5	950	1,131	149,350	2026/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	7.25	700	946	124,933	2026/11/1

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利 率	額面金額	評 価 額	債 額	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…イタリア)</b> <b>国債証券</b>					
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.05	500	548	72,372	2027/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.5	600	816	107,883	2027/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	550	705	93,191	2028/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.25	750	1,020	134,798	2029/11/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.5	900	1,103	145,685	2030/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	0.9	700	701	92,615	2031/4/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	6.0	650	957	126,414	2031/5/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.75	250	375	49,581	2033/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	250	363	47,986	2034/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.0	560	764	100,961	2037/2/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	450	700	92,448	2039/8/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	472	62,395	2040/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	4.75	150	239	31,562	2044/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.25	800	1,049	138,644	2046/9/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	3.45	400	544	71,908	2048/3/1
BIONTI POLIENNALI DEL TES	2.8	250	294	38,823	2067/3/1
<b>(ユーロ…フランス)</b> <b>国債証券</b>					
FRANCE (GOVT OF)	2.25	400	411	54,376	2022/10/25
FRANCE (GOVT OF)	8.5	200	227	30,057	2023/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	850	882	116,555	2023/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.25	750	824	108,834	2023/10/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	650	698	92,205	2024/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	750	803	106,103	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	414	54,701	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	950	1,198	158,200	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	600	635	83,875	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	400	470	62,097	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	350	413	54,583	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	530	70,002	2028/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	490	695	91,869	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	728	96,202	2029/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	950	1,150	151,950	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	800	902	119,214	2031/5/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	1,300	2,085	275,391	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,000	1,108	146,416	2034/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	180	284	37,599	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	500	555	73,367	2036/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	460	723	95,526	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	150	181	23,942	2039/6/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	670	654	86,460	2040/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.5	250	430	56,783	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	450	699	92,411	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	300	387	51,138	2048/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	320	606	80,149	2055/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	350	694	91,766	2060/4/25
<b>(ユーロ…オランダ)</b> <b>国債証券</b>					
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	270	284	37,612	2023/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	150	156	20,655	2023/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	100	107	14,157	2024/7/15

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…オランダ) 国債証券</b>					
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	150	154	20,379	2025/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	200	208	27,584	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	470	641	84,666	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	600	764	100,919	2033/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	700	1,104	145,818	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	200	210	27,744	2040/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	200	321	42,513	2047/1/15
<b>(ユーロ…スペイン) 国債証券</b>					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	300	330	43,603	2023/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	300	336	44,418	2024/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	500	534	70,610	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	600	713	94,192	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	900	987	130,442	2026/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	800	1,033	136,418	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	300	325	43,033	2028/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	500	544	71,899	2028/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	650	879	116,086	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	830	1,183	156,330	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	500	514	67,886	2029/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	600	684	90,347	2030/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	300	323	42,714	2030/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.1	300	290	38,359	2031/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	430	640	84,565	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	400	665	87,865	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	150	273	36,180	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	400	548	72,454	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	250	333	44,050	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	100	155	20,591	2066/7/30
<b>(ユーロ…ベルギー) 国債証券</b>					
BELGIUM KINGDOM	2.25	170	178	23,551	2023/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.6	200	217	28,693	2024/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	150	159	21,092	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	380	522	68,958	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.8	200	213	28,146	2028/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.1	400	402	53,096	2030/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,085	143,398	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.0	170	237	31,396	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	5.0	260	419	55,400	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	4.25	450	748	98,899	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	220	364	48,077	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	80	112	14,886	2066/6/22
<b>(ユーロ…オーストリア) 国債証券</b>					
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	250	262	34,632	2023/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	100	106	14,102	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	200	247	32,666	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	200	276	36,467	2027/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	200	208	27,551	2029/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	800	1,013	133,882	2034/5/23

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
<b>(ユーロ…オーストリア) 国債証券</b>					
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	350	551	72,863	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	250	395	52,244	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	80	165	21,888	2062/1/26
<b>(ユーロ…フィンランド) 国債証券</b>					
FINNISH GOVERNMENT	1.5	100	103	13,638	2023/4/15
FINNISH GOVERNMENT	4.0	200	233	30,887	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	2.75	300	360	47,587	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	1.125	150	166	21,990	2034/4/15
FINNISH GOVERNMENT	2.625	100	144	19,046	2042/7/4
<b>(ユーロ…アイルランド) 国債証券</b>					
IRISH TREASURY	3.9	200	212	28,091	2023/3/20
IRISH TREASURY	5.4	300	359	47,521	2025/3/13
IRISH TREASURY	1.0	300	318	42,054	2026/5/15
IRISH TREASURY	2.4	300	359	47,478	2030/5/15
IRISH TREASURY	1.7	200	235	31,106	2037/5/15
IRISH TREASURY	2.0	200	255	33,736	2045/2/18
ユーロ計				9,868,326	
<b>(イギリス) 国債証券</b>					
UK TREASURY	0.125	300	298	46,748	2023/1/31
UK TREASURY	0.125	300	296	46,446	2024/1/31
UK TREASURY	2.75	500	530	83,008	2024/9/7
UK TREASURY	1.25	600	614	96,273	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	150	180	28,255	2027/12/7
UK TREASURY	6.0	270	364	57,094	2028/12/7
UK TREASURY	0.875	500	495	77,665	2029/10/22
UK TREASURY	4.75	200	264	41,366	2030/12/7
UK TREASURY	4.25	280	366	57,334	2032/6/7
UK TREASURY	4.5	400	554	86,843	2034/9/7
UK TREASURY	0.625	200	182	28,574	2035/7/31
UK TREASURY	4.25	260	361	56,584	2036/3/7
UK TREASURY	4.75	170	259	40,619	2038/12/7
UK TREASURY	4.25	100	148	23,255	2040/12/7
UK TREASURY	4.5	270	424	66,529	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	550	746	116,846	2044/1/22
UK TREASURY	4.25	450	722	113,150	2046/12/7
UK TREASURY	1.5	100	102	16,051	2047/7/22
UK TREASURY	1.75	100	108	16,988	2049/1/22
UK TREASURY	4.25	560	1,011	158,483	2055/12/7
UK TREASURY	4.0	400	734	115,086	2060/1/22
UK TREASURY	3.5	300	547	85,821	2068/7/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	300	315	49,342	2025/9/7
小計				1,508,374	
<b>(スウェーデン) 国債証券</b>					
SWEDISH GOVERNMENT	1.5	2,500	2,588	34,249	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	1,850	2,018	26,708	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	1,500	1,569	20,762	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	2.25	1,750	2,078	27,502	2032/6/1

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千円	千円	千円	
<b>(スウェーデン) 国債証券</b>					
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	700	1,023	13,545	2039/3/30
小 計				122,768	
<b>(ノルウェー) 国債証券</b>					
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,400	1,421	19,372	2023/5/24
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	450	468	6,379	2024/3/14
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,010	13,768	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	998	13,611	2026/2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,300	1,329	18,126	2028/4/26
小 計				71,258	
<b>(デンマーク) 国債証券</b>					
KINGDOM OF DENMARK	1.75	500	543	9,649	2025/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	2,300	4,025	71,453	2039/11/15
小 計				81,102	
<b>(ポーランド) 国債証券</b>					
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,000	1,043	29,858	2023/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,000	1,015	29,064	2024/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	800	831	23,799	2025/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	800	809	23,174	2026/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	600	609	17,439	2028/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	1,000	1,006	28,811	2029/10/25
小 計				152,148	
<b>(オーストラリア) 国債証券</b>					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	300	323	27,632	2023/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	450	479	40,884	2024/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	200	216	18,444	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	480	546	46,604	2026/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	400	474	40,455	2027/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	400	432	36,910	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	650	729	62,269	2029/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	500	534	45,578	2030/5/21

銘柄	当 期 末				
	利 率	額面金額	評 価 額	償 還 年 月 日	
	%	千円	千円	千円	
<b>(オーストラリア) 国債証券</b>					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	500	469	40,086	2030/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	550	663	56,634	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	450	487	41,602	2047/3/21
小 計				457,102	
<b>(シンガポール) 国債証券</b>					
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	200	207	17,495	2023/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	400	442	37,434	2027/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	200	229	19,400	2033/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	150	165	13,967	2042/4/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	190	210	17,758	2046/3/1
小 計				106,056	
<b>(マレーシア) 国債証券</b>					
MALAYSIA GOVERNMENT	3.955	1,000	1,037	28,440	2025/9/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	1,400	1,441	39,528	2027/11/16
MALAYSIA GOVERNMENT	3.885	1,000	1,017	27,905	2029/8/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	1,000	968	26,548	2034/7/5
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	500	535	14,695	2043/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.48	600	611	16,762	2023/3/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.181	1,000	1,039	28,514	2024/7/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.392	2,250	2,366	64,904	2026/4/15
小 計				247,301	
<b>(イスラエル) 国債証券</b>					
ISRAEL FIXED BOND	4.25	1,200	1,271	45,218	2023/3/31
ISRAEL FIXED BOND	6.25	500	635	22,591	2026/10/30
ISRAEL FIXED BOND	5.5	620	968	34,440	2042/1/31
小 計				102,250	
合 計				25,084,499	

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

## ○投資信託財産の構成

(2021年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	25,084,499	97.1
コール・ローン等、その他	757,518	2.9
投資信託財産総額	25,842,017	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（25,659,540千円）の投資信託財産総額（25,842,017千円）に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.83円、1カナダドル=91.92円、1メキシコペソ=5.6413円、1ユーロ=132.05円、1イギリスポンド=156.62円、1スウェーデンクローナ=13.23円、1ノルウェークローネ=13.63円、1デンマーククローネ=17.75円、1ポーランドズロチ=28.6252円、1オーストラリアドル=85.32円、1シンガポールドル=84.51円、1マレーシアリンギット=27.4259円、1イスラエルシェケル=35.5652円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年10月26日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	50,969,020,439	
コール・ローン等	271,454,715	
公社債（評価額）	25,084,499,464	
未収入金	25,402,162,904	
未収利息	205,713,414	
前払費用	5,189,942	
(B) 負債	25,744,758,739	
未払金	25,741,903,188	
未払解約金	2,855,481	
未払利息	70	
(C) 純資産総額（A－B）	25,224,261,700	
元本	15,760,382,772	
次期繰越損益金	9,463,878,928	
(D) 受益権総口数	15,760,382,772口	
1万口当たり基準価額（C/D）	16,005円	

(注) 当ファンドの期首元本額は15,326,314,880円、期中追加設定元本額は1,464,475,775円、期中一部解約元本額は1,030,407,883円です。

(注) 2021年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	9,387,722,617円
・インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	4,087,190,320円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,238,549,893円
・インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	525,985,497円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	142,979,875円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	140,965,478円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	102,372,497円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	98,744,927円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	16,573,076円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	9,597,905円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	5,297,362円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,403,325円

(注) 1口当たり純資産額は1,6005円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

## ○損益の状況（2020年10月27日～2021年10月26日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	624,204,888	
受取利息	624,327,242	
支払利息	△ 122,354	
(B) 有価証券売買損益	△ 1,454,773,530	
売買益	2,676,992,339	
売買損	△ 4,131,765,869	
(C) 保管費用等	△ 3,473,967	
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 834,042,609	
(E) 前期繰越損益金	10,015,811,635	
(F) 追加信託差損益金	923,193,809	
(G) 解約差損益金	△ 641,083,907	
(H) 計（D＋E＋F＋G）	9,463,878,928	
次期繰越損益金（H）	9,463,878,928	

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

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

## ○お知らせ

## 約款変更について

2020年10月27日から2021年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。