

# 野村世界6資産分散投信

## (安定コース) / (分配コース) / (成長コース)

### 運用報告書(全体版)

第92期（決算日2021年3月10日） 第93期（決算日2021年5月10日） 第94期（決算日2021年7月12日）

作成対象期間（2021年1月13日～2021年7月12日）

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	安定コース 追加型投信／内外資産複合／インデックス型	分配コース	成長コース
信託期間	2005年10月3日以降、無期限とします。		
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、国内及び外国の各株式、各債券、各不動産投資信託証券（REIT）の6資産に実質的に投資します。各ファンド毎に、概ね基本投資割合を自歎としてバランスよく分散投資を行います。各ファンドは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各基本投資割合を掛け合わせた合成指數に連動する投資成果を目指して運用を行います。安定コースは、信託財産の着実な成長を目的に運用を行うことを基本とします。分配コースは、インカムゲイン（利子配当収益）の獲得と信託財産の成長を目的に運用を行うことを基本とします。成長コースは、信託財産の成長を目的に運用を行うことを基本とします。 ＜基本投資割合＞		
主な投資対象	野村世界6資産分散投信 「国内債券NOMURA-BP」総合 マザーファンド、「外国債券マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」の受益証券を主要投資対象とします。 国内債券NOMURA-BP総合 マザーファンド わが国の公社債を主要投資対象とします。 外国債券マザーファンド 外債の公債債を主要投資対象とします。 国内株式マザーファンド わが国の株式を主要投資対象とします。 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 外国の株式を主要投資対象とします。 J-REITインデックス マザーファンド J-REITを主要投資対象とします。 海外REITインデックス マザーファンド 日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。		
主な投資制限	野村世界6資産分散投信 外貨建て資産への直接投資は行いません。デリバティブの直接利用は行いません。株式への直接投資は行いません。 国内債券NOMURA-BP総合 マザーファンド 外貨建て資産への投資は行いません。 外国債券マザーファンド 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 国内株式マザーファンド 株式への投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への投資は行いません。 外国株式MSCI-KOKUSAI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。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 J-REITインデックス マザーファンド 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 海外REITインデックス マザーファンド 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。		
分配方針	年6回の毎決算時に、原則として利子・配当等収益等の水準および、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。		

#### 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

# 一目 次一

## ■野村世界6資産分散投信（安定コース）／（分配コース）／（成長コース）の運用状況のご報告

	安定コース	分配コース	成長コース
運用の概要		1ページ	
各ファンドの運用状況	2ページ	8ページ	14ページ
マザーファンドの運用経過		20ページ	
各ファンドの信託財産の状況	22ページ	31ページ	40ページ

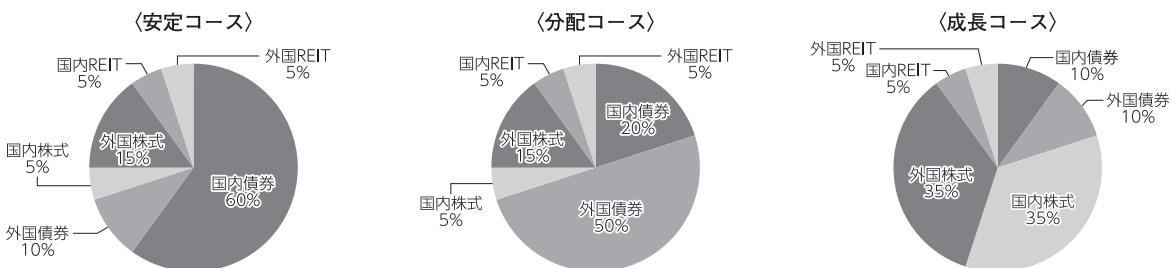
## ■各マザーファンドの運用状況のご報告

- |                                   |        |
|-----------------------------------|--------|
| 1. 国内株式マザーファンド 運用報告書              | 50ページ  |
| 2. 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 運用報告書  | 87ページ  |
| 3. 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 運用報告書 | 131ページ |
| 4. 外国債券マザーファンド 運用報告書              | 162ページ |
| 5. J-REITインデックス マザーファンド 運用報告書     | 185ページ |
| 6. 海外REITインデックス マザーファンド 運用報告書     | 196ページ |

## ◎運用の概要

- (1) [野村世界6資産分散投信（安定コース）]、[野村世界6資産分散投信（分配コース）]、[野村世界6資産分散投信（成長コース）]の各ファンドは、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、国内及び外国の各債券、国内及び外国の各株式、国内及び外国の各不動産投資信託証券（REIT）に実質的に投資します。
- (2) 各ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は以下を基本（これを「基本投資割合」といいます。）とし、原則として毎月、リバランスを行い、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。

## ◎各ファンドの基本投資割合



資産	実質的な投資をするマザーファンド	各マザーファンドの対象指数
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券	外国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
国内株式	国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX)
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数(配当込み)
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

\*「MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

\*「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。

## ○最近15期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率							
80期(2019年3月11日)	円 11,878	円 30	% 2.9	% 161.64	% 3.0	% 19.1	% 0.2	% 69.7	% —	% 10.3	百万円 64,765
81期(2019年5月10日)	11,933	30	0.7	162.86	0.8	18.7	0.3	70.1	—	10.2	69,295
82期(2019年7月10日)	12,123	30	1.8	166.04	2.0	19.6	0.2	68.8	—	10.5	77,812
83期(2019年9月10日)	12,152	30	0.5	167.06	0.6	19.8	0.2	68.5	—	10.5	82,370
84期(2019年11月11日)	12,210	30	0.7	168.38	0.8	19.8	0.2	69.1	—	10.0	84,571
85期(2020年1月10日)	12,289	30	0.9	170.06	1.0	19.5	0.3	69.2	—	10.2	87,808
86期(2020年3月10日)	11,633	30	△5.1	161.58	△5.0	17.5	0.3	71.4	—	9.7	85,111
87期(2020年5月11日)	11,572	30	△0.3	161.09	△0.3	19.6	0.3	68.5	—	10.5	84,089
88期(2020年7月10日)	11,755	30	1.8	164.35	2.0	19.5	0.3	69.1	—	10.1	85,964
89期(2020年9月10日)	11,925	30	1.7	167.30	1.8	19.2	0.2	69.3	—	10.0	88,175
90期(2020年11月10日)	11,997	30	0.9	168.91	1.0	20.5	0.3	67.8	—	10.6	89,613
91期(2021年1月12日)	12,208	30	2.0	172.45	2.1	19.8	0.3	69.0	—	10.0	91,723
92期(2021年3月10日)	12,373	30	1.6	175.43	1.7	19.7	0.3	69.1	—	10.0	91,746
93期(2021年5月10日)	12,682	30	2.7	180.30	2.8	19.3	0.4	69.2	—	10.1	93,131
94期(2021年7月12日)	12,851	30	1.6	183.39	1.7	19.4	0.3	69.3	—	10.3	93,754

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率ー売り建て比率。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指値をもとにしています。なお、外国株式・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

\* ファンドの基本投資割合、各マザーファンドの対象指数については1ページに記載しております。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク 騰落率	株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		基	準						
第92期	(期首) 2021年1月12日	円 12,208	% —	172.45	% —	% 19.8	% 0.3	% 69.0	% —
	1月末	12,217	0.1	172.66	0.1	19.6	0.3	68.9	—
	2月末	12,284	0.6	173.84	0.8	19.8	0.3	68.6	—
	(期末) 2021年3月10日	12,403	1.6	175.43	1.7	19.7	0.3	69.1	—
									10.0
第93期	(期首) 2021年3月10日	12,373	—	175.43	—	19.7	0.3	69.1	—
	3月末	12,556	1.5	177.93	1.4	19.9	0.4	68.5	—
	4月末	12,680	2.5	179.87	2.5	19.6	0.4	68.8	—
	(期末) 2021年5月10日	12,712	2.7	180.30	2.8	19.3	0.4	69.2	—
									10.1
第94期	(期首) 2021年5月10日	12,682	—	180.30	—	19.3	0.4	69.2	—
	5月末	12,718	0.3	180.99	0.4	19.4	0.4	69.2	—
	6月末	12,814	1.0	182.43	1.2	19.6	0.4	69.1	—
	(期末) 2021年7月12日	12,881	1.6	183.39	1.7	19.4	0.3	69.3	—
									10.3

\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

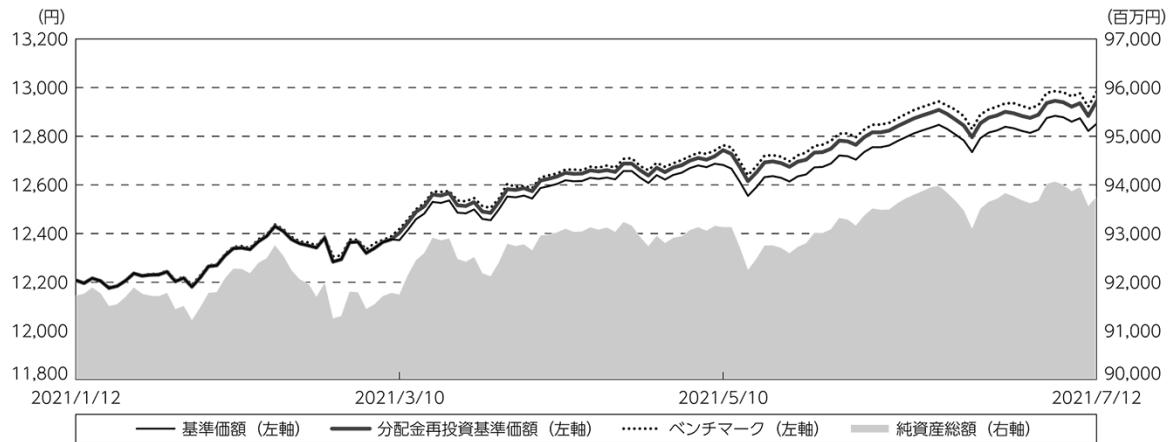
\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第92期首：12,208円

第94期末：12,851円 (既払分配金(税込み)：90円)

騰落率： 6.0% (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。作成期首（2021年1月12日）の値が基準価額と同一となるように指標化しております。

(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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) ベンチマークは、投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首（2021年1月12日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。

(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。

### ○基準価額の主な変動要因

投資対象とする6本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT (+33.1%)、国内REIT (+24.7%)、外国株式 (+20.6%)、国内株式 (+6.3%)、外国債券 (+3.1%)、国内債券 (+0.2%)と全て上昇しました。

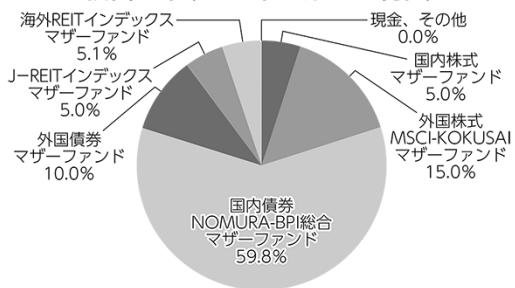
外国株式や外国REITなどの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	低金利政策の長期化観測などを背景に、国内債券利回りは小幅低下（価格は上昇）しました。
外 国 債 券	米国の追加経済対策に伴う国債増発懸念や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待などを背景に、外国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
国 内 株 式	円安に伴う国内輸出関連企業の業績回復期待や新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う世界景気の回復期待、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	米国における大規模な追加経済対策の成立や新型コロナウイルスのワクチン普及に伴い景気回復期待が高まることなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落などのマイナス要因はありましたか、新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う世界景気の回復期待や国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 R E I T	米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

＜投資比率（2021年7月12日現在）＞



当運用期間の最終決算期末における各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当運用期間を通じ、6本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

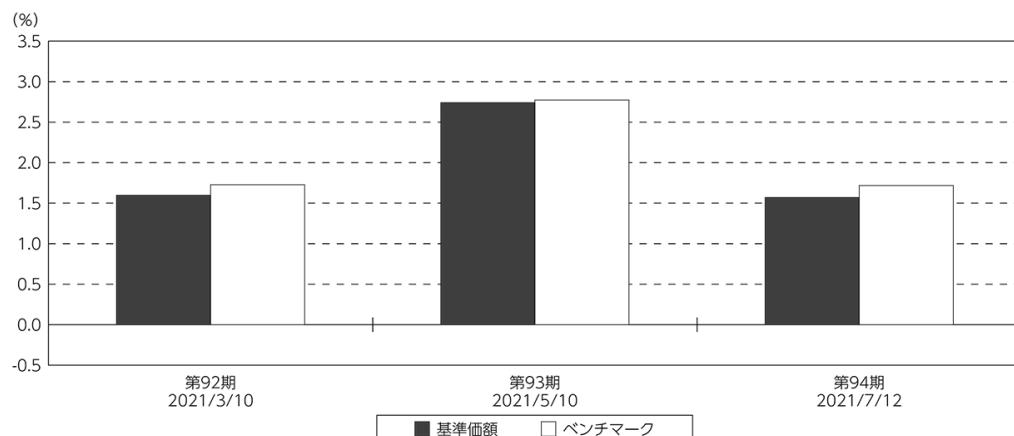
マザーファンドの運用経過については、20ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間における基準価額の騰落率は+6.0%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+6.3%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬、及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額とベンチマークの騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し決定しました。  
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.242%	30 0.236%	30 0.233%
当期の収益	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,305	3,613	3,781

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

引き続き国内及び外国の各債券・株式・REITの6資産について、基本投資割合を目処としてバランスよく分散投資し、信託財産の着実な成長を目指します。基本投資割合に各マザーファンドの対象指数の月次リターンを掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

## ○最近15期の運用実績

決算期 (分配落)	基準価額			ベンチマーク 期騰落率	株組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額 百万円
	税込分配金	期中騰落率	中騰落率							
80期(2019年3月11日)	円 9,954	円 30	% 3.6	% 170.75	% 4.0	% 19.1	% 0.2	% 69.6	% —	% 10.3
81期(2019年5月10日)	9,986	30	0.6	171.57	0.5	18.8	0.3	69.8	—	10.2
82期(2019年7月10日)	10,185	30	2.3	175.78	2.5	19.5	0.2	68.9	—	10.5
83期(2019年9月10日)	10,193	30	0.4	176.62	0.5	19.8	0.2	68.8	—	10.4
84期(2019年11月11日)	10,291	30	1.3	179.19	1.5	19.8	0.2	69.1	—	10.0
85期(2020年1月10日)	10,409	30	1.4	181.93	1.5	19.5	0.3	69.2	—	10.2
86期(2020年3月10日)	9,865	30	△4.9	172.85	△5.0	17.6	0.3	71.5	—	9.7
87期(2020年5月11日)	9,824	30	△0.1	172.73	△0.1	19.6	0.3	68.6	—	10.5
88期(2020年7月10日)	10,113	30	3.2	179.13	3.7	19.5	0.3	69.2	—	10.1
89期(2020年9月10日)	10,320	30	2.3	183.33	2.3	19.2	0.2	69.6	—	10.0
90期(2020年11月10日)	10,335	30	0.4	184.47	0.6	20.4	0.3	67.8	—	10.6
91期(2021年1月12日)	10,542	30	2.3	188.75	2.3	19.9	0.3	68.9	—	10.0
92期(2021年3月10日)	10,743	30	2.2	193.27	2.4	19.6	0.3	69.2	—	10.0
93期(2021年5月10日)	11,024	30	2.9	198.59	2.8	19.3	0.4	69.1	—	10.1
94期(2021年7月12日)	11,207	30	1.9	202.89	2.2	19.4	0.3	69.2	—	10.3
										121,090

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率ー売り建て比率。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指値をもとにしています。なお、外国株式・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

\* ファンドの基本投資割合、各マザーファンドの対象指数については1ページに記載しております。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額	ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	
			騰落率	騰落率						
第92期	(期首) 2021年1月12日	円 10,542	% —	% 188.75	% 19.9	% 0.3	% 68.9	% —	% 10.0	
	1月末	10,569	0.3	189.25	0.3	19.6	0.3	68.7	—	10.3
	2月末	10,624	0.8	190.87	1.1	19.8	0.3	68.4	—	10.5
	(期末) 2021年3月10日	10,773	2.2	193.27	2.4	19.6	0.3	69.2	—	10.0
	(期首) 2021年3月10日	10,743	—	193.27	—	19.6	0.3	69.2	—	10.0
第93期	3月末	10,918	1.6	195.90	1.4	19.8	0.4	68.5	—	10.3
	4月末	11,015	2.5	198.17	2.5	19.6	0.4	68.6	—	10.4
	(期末) 2021年5月10日	11,054	2.9	198.59	2.8	19.3	0.4	69.1	—	10.1
	(期首) 2021年5月10日	11,024	—	198.59	—	19.3	0.4	69.1	—	10.1
第94期	5月末	11,101	0.7	200.55	1.0	19.3	0.4	69.3	—	10.2
	6月末	11,175	1.4	201.81	1.6	19.6	0.4	68.9	—	10.3
	(期末) 2021年7月12日	11,237	1.9	202.89	2.2	19.4	0.3	69.2	—	10.3

\*期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

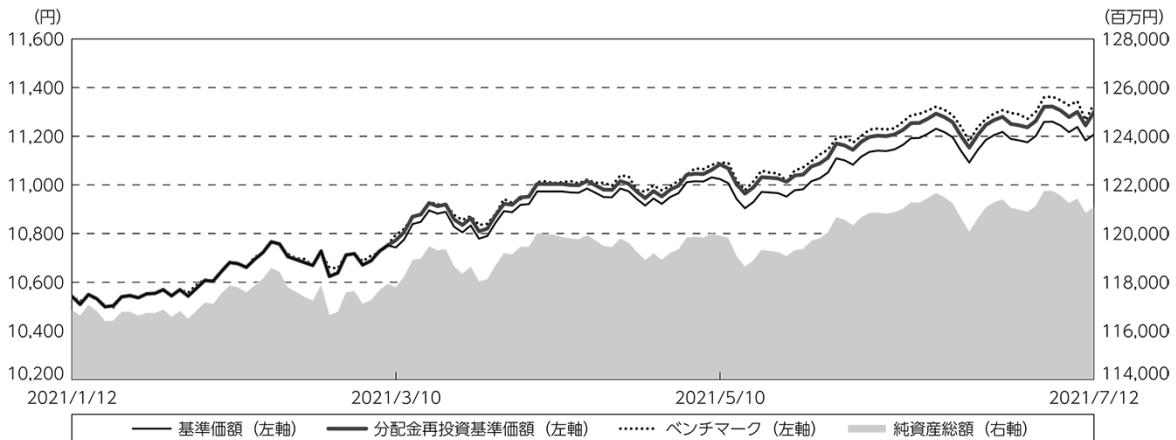
\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第92期首：10,542円

第94期末：11,207円（既払分配金（税込み）：90円）

騰落率：7.2%（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。作成期首（2021年1月12日）の値が基準価額と同一となるように指標化しております。

（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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）ベンチマークは、投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首（2021年1月12日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。

（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。

### ○基準価額の主な変動要因

投資対象とする6本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT (+33.1%)、国内REIT (+24.7%)、外国株式 (+20.6%)、国内株式 (+6.3%)、外国債券 (+3.1%)、国内債券 (+0.2%)と全て上昇しました。

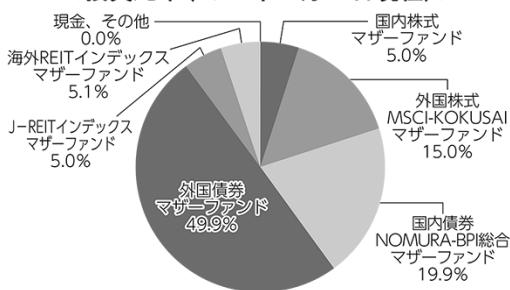
外国株式や外国債券などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	低金利政策の長期化観測などを背景に、国内債券利回りは小幅低下（価格は上昇）しました。
外 国 債 券	米国の追加経済対策に伴う国債増発懸念や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待などを背景に、外国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
国 内 株 式	円安に伴う国内輸出関連企業の業績回復期待や新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う世界景気の回復期待、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	米国における大規模な追加経済対策の成立や新型コロナウイルスのワクチン普及に伴い景気回復期待が高まることなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落などのマイナス要因はありましたか、新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う世界景気の回復期待や国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 R E I T	米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年7月12日現在)>



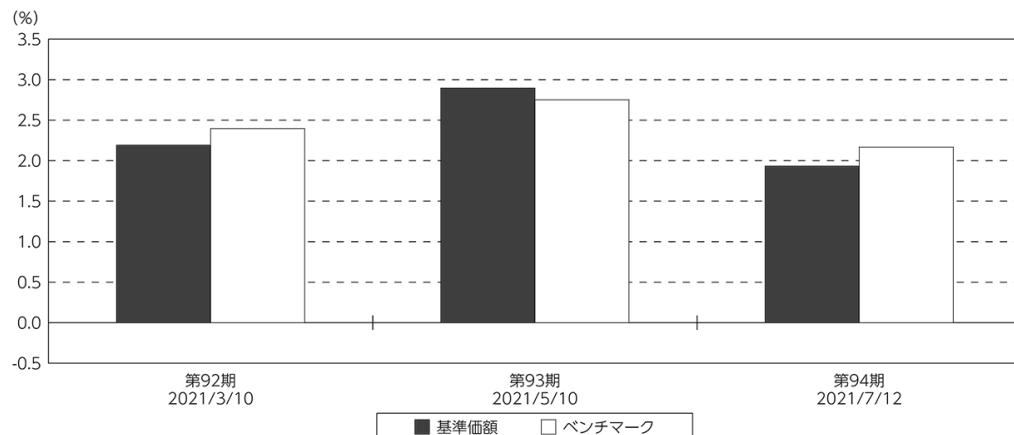
当運用期間の最終決算期末における各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当運用期間を通じ、6本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。  
マザーファンドの運用経過については、20ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間における基準価額の騰落率は+7.2%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+7.5%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬、及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額とベンチマークの騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し決定しました。  
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.278%	30 0.271%	30 0.267%
当期の収益	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,494	1,774	1,957

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

引き続き国内及び外国の各債券・株式・REITの6資産について、基本投資割合を目処としてバランスよく分散投資し、インカムゲイン（利子配当収益）の獲得と信託財産の成長を目指します。基本投資割合に各マザーファンドの対象指数の月次リターンを掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

## ○最近15期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率							
80期(2019年3月11日)	円 12,451	円 30	% 5.4	% 174.39	% 5.6	% 67.8	% 0.9	% 20.1	% —	% 10.9	百万円 34,404
81期(2019年5月10日)	12,528	30	0.9	175.42	0.6	67.2	1.1	20.3	—	10.9	34,627
82期(2019年7月10日)	12,806	30	2.5	179.92	2.6	68.3	0.7	19.5	—	11.0	36,024
83期(2019年9月10日)	12,704	30	△ 0.6	179.14	△ 0.4	68.6	0.8	19.3	—	10.8	36,122
84期(2019年11月11日)	13,387	30	5.6	188.86	5.4	68.8	0.9	19.5	—	10.4	37,684
85期(2020年1月10日)	13,723	30	2.7	194.19	2.8	68.3	1.0	19.7	—	10.6	38,359
86期(2020年3月10日)	11,591	30	△15.3	164.62	△15.2	66.1	1.3	21.4	—	10.7	32,485
87期(2020年5月11日)	11,983	30	3.6	170.08	3.3	68.1	1.2	19.3	—	10.9	33,968
88期(2020年7月10日)	12,552	30	5.0	178.87	5.2	67.9	1.3	19.8	—	10.6	35,749
89期(2020年9月10日)	13,129	30	4.8	187.74	5.0	68.3	0.7	19.9	—	10.5	37,514
90期(2020年11月10日)	13,518	30	3.2	193.49	3.1	69.1	1.1	18.7	—	10.7	38,866
91期(2021年1月12日)	14,352	30	6.4	206.02	6.5	68.9	1.0	19.4	—	10.3	40,803
92期(2021年3月10日)	14,903	30	4.0	214.69	4.2	68.4	1.3	19.6	—	10.3	41,630
93期(2021年5月10日)	15,627	30	5.1	225.11	4.9	68.0	1.5	19.6	—	10.4	43,551
94期(2021年7月12日)	15,960	30	2.3	230.64	2.5	68.0	1.1	19.7	—	10.7	44,672

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率ー売り建て比率。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指値をもとにしています。なお、外国株式・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

\* ファンドの基本投資割合、各マザーファンドの対象指数については1ページに記載しております。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額	ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
			騰落率	騰落率					
第92期	(期首) 2021年1月12日	円 14,352	% —	% 206.02	% —	% 68.9	% 1.0	% 19.4	% —
	1月末	14,245	△0.7	204.61	△0.7	68.0	1.2	19.5	—
	2月末	14,611	1.8	210.22	2.0	68.1	1.2	19.2	—
	(期末) 2021年3月10日	14,933	4.0	214.69	4.2	68.4	1.3	19.6	—
	(期首) 2021年3月10日	14,903	—	214.69	—	68.4	1.3	19.6	—
第93期	3月末	15,331	2.9	220.17	2.6	68.0	1.7	19.2	—
	4月末	15,480	3.9	222.56	3.7	67.6	1.4	19.6	—
	(期末) 2021年5月10日	15,657	5.1	225.11	4.9	68.0	1.5	19.6	—
	(期首) 2021年5月10日	15,627	—	225.11	—	68.0	1.5	19.6	—
第94期	5月末	15,634	0.0	225.45	0.2	67.9	1.4	19.7	—
	6月末	15,879	1.6	229.04	1.7	68.1	1.2	19.5	—
	(期末) 2021年7月12日	15,990	2.3	230.64	2.5	68.0	1.1	19.7	—
	(期首) 2021年7月12日	15,990	2.3	230.64	2.5	68.0	1.1	19.7	—

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

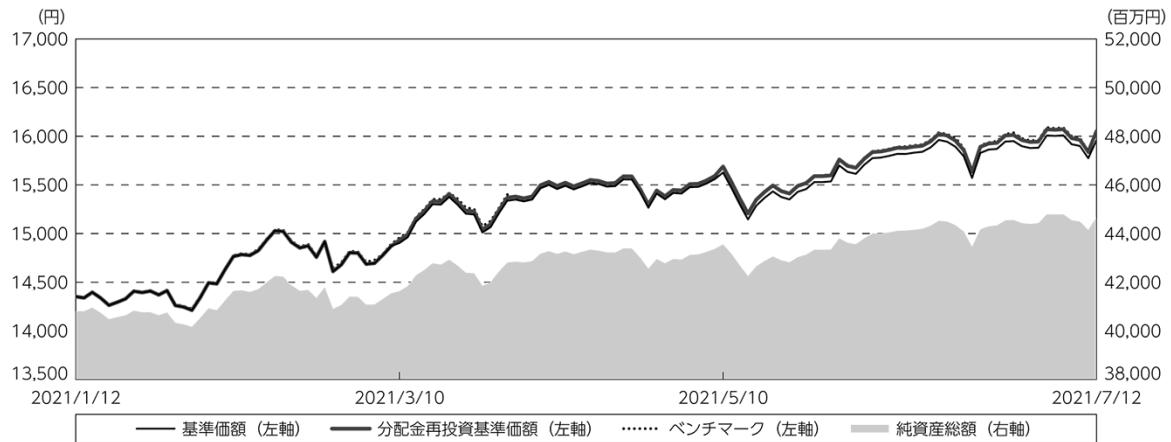
\* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第92期首：14,352円

第94期末：15,960円 (既払分配金(税込み)：90円)

騰落率： 11.9% (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。作成期首（2021年1月12日）の値が基準価額と同一となるように指標化しております。

(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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) ベンチマークは、投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首（2021年1月12日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。

(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。

### ○基準価額の主な変動要因

投資対象とする6本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国REIT (+33.1%)、国内REIT (+24.7%)、外国株式 (+20.6%)、国内株式 (+6.3%)、外国債券 (+3.1%)、国内債券 (+0.2%)と全て上昇しました。

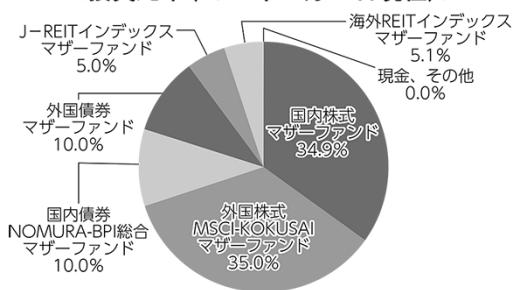
外国株式や国内株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	低金利政策の長期化観測などを背景に、国内債券利回りは小幅低下（価格は上昇）しました。
外 国 債 券	米国の追加経済対策に伴う国債増発懸念や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待などを背景に、外国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
国 内 株 式	円安に伴う国内輸出関連企業の業績回復期待や新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う世界景気の回復期待、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	米国における大規模な追加経済対策の成立や新型コロナウイルスのワクチン普及に伴い景気回復期待が高まることなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビル市況で平均空室率の上昇や平均賃料の下落などのマイナス要因はありましたか、新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う世界景気の回復期待や国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 R E I T	米中古住宅販売件数の回復や外国株式市場の上昇などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2021年7月12日現在)>



当運用期間の最終決算期末における各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、当運用期間を通じ、6本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

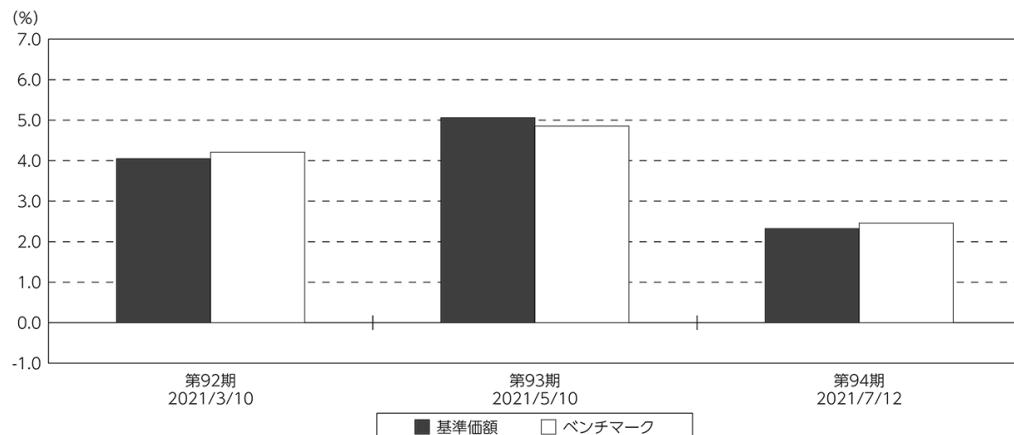
マザーファンドの運用経過については、20ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間における基準価額の騰落率は+11.9%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+12.0%を0.1ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬、及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額とベンチマークの騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し決定しました。  
留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.201%	30 0.192%	30 0.188%
当期の収益	30	30	30
当期の収益以外	—	—	—
翌期繰越分配対象額	6,818	7,537	7,868

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

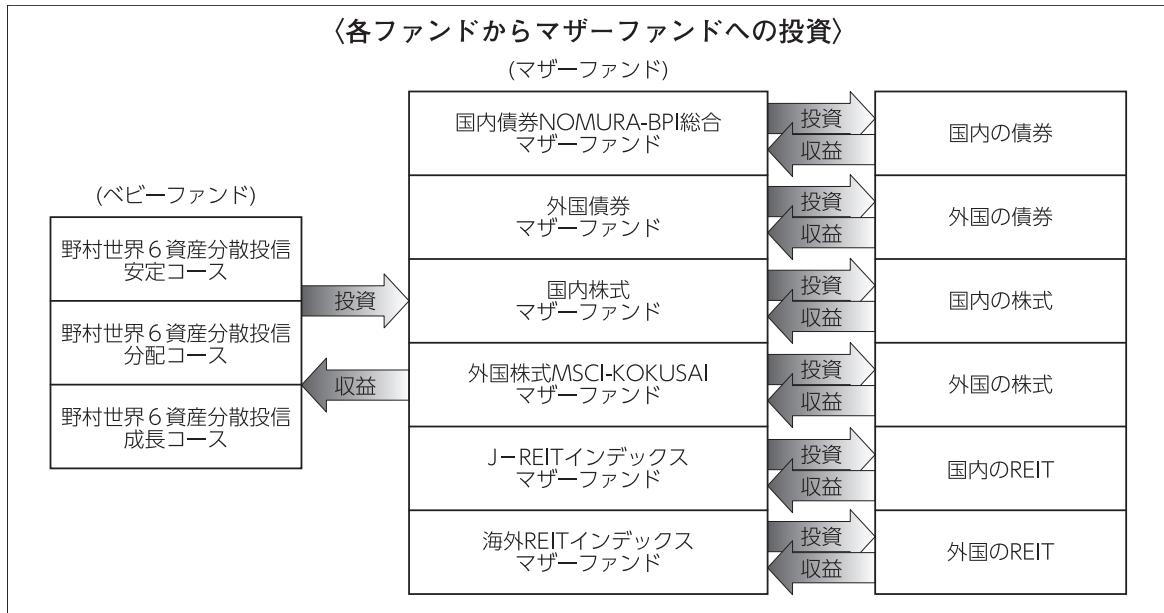
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

引き続き国内及び外国の各債券・株式・REITの6資産について、基本投資割合を目処としてバランスよく分散投資し、信託財産の成長を目指します。基本投資割合に各マザーファンドの対象指数の月次リターンを掛け合わせた合成指数に連動する投資成果を目指した運用を行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

## ◎マザーファンドの運用経過



### [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した利付債券銘柄に分散投資しました。指數構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指數に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

### [外国債券マザーファンド]

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指數構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指數構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指數に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

## [国内株式マザーファンド]

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式につきましては、東証1部上場銘柄に幅広く分散投資し、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。また、日々の追加設定・解約による資金移動に対しては売買にかかるコストなどを考慮し、株式先物を利用してまいりました。

## [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## [J-REITインデックス マザーファンド]

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指し、実質投資信託証券組入比率（先物を含む）は当運用期間を通じて高位に維持しました。J-REITへの投資にあたっては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数（配当込み）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行なってまいりました。また、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用してまいりました。

## [海外REITインデックス マザーファンド]

S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指し、実質投資信託証券組入比率（先物を含む）は当運用期間を通じて高位に維持しました。REITへの投資にあたっては、組入銘柄の構成比率がS&P先進国REIT指数（除く日本）の銘柄構成比とほぼ同水準になるように運用を行ないました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月13日～2021年7月12日)

項目	第92期～第94期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 42	% 0.338	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
( 投信会社 )	(16)	(0.125)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
( 販売会社 )	(23)	(0.185)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理および事務手続き等
( 受託会社 )	( 3 )	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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 )	(0.000)	
( 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	0.001	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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) その他の費用	0	0.004	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
( 保管費用 )	( 0 )	(0.001)	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 )	( 0 )	(0.001)	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
( その他の )	( 0 )	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	42	0.344	
作成期間の平均基準価額は、12,544円です。			

\*作成期間の費用（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。

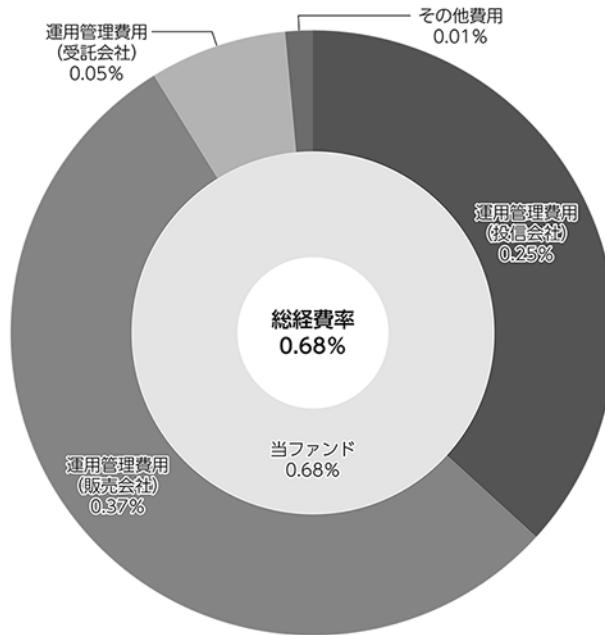
\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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マザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\*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）を作成期間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**

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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、売買委託手数料及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、マザーファンド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。

(2021年1月13日～2021年7月12日)

## ○売買及び取引の状況

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第92期～第94期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式マザーファンド	千口 97,743	千円 197,032	千口 251,640	千円 503,389
外国債券マザーファンド	158,611	396,170	168,781	423,168
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	19,591	71,937	706,786	2,664,730
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	2,455,318	3,250,854	1,578,420	2,093,578
J-REITインデックス マザーファンド	9,019	22,538	344,836	890,139
海外REITインデックス マザーファンド	8,657	21,633	422,449	1,084,269

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2021年1月13日～2021年7月12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	第92期～第94期	
	国内株式 マザーファンド	外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	132,049,443千円	85,842,326千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	396,252,870千円	901,771,417千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.33	0.09

\*(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

(2021年1月13日～2021年7月12日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村世界6資産分散投信（安定コース）&gt;

該当事項はございません。

&lt;国内株式マザーファンド&gt;

区 分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 31,781	百万円 254	% 0.8	百万円 100,267	百万円 0.189249	% 0.0
貸付有価証券(株式)	27,476	1,448	5.3	28,423	1,650	5.8

平均保有割合 1.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

\*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

## &lt;外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 132,788	百万円 1,117	% 0.8	百万円 56,917	百万円 149	% 0.3

平均保有割合 7.3%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 42,714	百万円 68	% 0.2	百万円 44,615	百万円 101	% 0.2

平均保有割合 1.6%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 3,643	百万円 151	% 4.1	百万円 4,736	百万円 85	% 1.8

平均保有割合 10.5%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,756	百万円 27	% 0.7	百万円 3,241	百万円 27	% 0.8

平均保有割合 12.6%

## 利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式マザーファンド>

種類	第92期～第94期		
	買付額	売付額	第94期末保有額
株式	百万円 67	百万円 496	百万円 1,211

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

### <国内株式マザーファンド>

種類	第92期～第94期	
	買付額	
株式	百万円 19	

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	第92期～第94期
売買委託手数料総額 (A)	492千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B) / (A)	0.6%

\*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2021年7月12日現在)

### 親投資信託残高

銘柄	第91期末		第94期末	
	口数	口数	評価額	千円
国内株式マザーファンド	千口 2,445,003	千口 2,291,106	4,684,396	
外国債券マザーファンド	3,679,178	3,669,008	9,355,972	
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,085,328	3,398,133	14,101,915	
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	41,211,250	42,088,148	56,078,249	
J-REITインデックス マザーファンド	1,985,297	1,649,479	4,728,398	
海外REITインデックス マザーファンド	2,044,408	1,630,616	4,767,434	

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(2021年7月12日現在)

## ○投資信託財産の構成

項目	第94期末	
	評価額	比率
国内株式マザーファンド	千円 4,684,396	% 5.0
外国債券マザーファンド	9,355,972	9.9
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	14,101,915	15.0
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	56,078,249	59.6
J-REITインデックス マザーファンド	4,728,398	5.0
海外REITインデックス マザーファンド	4,767,434	5.1
コール・ローン等、その他	405,518	0.4
投資信託財産総額	94,121,882	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券マザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（596,369,302千円）の投資信託財産総額（817,933,820千円）に対する比率は72.9%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（1,052,450,585千円）の投資信託財産総額（1,053,875,738千円）に対する比率は99.9%です。

\*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（42,161,817千円）の投資信託財産総額（42,290,569千円）に対する比率は99.7%です。

\*外貨建て資産は、第94期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=110.17円、1カナダドル=88.44円、1英ポンド=153.11円、1スイスフラン=120.51円、1スウェーデンクローナ=12.85円、1ノルウェークローネ=12.69円、1デンマーククローネ=17.59円、1ユーロ=130.82円、1ズロチ=28.7664円、1香港ドル=14.18円、1シンガポールドル=81.53円、1リングギ=26.3269円、1ウォン=0.0962円、1豪ドル=82.37円、1ニュージーランドドル=76.99円、1新シェケル=33.6225円、1メキシコペソ=5.5418円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第92期末	第93期末	第94期末
	2021年3月10日現在	2021年5月10日現在	2021年7月12日現在
(A) 資産	円	円	円
コール・ローン等	92,115,208,174	93,492,104,279	94,121,882,980
国内株式マザーファンド(評価額)	144,239,615	365,507,029	138,538,379
外国債券マザーファンド(評価額)	4,674,579,581	4,706,878,107	4,684,396,497
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	9,218,975,503	9,243,974,736	9,355,972,009
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	14,015,928,045	13,989,109,690	14,101,915,294
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	54,716,258,073	55,675,761,312	56,078,249,414
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	4,453,535,055	4,625,982,444	4,728,398,654
未収入金	4,627,983,372	4,649,844,816	4,767,434,139
(B) 負債			
未払収益分配金	263,708,930	235,046,145	266,978,594
未払解約金	368,422,167	360,482,330	367,243,860
未払信託報酬	222,453,648	220,301,275	218,871,771
未払利息	47,845,728	34,025,006	38,069,494
その他未払費用	97,807,255	105,814,551	109,947,852
(C) 純資産総額(A-B)	91,746,786,007	93,131,621,949	93,754,639,120
元本	74,151,216,071	73,433,758,433	72,957,257,274
次期繰越損益金	17,595,569,936	19,697,863,516	20,797,381,846
(D) 受益権総口数	74,151,216,071口	73,433,758,433口	72,957,257,274口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,373円	12,682円	12,851円

(注) 第92期首元本額は75,132,826,101円、第92~94期中追加設定元本額は1,496,673,884円、第92~94期中一部解約元本額は3,672,242,711円、1口当たり純資産額は、第92期1,2373円、第93期1,2682円、第94期1,2851円です。

## ○損益の状況

項 目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
(A) 配当等収益	円	円	円
支払利息	△ 3,306	△ 3,186	△ 5,309
(B) 有価証券売買損益	円	円	円
売買益	△ 3,306	△ 3,186	△ 5,309
売買損	1,539,384,080	2,591,984,981	1,554,329,776
売益 1,879,094,167	2,617,281,181	1,574,325,542	
売損 △ 339,710,087	△ 25,296,200	△ 19,995,766	
(C) 信託報酬等	円	円	円
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 98,122,740	△ 106,155,867	△ 110,302,499
(E) 前期繰越損益金	1,441,258,034	2,485,825,928	1,444,021,968
(F) 追加信託差損益金	4,612,859,141	5,739,794,931	7,900,614,447
(配当等相当額)	11,763,906,409	11,692,543,932	11,671,617,202
(売買損益相当額)	( 18,677,214,361)	( 18,532,616,016)	( 18,465,872,984)
(G) 計(D+E+F)	(△ 6,913,307,952)	(△ 6,840,072,084)	(△ 6,794,255,782)
(H) 収益分配金	17,818,023,584	19,918,164,791	21,016,253,617
次期繰越損益金(G+H)	△ 222,453,648	△ 220,301,275	△ 218,871,771
追加信託差損益金	17,595,569,936	19,697,863,516	20,797,381,846
(配当等相当額)	11,763,906,409	11,692,543,932	11,671,617,202
(売買損益相当額)	( 18,677,890,198)	( 18,533,376,056)	( 18,466,475,704)
分配準備積立金	(△ 6,913,983,789)	(△ 6,840,832,124)	(△ 6,794,858,502)
	5,831,663,527	8,005,319,584	9,125,764,644

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

\*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。

\*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、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2021年1月13日～2021年7月12日）は以下の通りです。

項 目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	190,769,499円	239,146,169円	201,101,677円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,153,252,646円	2,246,679,759円	1,242,920,291円
c. 信託約款に定める収益調整金	18,677,890,198円	18,533,376,056円	18,466,475,704円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	4,710,095,030円	5,739,794,931円	7,900,614,447円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	24,732,007,373円	26,758,996,915円	27,811,112,119円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,335円	3,643円	3,811円
g. 分配金	222,453,648円	220,301,275円	218,871,771円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円

## ○分配金のお知らせ

	第92期	第93期	第94期
1万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月13日～2021年7月12日)

項目	第92期～第94期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 41	% 0.376	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
( 投信会社 )	(15)	(0.142)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
( 販売会社 )	(23)	(0.207)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理および事務手続き等
( 受託会社 )	( 3 )	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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 )	(0.000)	
( 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	0.001	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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) その他の費用	1	0.006	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
( 保管費用 )	( 0 )	(0.002)	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 )	( 0 )	(0.001)	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
( その他の )	( 0 )	(0.003)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	42	0.384	
作成期間の平均基準価額は、10,900円です。			

\*作成期間の費用（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。

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

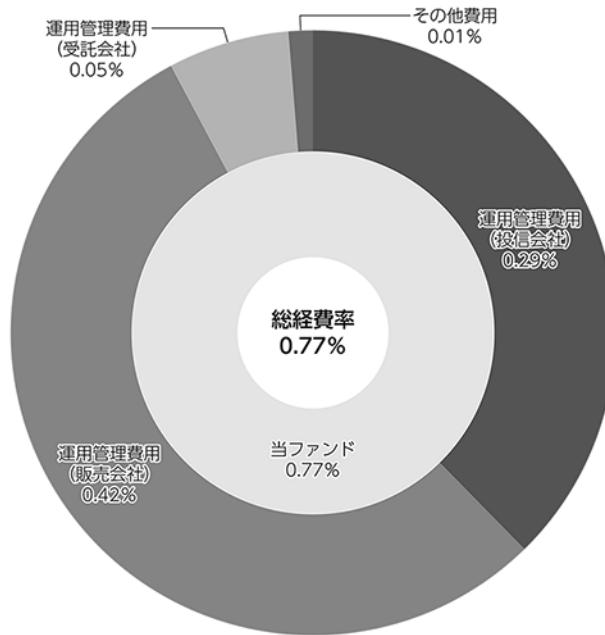
\*売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\*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）を作成期間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おります。

## (参考情報)

### ○総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.77%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、売買委託手数料及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、マザーファンド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。

(2021年1月13日～2021年7月12日)

## ○売買及び取引の状況

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第92期～第94期			
	設定期		解約	
	口数	金額	口数	金額
国内株式マザーファンド	千口 120,275	千円 242,472	千口 281,756	千円 562,384
外国債券マザーファンド	1,087,856	2,714,678	879,418	2,203,240
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	18,118	66,143	842,923	3,179,007
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,194,857	1,582,355	608,459	807,113
J-REITインデックスマザーファンド	15,012	38,953	418,438	1,080,628
海外REITインデックスマザーファンド	8,771	21,799	512,043	1,314,148

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2021年1月13日～2021年7月12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	第92期～第94期	
	国内株式 マザーファンド	外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	132,049,443千円	85,842,326千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	396,252,870千円	901,771,417千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.33	0.09

\*(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

(2021年1月13日～2021年7月12日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村世界6資産分散投信（分配コース）&gt;

該当事項はございません。

&lt;国内株式マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 31,781	百万円 254	% 0.8	百万円 100,267	百万円 0.189249	% 0.0
貸付有価証券(株式)	27,476	1,448	5.3	28,423	1,650	5.8

平均保有割合 1.5%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

\*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

## &lt;外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 132,788	百万円 1,117	% 0.8	百万円 56,917	百万円 149	% 0.3

平均保有割合 3.1%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 42,714	百万円 68	% 0.2	百万円 44,615	百万円 101	% 0.2

平均保有割合 10.1%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 3,643	百万円 151	% 4.1	百万円 4,736	百万円 85	% 1.8

平均保有割合 13.5%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,756	百万円 27	% 0.7	百万円 3,241	百万円 27	% 0.8

平均保有割合 16.2%

## 利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式マザーファンド>

種類	第92期～第94期		
	買付額	売付額	第94期末保有額
株式	百万円 67	百万円 496	百万円 1,211

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

### <国内株式マザーファンド>

種類	第92期～第94期	
	買付額	
株式	百万円 19	

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	第92期～第94期
売買委託手数料総額 (A)	632千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B) / (A)	0.6%

\*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2021年7月12日現在)

### 親投資信託残高

銘柄	第91期末		第94期末	
	口数	口数	評価額	千円
国内株式マザーファンド	千口 3,119,351	千口 2,957,870		6,047,662
外国債券マザーファンド	23,475,430	23,683,868		60,393,864
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5,211,872	4,387,068		18,205,893
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17,525,854	18,112,252		24,132,765
J-REITインデックス マザーファンド	2,532,941	2,129,516		6,104,470
海外REITインデックス マザーファンド	2,608,435	2,105,163		6,154,865

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(2021年7月12日現在)

## ○投資信託財産の構成

項目	第94期末	
	評価額	比率
国内株式マザーファンド	千円 6,047,662	% 5.0
外国債券マザーファンド	60,393,864	49.7
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	18,205,893	15.0
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	24,132,765	19.8
J-REITインデックス マザーファンド	6,104,470	5.0
海外REITインデックス マザーファンド	6,154,865	5.1
コール・ローン等、その他	568,104	0.4
投資信託財産総額	121,607,623	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券マザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（596,369,302千円）の投資信託財産総額（817,933,820千円）に対する比率は72.9%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（1,052,450,585千円）の投資信託財産総額（1,053,875,738千円）に対する比率は99.9%です。

\*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（42,161,817千円）の投資信託財産総額（42,290,569千円）に対する比率は99.7%です。

\*外貨建て資産は、第94期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=110.17円、1カナダドル=88.44円、1英ポンド=153.11円、1スイスフラン=120.51円、1スウェーデンクローナ=12.85円、1ノルウェークローネ=12.69円、1デンマーククローネ=17.59円、1ユーロ=130.82円、1ズロチ=28.7664円、1香港ドル=14.18円、1シンガポールドル=81.53円、1リングギ=26.3269円、1ウォン=0.0962円、1豪ドル=82.37円、1ニュージーランドドル=76.99円、1新シェケル=33.6225円、1メキシコペソ=5.5418円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第92期末	第93期末	第94期末
	2021年3月10日現在	2021年5月10日現在	2021年7月12日現在
(A) 資産	円	円	円
コール・ローン等	118,329,965,106	120,439,319,591	121,607,623,587
国内株式マザーファンド(評価額)	183,353,161	530,948,954	203,495,756
外国債券マザーファンド(評価額)	5,975,837,282	6,035,877,929	6,047,662,445
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	58,926,254,363	59,783,215,674	60,393,864,402
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	17,917,527,325	17,995,593,098	18,205,893,742
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	23,315,850,188	23,799,308,656	24,132,765,322
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	5,693,254,216	5,950,864,518	6,104,470,654
未収入金	5,916,270,332	5,981,561,438	6,154,865,995
未収入金	401,618,239	361,949,324	364,605,271
(B) 負債	円	円	円
未払収益分配金	530,886,140	526,813,854	516,728,717
未払解約金	328,957,114	326,335,828	324,157,034
未払信託報酬	62,590,337	48,650,268	34,165,952
未払利息	138,935,932	151,388,703	157,947,796
その他未払費用	64	264	142
その他未払費用	402,693	438,791	457,793
(C) 純資産総額(A-B)	117,799,078,966	119,912,505,737	121,090,894,870
元本	109,652,371,364	108,778,609,646	108,052,344,782
次期繰越損益金	8,146,707,602	11,133,896,091	13,038,550,088
(D) 受益権総口数	109,652,371,364口	108,778,609,646口	108,052,344,782口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,743円	11,024円	11,207円

(注) 第92期首元本額は110,865,340,541円、第92～94期中追加設定元本額は1,449,173,711円、第92～94期中一部解約元本額は4,262,169,470円、1口当たり純資産額は、第92期1,0743円、第93期1,1024円、第94期1,1207円です。

## ○損益の状況

項 目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
(A) 配当等収益 支払利息	△ 3,859 △ 3,859	△ 4,130 △ 4,130	△ 6,944 △ 6,944
(B) 有価証券売買損益 売買益 売買損	2,668,093,009 2,830,950,622 △ 162,857,613	3,524,371,168 3,549,818,749 △ 25,447,581	2,458,037,956 2,479,290,937 △ 21,252,981
(C) 信託報酬等	△ 139,338,625	△ 151,827,494	△ 158,405,589
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,528,750,525	3,372,539,544	2,299,625,423
(E) 前期繰越損益金	9,229,265,536	11,293,419,169	14,177,791,985
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額) (売買損益相当額)	△ 3,282,351,345 ( 4,958,602,096) (△ 8,240,953,441)	△ 3,205,726,794 ( 4,964,493,411) (△ 8,170,220,205)	△ 3,114,710,286 ( 4,998,435,704) (△ 8,113,145,990)
(G) 計(D+E+F)	8,475,664,716	11,460,231,919	13,362,707,122
(H) 収益分配金 次期繰越損益金(G+H) 追加信託差損益金 (配当等相当額) (売買損益相当額) 分配準備積立金	△ 328,957,114 8,146,707,602 △ 3,282,351,345 ( 4,959,444,880) (△ 8,241,796,225) 11,429,058,947	△ 326,335,828 11,133,896,091 △ 3,205,726,794 ( 4,965,495,848) (△ 8,171,222,642) 14,339,622,885	△ 324,157,034 13,038,550,088 △ 3,114,710,286 ( 4,999,316,612) (△ 8,114,026,898) 16,153,260,374

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

\*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。

\*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、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程(2021年1月13日～2021年7月12日)は以下の通りです。

項 目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	377,675,333円	461,273,387円	414,098,268円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	2,151,075,192円	2,911,266,157円	1,885,527,155円
c. 信託約款に定める収益調整金	4,959,444,880円	4,965,495,848円	4,999,316,612円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	9,229,265,536円	11,293,419,169円	14,177,791,985円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	16,717,460,941円	19,631,454,561円	21,476,734,020円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,524円	1,804円	1,987円
g. 分配金	328,957,114円	326,335,828円	324,157,034円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円

## ○分配金のお知らせ

	第92期	第93期	第94期
1万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月13日～2021年7月12日)

項目	第92期～第94期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 63	% 0.415	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
( 投信会社 )	(24)	(0.158)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
( 販売会社 )	(35)	(0.229)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内のファンドの管理および事務手続き等
( 受託会社 )	( 4 )	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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 )	(0.000)	
( 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	0.001	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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 )	(0.001)	
( 投資信託証券 )	( 0 )	(0.000)	
(d) その他の費用	1	0.005	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
( 保管費用 )	( 0 )	(0.001)	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 )	( 0 )	(0.002)	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 )	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	64	0.422	
作成期間の平均基準価額は、15,196円です。			

\*作成期間の費用（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。

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

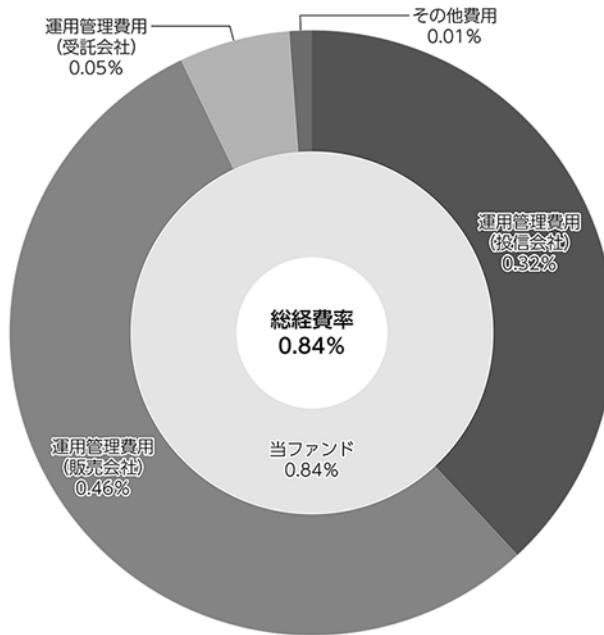
\*売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

\*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）を作成期間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

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を作成期中の平均受益権口数に作成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0.84%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、売買委託手数料及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、マザーファンド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。

(2021年1月13日～2021年7月12日)

## ○売買及び取引の状況

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第92期～第94期			
	設定期		解約	
	口数	金額	口数	金額
千円	千円	千円	千円	千円
国内株式マザーファンド	460,095	919,609	337,943	671,903
外国債券マザーファンド	189,430	473,029	58,269	145,159
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	57,065	218,271	466,098	1,758,487
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	425,706	563,564	101,559	134,643
J-REITインデックスマザーファンド	18,560	49,298	104,703	268,307
海外REITインデックスマザーファンド	11,991	31,546	133,055	340,560

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2021年1月13日～2021年7月12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	第92期～第94期	
	国内株式 マザーファンド	外国株式 MSCI-KOKUSAI マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	132,049,443千円	85,842,326千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	396,252,870千円	901,771,417千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.33	0.09

\*(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

(2021年1月13日～2021年7月12日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村世界6資産分散投信（成長コース）&gt;

該当事項はございません。

&lt;国内株式マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 31,781	百万円 254	% 0.8	百万円 100,267	百万円 0.189249	% 0.0
貸付有価証券(株式)	27,476	1,448	5.3	28,423	1,650	5.8

平均保有割合 3.7%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

\*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

## &lt;外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド&gt;

該当事項はございません。

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 132,788	百万円 1,117	% 0.8	百万円 56,917	百万円 149	% 0.3

平均保有割合 0.6%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 42,714	百万円 68	% 0.2	百万円 44,615	百万円 101	% 0.2

平均保有割合 0.7%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 3,643	百万円 151	% 4.1	百万円 4,736	百万円 85	% 1.8

平均保有割合 4.8%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区分	第92期～第94期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,756	百万円 27	% 0.7	百万円 3,241	百万円 27	% 0.8

平均保有割合 5.8%

## 利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式マザーファンド>

種類	第92期～第94期		
	買付額	売付額	第94期末保有額
株式	百万円 67	百万円 496	百万円 1,211

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

### <国内株式マザーファンド>

種類	第92期～第94期	
	買付額	
株式	百万円 19	

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	第92期～第94期
売買委託手数料総額 (A)	376千円
うち利害関係人への支払額 (B)	5千円
(B) / (A)	1.3%

\*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2021年7月12日現在)

### 親投資信託残高

銘柄	第91期末		第94期末	
	口数	口数	評価額	千円
国内株式マザーファンド	千口 7,505,379	千口 7,627,530	15,595,249	
外国債券マザーファンド	1,613,815	1,744,975	4,449,688	
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,180,044	3,771,012	15,649,323	
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	3,012,031	3,336,178	4,445,123	
J-REITインデックス マザーファンド	870,633	784,490	2,248,820	
海外REITインデックス マザーファンド	896,583	775,519	2,267,385	

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(2021年7月12日現在)

## ○投資信託財産の構成

項目	第94期末	
	評価額	比率
国内株式マザーファンド	15,595,249	34.8%
外国債券マザーファンド	4,449,688	9.9
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	15,649,323	34.9
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	4,445,123	9.9
J-REITインデックス マザーファンド	2,248,820	5.0
海外REITインデックス マザーファンド	2,267,385	5.1
コール・ローン等、その他	191,245	0.4
投資信託財産総額	44,846,833	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券マザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（596,369,302千円）の投資信託財産総額（817,933,820千円）に対する比率は72.9%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（1,052,450,585千円）の投資信託財産総額（1,053,875,738千円）に対する比率は99.9%です。

\*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第94期末における外貨建て純資産（42,161,817千円）の投資信託財産総額（42,290,569千円）に対する比率は99.7%です。

\*外貨建て資産は、第94期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=110.17円、1カナダドル=88.44円、1英ポンド=153.11円、1スイスフラン=120.51円、1スウェーデンクローナ=12.85円、1ノルウェークローネ=12.69円、1デンマーククローネ=17.59円、1ユーロ=130.82円、1ズロチ=28.7664円、1香港ドル=14.18円、1シンガポールドル=81.53円、1リングギ=26.3269円、1ウォン=0.0962円、1豪ドル=82.37円、1ニュージーランドドル=76.99円、1新シェケル=33.6225円、1メキシコペソ=5.5418円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第92期末	第93期末	第94期末
	2021年3月10日現在	2021年5月10日現在	2021年7月12日現在
(A) 資産	円	円	円
コール・ローン等	41,811,620,933	43,743,910,869	44,846,833,713
国内株式マザーファンド(評価額)	81,611,479	161,287,420	104,580,322
外国債券マザーファンド(評価額)	14,665,935,897	15,474,476,116	15,595,249,716
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	4,131,948,755	4,301,030,683	4,449,688,251
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	14,657,248,564	15,126,778,314	15,649,323,238
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	4,087,319,947	4,291,516,691	4,445,123,671
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	1,996,003,130	2,143,796,866	2,248,820,848
未収入金	2,074,246,818	2,154,854,016	2,267,385,508
(B) 負債			
未払収益分配金	117,306,343	90,170,763	86,662,159
未払解約金	181,235,888	192,201,761	174,457,662
未払信託報酬	83,802,286	83,609,779	83,972,941
未払利息	43,529,205	48,427,767	26,929,599
その他未払費用	53,692,445	59,927,598	63,305,182
(C) 純資産総額(A-B)	28	80	73
元本	211,924	236,537	249,867
次期繰越損益金	41,630,385,045	43,551,709,108	44,672,376,051
(D) 受益権総口数	27,934,095,612口	27,869,926,475口	27,990,980,572口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,903円	15,627円	15,960円

(注) 第92期首元本額は28,431,626,171円、第92~94期中追加設定元本額は1,263,665,122円、第92~94期中一部解約元本額は1,704,310,721円、1口当たり純資産額は、第92期1,4903円、第93期1,5627円、第94期1,5960円です。

## ○損益の状況

項 目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
(A) 配当等収益	円	円	円
支払利息	△ 2,044	△ 1,916	△ 3,039
(B) 有価証券売買損益			
売買益	△ 2,044	△ 1,916	△ 3,039
売買損	1,668,936,340	2,144,281,994	1,074,834,152
(C) 信託報酬等			
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,718,801,464	2,166,751,431	1,088,495,605
(E) 前期繰越損益金	△ 49,865,124	△ 22,469,437	△ 13,661,453
(F) 追加信託差損益金	△ 53,904,369	△ 60,164,135	△ 63,555,049
(G) 計(D+E+F)	1,615,029,927	2,084,115,943	1,011,276,064
(H) 収益分配金	8,517,634,846	9,881,119,050	11,747,100,239
次期繰越損益金(G+H)	3,647,426,946	3,800,157,419	4,006,992,117
追加信託差損益金	( 8,998,840,936)	( 9,123,336,707)	( 9,350,878,134)
(配当等相当額)	(△ 5,351,413,990)	(△ 5,323,179,288)	(△ 5,343,886,017)
(売買損益相当額)	13,780,091,719	15,765,392,412	16,765,368,420
分配準備積立金	△ 83,802,286	△ 83,609,779	△ 83,972,941
分配準備積立金	13,696,289,433	15,681,782,633	16,681,395,479
(配当等相当額)	3,647,426,946	3,800,157,419	4,006,992,117
(売買損益相当額)	( 8,999,349,035)	( 9,125,109,780)	( 9,351,665,366)
分配準備積立金	(△ 5,351,922,089)	(△ 5,324,952,361)	(△ 5,344,673,249)
	10,048,862,487	11,881,625,214	12,674,403,362

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

\*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。

\*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、追加設定をした額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) 分配金の計算過程（2021年1月13日～2021年7月12日）は以下の通りです。

項 目	第92期	第93期	第94期
	2021年1月13日～ 2021年3月10日	2021年3月11日～ 2021年5月10日	2021年5月11日～ 2021年7月12日
a. 配当等収益(経費控除後)	87,223,468円	220,334,608円	120,775,953円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,527,806,459円	1,863,781,335円	890,500,111円
c. 信託約款に定める収益調整金	8,999,349,035円	9,125,109,780円	9,351,665,366円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	8,517,634,846円	9,881,119,050円	11,747,100,239円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	19,132,013,808円	21,090,344,773円	22,110,041,669円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	6,848円	7,567円	7,898円
g. 分配金	83,802,286円	83,609,779円	83,972,941円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円

## ○分配金のお知らせ

	第92期	第93期	第94期
1万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

### 〈マザーファンドの対象指数について〉

- \* NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。
- \* 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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
- \* TOPIXの指数值及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数值の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は「野村世界6資産分散投信」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- \* MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドについていかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。  
請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。
- \* 東証REIT指数の指数值及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数值の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は「野村世界6資産分散投信」の発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- \* 「S & P先進国REIT指数（除く日本）」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービシーズ エルエル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に關しいかなる意思表明等を行なうものではありません。

# 国内株式マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2021年5月10日）

作成対象期間（2020年5月12日～2021年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	ベンチマーク指標					株組入式率	株先物比率	純資産額
		東証( T 0 P I X )	期騰落率	中騰落率	一騰落率	ク数			
16期(2017年5月10日)	円 15,104		% 21.4		% 18.7		% 98.6	% 1.4	百万円 335,246
17期(2018年5月10日)	17,299		14.5	1,777.62	12.1		98.4	1.6	379,913
18期(2019年5月10日)	15,442		△10.7	1,549.42	△12.8		97.9	2.1	394,025
19期(2020年5月11日)	15,150		△ 1.9	1,480.62	△ 4.4		97.5	2.5	423,056
20期(2021年5月10日)	20,400		34.7	1,952.27	31.9		97.5	2.5	385,597

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。  
東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	ベンチマーク指標					株組入式率	株先物比率
		東証( T 0 P I X )	騰落率	騰落率	騰落率	ク数		
(期首) 2020年5月11日	円 15,150		% —		% —		% 97.5	% 2.5
5月末	15,997		5.6	1,563.67	5.6		96.8	2.1
6月末	15,971		5.4	1,558.77	5.3		97.4	2.6
7月末	15,330		1.2	1,496.06	1.0		97.5	2.5
8月末	16,582		9.5	1,618.18	9.3		98.1	1.1
9月末	16,796		10.9	1,625.49	9.8		97.8	2.0
10月末	16,320		7.7	1,579.33	6.7		98.2	1.8
11月末	18,142		19.7	1,754.92	18.5		96.8	2.0
12月末	18,680		23.3	1,804.68	21.9		98.0	1.9
2021年1月末	18,723		23.6	1,808.78	22.2		98.0	2.0
2月末	19,310		27.5	1,864.49	25.9		97.3	2.3
3月末	20,408		34.7	1,954.00	32.0		97.0	2.8
4月末	19,832		30.9	1,898.24	28.2		97.8	2.2
(期末) 2021年5月10日	20,400		34.7	1,952.27	31.9		97.5	2.5

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

国内株式市場は、期首より新型コロナウイルスのワクチン開発報道が相次いだことや国内外の経済活動再開による景気回復期待が高まったことなどから上昇しましたが、米中対立が再度激化するとの懸念が高まったことなどで下落しました。その後、新型コロナウイルスのワクチン供給への期待感、欧米での新型コロナウイルス感染再拡大による景気減速懸念や米大統領選挙をめぐる不透明感などから、一進一退の展開となりました。

2020年11月以降は、米国大統領選挙の結果を受けて政治的な不透明感が和らぎ米国株式市場が上昇したことや、新型コロナウイルスのワクチン開発進展を受けて早期のワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどから上昇しました。2021年3月下旬以降は、新型コロナウイルス感染再拡大による景気減速懸念などから軟調な展開となりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指すため、現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数（TOPIX）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ないました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。

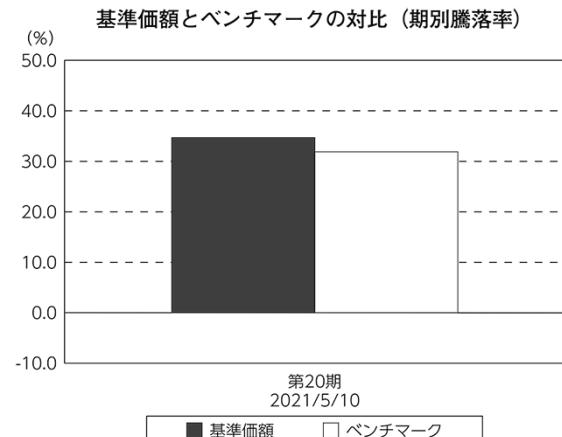
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+34.7%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の+31.9%を2.8ポイント上回りました。

### （プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには配当金が計上されたこと



(注) ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021年5月10日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 ( 株 式 ) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.001 (0.000) (0.001)	(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
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、17,674円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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5月12日～2021年5月10日)

## 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国 内	上場	千株 11,104 (△20,554)	千円 26,007,918 (—)	千株 75,960	千円 177,635,945

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）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 —

\*（ ）内は権利割当、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 92,148	百万円 95,233	百万円 —	百万円 —

\* 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2020年5月12日～2021年5月10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	203,643,863千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	420,655,377千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.48

\* (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5月12日～2021年5月10日)

### 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 26,007	百万円 687	% 2.6	百万円 177,635	百万円 9	% 0.0
貸付有価証券(株式)	98,488	4,429	4.5	113,098	6,010	5.3

\* 貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

### 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 46	百万円 755	百万円 1,225

### 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種類	買付額
株式	百万円 19

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額 (A)	5,668千円
うち利害関係人への支払額 (B)	292千円
(B) / (A)	5.2%

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野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2021年5月10日現在)

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	9.4	6.2	18,631
日本水産	269	176.8	95,472
マルハニチロ	38.9	29.8	79,327
雪国まいたけ	—	15.6	30,794
カネコ種苗	8.1	5.8	9,123
サカタのタネ	32.1	22.7	86,827
ホクト	20.5	16	32,480
ホクリヨウ	4.2	2.9	2,096
<b>鉱業 (0.2%)</b>			
住石ホールディングス	54.3	33.3	4,329
日鉄鉱業	6.2	4.4	30,316
三井松島ホールディングス	10.4	8	7,920
I N P E X	1,079.2	700.1	569,181
石油資源開発	35.1	24.9	55,726
K&Oエナジーグループ	13.1	9.2	13,312
<b>建設業 (2.4%)</b>			
ヒノキヤグループ	6.7	4.7	12,177
ショーボンドホールディングス	41.9	27.2	126,752
ミライ特・ホールディングス	79.9	66	119,592
タマホーム	14.5	11.5	28,485
サンヨーホームズ	2.3	2.2	1,685
日本アクリア	10.7	7.6	4,704
ファーストコーポレーション	8.2	5.8	4,518
ベステラ	4.6	3.6	5,929
R o b o t H o m e	55.5	35.7	6,247
キャンディル	4.5	3.3	1,785
スペースバリューホールディングス	32.8	23.2	17,864
ダイセキ環境ソリューション	5.2	3.7	3,614
第一カッター興業	3.3	4.7	6,655
明豊ファシリティワークス	8.6	—	—
安藤・間	160.2	122.1	105,128
東急建設	78.8	55.8	32,643
コムシスホールディングス	95.4	67.5	241,650
ビーアールホールディングス	29.3	25.5	14,713

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
	千株	千株	千円
高松コンストラクショングループ	16.7	11.8	24,496
東建コーポレーション	8.3	5.9	58,587
ソネック	2.8	2	1,872
ヤマウラ	11.7	8.3	7,669
オリエンタル白石	—	64	19,200
大成建設	207.1	136.8	578,664
大林組	621.2	439.6	457,623
清水建設	630.4	411.8	385,033
飛島建設	17.8	12.6	14,301
長谷工コーポレーション	240.5	144	221,184
松井建設	24.4	17.3	12,559
鈴高組	2.7	1.9	8,607
鹿島建設	487.7	322.1	509,884
不動テトラ	16.2	10.8	20,595
大末建設	7.2	5.5	5,357
鉄建建設	13.5	8.9	16,625
西松建設	47.9	31.5	92,736
三井住友建設	150.1	106.2	51,613
大豊建設	13.9	9.6	38,256
前田建設工業	155.6	110.1	108,008
佐田建設	13.4	10.1	4,403
ナカノフード建設	17	10.5	4,042
奥村組	33.7	24.2	67,348
東鉄工業	26.6	18.9	49,196
イチケン	4.5	3.2	6,188
富士ピー・エス	9.2	5.7	3,368
淺沼組	7	5.3	24,035
戸田建設	258	182.6	148,088
熊谷組	28.8	20.4	64,056
北野建設	3.8	2.7	6,534
植木組	2.7	3.9	6,009
矢作建設工業	27.4	19.4	15,558
ビーエス三菱	20.4	14.5	9,584
日本ハウスホールディングス	42.4	30	9,990
大東建託	67.8	48	558,240

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
新日本建設	26.4	18.7	16,194	
NIPPO	51.4	36.4	106,069	
東亜道路工業	3.9	2.7	12,136	
前田道路	54.8	27.2	59,649	
日本道路	6	4.2	33,726	
東亜建設工業	19.4	11.7	29,097	
日本国土開発	60.4	42.8	26,022	
若築建設	11.2	7.9	10,301	
東洋建設	69.6	49.3	29,234	
五洋建設	246.3	186.7	164,856	
世紀東急工業	29.8	21.1	18,757	
福田組	7.2	5.1	25,423	
住友林業	157.3	103.4	253,330	
日本基礎技術	20.9	13.4	6,954	
巴コーポレーション	27.6	19.5	7,605	
大和ハウス工業	614.6	406	1,388,926	
ライト工業	35.5	25.2	45,309	
積水ハウス	679.6	476.8	1,105,222	
日特建設	16.2	11.5	9,211	
北陸電気工事	10.7	7.6	8,664	
ユアテック	35.5	25.1	19,904	
日本リーテック	13	9.2	16,615	
四電工	3.4	2.4	7,908	
中電工	25	20.2	47,853	
関電工	88.4	71.5	68,282	
きんでん	147.6	89.3	165,562	
東京エネシス	20.6	14.6	14,162	
トーエネット	6.2	4.4	16,918	
住友電設	17.5	12.4	29,003	
日本電設工業	34.1	24.1	43,404	
協和エクシオ	94.2	66.7	199,766	
新日本空調	16.4	11.6	26,134	
九電工	43.6	30.8	117,348	
三機工業	44.8	31.2	44,085	
日揮ホールディングス	191.2	146.7	190,269	
中外炉工業	6.7	4.8	10,401	
ヤマト	19.9	14.1	9,841	
太平電業	15	9.7	26,228	
高砂熱学工業	54	39.7	67,291	
三晃金属工業	2.7	1.7	4,562	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
朝日工業社	4.2	3.3	9,619	
明星工業	40.2	28.4	22,521	
大氣社	30.2	21.4	64,521	
ダイダン	14.8	9.8	27,371	
日比谷総合設備	20	14.1	27,142	
フィル・カンパニー	3.6	2.5	7,587	
テスホールディングス	—	9.1	17,117	
O S J B ホールディングス	97.9	—	—	
レイズネクスト	33.3	23.6	28,367	
食料品(3.3%)				
ニッポン	58.2	41.2	66,332	
日清製粉グループ本社	224.6	159	293,196	
日東富士製粉	1.4	1	7,180	
昭和産業	18.2	11.8	35,695	
鳥越製粉	17.6	12.5	10,225	
中部飼料	24.3	17.2	24,252	
フィード・ワン	133.5	18.9	16,726	
東洋精糖	3.4	2.4	2,906	
日本甜菜製糖	10.4	7.3	11,928	
DM三井製糖ホールディングス	17.4	11.1	20,634	
塩水港精糖	21.5	16.8	3,981	
日新製糖	9.4	6.7	12,026	
森永製菓	46.7	33	123,750	
中村屋	5.1	3.4	13,090	
江崎グリコ	58.9	38.7	164,281	
名糖産業	9.6	6.2	9,479	
井村屋グループ	11.3	8	20,008	
不二家	11.1	9	19,620	
山崎製パン	149	105.5	185,152	
第一屋製パン	3.4	2.7	2,589	
モロゾフ	3.4	2.2	11,770	
亀田製菓	11.3	8	37,440	
寿スピリッツ	19.1	13.5	87,615	
カルビー	90.6	64.1	171,531	
森永乳業	36.8	26	163,280	
六甲バター	13.2	9.3	15,168	
ヤクルト本社	136.7	96.8	537,240	
明治ホールディングス	131.5	93	644,490	
雪印メグミルク	47.9	33.9	77,325	
ブリマハム	31.1	19.8	66,231	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日本ハム	76	53.8	259,854	
林兼産業	6.6	4.7	2,979	
丸大食品	21.2	13.8	23,749	
S Foods	15.9	12.6	41,769	
柿安本店	6.9	4.9	12,558	
伊藤ハム米久ホールディングス	128	90.6	66,409	
サッポロホールディングス	67.8	48	107,520	
アサヒグループホールディングス	416.4	307.4	1,457,383	
キリンホールディングス	843.1	596.7	1,242,329	
宝ホールディングス	147.4	104.3	153,529	
オエノンホールディングス	52.4	40	15,720	
養命酒製造	6.1	4.3	7,993	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	139.5	107.7	197,198	
サントリー食品インターナショナル	133	94.1	355,227	
ダイドーグループホールディングス	10.2	7.9	41,475	
伊藤園	60.4	42.7	266,448	
キーコーヒー	19.5	13.8	28,828	
ユニカフェ	5.1	4.2	4,221	
ジャパンフーズ	2.8	2	2,418	
日清オイリオグループ	25.6	18.1	56,743	
不二製油グループ本社	48.5	34.3	97,480	
かどや製油	2.2	1.5	6,240	
J-オイルミルズ	10.3	13.1	24,772	
キッコーマン	143.1	101.3	700,996	
味の素	439	334.6	777,108	
ブルドックソース	—	6.4	14,886	
キユーピー	110.7	78.3	203,893	
ハウス食品グループ本社	74.4	52.6	183,837	
カゴメ	75.4	57.5	184,862	
焼津水産化学工業	9.6	6.8	6,704	
アリアケジャパン	18.2	12.9	86,172	
ピエトロ	2.6	1.8	3,204	
エバラ食品工業	4.8	3.1	8,298	
やまみ	1.7	1.5	3,214	
ニチレイ	94.7	67	189,208	
東洋水産	102.3	72.4	329,782	
イートアンドホールディングス	6.9	4.9	9,074	
大冷	2.6	1.6	3,118	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11	7.9	6,525	
日清食品ホールディングス	84.5	55.2	436,080	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
永谷園ホールディングス	9.7	6.9	15,752	
一正蒲鉾	7.7	5.5	6,968	
フジッコ	21.5	15.2	29,518	
ロック・フィールド	21.4	15.2	24,000	
日本たばこ産業	1,148	754.4	1,620,074	
ケンコーマヨネーズ	11.1	8.6	15,342	
わらべや日洋ホールディングス	13	9.2	18,712	
なとり	11.1	7.9	15,254	
イフジ産業	3.5	2.2	2,081	
ピックルスコーポレーション	4.3	3.4	11,475	
ファーマフーズ	—	13.3	44,355	
北の達人コーポレーション	69.4	49.1	24,157	
ユーグレナ	85.7	71.7	65,892	
紀文食品	—	6.9	11,253	
ミヨシ油脂	7.6	4.9	6,027	
理研ビタミン	18.8	13.3	18,753	
繊維製品 (0.5%)				
片倉工業	28.2	18.4	26,900	
グンゼ	14.2	10.1	40,955	
東洋紡	76.7	54.3	78,897	
ユニチカ	56.8	40.2	16,080	
富士紡ホールディングス	9.4	6.6	29,964	
倉敷紡績	19.2	12.6	23,814	
シキボウ	10.2	7.7	7,384	
日本毛織	63.8	45.2	45,742	
ダイトウボウ	31.4	22.2	2,419	
トーア紡コーポレーション	7.7	5.4	2,484	
ダイドーリミテッド	25.5	18	3,240	
帝国繊維	21.8	15.5	32,612	
帝人	158.3	129.2	242,379	
東レ	1,404.7	994.1	703,922	
サカイオーベックス	5.1	3.6	11,088	
住江織物	4.3	3	5,988	
日本フエルト	11	7.8	3,424	
イチカワ	2.7	1.8	2,401	
日東製綱	2.2	1.5	2,322	
アツギ	16	10.6	6,805	
ダイニック	7.3	5.2	4,232	
セーレン	47.7	33.8	66,450	
ソト一	7.7	5.5	4,400	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
東海染工	2.7	1.7	1,912	
小松マテーレ	31.8	22.5	20,857	
ワコールホールディングス	50.6	34.3	89,248	
ホギメディカル	22.1	18.5	61,975	
レナウン	49.8	—	—	
クラウディアホールディングス	4.8	3.4	972	
T S I ホールディングス	65.1	41.7	14,052	
マツオカコーポレーション	5.6	4.4	8,254	
ワールド	27.5	18	26,262	
三陽商会	10.1	7.1	5,942	
ナイガイ	7.1	5	1,700	
オンワードホールディングス	116.5	82.5	25,245	
ルックホールディングス	6.6	4.7	5,997	
ゴールドワイン	35.2	22.7	153,225	
デサント	37.8	23.4	45,442	
キング	9.1	7.3	3,883	
ヤマトイターナショナル	17	12.1	4,029	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	12.3	8.4	39,606	
王子ホールディングス	811	618.1	470,992	
日本製紙	85.8	60.7	87,772	
三菱製紙	22	19.5	7,078	
北越コーポレーション	115.6	98.2	57,741	
中越パルプ工業	8.2	5.2	6,567	
巴川製紙所	5.8	4.5	3,654	
大王製紙	85.5	66.2	127,501	
阿波製紙	5	3.5	1,515	
レンゴー	183.4	141.6	136,644	
トーモク	11.9	8.4	17,194	
ザ・パック	14.7	10.4	29,452	
化学 (7.4%)				
クラレ	305.5	216.2	270,682	
旭化成	1,285.9	910.1	1,098,945	
共和レザー	10.5	7.5	5,775	
昭和電工	138.1	104.3	382,781	
住友化学	1,425.3	1,080.8	651,722	
住友精化	8.6	6.7	26,063	
日産化学	107.7	75.7	452,686	
ラサ工業	6.8	4.5	10,026	
クレハ	16.6	11.8	93,220	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
多木化学	7.6	5.4	31,806	
ティカ	14.2	10.1	14,412	
石原産業	34.8	24.6	23,074	
片倉コーブアグリ	5	3.5	4,242	
日本曹達	28.7	19.2	64,608	
東ソー	299.9	212.2	432,463	
トクヤマ	55.9	40.8	103,183	
セントラル硝子	39.6	26.2	62,198	
東亞合成	121.8	83.8	104,666	
大阪ソーダ	19.7	14	36,232	
関東電化工業	46	32.6	29,307	
デンカ	70.8	50.1	226,452	
信越化学工業	333.1	253.9	4,716,192	
日本カーバイド工業	6.6	5	6,755	
堺化学工業	12.5	9.6	18,768	
第一稀元素化学工業	21	13.8	19,320	
エア・ウォーター	180.4	140	270,200	
日本酸素ホールディングス	186.4	113.1	241,355	
日本化学工業	6	3.9	11,696	
東邦アセチレン	2.9	2.1	2,692	
日本パーカライジング	97.9	69.3	75,259	
高压ガス工業	30.8	21.8	15,979	
チタン工業	2.4	1.7	3,534	
四国化成工業	29.9	18.2	22,750	
戸田工業	4.5	2.9	6,243	
ステラ ケミファ	10.6	7.5	23,700	
保土谷化学工業	7.2	4	17,880	
日本触媒	30.1	24.9	147,657	
大日精化工業	17.2	11.3	26,848	
カネカ	50.2	35.5	158,507	
三菱瓦斯化学	180.5	137.6	359,824	
三井化学	176.1	118.5	433,710	
J S R	180.8	137.8	463,697	
東京応化工業	33.3	23.6	172,516	
大阪有機化学工業	17.9	12.7	51,879	
三菱ケミカルホールディングス	1,296.9	917.8	797,843	
K H ネオケム	34.2	22.6	61,404	
ダイセル	252.6	184.6	165,401	
住友ペーパーライト	30.5	21.6	100,440	
積水化学工業	417.1	290.4	581,961	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日本ゼオン	175	123.8	216,773	
アイカ工業	58.2	38.2	161,395	
宇部興産	98	69.3	161,676	
積水樹脂	34.9	22.7	49,349	
タキロンシーアイ	42	29.7	20,047	
旭有機材	11	7.8	11,294	
日立化成	89.7	—	—	
ニチバン	10.2	7.2	13,456	
リケンテクノス	48.8	33.5	18,525	
大倉工業	9.2	6.5	12,863	
積水化成品工業	26	18.4	11,021	
群栄化学工業	4.4	3.1	7,517	
タイガースポリマー	10.2	7.2	3,520	
ミライアル	6.8	4.4	5,957	
ダイキアクシス	6.9	5.2	4,747	
ダイキヨーニシカワ	40.9	28.9	22,946	
竹本容器	6.9	4.9	4,914	
森六ホールディングス	10.4	7.4	15,806	
恵和	—	2.7	6,820	
日本化薬	120.1	85	91,375	
カーリットホールディングス	20.7	13.6	9,860	
日本精化	15.6	9.9	14,315	
扶桑化学工業	19.7	10.8	46,224	
トリケミカル研究所	4.3	12.7	46,418	
A D E K A	89.3	63.2	138,028	
日油	73	51.7	317,955	
新日本理化	32.1	22.7	6,514	
ハリマ化成グループ	16	10.2	9,577	
花王	474.3	335.7	2,343,521	
第一工業製薬	7.2	4.7	17,437	
石原ケミカル	5.3	3.5	7,448	
日華化学	6.5	4.6	5,667	
ニイタカ	4	2.8	7,448	
三洋化成工業	11.6	8.2	44,280	
有機合成薬品工業	14.9	10.5	3,066	
大日本塗料	21.9	15.5	13,609	
日本ペイントホールディングス	160.1	566.4	992,899	
関西ペイント	218	154.3	434,200	
神東塗料	15.3	10.8	2,268	
中国塗料	55.2	33.1	33,232	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日本特殊塗料	14.5	10.3	10,938	
藤倉化成	26.2	18.5	10,193	
太陽ホールディングス	14.3	10.1	55,449	
D I C	81.9	58	170,810	
サカタインクス	42.3	30	32,580	
東洋インキ S C ホールディングス	41	29	60,610	
T & K T O K A	15	9.6	7,728	
富士フィルムホールディングス	379.8	246.4	1,795,270	
資生堂	393.6	278.6	2,206,512	
ライオン	257.5	182.3	371,892	
高砂香料工業	12.4	8.8	23,698	
マンダム	44.5	29.4	60,622	
ミルボン	26.5	18.7	108,273	
ファンケル	80.2	51.1	180,894	
コーセー	37.3	26.4	425,568	
コタ	11.4	8.9	13,714	
シーポン	2.6	1.8	3,555	
ポーラ・オルビスホールディングス	84.5	59.8	171,685	
ノエビアホールディングス	16.8	11.9	57,953	
アジュバンコスマジヤバン	4.4	3.1	3,220	
新日本製薬	—	3.8	7,957	
エステー	12.7	9	16,587	
アグロ カネショウ	8.2	5.3	7,870	
コニシ	32.5	23	37,122	
長谷川香料	34.1	24.2	52,828	
星光P M C	11.3	8	6,408	
小林製薬	55.5	39.3	386,319	
荒川化学工業	17.8	11.7	14,894	
メック	13.6	9.6	24,355	
日本高純度化学	5.4	3.8	10,161	
タカラバイオ	51.8	36.7	104,081	
J C U	24	15.8	64,622	
新田ゼラチン	12.4	8.8	5,693	
O A T アグリオ	3.4	2.7	3,831	
デクセリアルズ	51.1	39.2	79,066	
アース製薬	14.9	10.6	66,144	
北興化学工業	20.3	13.1	13,139	
大成ラミック	6.5	4.3	12,104	
クミアイ化学工業	81.9	58	52,142	
日本農薬	35.3	25	14,400	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
アキレス	13.7	9.7	13,754	
有沢製作所	31.3	19.5	18,915	
日東電工	136.7	84.7	764,841	
レック	21.1	16.6	19,538	
三光合成	22.6	14.7	6,629	
きもと	33.7	21.5	5,955	
藤森工業	17.8	12.6	53,046	
前澤化成工業	12.6	8.9	10,128	
未来工業	10.6	5	8,915	
ウェーブロックホールディングス	6.8	4.8	3,532	
J S P	11.6	8.2	14,276	
エフピコ	21.8	25.8	114,294	
天馬	13.2	10.5	24,318	
信越ボリマー	35.6	21.6	23,544	
東リ	49.3	34.9	9,004	
ニフコ	72.7	51.5	198,790	
バルカー	16.1	11.4	24,441	
ユニ・チャーム	381.8	297.2	1,264,288	
ショーエイコーポレーション	2.9	3.1	3,118	
医薬品 (5.2%)				
協和キリン	199.3	141	475,875	
武田薬品工業	1,648.1	1,166.4	4,350,672	
アステラス製薬	1,717.5	1,215.5	2,093,091	
大日本住友製薬	146.8	103.9	203,020	
塩野義製薬	253.3	176.3	1,022,011	
わかもと製薬	23.6	16.7	5,544	
あすか製薬	22.6	—	—	
日本新薬	51.8	39.7	294,177	
ビオフェルミン製薬	3.4	2.4	7,260	
中外製薬	206.5	438.5	1,828,983	
科研製薬	33.9	24	110,160	
エーザイ	237.1	154.9	1,123,025	
ロート製薬	101.7	66.8	191,048	
小野薬品工業	454.9	321.9	927,232	
久光製薬	52.4	40.8	267,648	
持田製薬	27.5	19.5	76,830	
参天製薬	369	244	348,920	
扶桑薬品工業	7	4.5	11,146	
日本ケミファ	2.6	1.7	3,986	
ツムラ	61.4	46.8	174,564	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日医工	56.1	39.7	38,628	
キッセイ薬品工業	35	24.8	56,990	
生化学工業	38.4	24.7	25,688	
榮研化学	34.8	24.6	54,366	
日水製薬	8.3	5.2	5,148	
鳥居薬品	12.4	8.8	22,668	
J C R フィーマ	14	39.5	120,870	
東和薬品	25.3	20.2	46,904	
富士製薬工業	13.5	8.6	10,526	
沢井製薬	40.7	—	—	
ゼリア新薬工業	35.9	25.4	51,079	
第一三共	566.8	1,203.5	3,517,228	
キョーリン製薬ホールディングス	43.7	30.9	58,957	
大幸薬品	24.2	17.2	17,870	
ダイト	11.9	9	31,230	
大塚ホールディングス	377.4	291.4	1,277,497	
大正製薬ホールディングス	41.9	33.4	226,118	
ペプチドリーム	100.7	72.3	352,101	
あすか製薬ホールディングス	—	16	22,112	
サワイグループホールディングス	—	30.7	163,631	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コーカス工業	167.3	118.4	13,024	
ニチ雷キ	23.4	16.5	23,331	
ユシロ化学工業	11.1	7.9	9,085	
ビービー・カストロール	7.1	5	7,010	
富士石油	52.9	34	8,330	
M O R E S C O	7.2	5.1	5,630	
出光興産	219.8	155.6	436,924	
E N E O S ホールディングス	2,979.9	2,108.9	1,070,266	
コスモエネルギーホールディングス	57.3	44.3	115,312	
ゴム製品 (0.6%)				
横浜ゴム	114.7	81.2	173,199	
T O Y O T I R E	113.7	73.8	154,684	
ブリヂストン	570.6	372.8	1,725,318	
住友ゴム工業	177.9	125.9	177,267	
藤倉コンポジット	17.3	12.2	6,014	
オカモト	12.1	8.5	34,595	
フコク	8.7	6.1	4,819	
ニッタ	22.3	14.5	39,353	
住友理工	38.4	27.2	20,264	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
三ツ星ベルト	26.1	17	29,376	
パンドー化学	34.8	24.7	18,623	
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>				
日東紡績	29.5	20.9	84,122	
A G C	195.8	128.7	673,101	
日本板硝子	94.8	71.1	54,818	
石塚硝子	3.6	2.4	4,675	
日本山村硝子	8.2	5.8	5,643	
日本電気硝子	79.6	52	145,288	
オハラ	7.8	5.5	8,662	
住友大阪セメント	37.5	25.2	92,610	
太平洋セメント	125.1	83	241,696	
日本ヒューム	19.9	12.8	9,331	
日本コンクリート工業	42.6	30.2	12,261	
三谷セキサン	9.2	6.5	26,617	
アジアパイルホールディングス	28.1	21.6	11,296	
東海カーボン	207.5	137.1	262,683	
日本カーボン	10.2	7.7	38,461	
東洋炭素	11.6	8.2	18,646	
ノリタケカンパニーリミテド	11	7.8	29,523	
T O T O	141.5	100.1	583,583	
日本碍子	237.8	154.3	315,543	
日本特殊陶業	150.7	106.6	182,072	
ダントーホールディングス	14.8	10.4	3,369	
MARUWA	7.6	4.8	54,432	
品川リフラクトリーズ	5.2	3.3	10,857	
黒崎播磨	3.9	2.4	11,400	
ヨータイ	15.7	10	11,060	
イソライト工業	10.2	6.2	4,092	
東京窯業	25.2	17.8	5,891	
ニッカトー	9	6.3	4,624	
フジミインコーポレーテッド	17.6	11.2	52,136	
クニミネ工業	8	4.4	5,341	
エーアンドエーマテリアル	3.3	2.7	2,748	
ニチアス	54.2	35.4	106,093	
ニチハ	27.5	19.5	63,667	
<b>鉄鋼 (0.9%)</b>				
日本製鉄	876.6	661.8	1,509,565	
神戸製鋼所	358.5	253.7	231,374	
中山製鋼所	27.2	19.2	9,388	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
合同製鐵	10.5	7.5	14,265	
ジェイ エフ イー ホールディングス	529	401.1	691,897	
東京製鐵	95.4	54	64,206	
共英製鋼	22.1	15.6	23,805	
大和工業	41.6	29.5	109,740	
東京鐵鋼	8.1	5.3	9,184	
大阪製鐵	10.4	7.4	10,411	
淀川製鋼所	26.4	18.2	47,156	
丸一鋼管	63.6	45	130,455	
モリ工業	5.9	4.1	11,180	
大同特殊鋼	32.1	22.7	138,697	
日本高周波鋼業	7.2	5.1	2,325	
日本冶金工業	16.2	10.8	26,935	
山陽特殊製鋼	13.4	16.6	30,577	
愛知製鋼	11	7.8	27,378	
日立金属	211	130.7	278,391	
日本金属	4.5	3.5	4,228	
大平洋金属	13.2	9.4	24,111	
新日本電工	126.2	89.4	36,385	
栗本鐵工所	9.7	6.3	11,025	
虹技	2.9	1.9	2,314	
日本鋳鉄管	2	1.6	2,192	
三菱製鋼	14.5	10.3	9,424	
日亜鋼業	28.6	20.3	6,496	
日本精線	3.2	2	8,700	
エンビプロ・ホールディングス	8.4	5.9	6,690	
シンニッタン	30.4	16.8	4,552	
新家工業	4.5	3.4	5,810	
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	32.2	20.9	22,300	
日本軽金属ホールディングス	495.6	37.8	87,620	
三井金属鉱業	52.9	37.4	152,592	
東邦亜鉛	10	7.7	19,958	
三菱マテリアル	129.4	91.6	250,434	
住友金属鉱山	250.4	177.2	936,147	
D O W A ホールディングス	49.6	35.1	177,606	
古河機械金属	34.8	22.9	30,663	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20.4	14.4	15,422	
東邦チタニウム	35.1	24.8	25,891	
U A C J	29.7	21	60,564	

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	千株	千株	千円
C K サンエツ		4.1	2.9	10,454			
古河電気工業		60.8	43.1	129,300			
住友電気工業		732.4	483.8	811,574			
フジクラ		236.5	167.4	98,766			
昭和電線ホールディングス		22.7	13.4	21,761			
東京特殊電線		2.9	1.8	4,705			
タツタ電線		38.8	24.4	14,957			
カナレ電気		3.2	2.3	4,112			
平河ヒューテック		9.8	7.7	10,325			
リヨービ		24.1	17.1	28,847			
アーレスティ		25.7	17	8,534			
アサヒホールディングス		34.3	52	122,668			
金属製品 (0.6%)							
稻葉製作所		11	7.8	11,661			
宮地エンジニアリンググループ		6	4.5	10,566			
トーカロ		54.4	35.8	55,561			
アルファ C o		6.9	4.9	6,169			
S U M C O		234.5	177.4	469,932			
川田テクロジーズ		4	2.8	12,250			
R S T e c h n o l o g i e s		5.5	4.5	28,260			
ジェイテックコーポレーション		—	1.5	4,245			
信和		11.3	7.4	5,964			
東洋製罐グループホールディングス		124.8	88.3	122,825			
ホッカンホールディングス		10.8	7	10,094			
コロナ		10.8	7.7	7,422			
横河ブリッジホールディングス		36.4	23.8	50,955			
駒井ハルティック		3.7	2.8	5,563			
高田機工		1.8	1.3	3,491			
三和ホールディングス		184.7	130.7	186,378			
文化シヤッター		57.7	40.8	39,494			
三協立山		25.2	17.9	15,376			
アルインコ		14.2	9.2	9,549			
東洋シヤッター		4.7	3.1	2,024			
L I X I L		289	190.9	560,291			
日本フィルコン		15	9.6	4,780			
ノーリツ		40.6	28.7	49,392			
長府製作所		19.9	14.1	28,778			
リンナイ		38.1	27	303,750			
ダイニチ工業		10.5	6.6	5,511			
日東精工		27	17.4	9,813			

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	千株	千株	千円
三洋工業					2.6	1.7	3,139
岡部					39.7	28.1	21,187
ジーク					24.3	17.2	25,284
東プレ					36.5	25.9	38,979
高周波熱鍊					37.7	26.7	15,512
東京製綱					14	9.9	10,890
サンコール					14.7	11.9	5,593
モリテック スチール					15.3	10.8	4,870
パイオラックス					29	20.5	31,098
エイチワーン					19.2	13.6	11,369
日本発條					210.1	138.1	112,827
中央発條					2.4	6.7	7,443
アドバネクス					2.8	2	2,968
立川ブラインド工業					8.6	6.1	8,387
三益半導体工業					15.3	10.8	29,473
機械 (5.8%)							
日本ドライケミカル					4.9	3.4	5,899
日本製鋼所					59.4	42.1	117,332
三浦工業					84.8	60	354,600
タクマ					66.4	47	107,160
ツガミ					40.6	28.7	50,540
オークマ					22.8	16.2	100,926
芝浦機械					22.1	14.4	39,139
アマダ					242.9	203.2	250,952
アイダエンジニアリング					51.3	36.3	35,102
滝澤鉄工所					6.1	4	4,676
F U J I					84.2	55.4	164,316
牧野フライス製作所					23	16.3	72,372
オーエスジー					90.5	68.4	127,360
ダイジェット工業					2.2	1.6	2,115
旭ダイヤモンド工業					51.4	36.4	19,656
DMG森精機					123.9	87.7	159,000
ソディック					46	29.2	31,477
ディスコ					26.5	18.8	659,880
日東工器					10.7	6.6	12,949
日進工具					7.7	10.9	16,905
パンチ工業					17.7	11.6	6,844
富士ダイス					8.6	7	4,662
豊和工業					10.8	7.6	6,976
O K K					8	5.3	2,353

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
東洋機械金属	14	9.9	5,256	
津田駒工業	3.8	2.7	2,511	
エンシュウ	4.7	3.3	3,234	
島精機製作所	30.8	20.3	45,167	
オプトラン	21.8	17.4	49,068	
N C ホールディングス	5.9	4.2	2,935	
イワキポンプ	12.4	8.8	8,800	
フリュー	19.1	13.5	13,459	
ヤマシンフィルタ	42.6	27.9	23,184	
日阪製作所	24.2	17.1	14,791	
やまびこ	38	26.9	32,522	
平田機工	9.3	6.6	47,982	
ペガサスミシン製造	19.8	14	7,112	
マルマエ	7.2	5.7	9,997	
タツモ	9.1	5.9	10,466	
ナブテスコ	115.4	81.7	411,768	
三井海洋開発	20.8	14.7	33,574	
レオン自動機	19.2	13.6	16,755	
S M C	62.1	41.1	2,680,953	
ホソカワミクロン	6.9	4.9	31,262	
ユニオンツール	7.3	5.2	18,434	
オイレス工業	25.3	19.4	31,544	
日精エー・エス・ピー機械	5.7	4.7	24,581	
サトーホールディングス	27.9	18.2	50,505	
技研製作所	17.2	12.2	55,571	
日本エアーテック	6.6	4.5	5,413	
カワタ	5.8	3.8	3,553	
日精樹脂工業	16.4	10.7	11,138	
オカダアイヨン	6.2	4.4	5,478	
ワイエイシホールディングス	8.4	5.5	5,318	
小松製作所	897.2	635.2	2,182,547	
住友重機械工業	113.4	80.2	260,650	
日立建機	79.4	65.5	239,075	
日工	27.1	20.9	15,277	
巴工業	8.4	5.5	11,594	
井関農機	19.8	14	22,904	
TOWA	20	13.1	28,728	
丸山製作所	4	2.8	5,177	
北川鉄工所	8.9	6.3	10,350	
ローツエ	8.7	6.1	59,475	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
タカキタ	6.9	4.9	3,273	
クボタ	1,050.9	736.4	2,001,903	
荏原実業	5	3.5	17,325	
三菱化工機	6.8	4.5	12,699	
月島機械	36.5	25.8	32,353	
帝国電機製作所	16.3	9.8	13,308	
東京機械製作所	8.1	5.7	2,981	
新東工業	47	33.3	25,907	
瀧谷工業	17.3	12.3	44,157	
アイチ コーポレーション	34.2	23.8	21,586	
小森コーポレーション	50.2	35.5	27,441	
鶴見製作所	15.2	10.8	19,375	
住友精密工業	2.9	2.1	4,687	
日本ギア工業	7.9	5.6	1,831	
酒井重工業	3.7	2.5	5,275	
荏原製作所	81.9	58.1	284,109	
石井鐵工所	2.6	2	5,898	
西島製作所	20	14.1	12,506	
北越工業	20.4	14.4	15,969	
ダイキン工業	252.4	178.6	4,128,339	
オルガノ	7.1	4.5	33,165	
トヨーカネツ	8.6	5.3	13,970	
栗田工業	107.2	75.9	381,018	
椿本チエイン	28.3	20	60,800	
大同工業	9.4	6.7	5,808	
木村化工機	16.5	11.7	9,020	
アネスト岩田	30.8	23.6	24,945	
ダイフク	101.2	77.1	866,604	
サムコ	4.9	3.5	11,392	
加藤製作所	10.8	7.7	8,385	
油研工業	3.3	2.4	4,087	
タダメ	95.6	67.6	79,092	
フジテック	72	48.3	125,193	
C K D	54.3	32.5	80,047	
キトー	15	11.8	21,523	
平和	55.2	39.1	75,502	
理想科学工業	17.5	10.3	14,358	
S A N K Y O	44.1	33.3	97,768	
日本金錢機械	21.9	15.5	9,331	
マースグループホールディングス	12.6	8.9	14,400	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
フクシマガリレイ	12.2	9.6	39,984	
オーラズミ	8.3	5.9	2,383	
ダイコク電機	9.1	6.4	6,035	
竹内製作所	33.1	23.5	72,262	
アマノ	51.9	36.7	108,485	
JUKI	27.6	19.5	16,828	
サンデンホールディングス	25.9	—	—	
蛇の目ミシン工業	18	12.7	10,172	
マックス	30.2	18.8	31,302	
グローリー	50.9	36	86,076	
新晃工業	18.4	13	30,888	
大和冷機工業	28.6	22.5	25,200	
セガサミーホールディングス	196.5	127.5	204,510	
日本ピストンリング	7.2	5.1	5,763	
リケン	9.2	6.5	15,567	
TPR	26.6	18.9	31,657	
ツバキ・ナカシマ	40.4	26.9	45,999	
ホシザキ	57.9	44.1	451,584	
大豊工業	16.1	11.4	11,605	
日本精工	372.9	287.9	308,340	
NTN	458.4	324.5	111,628	
ジェイテクト	190	134.5	147,546	
不二越	18.4	13	56,680	
日本トムソン	58.8	38.4	26,995	
THK	115.2	87.4	338,675	
ユーシン精機	15.3	9.3	8,137	
前澤給装工業	7.2	9.8	10,946	
イーグル工業	24.5	17.3	20,760	
前澤工業	13.2	8.4	5,594	
日本ピラー工業	20	14.2	26,823	
キット	80.3	43.3	31,392	
マキタ	258.3	182.8	935,936	
日立造船	157	111.1	91,768	
三菱重工業	332	220.3	771,490	
IHI	142.7	94.3	218,776	
スター精密	30.5	21.6	36,547	
電気機器(17.6%)				
日清紡ホールディングス	132	85.7	74,816	
イビデン	121.3	67.4	328,575	
ヨニカミノルタ	432.8	284.4	181,447	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
プラザー工業	241.9	171.2	371,161	
ミネベアミツミ	367.7	241.6	692,184	
日立製作所	951.8	674	3,628,816	
東芝	—	277.4	1,252,461	
三菱電機	1,980.7	1,401.8	2,377,452	
富士電機	119.4	84.5	435,175	
東洋電機製造	7.2	5.5	7,084	
安川電機	213.2	150.9	780,153	
シンフォニアテクノロジー	25.6	18.2	27,664	
明電舎	36.4	23.8	57,572	
オリジン	5.4	3.8	5,145	
山洋電気	9.6	6.8	53,720	
デンヨー	16.9	11.9	24,347	
東芝テック	24.8	15	66,450	
芝浦メカトロニクス	3.5	2.5	15,175	
マブチモーター	54.8	38.8	172,466	
日本電産	476.7	337.4	4,214,126	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11.9	7.3	6,913	
トレックス・セミコンダクター	11.4	7.5	13,845	
東光高岳	11	7.1	10,181	
ダブル・スコーピ	31.3	33.2	23,870	
ダイヘン	21.7	15.3	75,429	
ヤーマン	32.3	22.9	34,624	
JVCケンウッド	161.4	121.3	28,626	
ミマキエンジニアリング	17.7	12.6	8,555	
I-PLEX	8.1	6.5	12,870	
日新電機	46.4	32.9	40,861	
大崎電気工業	39.4	27.9	17,102	
オムロン	177.6	116.7	995,451	
日東工業	29.1	20.6	40,952	
IDEC	28.6	18.8	32,636	
正興電機製作所	4.7	4.4	7,620	
不二電機工業	3.3	2.3	2,964	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	66.1	50.4	151,452	
サクサホールディングス	4.6	3.3	4,920	
メルコホールディングス	6.8	4.8	20,736	
テクノメディカ	4.4	3.1	5,053	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	4.3	4.1	11,594	
日本電気	240.3	178.1	1,130,935	
富士通	191	126.1	2,115,327	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
沖電気工業	80.5	56.9	68,109	
岩崎通信機	8.7	6.1	5,624	
電気興業	9.5	6.7	17,326	
サンケン電気	21.6	16.4	82,984	
ナカヨ	3.8	2.7	4,114	
アイホン	11.2	7.9	16,471	
ルネサスエレクトロニクス	947.1	603.4	748,819	
セイコーエプソン	245.8	173.9	328,844	
ワコム	133.2	101.5	69,832	
アルパック	36.4	25.8	130,032	
アクセル	8.3	5.9	6,342	
E I Z O	15.4	11.9	49,504	
日本信号	50.4	32.7	31,457	
京三製作所	46.4	30.1	12,551	
能美防災	26.2	18.5	38,998	
ホーチキ	14.4	10.2	13,372	
星和電機	9.8	6.9	4,209	
エレコム	21.9	32.1	74,696	
パナソニック	2,263.1	1,495.1	1,929,426	
シャープ	229.2	186.4	339,620	
アンリツ	127.5	84.3	188,494	
富士通ゼネラル	53.8	42.8	124,804	
ソニーグループ	1,240.8	878.2	9,466,996	
T D K	95.6	67.7	1,003,314	
帝国通信工業	8.7	6.2	6,875	
タムラ製作所	66.2	50.4	26,560	
アルプスアルバイン	175.3	114.5	147,018	
池上通信機	6.3	4.4	3,907	
日本電波工業	17.9	13.6	10,009	
鈴木	9.7	6.3	7,585	
日本トリム	2.7	3	11,535	
ローランド ディー. ジー.	10.9	8.3	15,496	
フォスター電機	20.8	14.1	16,835	
S MK	5.1	3.6	10,216	
ヨコオ	12.8	10.8	28,490	
ティアック	14.2	8.8	1,126	
ホシデン	54.1	38.3	41,708	
ヒロセ電機	30.7	21.6	334,800	
日本航空電子工業	45.4	32.1	61,953	
T O A	21.2	16.5	15,147	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
マクセルホールディングス	42.6	27.9	37,386	
古野電気	25.5	18	20,106	
ユニデンホールディングス	5.4	3.6	9,453	
スマダコーポレーション	15.2	11.9	12,364	
アイコム	11	5.8	15,404	
リオン	8.3	5.9	16,018	
本多通信工業	16.9	10.9	5,559	
船井電機	20	15.7	14,302	
横河電機	181.7	140.3	289,859	
新電元工業	7	5.4	19,494	
アズビル	125	94.8	435,606	
東亜ディーケーケー	9.8	6.9	5,913	
日本光電工業	81.9	57.9	192,807	
チノー	6.8	4.4	6,023	
共和電業	20.7	14.7	5,659	
日本電子材料	7.8	5.4	10,800	
堀場製作所	39.2	27.8	209,890	
アドバンテスト	147.3	104.2	1,062,840	
小野測器	8.3	5.8	3,056	
エスペック	17.6	12.4	23,907	
キーエンス	179.5	137.6	7,360,224	
日置電機	10.3	6.7	36,180	
シスメックス	141.6	109.4	1,220,904	
日本マイクロニクス	34.5	24.4	41,431	
メガチップス	18.4	14	52,990	
O B A R A G R O U P	11.6	6.4	24,448	
澤藤電機	2.4	1.5	3,468	
原田工業	9.4	5.7	5,152	
コーチル	26.4	17.1	18,382	
イリソ電子工業	16.6	11.8	63,366	
オブテックスグループ	32.5	23	39,836	
千代田インテグレ	9.2	5.9	10,797	
アイ・オー・データ機器	6.4	5.2	5,740	
レーザーテック	87	61.6	1,157,464	
スタンレー電気	139.3	98.1	313,429	
岩崎電気	7.7	5.1	7,695	
ウシオ電機	109.3	71.9	106,627	
岡谷電機産業	15.5	10	3,980	
ヘリオス テクノ ホールディング	18.2	12.9	4,656	
エノモト	5.9	3.9	7,137	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日本セラミック	20.1	14.2	39,305	
遠藤照明	10	7.1	5,474	
古河電池	14.1	10	16,400	
双信電機	9.6	6.8	3,454	
山一電機	14.3	9.1	14,469	
図研	12.9	9.1	27,036	
日本電子	39.1	25.5	156,315	
カシオ計算機	175.2	112.7	223,596	
ファナック	188.2	123	3,269,340	
日本シエムケイ	46.5	30.2	13,801	
エンプラス	10.1	6.3	26,302	
大真空	7.2	4.7	12,149	
ローム	87.9	58.3	617,980	
浜松ホトニクス	142.1	100.6	641,828	
三井ハイテック	21.8	13.7	57,882	
新光電気工業	66.5	47.1	156,843	
京セラ	278.7	213.7	1,474,743	
太陽誘電	88.1	62.3	311,500	
村田製作所	581.9	411.8	3,582,248	
双葉電子工業	31.3	24	21,888	
北陸電気工業	8	5.2	4,867	
ニチコン	67.2	44.1	47,804	
日本ケミコン	15.1	14.1	24,928	
KOA	29.9	19.4	32,301	
市光工業	29.6	21	14,994	
小糸製作所	118.7	84	587,160	
ミツバ	36.4	25.8	17,415	
S C R E E N ホールディングス	34.4	24.3	253,206	
キヤノン電子	20.8	12.9	23,052	
キヤノン	1,066.3	696.6	1,826,136	
リコー	503.9	356.6	439,331	
象印マホービン	58	37.9	65,870	
MUTOH ホールディングス	2.5	1.8	2,827	
東京エレクトロン	125.7	82.1	4,109,926	
輸送用機器 (7.2%)				
トヨタ紡織	57.7	40.8	84,496	
芦森工業	4.1	2.6	2,646	
ユニプレス	38.4	23	25,530	
豊田自動織機	160.3	113.5	1,023,770	
モリタホールディングス	34.6	22.5	36,112	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
三櫻工業	25.1	19.4	23,454	
デンソー	436.1	308.7	2,245,483	
東海理化電機製作所	52.2	36.9	65,534	
三井E & S ホールディングス	71.5	54.3	32,417	
川崎重工業	154.1	109.1	306,243	
名村造船所	63.7	42.1	7,914	
サノヤスホールディングス	24.1	17.2	2,614	
日本車輌製造	7.2	5.1	12,474	
三菱ロジスネクスト	26.2	18.6	22,320	
近畿車輛	3	2.4	3,110	
日産自動車	2,336.1	1,653.3	962,881	
いすゞ自動車	573.9	372.2	430,263	
トヨタ自動車	2,210.2	1,420.2	12,080,221	
日野自動車	247.4	175.1	168,096	
三菱自動車工業	733.2	518.9	161,377	
エフティック	13.8	9.8	7,291	
レシップホールディングス	7.7	5.6	3,091	
G M B	3.5	2.5	2,405	
ファルティック	3.5	2.4	2,133	
武藏精密工業	44.1	31.2	61,401	
日産車体	38.7	20.5	15,088	
新明和工業	53.4	39.6	40,867	
極東開発工業	36.8	24.2	41,309	
日信工業	40.3	—	—	
トピー工業	16.3	11.5	16,077	
ティラド	7.2	4.4	8,659	
タヂエス	32.5	21.5	25,477	
N O K	106.5	67.8	98,445	
フタバ産業	55.1	35.1	19,234	
K Y B	22.2	15.7	50,161	
大同メタル工業	38	29	17,081	
プレス工業	98.2	69.5	23,421	
ミクニ	25.1	17.8	5,642	
太平洋工業	41.5	29.4	37,102	
ケーヒン	45.5	—	—	
河西工業	26.7	18.9	8,920	
アイシン	163.1	102.6	443,232	
マツダ	582.8	440	396,000	
今仙電機製作所	18.4	12.3	9,102	
本田技研工業	1,559.6	1,103.8	3,787,137	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
スズキ	392.6	277.9	1,194,136	
SUBARU	614.9	401.7	854,817	
安永	9.5	6.8	8,316	
ヤマハ発動機	258.3	198.1	569,537	
ショーワ	46.8	—	—	
TBK	23.5	16.6	6,905	
エクセディ	26.9	19	30,590	
豊田合成	64	45.3	122,898	
愛三工業	31	21.9	17,279	
盟和産業	3	2.1	1,810	
日本プラスト	15.5	11.8	6,938	
ヨロズ	18.5	12	15,216	
エフ・シー・シー	32.4	22.9	41,082	
シマノ	74.1	52.5	1,323,262	
ティ・エス テック	46	65.1	99,993	
ジャムコ	9.9	8.2	7,462	
<b>精密機器 (2.6%)</b>				
テルモ	560.5	429.7	1,822,357	
クリエートメディック	6.5	4.6	4,682	
日機装	59.4	45.3	52,593	
日本エム・ディ・エム	11.4	8.1	18,225	
島津製作所	236.7	180.4	718,894	
JMS	16.7	11.8	11,693	
クボテック	5.1	3.6	1,317	
長野計器	14.3	10.1	12,534	
ブイ・テクノロジー	9.3	6.6	36,432	
東京計器	12.6	8.9	9,603	
愛知時計電機	2.6	1.8	7,731	
インターラクション	10.6	7	16,639	
オーパル	17.7	12.5	3,575	
東京精密	35.9	23.6	124,136	
マニー	78.9	55.8	142,959	
ニコン	302.5	214.1	230,585	
トプコン	99.7	70.6	112,324	
オリンパス	1,096	775.7	1,767,820	
理研計器	17.5	12.4	35,811	
タムロン	16	11.3	27,266	
HOYA	395.6	275.9	3,629,464	
シード	8.4	5.4	3,888	
ノーリツ鋼機	13.4	12.6	31,739	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
エー・アンド・デイ	18.1	11.8	15,989	
朝日インテック	224.3	147.6	438,076	
シチズン時計	232	177.9	69,736	
リズム	6.2	4.4	3,577	
大研医器	13.7	11.1	6,415	
メニコン	28.1	21.5	147,275	
シンシア	2.1	1.5	1,332	
松風	8.9	6.4	13,676	
セイコーホールディングス	28	19.8	41,718	
ニプロ	137.1	104.5	144,837	
<b>その他製品 (2.4%)</b>				
中本パックス	5	3.6	5,774	
スノーピーク	10.6	8.3	34,569	
バラマウントベッドホールディングス	20.9	26.9	60,256	
トランザクション	10.8	7.7	10,487	
粧美堂	5.8	4.1	1,701	
ニホンフラッシュ	18.5	12	16,056	
前田工織	21.8	15.4	52,591	
永大産業	25.9	18.3	6,350	
アートネイチャー	21.2	13.5	9,166	
バンダイナムコホールディングス	204.8	115.9	937,746	
アイフィスジャパン	5	3.6	2,674	
共立印刷	33	23.4	3,135	
SHOEI	17.3	13.2	53,130	
フランスベッドホールディングス	28	18	16,758	
パイロットコーポレーション	32.3	23.7	84,964	
萩原工業	11	7.8	11,341	
トップ・フォームズ	42.4	25	28,875	
フジシールインターナショナル	44.4	28.8	71,395	
タカラトミー	88.8	62.9	60,698	
廣済堂	13.8	9.8	10,054	
エステールホールディングス	5.3	3.7	2,319	
アーク	75.6	—	—	
タカノ	7.7	4.8	3,076	
プロネクサス	17	11.2	13,092	
ホクシン	12.2	8.6	2,141	
ウッドワン	6.7	4.7	7,914	
大建工業	13.3	9.4	19,975	
凸版印刷	279.6	213.1	416,184	
大日本印刷	259.2	169.3	388,882	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
共同印刷	6.1	4.3	11,949	
N I S S H A	40.7	28.8	38,505	
光村印刷	1.7	1.2	2,122	
TAKARA & COMPANY	9.5	6.9	13,137	
アシックス	163.5	124	226,176	
ツツミ	6.2	3.5	8,372	
ローランド	—	10.9	57,988	
小松ウオール工業	6	4.3	8,853	
ヤマハ	117.8	83.4	524,586	
河合楽器製作所	6.1	3.9	13,611	
クリナップ	18.4	13	7,241	
ビジョン	119.7	90	333,000	
オリバー	4.2	3	7,686	
兼松サステック	1.3	0.9	1,601	
キングジム	16.5	11.7	11,138	
リンテック	47.1	30	75,210	
イトーキ	42.1	27.8	10,869	
任天堂	121.5	80.2	4,990,044	
三菱鉛筆	32.6	23.1	34,349	
タカラスタンダード	40.9	29	46,690	
コクヨ	95	67.2	114,374	
ナカバヤシ	19.5	13.8	8,376	
グローブライド	8.9	6.8	30,056	
オカムラ	69.1	48.2	65,600	
美津濃	18	13.9	32,136	
<b>電気・ガス業 (1.3%)</b>				
東京電力ホールディングス	1,581.3	1,189.1	410,239	
中部電力	606	428.9	584,376	
関西電力	750.5	531.2	583,257	
中国電力	285.7	202.2	251,334	
北陸電力	181.1	128.2	87,047	
東北電力	494.8	328.3	320,420	
四国電力	178.4	116.5	95,180	
九州電力	408.3	309.6	313,315	
北海道電力	185.4	131.2	70,323	
沖縄電力	36.7	27.3	40,677	
電源開発	157.6	111.5	188,658	
エフオン	10.6	8.5	8,763	
イーレックス	28.2	20.6	40,396	
レノバ	33.1	23.8	74,732	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
東京瓦斯	380.9	269.6	629,381	
大阪瓦斯	384.4	253.9	546,392	
東邦瓦斯	97.4	68.9	436,137	
北海道瓦斯	10.6	7.5	11,760	
広島ガス	40.8	28.9	11,213	
西部ガスホールディングス	22.3	15.8	40,337	
静岡ガス	56.2	39.8	39,083	
メタウォーター	9.6	15.8	33,180	
<b>陸運業 (3.4%)</b>				
S B S ホールディングス	17.1	10.4	29,286	
東武鉄道	206.5	146.1	430,702	
相鉄ホールディングス	63.4	48.1	108,369	
東急	499.6	353.6	516,256	
京浜急行電鉄	254.4	180	260,100	
小田急電鉄	294.6	224.5	673,051	
京王電鉄	102.8	78.3	564,543	
京成電鉄	137.8	105.1	348,932	
富士急行	27	19.1	100,466	
新京成電鉄	5.1	3.6	7,840	
東日本旅客鉄道	348.6	246.7	1,895,396	
西日本旅客鉄道	176.5	124.9	777,002	
東海旅客鉄道	164.7	116.6	1,897,082	
西武ホールディングス	265.8	168.9	197,106	
鴻池運輸	31.5	22.3	26,247	
西日本鉄道	54.9	38.9	110,826	
ハマキヨウレックス	15.2	10.8	34,344	
サカイ引越センター	10.4	6.4	36,224	
近鉄グループホールディングス	187.6	132.8	540,496	
阪急阪神ホールディングス	250.2	177.1	624,277	
南海電気鉄道	88.9	62.9	150,016	
京阪ホールディングス	83.5	59.1	227,535	
神戸電鉄	4.5	3.2	11,584	
名古屋鉄道	154.2	109.2	279,552	
山陽電気鉄道	13.4	9.5	17,955	
アルプス物流	—	9.3	8,862	
日本通運	64.9	46	411,240	
ヤマトホールディングス	328.9	186	577,530	
山九	52.1	34.1	168,113	
丸運	10.7	7.6	2,143	
丸全昭和運輸	15.2	10.8	35,316	

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	103.4	73.2	76,128	
トナミホールディングス	4.5	3.2	17,120	
ニッコンホールディングス	67.1	44.6	104,141	
日本石油輸送	2	1.4	3,708	
福山通運	24	17	73,695	
セイノーホールディングス	140.5	99.4	155,759	
エスライン	5.6	3.6	3,315	
神奈川中央交通	4.6	3.3	12,193	
日立物流	34.4	29.2	101,324	
丸和運輸機関	19.8	28	54,012	
C&Fロジホールディングス	19	13.4	23,557	
九州旅客鉄道	164.5	102.7	259,831	
S G ホールディングス	196.9	250.9	628,253	
<b>海運業 (0.3%)</b>				
日本郵船	156.9	111	490,065	
商船三井	118.7	78.8	368,784	
川崎汽船	57.8	40.9	129,448	
N S ユナイテッド海運	10.3	6.3	15,025	
明治海運	19.9	14.1	7,064	
飯野海運	88.8	61.6	34,557	
共栄タンカー	3.3	2.3	2,302	
乾汽船	10.8	9.1	10,428	
<b>空運業 (0.4%)</b>				
日本航空	331.7	323.4	749,317	
A N A ホールディングス	342.9	358.3	920,114	
バスコ	3.6	2.6	3,666	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
トランコム	5.2	4	36,080	
日新	16.2	10.6	15,073	
三菱倉庫	59.5	45.9	153,994	
三井倉庫ホールディングス	21.4	14.1	33,431	
住友倉庫	67.5	46.9	69,318	
濱澤倉庫	10.3	7.3	15,768	
東陽倉庫	33.9	22.3	7,403	
日本トランシスティ	41.3	29.2	15,709	
ケイヒン	3.6	2.6	3,640	
中央倉庫	11.4	8.1	8,926	
川西倉庫	3.4	2.4	2,805	
安田倉庫	15.4	10.9	10,387	
ファイズホールディングス	4	2.4	2,239	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
東洋埠頭	5.7	4	6,020	
宇德	16	9.5	4,778	
上組	104.7	73	162,425	
サンリツ	4.4	3.4	2,437	
キムラユニティー	5	3.5	4,487	
キューソー流通システム	4.7	3.3	5,395	
近鉄エクスプレス	39.9	25.1	68,447	
東海運	10.7	7.6	2,698	
エーアイティー	13.2	8.3	8,864	
内外トランスライン	6.6	4.7	8,732	
日本コンセプト	6	4.2	6,715	
<b>情報・通信業 (9.4%)</b>				
N E C ネッツエスアイ	18.4	45.5	86,131	
クロスギャット	5.1	3.6	3,679	
シスデナ	69.3	49.1	111,948	
デジタルアーツ	9.6	8	69,920	
日鉄ソリューションズ	29.1	19.9	66,167	
キュープシステム	10.3	7.3	8,022	
エイジア	3.5	2.1	4,046	
コア	8.2	5.8	8,723	
ラクーンホールディングス	8.7	9.7	30,991	
ソリトンシステムズ	8.5	6.9	12,226	
ソフトクリエイトホールディングス	8.5	5.4	13,559	
T I S	194.4	137.6	368,905	
J N S ホールディングス	7.8	6.8	3,706	
電算システム	7.4	5.2	17,368	
グリー	119.2	84.4	49,458	
G M O ベバボ	—	1.2	7,116	
コーポレーテクモホールディングス	39.7	36.6	170,739	
三菱総合研究所	8.3	5.9	24,426	
ボルテージ	4.5	3.7	2,397	
電算	2.2	1.5	3,603	
A G S	11	7	5,635	
ファインデックス	16.4	11.6	13,978	
ブレインパッド	5	3.6	18,576	
K L a b	37.7	25.2	19,656	
ポールトウワイン・ピットクルーホールディ	23.4	18.3	21,191	
イーブックイニシアティブジャパン	2.8	2.2	5,988	
ネクソン	542.1	348.1	1,207,907	
アイスタイル	54.4	42	21,084	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
エムアップホールディングス	5.6	3.6	10,227	
エイチーム	13.4	9.5	15,504	
エニグモ	18.4	13	17,030	
テクノスジャパン	15.1	10.7	7,040	
e n i s h	8.9	7.2	3,859	
コロプラ	63.7	45.2	36,792	
オルトプラス	11.8	10.6	5,183	
プロードリープ	96.3	68.2	39,078	
クロス・マーケティンググループ	8.6	6.1	3,208	
デジタルハーツホールディングス	10.3	6.2	9,851	
システム情報	14.6	10.3	10,289	
メディアドゥ	6.1	5.4	28,458	
じげん	48.1	34	13,872	
ブイキューブ	11.9	7.5	21,210	
エンカレッジ・テクノロジ	4.3	2.4	1,572	
サイバーリンクス	3	4.5	7,375	
ディー・エル・イー	15.6	11.1	3,307	
フィックスターズ	20.7	14.6	14,687	
CARTA HOLDINGS	9.4	5.6	8,512	
オプティム	10.2	9.6	26,409	
セレス	6.4	4.5	17,100	
S H I F T	7.8	6.9	106,053	
ティーガイア	17.2	14.6	28,163	
セック	2.8	2	5,470	
日本アジアグループ	20.5	13.3	12,502	
豆蔵ホールディングス	2.4	—	—	
テクマトリックス	13.7	21.3	44,218	
プロシップ	5.6	4	5,648	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	46.8	33.2	70,085	
GMOペイメントゲートウェイ	41.1	26.3	351,105	
ザッパラス	8.4	5.3	2,734	
システムリサーチ	5.1	4	8,600	
インターネットイニシアティブ	28.7	36.6	89,157	
さくらインターネット	20.8	14.7	9,775	
ヴィンクス	5.4	3.9	4,083	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.6	3.1	17,360	
S R Aホールディングス	10.3	7.3	19,213	
システムインテグレータ	6.1	3.9	2,616	
朝日ネット	13.8	11.1	8,347	
e B A S E	23.2	16.4	16,236	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
アバント	18.5	14.7	24,210	
アドソル日進	6.9	4.9	13,107	
ODKソリューションズ	—	2.9	2,447	
フリービット	10.1	8.2	7,585	
コムチュア	21.8	12.6	32,848	
サイバーコム	3.5	2.4	3,720	
アステリア	11.8	9.9	8,157	
アイル	10.8	7.6	13,406	
マークライズ	9.7	5.7	18,297	
メディカル・データ・ビジョン	14.8	15.7	30,395	
g u m i	24.9	19	26,619	
ショーケース	4.6	3	2,517	
モバイルファクトリー	4.3	3.1	4,454	
テラスカイ	7	4.4	12,245	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	7.6	6.1	13,291	
P C I ホールディングス	7.3	5.2	7,586	
パイプドHD	2.5	2.8	4,684	
アイビーシー	3.2	2.2	2,191	
ネオジャパン	3.7	2.6	4,609	
P R T I M E S	1.7	2.9	9,120	
ラクス	—	41.4	85,615	
ランドコンピュータ	2.9	2.1	2,320	
ダブルスタンダード	2.5	1.8	6,444	
オープンドア	9.6	8.2	16,998	
マイネット	6.3	4.5	3,888	
アカツキ	6.9	5.5	22,192	
ベネフィットジャパン	1.5	1	1,924	
U b i c o mホールディングス	4.3	3.6	11,358	
L I N E	44.5	—	—	
カナミックネットワーク	17.8	14.7	9,569	
ノムラシステムコーポレーション	4.2	6	1,872	
チエンジ	6.8	25.3	83,869	
シンクロ・フード	8.3	8.2	3,099	
オークネット	12	7.3	9,380	
キャピタル・アセット・プランニング	—	2.7	3,437	
セグエグループ	4.2	3.5	4,662	
エイトレッド	3.2	2.6	6,804	
AOI TYO Holdings	19.6	13.9	8,840	
マクロミル	39.7	28.1	24,587	
ビーグリー	3.8	2.7	3,790	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
オロ	5.1	4.3	16,168	
ユーザーローカル	1.9	2.1	9,870	
テモナ	4.1	3	2,718	
ニーズウェル	3.7	2.8	1,778	
サインポスト	4	3.3	3,075	
ソルクシーズ	8.2	5.3	4,849	
フェイス	6.8	4.2	3,855	
プロトコルボレーション	17.4	16.4	19,499	
ハイマックス	2.3	3.9	4,442	
野村総合研究所	275.5	238.9	807,482	
サイバネットシステム	13.8	9.8	8,192	
C E ホールディングス	10.2	7.3	4,321	
日本システム技術	3.1	2.4	3,820	
インテージホールディングス	24.2	17.2	23,564	
東邦システムサイエンス	5.1	3.6	3,340	
ソースネクスト	92.2	65.2	21,581	
インフォコム	21.3	12.5	34,587	
H E R O Z	2.8	3.9	10,853	
ラクスル	15.6	14.9	73,084	
I P S	—	3.2	8,028	
F I G	21	14.9	4,261	
システムサポート	2.2	4.1	6,232	
イーソル	9.2	7.5	8,970	
アルテリア・ネットワークス	21.5	15.2	24,122	
E d u L a b	—	1.3	8,229	
東海ソフト	1.3	2.1	2,576	
ウイングアーク1st	—	7.2	18,648	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3.3	3.1	6,448	
サーバーワークス	—	1.3	5,674	
東名	—	1.3	1,471	
ヴィッツ	—	1.3	2,694	
トピラシステムズ	2.3	1.8	2,408	
S a n s a n	—	12.2	105,652	
L i n k - U	—	2.5	2,952	
ギフティ	—	8.3	26,062	
ベース	—	1.6	9,712	
フォーカスシステムズ	12	9.2	8,546	
クレスコ	11.8	9	15,273	
フジ・メディア・ホールディングス	187.2	142.7	191,218	
オーピック	67.4	43.4	866,264	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ジャストシステム	31.6	19.6	127,400	
T D C ソフト	17	12	12,636	
Z ホールディングス	2,669.2	1,889.8	898,032	
トレンドマイクロ	86.4	73.5	393,225	
I D ホールディングス	7.4	5.2	7,098	
日本オラクル	39.4	27.9	302,715	
アルファンシステムズ	6	3.7	13,468	
フューチャー	23.5	16.6	34,926	
C A C H o l d i n g s	12.6	8.9	12,691	
S B テクノロジー	7	4.9	15,484	
トーセ	5.3	3.7	2,963	
オーピックビジネスコンサルタント	19.9	14.1	89,394	
伊藤忠テクノソリューションズ	88.6	62.7	239,827	
アイティフォー	23.5	17.9	14,194	
東計電算	2.9	2	8,660	
エックスネット	3	2.2	2,244	
大塚商会	105.2	74.4	421,104	
サイボウズ	22.7	16.1	37,947	
ソフトブレーン	11.4	—	—	
電通国際情報サービス	12	17	68,255	
A C C E S S	18.2	17.2	15,342	
デジタルガレージ	35	22.7	104,533	
E M システムズ	27.3	22.7	18,727	
ウェザーニューズ	6.6	4.1	22,222	
C I J	13.2	9.4	8,168	
ビジネスエンジニアリング	2.2	1.4	4,893	
日本エンタープライズ	19.7	14	3,192	
WOWOW	9.3	6.6	17,853	
スカラ	12.9	12.2	9,259	
インテリジェント ウェイブ	11.3	8	5,440	
I M A G I C A G R O U P	16.5	11.7	5,885	
ネットワンシステムズ	74	56.1	191,020	
システムソフト	41.8	28.4	4,629	
アルゴグラフィックス	16.5	10.7	32,902	
マーべラス	29.7	21.7	17,815	
エイベックス	33.4	23.7	35,573	
日本ユニシス	60.7	47.7	169,812	
兼松エレクトロニクス	10.6	7.5	28,200	
都築電気	—	6.1	11,181	
T B S ホールディングス	118.2	91.2	199,272	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
日本テレビホールディングス		千株	千株	千円
朝日放送グループホールディングス	162.2	114.8	165,426	
テレビ朝日ホールディングス	19.3	13.7	9,672	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	53.4	42.5	85,467	
テレビ東京ホールディングス	127.9	90.5	41,992	
日本ＢＳ放送	15.9	9.8	22,363	
ビジョン	6.6	4.6	5,032	
スマートバリュー	18.1	17.1	18,297	
USEN-NEXT HOLDINGS	5.1	3.6	3,132	
ワイヤレスゲート	7.4	13.1	27,680	
コネクシオ	9.2	5.6	2,615	
日本通信	11	7.8	11,497	
クロップス	151.5	121.5	26,973	
日本電信電話	3.5	2.5	2,240	
KDDI	2,598.2	1,609	4,592,086	
ソフトバンク	1,448.5	1,103.2	3,795,008	
光通信	1,766.4	1,250.1	1,811,394	
ＮＴＴドコモ	20	16.2	359,316	
エムティーアイ	1,435.8	—	—	
GMOインターネット	18.8	13.3	10,320	
ファイバーゲート	76.6	48.7	153,892	
アイドマーチテイリングコミュニケーション	6.2	4.5	7,069	
KADOKAWA	5.8	3.5	1,445	
学研ホールディングス	52.3	35.6	139,552	
ゼンリン	26.1	19.4	27,295	
昭文社ホールディングス	38.8	24.9	28,933	
インプレスホールディングス	8.9	5.5	2,623	
アイネット	16.1	11.4	2,736	
松竹	10	7.1	10,486	
東宝	12.9	9.1	113,113	
東映	114.7	81.2	358,092	
エヌ・ティ・ティ・データ	7.3	4.5	112,905	
ビー・シー・エー	517.5	366.3	641,391	
ビジネスブレイン太田昭和	3.3	2	8,880	
DTS	3.3	4.7	8,525	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	43.4	28.5	74,385	
シーアーシー	82.9	58.7	359,831	
カブコン	20.8	14.7	20,491	
アイ・エス・ピー	91.6	117.9	396,144	
ジャステック	3.8	6.3	8,523	
	12.4	8.8	11,316	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	
S C S K		千株	千株	千円	
日本システムウエア	44.8	31.7	200,661		
アイネス	6.4	4.5	9,967		
T K C	19.1	13.5	19,386		
富士ソフト	16.4	23.3	83,647		
N S D	24.9	14.7	81,144		
コナミホールディングス	62.5	44.2	80,002		
福井コンピュータホールディングス	70.6	50	337,000		
J B C C ホールディングス	7.6	6.3	26,082		
ミロク情報サービス	13.1	9.3	12,899		
ソフトバンクグループ	17.1	13.6	25,404		
卸売業（4.9%）	1,542.2	1,091.5	11,100,555		
ホウスイ	1.5	1.1	1,084		
高千穂交易	7.5	5.3	5,941		
オルバヘルスケアホールディングス	2.3	2.2	3,790		
伊藤忠食品	4.8	3.3	16,797		
エレマテック	18.2	11	13,365		
J A L U X	5.5	3.9	6,368		
あらた	15.5	11	50,600		
トーメンデバイス	15.5	11	7,488		
東京エレクトロン デバイス	2.9	4.5	29,745		
フィールズ	7.1	14.9	12.1	6,352	
双日	216.8	1,077.5	762.6	261,571	
アルフレッサ ホールディングス	51	143.2	293,273		
横浜冷凍	神栄	2.7	38.7	34,636	
ラサ商事	2.7	1.9	2,515		
アルコニックス	10.3	7.3	6,591		
神戸物産	20.7	20.7	24,240		
ハイパー	67.3	14.7	277,894		
あい ホールディングス	2.9	2.8	1,565		
ディープエックス	27.8	2.9	4,116		
ダイワボウホールディングス	6.9	62.9	114,163		
マクニカ・富士エレホールディングス	16.6	46.5	76,689		
ラクト・ジャパン	36.7	7.3	17,358		
グリムス	—	6	7,564		
パイタルケースケー・ホールディングス	36.7	4.1	17,688		
八洲電機	15.1	24	10,389		
メディアスホールディングス	11.1	10.7	7,659		
レスターホールディングス	20.3	14.4	29,332		

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ジュー・テックホールディングス		千株	千株	千円
大光	4.4	3.1	3,100	
O C H I ホールディングス	8.3	5.3	3,731	
TOKA I ホールディングス	5.7	4	5,180	
黒谷	103.1	66.9	61,280	
C o m i n i x	5.3	3.7	4,447	
三洋貿易	3.4	2.4	1,852	
ビューティガレージ	19.6	13.9	15,568	
ワイン・パートナーズ	3.1	2.2	7,953	
ミタチ産業	14.1	10	10,140	
シップヘルスケアホールディングス	5.8	3.8	2,618	
明治電機工業	31.3	48.7	142,934	
デリカフーズホールディングス	6.1	4.7	6,617	
スター・ティアホールディングス	6.9	5.3	3,333	
コメダホールディングス	4.4	2.7	3,010	
ピーバンドットコム	42.5	30.1	61,765	
アセンテック	1.9	1.9	1,533	
富士興産	2.1	3.5	5,124	
協栄産業	5.9	4.2	5,443	
小野建	2.2	1.5	2,062	
南陽	17.5	12.4	17,236	
佐鳥電機	4.3	2.8	5,042	
エコードトレーディング	13.2	8.6	6,914	
伯東	4.5	2.9	1,757	
コンドーテック	11.9	8.4	12,969	
中山福	15.1	10.7	11,031	
ナガイレーベン	11.2	7.9	3,752	
三義食品	25.9	18.3	47,104	
松田産業	21.4	15.2	46,360	
第一興商	14.2	10.1	23,957	
メディバルホールディングス	29	27.4	116,450	
S P K	210.5	138.4	292,716	
萩原電気ホールディングス	8.4	5.9	7,805	
アズワン	7.2	5.1	13,611	
スズデン	12.7	9.9	137,709	
尾家産業	6.8	4.8	6,460	
シモジマ	5.7	4	4,908	
ドウシシャ	11.9	8.4	9,760	
小津産業	18.4	13	24,492	
高速	4.3	3	6,453	
	11.6	7.3	10,636	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
たけびし		千株	千株	千円
リックス	4.4	6.8	4.8	7,142
丸文	5.7	17.3	12.2	6,392
ハピネット	6.9	16.3	11.5	17,491
橋本総業ホールディングス	11.6	3.9	2.8	7,341
日本ライフライン	18.4	57.8	44.6	66,409
タカショ一	20.9	12.6	8.9	6,781
マルカ	24.8	6.9	4.5	9,675
I D O M	27.2	52.6	46.5	28,783
進和	29.5	11.5	8.2	17,088
エスケイジャパン	31.1	4.2	3.3	1,504
ダイトロン	33.0	8.2	5.8	11,849
シーケス	34.9	24.8	17.5	27,212
田中商事	36.8	6	4.2	2,801
オーハシテクニカ	38.7	11	7.1	10,557
白銅	40.6	7	4.9	8,927
ダイコー通産	42.5	—	1.6	2,872
伊藤忠商事	44.4	1,364.6	965.7	3,441,754
丸紅	46.4	2,030.7	1,361.6	1,351,524
高島	48.3	3.1	2.2	3,916
長瀬産業	50.2	109.7	75.8	129,314
蝶理	52.1	12.4	8.8	13,657
豊田通商	54.1	217.7	138.7	708,757
三共生興	56.0	29.5	20.9	11,014
兼松	57.9	72.8	55.2	83,572
ツカモトコーポレーション	59.8	3.5	2.3	3,210
三井物産	61.7	1,714.8	1,121	2,846,779
日本紙パルプ商事	63.6	11.1	7.2	26,424
カメリ	65.5	25.4	18	20,970
東都水産	67.4	2.5	1.6	6,808
O U G ホールディングス	69.4	3.1	2.2	6,155
スター・ゼン	71.3	7.2	10.2	23,337
山善	73.2	76.2	53.9	55,247
椿本興業	75.1	3.6	2.5	8,912
住友商事	77.0	1,230.9	871.4	1,359,384
内田洋行	78.9	7.7	5.9	28,733
三菱商事	80.8	1,369	840.6	2,531,046
第一実業	82.7	9.5	6.3	26,523
キヤノンマーケティングジャパン	84.6	48.4	34.2	88,988
西華産業	86.5	11	7.3	12,556

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
佐藤商事	16.1	11.4	12,437	
菱洋エレクトロ	19.8	10.5	28,549	
東京産業	17.6	12.5	7,950	
ユアサ商事	18.5	14.1	44,203	
神鋼商事	4.9	3.1	7,901	
トルク	11.6	8.2	2,074	
阪和興業	36.4	27.6	99,498	
正栄食品工業	12.6	8.9	36,623	
カナデン	15.8	11.2	13,104	
菱電商事	14	9.9	16,671	
フルサト工業	10.8	7	11,487	
岩谷産業	43.3	33.1	238,982	
ナイス	8.3	5.5	11,082	
昭光通商	6.2	2.9	2,299	
ニチモウ	3	2.1	4,160	
極東貿易	5.6	4	5,628	
イワキ	25.6	18.4	13,965	
三愛石油	48	34	43,248	
稻畑産業	43	33.2	55,278	
G S I クレオス	4.8	6.8	8,330	
明和産業	18	12.7	6,210	
クワザワホールディングス	6.9	4.9	2,930	
ヤマエ久野	14.2	10.1	11,009	
ワキタ	41.6	27.2	29,920	
東邦ホールディングス	62.6	44.3	84,923	
サンゲツ	53.2	37.3	60,799	
ミツウロコグループホールディングス	28.8	20.3	27,567	
シナネンホールディングス	8	5.1	15,631	
伊藤忠エネクス	43.1	30.5	33,367	
サンリオ	54.8	38.8	68,055	
サンワテクノス	13.8	9.1	11,675	
リヨーサン	21.5	15.2	34,625	
新光商事	30.6	18.6	14,173	
トーホー	8.8	6.2	10,831	
三信電気	10.5	7.4	15,162	
東陽テクニカ	20.9	13.6	15,150	
モスフードサービス	25.6	19.5	59,962	
加賀電子	19.4	12.5	31,100	
ソーダニッカ	20.1	13.1	7,768	
立花エレテック	14.4	10.2	16,309	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
フォーバル	8.5	4.8	3,921	
P A L T A C	31.3	22.1	121,108	
三谷産業	25.6	18.1	7,547	
太平洋興発	7.7	5.4	3,742	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	3.5	3.1	8,357	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.7	1.2	2,653	
コーア商事ホールディングス	—	10.3	8,404	
国際紙パルプ商事	46.2	29.4	7,261	
ヤマタネ	9.8	5.9	8,785	
丸紅建材リース	1.9	1.3	2,431	
日鉄物産	13.9	9.8	45,913	
泉州電業	6	3.9	13,572	
トラスコ中山	40.6	31.6	95,274	
オートバックスセブン	72.4	51.2	76,544	
モリト	14.2	10.1	6,201	
加藤産業	28.2	19.9	65,769	
北恵	4.9	3.5	3,297	
イノテック	10.1	7.8	10,467	
イエローハット	36.8	26.1	50,555	
J K ホールディングス	17.6	12.5	10,612	
日伝	17.6	11.4	23,746	
北沢産業	14.6	9.3	2,390	
杉本商事	10.5	6.9	15,649	
因幡電機産業	55.5	36.8	96,305	
東テク	6.5	4.6	13,731	
ミスミグループ本社	244.5	173.2	601,004	
アルテック	15.5	10.1	3,282	
タキヒヨー	5.9	4.6	8,551	
蔵王産業	3.8	2.7	3,866	
スズケン	82.6	58.5	238,972	
ジェコス	13.4	9.5	8,721	
グローセル	19.5	15	6,465	
小売業 (4.5%)				
ローソン	49.3	34.9	177,990	
サンエー	16.2	10.4	44,824	
カワチ薬品	15.1	9.6	23,001	
エービーシー・マート	30.5	21.6	129,384	
ハードオフコーポレーション	7.7	6.1	4,849	
アスクル	20.4	11.2	43,400	
ゲオホールディングス	35.1	18.5	22,348	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
アダストリア	27	19.1	36,060	
ジーフット	11.8	8.3	3,419	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	2.8	2	792	
くら寿司	10.2	16.2	63,180	
キャンドウ	9.3	6.6	14,308	
アイケイ	—	4	3,304	
パルグループホールディングス	19.9	12.1	19,263	
エディオン	89.5	58.5	69,498	
サーラコーポレーション	39.6	28	17,304	
ワツツ	8.6	6.7	6,043	
ハローズ	7.3	5.5	16,555	
フジオードグループ本社	16.4	11.6	16,785	
あみやき亭	4.2	3	8,592	
ひらまつ	35.9	25.4	4,114	
大黒天物産	4.7	4.4	38,236	
ハニーズホールディングス	17.2	10.9	11,728	
ファーマライズホールディングス	4.7	3.3	2,580	
アルペン	14.9	10.6	26,584	
ハブ	5.5	4.4	2,882	
クオールホールディングス	28.7	18.6	25,370	
ジンズホールディングス	10.3	9.4	73,320	
ピックカメラ	115.7	81.9	93,775	
DCMホールディングス	108.1	85.2	92,953	
Mono t a RO	138.7	196.4	500,820	
東京一番フーズ	4.9	3.5	2,044	
DDホールディングス	7.7	6.6	3,570	
きちらホールディングス	5.2	3.7	2,131	
アークランドサービスホールディングス	14.2	11.5	26,300	
J. フロント リテイリング	233	164.9	173,145	
ドトール・日レスホールディングス	31.1	21.8	35,948	
マツモトキヨシホールディングス	80.6	57.1	254,380	
プロンコビリー	10.2	7.2	17,532	
ZOZO	134.2	81.4	292,633	
トレジャー・ファクトリー	5.7	4	4,640	
物語コーポレーション	5.2	7.4	49,210	
ココカラファイン	20.4	12.3	92,865	
三越伊勢丹ホールディングス	341	241.6	189,414	
Hamee	6.9	3.5	5,540	
マーケットエンタープライズ	—	0.9	1,371	
ウェルシアホールディングス	58	73	253,675	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
クリエイト S D ホールディングス	32.9	20.4	69,360	
丸善 C H I ホールディングス	22.8	16.1	6,327	
ミサワ	3.9	2.8	1,926	
ティーライフ	2.9	1.8	2,444	
エー・ピー・ホールディングス	3.7	2.6	1,123	
チムニー	5.9	4.2	5,271	
シュッピン	13.3	9.4	10,546	
オイシックス・ラ・大地	17.4	18.2	55,510	
ネクステージ	28	24.3	42,816	
ジョイフル本田	57.1	40.4	55,146	
鳥貴族ホールディングス	5.7	5.1	8,323	
キリン堂ホールディングス	7.7	—	—	
ホットランド	13	10.3	14,100	
すかいらーくホールディングス	218.6	154.7	254,017	
S F P ホールディングス	11.1	6.7	8,870	
綿半ホールディングス	7.3	10.3	13,441	
ヨシックス	3.2	2.7	5,424	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	56.7	40.1	44,390	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9	7.2	10,742	
B E E N O S	9	7	24,430	
あさひ	14.5	10.3	15,347	
日本調剤	11.8	8.4	14,868	
コスマス薬品	8.6	13.9	219,481	
トーエル	9.4	6.7	5,641	
オンリー	3.3	2.3	1,069	
セブン＆アイ・ホールディングス	763.2	540.1	2,540,090	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	104.9	74.2	59,582	
ツルハホールディングス	42.4	30.1	391,601	
サンマルクホールディングス	15.4	10.9	18,530	
フェリシモ	4.3	3.1	4,154	
トリドールホールディングス	48.2	34.2	59,986	
TOKYO BASE	17.6	12.4	9,126	
ウイルプラスホールディングス	2.4	2.2	2,904	
J M ホールディングス	14.8	9.3	19,929	
サツドラホールディングス	2.9	2.1	4,798	
アレンザホールディングス	9.7	10.5	12,915	
串カツ田中ホールディングス	4	3.7	6,334	
バロックジャパンリミテッド	13.5	9.6	7,372	
クスリのアオキホールディングス	17.5	13.7	109,463	
力の源ホールディングス	8.8	6.3	3,868	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
FOOD & LIFE COMPANIE	107.1	80.8	381,780	
LIXILビバ	19.3	—	—	
メディカルシステムネットワーク	18.8	12	8,580	
はるやまホールディングス	9.1	6.5	4,348	
ノジマ	34.7	24.6	80,319	
カッパ・クリエイト	27.4	19.4	29,003	
ライトオン	14.6	10.3	7,261	
ジーンズメイト	5.9	—	—	
良品計画	259	158.9	371,190	
三城ホールディングス	20.7	17.1	4,839	
アドヴァン	29.8	14.1	13,747	
アルビス	7.4	4.4	10,278	
コナカ	23	16.3	5,558	
ハウス オブ ローゼ	2.4	1.7	2,825	
G-7ホールディングス	11.5	6.7	19,249	
イオン北海道	25.7	18.2	20,566	
コジマ	33.5	23.7	21,021	
ヒマラヤ	6.8	4.8	4,756	
ヨーナン商事	27.7	19.6	60,172	
エコス	7.2	5.1	9,577	
ワタミ	23.1	18.1	17,810	
マルシェ	5.1	3.6	1,731	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	428.8	276	651,636	
西松屋チェーン	42.8	30.3	52,509	
ゼンショーホールディングス	93.5	74.1	209,184	
幸楽苑ホールディングス	12.4	8.8	14,396	
ハーススレイ	4.1	2.9	2,650	
サイゼリヤ	28.9	20.5	50,450	
VTホールディングス	80.8	52	22,308	
魚力	5.4	4.3	8,178	
ボプラ	5.1	3.6	1,116	
フジ・コーポレーション	5.2	7.3	9,606	
ユナイテッドアローズ	20.4	15.8	31,837	
ハイディ日高	28.2	19.9	34,546	
京都きもの友禅	12.4	8.8	2,349	
コロワイド	64.8	45.9	85,465	
ビーシーデボコーコーポレーション	25.9	16	7,440	
老番屋	13.7	9.7	47,530	
トップカルチャー	7	5	1,745	
P L A N T	5	3.5	2,569	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
スギホールディングス	38.9	27.6	238,188	
葉玉堂ホールディングス	8.5	6	14,436	
ヴィア・ホールディングス	23.9	—	—	
スクロール	30	19.7	17,572	
ヨンドシーホールディングス	19.8	12.7	24,028	
ファミリーマート	155.9	—	—	
木曽路	25.5	18	41,040	
S R S ホールディングス	23	17.7	14,691	
千趣会	35.2	24.9	10,009	
タカキュー	15	10.7	1,455	
リテールパートナーズ	25.8	16.7	20,173	
ケーヨー	40.1	25.5	18,436	
上新電機	22.9	15.8	44,666	
日本瓦斯	30.8	68.2	128,829	
ロイヤルホールディングス	34.1	24.1	47,163	
東天紅	1.4	1	1,004	
いなげや	24.2	15.4	24,162	
島忠	36.7	—	—	
チヨダ	20.5	14.5	12,948	
ライフコーポレーション	14.8	14	49,490	
リンガーハット	24	17	38,539	
M r M a x H D	26.8	19	12,293	
デンアライド	18	12.7	4,191	
A O K I ホールディングス	39	27.6	17,636	
オーパワ	30.6	21.7	25,410	
コメリ	30.1	21.3	61,088	
青山商事	40.3	30.7	26,494	
しまむら	22.7	16.1	176,939	
はせがわ	10.3	7.3	2,131	
高島屋	142.1	100.6	123,738	
松屋	39.3	30.2	28,539	
エイチ・ツー・オー リテイリング	92.4	65.4	56,505	
近鉄百貨店	7.5	5.3	16,668	
丸井グループ	178.8	116.8	244,929	
アクシアール リテイリング	16.2	11.5	48,817	
井筒屋	10.6	7	1,778	
イオン	750.7	531.3	1,640,654	
イズミ	39.7	28.1	122,937	
平和堂	39.6	25.5	58,395	
フジ	23.5	16.7	35,571	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
ヤオコー		千株	千株	千円
ヤビオホールディングス	22.1	15.7	109,586	
ケーズホールディングス	23.6	16.7	15,297	
Olympicグループ	188.2	117.5	172,255	
日産東京販売ホールディングス	10.1	7.1	5,552	
シルバーライフ	28.7	20.3	5,014	
一家ダイニングプロジェクト	2.6	2.8	7,165	
Genky Drug Stores	2	1.5	1,573	
ナルミヤ・インターナショナル	8.6	6.1	20,831	
ブックオフグループホールディングス	4.4	2.6	3,192	
ギフト	11.4	8	8,048	
AINホールディングス	—	1.7	3,651	
元気寿司	24	20	127,000	
ヤマダホールディングス	4.9	3.9	9,562	
アークランドサカモト	594.4	462.8	260,093	
ニトリホールディングス	30.5	21.6	33,415	
グルメ杵屋	84.5	54.8	1,080,108	
愛眼	13.9	9.8	9,408	
ケーユーホールディングス	15.6	11	2,497	
吉野家ホールディングス	10.2	7.2	7,120	
松屋フーズホールディングス	64.1	45.4	93,978	
サガミホールディングス	9.4	6.6	23,265	
関西スーパー・マーケット	26.1	19.3	20,052	
王将フードサービス	16.2	10.4	10,784	
プレナス	14.3	9.1	51,779	
ミニストップ	14.3	15.5	31,697	
アーツ	21.8	10.2	14,881	
パローホールディングス	39.9	26.3	63,935	
藤久	43.2	28.2	66,241	
ベルク	2.1	3.2	2,531	
大庄	9.6	6.8	40,256	
ファーストリテイリング	10.4	7.4	7,429	
サンドラッグ	26.1	18.5	1,621,710	
サックスバー ホールディングス	73.4	51.9	201,372	
ヤマザワ	16.5	11.7	7,464	
やまや	4.5	3.2	5,446	
ペルーナ	4	2.8	6,512	
銀行業 (5.1%)	41.9	29.6	35,549	
島根銀行	5.1	4.8	3,475	
じもとホールディングス	132	9.3	6,630	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
めぶきフィナンシャルグループ		千株	千株	千円
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,015.1	718.4	178,881	
九州フィナンシャルグループ	26.4	17.3	21,694	
ゆうちょ銀行	427.5	282.4	124,820	
富山第一銀行	553.5	391.7	408,151	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	46.6	33	9,603	
西日本フィナンシャルホールディングス	1,115.8	842.4	368,128	
関西みらいフィナンシャルグループ	130	90.3	66,189	
三十三フィナンシャルグループ	114.7	—	—	
第四北越フィナンシャルグループ	18.1	12	16,332	
ひろぎんホールディングス	33.9	22.5	54,427	
新生銀行	—	203.9	126,418	
あおぞら銀行	143.4	112.7	182,912	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	116.4	82.4	200,808	
りそなホールディングス	13,364.3	9,458.4	5,749,761	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,143.9	1,595.6	747,059	
三井住友フィナンシャルグループ	369.3	261.3	1,007,834	
千葉銀行	1,351.2	956.9	3,798,893	
群馬銀行	652	461.4	330,362	
武蔵野銀行	375.3	284.6	107,578	
千葉興業銀行	29.1	20.6	34,669	
筑波銀行	53.6	35.2	9,820	
七十七銀行	81.2	57.5	10,177	
青森銀行	66	43.4	62,322	
秋田銀行	15.1	10.7	25,102	
山形銀行	12.5	8.3	11,653	
岩手銀行	22	15.5	16,414	
東邦銀行	12.8	9.1	19,665	
東北銀行	174.7	123.6	27,562	
みちのく銀行	9.4	6.6	7,022	
ふくおかフィナンシャルグループ	12.5	8.9	9,122	
静岡銀行	164.6	124.8	246,105	
十六銀行	483.8	336.7	291,918	
スルガ銀行	24.5	17.3	36,208	
八十二銀行	199.9	121.2	50,298	
山梨中央銀行	471.5	311.4	124,560	
大垣共立銀行	22.7	16.1	13,797	
福井銀行	38.6	27.3	55,883	
北國銀行	16.7	11.8	20,886	
—	20.1	12.8	31,782	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
清水銀行	8.1	5.7	9,336	
富山銀行	3.8	2.7	7,535	
滋賀銀行	39.2	27.7	60,801	
南都銀行	32.5	20.1	37,788	
百五銀行	175.8	124.4	41,052	
京都銀行	70	49.5	297,000	
紀陽銀行	69.2	49	73,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	130	92	90,252	
広島銀行	288.4	—	—	
山陰合同銀行	115.8	87.1	45,553	
中国銀行	168.1	119	108,290	
鳥取銀行	6.7	4.4	5,046	
伊予銀行	278.8	183.2	116,332	
百十四銀行	20.8	14.7	23,079	
四国銀行	29.7	19.6	14,406	
阿波銀行	31.9	21.2	48,950	
大分銀行	11.2	8	15,520	
宮崎銀行	13	8.6	19,823	
佐賀銀行	11.9	7.8	10,873	
沖縄銀行	17.9	12.7	35,013	
琉球銀行	45.1	30	22,020	
セブン銀行	652.6	462	108,108	
みずほフィナンシャルグループ	26,547.1	1,878.8	3,048,353	
高知銀行	7.1	5	4,145	
山口フィナンシャルグループ	243.9	172.6	116,332	
長野銀行	6.4	4.5	5,395	
名古屋銀行	14.6	11.1	31,202	
北洋銀行	294.5	208.4	61,478	
愛知銀行	7.1	4.6	13,468	
中京銀行	8	5	8,630	
大光銀行	6.7	4.7	6,960	
愛媛銀行	27.3	19.3	18,064	
トマト銀行	7.5	5.3	5,602	
京葉銀行	83.3	59	25,665	
栃木銀行	94.4	66.8	12,224	
北日本銀行	6.1	4.3	7,920	
東和銀行	34.3	24.3	15,381	
福島銀行	18.4	15.8	3,728	
大東銀行	10.2	6.6	4,210	
トモニホールディングス	151	106.9	33,032	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
フィデアホールディングス	189.7	134.2	17,580	
池田泉州ホールディングス	224.7	159	28,302	
証券、商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	60.3	46.5	34,503	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	9.3	15,670	
マーキュリアインベストメント	8.7	5.4	4,363	
S B I ホールディングス	218.2	170.4	516,312	
日本アジア投資	16.5	11.7	2,960	
ジャフコ グループ	30	21.3	166,992	
大和証券グループ本社	1,567.6	1,035.5	647,291	
野村ホールディングス	3,437.6	2,111.1	1,225,493	
岡三証券グループ	166.5	117.8	56,426	
丸三証券	58	41.1	27,454	
東洋証券	69.8	45.6	8,025	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	224.4	147.4	63,087	
光世証券	4.7	3.3	2,349	
水戸証券	56.5	36.9	11,512	
いちよし証券	36.5	27.7	17,534	
松井証券	111.6	67.7	59,034	
だいこう証券ビジネス	9.5	—	—	
マネックスグループ	143.4	124	113,832	
極東証券	26.2	18.5	15,762	
岩井コスモホールディングス	18.5	14.2	25,290	
藍澤證券	35.1	24.8	25,891	
マネーパートナーズグループ	20.8	14.7	3,777	
スパークス・グループ	90.2	63.9	18,850	
小林洋行	5.6	4	1,124	
保険業 (1.9%)				
かんぽ生命保険	69.2	171.4	377,937	
S O M P O ホールディングス	367.3	243.7	1,036,943	
アニコム ホールディングス	16.2	38.9	40,728	
MS & AD インシュアラントグループホール	510.8	335.8	1,106,796	
ソニー フィナンシャルホールディングス	160.5	—	—	
第一生命ホールディングス	1,105.5	730.5	1,502,273	
東京海上ホールディングス	690.7	455.4	2,491,948	
T & D ホールディングス	583.9	413.3	577,380	
アドバンスクリエイト	4.1	6.5	6,805	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	55.1	36	177,660	
ジェイリース	5.4	4.6	3,785	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
イントラスト	6.9	3.9	2,574	
日本モーゲージサービス	4	7	7,154	
C a s a	6.8	3.9	3,619	
アルヒ	31.1	20.4	37,270	
プレミアグループ	10.6	6.4	15,430	
クレディセゾン	136.9	80.7	104,748	
芙蓉総合リース	20.5	14.5	109,330	
みずほリース	30.1	21.3	71,568	
東京センチュリー	39.3	32.1	215,391	
日本証券金融	86.1	58.5	48,145	
アイフル	298	232	75,168	
リコーリース	15.4	10.9	38,095	
イオンフィナンシャルサービス	119.6	84.6	107,526	
アコム	392.7	277.9	131,168	
ジャックス	21.6	15.3	33,552	
オリエントコーポレーション	528.4	374	55,352	
日立キャピタル	46.1	—	—	
アプラスファイナンシャル	93.7	—	—	
オリックス	1,221.9	839.4	1,528,547	
三菱HCキャピタル	495.8	478.2	306,526	
九州リースサービス	9.6	6.8	4,617	
日本取引所グループ	560.7	373.5	988,841	
イー・ギャランティ	20.9	15.9	33,708	
アサックス	10.1	7.2	5,004	
N E C キャピタルソリューション	7.9	5.6	11,597	
不動産業 (2.0%)				
いちご	248.6	154	53,746	
日本駐車場開発	192.8	151.6	24,104	
スター・マイカ・ホールディングス	10.1	7.1	7,881	
S R E ホールディングス	—	2	10,020	
A D ワークスグループ	36.2	27.4	4,466	
ヒューリック	417.2	293.3	371,611	
三栄建築設計	7.8	5.5	10,917	
野村不動産ホールディングス	118.6	84	236,712	
三重交通グループホールディングス	39.6	28	13,776	
サムティ	27.7	19.6	40,278	
ディア・ライフ	27.6	17.8	8,579	
コーチアールイー	5.7	4.1	2,546	
日本商業開発	12.4	8.8	15,338	
プレサンスコーポレーション	32.1	22.7	38,680	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ユニゾホールディングス	6.3	—	—	
T H E グローバル社	9.2	—	—	
ハウスコム	3.4	2.4	2,990	
日本管理センター	12.9	7.5	9,645	
サンセイランディック	5.7	4.1	3,480	
エストラスト	2.7	1.6	1,086	
フージャースホールディングス	38.9	22.5	15,547	
オーブンハウス	56.8	43.9	199,306	
東急不動産ホールディングス	531.2	376	241,768	
飯田グループホールディングス	163	115.3	320,534	
イーグランド	3.1	2.2	2,072	
ムゲンエステート	13.5	8.5	4,267	
ビーロット	9.1	6.5	4,348	
ファーストブラザーズ	4.4	2.5	2,505	
ハウスドウ	9.6	6.8	7,262	
シーアールイー	4.8	3.6	5,310	
プロパティエージェント	3.1	2.2	5,486	
ケイアイスター不動産	6.1	4.3	16,254	
アグレ都市デザイン	3.2	2.5	2,522	
グッドコムアセット	4.7	6.6	9,702	
ジェイ・エス・ピー	4.2	2.6	8,983	
テンポイノベーション	4.4	3.9	3,455	
グローバル・リンク・マネジメント	3.3	2.4	2,196	
フェイスネットワーク	—	1.1	1,442	
パーク24	104.9	74.2	165,466	
バラカ	5	3.6	6,120	
三井不動産	963.6	630.2	1,584,953	
三菱地所	1,368.9	908.4	1,700,979	
平和不動産	35.8	23.7	92,667	
東京建物	205.8	136.6	235,908	
ダイビル	50.3	35.1	44,857	
京阪神ビルディング	31.7	23.8	36,176	
住友不動産	439.2	310.8	1,216,160	
テーオーシー	38.3	27.1	20,081	
東京楽天地	3.2	2.3	9,763	
レオパレス21	256	114.7	17,549	
スター・マイカ・ホールディングス	26.6	16.5	45,474	
フジ住宅	22.7	16	10,656	
空港施設	19.5	13.8	8,763	
明和地所	10.7	6.5	4,342	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ゴールドクレスト	15.4	12.5	20,375	
エスリード	7.6	5.4	9,061	
日神グループホールディングス	28.9	20.4	10,220	
日本エスコン	35.3	25.1	19,050	
タカラレーベン	89.3	57.9	21,365	
AVANTIA	11	7.1	6,439	
イオンモール	97.9	69.3	121,760	
毎日コムネット	5	4.7	3,642	
ファースト住建	8.3	5.9	7,339	
カチタス	48.4	34.2	114,228	
トーセイ	26.9	19.1	21,449	
穴吹興産	4.3	3	6,381	
サンフロンティア不動産	27	17	17,408	
エフ・ジー・ネクスト	17	13.6	14,320	
インテリックス	5.5	3.1	2,672	
ランドビジネス	6.6	5.8	2,331	
サンネクスタグループ	6	4.4	4,360	
グランディハウス	15.2	9.4	4,371	
日本空港ビルディング	62.3	48	233,760	
サービス業(5.5%)				
明豊ファシリティワークス	—	6.1	4,812	
日本工営	12.7	8.3	25,688	
L I F U L L	66	40.9	16,728	
ミクシィ	—	34	92,004	
ジェイエイシーリクルートメント	12.7	9.2	16,486	
日本M&Aセンター	143	219.7	608,788	
メンバーズ	5.6	4	11,904	
中広	2.6	1.8	628	
UTグループ	29.8	19.3	71,796	
アイティメディア	7.6	4.5	8,968	
タケエイ	18.1	14.9	19,131	
E・Jホールディングス	3.3	7	7,945	
夢真ビーネックスグループ	23.7	35.5	50,694	
コシダカホールディングス	45.6	35.8	20,298	
アルトナー	4.6	3.2	2,601	
パソナグループ	20.5	14.5	28,144	
CDS	4.7	3.3	5,174	
リンクアンドモチベーション	41.7	24.6	16,974	
GCA	22.9	17.5	14,875	
エス・エム・エス	58.9	45.5	139,230	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
サニーサイドアップグループ	6.5	4.6	3,477	
バーソルホールディングス	189.2	133.9	283,600	
リニカル	9.1	7.5	5,557	
クックパッド	66.1	42.1	11,872	
エスクリ	5.9	4.2	1,768	
アイ・ケイ・ケイ	9.2	6.5	4,355	
学情	6.7	4.7	6,462	
スタジオアリス	9.5	6.7	16,080	
シミックホールディングス	9.3	7.4	11,669	
エプロ	4	3.2	3,139	
NJS	4.2	3.3	6,642	
綜合警備保障	75.3	53.3	259,837	
カカクコム	139.8	99	285,318	
セントケア・ホールディング	12.2	9.8	11,701	
サイネックス	3.2	2.3	1,531	
ルネサンス	10.5	8.4	9,752	
ディップ	26.7	20.9	67,507	
デジタルホールディングス	10.3	9.3	17,958	
新日本科学	20.5	16.3	11,947	
ツクイホールディングス	44.6	6.3	5,802	
キャリアデザインセンター	4.3	3.4	3,634	
ペネフィット・ワン	68.9	48.7	133,535	
エムスリー	417.4	236.3	1,763,270	
ツカダ・グローバルホールディング	12	10.7	3,712	
プラス	2.5	1.7	887	
アウトソーシング	108.3	76.7	146,036	
ウェルネット	19.1	13.5	7,033	
ワールドホールディングス	6.4	4.6	12,792	
ディー・エヌ・エー	92.7	56.7	119,070	
博報堂DYホールディングス	263.3	186.4	342,603	
ぐるなび	32.9	23.3	13,793	
タカミヤ	20.1	16.2	8,488	
ジャパンベストレスキューシステム	14.9	9.1	6,643	
ファンコミュニケーションズ	52	36.8	14,646	
ライク	6.2	3.5	8,102	
ビジネス・ブレークスルー	7.9	5.6	2,514	
エスプール	48.6	34.4	32,955	
WDBホールディングス	8.6	6.1	14,377	
手間いらす	1.2	1.7	9,469	
ティア	11	7.8	3,829	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
C D G	2	1.2	1,912	
アドウェイズ	—	21.8	18,769	
バリューコマース	10.6	9	30,150	
インフォマート	207.4	135.5	121,950	
J P ホールディングス	59.4	38.2	12,109	
E P S ホールディングス	25.6	20.2	28,280	
レッグス	4.7	3.3	8,210	
プレステージ・インターナショナル	70.9	50.2	37,348	
アミューズ	10.3	7.3	17,235	
ドリームインキュベータ	5.7	4.1	4,157	
クイック	11.7	8.3	10,341	
T A C	11.4	7.2	1,764	
ケネディクス	176.3	—	—	
電通グループ	195.1	150.6	532,371	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7.2	6.3	5,317	
びあ	5.4	3.8	10,795	
イオンファンタジー	7.3	5.2	10,535	
シーディーエス	21.4	15.1	13,408	
ネクシィーズグループ	5.8	4.7	4,681	
H. U. グループホールディングス	52.9	37.5	137,062	
アルプス技研	16.7	11.8	24,095	
ダイオーズ	3.7	2.6	2,574	
日本空調サービス	19.8	14	10,402	
オリエンタルランド	201.3	142.5	2,175,262	
ダスキン	47	31.1	82,539	
明光ネットワークジャパン	23.9	15.7	9,247	
ファルコホールディングス	10.4	6.4	10,867	
秀英予備校	4.1	2.9	1,186	
田谷	3.5	—	—	
ラウンドワン	52.8	45.7	56,622	
リゾートトラスト	86.8	61.4	104,257	
ビー・エム・エル	24.4	17.2	65,962	
ワタベウェディング	3	—	—	
りらいあコミュニケーションズ	34.2	20.4	27,213	
リソー教育	86.5	68	19,856	
早稲田アカデミー	8.2	5.7	5,278	
ユー・エス・エス	211.9	150	300,150	
東京個別指導学院	6.7	11.8	6,985	
サイバーエージェント	116.6	330.2	723,138	
楽天グループ	882.2	624.9	833,616	

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	9.7	7	11,067	
モーニングスター	—	19.5	8,989	
ティー・オー・ダブリュー	30.1	23.4	7,628	
山田コンサルティンググループ	12.2	7.8	9,656	
セントラルスポーツ	7.1	5	12,150	
フルキャストホールディングス	18.9	11.4	22,560	
エン・ジャパン	33.6	23.8	81,872	
リソルホールディングス	2.1	1.5	6,000	
テクノプロ・ホールディングス	37.8	26.7	226,149	
アトラグループ	4.3	3.1	1,038	
インターワークス	3.6	3.8	1,482	
アイ・アールジャパンホールディングス	7.7	5.4	70,902	
K e e P e r 技研	7	8.6	19,848	
ファーストロジック	3.6	2.6	2,015	
三機サービス	3.6	2.6	2,797	
G u n o s y	11.7	8.3	8,482	
デザインワン・ジャパン	5.6	3.3	841	
イー・ガーディアン	8.3	5.4	15,044	
リブセンス	12.1	7.4	1,709	
ジャパンマテリアル	58.2	41.2	52,530	
ベクトル	23.6	16.7	15,998	
ウチヤマホールディングス	9.3	6.6	2,494	
チャーム・ケア・コーポレーション	16.1	10	12,630	
ライクキッズ	3.2	—	—	
キャリアリンク	6.2	4.4	9,838	
I B J	12.9	11	10,032	
アサンテ	7.6	4.8	8,750	
N・フィールド	13	1.7	2,034	
バリューHR	7.5	5.3	8,798	
M&Aキャピタルパートナーズ	15.4	11	51,590	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7.2	5.2	8,819	
E R I ホールディングス	5.3	3.7	2,175	
アピスト	2.9	2.1	6,426	
シグマクシス	13	7.3	15,614	
ウィルグループ	12.4	9.8	9,976	
エスクロー・エージェント・ジャパン	26.1	19.9	5,034	
メドピア	—	10.3	59,019	
レアジョブ	—	2.5	5,112	
リクルートホールディングス	1,355.9	959.6	5,044,617	
エラン	11.2	18.5	25,382	

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
		千株	千円
土木管理総合試験所	8.2	6.5	2,639
ネットマークティング	7.3	6.4	3,782
日本郵政	1,551.4	1,013.5	962,216
ペルシステム24ホールディングス	31.7	22.4	37,945
鎌倉新書	14.2	13.5	18,427
SMN	4	2.9	2,334
一蔵	2	1.7	681
LITALICO	6.5	—	—
グローバルキッズCOMPANY	3.4	2.4	2,431
エアトリ	9.9	8.4	18,866
アトラエ	5.7	9.3	15,614
ストライク	7.1	5.1	21,828
ソラスト	52.2	32.9	46,389
セラク	5.9	4.2	9,706
インソース	7.9	13	31,928
ペイカレント・コンサルティング	11.5	8.8	299,200
Orchestra Holdings	3.9	3	8,361
アイモバイル	6.7	3.8	5,198
キャリアインデックス	7.7	5.5	3,311
MS-Japan	6.1	5.4	5,610
船場	3.1	2.7	2,305
グレイステクノロジー	8.7	13.6	34,720
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	19.9	38.6	86,541
フルテック	2.6	1.9	2,800
グリーンズ	4.8	5	2,960
ツナググループ・ホールディングス	3.2	2.9	887
GameWith	5.6	4	2,660
ソウルドアウト	3.9	3.2	5,078
MS&Consulting	3.5	2.1	1,274
ウェルビー	—	4.9	7,261
エル・ティー・エス	—	1.3	5,778
ミダック	2.5	2.9	15,747
日総工産	12.6	10.5	8,148
キュービーネットホールディングス	7.8	6.1	10,815
RPAホールディングス	14.4	15.4	11,781
スプリックス	5.3	3.8	4,054
マネジメントソリューションズ	8.2	6.5	12,844
プロレド・パートナーズ	2.5	2.4	7,113
and factory	1.8	3	2,109
テノ.ホールディングス	—	1.4	1,582
フロンティア・マネジメント	—	3	4,977
ピアラ	—	0.9	1,423
コプロ・ホールディングス	—	1.7	2,254
ギークス	1.9	2.3	3,930
カーブスホールディングス	51.9	36.8	30,212
フォーラムエンジニアリング	9.8	9.3	9,699
ダイレクトマーケティングミックス	—	7	24,395
ポビンズホールディングス	—	3.5	16,100
LITALICO	—	5.4	24,948

銘柄	期首(前期末)	当期末	
		株数	評価額
		千株	千円
アドバンテッジリスクマネジメント	9.5	6.8	4,964
リログループ	103.5	73.2	167,701
東祥	11.8	8.3	13,935
エイチ・アイ・エス	29.5	20.6	47,153
ラックランド	4.4	3.8	9,492
共立メンテナンス	31.4	22.2	78,477
イチネンホールディングス	21.2	13.9	18,056
建設技術研究所	13.1	8.6	22,041
スペース	12.3	8.7	7,856
長大	7.5	5.3	9,402
燐ホールディングス	8.2	5.8	6,177
スバル興業	1.1	0.8	6,536
東京アートル	7.4	5.2	6,531
タナベ経営	3.6	2.6	3,629
ナガワ	6	4.3	35,475
よみうりランド	4.1	—	—
東京都競馬	12.4	8.8	47,696
常磐興産	7.6	5.4	7,695
カナモト	31	23.6	65,490
東京ドーム	76.6	—	—
西尾レントオール	17.5	12.4	39,866
トランス・コスモス	18	12.7	39,560
乃村工藝社	81.1	57.4	47,699
藤田観光	8.3	5.3	10,266
KNT-CTホールディングス	11.8	7.1	7,625
日本管財	20.3	14.3	32,103
トーカイ	18.3	12.9	31,759
白洋舎	2.2	1.5	3,501
セコム	200.9	132	1,229,844
セントラル警備保障	9.1	6.4	19,136
丹青社	35.7	25.3	21,758
メイティック	23.2	16.2	99,306
応用地質	20.4	15.1	20,052
船井総研ホールディングス	39.1	27.4	62,170
進学会ホールディングス	7.4	5.2	2,199
オオバ	13.7	9.4	8,074
いであ	4.6	3.3	6,157
学究社	5.5	3.9	5,112
ベネッセホールディングス	63	49.1	119,951
イオンディライト	23.3	16.5	55,852
ナック	10.5	6.3	5,966
ニチイ学館	26.9	—	—
ダイセキ	31.7	22.5	92,587
ステップ	6.9	4.9	7,884
合計	株数・金額	232,660	147,249 375,833,453
	銘柄数×比率>	2,155	2,172 <97.5%>

\*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

\*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。

\*評価額欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内新株予約権証券

2021年5月10日現在の組入れはございません。

銘柄		期首(前期末)
		証券数
千葉興業銀行		証券 52,900
合計	証券数・金額	52,900
	銘柄数 < 比率 >	1

## 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	百万円	百万円
			9,730	—

\* 単位未満は切り捨て。

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2021年5月10日現在)

区分	分	当期末	
		数量	量
貸付有価証券<株式>総株数	( 野村證券株式会社 )	株	2,502,700
		( 311,700 )	

\* ( ) 内は利害関係人との貸付状況です。

## ○投資信託財産の構成

(2021年5月10日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 375,833,453	% 88.4
コール・ローン等、その他	49,237,916	11.6
投資信託財産総額	425,071,369	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月10日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コレ・ローン等	425,022,491,500
株式(評価額)	44,988,320,369
未収入金	375,833,453,070
未収配当金	46,035,390
その他未収益	3,735,225,261
差入委託証拠金	44,504,310
△	374,953,100
(B) 負債	39,424,949,574
未払金	13,358,038
未払解約金	35,484,489,542
未払利息	△ 98,598
受入担保金	3,927,200,592
(C) 純資産額(A-B)	385,597,541,926
元本	189,017,112,223
次期繰越損益金	196,580,429,703
(D) 受益権総口数	189,017,112,223口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,400円

(注) 期首元本額は279,253,369,640円、期中追加設定元本額は23,335,658,932円、期中一部解約元本額は113,571,916,349円、1口当たり純資産額は2,0400円です。

## ○損益の状況 (2020年5月12日～2021年5月10日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円
受取配当金	9,039,191,180
その他収益金	8,853,039,847
支払利息	180,150,118
(B) 有価証券売買損益	6,001,215
売買益	115,100,625,944
売買損	△ 121,958,784,335
(C) 先物取引等取引損益	△ 6,858,158,391
取引益	2,127,065,351
取引損	2,641,860,695
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 514,795,344
(E) 前期繰越損益金	126,266,882,475
(F) 追加信託差損益金	143,803,269,334
(G) 解約差損益金	17,543,964,090
(H) 計(D+E+F+G)	△ 91,033,686,196
次期繰越損益金(H)	196,580,429,703
次期繰越損益金(H)	196,580,429,703

\*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。

\*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。

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	円 32,220,763,485
マイバランス70(確定拠出年金向け)	27,093,324,207
マイバランス50(確定拠出年金向け)	24,083,598,606
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	15,014,456,932
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,945,323,488
マイバランス30(確定拠出年金向け)	8,958,214,964
のむラップ・ファンド(普通型)	8,695,111,419
野村世界6資産分散投信(成長コース)	7,585,527,508
マイバランスDC50	5,299,473,498
マイバランスDC70	5,206,076,741
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,285,699,847
マイ・ロード	3,191,469,284
マイバランスDC30	3,167,103,613
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,958,763,691
のむラップ・ファンド(積極型)	2,605,707,453
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,494,073,607
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)	2,339,716,726
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,307,293,190
のむラップ・ファンド(保守型)	2,278,293,916

ファンド名	当期末
	元本額
野村6資産均等バランス	円 1,951,592,442
野村インデックスファンド・TOPIX	1,679,369,131
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	1,590,034,474
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,461,328,501
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,352,391,649
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,151,048,194
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	912,963,559
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	782,670,090
野村国内外マルチアセット(6資産)オーブン投信(適格機関投資家専用)	699,275,196
ファンドランプ(ウエルス・スクエア)日本株式	691,314,864
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	580,285,208
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	515,311,620
バランスセレクト70	440,069,742
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	404,598,424
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	391,895,637
野村DC運用戦略ファンド	365,001,395
のむラップ・ファンド(やや積極型)	361,028,737
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	326,996,341
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	321,094,000

ファンド名	当期末
	元本額
	円
バランスセレクト50	313,849,023
のむラップ・ファンド（やや保守型）	302,031,995
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	253,526,608
野村国内外マルチアセット(6資産) ファンド（適格機関投資家専用）	246,968,397
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	208,220,831
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	200,134,268
野村資産設計ファンド2040	161,263,364
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	151,076,855
バランスセレクト30	140,022,812
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	119,310,499
野村資産設計ファンド2030	101,390,924
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	96,567,613
野村資産設計ファンド2035	83,905,441
世界6資産分散ファンド	79,787,197
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	75,664,570
野村資産設計ファンド2025	73,941,030
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	67,530,749
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	66,741,873
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	59,068,096
野村資産設計ファンド2050	39,493,907
野村資産設計ファンド2015	39,488,612
野村資産設計ファンド2020	39,277,688
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	34,867,911
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	30,864,791
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	30,247,336
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	27,270,818

ファンド名	当期末
元本額	円
野村資産設計ファンド2045	26,478,951
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	23,325,274
インデックス・ブレンド（タイプV）	22,186,770
野村資産設計ファンド2060	19,460,583
ネクストコア	19,011,164
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	18,375,215
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	15,996,706
インデックス・ブレンド（タイプIII）	15,910,681
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	13,386,405
野村ターゲットデートファンド2016～2026-2028年目標型	13,064,858
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	8,983,053
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,495,347
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	8,207,928
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	7,785,224
野村ターゲットデートファンド2016～2029-2031年目標型	6,709,190
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	5,973,831
インデックス・ブレンド（タイプIV）	5,531,274
野村ターゲットデートファンド2016～2032-2034年目標型	5,138,457
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	4,381,261
野村ターゲットデートファンド2016～2035-2037年目標型	4,117,723
インデックス・ブレンド（タイプII）	3,751,683
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	3,423,934
インデックス・ブレンド（タイプI）	3,307,598
野村FDR用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	2,388,183
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	885,380
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	60,963

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日2021年3月31日）

作成対象期間（2020年4月1日～2021年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	外国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**  
東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	ベンチマーク			株組入比率	株先物比率	投資信託券組入比率	純資産額
		期騰落率	中率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)				
15期(2017年3月31日)	円 23,082	% 14.6		246.86	% 15.0	% 95.0	% 2.4	% 2.5 百万円 364,352
16期(2018年4月2日)	24,752	7.2		265.15	7.4	95.6	1.9	2.3 454,743
17期(2019年4月1日)	27,269	10.2		293.26	10.6	95.6	1.7	2.6 566,435
18期(2020年3月31日)	24,094	△11.6		260.14	△11.3	95.8	1.5	2.7 556,023
19期(2021年3月31日)	37,781	56.8		408.16	56.9	95.9	1.9	2.2 927,648

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに、営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指指数化しています。(以下同じ)

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関するいかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	ベンチマーク			株組入比率	株先物比率	投資信託券組入比率
		騰落率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)	騰落率			
(期首) 2020年3月31日	円 24,094	% —	260.14	% —	% 95.8	% 1.5	% 2.7
4月末	26,460	9.8	285.29	9.7	96.0	1.3	2.6
5月末	27,600	14.6	297.62	14.4	94.9	2.5	2.5
6月末	28,131	16.8	303.46	16.7	95.9	1.6	2.5
7月末	29,070	20.7	313.19	20.4	96.3	1.2	2.5
8月末	31,303	29.9	337.76	29.8	95.8	1.0	2.3
9月末	30,075	24.8	324.53	24.8	96.3	1.3	2.3
10月末	29,243	21.4	315.51	21.3	96.3	1.3	2.3
11月末	32,609	35.3	352.10	35.4	95.6	1.5	2.2
12月末	33,554	39.3	362.28	39.3	96.3	1.5	2.2
2021年1月末	34,249	42.1	370.12	42.3	96.3	1.5	2.2
2月末	35,409	47.0	383.43	47.4	96.2	1.1	2.2
(期末) 2021年3月31日	37,781	56.8	408.16	56.9	95.9	1.9	2.2

\*騰落率は期首比です。

\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から欧米で新型コロナウイルス感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方や、FRB（米連邦準備制度理事会）の緊急資金供給策の発表などを受けて上昇しました。その後も、各国で経済活動の再開が段階的に進んだことや、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などを背景に上昇しました。2020年9月以降は、主要株価指数が史上最高値を更新したことで利益確定の動きが広がったとの見方や、欧米で新型コロナウイルス新規感染者数が急増したことなどから軟調に推移しましたが、11月に入ると、米大手製薬会社が新型コロナウイルスワクチンの臨床試験による高い有効性を発表したことや、米大統領・議会選挙の結果を受けて再び上昇しました。その後も、新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったこと、欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどを受けて上昇しました。

為替市場は、期首から新型コロナウイルス感染拡大の責任を巡る米中対立への懸念や、世界的な経済活動再開への期待などから、主要通貨は対円で一進一退となりました。2020年6月中旬以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）でゼロ金利政策の維持が表明され、米国の低金利が長期化するとの観測や、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大などが懸念される中、下落（円高）しました。2021年1月以降は、米長期金利が上昇し日米金利差の拡大が意識されたことや、米国で新型コロナウイルスの新規感染者数の減少傾向が見られたことなどから上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+56.8%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の+56.9%を0.1ポイント下回りました。

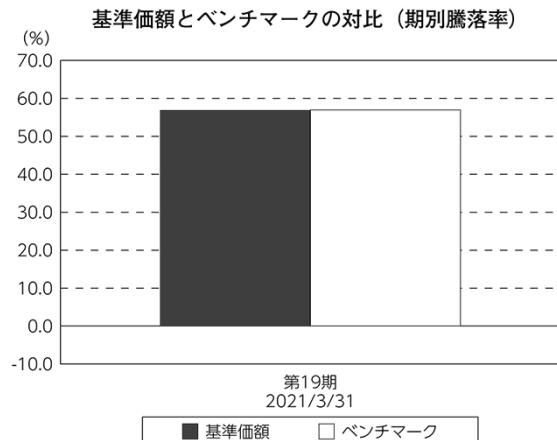
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他、差異を生じた要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## ○1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	円 1 (0) (0) (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.000) (0.000) (0.001)	(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) (新株予約権証券) (投資信託証券) (先物・オプション)			
(b) 有価証券取引税	2	0.006	(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) (新株予約権証券) (投資信託証券)	(2) (0) (0)	(0.005) (0.000) (0.000)	
(c) その他の費用	3	0.009	(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) (その他)	(2) (0)	(0.008) (0.001)	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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	6	0.017	
期中の平均基準価額は、30,149円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

\*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おります。

## ○売買及び取引の状況

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 79,265 ( 31,411)	千米ドル 749,342 ( 18,392)	百株 53,899 ( 3,468)	千米ドル 399,285 ( 28,262)
	カナダ	14,061 (△ 950)	千カナダドル 54,569 ( - )	9,065 ( 439)	千カナダドル 23,633 ( 978)
	イギリス	58,322 ( 27,201)	千英ポンド 32,903 ( 12,718)	47,971 (18,850)	千英ポンド 18,858 ( 2,488)
	スイス	4,537 ( 58)	千スイスフラン 32,105 (△ 232)	2,921 ( 116)	千スイスフラン 16,682 ( 760)
	スウェーデン	8,077 ( 390)	千スウェーデンクローナ 140,085 ( 273)	3,784 ( - )	千スウェーデンクローナ 51,047 ( 273)
	ノルウェー	1,556	千ノルウェークローネ 25,531	784	千ノルウェークローネ 11,654
	デンマーク	1,328 ( 2,286)	千デンマーククローネ 62,169 ( 4,458)	657 ( 1,960)	千デンマーククローネ 30,755 ( 1,028)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	5,870 ( 704)	32,171 (△ 511)	3,151 ( 99)	12,699 ( - )
	イタリア	13,005 ( 1,689)	8,944 ( 1,178)	9,367 ( 910)	3,674 ( - )
	フランス	5,163 (△ 366)	27,505 (△ 93)	2,870 ( 397)	14,636 ( 993)
	イギリス	— ( 2,399)	— ( 10,629)	— ( 2,399)	— ( 10,629)
	オランダ	2,542 ( 230)	15,630 (△ 9,460)	2,283 ( 1,689)	6,383 ( 1,178)
	スペイン	9,215 ( 72,268)	5,679 ( 1,555)	18,448 (69,600)	5,130 ( 1,160)
	ベルギー	400 ( 53)	2,883 ( 347)	230	1,249
	オーストリア	222	521	289	815
	ルクセンブルグ	294 ( 194)	382 ( - )	410	186
	フィンランド	2,479	3,627	1,561	2,275
	アイルランド	388 ( 87)	2,454 ( 630)	2,738	1,182

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	ヨーロ	百株	千ユーロ	百株	千ユーロ
	ボルトガル	825 ( 4,524)	333 ( 150)	290 ( 4,170)	126 ( 33)
	香港	21,168 (△ 2,737)	千香港ドル 84,642 ( - )	16,737 ( 1,340)	千香港ドル 56,690 ( 3,681)
	シンガポール	10,124 ( 4,583)	千シンガポールドル 3,503 ( 825)	19,153 ( 1,155)	千シンガポールドル 3,773 ( 132)
	オーストラリア	20,689 ( 2,210)	千豪ドル 36,530 ( 469)	17,558 ( 932)	千豪ドル 16,453 ( 52)
	ニュージーランド	1,020	千ニュージーランドドル 1,178	1,580	千ニュージーランドドル 813
	イスラエル	33	千新シェケル 1,999	8	千新シェケル 636

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 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	アメリカ	証券 — ( 17,750)	千米ドル — (82)	証券 17,750	千米ドル 77
	スイス	— (170,600)	千スイスフラン — (18)	170,600	千スイスフラン 30

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分です。

## 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	千米ドル	口	千米ドル
AGNC INVESTMENT CORP	13,000	184	—	—
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	4,500	713	—	—
AMERICAN TOWER CORP	7,300	1,731	3,000	729
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	46,000	300	22,000	168
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,300	524	2,500	435
BOSTON PROPERTIES	2,400	180	2,100	217
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,500	128	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	10,100	1,630	2,500	411
DIGITAL REALTY TRUST INC	7,200	1,050	2,700	395
DUKE REALTY CORP	5,600	228	—	—
EQUINIX INC	2,330	1,781	770	604
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,900	179	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	5,600	335	3,000	167
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,430	312	800	173
FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	11,100	968
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12,300	335	—	—
INVITATION HOMES INC	7,000	203	—	—
IRON MOUNTAIN INC	5,900	162	—	—
KIMCO REALTY CORP	—	—	65,000	722
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	16,000	352	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,700	210	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	—	27,900	1,051
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4,300	138	—	—
PROLOGIS INC	16,700	1,685	8,500	869
PUBLIC STORAGE	4,500	1,014	2,500	554
REALTY INCOME CORP	5,700	334	—	—
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,400	709	2,070	579
SL GREEN REALTY CORP	—	—	12,500	526
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,900	536	—	—
SUN COMMUNITIES INC	3,500	530	—	—
UDR INC	4,700	158	4,900	188
VENTAS INC	14,900	604	7,800	361
VEREIT INC	25,000	165	—	—
	(△185,000)	(△ 962)		
VEREIT INC	—	—	—	—
	( 37,000)	( 962)		
VICI PROPERTIES INC	19,000	406	—	—
WELLTOWER INC	10,800	631	5,900	397
WEYERHAEUSER CO	6,000	180	—	—
小計	280,460	17,643	187,540	9,522
	(△148,000)	( —)		
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,400	153	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	16,000	249
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	—	—	20,000	193
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	11,000	264
小計	3,400	153	47,000	708
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
SEGRO PLC	17,000	162	—	—
小計	17,000	162	—	—

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ヨーロッパ	千ユーロ		千ユーロ	
フランス				
ICADE	—	—	5,200	322
KLEPIERRE	—	—	—	—
	(—)	(△ 27)		
COVIVIO	1,900	109	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,800	176	—	—
小計	4,700	286	5,200	322
ユーロ 計	(—)	(△ 27)	5,200	322
			千香港ドル	千香港ドル
香港				
LINK REIT	62,000	3,986	39,000	2,594
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	100,000	746	—	—
小計	162,000	4,733	39,000	2,594
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	( 316,779)	( 547)		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	139,200	446	60,000	196
	( 19,240)	( 44)		
ASCENDAS REAL ESTATE-RTS	—	—	—	—
	( 19,240)	( 56)	( 19,240)	(0.58799)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
			(439,972)	( 655)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	420,000	861	—	—
	( 7,980)	( 12)		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS	—	—	—	—
	( 7,980)	( 15)	( 7,980)	(0.04308)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△ 2)		
小計	559,200	1,307	60,000	196
	( 371,219)	( 674)	(467,192)	( 656)
オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
GPT GROUP	45,000	175	—	—
LENDLEASE GROUP	23,000	297	—	—
STOCKLAND TRUST GROUP	112,000	393	60,000	236
GOODMAN GROUP	43,000	729	14,000	180
SCENTRE GROUP	220,000	566	270,000	762
VICINITY CENTRES	200,000	283	—	—
小計	643,000	2,446	344,000	1,180

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\*（ ）内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 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
外 国 株式先物取引	百万円 128,672	百万円 124,008	百万円 —	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。

\*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。

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## ○株式売買比率

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
(a) 期中の株式売買金額	169,458,786千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	712,894,879千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23

\*(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4月1日～2021年3月31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。

(2021年3月31日現在)

## ○組入資産の明細

## 外国株式

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	保険	
AFLAC INC	1,147	1,089	5,644	624,879	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AES CORP	1,010	1,100	2,956	327,347	各種電気通信サービス	
AT & T INC	11,424	11,810	36,292	4,017,901	ヘルスケア機器・用品	
ABBOTT LABORATORIES	2,768	2,937	35,170	3,893,734	バイオテクノロジー	
ABBVIE INC	2,316	2,926	31,246	3,459,328	ヘルスケア機器・用品	
ABTO MED INC	72	72	2,231	247,009	娯楽	
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,208	1,290	11,953	1,323,332	電気設備	
ACUITY BRANDS INC	62	—	—	—	ソフトウェア	
ADOBE INC	757	794	36,999	4,096,205	専門小売り	
ADVANCE AUTO PARTS	109	109	2,028	224,537	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,663	1,993	15,146	1,676,902	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	490	519	6,479	717,311	ホテル・レストラン・レジャー	
AIRBNB INC-CLASS A	—	87	1,592	176,357	化学	
AIR PRODUCTS	347	363	10,258	1,135,745	情報技術サービス	
AKAMAI TECHNOLOGIES	258	274	2,772	306,924	化学	
ALBEMARLE CORP	167	197	2,864	317,093	バイオテクノロジー	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	342	369	5,662	626,873	ヘルスケア機器・用品	
ALIGN TECHNOLOGY INC	118	125	6,590	729,670	保険	
ALLEGHANY CORP	23	23	1,478	163,693	情報技術サービス	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	66	—	—	—	電力	
ALLIANT ENERGY CORP	376	409	2,215	245,238	小売	
ALLSTATE CORP	506	496	5,808	643,076	保険	
ALLY FINANCIAL INC	574	630	2,898	320,837	消費者金融	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	175	187	2,526	279,756	バイオテクノロジー	
ALPHABET INC-CL C	483	492	101,132	11,196,386	インターネット・メディアおよびサービス	
ALPHABET INC-CL A	468	498	101,955	11,287,453	インターネット・メディアおよびサービス	
ALTICE USA INC-A	200	360	1,188	131,523	メディア	
ALTRIA GROUP INC	2,931	3,105	15,916	1,762,085	タバコ	
AMAZON.COM INC	658	706	215,917	23,904,209	インターネット販売・通信販売	
AMERCO	11	17	1,052	116,537	陸運・鉄道	
AMEREN CORPORATION	391	415	3,375	373,667	総合公益事業	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	146	—	—	—	旅客航空輸送業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	777	834	7,066	782,330	電力	
AMERICAN EXPRESS CO	1,079	1,136	16,300	1,804,624	消費者金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	125	125	1,454	161,069	保険	
AMERICAN INTL GROUP	1,378	1,450	6,864	759,946	バイオテクノロジー	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	283	306	4,493	497,487	水道	
AMERISOURCEBERGEN CORP	239	257	3,059	338,755	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	203	192	4,469	494,847	資本市場	
AMETEK INC	355	373	4,753	526,261	電気設備	
AMGEN INC	930	961	24,000	2,657,147	バイオテクノロジー	
AMPHENOL CORP-CL A	464	1,004	6,585	729,051	電子装置・機器・部品	
ANALOG DEVICES INC	581	618	9,431	1,044,139	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	134	145	4,812	532,781	ソフトウェア	
ANTHEM INC	394	409	14,891	1,648,613	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
APACHE CORPORATION	541	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	275	1,296	143,549	資本市場	
APPLE INC	6,940	28,174	337,806	37,398,531	コンピュータ・周辺機器	

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	千米ドル	千円	
APPLIED MATERIALS	1,436	1,507	19,102	2,114,863	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	410	390	1,494	165,410	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	884	938	5,431	601,268	食品
ARCONIC INC	570	—	—	—	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC	81	96	2,869	317,633	通信機器
ARROW ELECTRIS INC	121	121	1,324	146,604	電子装置・機器・部品
ASSURANT INC	90	102	1,476	163,412	保険
ATMOS ENERGY CORP	184	202	1,997	221,151	ガス
AUTODESK INC.	342	367	9,851	1,090,646	ソフトウェア
AUTOLIV INC	119	140	1,306	144,640	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	679	706	13,265	1,468,571	情報技術サービス
AUTOZONE	36	37	5,373	594,912	専門小売り
AVALARA INC	—	131	1,640	181,592	ソフトウェア
AVANTOR INC	—	840	2,389	264,574	ライフサイエンス・ツール/サービス
avery DENNISON CORP	134	134	2,481	274,717	容器・包装
BAKER HUGHES CO	1,010	1,110	2,412	267,035	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	475	551	4,657	515,643	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	13,370	12,900	50,297	5,568,391	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,279	1,343	6,427	711,599	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC.	755	855	7,317	810,075	ヘルスケア機器・用品
BECTON, DICKINSON	420	484	11,867	1,313,817	ヘルスケア機器・用品
BEIGENE, LTD ADR	63	—	—	—	バイオテクノロジー
WR BERKLEY CORP	217	239	1,824	201,940	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	2,055	2,272	58,660	6,494,333	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	363	393	4,547	503,486	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	36	36	2,053	227,343	ライフサイエンス・ツール/サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	280	306	2,293	253,943	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	283	252	6,955	770,038	バイオテクノロジー
BLACK KNIGHT INC	242	270	1,966	217,731	情報技術サービス
BLACKROCK INC	181	254	19,053	2,109,433	資本市場
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	1,040	1,126	8,360	925,596	資本市場
BOEING CO	838	885	22,302	2,469,152	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC	65	67	15,760	1,744,845	インターネット販売・通信販売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	226	226	1,825	202,090	情報技術サービス
BORGWARNER INC	296	404	1,879	208,113	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,193	2,350	9,155	1,013,616	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,670	3,742	23,690	2,622,786	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	179	194	2,967	328,566	情報技術サービス
BROADCOM INC	622	668	30,498	3,376,528	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	388	388	1,785	197,638	保険
BROWN-FORMAN CORP-CL B	478	527	3,689	408,409	飲料
BURLINGTON STORES INC	105	114	3,473	384,572	専門小売り
CBOE GLOBAL MARKETS INC	179	179	1,739	192,622	資本市場
CBRE GROUP INC	483	548	4,335	480,013	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	200	—	—	—	ソフトウェア
CDW CORPORATION	224	239	3,939	436,108	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	353	353	1,603	177,543	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	201	220	2,151	238,227	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	580	595	14,625	1,619,144	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CME GROUP INC	562	600	12,296	1,361,334	資本市場
CMS ENERGY CORP	433	482	2,941	325,616	総合公益事業
CSX CORP	1,162	1,279	12,325	1,364,580	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	2,040	2,184	16,615	1,839,543	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CABLE ONE INC	—	8	1,451	160,727	メディア

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	千米ドル	千円		
CABOT OIL & GAS CORP	640	640	1,202	133,135	石油・ガス・消耗燃料	
CAENCE DESIGN SYS INC	446	469	6,137	679,516	ソフトウェア	
CAMPBELL SOUP CO	248	309	1,587	175,767	食品	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	723	766	9,847	1,090,238	消費者金融	
CARDINAL HEALTH INC	443	472	2,939	325,444	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CARMAX INC	261	279	3,789	419,552	専門小売り	
CARLYLE GROUP INC/THE	—	220	816	90,385	資本市場	
CARNIVAL CORP	621	1,290	3,437	380,604	ホテル・レストラン・レジャー	
CARRIER GLOBAL CORP	—	1,390	5,888	651,864	建設関連製品	
CARVANA CO	—	102	2,595	287,392	専門小売り	
CATALENT INC	—	280	2,899	321,054	医薬品	
CATERPILLAR INC DEL	868	899	20,953	2,319,805	機械	
CELANESE CORP-SERIES A	196	195	2,954	327,043	化学	
CENTENE CORP	921	975	6,374	705,726	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	754	940	2,143	237,273	総合公益事業	
CENTURYLINK INC	1,480	—	—	—	各種電気通信サービス	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	216	1,769	195,874	ソフトウェア	
CERNER CORP	499	520	3,725	412,425	ヘルスケア・テクノロジー	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	235	230	14,583	1,614,539	メディア	
CHENIERE ENERGY INC	364	364	2,628	290,954	石油・ガス・消耗燃料	
CHEVRON CORP	2,960	3,190	33,791	3,741,075	石油・ガス・消耗燃料	
CHEWY INC - CLASS A	—	123	988	109,456	インターネット販売・通信販売	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	41	44	6,272	694,398	ホテル・レストラン・レジャー	
CHURCH & DWIGHT CO INC	375	398	3,499	387,398	家庭用品	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	246	246	2,584	286,181	保険	
CISCO SYSTEMS	6,638	7,002	36,249	4,013,165	通信機器	
CINTAS CORP	134	143	4,823	534,013	商業サービス・用品	
CITIGROUP	3,421	3,457	25,222	2,792,357	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	700	700	3,134	347,031	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	199	198	2,740	303,358	ソフトウェア	
CLOROX CO	193	213	4,128	457,098	家庭用品	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	329	2,164	239,667	ソフトウェア	
COCA COLA CO	6,368	6,765	35,955	3,980,685	飲料	
COGNEX CORP	278	278	2,273	251,666	電子装置・機器・部品	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	866	875	6,874	761,117	情報技術サービス	
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,265	1,363	10,812	1,197,071	家庭用品	
COMCAST CORP-CL A	7,104	7,566	41,597	4,605,299	メディア	
COMERICA INC	230	—	—	—	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	769	821	3,146	348,301	食品	
CONCHO RESOURCES INC	310	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
CONOCOPHILLIPS	1,710	2,231	11,920	1,319,688	石油・ガス・消耗燃料	
CONSOLIDATED EDISON INC	525	570	4,239	469,372	総合公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	259	283	6,620	732,987	飲料	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	139	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
THE COOPER COMPANIES, INC.	75	91	3,502	387,761	ヘルスケア機器・用品	
COPART INC	319	358	3,803	421,113	商業サービス・用品	
CORNING INC	1,190	1,290	5,624	622,677	電子装置・機器・部品	
CORTEVA INC	1,150	1,217	5,712	632,441	化学	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	691	733	25,640	2,838,623	食品・生活必需品小売り	
COSTAR GROUP INC	58	66	5,293	585,990	専門サービス	
COTY INC-CL A	490	—	—	—	パソコン用品	
COUPA SOFTWARE INC	—	114	2,720	301,198	ソフトウェア	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	290	5,083	562,752	ソフトウェア	
CROWN HOLDINGS INC	212	228	2,212	244,972	容器・包装	

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)						
CUMMINS INC	百株	百株	千米ドル	千円		
DR HORTON INC	226	249	6,561	726,440	機械	
DTE ENERGY COMPANY	538	561	5,006	554,254	家庭用耐久財	
DXC TECHNOLOGY CO	305	328	4,379	484,885	総合公益事業	
DANAHER CORP	378	—	—	—	情報技術サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	981	1,060	23,638	2,616,962	ヘルスケア機器・用品	
DATADOG INC - CLASS A	198	220	3,191	353,335	ホテル・レストラン・レジャー	
DAVITA INC	—	293	2,266	250,973	ソフトウェア	
DEERE & COMPANY	148	125	1,368	151,506	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
DELL TECHNOLOGIES-C	471	494	18,471	2,044,996	機械	
DELTA AIR LINES INC	266	407	3,605	399,177	コンピュータ・周辺機器	
DENTSPPLY SIRONA INC	252	252	1,232	136,425	旅客航空輸送業	
DEVON ENERGY CORP	352	352	2,236	247,614	ヘルスケア機器・用品	
DEXCOM INC	624	1,000	2,200	243,562	石油・ガス・消耗燃料	
DIAMONDBACK ENERGY INC	144	161	5,589	618,860	ヘルスケア機器・用品	
DISNEY (WALT) CO	231	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,820	3,000	55,659	6,162,007	娯楽	
DISCOVERY INC - A	496	500	4,763	527,311	消費者金融	
DISCOVERY INC - C	245	245	1,064	117,826	メディア	
DISH NETWORK CORP-A	570	491	1,817	201,181	メディア	
DOCUSIGN INC	371	384	1,377	152,492	メディア	
DOLLAR GENERAL CORP	166	293	5,770	638,834	ソフトウェア	
DOLLAR TREE INC	397	418	8,433	933,634	複合小売り	
DOMINION ENERGY INC	376	382	4,439	491,550	複合小売り	
DOMINOS PIZZA INC	1,278	1,340	10,121	1,120,498	総合公益事業	
DOVER CORP	59	63	2,322	257,168	ホテル・レストラン・レジャー	
DOW INC	229	243	3,362	372,277	機械	
DRAFTKINGS INC - CL A	1,152	1,245	8,043	890,545	化学	
DROPBOX INC-CLASS A	—	277	1,689	187,066	ホテル・レストラン・レジャー	
DUKE ENERGY CORP	390	510	1,338	148,213	ソフトウェア	
DUPONT DE NEMOURS INC	1,138	1,230	11,837	1,310,531	電力	
DYNATRACE INC	1,150	877	6,868	760,429	化学	
EOG RESOURCES INC	—	290	1,354	149,998	ソフトウェア	
E*TRADE FINANCIAL CORP	904	981	7,186	795,651	石油・ガス・消耗燃料	
EAST WEST BANCORP INC	350	—	—	—	資本市場	
EASTMAN CHEMICAL CO.	207	—	—	—	銀行	
EATON VANCE CORP	208	230	2,564	283,941	化学	
EBAY INC	164	—	—	—	資本市場	
ECOLAB INC	1,200	1,128	6,804	753,281	インターネット販売・通信販売	
EDISON INTERNATIONAL	401	430	9,245	1,023,513	化学	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	555	612	3,637	402,732	電力	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	325	1,042	8,632	955,756	ヘルスケア機器・用品	
ELECTRONIC ARTS	600	740	2,131	235,945	医薬品	
EMERSON ELEC	461	485	6,519	721,813	娯楽	
ENPHASE ENERGY INC	938	982	8,949	990,848	電気設備	
ENERGY CORP	—	195	2,936	325,122	半導体・半導体製造装置	
EPAM SYSTEMS INC	313	336	3,314	367,000	電力	
EQUIifax INC	84	95	3,643	403,354	情報技術サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	185	197	3,610	399,731	専門サービス	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	620	690	2,236	247,579	各種金融サービス	
ESSENTIAL UTILITIES INC	37	44	979	108,443	保険	
ETSY INC	349	396	1,748	193,558	水道	
EVERGY INC	—	209	4,156	460,153	インターネット販売・通信販売	
EVERSOURCE ENERGY	359	359	2,131	235,965	電力	
	503	564	4,866	538,798	電力	

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	千米ドル	千円	
EXACT SCIENCES CORP	226	258	3,190	353,183	バイオテクノロジー	
EXELON CORPORATION	1,515	1,637	7,120	788,360	電力	
EXPEDIA GROUP INC	207	223	3,921	434,193	インターネット販売・通信販売	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	273	271	2,906	321,745	航空貨物・物流サービス	
EXXON MOBIL CORP	6,621	7,007	39,722	4,397,698	石油・ガス・消耗燃料	
FLIR SYSTEMS INC	207	—	—	—	電子装置・機器・部品	
FMC CORP	196	212	2,353	260,569	化学	
FACEBOOK INC-A	3,761	3,984	114,739	12,702,776	インターネット・メディアおよびサービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	59	64	1,992	220,598	資本市場	
FAIR ISAAC CORP	—	46	2,240	248,092	ソフトウェア	
FASTENAL CO	874	969	4,905	543,041	商社・流通業	
FEDEX CORPORATION	391	417	11,922	1,319,980	航空貨物・物流サービス	
F5 NETWORKS INC	93	104	2,159	239,061	通信機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	964	1,035	14,749	1,632,948	情報技術サービス	
FNF GROUP	405	454	1,855	205,371	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	1,120	1,200	4,574	506,431	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	257	290	4,874	539,603	銀行	
FISERV INC	908	952	11,496	1,272,761	情報技術サービス	
FIRSTENERGY CORP	834	866	2,986	330,672	電力	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	138	135	3,734	413,476	情報技術サービス	
FLOWSERVE CORP	206	—	—	—	機械	
FORD MOTOR COMPANY	6,070	6,560	8,173	904,916	自動車	
FORTINET INC	228	224	4,061	449,680	ソフトウェア	
FORTIVE CORP	476	518	3,699	409,520	機械	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	216	234	2,246	248,698	建設関連製品	
FOX CORP-CLASS A	528	580	2,152	238,289	メディア	
FOX CORP-CLASS B	254	254	910	100,783	メディア	
FRANKLIN RESOURCES INC	434	510	1,495	165,603	資本市場	
FREEPORT-MCMORAN INC	2,250	2,390	7,810	864,702	金属・鉱業	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	297	319	4,007	443,681	保険	
GAP INC	315	—	—	—	専門小売り	
GARTNER INC	141	141	2,562	283,682	情報技術サービス	
GENERAC HOLDINGS INC	—	102	3,241	358,816	電気設備	
GENERAL DYNAMICS	383	410	7,466	826,571	航空宇宙・防衛	
GENERAL ELEC CO	13,550	14,530	19,324	2,139,459	コングロマリット	
GENERAL MILLS	943	1,028	6,352	703,231	食品	
GENERAL MOTORS CO	1,990	2,153	12,597	1,394,636	自動車	
GENUINE PARTS CO	232	232	2,727	301,975	販売	
GILEAD SCIENCES INC	1,982	2,082	13,637	1,509,763	バイオテクノロジー	
GLOBAL PAYMENTS INC	473	492	10,055	1,113,298	情報技術サービス	
GLOBE LIFE INC	157	157	1,543	170,894	保険	
GODADDY INC - CLASS A	269	269	2,043	226,186	情報技術サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP	501	543	18,028	1,995,895	資本市場	
GRAINGER(W.W.) INC	70	74	2,966	328,377	商社・流通業	
GRUBHUB INC	145	—	—	—	インターネット販売・通信販売	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	121	136	1,367	151,423	ソフトウェア	
HCA HEALTHCARE INC	424	454	8,559	947,646	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	268	—	—	—	商社・流通業	
HP INC	2,320	2,250	7,101	786,151	コンピュータ・周辺機器	
HALLIBURTON CO	1,280	1,500	3,225	357,039	エネルギー設備・サービス	
HANESBRANDS INC	510	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
HARLEY-DAVIDSON INC	224	—	—	—	自動車	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	545	589	3,988	441,524	保険	
HASBRO INC	196	214	2,073	229,527	レジャー用品	

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	千米ドル	千円		
HEICO CORP	63	63	779	86,347	航空宇宙・防衛	
HEICO CORP-CLASS A	124	123	1,411	156,231	航空宇宙・防衛	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	117	127	1,948	215,683	情報技術サービス	
HERSHEY CO/THE	235	251	3,987	441,443	食品	
HESS CORP	432	473	3,360	372,006	石油・ガス・消耗燃料	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,020	2,200	3,471	384,340	コンピュータ・周辺機器	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	416	468	5,712	632,420	ホテル・レストラン・レジャー	
HOLLYFRONTIER CORP	236	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
HOLOGIC INC	433	434	3,205	354,931	ヘルスケア機器・用品	
HOME DEPOT	1,706	1,784	54,379	6,020,397	専門小売り	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,120	1,165	25,407	2,812,862	コングロマリット	
HORMEL FOODS CORP	456	500	2,408	266,589	食品	
HOWMET AEROSPACE INC	—	660	2,096	232,065	航空宇宙・防衛	
HUBSPOT INC	—	70	3,066	339,529	ソフトウェア	
HUMANA INC	204	217	9,237	1,022,728	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	132	132	2,235	247,468	陸運・鉄道	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,540	1,720	2,753	304,864	銀行	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	65	65	1,336	148,003	航空宇宙・防衛	
IAC/INTERACTIVE CORP	—	136	2,801	310,165	インターネット・メディアおよびサービス	
IAC/INTERACTIVE CORP	126	—	—	—	インターネット・メディアおよびサービス	
IPC PHOTONICS CORP	59	59	1,207	133,642	電子装置・機器・部品	
IDEX CORP	123	123	2,588	286,590	機械	
IDEXX LABORATORIES INC	136	142	6,801	752,974	ヘルスケア機器・用品	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	500	529	11,889	1,316,320	機械	
ILLUMINA INC	228	244	9,013	997,905	ライフサイエンス・ツール/サービス	
INCYTE CORP	285	312	2,503	277,126	バイオテクノロジー	
INGERSOLL-RAND INC	528	580	2,902	321,315	機械	
INGREDION INC	96	—	—	—	食品	
INSULET CORP	98	106	2,770	306,736	ヘルスケア機器・用品	
INTEL CORP	6,802	6,791	43,306	4,794,430	半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	876	930	10,344	1,145,227	資本市場	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,388	1,485	20,005	2,214,855	情報技術サービス	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	155	371	5,195	575,207	化学	
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	598	601	3,305	365,951	容器・包装	
INTERPUBRIC GROUP	580	670	1,963	217,408	メディア	
INTUIT INC	404	433	16,179	1,791,230	ソフトウェア	
INTUITIVE SURGICAL INC	181	194	14,115	1,562,749	ヘルスケア機器・用品	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	214	214	956	105,926	バイオテクノロジー	
IQVIA HOLDINGS INC	252	322	6,143	680,140	ライフサイエンス・ツール/サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	4,903	5,051	78,027	8,638,463	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	200	213	2,729	302,146	建設・土木	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	430	—	—	—	各種金融サービス	
JOHNSON & JOHNSON	4,114	4,362	71,977	7,968,613	医薬品	
JONES LANG LASALLE INC	76	—	—	—	不動産管理・開発	
JUNIPER NETWORKS INC	530	530	1,349	149,448	通信機器	
KLA CORP	244	255	8,085	895,121	半導体・半導体製造装置	
KKR & CO INC-A	784	855	4,205	465,618	資本市場	
KANSAS CITY SOUTHERN	151	151	3,920	434,028	陸運・鉄道	
KELLOGG CO	400	433	2,760	305,649	食品	
KEURIG DR PEPPER INC	—	920	3,211	355,569	飲料	
KEYCORP	1,580	1,580	3,174	351,417	銀行	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	289	304	4,302	476,364	電子装置・機器・部品	
KIMBERLY-CLARK CORP	533	572	7,911	875,863	家庭用品	
KINDER MORGAN INC	3,150	3,440	5,717	632,960	石油・ガス・消耗燃料	

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		
				外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円		
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	208	208	1,020	112,996	陸運・鉄道		
KOHLS CORP	253	—	—	—	複合小売り		
KRAFT HEINZ CO/THE	1,041	1,090	4,390	486,074	食品		
KROGER CO	1,269	1,260	4,798	531,195	食品・生活必需品小売		
LKQ CORP	450	490	2,100	232,506	販売		
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	344	344	6,985	773,414	航空宇宙・防衛		
LABORATORY CRP OF AMER HLDS	149	158	4,005	443,496	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
LAM RESEARCH	224	237	13,586	1,504,200	半導体・半導体製造装置		
LAMB WESTON HOLDINGS INC	217	239	1,886	208,819	食品		
LAS VEGAS SANDS CORP	538	586	3,587	397,171	ホテル・レストラン・レジャー		
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	344	378	11,155	1,235,071	パーソナル用品		
LEAR CORP	84	97	1,723	190,776	自動車部品		
LEGGETT & PLATT INC	189	—	—	—	家庭用耐久財		
LEIDOS HOLDINGS INC	215	215	2,078	230,100	情報技術サービス		
LENNAR CORP-A	430	465	4,732	523,964	家庭用耐久財		
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	57	1,802	199,574	建設関連製品		
LIBERTY BROADBAND CORP-A	—	40	588	65,159	メディア		
LIBERTY BROADBAND CORP-C	167	259	3,942	436,473	メディア		
LIBERTY SIRIUXM GROUP	129	129	571	63,253	メディア		
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	267	299	1,325	146,775	メディア		
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	293	340	1,478	163,664	娯楽		
ELI LILLY & CO.	1,353	1,427	26,470	2,930,587	医薬品		
LINCOLN NATIONAL CORP	299	299	1,875	207,584	保険		
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	230	266	2,220	245,868	娯楽		
LOCKHEED MARTIN	397	420	15,562	1,722,944	航空宇宙・防衛		
LOEWS CORP	433	431	2,270	251,320	保険		
LOWES COS INC	1,205	1,214	23,068	2,553,905	専門小売り		
LULULEMON ATHLETICA INC	172	208	6,595	730,184	繊維・アパレル・贅沢品		
LUMEN TECHNOLOGIES INC	—	1,470	1,944	215,309	各種電気通信サービス		
M & T BANK CORP	200	217	3,338	369,658	銀行		
MGМ RESORTS INTERNATIONAL	790	800	3,056	338,418	ホテル・レストラン・レジャー		
MSCI INC	131	137	5,728	634,173	資本市場		
MANPOWERGROUP INC	96	—	—	—	専門サービス		
MARATHON OIL CORP	1,230	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料		
MARATHON PETROLEUM CORP	985	1,060	5,681	629,009	石油・ガス・消耗燃料		
MARKEL CORP	21	23	2,693	298,239	保険		
MARKETAXESS HOLDINGS INC	58	61	3,038	336,441	資本市場		
MARSH & MCLENNAN COS	794	848	10,304	1,140,855	保険		
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	432	464	6,877	761,449	ホテル・レストラン・レジャー		
MARTIN MARIETTA MATERIALS	97	105	3,608	399,454	建設資材		
MASCO CORP	428	425	2,550	282,357	建設関連製品		
MASIMO CORP	—	82	1,854	205,285	ヘルスケア機器・用品		
MASTERCARD INC	1,403	1,474	52,798	5,845,341	情報技術サービス		
MATCH GROUP INC	84	—	—	—	インターネット・メディアおよびサービス		
MATCH GROUP INC	—	416	5,469	605,535	インターネット・メディアおよびサービス		
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	424	452	4,064	449,967	半導体・半導体製造装置		
MCCORMICK & CO INC.	189	402	3,613	400,103	食品		
MCDONALD'S CORP	1,179	1,236	27,807	3,078,571	ホテル・レストラン・レジャー		
MCKESSON CORP	256	262	5,149	570,055	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	340	340	681	75,433	ホテル・レストラン・レジャー		
MERCADOLIBRE INC	69	74	10,610	1,174,662	インターネットネット販売・通信販売		
MERCK & CO INC	3,983	4,193	32,269	3,572,537	医薬品		
METLIFE INC	1,206	1,254	7,704	852,973	保険		
METTLER-TOLEDO INTL	38	38	4,447	492,402	ライフサイエンス・ツール/サービス		

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	千米ドル	千円		
MICROSOFT CORP	11,321	11,902	275,947	30,550,188	ソフトウェア	
MICROCHIP TECHNOLOGY	373	427	6,409	709,617	半導体・半導体製造装置	
MICRON TECHNOLOGY	1,740	1,845	15,966	1,767,665	半導体・半導体製造装置	
MIDDLEBY CORP	87	—	—	—	機械	
MODERNA INC	—	463	5,486	607,364	バイオテクノロジー	
MOHAWK INDUSTRIES	87	102	1,989	220,236	家庭用耐久財	
MOLINA HEALTHCARE INC	—	97	2,281	252,578	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	284	314	1,643	181,949	飲料	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,259	2,386	14,024	1,552,697	食品	
MONGODB INC	74	88	2,285	253,002	情報技術サービス	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	69	2,363	261,704	半導体・半導体製造装置	
MONSTER BEVERAGE CORP	638	666	6,039	668,683	飲料	
MOODY'S CORP	268	283	8,420	932,189	資本市場	
MORGAN STANLEY	1,910	2,331	18,435	2,041,036	資本市場	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	450	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
MOSAIC CO/THE	560	560	1,755	194,300	化学	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	268	276	5,150	570,204	通信機器	
NRG ENERGY INC	405	405	1,502	166,302	電力	
NVR INC	5	5	2,630	291,246	家庭用耐久財	
NASDAQ INC	184	184	2,713	300,365	資本市場	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	580	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
NETAPP INC	352	352	2,542	281,440	コンピュータ・周辺機器	
NETFLIX INC	685	732	37,585	4,161,066	娯楽	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	142	142	1,338	148,184	バイオテクノロジー	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,840	1,840	916	101,445	不動産管理・開発	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	354	354	2,336	258,662	コングロマリット	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	333	403	1,331	147,456	コングロマリット	
NEWELL BRANDS INC	660	660	1,762	195,093	家庭用耐久財	
NEWMONT CORP	1,276	1,317	7,886	873,080	金属・鉱業	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	550	670	1,721	190,557	メディア	
NEXTERA ENERGY INC	765	3,252	24,136	2,672,134	電力	
NIKE INC-B	1,952	2,083	27,693	3,065,945	繊維・アパレル・贅沢品	
NISOURCE INC	582	650	1,559	172,635	総合公益事業	
NOBLE ENERGY INC	710	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
NORDSON CORP	—	87	1,775	196,517	機械	
NORDSTROM INC	150	—	—	—	複合小売り	
NORFOLK SOUTHERN CORP	403	418	11,298	1,250,815	陸運・鉄道	
NORTHERN TRUST CORP	321	321	3,435	380,326	資本市場	
NORTHROP GRUMMAN CORP	251	260	8,389	928,821	航空宇宙・防衛	
NORTONLIFELOCK INC	980	910	1,920	212,574	ソフトウェア	
NUCOR CORP	467	509	4,091	453,008	金属・鉱業	
NVIDIA CORP	909	1,025	52,815	5,847,189	半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	325	325	1,054	116,757	電力	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC,	119	118	6,023	666,807	専門小売り	
occidental PETE CORP	1,420	1,580	4,318	478,061	石油・ガス・消耗燃料	
OKTA INC	165	203	4,335	479,935	情報技術サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	153	153	3,681	407,560	陸運・鉄道	
OMNICOM GROUP	345	345	2,603	288,180	メディア	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	590	680	2,711	300,152	半導体・半導体製造装置	
ONEOK INC	670	740	3,719	411,757	石油・ガス・消耗燃料	
ORACLE CORPORATION	3,598	3,230	22,787	2,522,820	ソフトウェア	
OTIS WORLDWIDE CORP	—	696	4,853	537,375	機械	
OWENS CORNING INC	168	168	1,546	171,187	建設関連製品	
PG&E CORP	—	2,370	2,723	301,477	電力	

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	千米ドル	千円	
PNC FINANCIAL	689	698	12,397	1,372,568	銀行
PPG INDUSTRIES	368	398	6,081	673,232	化学
PPL CORPORATION	1,148	1,290	3,750	415,165	電力
PPD INC	—	200	754	83,497	ライフサイエンス・ツール/サービス
PVH CORP	116	—	—	—	織維・アパレル・贅沢品
PTC INC	170	187	2,468	273,276	ソフトウェア
PACCAR	538	583	5,440	602,323	機械
PACKAGING CORP OF AMERICA	145	161	2,180	241,430	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	152	156	4,960	549,227	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP	201	216	6,854	758,842	機械
PAYCHEX INC	505	548	5,437	602,019	情報技術サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	75	81	2,917	323,000	ソフトウェア
PAYPAL HOLDINGS INC	1,747	1,845	43,641	4,831,564	情報技術サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	—	402	4,308	476,964	レジャー用品
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	710	—	—	—	銀行
PEPSICO INC	2,182	2,290	32,641	3,613,758	飲料
PERKINELMER INC	174	188	2,401	265,850	ライフサイエンス・ツール/サービス
PFIZER INC	8,658	9,210	33,257	3,681,916	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,437	2,586	23,105	2,558,055	タバコ
PHILLIPS 66	703	711	5,852	647,901	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	170	191	1,541	170,687	電力
PINTEREST INC- CLASS A	460	847	5,870	649,929	インターネット・メディアおよびサービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	261	335	5,380	595,705	石油・ガス・消耗燃料
PLUG POWER INC	—	776	2,641	292,440	電気設備
POLARIS INC	83	—	—	—	レジャー用品
POOL CORP	—	65	2,225	246,374	販売
T ROWE PRICE GROUP INC	366	382	6,578	728,339	資本市場
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	444	444	2,692	298,077	保険
PROCTER & GAMBLE CO	3,899	4,109	55,656	6,161,720	家庭用品
PROGRESSIVE CO	920	961	9,182	1,016,578	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	630	666	6,132	678,932	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	781	858	5,131	568,130	総合公益事業
PULTEGROUP INC	379	430	2,268	251,117	家庭用耐久財
QORVO INC	176	194	3,446	381,509	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,791	1,868	24,304	2,690,756	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	205	219	2,813	311,530	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	211	211	1,976	218,811	化学
RALPH LAUREN CORPORATION	78	—	—	—	織維・アパレル・贅沢品
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	196	196	2,406	266,422	資本市場
RAYTHEON COMPANY	433	—	—	—	航空宇宙・防衛
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	2,506	19,501	2,159,032	航空宇宙・防衛
REGENERON PHARMACEUTICALS	127	175	8,246	912,929	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,500	1,620	3,387	375,021	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	90	105	1,347	149,235	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	343	361	3,625	401,381	商業サービス・用品
RESMED INC	225	245	4,638	513,483	ヘルスケア機器・用品
RINGCENTRAL INC-CLASS A	119	125	3,584	396,826	ソフトウェア
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	203	1,574	174,309	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	178	196	5,245	580,756	電気設備
ROKU INC	142	175	5,484	607,162	娯楽
ROLLINS INC	239	358	1,216	134,626	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	164	175	7,088	784,817	コングロマリット
ROSS STORES INC	561	598	7,198	796,970	専門小売り
S&P GLOBAL INC	384	396	13,970	1,546,628	資本市場

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	千米ドル	千円		
SEI INVESTMENTS COMPANY	191	191	1,171	129,707		資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	367	370	2,537	280,881		ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	81	87	4,268	472,592		銀行
SABRE CORP	420	—	—	—		情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC	1,304	1,508	31,668	3,505,964		ソフトウェア
SAREPTA THERAPEUTICS INC	112	126	921	101,970		バイオテクノロジー
HENRY SCHEIN INC	231	231	1,593	176,383		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	2,140	2,340	6,369	705,165		エネルギー・設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,797	2,539	16,442	1,820,356		資本市場
SEAGEN INC	—	207	2,846	315,131		バイオテクノロジー
SEALED AIR CORP	219	265	1,234	136,627		容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	187	—	—	—		バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	436	473	6,223	688,977		総合公益事業
SERVICENOW INC	296	323	15,763	1,745,137		ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	129	134	10,021	1,109,506		化学
SIGNATURE BANK	89	—	—	—		銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,290	1,750	1,071	118,570		メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	272	271	4,837	535,573		半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	—	761	3,082	341,213		ソフトウェア
SMITH (A.O.) CORP	218	218	1,508	166,988		建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	174	186	2,391	264,710		食品
SNAP-ON INC	84	84	1,949	215,788		機械
SNAP INC-A	1,170	1,522	7,550	835,931		インターラクティブ・メディアおよびサービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	39	866	95,882		情報技術サービス
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	—	82	2,223	246,174		半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO.	1,647	1,767	10,874	1,203,873		電力
SOUTHWEST AIRLINES	198	249	1,541	170,665		旅客航空輸送業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	146	—	—	—		航空宇宙・防衛
SPUNK INC	237	270	3,562	394,420		ソフトウェア
SPRINT CORP	1,290	—	—	—		無線通信サービス
SQUARE INC - A	531	636	13,535	1,498,569		情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	239	259	5,190	574,653		機械
STARBUCKS CORP	1,852	1,949	21,491	2,379,337		ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	559	596	5,144	569,500		資本市場
STEEL DYNAMICS	334	334	1,712	189,618		金属・鉱業
STRYKER CORP	529	565	13,735	1,520,618		ヘルスケア機器・用品
SUNRUN INC	—	185	1,071	118,627		電気設備
SYNOPSYS INC	239	255	6,109	676,415		ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	940	860	3,531	390,934		消費者金融
SYSCO CORP	758	813	6,495	719,067		食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	412	—	—	—		資本市場
TJX COS INC	1,898	2,003	13,323	1,475,095		専門小売り
T-MOBILE US INC	530	931	11,603	1,284,677		無線通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	181	194	3,435	380,349		娯楽
TAPESTRY INC	450	—	—	—		繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	788	836	16,690	1,847,831		複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	348	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
TELADOC HEALTH INC	—	193	3,372	373,367		ヘルスケア・テクノロジー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	57	58	2,349	260,126		航空宇宙・防衛
TELEFLEX INC	71	75	3,135	347,165		ヘルスケア機器・用品
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	100	1,682	186,236		ライフサイエンス・ツール/サービス
TERADYNE INC	250	272	3,154	349,191		半導体・半導体製造装置
TESLA INC	212	1,256	79,872	8,842,630		自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,670	1,730	1,960	217,001		医薬品

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	千米ドル	千円	
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,465	1,521	28,281	3,131,041	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	335	379	2,095	231,991	航空宇宙・防衛	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	68	4,293	475,337	ソフトウェア	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	628	655	29,571	3,273,836	ライフサイエンス・ツール/サービス	
3M CORP	902	956	18,607	2,060,045	コングロマリット	
TIFFANY & CO	169	—	—	—	専門小売り	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	178	195	3,452	382,223	専門小売り	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	164	1,201	133,014	資本市場	
TRANSDIGM GROUP INC	76	86	5,074	561,807	航空宇宙・防衛	
TRUNSION	290	311	2,788	308,741	専門サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	408	426	6,561	726,443	保険	
TRIMBLE INC	388	422	3,208	355,255	電子装置・機器・部品	
TRIPADVISOR INC	146	—	—	—	インターネット・メディアおよびサービス	
TRUIST FINANCIAL CORP	2,085	2,253	13,243	1,466,147	銀行	
TWILIO INC - A	186	233	7,483	828,549	情報技術サービス	
TWITTER INC	1,147	1,328	8,365	926,097	インターネット・メディアおよびサービス	
TYLER TECHNOLOGIES INC	61	65	2,700	298,988	ソフトウェア	
TYSON FOODS INC-CL A	469	501	3,805	421,262	食品	
UGI CORP	309	360	1,495	165,600	ガス	
US BANCORP	2,305	2,231	12,464	1,379,955	銀行	
UBER TECHNOLOGIES INC	655	1,615	8,633	955,846	陸運・鉄道	
ULTA BEAUTY INC	85	86	2,648	293,248	専門小売り	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	240	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	250	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
UNION PAC CORP	1,088	1,113	24,611	2,724,768	陸運・鉄道	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	92	—	—	—	旅客航空輸送業	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,099	1,174	19,798	2,191,873	航空貨物・物流サービス	
UNITED RENTALS INC	112	122	4,065	450,054	商社・流通業	
UNITED TECHNOLOGIES	1,286	—	—	—	航空宇宙・防衛	
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,482	1,572	58,723	6,501,293	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	118	130	1,770	196,008	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNUM GROUP	312	—	—	—	保険	
V F CORP	525	563	4,511	499,448	繊維・アパレル・贅沢品	
VAIL RESORTS INC	60	67	1,944	215,228	ホテル・レストラン・レジャー	
VALERO ENERGY CORP	628	665	4,773	528,459	石油・ガス・消耗燃料	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	142	153	2,707	299,695	ヘルスケア機器・用品	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	207	227	5,662	626,846	ヘルスケア・テクノロジー	
VERISIGN INC	162	176	3,429	379,703	情報技術サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS	6,468	6,857	40,175	4,447,792	各種電気通信サービス	
VERISK ANALYTICS INC	242	260	4,574	506,465	専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS	404	436	9,286	1,028,093	バイオテクノロジー	
VIACOMCBS INC-CLASS B	880	951	4,432	490,734	メディア	
VIATRIS INC	—	2,007	2,840	314,441	医薬品	
VISA INC-CLASS A SHARES	2,678	2,804	59,416	6,578,029	情報技術サービス	
VISTRA CORP	590	700	1,246	138,022	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
VMWARE INC - CLASS A	130	142	2,132	236,110	ソフトウェア	
VOYA FINANCIAL INC	217	217	1,381	152,913	各種金融サービス	
VULCAN MATERIALS CO	208	223	3,840	425,207	建設資材	
WABCO HOLDINGS INC	81	—	—	—	機械	
WEC ENERGY GROUP INC	498	536	5,005	554,181	総合公益事業	
WABTEC CORP	288	288	2,295	254,183	機械	
WALMART INC	2,225	2,348	31,871	3,528,521	食品・生活必需品小売り	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,182	1,203	6,373	705,609	食品・生活必需品小売り	
WASTE CONNECTIONS INC	403	445	4,794	530,791	商業サービス・用品	

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)							
WASTE MANAGEMENT INC	百株	百株	千米ドル	千円			
WATERS CORP	668	693	8,959	991,862	商業サービス・用品		
WAYFAIR INC - CLASS A	103	105	2,966	328,405	ライフサイエンス・ツール/サービス		
WELLS FARGO CO	86	115	3,645	403,618	インターネット販売・通信販売		
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	6,291	6,500	25,603	2,834,563	銀行		
WESTERN DIGITAL CORP	118	124	3,451	382,106	ヘルスケア機器・用品		
WESTERN UNION CO	476	516	3,377	373,949	コンピュータ・周辺機器		
WESTLAKE CHEMICAL CORP	660	660	1,639	181,502	情報技術サービス		
WESTROCK CO	50	—	—	—	化学		
WHIRLPOOL CORP	387	432	2,299	254,533	容器・包装		
WILLIAMS COS	94	103	2,268	251,142	家庭用耐久財		
WORKDAY INC-CLASS A	1,910	1,980	4,688	519,079	石油・ガス・消耗燃料		
WYNN RESORTS LTD	254	291	7,077	783,604	ソフトウェア		
XPO LOGISTICS INC	155	171	2,145	237,494	ホテル・レストラン・レジャー		
XCEL ENERGY INC	143	143	1,774	196,405	航空貨物・物流サービス		
XILINX INC	812	885	5,841	646,755	電力		
XYLEM INC	399	412	4,956	548,718	半導体・半導体製造装置		
XEROX HOLDINGS CORP	278	303	3,177	351,821	機械		
YUM BRANDS INC	289	—	—	—	コンピュータ・周辺機器		
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	471	508	5,576	617,353	ホテル・レストラン・レジャー		
ZENDESK INC	84	89	4,225	467,859	電子装置・機器・部品		
ZILLLOW GROUP INC - A	—	188	2,399	265,663	ソフトウェア		
ZILLLOW GROUP INC - C	202	246	3,044	337,056	インターネット・メディアおよびサービス		
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	319	349	5,626	622,918	ヘルスケア機器・用品		
ZIONS BANCORP NA	275	—	—	—	銀行		
ZOETIS INC	740	794	12,468	1,380,440	医薬品		
ZSCALER INC	—	119	1,972	218,419	ソフトウェア		
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	323	10,116	1,119,946	ソフトウェア		
ALLEGION PLC	148	148	1,854	205,288	建設関連製品		
ALLERGAN PLC	510	—	—	—	医薬品		
AMCOR PLC	2,500	2,680	3,146	348,329	容器・包装		
AON PLC	—	375	8,703	963,550	保険		
AON PLC	369	—	—	—	保険		
ARCH CAPITAL GROUP LTD	639	650	2,545	281,801	保険		
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	212	212	1,066	118,033	保険		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	292	360	1,064	117,853	化学		
ACCENTURE PLC-CL A	995	1,050	29,247	3,238,018	情報技術サービス		
BUNGE LIMITED	220	220	1,755	194,386	食品		
CAPRI HOLDINGS LTD	199	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品		
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	351	326	1,681	186,123	飲料		
EATON CORP PLC	645	654	9,133	1,011,199	電気設備		
EVEREST RE GROUP LTD	62	62	1,576	174,545	保険		
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	359	3,127	346,297	医薬品		
IHS MARKIT LTD	593	638	6,182	684,504	専門サービス		
INVESCO LTD	580	680	1,692	187,378	資本市場		
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	90	90	1,498	165,888	医薬品		
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,200	1,185	7,196	796,725	建設関連製品		
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	609	67,435	各種電気通信サービス		
LIBERTY GLOBAL PLC-C	640	640	1,616	178,978	各種電気通信サービス		
LINDE PLC	842	872	24,351	2,695,951	化学		
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	990	1,128	5,338	591,061	半導体・半導体製造装置		
MEDTRONIC PLC	2,099	2,230	26,499	2,933,714	ヘルスケア機器・用品		
APTIV PLC	392	454	6,232	690,051	自動車部品		
NIELSEN HOLDINGS PLC	540	—	—	—	専門サービス		

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)						
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDING	百株	百株	千米ドル	千円		
330	—	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
NOVOCURE LTD	—	140	1,753	194,129		ヘルスケア機器・用品
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	67	78	1,284	142,181		保険
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	—	289	1,260	139,595		医薬品
SEAGATE TECHNOLOGY	373	373	2,823	312,601		コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	232	275	1,707	189,004		機械
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	245	245	1,419	157,101		電気設備
STERIS PLC	129	138	2,622	290,327		ヘルスケア機器・用品
TECHNIFFM PLC	610	—	—	—		エネルギー設備・サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC	376	403	6,728	744,866		建設関連製品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	202	218	5,064	560,675		保険
PERRIGO CO PLC	196	—	—	—		医薬品
CHUBB LTD	712	743	12,000	1,328,541		保険
GARMIN LTD	205	242	3,163	350,249		家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	524	554	7,062	781,877		電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	189	187	2,139	236,901		ソフトウェア
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	55	71	904	100,102		ソフトウェア
WIX.COM LTD	77	94	2,509	277,849		情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	170	—	—	—		商社・流通業
LYONDELLBASELL INDU-CL A	421	452	4,747	525,579		化学
MYLAN NV	770	—	—	—		医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV	432	468	9,255	1,024,691		半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	266	386	3,294	364,735		ホテル・レストラン・レジャー
FLEX LTD	760	—	—	—		電子装置・機器・部品
小計	株数・金額	465,696	519,005	5,756,681	637,322,181	
銘柄	数比率	608	593	<68.7%>		
(カナダ)						
AGNICO EAGLE MINES LTD	377	410	2,938	257,938		金属・鉱業
AIR CANADA	204	320	853	74,943		旅客航空輸送業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	850	970	1,918	168,419		総合公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	1,342	1,450	5,955	522,743		食品・生活必需品小売
ALTAGAS LTD	420	420	878	77,127		ガス
ATCO LTD CL1	130	130	545	47,848		総合公益事業
AURORA CANNABIS INC	2,000	—	—	—		医薬品
BCE INC	227	256	1,474	129,436		各種電気通信サービス
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	370	1,064	93,408		電気設備
BANK OF MONTREAL	990	1,056	11,950	1,049,037		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,893	1,994	15,862	1,392,390		銀行
BARRICK GOLD	2,770	2,990	7,367	646,706		金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC	510	510	2,000	175,624		医薬品
BLACKBERRY LTD	710	940	1,107	97,200		ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS	2,800	—	—	—		航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT-CL A	1,402	2,108	12,076	1,060,095		資本市場
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	187	1,094	96,069		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
B2GOLD CORP	—	1,750	931	81,723		金属・鉱業
CAE INC	410	500	1,791	157,213		航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	247	247	1,721	151,077		容器・包装
CGI INC	384	372	3,869	339,701		情報技術サービス
CI FINANCIAL CORP	336	—	—	—		資本市場
CAMECO CORP	560	720	1,460	128,172		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	696	750	9,312	817,407		銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,124	1,186	17,378	1,525,481		陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,870	1,990	7,709	676,718		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	213	221	10,326	906,474		陸運・鉄道

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	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	86	102	1,811	158,970	複合小売り	
CANADIAN UTILITIES LTD A	203	203	689	60,514	総合公益事業	
CANOPY GROWTH CORP	330	350	1,406	123,445	医薬品	
CENOVUS ENERGY INC	1,560	2,160	2,075	182,210	石油・ガス・消耗燃料	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	32	34	5,956	522,896	ソフトウェア	
CRONOS GROUP INC	250	—	—	—	医薬品	
DOLLARAMA INC	466	466	2,434	213,690	複合小売り	
EMERA INC	379	425	2,374	208,431	電力	
EMPIRE CO LTD A	260	260	1,027	90,150	食品・生活必需品小売り	
ENBRIDGE INC	3,178	3,330	15,397	1,351,629	石油・ガス・消耗燃料	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	41	41	2,301	202,055	保険	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	990	930	2,250	197,557	金属・鉱業	
FIRSTSERVICE CORP	—	60	1,106	97,151	不動産管理・開発	
FORTIS INC	682	—	—	—	電力	
FORTIS INC	—	753	4,109	360,764	電力	
FRANCO-NEVADA CORP	293	323	5,048	443,184	金属・鉱業	
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	—	300	1,294	113,631	商業サービス・用品	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	318	318	1,227	107,748	繊維・アパレル・贅沢品	
GREAT-WEST LIFECO INC	420	420	1,411	123,875	保険	
HUSKY ENERGY INC	520	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
HYDRO ONE LTD	490	550	1,625	142,664	電力	
IGM FINANCIAL INC	150	150	575	50,548	資本市場	
IA FINANCIAL CORP INC	183	183	1,267	111,241	保険	
IMPERIAL OIL	375	375	1,164	102,241	石油・ガス・消耗燃料	
INTACT FINANCIAL CORP	215	245	3,773	331,258	保険	
INTER PIPELINE LTD	600	750	1,356	119,095	石油・ガス・消耗燃料	
KEYERA CORP	340	340	889	78,075	石油・ガス・消耗燃料	
KINROSS GOLD CORP	1,980	2,170	1,768	155,243	金属・鉱業	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	441	427	1,720	151,052	金属・鉱業	
LOBLAW COMPANIES	285	285	2,000	175,621	食品・生活必需品小売り	
LUNDIN MINING CORP	950	1,180	1,522	133,618	金属・鉱業	
MAGNA INTERNATIONAL INC	451	482	5,398	473,913	自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	3,030	3,260	8,883	779,793	保険	
METHANEX CORP	86	—	—	—	化学	
METRO INC	396	435	2,522	221,430	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	523	550	4,716	414,040	銀行	
NORTHLAND POWER INC	—	300	1,344	118,055	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
NUTRIEN LTD	900	961	6,617	580,879	化学	
ONEX CORPORATION	132	132	1,037	91,085	各種金融サービス	
OPEN TEXT CORP	417	470	2,812	246,879	ソフトウェア	
OVINTIV INC	410	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	353	1,307	114,773	金属・鉱業	
PARKLAND FUEL CORP	217	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
PARKLAND CORP	—	217	832	73,088	石油・ガス・消耗燃料	
PEMBINA PIPELINE CORP	880	880	3,173	278,550	石油・ガス・消耗燃料	
POWER CORPORATION OF CANADA	869	970	3,218	282,516	保険	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	310	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
QUEBECOR INC-CL B	270	270	935	82,075	メディア	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	433	494	4,096	359,612	ホテル・レストラン・レジャー	
ITCHIE BROS. AUCTIONEERS	—	183	1,344	117,988	商業サービス・用品	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	555	582	3,471	304,688	無線通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	2,248	2,348	27,504	2,414,342	銀行	
SSR MINING INC	—	340	592	52,050	金属・鉱業	
SAPUTO INC	366	410	1,545	135,681	食品	

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	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	770	770	—	2,562	224,941	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	163	182	—	24,159	2,120,762	情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE	380	—	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC	923	988	—	6,332	555,831	保険
SUNCOR ENERGY INC	2,440	2,490	—	6,635	582,494	石油・ガス・消耗燃料
TMX GROUP LTD	—	95	—	1,228	107,874	資本市場
TC ENERGY CORP	1,470	1,580	—	9,222	809,547	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B	820	790	—	1,926	169,135	金属・鉱業
TELUS CORP	586	586	—	1,481	130,037	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	317	278	—	3,076	270,066	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	128	—	1,220	107,111	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK	2,841	3,007	—	24,846	2,181,055	銀行
WSP GLOBAL INC	157	198	—	2,356	206,896	建設・土木
WEST FRASER TIMBER	84	140	—	1,169	102,651	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE) LTD	123	123	—	1,376	120,871	食品・生活必需品小売
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	716	761	—	3,622	317,970	金属・鉱業
YAMANA GOLD INC	—	1,640	—	877	77,018	金属・鉱業
小計	株数	・	金額	62,765	66,371	32,007,240
	銘柄	比	率	84	87	<3.5%>
(イギリス)				千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	590	620	—	1,048	159,600	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP PLC	687	735	—	3,174	483,248	商社・流通業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,590	1,590	—	1,203	183,277	家庭用耐久財
AVIVA PLC	6,040	6,700	—	2,761	420,419	保険
DIAGEO PLC	3,681	3,901	—	11,820	1,799,363	飲料
SCHRODERS PLC	197	197	—	678	103,313	資本市場
DCC PLC	160	160	—	1,009	153,691	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	5,020	5,470	—	2,806	427,174	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,597	3,830	—	10,609	1,615,023	タバコ
HALMA PLC	590	650	—	1,532	233,223	電子装置・機器・部品
STANDARD CHARTERED PLC	4,140	4,430	—	2,275	346,361	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	1,490	1,610	—	2,409	366,777	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	31,810	33,620	—	14,478	2,204,054	銀行
LEGAL & GENERAL	9,400	10,100	—	2,884	439,116	保険
MEGGITT PLC	1,110	—	—	—	—	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	3,700	3,700	—	673	102,539	食品・生活必需品小売
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	541	620	—	1,501	228,500	食品
PEARSON	1,260	1,260	—	976	148,652	メディア
PERSIMMON PLC	480	526	—	1,565	238,297	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	4,100	4,280	—	6,751	1,027,811	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,749	1,850	—	10,319	1,570,907	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	810	950	—	1,214	184,894	資本市場
SSE PLC	1,650	1,770	—	2,539	386,521	電力
BP PLC	31,780	33,390	—	10,067	1,532,512	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	110,500	115,900	—	4,995	760,432	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	5,000	6,200	—	1,134	172,767	家庭用耐久財
TESCO PLC	15,300	—	—	—	—	食品・生活必需品小売
SMITH & NEPHEW PLC	1,370	1,500	—	2,064	314,316	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	7,820	8,270	—	10,808	1,645,437	医薬品
WEIR GROUP PLC	380	—	—	—	—	機械
ASTRAZENECA PLC	2,055	2,179	—	15,882	2,417,828	医薬品
BT GROUP PLC	12,900	15,300	—	2,351	357,985	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	229	—	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	3,100	—	—	—	—	複合小売

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	千英ポンド	千円	
BARCLAYS PLC	27,400	29,200	5,522	840,749		銀行
INTERTEK GROUP PLC	256	256	1,433	218,236		専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	660	660	1,277	194,513		織維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	198	219	1,758	267,640		複合小売
KINGFISHER PLC	3,080	3,490	1,140	173,623		専門小売
ITV PLC	5,000	—	—	—		メディア
SAINSBURY	2,550	2,990	730	111,242		食品・生活必需品小売
G4S PLC	2,190	—	—	—		商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	308	308	936	142,489		保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	195	195	872	132,750		家庭用耐久財
CENTRICA PLC	9,200	—	—	—		総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	6,560	6,760	9,774	1,488,042		石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	5,860	6,100	8,348	1,270,886		石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	500	550	1,266	192,738		商社・流通業
RENTOKIL INTIAL PLC	2,850	3,180	1,544	235,123		商業サービス・用品
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	296	651	99,132		医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	492	532	3,678	559,939		資本市場
UNILEVER PLC	1,742	4,342	17,637	2,684,911		パーソナル用品
TUI AG-DI	700	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
EXPERIAN PLC	1,411	1,529	3,837	584,226		専門サービス
MONDI PLC	750	840	1,606	244,621		紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	370	370	848	129,209		水道
WHITBREAD PLC	211	316	1,090	166,079		ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	520	520	808	123,093		資本市場
SMITHS GROUP PLC	610	610	937	142,679		コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,600	2,060	5,911	899,857		金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,550	1,670	1,949	296,806		資本市場
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,102	1,190	7,725	1,176,049		家庭用品
RELX PLC	3,000	3,240	5,900	898,163		専門サービス
FRESNILLO PLC	—	300	257	39,156		金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,060	1,060	972	148,099		水道
OCADO GROUP PLC	720	830	1,684	256,492		インターネット販売・通信販売
GLENCORE PLC	17,000	16,800	4,805	731,562		金属・鉱業
ENTAIN PLC	870	1,020	1,562	237,880		ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,770	13,800	1,497	228,039		航空宇宙・防衛
EVRAZ PLC	760	760	435	66,339		金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	133	133	3	485		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EASYJET PLC	210	—	—	—		旅客航空輸送業
NATWEST GROUP PLC	7,700	7,700	1,519	231,269		銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,750	1,750	1,060	161,493		ソフトウェア
WPP PLC	2,000	2,000	1,894	288,445		メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	290	340	796	121,269		飲料
AVEVA GROUP PLC	112	199	669	101,843		ソフトウェア
COMPASS GROUP PLC	2,510	2,920	4,311	656,321		ホテル・レストラン・レジャー
NATIONAL GRID PLC	5,480	5,910	5,064	771,025		総合公益事業
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,660	3,660	1,063	161,911		資本市場
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	890	658	100,258		保険
BHP GROUP PLC	3,290	3,470	7,306	1,112,205		金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	42,100	45,000	6,033	918,494		無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	258	288	1,442	219,649		ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	481	—	—	—		ソフトウェア
CRODA INTERNATIONAL PLC	193	223	1,419	216,108		化学
FERGUSON PLC	346	366	3,218	489,968		商社・流通業
M&G PLC	3,780	4,400	921	140,258		各種金融サービス

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	千英ポンド	千円		
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,620	1,620	1,103	167,992	保険		
TESCO PLC	—	13,026	2,994	455,890	食品・生活必需品小売り		
INFORMA PLC	1,860	2,480	1,410	214,663	メディア		
AUTO TRADER GROUP PLC	1,410	1,710	950	144,734	インターネット・メディアおよびサービス		
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	116	116	1,333	202,986	機械		
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	2,190	2,190	690	105,082	保険		
JD SPORTS FASHION PLC	760	930	776	118,214	専門小売り		
MELROSE INDUSTRIES PLC	7,300	8,500	1,459	222,236	コングロマリット		
JOHNSON MATTHEY PLC	302	302	933	142,149	化学		
小計	株数	・金額	468,722	487,424	278,981	42,469,387	
	銘柄数	<比率>	93	86	<4.6%>		
(スイス)			千スイスフラン				
SGS SA-REG	9	9	2,665	313,074	専門サービス		
BARRY CALLEBAUT AG	4	4	984	115,617	食品		
SWISSCOM AG-REG	40	44	2,258	265,298	各種電気通信サービス		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	1,470	172,753	食品		
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.17	0.16	1,406	165,181	食品		
GIVAUDAN-REG	14	15	5,607	658,647	化学		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	235	251	10,322	1,212,344	保険		
NOVARTIS AG-REG	3,361	3,670	30,042	3,528,505	医薬品		
ABB LTD	2,850	3,030	8,641	1,014,951	電気設備		
ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	—	53	1,691	198,697	医薬品		
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	1,098	1,164	35,368	4,153,988	医薬品		
ADECCO GROUP AG-REG	249	249	1,609	189,040	専門サービス		
LAFARGEHOLCIM LTD	774	884	4,955	582,047	建設資材		
CLARIANT AG-REG	320	320	618	72,668	化学		
NESTLE SA-REG	4,652	4,774	50,575	5,940,122	食品		
BALOISE HOLDING AG	74	74	1,209	142,102	保険		
TEMENOS AG-REG	104	104	1,417	166,426	ソフトウェア		
SONOVA HOLDING AG-REG	88	88	2,231	262,069	ヘルスケア機器・用品		
STRAUmann HOLDING AG-REG	16	17	2,063	242,401	ヘルスケア機器・用品		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,960	4,120	4,290	503,975	資本市場		
THE SWATCH GROUP AG-B	47	47	1,306	153,460	繊維・アパレル・贅沢品		
THE SWATCH GROUP AG-REG	74	74	398	46,846	繊維・アパレル・贅沢品		
LONZA AG-REG	115	121	6,438	756,183	ライフサイエンス・ツール/サービス		
SWISS LIFE HOLDING AG	51	52	2,454	288,274	保険		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	12	14	1,215	142,744	化学		
SWISS PRIME SITE-REG	114	135	1,190	139,847	不動産管理・開発		
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	58	—	—	—	各種金融サービス		
DUFRY AG-REG	65	—	—	—	専門小売り		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	29	31	3,868	454,412	資本市場		
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	61	67	1,881	220,965	機械		
SCHINDLER HOLDING AG-REG	30	30	823	96,684	機械		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	84	84	2,283	268,251	海運業		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	270	2,614	307,094	コンピュータ・周辺機器		
GEBERIT AG-REG	56	62	3,799	446,239	建設関連製品		
JULIUS BAER GROUP LTD	358	358	2,195	257,832	資本市場		
SWISS RE LTD	462	483	4,567	536,423	保険		
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	815	857	7,934	931,860	繊維・アパレル・贅沢品		
SIKA AG-REG	199	238	6,392	750,820	化学		
ALCON INC	659	827	5,507	646,893	ヘルスケア機器・用品		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	54	505	59,427	銀行		
UBS GROUP AG	6,010	6,020	8,843	1,038,654	資本市場		

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	
(スイス) VIFOR PHARMA AG		百株 67	百株 76	千スイスフラン 983	千円 115,460	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	27,221	28,779	234,638	27,558,293	
(スウェーデン)		39	40	—	<3.0%>	
LUNDBERGS AB-B SHS		126	126	6,002	76,173	各種金融サービス
SKANDINAViska ENSKILDA BANKEN AB		2,510	2,670	29,757	377,618	銀行
SWEDBANK AB		1,370	1,480	22,999	291,859	銀行
SWEDISH MATCH AB		260	260	17,643	223,897	タバコ
SECURITAS AB-B SHS		450	540	8,059	102,275	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		715	767	53,429	678,016	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B		1,270	1,300	26,442	335,548	専門小売り
ERICSSON LM-B		4,740	4,910	56,956	722,771	通信機器
TELIA CO AB		4,300	4,280	16,169	205,195	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		510	600	13,830	175,502	建設・土木
LUNDIN ENERGY AB		288	288	8,127	103,136	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB		510	510	13,739	174,352	機械
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR		158	—	—	—	無線通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		—	151	6,570	83,373	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB		138	171	7,281	92,398	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		550	730	9,011	114,360	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B		340	340	8,136	103,248	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES		580	600	14,844	188,370	機械
VOLVO AB-B SHS		2,340	2,330	51,819	657,585	機械
SANDVIK AB		1,780	1,840	44,086	559,456	機械
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		—	150	4,872	61,825	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		250	250	7,735	98,157	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B		—	1,000	16,190	205,451	紙製品・林產品
HEXAGON AB-B SHS		423	456	36,270	460,269	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS		780	780	9,090	115,363	無線通信サービス
ATLAS COPCO AB-A		1,045	1,129	60,266	764,775	機械
ATLAS COPCO AB-B		627	627	28,653	363,617	機械
EPIROC AB - A		1,030	1,130	22,068	280,054	機械
EPIROC AB - B		580	690	12,361	156,865	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B		925	1,030	28,160	357,352	家庭用品
EQT AB		—	420	11,915	151,206	資本市場
BOLIDEN AB		440	440	14,449	183,365	金属・鉱業
EVOLUTION GAMING GROUP		—	273	34,520	438,069	ホテル・レストラン・レジャー
KINNEVIK AB - B		390	—	—	—	各種金融サービス
KINNEVIK AB - B		—	390	16,440	208,629	各種金融サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A		2,430	2,670	25,583	324,660	銀行
ASSA ABLOY AB-B		1,590	1,700	42,534	539,756	建設関連製品
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		—	510	13,708	173,964	建設関連製品
NORDEA BANK ABP		5,150	5,480	47,599	604,034	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		—	260	5,876	74,566	コングロマリット
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	38,595	43,278	853,201	10,827,128	
(ノルウェー)		32	38	—	<1.2%>	
DNB ASA		1,450	1,550	28,287	366,606	銀行
TELENOR ASA		1,160	1,160	17,469	226,406	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA-CL A		—	106	3,826	49,592	メディア
EQUINOR ASA		1,580	1,600	26,976	349,608	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		262	296	13,237	171,553	化学
MOWI ASA		690	700	14,756	191,237	食品
NORSK HYDRO		2,180	2,180	11,645	150,926	金属・鉱業

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		
(ノルウェー)		百株	百株	千円		
AKER AB ASA		180	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA		1,150	1,330	11,278	146,168	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		310	310	6,212	80,512	保険
ADEVINTA ASA		—	450	5,710	74,008	インターネット・メディアおよびサービス
SCHIBSTED ASA-B SHS		129	181	5,654	73,281	メディア
小計	株数・金額	9,091	9,863	145,054	1,879,901	
	銘柄数 <比率>	10	11	—	<0.2%>	
(デンマーク)		千デンマーククローネ				
CARLSBERG B		162	168	16,574	289,231	飲料
AP MOLLER-MAERSK A/S-B		10	10	15,262	266,321	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A		6	5	7,683	134,071	海運業
GN STORE NORD A/S		—	212	10,472	182,750	ヘルスケア機器・用品
DANSKE BANK AS		970	1,090	13,134	229,197	銀行
GENMAB A/S		100	110	22,330	389,660	バイオテクノロジー
ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS		—	11	2,947	51,439	建設関連製品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		298	332	41,334	721,278	電気設備
H LUNDBECK A/S		105	105	2,283	39,851	医薬品
DSV PANALPINA A S		325	338	41,016	715,734	航空貨物・物流サービス
PANDORA A/S		160	160	10,854	189,409	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S		167	182	10,326	180,200	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		337	337	13,530	236,108	化学
COLOPLAST-B		185	194	18,433	321,671	ヘルスケア機器・用品
AMBU A/S-B		—	290	8,146	142,149	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		2,772	2,842	122,404	2,135,966	医薬品
ISS A/S		218	—	—	—	商業サービス・用品
TRYG A/S-NEW		—	326	4,893	85,389	保険
TRYG A/S		199	280	4,194	73,192	保険
ORSTED A/S		300	318	31,761	554,244	電力
DEMANIT A/S		160	160	4,248	74,127	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額	6,474	7,472	401,833	7,011,995	
	銘柄数 <比率>	17	20	—	<0.8%>	
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ				
ADIDAS AG		281	313	8,294	1,076,626	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		642	673	2,563	332,736	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		168	168	563	73,160	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		105	105	437	56,805	化学
HANNOVER RUECK SE		96	96	1,509	195,883	保険
GEA GROUP AG		242	242	848	110,097	機械
CONTINENTAL AG		175	189	2,144	278,317	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		1,534	1,659	7,730	1,003,476	航空貨物・物流サービス
MERCK KGAA		199	211	3,079	399,724	医薬品
RWE AG		931	1,085	3,515	456,298	総合公益事業
SAP SE		1,539	1,724	17,853	2,317,415	ソフトウェア
E.ON SE		3,550	3,800	3,708	481,303	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		163	180	1,518	197,075	家庭用品
PUMA SE		126	163	1,341	174,167	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG		1,543	1,616	8,686	1,127,442	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		277	289	2,779	360,792	家庭用品
BASF SE		1,445	1,512	10,868	1,410,699	化学
BEIERSDORF AG		160	160	1,440	186,995	パーソナル用品
HOCHTIEF AG		38	38	286	37,140	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG		226	249	1,951	253,261	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE		333	366	2,307	299,482	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG		654	680	14,895	1,933,422	保険

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…ドイツ)						
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	百株	百株	千ユーロ	千円		
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	420	560	640	83,191	旅客航空輸送業	
VOLKSWAGEN AG	228	229	6,068	787,691	保険	
VOLKSWAGEN AG-PREF	51	51	1,608	208,788	自動車	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	289	312	7,505	974,169	自動車	
NEMETSCHKE SE	1,403	1,431	10,867	1,410,538	自動車	
THYSSENKRUPP AG	—	92	496	64,484	ソフトウェア	
SIEMENS AG	620	—	—	—	金属・鉱業	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,201	1,263	17,818	2,312,828	コングロマリット	
BAIER MOTOREN WERK	3,140	3,340	3,440	446,537	資本市場	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	521	559	4,963	644,316	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	78	102	691	89,698	自動車	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,180	5,580	9,550	1,239,612	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	53	57	2,426	314,896	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	1,990	2,188	7,775	1,009,202	ヘルスケア機器・用品	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	—	8	568	73,743	機械	
BECHTLE AG	60	72	920	119,436	ヘルスケア機器・用品	
DEUTSCHE BOERSE AG	—	44	696	90,465	情報技術サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	295	320	4,528	587,734	資本市場	
FRAPORT AG	227	254	2,342	304,041	自動車	
WIRECARD AG	63	—	—	—	運送インフラ	
LANXESS	180	—	—	—	情報技術サービス	
MTU AERO ENGINES AG	120	127	813	105,567	化学	
DEUTSCHE WOHNEN SE	84	92	1,851	240,384	航空宇宙・防衛	
SYMRISE AG	562	555	2,200	285,562	不動産管理・開発	
BRENNTAG SE	198	209	2,146	278,606	化学	
EVONIK INDUSTRIES AG	238	268	1,972	256,027	商社・流通業	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	330	330	1,005	130,558	化学	
COMMERZBANK AG	1,500	1,500	374	48,558	各種電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	1,580	1,580	838	108,899	銀行	
KION GROUP AG	—	125	1,408	182,855	不動産管理・開発	
VONOVIA SE	99	110	918	119,221	機械	
KNORR-BREMSE AG	795	878	4,883	633,869	不動産管理・開発	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	71	127	1,348	175,066	機械	
METRO AG	239	460	2,096	272,149	ヘルスケア機器・用品	
TEAMVIEWER AG	250	—	—	—	食品・生活必需品小売	
SIEMENS ENERGY AG	—	252	898	116,577	ソフトウェア	
ZALANDO SE	—	660	2,002	259,916	電気設備	
SCOUT24 AG	215	249	2,059	267,288	インターネット販売・通信販売	
COVESTRO AG	—	171	1,102	143,162	インターネット・メディアおよびサービス	
HELLOFRESH SE	269	305	1,775	230,407	化学	
QIAGEN N.V.	—	240	1,466	190,338	インターネット販売・通信販売	
UNIPER SE	354	394	1,609	208,962	ライフサイエンス・ツール/サービス	
DELIVERY HERO SE	311	311	965	125,301	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
	179	221	2,418	313,966	インターネット販売・通信販売	
小計	株数	金額	37,820	41,145	217,387	28,216,956
	銘柄	数	比	率	<3.0%>	
小計	株数	金額	58	62	<3.0%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	1,750	1,880	3,222	418,257	保険	
INTESA SANPAOLO	23,300	27,800	6,459	838,421	銀行	
MEDIOBANCA S.P.A.	880	1,070	1,032	133,997	銀行	
ENEL SPA	12,630	13,580	11,452	1,486,471	電力	
ENI SPA	4,030	4,110	4,279	555,457	石油・ガス・消耗燃料	
SNAM SPA	3,200	3,500	1,653	214,565	ガス	
TENARIS SA	710	710	685	89,006	エネルギー設備・サービス	

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)						
TELECOM ITALIA SPA	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELECOM ITALIA-RNC	15,500	11,700	538	69,934	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	8,800	8,800	431	55,992	各種電気通信サービス	
TERNA SPA	790	790	1,262	163,862	運送インフラ	
RECORDATI SPA	2,220	2,220	1,434	186,148	電力	
LEONARDO SPA	168	168	764	99,175	医薬品	
AMPLIFON SPA	640	—	—	—	航空宇宙・防衛	
PRYSMIAN SPA	—	203	649	84,265	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
DIASORIN SPA	370	430	1,168	151,646	電気設備	
FERRARI NV	189	213	3,731	484,382	ヘルスケア機器・用品	
CNH INDUSTRIAL NV	1,540	1,700	2,289	297,118	自動車	
MONCLER SPA	281	321	1,579	205,037	機械	
NEXI SPA	—	740	1,082	140,572	繊維・アパレル・贅沢品	
STELLANTIS NV	—	3,340	5,044	654,778	情報技術サービス	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	910	1,010	1,414	183,537	自動車	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,700	—	—	—	銀行	
UNICREDIT SPA	3,130	3,610	3,299	428,327	自動車	
EXOR NV	172	172	1,228	159,404	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	770	880	955	123,990	各種金融サービス	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	550	516	66,999	保険	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	910	—	—	—	各種電気通信サービス	
PIRELLI & C. SPA	530	—	—	—	飲料	
	85,120	89,537	56,724	7,362,843	自動車部品	
小計	株数・金額					
	銘柄	株数	比	率	<0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	348	400	1,377	178,812	建設・土木	
AIRBUS SE	918	968	9,457	1,227,565	航空宇宙・防衛	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	820	870	1,875	243,468	総合公益事業	
LOREAL-ORD	394	420	13,767	1,787,034	パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	435	460	26,381	3,424,253	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT AVIATION SA	3	3	311	40,371	航空宇宙・防衛	
THALES SA	163	186	1,584	205,696	航空宇宙・防衛	
CAPGEMINI SA	245	273	3,958	513,813	情報技術サービス	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	83	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	95	—	—	—	電子装置・機器・部品	
PUBLICIS GROUPE	321	380	2,020	262,305	メディア	
FAURECIA	105	150	673	87,400	自動車部品	
BOLLORE	1,380	1,380	563	73,082	娯楽	
MICHELIN (CGDE)	267	287	3,709	481,489	自動車部品	
PERNOD RICARD SA	335	343	5,530	717,907	飲料	
RENAULT SA	281	337	1,268	164,669	自動車	
REMY COINTREAU	40	39	622	80,742	飲料	
SEB SA	38	41	630	81,872	家庭用耐久財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	869	887	11,375	1,476,575	電気設備	
VIVENDI SA	1,300	1,400	3,907	507,180	娯楽	
ORANGE SA	3,120	3,250	3,432	445,473	各種電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	50	53	5,049	655,443	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT SYSTEMES SA	209	223	4,032	523,477	ソフトウェア	
KERING SA	117	127	7,498	973,250	繊維・アパレル・贅沢品	
CNP ASSURANCES	280	280	461	59,894	保険	
CARREFOUR SUPERMARCHE	950	950	1,457	189,219	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	153	153	1,009	131,072	情報技術サービス	
SANOFI	1,767	1,869	15,673	2,034,411	医薬品	
ACCOR SA	262	320	1,041	135,241	ホテル・レストラン・レジャー	

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…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
STMICROELECTRONICS NV	1,050	1,078	3,439	446,498	半導体・半導体製造装置	
SOCIETE GENERALE	1,270	1,290	2,910	377,832	銀行	
TELEPERFORMANCE	90	96	2,966	385,038	専門サービス	
EURAZEO SE	59	59	389	50,495	各種金融サービス	
SODEXO	132	138	1,139	147,884	ホテル・レストラン・レジャー	
AXA SA	3,010	3,170	7,338	952,543	保険	
PEUGEOT CITROEN	880	—	—	—	自動車	
JC DECAUX SA	150	—	—	—	メディア	
ESSILORLUXOTTICA	439	478	6,596	856,212	織維・アパレル・贅沢品	
CREDIT AGRICOLE SA	1,840	1,840	2,296	298,062	銀行	
BNP PARIBAS	1,739	1,850	9,734	1,263,564	銀行	
ORPEA	—	93	925	120,158	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	790	828	4,250	551,773	建設関連製品	
WENDEL	43	43	455	59,162	各種金融サービス	
ILLIAD SA	24	24	387	50,279	各種電気通信サービス	
SES FDR	560	560	381	49,515	メディア	
SAFRAN SA	508	538	6,270	813,896	航空宇宙・防衛	
ENGIE	2,900	3,080	3,706	481,140	総合公益事業	
ALSTOM	303	433	1,849	240,044	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	241	—	—	—	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	940	1,090	1,235	160,369	電力	
IPSEN	55	55	385	49,973	医薬品	
ARKEMA	99	116	1,205	156,515	化学	
LEGRAND SA	410	452	3,570	463,489	電気設備	
EIFFAGE SA	121	141	1,225	159,115	建設・土木	
TOTAL SE	3,762	4,159	16,739	2,172,848	石油・ガス・消耗燃料	
ADP	47	47	479	62,226	運送インフラ	
NATIXIS	1,580	1,580	640	83,100	資本市場	
UBISOFT ENTERTAINMENT	144	144	921	119,586	娯楽	
SCOR SE	232	232	689	89,497	保険	
VINCI	810	873	7,717	1,001,708	建設・土木	
DANONE	972	1,038	6,103	792,226	食品	
AIR LIQUIDE SA	734	791	10,998	1,427,651	化学	
BUREAU VERITAS SA	470	470	1,136	147,573	専門サービス	
GETLINK	720	720	952	123,642	運送インフラ	
SUEZ	520	520	936	121,492	総合公益事業	
EDENRED	382	424	1,892	245,622	情報技術サービス	
VALEO SA	373	373	1,094	142,099	自動車部品	
BIOMERIEUX	69	69	735	95,473	ヘルスケア機器・用品	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	154	599	77,877	ホテル・レストラン・レジャー	
FAURECIA	—	56	253	32,854	自動車部品	
WORLDLINE SA	198	386	2,738	355,436	情報技術サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	41	45	1,564	203,070	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AMUNDI SA	100	100	702	91,184	資本市場	
小計	株数	金額	44,157	45,686	248,231	32,220,466
	銘柄	数	比	率	< 3.5% >	
70	68	—	< 3.5% >			
(ユーロ…オランダ)						
ASM INTERNATIONAL NV	—	78	1,866	242,276	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	184	184	1,116	144,875	専門サービス	
WOLTERS KLUWER	418	444	3,270	424,511	専門サービス	
VOPAK	114	114	483	62,784	石油・ガス・消耗燃料	
AEGON NV	2,930	2,930	1,214	157,602	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	5,600	5,600	1,624	210,795	各種電気通信サービス	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,426	1,527	7,384	958,517	ヘルスケア機器・用品	

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…オランダ)					
HEINEKEN NV	百株	百株	千ユーロ	千円	
	400	438	3,880	503,712	飲料
HEINEKEN HOLDING NV		172	200	1,536	飲料
KONINKLIJKE DSM NV	285	291	4,300	558,267	化学
UNILEVER NV	2,276	—	—	—	パーソナル用品
ASML HOLDING NV	666	703	36,342	4,717,237	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,706	1,860	4,454	578,220	食品・生活必需品小売
AKZO NOBEL	324	312	2,984	387,400	化学
PROSUS NV	768	816	7,747	1,005,574	インターネット販売・通信販売
JDE PEET'S BV	—	110	347	45,047	食品
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	—	910	881	114,361	飲料
NN GROUP NV	470	470	1,988	258,116	保険
ARGENX SE	—	76	1,779	231,033	バイオテクノロジー
ARCELORMITTAL	990	1,190	2,905	377,118	金属・鉱業
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	175	206	1,596	207,225	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV-CVA	700	700	726	94,267	銀行
ALTICE EUROPE N.V.	990	—	—	—	各種電気通信サービス
ADYEN NV	16	30	5,726	743,283	情報技術サービス
ING GROEP NV	6,170	6,390	6,694	868,902	銀行
小計	株数・金額	26,781	25,580	100,851	13,090,504
銘柄数 <比率>		21	23	<1.4%>	
(ユーロ…スペイン)					
ENDESA S.A.	500	500	1,142	148,296	電力
BANKINTER S.A.	910	—	—	—	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	10,560	10,900	4,903	636,527	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	490	500	1,045	135,705	ガス
REPSOL SA	2,204	2,448	2,613	339,172	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA	26,140	28,500	8,383	1,088,149	銀行
TELEFONICA SA	7,320	8,200	3,147	408,501	各種電気通信サービス
ENAGAS SA	390	390	720	93,549	ガス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	380	380	1,188	154,285	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	403	370	1,026	133,291	建設・土木
FERROVIAL SA	770	797	1,771	229,919	建設・土木
MAPFRE SA	1,630	—	—	—	保険
BANCO DE SABADELL SA	8,019	—	—	—	銀行
CAIXABANK	5,300	6,000	1,611	209,185	銀行
IBERDROLA SA	9,660	10,220	11,134	1,445,282	電力
AMADEUS IT GROUP SA	667	760	4,604	597,609	情報技術サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA	700	700	1,045	135,653	電力
INDITEX SA	1,680	1,840	5,216	677,088	専門小売
AENA SME SA	107	117	1,609	208,967	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SA	386	539	2,538	329,521	各種電気通信サービス
GRIFOLS SA	468	468	1,051	136,497	バイオテクノロジー
BANKIA SA	1,510	—	—	—	銀行
小計	株数・金額	80,196	73,631	54,755	7,107,206
銘柄数 <比率>		22	18	<0.8%>	
(ユーロ…ベルギー)					
KBC GROEP NV	382	409	2,596	337,003	銀行
SOFINA SA	—	23	664	86,278	各種金融サービス
SOLVAY SA	114	116	1,260	163,667	化学
UCB SA	195	206	1,674	217,386	医薬品
COLRUYT SA	87	87	441	57,253	食品・生活必需品小売
GROUPE BRUXELLES LAM	124	195	1,733	225,065	各種金融サービス
PROXIMUS	260	260	487	63,260	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	70	70	452	58,713	バイオテクノロジー

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…ベルギー)						
ELIA GROUP SA/NV	百株	百株	千ユーロ	千円		
TELENET GROUP HOLDING NV	—	48	444	57,631	電力	
AGEAS	67	—	—	—	メディア	
UMICORE	289	289	1,502	194,988	保険	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	310	343	1,550	201,236	化学	
	1,201	1,277	7,004	909,163	飲料	
小計	3,099	3,323	19,812	2,571,649		
	銘柄数 <比率>	11	12	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	210	250	1,091	141,676	石油・ガス・消耗燃料	
VERBUND AG	110	110	666	86,524	電力	
VOESTALPINE AG	200	200	710	92,261	金属・鉱業	
ERSTE GROUP BANK AG	480	490	1,433	186,035	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	201	201	378	49,074	銀行	
ANDRITZ AG	117	—	—	—	機械	
小計	1,318	1,251	4,280	555,573		
	銘柄数 <比率>	6	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE	17	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AROUNDOWN SA	1,850	1,730	1,057	137,292	不動産管理・開発	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	—	216	1,752	227,518	ライフサイエンス・ツール/サービス	
小計	1,867	1,946	2,810	364,810		
	銘柄数 <比率>	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS	—	440	1,134	147,234	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ	630	660	592	76,964	機械	
UPM-KYMMENE OYJ	832	910	2,987	387,781	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R	850	960	1,612	209,341	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A SHS	682	804	3,118	404,809	保険	
FORTUM OYJ	720	720	1,648	213,920	電力	
ELISA OYJ	221	221	1,141	148,190	各種電気通信サービス	
METSO OYJ	162	—	—	—	機械	
NOKIA OYJ	8,800	9,230	3,150	408,955	通信機器	
NESTE OYJ	668	714	3,295	427,797	石油・ガス・消耗燃料	
NOKIAN RENKAAT OYJ	210	—	—	—	自動車部品	
KONE OYJ	540	574	4,006	520,046	機械	
ORION OYJ	165	165	561	72,924	医薬品	
小計	14,480	15,398	23,250	3,017,967		
	銘柄数 <比率>	12	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC	1,253	1,322	5,233	679,346	建設資材	
KINGSPAN GROUP PLC	245	264	1,842	239,185	建設関連製品	
KERRY GROUP PLC-A	244	259	2,807	364,421	食品	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	1,398	—	—	銀行	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	353	423	1,710	222,037	容器・包装	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,330	—	—	—	銀行	
AIB GROUP PLC	1,250	—	—	—	銀行	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	121	266	4,931	640,126	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	6,194	3,932	16,526	2,145,117		
	銘柄数 <比率>	8	6	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL	3,870	4,760	2,280	296,010	電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	810	810	805	104,507	石油・ガス・消耗燃料	

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	
(ユーロ…ポルトガル) JERONIMO MARTINS		百株 380	百株 380	千ユーロ 523	千円 67,968	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	5,060	5,950	3,609	468,486	
ユ一口計	株数・金額 銘柄数 <比率>	306,092	307,381	748,240	97,121,583	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		480	480	4,800	68,352	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		3,100	3,600	7,326	104,322	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		2,200	2,200	3,679	52,394	銀行
CLP HLDGS		2,530	2,810	21,327	303,709	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,887	1,983	91,931	1,309,109	資本市場
MTR CORP		2,430	2,720	12,131	172,748	陸運・鉄道
HANG SENG BANK		1,190	1,310	19,715	280,748	銀行
HENDERSON LAND		2,294	2,294	8,248	117,458	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		2,250	2,250	10,316	146,903	電力
HONG KONG & CHINA GAS		15,603	17,403	21,545	306,811	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		3,350	3,560	25,667	365,506	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		1,140	—	—	—	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		5,690	6,100	17,354	247,128	銀行
NWS HOLDINGS LTD		2,205	—	—	—	コングロマリット
PCCW LTD		7,500	7,500	3,360	47,846	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		970	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		9,396	—	—	—	不動産管理・開発
SINO LAND CO. LTD		4,800	4,800	5,328	75,870	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		2,480	2,220	27,084	385,676	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		750	750	4,380	62,371	不動産管理・開発
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED		1,300	—	—	—	食品
WHEELOCK & COMPANY LTD		1,340	—	—	—	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED		2,120	2,330	30,453	433,652	機械
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD		—	2,800	7,224	102,869	建設関連製品
SJM HOLDINGS LIMITED		2,700	2,700	2,770	39,447	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		2,280	2,280	3,451	49,155	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		18,930	19,980	191,907	2,732,768	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		5,996	5,996	6,823	97,165	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		3,840	3,840	14,822	211,070	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,730	1,730	4,221	60,109	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,830	2,790	12,680	180,571	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD		—	2,600	6,565	93,485	不動産管理・開発
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		2,160	2,900	6,800	96,839	飲料
WH GROUP LIMITED		14,600	16,100	11,624	165,528	食品
NEW WORLD DEVELOPMENT		—	2,689	10,931	155,663	不動産管理・開発
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		4,250	4,600	28,637	407,797	コングロマリット
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		1,070	1,070	5,007	71,308	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD		4,090	4,450	21,317	303,560	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	140,483	140,837	649,434	9,247,951	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		2,490	2,490	971	79,892	航空宇宙・防衛
DBS GROUP HLDGS		2,840	3,020	8,758	720,520	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		700	700	558	45,956	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		140	—	—	—	販売
SATS LTD		1,150	—	—	—	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		1,290	1,290	1,283	105,597	資本市場
CAPITALAND LIMITED		3,800	4,300	1,621	133,367	不動産管理・開発

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		
(シンガポール)		百株	百株	千円	千円	
COMFORTDELGRO CORP LTD	3,100	—	—	—	—	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD	770	2,400	1,346	110,768	110,768	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK	2,000	1,900	4,926	405,319	405,319	銀行
UOL GROUP LIMITED	650	870	695	57,188	57,188	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	450	450	908	74,746	74,746	電子装置・機器・部品
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	2,400	—	—	—	—	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	12,900	14,000	3,444	283,337	283,337	各種電気通信サービス
SEMCORP INDUSTRIES LTD	1,400	—	—	—	—	総合公益事業
OCBC-ORD	5,240	5,590	6,635	545,888	545,888	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,890	3,400	1,866	153,565	153,565	食品
KEPPEL CORP.	2,320	2,320	1,238	101,922	101,922	コングロマリット
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	4,400	—	—	—	—	機械
GENTING SINGAPORE LTD	8,700	11,300	1,056	86,922	86,922	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数	・金額	59,630	54,030	35,310	2,904,994
銘柄	数	比	20	14	—	<0.3%>
(オーストラリア)		千豪ドル				
RAMSAY HEALTH CARE LTD	250	295	1,946	164,224	164,224	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	4,390	4,750	13,347	1,125,995	1,125,995	銀行
WESTPAC BANKING CORP	5,630	5,940	14,469	1,220,675	1,220,675	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,190	2,760	5,547	467,995	467,995	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	6,500	7,300	2,503	211,229	211,229	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	920	—	—	—	—	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	770	770	1,034	87,302	87,302	飲料
ASX LTD	307	307	2,164	182,636	182,636	資本市場
BHP GROUP LIMITED	4,580	4,860	21,826	1,841,263	1,841,263	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	400	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	971	—	—	—	—	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	760	760	1,127	95,144	95,144	情報技術サービス
COMPUTERSHARE LTD-RIGHTS	—	86	11	928	928	情報技術サービス
CSL LIMITED	712	758	19,909	1,679,576	1,679,576	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	88	88	1,225	103,352	103,352	インターネット・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	4,340	4,620	5,996	505,886	505,886	運送インフラ
COCHLEAR LTD	89	103	2,152	181,601	181,601	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,650	2,650	1,221	103,058	103,058	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,778	2,951	25,201	2,126,001	2,126,001	銀行
BORAL LTD	2,000	—	—	—	—	建設資材
RIO TINTO LTD	575	607	6,652	561,223	561,223	金属・鉱業
APA GROUP	1,800	2,050	2,045	172,592	172,592	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	880	990	3,327	280,698	280,698	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	3,610	4,300	1,990	167,952	167,952	保険
TPG TELECOM LTD	520	—	—	—	—	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	73	—	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD	590	590	823	69,482	69,482	化学
BLUESCOPE STEEL LTD	880	900	1,730	146,001	146,001	金属・鉱業
WORLEY LTD	470	—	—	—	—	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,903	2,220	2,164	182,597	182,597	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	4,560	5,410	14,017	1,182,500	1,182,500	銀行
NEWCREST MINING	1,170	1,320	3,252	274,379	274,379	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	2,040	3,500	1,442	121,647	121,647	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	2,330	—	—	—	—	化学
AMP LIMITED	5,300	5,300	681	57,453	57,453	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,080	1,700	850	71,706	71,706	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE	1,950	2,440	2,308	194,723	194,723	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	1,940	1,891	159,566	159,566	金属・鉱業

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		
(オーストラリア)						
CHALLENGER LIMITED	百株	百株	千豪ドル	千円		
SANTOS LTD.	800	—	—	—		各種金融サービス
SONIC HEALTHCARE LTD	2,610	3,100	2,210	186,460		石油・ガス・消耗燃料
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	690	780	2,746	231,684		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS	170	170	527	44,457		石油・ガス・消耗燃料
WESFARMERS LIMITED	3,400	3,709	1,713	144,559		ホテル・レストラン・レジャー
ALUMINA LTD	1,750	1,902	9,936	838,205		複合小売り
WOODSIDE PETROLEUM	3,500	—	—	—		金属・鉱業
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,520	1,630	3,925	331,116		石油・ガス・消耗燃料
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,970	2,120	8,533	719,843		食品・生活必需品小売り
SEEK LTD	192	192	864	72,887		資本市場
BRAMBLES LTD	480	600	1,677	141,522		インフラ/ティ・メディアおよびサービス
MACQUARIE GROUP LIMITED	2,510	2,470	2,573	217,120		商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	530	568	8,551	721,430		資本市場
EVOLUTION MINING LTD	550	550	646	54,564		ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	—	2,720	1,136	95,913		金属・鉱業
TREASURY WINE ESTATES LTD	670	730	2,860	241,342		建設資材
SYDNEY AIRPORT	1,110	1,110	1,148	96,916		飲料
AURIZON HOLDINGS LTD	1,680	2,006	1,195	100,869		運送インフラ
XERO LIMITED	3,050	3,050	1,174	99,059		陸運・鉄道
AFTERPAY LTD	—	198	2,487	209,826		ソフトウェア
AMPOL LTD	—	348	3,515	296,596		情報技術サービス
TPG TELECOM LTD	—	400	986	83,178		石油・ガス・消耗燃料
AUSNET SERVICES	3,300	3,300	598	50,527		各種電気通信サービス
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,300	4,500	1,264	106,673		電力
AGL ENERGY LTD	4,500	1,050	1,030	86,895		保険
SOUTH32 LTD	7,800	7,800	2,184	184,242		総合公益事業
CIMIC GROUP LTD	180	180	313	26,421		金属・鉱業
COLES GROUP LTD	1,760	2,270	3,570	301,225		建設・土木
WISETECH GLOBAL LTD	210	210	591	49,869		食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	116,038	120,448	231,157	19,500,444	
	銘柄数 <比率>	61	58		<2.1%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
RYMAN HEALTHCARE LTD	580	740	1,115	86,349		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	1,170	1,170	999	77,316		食品
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	860	930	2,982	230,786		ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	1,500	—	—	—		建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	3,070	3,070	1,399	108,325		各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	1,000	1,000	620	47,975		電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,520	2,230	1,710	132,351		運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD	2,010	2,010	1,074	83,132		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額	11,710	11,150	9,902	766,238	
	銘柄数 <比率>	8	7		<0.1%>	
(イスラエル)			千新シェケル			
BANK HAPOALIM BM	1,830	1,830	4,758	157,918		銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,380	2,380	5,236	173,782		銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	36	50	2,328	77,282		航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	1,720	1,720	2,385	79,179		銀行
ICL GROUP LTD	1,250	1,250	2,475	82,145		化学
NICE LTD	95	106	7,689	255,205		ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	230	230	2,004	66,520		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
(イスラエル) AZRIELI GROUP		百株 65	百株 65	千新シェケル 1,356	千円 45,023	不動産管理・開発
小計	株数・金額	7,606	7,631	28,233	937,058	
	銘柄数 <比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,720,128	1,803,673	—	889,554,397	
	銘柄数 <比率>	1,252	1,229	—	<95.9%>	

\* 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。

\* 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。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円 %
AGNC INVESTMENT CORP	80,000	93,000	1,570	173,899	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,900	22,400	3,724	412,333	0.0
AMERICAN TOWER CORP	69,400	73,700	17,477	1,934,984	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	214,000	238,000	2,075	229,763	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	22,700	4,253	470,882	0.1
BOSTON PROPERTIES	24,700	25,000	2,575	285,105	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,500	16,000	1,777	196,762	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	64,500	72,100	12,328	1,364,874	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	40,700	45,200	6,384	706,777	0.1
DUKE REALTY CORP	56,600	62,200	2,642	292,524	0.0
EQUINIX INC	13,250	14,810	9,994	1,106,477	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	29,400	1,902	210,655	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	57,700	60,300	4,391	486,199	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,070	10,700	2,975	329,460	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	20,700	2,753	304,795	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	75,700	88,000	2,814	311,564	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	109,000	1,885	208,765	0.0
INVITATION HOMES INC	85,000	92,000	2,967	328,476	0.0
IRON MOUNTAIN INC	43,100	49,000	1,820	201,585	0.0
KIMCO REALTY CORP	65,000	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	99,000	2,101	232,686	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	19,300	2,843	314,821	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	—	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,200	36,500	1,355	150,079	0.0
PROLOGIS INC	114,500	122,700	13,099	1,450,240	0.2
PUBLIC STORAGE	24,500	26,500	6,546	724,740	0.1
REALTY INCOME CORP	49,900	55,600	3,565	394,689	0.0
REGENCY CENTERS CORP	26,200	26,200	1,495	165,537	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	18,100	4,999	553,543	0.1
SL GREEN REALTY CORP	12,500	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	54,800	6,323	700,060	0.1
SUN COMMUNITIES INC	14,300	17,800	2,666	295,240	0.0
UDR INC	46,300	46,100	2,046	226,605	0.0
VENTAS INC	56,800	63,900	3,496	387,109	0.0
VEREIT INC	160,000	—	—	—	—
VEREIT INC	—	37,000	1,433	158,648	0.0
VICI PROPERTIES INC	68,000	87,000	2,454	271,712	0.0
VORNADO REALTY TRUST	27,000	27,000	1,257	139,205	0.0
WP CAREY INC	27,400	27,400	1,936	214,434	0.0
WELLTOWER INC	63,100	68,000	4,959	549,037	0.1
WEYERHAEUSER CO	115,000	121,000	4,289	474,885	0.1
小計	口数	金額	2,153,190	2,098,110	153,185 16,959,169
	銘柄	数 < 比率 >	41	37	— <1.8%>
(カナダ)					
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	14,900	千カナダドル	803	70,549
					0.0

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	
(カナダ)				千カナダドル	千円	%
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT		16,000	—	—	—	—
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		20,000	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		22,000	22,000	428	37,638	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		11,000	—	—	—	—
小計	口数・金額	80,500	36,900	1,232	108,187	
銘柄数<比率>		5	2	—	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		128,000	128,000	668	101,713	0.0
SEGRO PLC		176,000	193,000	1,821	277,350	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		111,000	111,000	781	118,958	0.0
小計	口数・金額	415,000	432,000	3,271	498,023	
銘柄数<比率>		3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		5,200	—	—	—	—
KLEPIERRE		32,300	32,300	655	85,066	0.0
GECINA SA		7,100	7,100	836	108,562	0.0
COVIVIO		6,600	8,500	621	80,651	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		21,400	24,200	1,675	217,431	0.0
ユ一口計	口数・金額	72,600	72,100	3,788	491,711	
銘柄数<比率>		5	4	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		330,000	353,000	25,627	364,939	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		370,000	470,000	3,647	51,936	0.0
小計	口数・金額	700,000	823,000	29,275	416,876	
銘柄数<比率>		2	2	—	<0.0%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		390,000	706,779	1,540	126,759	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		440,800	539,240	1,655	136,195	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		439,972	—	—	—	—
SUNTEC REIT		300,000	300,000	474	38,995	0.0
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—	427,980	834	68,659	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		370,000	370,000	795	65,445	0.0
小計	口数・金額	1,940,772	2,343,999	5,300	436,056	
銘柄数<比率>		5	5	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		660,000	660,000	1,597	134,739	0.0
GPT GROUP		285,000	330,000	1,488	125,552	0.0
LENDLEASE GROUP		88,000	111,000	1,428	120,514	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		348,000	400,000	1,720	145,099	0.0
DEXUS		171,000	171,000	1,633	137,764	0.0
GOODMAN GROUP		254,000	283,000	5,105	430,684	0.0
SCENTRE GROUP		870,000	820,000	2,304	194,382	0.0
VICINITY CENTRES		470,000	670,000	1,092	92,129	0.0
小計	口数・金額	3,146,000	3,445,000	16,368	1,380,866	
銘柄数<比率>		8	8	—	<0.1%>	
合計	口数・金額	8,508,062	9,251,109	—	20,290,891	
銘柄数<比率>		69	61	—	<2.2%>	

\*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。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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	CAN60	百万円	百万円
		EURO50	625	—
		FT100	1,924	—
		SPI200	850	—
		SPEMINI	410	—
		SWISSMKT	12,893	—
			542	—

\* 単位未満は切り捨て。

\* 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3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円	%
	889,554,397	95.9
投資証券	20,290,891	2.2
コール・ローン等、その他	18,223,764	1.9
投資信託財産総額	928,069,052	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建て純資産（924,695,878千円）の投資信託財産総額（928,069,052千円）に対する比率は99.6%です。

\* 外貨建て資産は、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、1米ドル=110.71円、1カナダドル=87.78円、1英ポンド=152.23円、1スイスフラン=117.45円、1スウェーデンクローネ=12.69円、1ノルウェークローネ=12.96円、1デンマーククローネ=17.45円、1ユーロ=129.80円、1香港ドル=14.24円、1シンガポールドル=82.27円、1豪ドル=84.36円、1ニュージーランドドル=77.38円、1新シェケル=33.19円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月31日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円 930,897,307,010
コレ・ローン等	11,360,420,610
株式(評価額)	889,554,397,361
投資証券(評価額)	20,290,891,015
未収入金	2,928,620,789
未収配当金	1,068,206,289
差入委託証拠金	5,694,770,946
(B) 負債	3,249,055,909
未払金	2,860,485,021
未払解約金	385,126,122
未払利息	3,166
その他未払費用	3,441,600
(C) 純資産総額(A-B)	927,648,251,101
元本	245,531,591,330
次期繰越損益金	682,116,659,771
(D) 受益権総口数	245,531,591,330口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,781円

(注) 期首元本額は230,777,414,749円、期中追加設定元本額は55,380,942,946円、期中一部解約元本額は40,626,766,365円、1口当たり純資産額は3,7781円です。

## ○損益の状況 (2020年4月1日～2021年3月31日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円 13,052,106,182
受取配当金	13,036,907,012
受取利息	680,215
その他収益金	20,299,141
支払利息	△ 5,780,186
(B) 有価証券売買損益	309,639,022,800
売買益	315,409,403,936
売買損	△ 5,770,381,136
(C) 先物取引等取引損益	4,156,399,219
取引益	4,706,021,361
取引損	△ 549,622,142
(D) 保管費用等	△ 64,488,873
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	326,783,039,328
(F) 前期繰越損益金	325,246,401,340
(G) 追加信託差損益金	115,522,734,190
(H) 解約差損益金	△ 85,435,515,087
(I) 計(E+F+G+H)	682,116,659,771
次期繰越損益金(I)	682,116,659,771

\*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算によるものを含みます。

\*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。

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	円 74,442,669,963
野村外国株インデックスBコース(野村投資一任口座向け)	45,981,765,212
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	26,522,667,082
野村Pops用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	13,216,423,125
マイバランス50(確定拠出年金向け)	8,813,350,365
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,195,934,986
のむラップ・ファンド(普通型)	7,413,821,765
野村つみたて外国株投信	7,140,146,927
のむラップ・ファンド(積極型)	5,874,675,457
野村インデックスファンド・外国株式	5,178,091,514
野村世界6資産分散投信(分配コース)	4,908,070,670
野村外国株(含む新興国)インデックスBコース(野村投資一任口座向け)	4,311,126,171
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,032,789,678
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,834,191,486
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,627,138,869
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,466,653,600
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	2,021,283,487
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,908,713,316

ファンド名	当期末
	元本額
マイバランスDC50	円 1,903,591,578
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)外国株式	1,857,341,281
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,678,880,730
マイバランスDC70	1,540,701,049
マイ・ロード	1,087,359,782
野村6資産均等バランス	983,476,455
マイバランスDC30	858,222,247
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	842,367,196
のむラップ・ファンド(保守型)	819,498,259
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	676,118,737
のむラップ・ファンド(やや積極型)	487,897,427
野村外国株式インデックスファンド	477,100,665
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	350,614,763
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	289,956,615
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	260,136,200
野村DC運用戦略ファンド	253,010,969
ノムラPops用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	196,334,939
野村スリーゼロ先進国株式投信	178,508,014

ファンド名	当期末
	元本額
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	円 176,662,260
のむラップ・ファンド(やや保守型)	174,692,702
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	139,042,389
バランスセレクト70	134,470,714
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	129,529,492
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	120,394,293
バランスセレクト50	115,756,756
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	102,922,540
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	81,695,228
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	71,722,146
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	57,114,645
野村資産設計ファンド2040	50,195,153
世界6資産分散ファンド	43,897,531
バランスセレクト30	39,135,026
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	34,314,793
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	34,161,289
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	32,976,146
野村資産設計ファンド2030	31,475,054
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	30,559,867
インデックス・ブレンド(タイプV)	29,572,851
野村資産設計ファンド2035	25,928,039
野村資産設計ファンド2025	23,182,058
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	20,090,323
インデックス・ブレンド(タイプIII)	19,291,406
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	13,989,553
ネクストコア	13,056,429
野村資産設計ファンド2015	12,330,327
野村資産設計ファンド2020	12,272,666

ファンド名	当期末
	元本額
野村資産設計ファンド2050	円 12,050,256
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	10,025,453
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	9,925,325
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	9,896,292
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	9,541,976
野村資産設計ファンド2045	7,896,295
インデックス・ブレンド(タイプIV)	7,664,466
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,945,648
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	6,582,277
野村資産設計ファンド2060	5,888,132
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	5,574,893
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	5,432,214
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	4,681,040
野村ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型	4,139,055
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	3,987,021
インデックス・ブレンド(タイプII)	3,031,339
インデックス・ブレンド(タイプI)	2,325,239
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,237,410
野村ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型	2,097,616
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	1,908,206
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	1,868,065
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,615,748
野村ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型	1,598,417
野村FOF用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	1,285,977
野村ターゲットデートファンド2016-2035-2037年目標型	1,270,861
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	1,019,172
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	40,682

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日2021年3月31日）

作成対象期間（2020年4月1日～2021年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**  
東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	ベンチマーク		債組入比率	債先物比率	純資産額
		NOMURA-BPI	中総合			
	円	%	%	%	%	百万円
15期(2017年3月31日)	12,991	△1.1	378.492	△1.2	99.5	— 687,986
16期(2018年4月2日)	13,114	0.9	381.893	0.9	99.6	— 672,515
17期(2019年4月1日)	13,342	1.7	388.518	1.7	99.3	— 663,317
18期(2020年3月31日)	13,340	△0.0	388.450	△0.0	98.1	— 679,315
19期(2021年3月31日)	13,248	△0.7	385.724	△0.7	99.5	— 735,829

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指標で、当該指標に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	ベンチマーク		債組入比率	債先物比率	券率
		騰落率	NOMURA-BPI 総合			
(期首) 2020年3月31日	円 13,340	% —	388.450	% —	% 98.1	% —
4月末	13,385	0.3	389.790	0.3	98.9	—
5月末	13,328	△0.1	388.127	△0.1	99.5	—
6月末	13,276	△0.5	386.558	△0.5	99.2	—
7月末	13,322	△0.1	387.913	△0.1	99.0	—
8月末	13,261	△0.6	386.087	△0.6	99.0	—
9月末	13,299	△0.3	387.219	△0.3	99.1	—
10月末	13,278	△0.5	386.633	△0.5	99.0	—
11月末	13,296	△0.3	387.118	△0.3	99.4	—
12月末	13,298	△0.3	387.203	△0.3	99.3	—
2021年1月末	13,266	△0.6	386.252	△0.6	99.2	—
2月末	13,156	△1.4	383.056	△1.4	99.6	—
(期末) 2021年3月31日	13,248	△0.7	385.724	△0.7	99.5	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したことから基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

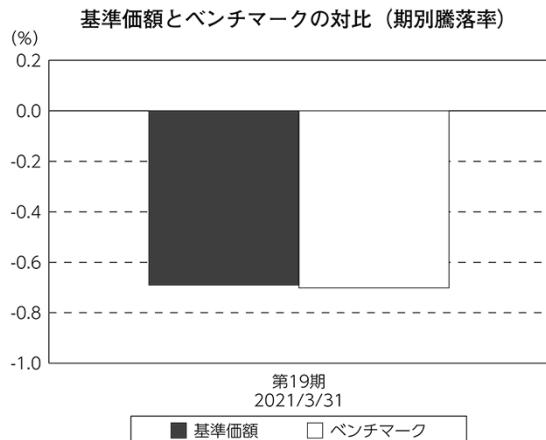
NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は-0.7%となり、ベンチマークの-0.7%と同程度となりました。

### (その他要因)

ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること。



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

## ◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、債券組入比率を高位に保ち、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2020年4月1日～2021年3月31日)

該当事項はございません。

## ○ 売買及び取引の状況

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## 公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	千円 161,645,022	千円 88,808,458
	地方債証券	8,748,076	5,511,688
	特殊債券	9,259,092	6,363,803 ( 807,197 )
	社債券（投資法人債券を含む）	9,088,695	10,747,465

\* 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\* 単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は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。

\* 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## ○ 利害関係人との取引状況等

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	188,740	1,317	0.7	111,431	850	0.8

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野村證券株式会社です。

(2021年3月31日現在)

## ○組入資産の明細

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	当期末		
					残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年末満
国債証券	千円 552,445,000 ( 2,460,000)	千円 590,339,899 ( 3,500,913)	% 80.2 ( 0.5)	% — (—)	% 53.7 ( 0.5)	% 18.2 ( 0.0)	% 8.3 ( —)
地方債証券	48,556,100 ( 48,556,100)	50,873,297 ( 50,873,297)	6.9 ( 6.9)	— (—)	3.5 ( 3.5)	2.6 ( 2.6)	0.9 ( 0.9)
特殊債券 (除く金融債)	58,137,926 ( 58,137,926)	60,862,888 ( 60,862,888)	8.3 ( 8.3)	— (—)	4.2 ( 4.2)	2.7 ( 2.7)	1.3 ( 1.3)
金融債券	2,500,000 ( 2,500,000)	2,506,222 ( 2,506,222)	0.3 ( 0.3)	— (—)	— ( —)	0.2 ( 0.2)	0.2 ( 0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	27,305,000 ( 27,305,000)	27,858,685 ( 27,858,685)	3.8 ( 3.8)	— (—)	2.3 ( 2.3)	1.3 ( 1.3)	0.2 ( 0.2)
合計	688,944,026 (138,959,026)	732,440,992 (145,602,006)	99.5 (19.8)	— (—)	63.6 (10.4)	25.0 ( 6.8)	10.9 ( 2.6)

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 價 額	千 円	
国債証券	%			千円	
国庫債券 利付(2年) 第415回	0.1	3,700,000	3,711,359	千円	2022/8/1
国庫債券 利付(2年) 第416回	0.1	3,000,000	3,009,810	千円	2022/9/1
国庫債券 利付(2年) 第417回	0.1	3,200,000	3,211,296	千円	2022/10/1
国庫債券 利付(2年) 第418回	0.1	4,400,000	4,416,412	千円	2022/11/1
国庫債券 利付(2年) 第420回	0.1	500,000	502,065	千円	2023/1/1
国庫債券 利付(2年) 第421回	0.1	3,500,000	3,515,470	千円	2023/2/1
国庫債券 利付(2年) 第422回	0.1	600,000	602,880	千円	2023/3/1
国庫債券 利付(5年) 第132回	0.1	3,000,000	3,008,220	千円	2022/6/20
国庫債券 利付(5年) 第133回	0.1	6,200,000	6,220,522	千円	2022/9/20
国庫債券 利付(5年) 第134回	0.1	2,500,000	2,509,900	千円	2022/12/20
国庫債券 利付(5年) 第135回	0.1	8,500,000	8,539,355	千円	2023/3/20
国庫債券 利付(5年) 第136回	0.1	3,300,000	3,317,622	千円	2023/6/20
国庫債券 利付(5年) 第137回	0.1	4,000,000	4,023,800	千円	2023/9/20
国庫債券 利付(5年) 第138回	0.1	5,500,000	5,536,795	千円	2023/12/20
国庫債券 利付(5年) 第139回	0.1	5,600,000	5,639,200	千円	2024/3/20
国庫債券 利付(5年) 第140回	0.1	3,900,000	3,929,601	千円	2024/6/20
国庫債券 利付(5年) 第141回	0.1	4,500,000	4,536,090	千円	2024/9/20
国庫債券 利付(5年) 第143回	0.1	5,570,000	5,618,793	千円	2025/3/20
国庫債券 利付(5年) 第144回	0.1	4,500,000	4,540,995	千円	2025/6/20
国庫債券 利付(5年) 第145回	0.1	4,900,000	4,946,207	千円	2025/9/20
国庫債券 利付(5年) 第146回	0.1	2,100,000	2,119,404	千円	2025/12/20
国庫債券 利付(40年) 第1回	2.4	2,360,000	3,401,279	千円	2048/3/20
国庫債券 利付(40年) 第2回	2.2	900,000	1,259,937	千円	2049/3/20
国庫債券 利付(40年) 第3回	2.2	900,000	1,266,300	千円	2050/3/20
国庫債券 利付(40年) 第4回	2.2	1,130,000	1,597,345	千円	2051/3/20
国庫債券 利付(40年) 第5回	2.0	1,200,000	1,643,016	千円	2052/3/20
国庫債券 利付(40年) 第6回	1.9	1,300,000	1,755,650	千円	2053/3/20
国庫債券 利付(40年) 第7回	1.7	1,400,000	1,821,344	千円	2054/3/20
国庫債券 利付(40年) 第8回	1.4	1,500,000	1,825,710	千円	2055/3/20
国庫債券 利付(40年) 第9回	0.4	2,050,000	1,871,978	千円	2056/3/20
国庫債券 利付(40年) 第10回	0.9	2,010,000	2,147,082	千円	2057/3/20
国庫債券 利付(40年) 第11回	0.8	1,750,000	1,814,715	千円	2058/3/20
国庫債券 利付(40年) 第12回	0.5	2,070,000	1,939,983	千円	2059/3/20
国庫債券 利付(40年) 第13回	0.5	5,020,000	4,698,218	千円	2060/3/20
国庫債券 利付(10年) 第323回	0.9	1,700,000	1,721,267	千円	2022/6/20
国庫債券 利付(10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,236,128	千円	2022/6/20
国庫債券 利付(10年) 第325回	0.8	4,400,000	4,459,972	千円	2022/9/20
国庫債券 利付(10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,129,862	千円	2022/12/20
国庫債券 利付(10年) 第327回	0.8	3,100,000	3,149,414	千円	2022/12/20
国庫債券 利付(10年) 第328回	0.6	5,250,000	5,325,547	千円	2023/3/20
国庫債券 利付(10年) 第329回	0.8	6,000,000	6,124,860	千円	2023/6/20
国庫債券 利付(10年) 第330回	0.8	3,800,000	3,888,084	千円	2023/9/20
国庫債券 利付(10年) 第331回	0.6	1,900,000	1,934,618	千円	2023/9/20
国庫債券 利付(10年) 第332回	0.6	5,900,000	6,019,180	千円	2023/12/20
国庫債券 利付(10年) 第333回	0.6	3,600,000	3,678,804	千円	2024/3/20
国庫債券 利付(10年) 第334回	0.6	6,600,000	6,756,816	千円	2024/6/20

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
国債証券	%	千円	千円		
国庫債券 利付(10年) 第335回	0.5	4,600,000	4,700,188	2024/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第336回	0.5	2,750,000	2,813,717	2024/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第337回	0.3	3,000,000	3,047,070	2024/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第338回	0.4	5,000,000	5,103,600	2025/3/20	
国庫債券 利付(10年) 第339回	0.4	5,000,000	5,109,150	2025/6/20	
国庫債券 利付(10年) 第340回	0.4	4,200,000	4,296,222	2025/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第341回	0.3	7,300,000	7,438,481	2025/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第342回	0.1	8,350,000	8,429,074	2026/3/20	
国庫債券 利付(10年) 第343回	0.1	5,900,000	5,957,171	2026/6/20	
国庫債券 利付(10年) 第344回	0.1	5,800,000	5,855,738	2026/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第345回	0.1	5,000,000	5,048,800	2026/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第346回	0.1	4,900,000	4,946,942	2027/3/20	
国庫債券 利付(10年) 第347回	0.1	5,400,000	5,452,218	2027/6/20	
国庫債券 利付(10年) 第348回	0.1	6,800,000	6,863,988	2027/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第349回	0.1	2,800,000	2,826,404	2027/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第350回	0.1	6,150,000	6,207,933	2028/3/20	
国庫債券 利付(10年) 第351回	0.1	7,700,000	7,766,759	2028/6/20	
国庫債券 利付(10年) 第352回	0.1	6,600,000	6,654,252	2028/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第353回	0.1	5,100,000	5,139,372	2028/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第354回	0.1	4,350,000	4,379,406	2029/3/20	
国庫債券 利付(10年) 第355回	0.1	5,100,000	5,131,365	2029/6/20	
国庫債券 利付(10年) 第356回	0.1	4,800,000	4,826,352	2029/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第357回	0.1	1,900,000	1,909,063	2029/12/20	
国庫債券 利付(10年) 第358回	0.1	5,470,000	5,491,934	2030/3/20	
国庫債券 利付(10年) 第359回	0.1	5,600,000	5,617,920	2030/6/20	
国庫債券 利付(10年) 第360回	0.1	7,900,000	7,914,852	2030/9/20	
国庫債券 利付(10年) 第361回	0.1	6,900,000	6,906,624	2030/12/20	
国庫債券 利付(30年) 第1回	2.8	500,000	616,505	2029/9/20	
国庫債券 利付(30年) 第2回	2.4	500,000	604,265	2030/2/20	
国庫債券 利付(30年) 第3回	2.3	160,000	192,644	2030/5/20	
国庫債券 利付(30年) 第4回	2.9	900,000	1,143,288	2030/11/20	
国庫債券 利付(30年) 第5回	2.2	150,000	181,602	2031/5/20	
国庫債券 利付(30年) 第6回	2.4	600,000	743,694	2031/11/20	
国庫債券 利付(30年) 第7回	2.3	600,000	742,080	2032/5/20	
国庫債券 利付(30年) 第8回	1.8	100,000	118,746	2032/11/22	
国庫債券 利付(30年) 第9回	1.4	265,000	302,630	2032/12/20	
国庫債券 利付(30年) 第10回	1.1	250,000	277,105	2033/3/20	
国庫債券 利付(30年) 第11回	1.7	160,000	188,963	2033/6/20	
国庫債券 利付(30年) 第12回	2.1	220,000	271,189	2033/9/20	
国庫債券 利付(30年) 第13回	2.0	290,000	354,751	2033/12/20	
国庫債券 利付(30年) 第14回	2.4	800,000	1,021,800	2034/3/20	
国庫債券 利付(30年) 第15回	2.5	900,000	1,164,339	2034/6/20	
国庫債券 利付(30年) 第16回	2.5	915,000	1,187,944	2034/9/20	
国庫債券 利付(30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,546,344	2034/12/20	
国庫債券 利付(30年) 第18回	2.3	2,200,000	2,812,458	2035/3/20	
国庫債券 利付(30年) 第19回	2.3	2,050,000	2,627,034	2035/6/20	
国庫債券 利付(30年) 第20回	2.5	1,270,000	1,667,903	2035/9/20	
国庫債券 利付(30年) 第21回	2.3	300,000	386,493	2035/12/20	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
国債証券	%	千円	千円		
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	792,480	2036/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,112,202	2036/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	929,747	2036/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	650,125	2036/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,121,124	2037/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,078,689	2037/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	1,200,000	1,617,096	2038/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	1,500,000	2,004,630	2038/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	1,700,000	2,250,851	2039/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	1,200,000	1,572,876	2039/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	1,200,000	1,599,132	2040/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	2,400,000	3,079,752	2040/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	1,600,000	2,120,752	2041/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,971,025	2041/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	2,000,000	2,591,440	2042/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,944,322	2042/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	1,600,000	2,021,696	2043/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,058,224	2043/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	1,300,000	1,646,385	2043/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	1,500,000	1,871,055	2043/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	1,600,000	1,997,600	2044/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,626,222	2044/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,752,898	2044/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	1,700,000	2,056,133	2044/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	2,178,234	2045/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	1,700,000	2,097,171	2045/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	1,900,000	2,258,055	2045/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	2,900,000	3,447,665	2045/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,995,513	2046/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第51回	0.3	2,650,000	2,473,139	2046/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第52回	0.5	1,900,000	1,860,062	2046/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第53回	0.6	1,700,000	1,701,887	2046/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第54回	0.8	1,700,000	1,782,382	2047/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第55回	0.8	1,500,000	1,571,520	2047/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第56回	0.8	1,900,000	1,989,072	2047/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第57回	0.8	1,600,000	1,673,680	2047/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第58回	0.8	2,100,000	2,194,920	2048/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第59回	0.7	1,600,000	1,631,696	2048/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第60回	0.9	1,150,000	1,228,464	2048/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第61回	0.7	1,000,000	1,016,510	2048/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第62回	0.5	500,000	482,250	2049/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第63回	0.4	1,400,000	1,311,842	2049/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第64回	0.4	1,500,000	1,401,480	2049/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第65回	0.4	1,200,000	1,119,264	2049/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第66回	0.4	2,600,000	2,426,736	2050/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第67回	0.6	1,300,000	1,277,757	2050/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第68回	0.6	1,950,000	1,916,401	2050/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第69回	0.7	2,350,000	2,370,398	2050/12/20	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
国債証券	%	千円	千円		
国庫債券 利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	123,112	2022/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	215,191	2022/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	185,371	2022/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	237,235	2022/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	800,506	2022/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	306,684	2023/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	449,156	2023/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	312,921	2023/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	420,180	2023/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	480,348	2023/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	315,894	2023/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	328,742	2024/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	310,126	2024/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	597,195	2024/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	584,161	2024/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	215,064	2024/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	1,470,000	1,584,027	2024/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	1,200,000	1,295,064	2024/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	800,000	866,368	2024/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	652,962	2025/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	983,073	2025/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	758,996	2025/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	868,160	2025/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	936,909	2025/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	1,400,000	1,531,138	2025/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	394,041	2025/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	901,221	2025/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,512,589	2025/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,319,208	2025/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	443,704	2026/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	1,700,000	1,902,708	2026/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	557,125	2026/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,237,533	2026/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	526,296	2026/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,687,470	2026/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	282,617	2026/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	731,009	2026/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	337,008	2027/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	225,870	2027/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	100,000	114,696	2027/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	453,792	2027/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	300,000	343,710	2027/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	341,763	2027/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	1,100,000	1,258,620	2027/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	820,000	947,993	2028/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	292,515	2028/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	587,475	2028/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	700,632	2028/6/20	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
国債証券	%	千円	千円		
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	461,304	2028/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,199,744	2028/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	466,092	2028/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	348,639	2028/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,834,704	2028/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,035,000	2029/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,282,501	2029/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	942,720	2029/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,106,342	2029/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	2,000,000	2,348,820	2029/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	1,700,000	2,004,317	2029/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	1,000,000	1,187,700	2029/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,311,123	2030/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	1,400,000	1,656,200	2030/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	588,930	2030/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	927,624	2030/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	912,952	2030/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	1,200,000	1,405,956	2030/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	900,000	1,045,998	2030/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	500,000	597,130	2030/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,184,620	2030/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	400,000	483,132	2031/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	1,200,000	1,425,708	2031/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	500,000	589,105	2031/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	1,800,000	2,126,664	2031/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	2,600,000	3,045,562	2031/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	1,400,000	1,644,076	2031/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	931,192	2031/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,516,593	2031/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,648,066	2031/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	1,400,000	1,651,902	2032/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	700,000	818,391	2032/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	810,824	2032/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,171,660	2032/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	919,664	2032/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	1,000,000	1,160,620	2032/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	2,300,000	2,700,499	2032/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	2,600,000	3,058,874	2032/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	950,000	1,128,590	2032/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	1,300,000	1,517,139	2033/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	1,300,000	1,501,903	2033/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	2,300,000	2,716,346	2033/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	2,400,000	2,839,752	2033/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	4,000,000	4,691,760	2033/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	2,100,000	2,440,410	2034/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	3,850,000	4,480,129	2034/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	3,330,000	3,836,559	2034/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	2,500,000	2,816,900	2034/12/20	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	%	
<b>国債証券</b>		千円	千円		
国庫債券 利付(20年) 第152回	1.2	2,650,000	2,987,742		2035/3/20
国庫債券 利付(20年) 第153回	1.3	1,600,000	1,828,160		2035/6/20
国庫債券 利付(20年) 第154回	1.2	1,220,000	1,378,014		2035/9/20
国庫債券 利付(20年) 第155回	1.0	5,350,000	5,890,403		2035/12/20
国庫債券 利付(20年) 第156回	0.4	5,650,000	5,726,783		2036/3/20
国庫債券 利付(20年) 第157回	0.2	2,990,000	2,937,914		2036/6/20
国庫債券 利付(20年) 第158回	0.5	2,100,000	2,155,713		2036/9/20
国庫債券 利付(20年) 第159回	0.6	2,000,000	2,080,700		2036/12/20
国庫債券 利付(20年) 第160回	0.7	2,300,000	2,425,396		2037/3/20
国庫債券 利付(20年) 第161回	0.6	2,100,000	2,180,556		2037/6/20
国庫債券 利付(20年) 第162回	0.6	1,700,000	1,763,427		2037/9/20
国庫債券 利付(20年) 第163回	0.6	2,600,000	2,694,146		2037/12/20
国庫債券 利付(20年) 第164回	0.5	2,600,000	2,649,712		2038/3/20
国庫債券 利付(20年) 第165回	0.5	2,200,000	2,239,028		2038/6/20
国庫債券 利付(20年) 第166回	0.7	2,300,000	2,414,632		2038/9/20
国庫債券 利付(20年) 第167回	0.5	2,600,000	2,638,636		2038/12/20
国庫債券 利付(20年) 第168回	0.4	2,700,000	2,688,714		2039/3/20
国庫債券 利付(20年) 第169回	0.3	2,530,000	2,470,241		2039/6/20
国庫債券 利付(20年) 第170回	0.3	2,000,000	1,948,820		2039/9/20
国庫債券 利付(20年) 第171回	0.3	1,500,000	1,458,630		2039/12/20
国庫債券 利付(20年) 第172回	0.4	3,840,000	3,796,492		2040/3/20
国庫債券 利付(20年) 第173回	0.4	3,250,000	3,209,895		2040/6/20
国庫債券 利付(20年) 第174回	0.4	3,340,000	3,295,344		2040/9/20
国庫債券 利付(20年) 第175回	0.5	4,600,000	4,620,700		2040/12/20
メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	0.6	100,000	99,634		2023/4/20
小計		552,445,000	590,339,899		
<b>地方債証券</b>					
東京都 公募第708回	0.89	100,000	101,068		2022/6/20
東京都 公募第710回	0.81	100,000	100,970		2022/6/20
東京都 公募第712回	0.77	100,000	101,114		2022/9/20
東京都 公募第715回	0.76	100,000	101,283		2022/12/20
東京都 公募第716回	0.77	200,000	202,602		2022/12/20
東京都 公募第731回	0.635	100,000	101,826		2024/3/19
東京都 公募第736回	0.505	100,000	101,680		2024/9/20
東京都 公募第745回	0.533	300,000	306,477		2025/6/20
東京都 公募第760回	0.045	100,000	99,999		2026/9/18
東京都 公募第761回	0.075	100,000	100,163		2026/9/18
東京都 公募第769回	0.21	500,000	504,175		2027/6/18
東京都 公募第778回	0.165	100,000	100,588		2028/3/17
東京都 公募(30年) 第7回	2.51	100,000	133,930		2038/9/17
東京都 公募第10回	2.31	200,000	263,116		2039/9/20
東京都 公募第1回	1.54	300,000	310,167		2023/6/20
東京都 公募(20年) 第3回	2.26	200,000	213,292		2024/3/19
東京都 公募第7回	2.16	100,000	109,556		2025/9/19
東京都 公募(20年) 第13回	2.15	100,000	113,882		2027/12/20
東京都 公募(20年) 第16回	2.01	200,000	229,210		2028/12/20
東京都 公募(20年) 第17回	2.09	200,000	230,436		2028/12/20
東京都 公募第23回	2.12	100,000	118,712		2030/12/20

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
<b>地方債証券</b>	%				
東京都 公募(20年) 第26回	1.74	100,000	116,509	千円	2032/6/18
東京都 公募(20年) 第29回	1.57	200,000	231,230		2033/9/20
北海道 公募平成24年度第6回	0.84	100,000	101,157		2022/8/31
北海道 公募平成24年度第9回	0.79	100,000	101,214		2022/10/31
北海道 公募平成25年度第1回	0.58	300,000	303,447		2023/4/26
北海道 公募平成26年度第13回	0.461	100,000	101,610		2024/12/26
北海道 公募平成27年度第7回	0.529	100,000	102,193		2025/8/28
北海道 公募平成29年度第5回	0.18	200,000	201,180		2027/6/30
北海道 公募平成29年度第6回	0.01	700,000	699,860		2022/7/28
北海道 公募平成29年度第7回	0.21	100,000	100,798		2027/8/31
北海道 公募平成29年度第9回	0.205	100,000	100,784		2027/10/27
北海道 公募平成30年度第15回	0.291	269,280	269,772		2038/9/24
宮城県 公募第32回2号	0.105	100,000	100,328		2026/9/28
神奈川県 公募第196回	0.678	100,000	101,305		2023/3/20
神奈川県 公募第200回	0.825	100,000	102,004		2023/9/20
神奈川県 公募第205回	0.664	100,000	101,913		2024/3/19
神奈川県 公募第206回	0.654	100,000	102,041		2024/6/20
神奈川県 公募第210回	0.451	200,000	203,206		2024/12/20
神奈川県 公募第212回	0.42	100,000	101,585		2025/3/19
神奈川県 公募第231回	0.22	200,000	201,940		2027/12/20
神奈川県 公募第247回	0.12	200,000	199,090		2030/6/20
神奈川県 公募(30年) 第3回	2.62	100,000	133,750		2037/3/19
神奈川県 公募第7回	2.22	300,000	338,433		2027/3/19
神奈川県 公募(20年) 第14回	1.969	100,000	116,586		2030/7/19
神奈川県 公募(20年) 第17回	1.975	200,000	235,998		2031/7/11
神奈川県 公募(20年) 第26回	1.477	100,000	114,891		2034/6/20
大阪府 公募第378回	0.7	104,000	105,857		2023/11/28
大阪府 公募第381回	0.683	100,000	101,902		2024/2/27
大阪府 公募第382回	0.674	100,000	101,927		2024/3/28
大阪府 公募第383回	0.695	100,000	102,042		2024/4/26
大阪府 公募第384回	0.67	100,000	102,022		2024/5/29
大阪府 公募第387回	0.521	300,000	305,010		2024/8/28
大阪府 公募第389回	0.53	100,000	101,787		2024/10/30
大阪府 公募第396回	0.554	200,000	204,346		2025/5/28
大阪府 公募第417回	0.248	102,000	103,037		2027/2/26
大阪府 公募第423回	0.185	100,000	100,638		2027/8/30
大阪府 公募第429回	0.197	179,000	180,313		2028/2/25
大阪府 公募第452回	0.062	100,000	99,102		2030/1/30
大阪府 公募第5回	2.16	100,000	117,900		2030/5/28
大阪府 公募第8回	1.83	100,000	116,869		2031/12/22
大阪府 公募(5年) 第141回	0.001	230,000	229,921		2022/8/30
大阪府 公募(5年) 第178回	0.001	400,000	399,448		2025/12/25
京都府 公募平成24年度第2回	0.91	100,000	101,093		2022/6/20
京都府 公募平成24年度第6回	0.8	100,000	101,224		2022/10/21
京都府 公募平成25年度第15回	0.66	200,000	203,800		2024/3/19
京都府 公募平成26年度第5回	1.455	100,000	114,694		2034/8/10
京都府 公募平成26年度第7回	0.564	200,000	203,766		2024/9/19
京都府 公募(20年) 平成27年度第5回	1.23	200,000	224,254		2035/8/17

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
<b>地方債証券</b>	%	千円	千円		
京都府 公募 (15年) 平成27年度第8回	0.78	100,000	105,734	2030/10/11	
京都府 公募 (20年) 平成28年度第5回	0.327	100,000	98,935	2036/8/15	
京都府 公募平成29年度第4回	0.19	100,000	100,712	2027/6/21	
兵庫県 公募平成26年度第17回	0.46	100,000	101,679	2025/2/26	
兵庫県 公募平成29年度第22回	0.19	100,000	100,676	2028/1/21	
兵庫県 公募 (30年) 第2回	2.36	200,000	265,950	2040/3/19	
兵庫県 公募 (15年) 第1回	1.66	300,000	325,584	2026/7/29	
兵庫県 公募 (15年) 第3回	1.35	200,000	215,838	2027/7/16	
兵庫県 公募 (12年) 第3回	0.56	300,000	306,417	2025/4/16	
兵庫県 公募 (15年) 第11回	0.718	100,000	104,917	2030/5/10	
兵庫県 公募第2回	2.37	100,000	114,695	2027/9/17	
兵庫県 公募第9回	2.25	100,000	117,864	2029/11/19	
兵庫県 公募 (20年) 第11回	1.84	200,000	230,522	2030/8/16	
兵庫県 公募 (20年) 第14回	1.72	100,000	116,067	2032/5/24	
兵庫県 公募 (20年) 第22回	1.4	100,000	113,851	2034/9/8	
静岡県 公募平成24年度第5回	0.849	100,060	101,147	2022/7/20	
静岡県 公募平成24年度第10回	0.678	100,000	101,309	2023/3/22	
静岡県 公募平成25年度第5回	0.926	101,000	103,134	2023/7/25	
静岡県 公募平成26年度第3回	0.679	165,000	168,430	2024/5/27	
静岡県 公募平成26年度第8回	0.564	100,000	101,892	2024/9/25	
静岡県 公募平成26年度第9回	0.554	200,000	203,802	2024/10/24	
静岡県 公募平成27年度第11回	0.11	115,400	115,914	2026/3/19	
静岡県 公募平成28年度第2回	0.08	300,000	300,891	2026/3/19	
静岡県 公募平成29年度第3回	0.17	100,000	100,624	2027/3/19	
静岡県 公募 (31年) 第1回	0.095	174,000	173,587	2029/3/19	
静岡県 公募 (15年) 第5回	1.087	200,000	214,900	2028/11/20	
静岡県 公募 (15年) 第9回	0.739	100,000	105,208	2030/9/20	
静岡県 公募 (20年) 第11回	1.841	100,000	115,780	2030/10/18	
静岡県 公募 (20年) 第14回	1.736	200,000	232,932	2032/6/18	
静岡県 公募 (20年) 第18回	1.473	100,000	114,902	2034/7/10	
静岡県 公募 (20年) 第30回	0.449	200,000	197,314	2040/9/20	
愛知県 公募平成20年度第8回	2.04	100,000	114,835	2028/12/20	
愛知県 公募 (20年) 平成24年度第4回	1.687	100,000	115,903	2032/6/11	
愛知県 公募平成24年度第8回	0.835	150,000	151,740	2022/8/29	
愛知県 公募 (15年) 平成24年度第14回	1.314	400,000	433,064	2027/12/13	
愛知県 公募平成24年度第17回	1.829	100,000	118,119	2033/2/8	
愛知県 公募 (30年) 平成25年度第8回	2.024	120,000	155,031	2043/6/19	
愛知県 公募平成26年度第8回	1.814	100,000	125,505	2044/6/20	
愛知県 公募平成26年度第13回	1.363	100,000	113,617	2034/11/14	
愛知県 公募平成26年度第17回	0.463	300,000	305,190	2025/2/26	
愛知県 公募 (15年) 平成27年度第2回	0.74	100,000	105,187	2030/4/26	
愛知県 公募平成27年度第15回	0.471	100,000	102,099	2025/11/27	
愛知県 公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,798	2027/8/31	
愛知県 公募平成29年度第9回	0.15	100,000	100,482	2027/9/15	
広島県 公募平成24年度第4回	0.81	100,000	101,322	2022/11/28	
広島県 公募平成25年度第3回	0.8	200,000	203,904	2023/9/25	
広島県 公募平成26年度第5回	0.33	109,650	110,949	2025/1/27	
広島県 公募平成26年度第7回	0.46	200,000	203,502	2025/3/25	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
地方債証券	%				
広島県 公募平成29年度第3回	0.15	100,000	100,484	千円	2027/9/27
広島県 公募平成29年度第4回	0.22	211,300	213,326	千円	2027/11/24
広島県 公募令和2年度第2回	0.165	100,000	99,907	千円	2030/7/22
埼玉県 公募平成24年度第4回	0.84	300,000	303,261	千円	2022/7/25
埼玉県 公募平成25年度第4回	0.921	100,000	102,098	千円	2023/7/24
埼玉県 公募平成25年度第6回	0.806	148,000	150,917	千円	2023/9/27
埼玉県 公募平成25年度第10回	0.67	100,000	101,892	千円	2024/2/26
埼玉県 公募平成25年度第11回	0.655	100,000	101,898	千円	2024/3/26
埼玉県 公募平成26年度第3回	0.67	100,000	102,038	千円	2024/5/20
埼玉県 公募平成26年度第6回	0.554	200,000	203,718	千円	2024/9/26
埼玉県 公募平成26年度第7回	0.476	400,000	406,812	千円	2024/12/25
埼玉県 公募平成26年度第9回	0.429	100,000	101,596	千円	2025/2/25
埼玉県 公募平成27年度第9回	0.235	100,000	101,054	千円	2026/2/25
埼玉県 公募平成28年度第5回	0.05	100,000	100,026	千円	2026/7/28
埼玉県 公募平成30年度第4回	0.205	200,000	201,580	千円	2028/6/26
埼玉県 公募平成30年度第7回	0.02	200,000	200,016	千円	2023/10/26
埼玉県 公募(15年) 第1回	0.941	100,000	106,817	千円	2029/10/19
埼玉県 公募(15年) 第2回	0.869	200,000	212,780	千円	2030/5/22
埼玉県 公募(15年) 第3回	0.43	100,000	102,078	千円	2032/1/30
埼玉県 公募(25年) 第2回	0.781	200,000	207,964	千円	2042/9/19
埼玉県 公募(20年) 第6回	2.26	100,000	116,075	千円	2028/9/21
埼玉県 公募(20年) 第16回	1.216	100,000	111,928	千円	2035/8/14
埼玉県 公募(20年) 第20回	0.626	100,000	103,185	千円	2037/5/15
福岡県 公募平成26年度第1回	0.654	100,000	102,051	千円	2024/6/26
福岡県 公募平成27年度第1回	0.578	300,000	307,074	千円	2025/6/26
福岡県 公募平成29年度第1回	0.2	100,000	100,775	千円	2027/6/23
福岡県 公募平成23年度第1回	1.491	100,000	108,043	千円	2026/11/27
福岡県 公募(15年) 平成27年度第1回	0.784	200,000	211,638	千円	2030/11/25
福岡県 公募(15年) 令和元年度第1回	0.254	100,000	99,083	千円	2034/6/14
福岡県 公募(30年) 平成19年度第1回	2.62	100,000	134,435	千円	2037/9/18
福岡県 公募(30年) 平成26年度第1回	1.827	100,000	125,772	千円	2044/6/20
福岡県 公募(30年・定期償還) 平成29年度第2回	0.937	100,000	105,934	千円	2047/12/20
福岡県 公募(20年) 平成20年度第2回	2.05	100,000	114,911	千円	2028/12/20
福岡県 公募(20年) 平成22年度第2回	2.116	300,000	357,174	千円	2031/2/21
福岡県 公募(20年) 平成24年度第2回	1.635	100,000	115,448	千円	2032/8/16
千葉県 公募平成24年度第2回	0.91	100,000	101,029	千円	2022/5/25
千葉県 公募平成24年度第7回	0.74	100,000	101,253	千円	2022/12/22
千葉県 公募平成24年度第8回	0.84	100,000	101,503	千円	2023/1/25
千葉県 公募平成25年度第3回	0.89	100,000	101,953	千円	2023/6/23
千葉県 公募平成25年度第4回	0.92	100,000	102,099	千円	2023/7/25
千葉県 公募平成26年度第1回	0.679	100,000	102,023	千円	2024/4/25
千葉県 公募平成26年度第3回	0.611	200,000	203,916	千円	2024/7/25
千葉県 公募平成27年度第6回	0.469	200,000	204,250	千円	2025/12/25
千葉県 公募平成28年度第4回	0.085	200,000	200,436	千円	2026/9/25
千葉県 公募平成29年度第4回	0.15	100,000	100,483	千円	2027/9/24
千葉県 公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,798	千円	2028/3/24
千葉県 公募(20年) 第1回	2.06	400,000	438,484	千円	2025/12/19
千葉県 公募(20年) 第8回	2.18	100,000	118,136	千円	2030/4/19

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
地方債証券	%			千円	
千葉県 公募(20年) 第16回	1.555	200,000	231,632	2034/4/14	
千葉県 公募(20年) 第17回	1.403	100,000	114,131	2034/10/13	
群馬県 公募第12回	0.519	100,000	102,177	2025/8/15	
群馬県 公募(20年) 第3回	1.687	100,000	115,892	2032/6/25	
岐阜県 公募平成26年度第1回	0.554	186,670	190,151	2024/9/30	
共同発行市場地方債 公募第110回	0.89	200,000	202,012	2022/5/25	
共同発行市場地方債 公募第111回	0.89	200,000	202,156	2022/6/24	
共同発行市場地方債 公募第112回	0.84	100,000	101,087	2022/7/25	
共同発行市場地方債 公募第113回	0.77	800,000	808,472	2022/8/25	
共同発行市場地方債 公募第114回	0.82	243,700	246,604	2022/9/22	
共同発行市場地方債 公募第115回	0.8	100,000	101,233	2022/10/25	
共同発行市場地方債 公募第116回	0.8	200,000	202,598	2022/11/25	
共同発行市場地方債 公募第118回	0.84	100,000	101,503	2023/1/25	
共同発行市場地方債 公募第119回	0.8	200,000	202,988	2023/2/24	
共同発行市場地方債 公募第120回	0.68	300,000	303,948	2023/3/24	
共同発行市場地方債 公募第121回	0.57	100,000	101,148	2023/4/25	
共同発行市場地方債 公募第122回	0.62	400,000	405,208	2023/5/25	
共同発行市場地方債 公募第124回	0.91	300,000	306,225	2023/7/25	
共同発行市場地方債 公募第126回	0.81	100,000	101,977	2023/9/25	
共同発行市場地方債 公募第128回	0.66	700,000	711,900	2023/11/24	
共同発行市場地方債 公募第129回	0.71	100,000	101,887	2023/12/25	
共同発行市場地方債 公募第130回	0.76	100,000	102,088	2024/1/25	
共同発行市場地方債 公募第132回	0.66	100,000	101,911	2024/3/25	
共同発行市場地方債 公募第136回	0.611	200,000	203,916	2024/7/25	
共同発行市場地方債 公募第137回	0.566	500,000	509,255	2024/8/23	
共同発行市場地方債 公募第139回	0.544	155,000	157,893	2024/10/25	
共同発行市場地方債 公募第143回	0.448	540,000	549,018	2025/2/25	
共同発行市場地方債 公募第145回	0.406	1,000,000	1,015,670	2025/4/25	
共同発行市場地方債 公募第154回	0.405	300,000	305,556	2026/1/23	
共同発行市場地方債 公募第156回	0.1	200,000	200,796	2026/3/25	
共同発行市場地方債 公募第157回	0.08	300,000	300,528	2026/4/24	
共同発行市場地方債 公募第161回	0.06	300,000	300,240	2026/8/25	
共同発行市場地方債 公募第172回	0.225	600,000	605,652	2027/7/23	
共同発行市場地方債 公募第184回	0.175	100,000	100,581	2028/7/25	
共同発行市場地方債 公募第186回	0.25	400,000	404,308	2028/9/25	
共同発行市場地方債 公募第188回	0.264	300,000	303,522	2028/11/24	
共同発行市場地方債 公募第190回	0.16	610,000	612,055	2029/1/25	
共同発行市場地方債 公募第191回	0.14	100,000	100,130	2029/2/22	
共同発行市場地方債 公募第200回	0.07	100,000	99,358	2029/11/22	
共同発行市場地方債 公募第213回	0.125	300,000	298,419	2030/12/25	
堺市 公募平成22年度第1回	1.97	100,000	117,055	2030/11/19	
堺市 公募平成26年度第1回	1.664	100,000	122,133	2044/9/20	
島根県 公募(30年) 平成29年度第1回	0.919	100,000	105,531	2047/6/20	
佐賀県 公募平成28年度第1回	0.08	100,000	100,084	2026/11/30	
福島県 公募平成26年度第1回	0.495	200,000	203,474	2024/11/28	
滋賀県 公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,682	2023/11/29	
滋賀県 公募平成26年度第1回	0.495	142,000	144,466	2024/11/28	
栃木県 公募平成24年度第1回	0.79	100,000	101,293	2022/11/30	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
<b>地方債証券</b>	%				
栃木県 公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,682	千円	2023/11/29
熊本市 公募平成29年度第1回	0.19	100,000	100,763		2027/11/30
新潟市 公募平成25年度第1回	0.72	233,200	237,670		2023/12/26
新潟市 公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,904		2027/12/24
浜松市 公募平成26年度第1回	0.335	100,000	101,201		2025/1/23
大阪市 公募平成25年度第6回	0.694	100,000	101,787		2023/11/22
大阪市 公募平成26年度第5回	0.593	100,000	101,997		2024/9/27
大阪市 公募(15年) 第1回	1.753	100,000	109,025		2026/7/17
大阪市 公募(20年) 第1回	2.3	300,000	344,025		2027/11/15
大阪市 公募(20年) 第5回	2.47	100,000	117,635		2028/9/21
大阪市 公募(20年) 第6回	2.21	100,000	116,137		2028/12/20
大阪市 公募(20年) 第17回	1.721	100,000	116,690		2032/12/21
大阪市 公募(20年) 第26回	0.635	100,000	103,086		2037/10/23
名古屋市 公募第481回	0.744	100,000	101,256		2022/12/20
名古屋市 公募第488回	0.598	300,000	306,009		2024/9/20
名古屋市 公募第489回	0.461	100,000	101,640		2024/12/20
名古屋市 公募第501回	0.175	200,000	201,292		2027/9/29
名古屋市 公募第503回	0.205	100,000	100,832		2028/3/24
名古屋市 公募第504回	0.205	200,000	201,650		2028/6/20
名古屋市 公募第512回	0.15	300,000	299,451		2030/6/20
名古屋市 公募(12年) 第1回	1.033	200,000	208,538		2025/6/20
名古屋市 公募(15年) 第2回	0.905	100,000	106,525		2029/11/16
京都市 公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,860		2027/8/25
京都市 公募平成29年度第4回	0.235	101,280	102,347		2028/1/31
京都市 公募(20年) 第2回	2.12	100,000	109,377		2025/9/19
京都市 公募(20年) 第5回	2.36	200,000	226,150		2026/12/18
京都市 公募(20年) 第6回	2.38	100,000	114,833		2027/9/17
京都市 公募(20年) 第13回	1.359	100,000	113,589		2034/11/24
京都市 公募(20年) 第15回	0.487	200,000	202,256		2036/11/28
神戸市 公募平成26年度第17回	0.28	300,000	302,982		2025/1/27
神戸市 公募平成28年度第1回	0.08	200,000	200,352		2026/4/17
神戸市 公募平成30年度第2回	0.845	200,000	207,040		2048/3/19
横浜市 公募公債平成24年度第2回	0.815	200,000	202,478		2022/10/17
横浜市 公募公債平成25年度第1回	0.664	200,000	202,772		2023/5/19
横浜市 公募公債平成25年度第5回	0.655	200,000	203,352		2023/11/17
横浜市 公募公債平成26年度第5回	0.471	200,000	203,338		2024/12/13
横浜市 公募平成28年度第5回	0.23	300,000	302,904		2027/2/19
横浜市 公募平成29年度第3回	0.22	100,000	100,919		2027/8/13
横浜市 公募(30年) 第2回	2.49	200,000	258,222		2035/3/20
横浜市 公募(20年) 第18回	2.21	100,000	116,923		2029/5/25
横浜市 公募(20年) 第26回	1.776	100,000	117,466		2033/1/28
横浜市 公募(20年) 第30回	1.376	100,000	113,798		2034/10/20
札幌市 公募(15年) 平成23年度第9回	1.493	200,000	216,706		2027/2/12
札幌市 公募(20年) 平成24年度第1回	1.79	100,000	116,892		2032/4/23
札幌市 公募(20年) 平成24年度第11回	1.794	100,000	117,727		2033/2/28
札幌市 公募平成26年度第4回	0.54	100,000	101,674		2024/6/20
札幌市 公募平成26年度第9回	0.43	200,000	203,050		2024/12/20
川崎市 公募第85回	0.72	100,000	101,214		2022/12/20

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
<b>地方債証券</b>					
川崎市 公募(20年) 第17回	1.527	100,000	114,868	千円	2033/5/9
川崎市 公募(20年) 第19回	1.362	100,000	113,541	千円	2034/9/20
川崎市 公募(30年) 第11回	0.817	100,000	102,882	千円	2048/3/19
北九州市 公募(10年) 令和2年度第2回	0.125	200,000	198,756	千円	2030/12/24
北九州市 公募(20年) 第3回	2.33	200,000	228,924	千円	2027/9/21
北九州市 公募(20年) 第14回	1.732	100,000	116,666	千円	2032/11/12
福岡市 公募(20年) 平成21年度第3回	2.14	200,000	233,684	千円	2029/9/18
福岡市 公募(20年) 平成23年度第4回	1.89	100,000	117,197	千円	2031/8/19
福岡市 公募平成26年度第2回	1.49	100,000	115,056	千円	2034/6/20
福岡市 公募平成26年度第5回	0.539	100,000	101,853	千円	2024/10/28
福岡市 公募平成26年度第8回	0.465	160,000	162,833	千円	2025/3/25
広島市 公募平成26年度第2回	0.456	100,000	101,628	千円	2024/12/25
広島市 公募平成27年度第2回	0.464	500,000	510,505	千円	2025/12/25
広島市 公募(10年) 平成30年度第6回	0.146	241,000	241,426	千円	2029/2/22
千葉市 公募平成26年度第2回	0.505	200,000	203,546	千円	2024/11/27
三重県 公募平成24年度第1回	0.801	140,660	142,395	千円	2022/10/25
三重県 公募平成28年度第1回	0.165	155,000	155,885	千円	2026/12/25
福井県 公募平成24年度第4回	0.46	100,000	100,922	千円	2023/4/26
福井県 公募平成27年度第4回	0.085	200,000	200,404	千円	2026/4/27
山梨県 公募平成24年度第1回	0.8	200,000	202,478	千円	2022/10/28
岡山県 公募平成28年度第2回	0.205	168,900	170,312	千円	2027/3/31
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	115,540	千円	2028/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	2.298	300,000	351,120	千円	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券 第117回	2.26	100,000	115,022	千円	2028/12/20
福岡北九州高速道路債券 第136回	0.833	100,000	104,655	千円	2030/3/19
小計		48,556,100	50,873,297	千円	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
政保 地方公共団体金融機関債券 第37回	0.895	604,000	610,662	千円	2022/6/17
政保 地方公共団体金融機関債券 第38回	0.839	194,000	196,135	千円	2022/7/15
政保 地方公共団体金融機関債券 第39回	0.801	100,000	101,123	千円	2022/8/15
政保 地方公共団体金融機関債券 第40回	0.819	101,000	102,233	千円	2022/9/16
政保 地方公共団体金融機関債券 第41回	0.791	102,000	103,276	千円	2022/10/18
政保 地方公共団体金融機関債券 第42回	0.805	108,000	109,438	千円	2022/11/14
政保 地方公共団体金融機関債券 第43回	0.734	202,000	204,589	千円	2022/12/16
政保 地方公共団体金融機関債券 第44回	0.834	145,000	147,225	千円	2023/1/20
政保 地方公共団体金融機関債券 第45回	0.815	223,000	226,487	千円	2023/2/17
政保 地方公共団体金融機関債券 第48回	0.605	500,000	506,390	千円	2023/5/16
政保 地方公共団体金融機関債券 第49回	0.882	13,000	13,252	千円	2023/6/16
政保 地方公共団体金融機関債券 第50回	0.911	100,000	102,076	千円	2023/7/14
政保 地方公共団体金融機関債券 第56回	0.747	591,000	603,221	千円	2024/1/19
政保 地方公共団体金融機関債券 第59回	0.669	116,000	118,302	千円	2024/4/12
政保 地方公共団体金融機関債券 第64回	0.544	100,000	101,823	千円	2024/9/13
政保 地方公共団体金融機関債券 第65回	0.539	400,000	407,416	千円	2024/10/16
政保 地方公共団体金融機関債券 第69回	0.414	320,000	324,956	千円	2025/2/17
政保 地方公共団体金融機関債券 第72回	0.509	189,000	192,861	千円	2025/5/23
政保 地方公共団体金融機関債券 第78回	0.381	509,000	517,622	千円	2025/11/18
政保 地方公共団体金融機関債券(8年) 第5回	0.173	500,000	502,310	千円	2024/1/29
政保 地方公共団体金融機関債券 第83回	0.02	116,000	115,998	千円	2026/4/17

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
特殊債券(除く金融債)	%			千円	
政保 地方公共団体金融機関債券 第108回	0.145	157,000	157,891	千円	2028/5/19
政保 地方公共団体金融機関債券 第110回	0.13	100,000	100,399	千円	2028/7/18
政保 地方公共団体金融機関債券 第113回	0.219	110,000	111,106	千円	2028/10/16
新関西国際空港債券 政府保証第1回	0.801	151,000	152,742	千円	2022/8/29
新関西国際空港債券 政府保証第2回	0.882	191,000	194,760	千円	2023/6/27
新関西国際空港債券 政府保証第5回	0.145	117,000	117,699	千円	2027/3/30
原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第16回	0.001	300,000	299,937	千円	2023/11/27
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	2.2	100,000	104,875	千円	2023/6/19
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	0.819	102,000	103,254	千円	2022/9/20
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	0.668	159,000	161,124	千円	2023/3/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	0.001	1,500,000	1,500,450	千円	2023/2/17
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	0.155	300,000	302,004	千円	2027/12/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	0.105	300,000	300,000	千円	2029/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	2.1	200,000	233,766	千円	2029/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	2.1	200,000	234,284	千円	2029/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	2.2	200,000	236,292	千円	2030/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	2.1	200,000	235,380	千円	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	1.9	200,000	232,444	千円	2030/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	2.1	100,000	129,153	千円	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	0.901	1,000,000	1,010,680	千円	2022/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	1.83	100,000	124,971	千円	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	0.839	100,000	101,134	千円	2022/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	1.634	100,000	115,503	千円	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	0.801	218,000	220,524	千円	2022/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	1.56	100,000	114,732	千円	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	1.919	300,000	380,460	千円	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	0.819	200,000	202,506	千円	2022/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	0.791	200,000	202,558	千円	2022/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	0.734	200,000	202,614	千円	2022/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	0.834	900,000	914,040	千円	2023/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	1.726	100,000	116,970	千円	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	0.541	196,000	198,181	千円	2023/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	0.605	400,000	405,208	千円	2023/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	0.882	1,000,000	1,019,740	千円	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	0.835	272,000	277,464	千円	2023/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	0.693	300,000	305,625	千円	2023/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	0.66	137,000	139,597	千円	2024/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	0.645	145,000	147,759	千円	2024/3/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	1.483	100,000	115,027	千円	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	1.72	100,000	123,621	千円	2044/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	1.478	100,000	115,063	千円	2034/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	0.644	300,000	306,117	千円	2024/6/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	1.72	100,000	123,752	千円	2044/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	0.556	190,000	193,503	千円	2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回	0.539	630,000	641,818	千円	2024/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	0.466	100,000	101,686	千円	2024/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	1.16	500,000	555,540	千円	2035/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第241回	0.45	200,000	203,476	千円	2025/3/31

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
特殊債券(除く金融債)	%			千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第261回	0.381	401,000	407,833	2025/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第271回	0.02	151,000	151,036	2026/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第297回	0.085	100,000	100,286	2026/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第306回	0.145	403,000	405,409	2027/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第315回	0.13	100,000	100,498	2027/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第321回	0.155	600,000	604,026	2027/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第324回	0.09	100,000	100,226	2027/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第335回	0.84	100,000	103,735	2047/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第339回	0.195	500,000	504,645	2028/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第342回	0.145	131,000	131,729	2028/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第351回	0.145	100,000	100,504	2028/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第354回	0.13	200,000	200,802	2028/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第357回	0.209	100,000	100,951	2028/8/31
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	360,000	366,372	2023/10/20
関西国際空港債券	政府保証第54回	2.4	300,000	350,292	2028/6/23
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	368,000	372,964	2023/3/22
中部国際空港債券	政府保証第22回	0.001	300,000	299,925	2024/3/1
預金保険機構債券	政府保証第230回	0.1	300,000	300,846	2024/8/6
預金保険機構債券	政府保証第231回	0.1	300,000	300,885	2024/10/4
新関西国際空港社債	財投機関債第6回	1.445	300,000	328,422	2028/9/15
新関西国際空港社債	財投機関債第9回	1.231	100,000	108,097	2028/12/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	107,181	2029/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第22回	0.05	200,000	199,972	2023/12/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第31回	0.781	300,000	303,414	2022/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	107,027	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第78回	0.225	200,000	201,378	2027/4/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第82回	0.27	100,000	100,935	2027/7/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第86回	0.235	300,000	302,334	2027/10/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第96回	0.195	200,000	200,720	2028/7/12
道路債券	財投機関債第17回	1.54	300,000	307,911	2022/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	130,731	2035/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第8回	2.45	200,000	223,840	2026/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第17回	2.35	100,000	112,269	2026/9/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第23回	2.39	300,000	342,612	2027/7/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第33回	2.91	200,000	304,988	2048/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第39回	2.37	200,000	232,906	2028/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第47回	2.41	100,000	117,852	2029/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第89回	1.711	100,000	115,622	2032/6/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第100回	0.784	200,000	202,666	2022/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第102回	0.666	100,000	101,291	2023/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第103回	1.69	350,000	405,944	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第105回	1.853	100,000	117,936	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第107回	0.935	100,000	102,034	2023/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第116回	0.722	400,000	406,948	2023/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第122回	0.704	100,000	102,016	2024/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第123回	0.69	100,000	101,974	2024/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	203,378	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	203,180	2024/6/20

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
特殊債券(除く金融債)	%			千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	0.583	200,000	203,796	2024/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	1.523	300,000	351,960	2044/12/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	1.604	100,000	119,043	2045/3/17	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	0.857	100,000	105,902	2030/6/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	1.149	100,000	110,176	2035/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	0.652	100,000	92,372	2056/3/17	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	0.614	100,000	102,117	2037/9/18	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第260回	0.651	200,000	195,200	2050/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	2.28	130,000	134,353	2022/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	2.83	400,000	523,100	2033/12/20	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	2.91	100,000	132,697	2034/6/20	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第38回	2.26	1,000,000	1,077,170	2024/9/20	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	2.95	100,000	132,788	2034/3/24	
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	2.07	100,000	114,713	2028/12/20	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	2.12	100,000	116,708	2029/12/28	
地方公共団体金融機構債券 F16回	2.042	100,000	111,179	2027/1/7	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	2.242	300,000	354,600	2030/3/28	
地方公共団体金融機構債券 F24回	1.681	100,000	103,278	2023/3/17	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第10回	1.752	300,000	342,864	2030/8/28	
地方公共団体金融機構債券 F104回	1.314	100,000	105,046	2025/3/7	
地方公共団体金融機構債券 F106回	1.259	100,000	103,662	2024/3/19	
地方公共団体金融機構債券 F122回	1.412	100,000	108,039	2027/6/18	
地方公共団体金融機構債券 F124回	1.418	100,000	108,027	2027/6/4	
地方公共団体金融機構債券 第37回	0.852	400,000	404,184	2022/6/28	
地方公共団体金融機構債券 F132回	1.09	500,000	522,905	2025/7/30	
地方公共団体金融機構債券 第41回	0.801	600,000	607,494	2022/10/28	
地方公共団体金融機構債券 F142回	1.016	100,000	103,626	2024/11/28	
地方公共団体金融機構債券 F145回	1.059	200,000	208,154	2025/3/19	
地方公共団体金融機構債券 F147回	1.291	100,000	107,065	2027/3/19	
地方公共団体金融機構債券 第42回	0.801	100,000	101,316	2022/11/28	
地方公共団体金融機構債券 第44回	0.791	100,000	101,427	2023/1/27	
地方公共団体金融機構債券 F160回	1.052	100,000	106,497	2028/5/26	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第29回	1.725	100,000	116,689	2033/6/28	
地方公共団体金融機構債券 第51回	0.841	600,000	611,880	2023/8/28	
地方公共団体金融機構債券 第52回	0.801	300,000	305,880	2023/9/15	
地方公共団体金融機構債券(15年) 第2回	1.161	200,000	215,490	2028/12/28	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第38回	1.487	100,000	114,404	2034/7/28	
地方公共団体金融機構債券 F240回	1.069	300,000	322,983	2030/2/28	
地方公共団体金融機構債券 第64回	0.574	100,000	101,913	2024/9/27	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回	1.425	100,000	113,714	2034/9/28	
地方公共団体金融機構債券 第74回	0.519	300,000	306,324	2025/7/28	
地方公共団体金融機構債券 第77回	0.491	100,000	102,105	2025/10/28	
地方公共団体金融機構債券 第79回	0.484	400,000	408,592	2025/12/26	
地方公共団体金融機構債券 第95回	0.2	200,000	201,208	2027/4/28	
地方公共団体金融機構債券 第101回	0.235	400,000	403,396	2027/10/28	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	1.45	100,000	102,482	2022/12/20	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	2.11	200,000	210,338	2023/9/20	
公営企業債券(20年) 第19回財投機関債	2.37	100,000	112,939	2026/12/18	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
公営企業債券(20年) 第20回財投機関債	2.25	100,000	112,784	2027/3/24	
公営企業債券(20年) 第24回財投機関債	2.29	100,000	115,171	2028/4/25	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	117,001	2028/6/20	
都市再生債券 財投機関債第96回	0.599	200,000	203,906	2024/9/20	
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	106,943	2029/9/20	
都市再生債券 財投機関債第101回	0.935	100,000	106,290	2029/11/20	
都市再生債券 財投機関債第109回	0.918	100,000	106,455	2030/6/20	
都市再生債券 財投機関債第113回	0.851	300,000	317,718	2030/9/20	
都市再生債券 財投機関債第121回	0.482	200,000	205,072	2031/2/20	
都市再生債券 財投機関債第127回	0.075	100,000	99,891	2026/9/18	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	109,238	2025/6/20	
東京交通債券 第342回	2.4	200,000	205,826	2022/6/21	
東京交通債券 第347回	2.05	157,000	166,261	2024/3/8	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	0.93	100,000	101,123	2022/6/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	2.26	400,000	450,988	2027/3/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	2.46	200,000	228,880	2027/6/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	2.15	100,000	105,268	2023/9/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	1.94	100,000	107,547	2025/3/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	2.11	100,000	117,291	2030/6/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	1.95	100,000	116,334	2030/10/22	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	2.066	100,000	118,368	2031/6/13	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	1.751	300,000	325,971	2026/6/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	2.056	100,000	118,338	2031/7/11	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回	1.841	200,000	232,938	2031/10/17	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	1.595	200,000	216,938	2026/12/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	1.836	100,000	117,376	2032/11/12	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	1.801	100,000	116,830	2032/9/17	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	2.273	100,000	131,936	2042/9/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	1.092	200,000	213,202	2028/3/17	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	1.31	100,000	108,366	2028/6/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	1.192	100,000	107,789	2028/10/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	0.484	250,000	255,170	2025/12/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	0.155	300,000	300,852	2026/12/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	0.403	100,000	101,031	2032/11/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回	0.274	130,000	131,176	2028/8/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第301回	0.04	300,000	299,928	2025/12/19	
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	202,908	2023/2/8	
成田国際空港 第17回	0.489	400,000	406,584	2025/2/20	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第6回	2.04	200,000	216,806	2025/6/20	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	2.098	200,000	236,022	2030/12/13	
東日本高速道路 第61回	0.14	200,000	198,932	2029/7/31	
中日本高速道路 第63回	0.576	100,000	102,353	2025/11/13	
中日本高速道路 第79回	0.04	300,000	299,940	2024/8/19	
西日本高速道路 第20回	0.759	200,000	203,606	2023/9/20	
西日本高速道路 第22回	0.744	400,000	408,296	2024/3/19	
西日本高速道路 第23回	0.602	100,000	101,792	2024/6/20	
西日本高速道路 第30回	0.17	300,000	301,149	2026/5/22	
西日本高速道路 第50回	0.04	200,000	199,966	2024/6/20	

銘柄		当期末			
		利 率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第57回	0.835	300,000	305,436	2023/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第62回	0.714	100,000	101,875	2023/12/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第68回	0.586	200,000	203,682	2024/8/5
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第69回	1.441	100,000	113,838	2034/8/4
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第71回	0.525	500,000	508,950	2024/11/27
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第90回	0.2	300,000	298,827	2031/5/30
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	28,431	28,443	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	53,635	54,249	2039/6/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	32,019	32,288	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	35,682	36,687	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	11,122	11,308	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	24,136	24,688	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	27,768	28,921	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	30,945	31,126	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	49,964	51,152	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	53,820	54,582	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	47,976	49,247	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	77,898	80,140	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	13,391	13,884	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	20,661	22,122	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	66,873	71,174	2044/9/10
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券		1.64	11,720	11,842	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	64,656	68,016	2045/11/10
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券		1.71	23,604	23,869	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	79,515	84,157	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	64,354	67,856	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	36,752	39,169	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	78,813	83,495	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	81,531	85,186	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	124,833	130,606	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	120,600	126,920	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	78,046	81,821	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	29,434	31,082	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	64,030	67,835	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	40,357	41,973	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	87,898	91,508	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	39,108	40,682	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	22,170	22,479	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	117,561	123,175	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	25,110	26,769	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	27,170	28,993	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	25,312	26,907	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	27,323	29,006	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	78,558	82,932	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	111,222	117,232	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	37,127	39,157	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	76,806	80,291	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券		1.82	10,265	10,336	2036/5/10

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
特殊債券(除く金融債)	%			千円	
貸付債権担保 S種第14回住宅金融支援機構債券	1.7	46,550	46,574	千円	2032/5/10
貸付債権担保 S種第15回住宅金融支援機構債券	1.65	18,996	19,006	千円	2032/5/10
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	2.25	72,192	76,534	千円	2044/4/10
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	1.82	73,071	77,611	千円	2045/1/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	134,480	141,182	千円	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	80,366	84,800	千円	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	131,952	137,893	千円	2047/9/10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	1.07	115,059	119,602	千円	2048/4/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	89,550	94,263	千円	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	75,868	79,505	千円	2048/8/10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	1.04	184,444	191,871	千円	2049/4/10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	1.01	319,753	332,140	千円	2049/5/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	48,694	50,402	千円	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	50,684	52,524	千円	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	51,924	53,598	千円	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	109,014	111,802	千円	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	114,502	116,558	千円	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	60,519	62,267	千円	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	64,313	65,976	千円	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	191,736	197,662	千円	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	197,769	204,684	千円	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	132,800	137,297	千円	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	64,768	66,841	千円	2050/9/10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	0.89	65,349	67,627	千円	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	0.41	242,898	244,250	千円	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	0.48	162,800	164,528	千円	2052/1/10
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	0.46	164,048	165,542	千円	2052/2/10
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	0.47	81,986	82,793	千円	2052/3/10
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	0.46	163,854	165,351	千円	2052/4/10
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	0.4	82,632	83,069	千円	2052/5/10
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	0.43	83,037	83,628	千円	2052/6/10
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	0.46	84,470	85,219	千円	2052/8/10
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	0.42	337,656	339,708	千円	2052/10/10
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	0.43	254,952	256,637	千円	2052/11/10
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	0.42	170,066	171,074	千円	2053/1/10
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	0.46	173,062	174,513	千円	2053/2/10
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	0.39	176,570	177,163	千円	2053/7/10
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	0.39	88,301	88,590	千円	2053/8/10
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	0.44	89,084	89,745	千円	2053/9/10
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	0.38	89,671	89,933	千円	2054/1/10
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	0.32	273,804	273,324	千円	2054/3/10
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	0.33	275,004	274,629	千円	2054/5/10
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	0.21	471,440	465,938	千円	2054/11/10
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	0.33	190,682	190,338	千円	2055/1/10
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	0.3	192,240	191,378	千円	2055/3/10
貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	0.33	298,476	297,744	千円	2056/1/10
貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	0.36	199,644	199,747	千円	2056/2/10
貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	0.41	300,000	301,416	千円	2056/3/10

銘柄	利 率 %	当 期 末		
		額面金額 千円	評価額 千円	償還年月日
特殊債券(除く金融債) 貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券 フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	0.41 0.725	200,000 100,000	200,904 101,818	2056/4/10 2024/7/30
小計		58,137,926	60,862,888	
<b>金融債券</b>				
商工債券 利付第806回い号	0.1	300,000	300,258	2022/7/27
商工債券 利付第811回い号	0.17	300,000	300,705	2022/12/27
商工債券 利付第815回い号	0.17	100,000	100,270	2023/4/27
商工債券 利付第818回い号	0.17	100,000	100,291	2023/7/27
商工債券 利付第819回い号	0.18	300,000	300,975	2023/8/25
商工債券 利付第829回い号	0.13	200,000	200,354	2024/6/27
商工債券 利付第831回い号	0.08	200,000	200,028	2024/8/27
商工債券 利付第833回い号	0.05	100,000	99,855	2024/10/25
しんきん中金債券 利付第335回	0.1	200,000	200,222	2022/10/27
商工債券 利付(3年) 第236回	0.02	500,000	499,890	2022/9/27
商工債券 利付(10年) 第15回	0.48	200,000	203,374	2025/9/19
小計		2,500,000	2,506,222	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
東京電力 第548回	2.347	100,000	111,181	2028/9/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	110,191	2029/12/10
中部電力 第500回	0.875	200,000	205,122	2024/5/24
中部電力 第524回	0.39	100,000	101,154	2027/5/25
中部電力 第530回	0.274	200,000	199,660	2029/6/25
関西電力 第509回	0.47	100,000	101,424	2027/5/25
関西電力 第511回	0.41	100,000	100,985	2027/9/17
関西電力 第527回	0.28	200,000	201,228	2024/4/25
関西電力 第535回	0.18	200,000	200,374	2025/12/19
中国電力 第377回	1.121	100,000	102,584	2023/8/25
中国電力 第378回	1.004	100,000	102,444	2023/10/25
中国電力 第400回	0.34	100,000	100,767	2027/9/24
中国電力 第402回	0.25	100,000	100,602	2024/10/25
北陸電力 第301回	1.158	100,000	102,202	2023/3/24
北陸電力 第307回	1.055	100,000	104,674	2026/6/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	102,375	2024/9/25
北陸電力 第326回	0.719	100,000	101,127	2038/4/23
東北電力 第475回	0.809	100,000	102,514	2024/9/25
東北電力 第481回	0.803	200,000	205,814	2025/7/25
東北電力 第484回	0.758	100,000	102,187	2036/5/23
東北電力 第491回	0.42	100,000	101,254	2027/2/25
東北電力 第521回	0.45	100,000	100,975	2030/5/24
四国電力 第281回	1.111	100,000	102,624	2023/9/25
九州電力 第424回	1.233	100,000	103,110	2023/11/24
九州電力 第428回	0.936	105,000	107,972	2024/7/25
九州電力 第449回	0.43	200,000	202,572	2027/4/23
九州電力 第451回	0.45	100,000	101,395	2027/5/25
九州電力 第476回	0.43	100,000	100,873	2029/5/25
九州電力 第484回	0.375	200,000	200,670	2029/11/22
北海道電力 第321回	0.886	100,000	102,888	2024/12/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	108,456	2030/3/25

銘柄	利率	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
北海道電力 第338回	0.84	100,000	102,912	2036/11/25	
北海道電力 第345回	0.27	300,000	301,761	2024/9/25	
東京電力パワーグリッド 第6回	0.85	100,000	101,869	2027/8/31	
東京電力パワーグリッド 第11回	0.79	300,000	303,741	2028/1/25	
東京電力パワーグリッド 第14回	0.43	100,000	100,677	2023/7/24	
東京電力パワーグリッド 第28回	1.01	100,000	102,167	2029/7/10	
東京電力パワーグリッド 第35回	1.2	100,000	103,655	2030/4/23	
東京電力パワーグリッド 第38回	0.58	200,000	202,422	2025/7/16	
東京電力パワーグリッド 第40回	1.37	400,000	418,808	2035/7/13	
長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	199,572	2030/7/12	
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	0.69	100,000	99,996	2036/11/28	
日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付	0.03	200,000	199,786	2023/7/14	
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	100,280	2024/3/8	
日本たばこ産業 第13回	0.355	100,000	100,254	2028/9/8	
三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付	0.41	100,000	98,833	2027/8/31	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	101,297	2023/9/20	
森ビルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	0.34	200,000	197,676	2026/8/28	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	0.97	100,000	98,811	2038/5/17	
セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付	0.06	100,000	100,034	2023/12/20	
セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約付	0.28	200,000	200,736	2027/12/20	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	100,153	2027/7/16	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,822	2028/7/18	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	0.734	200,000	198,262	2028/10/25	
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	0.425	100,000	100,737	2028/1/26	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	100,039	2027/9/13	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	99,821	2028/6/19	
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,469	2029/5/30	
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付	0.83	100,000	99,456	2040/6/11	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	0.424	100,000	100,095	2028/10/25	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	100,084	2024/5/31	
オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,091	2025/9/17	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	99,282	2024/12/6	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	0.37	100,000	98,781	2026/7/31	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	0.45	100,000	97,389	2029/6/25	
プリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	0.295	100,000	100,222	2027/4/21	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	0.385	300,000	298,416	2028/6/20	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	99,315	2026/5/27	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,045	2025/7/14	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	0.3	200,000	199,624	2027/3/1	
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	0.01	300,000	299,679	2023/7/18	
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,889	2025/10/22	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	215,658	2028/12/13	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	0.658	100,000	100,673	2022/7/15	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	202,196	2026/9/18	
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	0.08	100,000	100,006	2023/12/22	
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	100,048	2025/12/24	
ソニー 第32回	0.28	100,000	100,383	2023/9/20	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	99,379	2027/6/7	

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%			千円	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,936	2027/8/27	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,468	2024/9/13	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	0.25	100,000	100,181	2022/10/31	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	101,806	2023/3/20	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	0.42	100,000	99,299	2026/12/11	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	100,493	2024/3/21	
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	99,816	2025/12/2	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	103,826	2025/12/5	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	0.954	200,000	207,542	2026/7/10	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	107,172	2029/7/13	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	1.286	100,000	106,882	2029/1/29	
住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	100,165	2027/7/26	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	0.543	200,000	200,908	2022/6/3	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	0.904	100,000	102,385	2024/4/24	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	100,476	2027/7/30	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	102,086	2024/6/28	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	0.94	100,000	101,715	2024/6/26	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	0.27	100,000	100,152	2025/7/23	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	0.915	200,000	203,280	2025/6/5	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	2.54	100,000	114,270	2027/7/27	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	103,384	2022/10/27	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.849	300,000	304,341	2024/9/12	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	0.884	100,000	101,714	2025/5/29	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	1.328	100,000	105,283	2030/5/29	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	1.389	300,000	305,148	2022/9/20	
三井住友信託銀行 第18回社債間限定同順位特約付	0.16	200,000	199,954	2026/1/27	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	101,380	2023/3/20	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	101,415	2024/12/20	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	0.39	300,000	303,276	2027/9/17	
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.95	200,000	202,958	2024/7/16	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	2.87	100,000	112,571	2026/11/6	
芙蓉総合リース 第26回社債間限定同順位特約付	0.03	200,000	199,378	2023/10/20	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	0.24	300,000	300,645	2025/7/15	
みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付	0.33	200,000	199,872	2028/1/20	
N T T ファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,471	2026/12/18	
N T T ファイナンス 第18回日本電信電話保証付	0.38	200,000	201,210	2030/9/20	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	0.265	100,000	99,806	2027/10/22	
リコーアイリース 第28回社債間限定同順位特約付	0.345	100,000	99,948	2027/7/20	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	0.274	100,000	100,017	2023/8/30	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,205	2023/6/15	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,513	2026/6/19	
日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	99,025	2029/10/19	
三井住友ファイナンス&リース 第27回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,965	2026/10/16	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	100,597	2027/7/13	
三菱UFJリース 第56回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	101,137	2028/1/18	
三菱UFJリース 第76回社債間限定同順位特約付	0.37	300,000	299,280	2030/1/23	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	102,100	2025/8/12	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	197,246	2030/4/16	

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%			千円	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	0.24	100,000	99,706	2027/6/18	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	100,334	2027/3/19	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	0.96	100,000	96,424	2039/7/19	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	102,289	2024/1/26	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	102,005	2023/6/26	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	2.9	100,000	115,181	2028/3/17	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	0.871	100,000	101,695	2024/8/30	
東武鉄道 第124回社債間限定同順位特約付	0.001	100,000	99,704	2023/11/27	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	0.58	200,000	202,782	2025/1/28	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	109,243	2033/6/3	
東京急行電鉄 第83回社債間限定同順位特約付	0.459	200,000	202,214	2031/4/22	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	214,224	2030/6/12	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	0.756	100,000	101,619	2037/5/29	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	2.376	200,000	232,586	2028/12/12	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	115,196	2030/9/27	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	0.981	100,000	106,415	2035/1/29	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	113,425	2045/1/27	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	1.246	100,000	108,180	2058/9/27	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	0.771	200,000	186,832	2059/12/23	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	2.34	100,000	112,689	2027/2/19	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	2.26	300,000	341,229	2027/12/20	
西日本旅客鉄道 第65回社債間限定同順位特約付	0.24	200,000	199,630	2030/8/27	
西日本旅客鉄道 第66回社債間限定同順位特約付	0.629	200,000	200,138	2040/8/27	
東海旅客鉄道 第17回社債間限定同順位特約付	2.21	200,000	214,864	2024/9/20	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	234,580	2030/4/23	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	110,048	2032/9/30	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	1.014	300,000	320,313	2035/1/26	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	118,970	2045/3/6	
東京地下鉄 第22回	0.215	100,000	100,246	2027/6/21	
東京地下鉄 第23回	0.661	100,000	101,343	2037/6/19	
東京地下鉄 第24回	1.035	100,000	104,952	2047/6/21	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	0.758	200,000	199,832	2032/3/17	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	0.717	100,000	102,733	2031/3/4	
阪急阪神ホールディングス 第47回	1.202	400,000	429,672	2029/7/18	
阪急阪神ホールディングス 第49回	0.817	100,000	102,600	2036/12/15	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,558	2027/4/30	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	99,683	2026/7/14	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	0.7	100,000	99,040	2036/7/14	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	2.13	100,000	105,775	2031/9/9	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	100,535	2027/2/23	
九州旅客鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	0.929	200,000	200,880	2049/3/5	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	96,896	2039/12/9	
ANAホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	0.99	100,000	91,129	2036/6/9	
滋賀倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,462	2023/6/14	
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	101,805	2023/12/20	
KDDI 第25回社債間限定同順位特約付	0.395	100,000	99,991	2028/11/22	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	102,486	2024/2/20	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	102,622	2024/6/20	

銘柄	利 率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%				
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	102,361	千円	2024/8/20
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	0.415	100,000	101,097	千円	2027/7/20
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	0.414	100,000	100,827	千円	2028/9/20
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	124,669	千円	2043/12/17
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	94,282	千円	2039/9/13
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	0.642	100,000	94,603	千円	2049/6/4
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,344	千円	2024/3/14
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	98,068	千円	2034/12/12
広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	0.405	100,000	100,357	千円	2028/9/13
東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	0.18	100,000	99,895	千円	2023/7/5
ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.405	100,000	101,056	千円	2028/6/6
ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	1.569	100,000	100,924	千円	2024/6/12
フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 第29回円貨社債	0.25	200,000	199,406	千円	2024/10/10
フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 第31回円貨社債	0.423	100,000	98,904	千円	2029/10/10
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	0.45	100,000	100,186	千円	2026/6/17
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債 (2014)	0.865	100,000	102,127	千円	2024/11/28
クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債 (2018)	0.204	100,000	99,739	千円	2023/6/8
クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債 (2018)	0.509	100,000	99,453	千円	2028/6/8
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債 (2015)	1.043	100,000	100,595	千円	2025/6/5
エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー 第2回円	0.842	100,000	100,728	千円	2023/9/26
エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー 第3回円	1.207	100,000	100,978	千円	2026/9/25
ロイズ・バンキング・グループ・ビーエルシー 第6回円貨社債	0.65	100,000	100,381	千円	2023/5/30
ロイズ・バンキング・グループ・ビーエルシー 第7回円貨社債	0.968	100,000	99,262	千円	2028/5/30
サンタンデール銀行 第1回円貨社債	0.568	100,000	99,990	千円	2023/1/11
フランス電力 第4回円貨社債 (2017)	1.088	100,000	102,314	千円	2027/1/26
現代キャピタル・サービスズ・インク 第15回円貨社債	0.65	200,000	196,070	千円	2023/8/2
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債 (2017)	0.967	100,000	100,823	千円	2024/3/1
ウエストパック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社債	0.32	200,000	199,848	千円	2023/7/6
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	0.293	200,000	200,264	千円	2024/1/23
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債 (2017)	0.448	100,000	99,983	千円	2022/5/26
小計		27,305,000	27,858,685		
合計		688,944,026	732,440,992		

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2021年3月31日現在)

項目	当 期 末	
	評価額	比率
公社債	732,440,992	% 98.8
コール・ローン等、その他	9,002,388	1.2
投資信託財産総額	741,443,380	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月31日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コレ・ローン等	741,443,380,268
公社債(評価額)	6,658,847,151
未収入金	732,440,992,596
未収利息	1,527,665,360
前払費用	798,689,638
前払利息	17,185,523
(B) 負債	5,613,526,512
未払金	5,020,835,000
未払解約金	592,685,149
未払利息	6,363
(C) 純資産総額(A-B)	735,829,853,756
元本	555,429,500,070
次期繰越損益金	180,400,353,686
(D) 受益権総口数	555,429,500,070口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,248円

(注) 期首元本額は509,213,794,132円、期中追加設定元本額は109,094,889,019円、期中一部解約元本額は62,879,183,081円、1口当たり純資産額は1,3248円です。

## ○損益の状況 (2020年4月1日~2021年3月31日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円
受取利息	5,636,811,966
支払利息	5,639,165,376
△	△ 2,353,410
(B) 有価証券売買損益	△ 10,484,385,273
売買益	397,903,581
売買損	△ 10,882,288,854
(C) 当期損益金(A+B)	△ 4,847,573,307
(D) 前期繰越損益金	170,101,972,795
(E) 追加信託差損益金	35,853,917,336
(F) 解約差損益金	△ 20,707,963,138
(G) 計(C+D+E+F)	180,400,353,686
次期繰越損益金(G)	180,400,353,686

\*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。

\*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。

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	円 160,072,020,061
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	50,684,248,245
マイバランス50(確定拠出年金向け)	48,012,057,740
野村世界6資産分散投信(安定コース)	41,279,288,281
マイバランス30(確定拠出年金向け)	36,957,694,659
マイ・ロード	33,474,705,153
マイバランス70(確定拠出年金向け)	18,180,099,308
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	18,055,531,807
野村世界6資産分散投信(分配コース)	17,613,590,187
ファンドランプ(ウェルス・スクエア)債券・安定型	16,865,747,649
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,072,423,854
マイバランスDC30	13,048,928,547
のむラップ・ファンド(保守型)	13,035,131,169
マイバランスDC50	10,536,432,250
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,440,101,077
のむラップ・ファンド(普通型)	10,396,404,692
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	5,996,645,094
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,630,888,862
マイバランスDC70	3,483,226,048
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,101,234,791
野村6資産均等バランス	2,647,040,693
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	2,341,271,307

ファンド名	当期末
	元本額
野村インデックスファンド・国内債券	円 2,336,235,916
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,889,625,001
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,585,821,345
のむラップ・ファンド(積極型)	1,445,869,703
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,352,621,530
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,303,446,491
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,066,154,772
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	963,345,785
野村日本債券インデックスファンド	892,862,563
のむラップ・ファンド(やや保守型)	890,461,251
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	883,874,195
野村円債投資インデックスファンド	870,238,879
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	690,877,988
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	677,187,339
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	570,588,956
野村国内債券インデックスファンド	412,178,214
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	369,436,143
野村資産設計ファンド2015	349,341,186
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	349,283,317
野村資産設計ファンド2020	347,706,914
野村資産設計ファンド2025	326,485,501
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	324,043,679

ファンド名	当期末
	元本額
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用) のむラップ・ファンド(やや積極型)	円 313,430,101 293,178,353
野村資産設計ファンド2030	257,830,546
野村資産設計ファンド2040	187,640,575
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	177,555,444
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	154,432,605
野村世界6資産分散投信(DC) 安定コース	150,612,897
野村資産設計ファンド2035	135,243,787
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	122,979,708
世界6資産分散ファンド	118,151,164
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	87,956,063
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	82,252,473
インデックス・ブレンド(タイプIII)	75,337,676
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	68,486,483
インデックス・ブレンド(タイプI)	48,855,898
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	44,498,366
インデックス・ブレンド(タイプII)	28,563,778
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	26,270,204
野村ターゲットデートファンド2016~2028年目標型	24,962,651
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	24,925,840

ファンド名	当期末
	元本額
野村資産設計ファンド2050	円 21,680,129
野村資産設計ファンド2045	18,534,637
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	18,435,781
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	17,498,696
インデックス・ブレンド(タイプIV)	14,641,420
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	14,051,378
野村FOFs用・ターゲット・リターン・資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	13,844,948
インデックス・ブレンド(タイプV)	12,579,673
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,912,684
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	10,272,001
野村資産設計ファンド2060	7,884,577
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	7,173,206
野村ターゲットデートファンド2016~2029~2031年目標型	6,735,994
野村ターゲットデートファンド2016~2032~2034年目標型	3,747,903
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,996,018
野村ターゲットデートファンド2016~2035~2037年目標型	2,261,041
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	498,750
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	188,480

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2021年5月10日）

作成対象期間（2020年5月12日～2021年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	ベンチマーク		債組入比率	債先物比率	純資産額
		期騰落	中率			
16期(2017年5月10日)	円 22,009	% 1.3	223.71	1.6	99.0	百万円 664,754
17期(2018年5月10日)	22,325	1.4	226.02	1.0	99.0	— 616,573
18期(2019年5月10日)	22,598	1.2	228.62	1.1	99.0	— 605,827
19期(2020年5月11日)	23,625	4.5	238.73	4.4	98.9	— 564,663
20期(2021年5月10日)	25,182	6.6	254.51	6.6	99.0	— 577,343

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク(=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、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指値をもとにしています。

\*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により運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(出所) FTSE Fixed Income LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

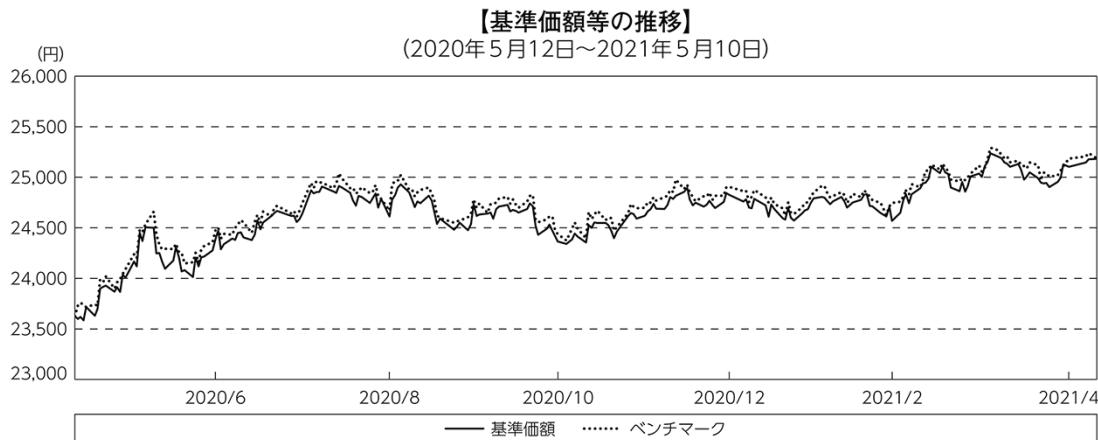
年月日	基準価額	ベンチマーク		債組入比率	債先物比率	券率
		騰落	率			
(期首) 2020年5月11日	円 23,625	% —	238.73	% —	% 98.9	% —
5月末	24,005	1.6	243.42	2.0	99.1	—
6月末	24,391	3.2	247.35	3.6	99.0	—
7月末	24,640	4.3	250.04	4.7	98.9	—
8月末	24,613	4.2	249.29	4.4	99.0	—
9月末	24,733	4.7	250.42	4.9	98.7	—
10月末	24,365	3.1	246.96	3.4	98.9	—
11月末	24,620	4.2	249.57	4.5	99.1	—
12月末	24,827	5.1	251.66	5.4	99.0	—
2021年1月末	24,792	4.9	251.09	5.2	98.8	—
2月末	24,570	4.0	250.05	4.7	99.1	—
3月末	25,111	6.3	253.57	6.2	99.0	—
4月末	25,102	6.3	254.49	6.6	98.9	—
(期末) 2021年5月10日	25,182	6.6	254.51	6.6	99.0	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、FTSE世界債券インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが米国を中心に上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、主要通貨が対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

当運用期間では、米国の追加経済対策に伴う国債増発懸念や新型コロナウイルスのワクチン普及による景気回復期待などを背景に、外国債券利回りは米国を中心に上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、内外長期金利差の拡大や世界景気の回復期待から安全資産としての円への需要が減少したことなどを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

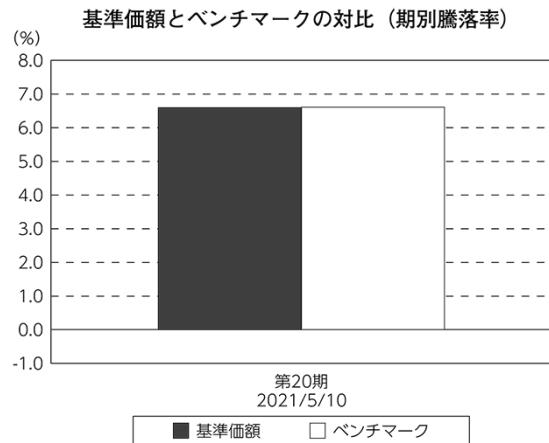
当運用期間の基準価額の騰落率は+6.6%となり、ベンチマークの+6.6%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### （その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



(注) ベンチマークは、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることでFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

## ○ 1万口当たりの費用明細

(2020年5月12日～2021年5月10日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他の費用	円 4	% 0.016	(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 )	(2)	(0.007)	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
( その他の )	(2)	(0.009)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	4	0.016	
期中の平均基準価額は、24,647円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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5月12日～2021年5月10日)

## 公社債

		買付額	売付額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 755,747
	カナダ	国債証券	千カナダドル 40,503
	イギリス	国債証券	千英ポンド 47,777
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 30,108
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 20,909
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 17,819
	ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	国債証券	73,148
	イタリア	国債証券	80,406
	フランス	国債証券	79,129
	オランダ	国債証券	23,173
	スペイン	国債証券	45,772

		買付額	売付額
外 国	ユーロ	千ユーロ	千ユーロ
	ベルギー 国債証券	20,291	25,461
	オーストリア 国債証券	10,588	9,497
	フィンランド 国債証券	1,989	502
	アイルランド 国債証券	28,828	15,560
	ポーランド 国債証券	千ズロチ 279,663	千ズロチ 283,094
	シンガポール 国債証券	千シンガポールドル 5,653	千シンガポールドル 7,430
	マレーシア 国債証券	千リンギ 27,109	千リンギ 23,803
	オーストラリア 国債証券	千豪ドル 66,000	千豪ドル 67,847
	イスラエル 国債証券	千新シェケル 15,053	千新シェケル 6,617
	メキシコ 国債証券	千メキシコペソ 209,236	千メキシコペソ 298,993

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年5月12日～2021年5月10日)

### 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 72,414	百万円 487	% 0.7	百万円 96,753	百万円 677	% 0.7

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野村信託銀行です。
--

(2021年5月10日現在)

## ○組入資産の明細

## 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	千米ドル 2,114,460	千米ドル 2,319,241	千円 252,263,901	% 43.7	% —	% 19.9	% 17.5	% 6.3
カナダ	千カナダドル 112,940	千カナダドル 131,371	千円 11,788,003	2.0	—	1.1	0.5	0.4
イギリス	千英ポンド 187,300	千英ポンド 245,691	千円 37,504,731	6.5	—	5.2	1.2	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 142,900	千スウェーデンクローナ 160,294	千円 2,099,858	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 108,800	千ノルウェークローネ 113,726	千円 1,508,013	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 131,770	千デンマーククローネ 165,425	千円 2,942,923	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	228,750	305,535	40,428,481	7.0	—	4.7	2.3	0.0
イタリア	327,760	422,562	55,913,474	9.7	—	6.4	2.4	0.9
フランス	342,170	439,968	58,216,657	10.1	—	6.5	2.7	0.8
オランダ	57,700	76,236	10,087,621	1.7	—	1.4	0.2	0.1
スペイン	216,350	283,413	37,501,318	6.5	—	4.5	1.5	0.5
ベルギー	80,800	104,775	13,863,837	2.4	—	1.9	0.5	0.0
オーストリア	49,800	62,287	8,241,932	1.4	—	1.2	0.3	0.0
フィンランド	18,400	20,320	2,688,839	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	52,780	59,511	7,874,579	1.4	—	0.8	0.3	0.3
ポーランド	千ズロチ 117,600	千ズロチ 124,821	千円 3,626,776	0.6	—	0.2	0.2	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 28,270	千シンガポールドル 30,764	千円 2,525,149	0.4	—	0.3	0.1	0.0
マレーシア	千リンギ 97,080	千リンギ 102,943	千円 2,730,575	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストラリア	千豪ドル 133,930	千豪ドル 150,495	千円 12,858,309	2.2	—	1.6	0.5	0.2
イスラエル	千新シェケル 68,700	千新シェケル 77,862	千円 2,605,943	0.5	—	0.2	0.1	0.1
メキシコ	千メキシコペソ 776,400	千メキシコペソ 835,537	千円 4,564,125	0.8	—	0.4	0.3	0.1
合計	—	—	571,835,057	99.0	—	57.3	31.5	10.3

\*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。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
国債証券	US TREASURY BOND	6.25	38,800	44,136	4,800,728	2023/8/15	
	US TREASURY BOND	2.375	45,100	48,061	5,227,643	2024/8/15	
	US TREASURY BOND	6.0	62,100	77,547	8,434,827	2026/2/15	
	US TREASURY BOND	6.125	14,800	19,486	2,119,522	2027/11/15	
	US TREASURY BOND	5.5	48,600	63,016	6,854,330	2028/8/15	
	US TREASURY BOND	5.25	48,000	61,687	6,709,749	2028/11/15	
	US TREASURY BOND	5.25	28,200	36,417	3,961,148	2029/2/15	
	US TREASURY BOND	4.375	100	134	14,643	2038/2/15	
	US TREASURY BOND	2.875	500	560	60,928	2043/5/15	
	US TREASURY BOND	3.75	4,100	5,246	570,702	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	1.75	16,300	16,564	1,801,761	2022/4/30	
	US TREASURY N/B	1.875	20,000	20,352	2,213,766	2022/4/30	
	US TREASURY N/B	1.75	8,300	8,441	918,201	2022/5/15	
	US TREASURY N/B	2.125	200	204	22,207	2022/5/15	
	US TREASURY N/B	1.875	200	203	22,169	2022/5/31	
	US TREASURY N/B	1.75	900	916	99,634	2022/5/31	
	US TREASURY N/B	1.75	33,400	34,014	3,699,757	2022/6/15	
	US TREASURY N/B	2.125	17,700	18,113	1,970,238	2022/6/30	
	US TREASURY N/B	1.75	100	101	11,084	2022/6/30	
	US TREASURY N/B	1.75	200	203	22,186	2022/7/15	
	US TREASURY N/B	2.0	100	102	11,135	2022/7/31	
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,022	111,187	2022/7/31	
	US TREASURY N/B	1.625	900	917	99,847	2022/8/15	
	US TREASURY N/B	1.5	400	407	44,296	2022/8/15	
	US TREASURY N/B	1.875	32,400	33,161	3,607,020	2022/8/31	
	US TREASURY N/B	1.625	8,200	8,365	909,961	2022/8/31	
	US TREASURY N/B	1.5	100	101	11,084	2022/9/15	
	US TREASURY N/B	1.75	900	920	100,145	2022/9/30	
	US TREASURY N/B	1.875	1,600	1,639	178,369	2022/9/30	
	US TREASURY N/B	1.375	600	610	66,457	2022/10/15	
	US TREASURY N/B	1.875	100	102	11,162	2022/10/31	
	US TREASURY N/B	2.0	1,500	1,542	167,743	2022/10/31	
	US TREASURY N/B	1.625	7,100	7,265	790,246	2022/11/15	
	US TREASURY N/B	2.0	100	102	11,199	2022/11/30	
	US TREASURY N/B	2.125	20,000	20,660	2,247,205	2022/12/31	
	US TREASURY N/B	1.5	1,600	1,637	178,083	2023/1/15	
	US TREASURY N/B	1.75	50,900	52,335	5,692,536	2023/1/31	
	US TREASURY N/B	2.375	100	103	11,301	2023/1/31	
	US TREASURY N/B	2.0	400	413	44,957	2023/2/15	
	US TREASURY N/B	1.5	64,800	66,417	7,224,227	2023/2/28	
	US TREASURY N/B	2.625	17,900	18,707	2,034,825	2023/2/28	
	US TREASURY N/B	1.5	400	410	44,636	2023/3/31	
	US TREASURY N/B	2.5	100	104	11,365	2023/3/31	
	US TREASURY N/B	1.625	15,000	15,437	1,679,157	2023/4/30	
	US TREASURY N/B	2.75	400	420	45,741	2023/4/30	
	US TREASURY N/B	1.75	40,500	41,806	4,547,320	2023/5/15	
	US TREASURY N/B	1.625	9,200	9,476	1,030,704	2023/5/31	

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		
				%	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.75	9,100	9,585	1,042,583	2023/5/31
		US TREASURY N/B	1.375	800	820	89,238	2023/6/30
		US TREASURY N/B	2.625	100	105	11,448	2023/6/30
		US TREASURY N/B	1.25	4,300	4,401	478,764	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.75	37,100	39,212	4,265,193	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.5	6,500	6,841	744,150	2023/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	10,900	11,198	1,218,011	2023/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	1,000	1,059	115,198	2023/8/31
		US TREASURY N/B	1.375	35,200	36,190	3,936,386	2023/9/30
		US TREASURY N/B	2.875	1,000	1,063	115,712	2023/9/30
		US TREASURY N/B	1.625	10,600	10,971	1,193,315	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.875	1,000	1,065	115,933	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.75	42,600	45,305	4,927,908	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	9,200	9,645	1,049,115	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.875	29,300	31,280	3,402,329	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	43,000	45,275	4,924,667	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.625	800	850	92,488	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.25	4,300	4,533	493,106	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.5	1,300	1,379	150,089	2024/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	800	855	93,032	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	500	526	57,235	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.375	400	423	46,081	2024/2/29
		US TREASURY N/B	2.125	1,700	1,789	194,688	2024/3/31
		US TREASURY N/B	2.0	500	525	57,112	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.25	700	740	80,537	2024/4/30
		US TREASURY N/B	2.5	20,900	22,286	2,424,076	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	2,200	2,313	251,604	2024/5/31
		US TREASURY N/B	2.0	17,700	18,629	2,026,378	2024/6/30
		US TREASURY N/B	1.75	500	522	56,783	2024/6/30
		US TREASURY N/B	2.125	3,800	4,018	437,059	2024/7/31
		US TREASURY N/B	1.875	300	314	34,242	2024/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	42,700	45,211	4,917,704	2024/9/30
		US TREASURY N/B	2.25	2,400	2,552	277,598	2024/10/31
		US TREASURY N/B	1.5	500	518	56,396	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	34,200	36,378	3,956,934	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	2,300	2,437	265,073	2024/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	1,900	2,024	220,217	2024/12/31
		US TREASURY N/B	2.5	1,000	1,074	116,893	2025/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	18,100	19,120	2,079,785	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.75	1,900	2,062	224,310	2025/2/28
		US TREASURY N/B	1.125	17,300	17,707	1,926,044	2025/2/28
		US TREASURY N/B	2.625	32,700	35,363	3,846,461	2025/3/31
		US TREASURY N/B	2.875	34,500	37,703	4,100,996	2025/4/30
		US TREASURY N/B	2.125	8,050	8,559	930,973	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,000	1,093	118,928	2025/5/31
		US TREASURY N/B	2.75	4,100	4,465	485,675	2025/6/30
		US TREASURY N/B	2.875	5,200	5,697	619,734	2025/7/31
		US TREASURY N/B	2.0	27,000	28,597	3,110,588	2025/8/15

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		
				千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.75	700	763	83,048 2025/8/31	
		US TREASURY N/B	3.0	29,200	32,210	3,503,493 2025/9/30	
		US TREASURY N/B	3.0	100	110	12,003 2025/10/31	
		US TREASURY N/B	2.25	50,600	54,193	5,894,614 2025/11/15	
		US TREASURY N/B	2.875	10,000	10,992	1,195,705 2025/11/30	
		US TREASURY N/B	2.625	10,000	10,883	1,183,850 2025/12/31	
		US TREASURY N/B	2.625	17,200	18,728	2,037,100 2026/1/31	
		US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,083	226,649 2026/2/15	
		US TREASURY N/B	2.5	1,000	1,083	117,841 2026/2/28	
		US TREASURY N/B	2.25	5,000	5,360	583,109 2026/3/31	
		US TREASURY N/B	2.375	8,600	9,277	1,009,159 2026/4/30	
		US TREASURY N/B	1.625	1,800	1,874	203,938 2026/5/15	
		US TREASURY N/B	2.125	300	319	34,803 2026/5/31	
		US TREASURY N/B	1.875	3,000	3,161	343,836 2026/7/31	
		US TREASURY N/B	1.5	21,100	21,804	2,371,697 2026/8/15	
		US TREASURY N/B	1.375	12,000	12,320	1,340,114 2026/8/31	
		US TREASURY N/B	1.625	10,000	10,394	1,130,655 2026/9/30	
		US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,814	632,477 2026/10/31	
		US TREASURY N/B	2.0	13,000	13,765	1,497,303 2026/11/15	
		US TREASURY N/B	1.625	30,000	31,142	3,387,378 2026/11/30	
		US TREASURY N/B	1.75	100	104	11,365 2026/12/31	
		US TREASURY N/B	1.5	200	206	22,410 2027/1/31	
		US TREASURY N/B	2.25	11,300	12,116	1,317,874 2027/2/15	
		US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,411	153,527 2027/2/28	
		US TREASURY N/B	0.5	17,000	16,476	1,792,172 2027/4/30	
		US TREASURY N/B	2.375	38,000	41,013	4,461,014 2027/5/15	
		US TREASURY N/B	2.25	8,700	9,321	1,013,907 2027/8/15	
		US TREASURY N/B	2.25	1,000	1,070	116,460 2027/11/15	
		US TREASURY N/B	2.75	25,500	28,102	3,056,740 2028/2/15	
		US TREASURY N/B	2.875	40,600	45,107	4,906,313 2028/5/15	
		US TREASURY N/B	2.875	9,900	11,007	1,197,292 2028/8/15	
		US TREASURY N/B	3.125	1,200	1,356	147,558 2028/11/15	
		US TREASURY N/B	2.625	500	547	59,526 2029/2/15	
		US TREASURY N/B	2.375	1,100	1,183	128,713 2029/5/15	
		US TREASURY N/B	1.625	300	305	33,184 2029/8/15	
		US TREASURY N/B	1.75	2,100	2,153	234,288 2029/11/15	
		US TREASURY N/B	1.5	1,700	1,702	185,212 2030/2/15	
		US TREASURY N/B	6.25	13,000	18,305	1,991,102 2030/5/15	
		US TREASURY N/B	0.625	16,600	15,351	1,669,740 2030/5/15	
		US TREASURY N/B	0.875	600	563	61,328 2030/11/15	
		US TREASURY N/B	5.375	75,400	101,925	11,086,434 2031/2/15	
		US TREASURY N/B	1.125	1,000	959	104,334 2031/2/15	
		US TREASURY N/B	4.5	16,300	21,900	2,382,125 2036/2/15	
		US TREASURY N/B	5.0	6,200	8,849	962,563 2037/5/15	
		US TREASURY N/B	4.5	100	136	14,861 2038/5/15	
		US TREASURY N/B	3.5	100	122	13,298 2039/2/15	
		US TREASURY N/B	4.25	100	133	14,556 2039/5/15	
		US TREASURY N/B	4.5	100	138	15,011 2039/8/15	

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		
				%	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4.375	100	136	14,813	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	100	140	15,288	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	136	14,870	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	100	128	13,994	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	100	134	14,680	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	300	430	46,858	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	137	14,959	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.75	100	127	13,825	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	100	116	12,666	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	100	116	12,688	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	100	114	12,439	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	200	219	23,915	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	100	109	11,945	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	290	337	36,747	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	100	125	13,660	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	4,300	5,410	588,493	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	15,200	18,422	2,003,791	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	25,000	29,142	3,169,838	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	35,100	40,092	4,360,823	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	39,900	41,821	4,548,951	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	23,400	26,746	2,909,204	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	17,500	19,591	2,130,999	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,700	4,236	460,851	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	51,500	53,916	5,864,451	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	28,200	29,524	3,211,333	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	34,500	34,423	3,744,209	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	14,200	15,926	1,732,351	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,000	2,295	249,678	2047/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,700	1,951	212,305	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	11,400	12,514	1,361,214	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	10,216	1,111,254	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	9,500	10,930	1,188,877	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	5,100	6,004	653,104	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	10,500	12,098	1,315,940	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.375	6,100	7,520	818,019	2048/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	2,470	2,850	310,063	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	100	112	12,265	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	11,250	11,199	1,218,117	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	300	306	33,390	2049/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	1,000	942	102,494	2050/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,200	1,716	186,677	2050/5/15
		US TREASURY N/B	1.375	9,100	7,330	797,297	2050/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	6,900	5,929	645,001	2050/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	12,900	11,785	1,281,893	2051/2/15
	小 計					252,263,901	
カナダ	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	14,350	14,740	1,322,692	2022/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	200	202	18,176	2022/5/1

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		
				千カナダドル	千円		
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.25	300	300	26,934	2022/8/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0	12,000	12,124	1,087,967	2022/9/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,300	1,334	119,783	2023/3/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,460	4,571	410,156	2023/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,100	1,141	102,467	2023/9/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.25	500	525	47,158	2024/3/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	6,800	7,217	647,650	2024/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	17,000	17,406	1,561,848	2025/3/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.25	3,700	3,935	353,143	2025/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	300	309	27,726	2026/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,400	1,401	125,776	2026/9/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0	6,700	9,425	845,778	2027/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.0	200	199	17,898	2027/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	800	844	75,793	2028/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	11,380	15,252	1,368,649	2029/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,000	1,074	96,386	2029/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	10,200	14,695	1,318,669	2033/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0	2,600	3,763	337,686	2037/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	3,400	4,586	411,576	2041/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,950	12,837	1,151,925	2045/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,493	134,005	2048/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,867	167,557	2051/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	100	118	10,590	2064/12/1	
小	計				11,788,003		
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
国債証券	UK TREASURY	1.75	500	511	78,090	2022/9/7	
	UK TREASURY	0.125	3,000	3,005	458,772	2023/1/31	
	UK TREASURY	0.75	16,700	16,970	2,590,539	2023/7/22	
	UK TREASURY	2.25	2,300	2,419	369,289	2023/9/7	
	UK TREASURY	1.0	1,600	1,642	250,803	2024/4/22	
	UK TREASURY	2.75	7,450	8,102	1,236,860	2024/9/7	
	UK TREASURY	5.0	14,750	17,470	2,666,912	2025/3/7	
	UK TREASURY	0.625	200	203	31,072	2025/6/7	
	UK TREASURY	2.0	200	215	32,897	2025/9/7	
	UK TREASURY	1.5	510	540	82,532	2026/7/22	
	UK TREASURY	1.25	400	419	64,045	2027/7/22	
	UK TREASURY	4.25	12,730	15,846	2,418,993	2027/12/7	
	UK TREASURY	1.625	200	215	32,891	2028/10/22	
	UK TREASURY	6.0	4,800	6,717	1,025,442	2028/12/7	
	UK TREASURY	4.75	7,700	10,527	1,607,091	2030/12/7	
	UK TREASURY	4.25	7,500	10,146	1,548,834	2032/6/7	
	UK TREASURY	4.5	12,300	17,623	2,690,236	2034/9/7	
	UK TREASURY	4.25	750	1,073	163,940	2036/3/7	
	UK TREASURY	4.75	100	157	24,008	2038/12/7	
	UK TREASURY	4.25	600	903	137,889	2039/9/7	
	UK TREASURY	4.25	500	763	116,604	2040/12/7	
	UK TREASURY	4.5	570	919	140,344	2042/12/7	
	UK TREASURY	3.5	18,440	26,794	4,090,112	2045/1/22	

銘 柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	4.25	5,900	9,691	1,479,338	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	8,200	8,555	1,306,034	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	16,100	17,788	2,715,375	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	5,350	9,137	1,394,901	2049/12/7
	UK TREASURY	3.75	6,750	11,029	1,683,611	2052/7/22
	UK TREASURY	1.625	1,000	1,092	166,736	2054/10/22
	UK TREASURY	1.75	700	803	122,595	2057/7/22
	UK TREASURY	4.0	1,200	2,233	340,880	2060/1/22
	UK TREASURY	2.5	100	145	22,139	2065/7/22
	UK TREASURY	3.5	200	369	56,398	2068/7/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	21,800	30,249	4,617,580	2044/1/22
	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	4.25	6,200	11,404	1,740,929	2055/12/7
小 計					37,504,731	
スウェーデン			千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	32,050	33,350	436,892	2022/6/1
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	7,900	8,255	108,145	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	33,950	37,548	491,887	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,667	165,944	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	16,800	17,504	229,307	2028/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	18,900	19,670	257,679	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	21,300	31,297	410,002	2039/3/30
小 計					2,099,858	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	5,300	5,465	72,468	2023/5/24
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	37,800	40,312	534,543	2024/3/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	12,500	12,940	171,591	2025/3/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	5,700	5,849	77,562	2026/2/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	9,600	9,945	131,878	2027/2/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	9,400	9,903	131,324	2028/4/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	22,000	22,792	302,229	2029/9/6
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	6,500	6,516	86,414	2030/8/19
小 計					1,508,013	
デンマーク			千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0.25	400	404	7,192	2022/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	1.5	24,270	25,495	453,567	2023/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	1.75	29,300	32,212	573,058	2025/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	15,700	16,488	293,324	2027/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	26,300	27,659	492,066	2029/11/15
	KINGDOM OF DENMARK	4.5	35,800	63,165	1,123,714	2039/11/15
小 計					2,942,923	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	—	250	252	33,404
		BUNDES OBLIGATION	—	500	506	67,076
		BUNDES OBLIGATION	—	2,000	2,047	270,893
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	400	411	54,417
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	300	308	40,855
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	390	405	53,638
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,400	5,643	746,738
						2023/5/15

銘 柏			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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	2,580	2,740	362,670	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	25,600	30,402	4,022,866	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,700	1,817	240,435	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	10,800	11,525	1,525,088	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	7,700	8,132	1,076,154	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,700	2,821	373,358	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	9,100	9,751	1,290,326	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	23,200	24,462	3,236,883	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	1,031	136,473	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	700	733	96,991	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	20,200	29,130	3,854,537	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	200	213	28,185	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	18,200	25,783	3,411,706	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	600	640	84,737	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,200	11,326	1,498,787	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	18,600	29,486	3,901,713	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	8,400	13,190	1,745,391	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	9,400	15,484	2,048,968	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	10,700	17,401	2,302,505	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	3,800	6,676	883,382	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	4,000	7,552	999,329	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,130	1,863	246,516	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	5,800	8,833	1,168,837	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	11,600	17,995	2,381,170	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	13,600	16,962	2,244,437	2048/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.0	900	914	121,052	2022/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	400	406	53,753	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	1,200	1,291	170,915	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,500	1,536	203,270	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	23,160	25,146	3,327,376	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	2,800	2,817	372,830	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	4,700	4,806	636,021	2023/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	102	13,531	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,800	1,970	260,785	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	500	556	73,569	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,000	1,063	140,748	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	18,700	22,965	3,038,790	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	16,200	18,318	2,423,964	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	300	317	42,042	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.75	600	634	83,972	2024/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	5,800	6,533	864,462	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	4,700	4,942	653,932	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,089	144,175	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,989	2,645,062	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	800	844	111,773	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	3,175	420,141	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	7,000	7,749	1,025,440	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,255	430,701	2025/12/1

銘 柏		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,900	14,362	1,900,394
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1	2,000	2,190	289,780
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	18,100	24,938	3,299,819
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.05	200	219	29,097
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	22,500	31,171	4,124,612
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	8,000	10,371	1,372,317
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	29,900	41,019	5,427,741
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,000	1,070	141,704
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	16,000	23,790	3,147,945
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	532	70,493
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	10,900	16,480	2,180,739
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,400	1,607	212,720
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	20,400	29,688	3,928,332
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	13,200	16,639	2,201,794
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	2,700	3,669	485,521
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	500	612	80,979
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	5,000	7,763	1,027,266
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1	200	248	32,945
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	11,200	17,508	2,316,785
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	8,800	13,826	1,829,530
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	5,500	7,073	935,899
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,800	3,747	495,871
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	7,000	9,999	1,323,133
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	9,100	10,139	1,341,621
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	3,000	3,462	458,111
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	4,200	4,248	562,179
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,600	2,631	348,170
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	1,570	1,647	217,954
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	101	13,459
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	10,100	10,981	1,453,047
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,836	242,939
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	13,000	13,538	1,791,371
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,800	1,883	249,256
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	13,300	13,753	1,819,851
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	8,640	1,143,253
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	4,900	5,231	692,294
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	11,600	12,393	1,639,936
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,000	2,095	277,234
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	9,400	11,534	1,526,214
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	10,100	11,276	1,492,094
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	111	14,772
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	100	120	15,956
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	10,400	13,264	1,755,134
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	2,000	2,301	304,510
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	471	62,401
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	200	201	26,642
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	16,000	16,683	2,207,573
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	11,100	13,111	1,734,889

銘 柄		当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	25,600	28,696	3,797,097
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	3,000	3,248	429,782
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	9,500	12,283	1,625,352
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,402	847,192
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	33,800	40,487	5,357,283
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	3,700	4,434	586,717
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	27,000	39,188	5,185,447
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	13,000	14,827	1,961,966
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	20,400	33,351	4,413,007
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	18,300	29,321	3,879,855
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	300	474	62,779
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	5,800	10,026	1,326,662
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	25,550	39,508	5,227,704
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	5,650	10,617	1,404,928
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	9,700	19,042	2,519,740
						2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	100	103	13,691
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	200	215	28,459
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	3,500	4,041	534,810
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	400	421	55,812
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	101	13,486
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	7,700	8,360	1,106,293
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,500	1,553	205,522
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,900	1,999	264,594
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,500	2,681	354,761
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	12,300	17,192	2,274,969
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,077	142,627
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,400	2,503	331,255
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	8,900	11,524	1,524,869
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	3,700	5,926	784,256
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	500	523	69,203
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	4,100	6,993	925,409
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	6,900	11,015	1,457,597
						2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	5,400	5,464	723,102
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	14,800	16,323	2,159,863
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	4,200	4,281	566,512
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	7,300	8,194	1,084,290
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	15,600	17,861	2,363,380
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,900	7,780	1,029,462
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	450	499	66,099
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	969	128,295
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	12,900	15,624	2,067,373
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	5,000	5,547	734,061
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	4,000	4,431	586,407
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	22,400	29,545	3,909,448
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	7,600	8,314	1,100,161
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,000	2,183	288,910
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	5,000	5,460	722,533
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	11,500	15,799	2,090,636
						2028/10/31

銘 柏			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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	2,000	2,286	302,578	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	5,400	6,439	852,074	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,000	1,135	150,274	2035/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,900	3,161	418,355	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	4,700	7,718	1,021,341	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	10,000	17,925	2,371,911	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	3,200	4,281	566,489	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	10,500	13,636	1,804,321	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	3,700	5,632	745,313	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	16,000	23,155	3,063,973	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	27,800	43,523	5,759,053	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	4,200	6,235	825,091	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	600	641	84,830	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	3,800	4,035	534,040	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	1,900	1,939	256,674	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	4,000	4,403	582,631	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	1,000	1,037	137,315	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,700	1,794	237,434	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	6,700	8,348	1,104,668	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	3,300	3,544	469,051	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,139	283,107	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,074	142,124	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	6,500	7,038	931,283	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	5,200	5,688	752,686	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	1,700	2,413	319,409	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	100	112	14,862	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	572	75,783	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	100	121	16,137	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	4,600	7,677	1,015,844	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	4,000	6,587	871,627	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	5,200	6,077	804,132	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	2,700	3,229	427,336	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,653	218,844	2057/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,000	1,377	182,226	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,500	16,137	2,135,281	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	10,500	17,128	2,266,502	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	100	100	13,352	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	200	212	28,125	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	900	912	120,743	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	150	158	21,020	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	1,300	1,324	175,318	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	700	755	99,934	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,400	185,366	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	6,824	903,020	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,130	281,957	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	7,600	10,758	1,423,525	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	9,600	10,115	1,338,485	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	7,600	9,771	1,292,956	2034/5/23

銘 柄			当 期 末					
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	400	639	84,650	2037/3/15	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	3,200	5,067	670,529	2044/6/20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	5,600	6,806	900,601	2047/2/20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,045	270,646	2051/3/20	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	950	1,959	259,342	2062/1/26	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	800	1,302	172,354	2117/9/20	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.625	100	103	13,645	2022/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	100	104	13,791	2023/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	—	400	406	53,758	2023/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	700	754	99,890	2024/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	3,600	4,288	567,501	2025/7/4	
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	100	106	14,052	2025/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,098	277,668	2026/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,300	4,026	532,724	2028/7/4	
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,400	2,527	334,472	2029/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	800	858	113,628	2031/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	223	29,577	2034/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	4,000	3,884	514,026	2036/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	400	576	76,243	2042/7/4	
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	300	361	47,857	2047/4/15	
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.4	4,630	5,686	752,503	2025/3/13	
		IRISH GOVERNMENT	0.9	6,500	6,993	925,363	2028/5/15	
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	4,600	4,923	651,415	2026/5/15	
		IRISH TSY 1.10% 2029	1.1	600	655	86,728	2029/5/15	
		IRISH TSY 1.3% 2033	1.3	3,200	3,581	473,941	2033/5/15	
		IRISH TSY 1.35% 2031	1.35	2,000	2,244	296,967	2031/3/18	
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	2,600	2,985	395,083	2050/5/15	
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	2,900	3,432	454,218	2037/5/15	
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	1,600	2,031	268,806	2045/2/18	
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	6,000	7,284	963,900	2030/5/15	
		IRISH TSY 2022	—	2,200	2,219	293,682	2022/10/18	
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,100	6,793	898,930	2024/3/18	
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	9,850	10,678	1,413,038	2023/3/20	
小 計						234,816,743		
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ			
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	49,800	51,856	1,506,739	2023/1/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	33,000	35,032	1,017,892	2024/10/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	34,800	37,932	1,102,144	2029/10/25	
小 計						3,626,776		
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル			
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	2,700	2,796	229,572	2022/9/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	500	511	41,993	2023/2/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	4,100	4,298	352,849	2023/7/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	1,450	1,506	123,669	2024/2/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,300	2,478	203,471	2024/9/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,174	96,364	2025/6/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	741	60,857	2026/6/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,426	363,327	2027/3/1	

銘 柄		当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
千円	千円						
シンガポール	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	500	545	44,754	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	300	334	27,418	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,850	3,191	261,992	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	1,200	1,419	116,471	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	1,920	2,025	166,247	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,750	3,150	258,562	2042/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,000	1,161	95,335	2046/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	1,000	1,002	82,262	2050/3/1
小 計						2,525,149	
マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	422	11,195	2024/9/30
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	2,600	2,815	74,687	2033/11/7
		MALAYSIA GOVERNMENT	3.828	2,700	2,693	71,452	2034/7/5
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	400	431	11,436	2037/4/7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	500	509	13,512	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.795	500	512	13,597	2022/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	13,500	13,842	367,173	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.757	3,900	4,023	106,712	2023/4/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.8	2,200	2,280	60,477	2023/8/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	6,121	162,373	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	634	16,842	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	15,600	16,862	447,280	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	4,600	4,888	129,662	2027/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	7,000	7,256	192,465	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	2,200	2,310	61,299	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.885	280	294	7,822	2029/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	12,700	13,919	369,215	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,689	124,382	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	800	804	21,348	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	2,300	2,397	63,594	2035/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	9,700	10,581	280,673	2043/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.736	4,100	4,325	114,742	2046/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.921	300	325	8,625	2048/7/6
小 計						2,730,575	
オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	7,520	8,023	685,492	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	80	82	7,061	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	3,900	4,310	368,288	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	5,100	5,496	469,623	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	9,400	10,434	891,515	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	15,014	1,282,833	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	12,400	15,176	1,296,702	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	2,200	2,440	208,524	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,100	1,221	104,391	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	11,597	990,875	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	13,300	14,745	1,259,873	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	22,200	24,135	2,062,170	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	5,700	5,407	462,041	2030/12/21

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		
オーストラリア		%	千豪ドル	千豪ドル	千円		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	800	790	67,581	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	7,700	9,993	853,860	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,422	121,541	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	8,250	10,065	859,958	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	700	798	68,246	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,500	1,584	135,374	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	4,900	5,298	452,734	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	3,000	2,453	209,618	
小計					12,858,309		
イスラエル			千新シェケル	千新シェケル			
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	0.75	9,800	9,884	330,807	
		ISRAEL FIXED BOND	1.25	5,000	5,088	170,293	
		ISRAEL FIXED BOND	4.25	5,000	5,386	180,285	
		ISRAEL FIXED BOND	1.5	5,000	5,164	172,836	
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,900	6,492	217,297	
		ISRAEL FIXED BOND	1.75	5,000	5,274	176,540	
		ISRAEL FIXED BOND	6.25	6,500	8,478	283,749	
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	5,000	5,382	180,128	
		ISRAEL FIXED BOND	2.25	5,000	5,477	183,317	
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	5,500	5,430	181,739	
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	6,000	9,452	316,364	
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	6,351	212,581	
小計					2,605,943		
メキシコ			千メキシコペソ	千メキシコペソ			
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	44,400	45,246	247,159	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.75	17,300	17,876	97,647	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	87,300	94,049	513,746	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	65,000	74,475	406,819	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	66,300	65,985	360,443	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	112,300	120,144	656,290	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	45,300	51,061	278,924	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	68,100	73,203	399,875	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	400	425	2,322	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	41,300	52,028	284,205	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	25,800	28,405	155,162	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	52,200	52,875	288,834	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	43,000	44,398	242,528	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	107,700	115,361	630,163	
小計					4,564,125		
合計					571,835,057		

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(2021年5月10日現在)

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

区分	分	当期末
		数量
貸付有価証券<債券>券面総額		米ドル 1,341,077,000
貸付有価証券<債券>券面総額		ユーロ 202,365,708
貸付有価証券<債券>券面総額		豪ドル 10,500,000
貸付有価証券<債券>券面総額		新シェケル 21,508,000

## ○投資信託財産の構成

(2021年5月10日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 571,835,057	% 70.7
コール・ローン等、その他	237,015,002	29.3
投資信託財産総額	808,850,059	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産（587,191,776千円）の投資信託財産総額（808,850,059千円）に対する比率は72.6%です。

\*外貨建て資産は、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米ドル=108.77円、1カナダドル=89.73円、1英ポンド=152.65円、1スウェーデンクローナ=13.10円、1ノルウェークローネ=13.26円、1デンマーククローネ=17.79円、1ユーロ=132.32円、1ズロチ=29.0558円、1シンガポールドル=82.08円、1リンギ=26.5249円、1豪ドル=85.44円、1新シェケル=33.4685円、1メキシコペソ=5.4625円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月10日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	818,730,540,720
公社債(評価額)	3,368,503,059
未収入金	571,835,057,567
未収利息	24,978,090,700
未収費用	5,025,696,316
前払費用	197,043,726
その他未収収益	16,169,413
受入担保代用有価証券	213,309,979,939
(B) 負債	241,387,316,580
未払金	16,692,931,483
未払解約金	11,376,973,565
未払利息	769
受入担保金	213,309,979,939
その他未払費用	7,430,824
(C) 純資産総額(A-B)	577,343,224,140
元本	229,270,699,136
次期繰越損益金	348,072,525,004
(D) 受益権総口数	229,270,699,136口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,182円

(注) 期首元本額は239,006,740,496円、期中追加設定元本額は35,351,538,325円、期中一部解約元本額は45,087,579,685円、1口当たり純資産額は2,5182円です。

(注) 2021年5月10日現在、有価証券の貸付などに係る受入担保代用有価証券として担保に受け入れている資産は以下の通りです。  
・有価証券 213,309,979,938円

## ○損益の状況 (2020年5月12日～2021年5月10日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円
受取利息	16,281,004,505
その他収益金	16,105,080,462
支払利息	177,963,772
△	△ 2,039,729
(B) 有価証券売買損益	20,790,838,290
売買益	51,615,142,918
売買損	△ 30,824,304,628
(C) 保管費用等	△ 94,485,758
(D) 当期損益金(A+B+C)	36,977,357,037
(E) 前期繰越損益金	325,656,344,897
(F) 追加信託差損益金	51,569,954,030
(G) 解約差損益金	△ 66,131,130,960
(H) 計(D+E+F+G)	348,072,525,004
次期繰越損益金(H)	348,072,525,004

\*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。

\*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。

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
野村外国債券インデックスBコース(野村投資一任口座向け)	円 74,818,812,732
野村世界6資産分散投信(分配コース)	23,740,455,752
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	18,011,444,164
のむラップ・ファンド(普通型)	13,938,678,094
マイ・ロード	8,939,154,926
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	8,623,483,999
野村DC外国債券インデックスファンド	7,108,981,810
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,293,193,627
野村外国債券(含む新興国)インデックスBコース(野村投資一任口座向け)	6,088,822,869
NEW FUNDS外国債券-FINSE世界債券インデックス(除く日本、為替ヘッジなし)連動型上場投信	5,667,170,120
のむラップ・ファンド(保守型)	5,645,802,658
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,323,230,922
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,770,974,663
野村DC運用戦略ファンド	4,296,569,976
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,670,865,990
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,284,276,560
のむラップ・ファンド(積極型)	3,147,958,870

ファンド名	当期末
	元本額
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	円 2,461,786,806
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,934,128,760
マイバランスDC30	1,883,999,929
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,707,978,192
野村6資産均等バランス	1,541,574,583
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,425,155,305
マイバランスDC50	1,391,309,022
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,378,405,093
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,255,060,309
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,218,245,982
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,146,434,164
ノムラPofSインデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	1,042,220,964
マイバランスDC70	921,800,996
野村インデックスファンド・外国債券	848,053,397
野村外国債券バッジファンド(確定拠出年金向け)	588,329,497
のむラップ・ファンド(やや保守型)	573,888,162
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	527,656,307

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	521,149,202
のむラップ・ファンド（やや積極型）	486,962,000
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	341,008,805
野村外国債券インデックスファンド	278,297,835
ネクストコア	219,365,979
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	216,375,190
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	198,495,983
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	190,957,541
野村グローバル・インデックス・バランス325VA（適格機関投資家専用）	178,098,999
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	170,058,001
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	164,472,969
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	96,385,078
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	94,875,236
バランスセレクト50	83,147,612
バランスセレクト30	82,860,900
バランスセレクト70	77,285,302
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	65,416,645
世界6資産分散ファンド	63,024,121
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	59,766,492
野村資産設計ファンド2040	49,424,312
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	44,502,358
野村資産設計ファンド2030	38,843,108
野村資産設計ファンド2025	37,769,319
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	35,130,230
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	34,607,691
野村資産設計ファンド2035	28,572,800
野村資産設計ファンド2015	20,274,883
野村資産設計ファンド2020	20,166,589
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	15,062,740

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	14,191,473
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	13,818,490
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	11,670,049
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,948,189
野村資産設計ファンド2050	7,775,081
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,290,687
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	7,039,590
野村資産設計ファンド2045	6,762,765
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	6,372,815
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	6,214,458
インデックス・ブレンド（タイプIII）	5,749,920
野村FOR用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	5,659,288
マイターゲット2065（確定拠出年金向け）	5,310,864
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	4,902,707
野村ターゲットデートファンド2016～2026～2028年目標型	4,854,845
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,592,551
インデックス・ブレンド（タイプV）	3,492,360
野村資産設計ファンド2060	2,854,794
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,704,530
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,635,355
野村ターゲットデートファンド2016～2029～2031年目標型	2,051,455
インデックス・ブレンド（タイプI）	1,931,676
インデックス・ブレンド（タイプII）	1,401,384
野村ターゲットデートファンド2016～2032～2034年目標型	1,396,139
インデックス・ブレンド（タイプIV）	1,341,811
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	1,142,063
野村ターゲットデートファンド2016～2035～2037年目標型	1,031,054
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	279,596
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	20,027

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# J-REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日2021年6月10日）

作成対象期間（2020年6月11日～2021年6月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国のREIT（不動産投資信託証券）（「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	J-REITを主要投資対象とします。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への直接投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク			投資信託組入比率	純総資産額
	期騰	中落	率	東証REIT指数 (配当込み)	期騰	中落		
12期(2017年6月12日)	円 19,362	% △ 4.3		3,254.14	% △ 4.3		% 98.2	百万円 28,442
13期(2018年6月11日)	20,182	4.2		3,387.54	4.1		97.8	33,180
14期(2019年6月10日)	23,229	15.1		3,896.50	15.0		97.7	40,406
15期(2020年6月10日)	22,155	△ 4.6		3,713.86	△ 4.7		96.6	37,084
16期(2021年6月10日)	28,259	27.6		4,732.62	27.4		97.0	48,024

東証REIT指数の指數値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指數値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額			ベンチマーク			投資信託組入比率	%
	騰	落	率	東証REIT指数 (配当込み)	騰	落		
(期首) 2020年6月10日	円 22,155	% —		3,713.86	% —		% 96.6	96.6
6月末	21,030	△ 5.1		3,525.99	△ 5.1			96.6
7月末	21,087	△ 4.8		3,535.10	△ 4.8			96.6
8月末	22,282	0.6		3,735.15	0.6			95.9
9月末	22,060	△ 0.4		3,698.94	△ 0.4			96.8
10月末	20,958	△ 5.4		3,512.43	△ 5.4			97.0
11月末	21,696	△ 2.1		3,635.82	△ 2.1			97.0
12月末	23,005	3.8		3,854.76	3.8			95.9
2021年1月末	23,898	7.9		4,004.00	7.8			96.0
2月末	25,130	13.4		4,207.24	13.3			95.6
3月末	26,268	18.6		4,399.26	18.5			95.9
4月末	26,984	21.8		4,518.99	21.7			96.8
5月末	27,174	22.7		4,551.00	22.5			96.9
(期末) 2021年6月10日	28,259	27.6		4,732.62	27.4			97.0

\*騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン普及による経済の正常化期待が高まったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

国内REIT市場は、期首から新型コロナウイルスの感染再拡大への警戒感から、保有施設の利用低迷が懸念されたことなどを背景に下落しました。その後は、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大に対する警戒感が高まる一方、国内REITの分配金利回りの相対的な高さなどが好感されたことや、新型コロナウイルスのワクチン開発進展への期待感などから、一進一退の展開となりました。

2020年12月以降は、新型コロナウイルスのワクチン普及による経済の正常化期待が高まることなどを受けて上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

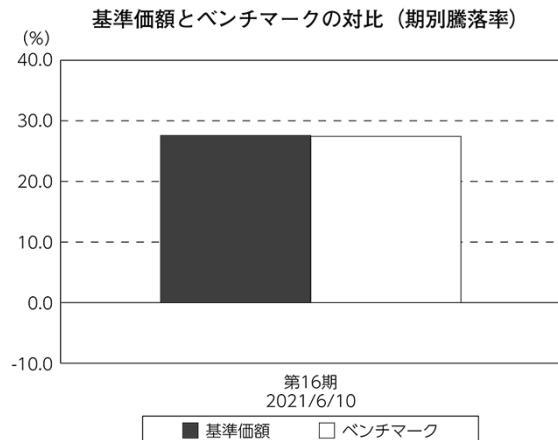
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数でほぼ同水準になるよう銘柄間の投資比率調整を行なってまいりました。なお、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+27.6%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の+27.4%を0.2ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

- ・ベンチマークの変更に起因する売買などの影響
- ・実質REIT組入比率が100%に満たないことの影響が、指標の上昇時にはマイナスに、下落時にはプラスに作用したこと



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、REITの実質組入比率を高位に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

(2020年6月11日～2021年6月10日)

## ○1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (投資信託証券) (先物・オプション)	円 1 (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.002)	(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
合計	1	0.002	
期中の平均基準価額は、23,464円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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6月11日～2021年6月10日)

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
国内	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	口 334	千円 36,353	口 158	千円 18,220
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	647	61,768	238	24,035
	SOS i L A物流リート投資法人 投資証券	420	54,208	244	32,917
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	419	253,983	347	213,521
	MCUBS Mid City投資法人 投資証券	1,058 (△ 4,958)	84,981 (△ 447,304)	1,147	92,375
	森ビルズリート投資法人 投資証券	1,365	189,668	1,190	167,818
	産業ファンド投資法人 投資証券	2,000	369,010	1,409	260,622
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	1,033	325,657	962	305,260
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	834	158,069	672	127,316
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	541	222,727	507	214,592
海外	G L P投資法人 投資証券	5,668	940,472	2,959	493,799
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	533	165,652	447	141,069
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,937	658,792	1,529	519,383
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	171	89,379	161	84,304
	O neリート投資法人 投資証券	174	45,145	163	43,092
	イオンリート投資法人 投資証券	1,096	137,404	1,282	158,840
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	972	144,638	999	145,208
	日本リート投資法人 投資証券	353	128,862	331	123,051

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	6,953	106,012	6,791	105,845
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	3,203	245,972	2,933	229,676
トーセイ・リート投資法人 投資証券	249	27,984	220	25,083
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	523	124,262	450	101,930
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	233	29,622	218	27,816
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	208	21,840	225	23,575
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	3,505	498,662	3,261	476,732
いちごホテルリート投資法人 投資証券	222	15,772	174	12,976
ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,260	391,230	1,076	181,840
スター・アジア不動産投資法人 投資証券	1,038 ( 2,862)	50,998 ( 72,882)	1,093	52,808
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	100	11,164	113	12,191
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	604	307,955	326	170,447
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	176	12,381	198	13,385
さくら総合リート投資法人 投資証券	22 (△ 864)	1,817 (△ 72,882)	9	727
投資法人みらい 投資証券	1,181	47,569	1,331	52,341
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	241	27,399	297	32,565
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	453	192,178	220	93,737
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	826	129,910	285	44,791
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	196	18,471	154	14,878
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	384	35,498	297	28,007
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	1,081	158,740	348	48,236
日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,774	1,039,250	1,079	670,719
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	1,084	627,382	1,016	606,379
日本都市ファンド投資法人 投資証券	2,733 ( 12,571)	376,664 ( 447,304)	2,804	385,314
オリックス不動産投資法人 投資証券	2,165	353,439	2,028	337,160
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	676	226,868	769	256,183
N T T都市開発リート投資法人	976	124,654	914	119,382
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	724	111,412	678	106,832
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	756	79,622	709	76,327
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	2,329	291,827	2,602	324,962
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	777	105,832	728	101,261
インヴィンシブル投資法人 投資証券	4,554	153,523	5,074	167,663
フロンティア不動産投資法人 投資証券	364	140,288	433	162,829
平和不動産リート投資法人 投資証券	801	104,368	665	85,886
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	711	213,052	666	199,938
福岡リート投資法人 投資証券	561	80,539	525	77,836
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	333	218,334	312	207,956
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	1,101	83,491	868	69,315
大和証券オフィス投資法人 投資証券	238	150,632	293	184,719
阪急阪神リート投資法人 投資証券	487	62,109	456	59,074
スタートプロシード投資法人 投資証券	165	33,947	155	31,886
大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,546	414,794	1,447	391,853
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	3,497	184,483	3,275	176,541

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	大和証券リビング投資法人 投資証券 ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	1,692 1,006	千円 172,722 128,115	1,282 931	千円 132,378 119,706
	合計	74,263 ( 9,611)	11,999,582 ( -)	64,473	9,967,138

\* 金額は受け渡し代金。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 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	REIT先物取引	百万円 5,187	百万円 5,339	百万円 -	百万円 -

\* 単位未満は切り捨て。

### ○利害関係人との取引状況等

(2020年6月11日～2021年6月10日)

### 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	売付額等 C		うち利害関係人 との取引状況D	D C
			B A	C D		
投資信託証券	百万円 11,999	百万円 527	% 4.4	百万円 9,967	百万円 1,443	% 14.5

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額 (A)	898千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9千円
(B) / (A)	1.0%

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野村證券株式会社です。

(2021年6月10日現在)

## ○組入資産の明細

## 国内投資信託証券

銘 柏	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	478	654	92,148	0.2
サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	570	979	125,507	0.3
S O S i L A物流リート投資法人 投資証券	876	1,052	158,641	0.3
日本アコモーションファンド投資法人 投資証券	1,307	1,379	897,729	1.9
M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	5,047	—	—	—
森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,526	4,701	772,844	1.6
産業ファンド投資法人 投資証券	5,066	5,657	1,163,644	2.4
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,731	3,802	1,395,334	2.9
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,566	2,728	636,442	1.3
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,971	2,005	1,020,545	2.1
G L P 投資法人 投資証券	9,797	12,506	2,349,877	4.9
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,713	1,799	642,243	1.3
日本プロジスリート投資法人 投資証券	5,919	6,327	2,246,085	4.7
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	599	609	427,518	0.9
O n e リート投資法人 投資証券	613	624	201,240	0.4
イオンリート投資法人 投資証券	4,245	4,059	645,381	1.3
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,345	3,318	612,502	1.3
日本リート投資法人 投資証券	1,278	1,300	591,500	1.2
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	25,272	25,434	572,773	1.2
積木ハウス・リート投資法人 投資証券	11,502	11,772	1,091,264	2.3
トーセイ・リート投資法人 投資証券	856	885	123,280	0.3
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,519	1,592	474,734	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	839	854	124,342	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	787	770	97,636	0.2
野村不動産マスタートファンド投資法人 投資証券	12,699	12,943	2,367,274	4.9
いちごホテルリート投資法人 投資証券	652	700	71,820	0.1
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,657	4,841	874,768	1.8
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,305	4,112	250,832	0.5
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	388	375	52,012	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,119	1,397	820,039	1.7
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	668	646	55,556	0.1
さくら総合リート投資法人 投資証券	851	—	—	—
投資法人みらい 投資証券	4,473	4,323	224,796	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	923	867	124,587	0.3
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	774	1,007	485,374	1.0
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	740	1,281	239,418	0.5
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	571	613	75,766	0.2
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,116	1,203	147,608	0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	819	1,552	232,024	0.5
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,809	4,504	3,283,416	6.8
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,934	4,002	2,749,374	5.7
日本都市ファンド投資法人 投資証券	7,435	19,935	2,302,492	4.8
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,838	7,975	1,706,650	3.6
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,585	2,492	1,122,646	2.3

銘柄	期首(前期末)		当期末		比率
	口数	口数	評価額	千円	
N T T都市開発リート投資法人	3,553	3,615	601,174	1.3	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,637	2,683	543,844	1.1	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,732	2,779	354,044	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,832	8,559	1,377,999	2.9	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,811	2,860	457,886	1.0	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,255	16,735	779,851	1.6	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,397	1,328	693,216	1.4	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,450	2,586	446,602	0.9	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,570	2,615	843,337	1.8	
福岡リート投資法人 投資証券	2,034	2,070	380,673	0.8	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,217	1,238	1,000,304	2.1	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,046	3,279	331,506	0.7	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	908	853	678,135	1.4	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,777	1,808	287,291	0.6	
スターツプロシード投資法人 投資証券	613	623	151,139	0.3	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,612	5,711	1,867,497	3.9	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	12,672	12,894	907,737	1.9	
大和証券リビング投資法人 投資証券	4,816	5,226	624,507	1.3	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,639	3,714	606,496	1.3	
合計	口数・金額	231,349	250,750	46,582,915	
	銘柄数<比率>	63	61	<97.0%>	

\*評価額の単位未満は切り捨て。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期末		百万円	百万円
		買建額	売建額		
国内 REIT先物取引	東証REIT指数			1,437	—

\*単位未満は切り捨て。

(2021年6月10日現在)

## ○投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 46,582,915	% 96.9
コール・ローン等、その他	1,507,227	3.1
投資信託財産総額	48,090,142	100.0

※金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月10日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	円 48,090,142,541
コール・ローン等	1,120,371,368
投資証券(評価額)	46,582,915,980
未収入金	52,628,126
未収配当金	267,568,467
差入委託証拠金	66,658,600
(B) 負債	66,050,917
未払解約金	66,049,836
未払利息	1,081
(C) 純資産総額(A-B)	48,024,091,624
元本	16,994,222,275
次期繰越損益金	31,029,869,349
(D) 受益権総口数	16,994,222,275口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,259円

(注) 期首元本額は16,738,803,506円、期中追加設定元本額は5,226,115,786円、期中一部解約元本額は4,970,697,017円、1口当たり純資産額は2,8259円です。

## ○損益の状況 (2020年6月11日～2021年6月10日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	円 1,569,241,079
受取配当金	1,552,236,004
その他収益金	17,253,170
支払利息	△ 248,095
(B) 有価証券売買損益	8,741,909,999
売買益	9,099,183,373
売買損	△ 357,273,374
(C) 先物取引等取引損益	315,395,930
取引益	341,409,510
取引損	△ 26,013,580
(D) 当期損益金(A+B+C)	10,626,547,008
(E) 前期繰越損益金	20,346,107,097
(F) 追加信託差損益金	6,662,931,189
(G) 解約差損益金	△ 6,605,715,945
(H) 計(D+E+F+G)	31,029,869,349
次期繰越損益金(H)	31,029,869,349

\*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。

\*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。

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
野村インデックスファンド・J-REIT	3,358,422,990 円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,212,034,160
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,173,190,580
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,712,108,774
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,704,770,108
野村6資産均等バランス	1,489,985,949
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	995,602,736
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	844,896,999
野村世界6資産分散投信（成長コース）	801,797,475
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	540,233,168
野村DC運用戦略ファンド	422,144,431
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	188,337,138
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	146,674,229
野村世界REITインデックスAコース（野村投資一任口座向け）	90,621,998
ノムラFOF用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	85,140,380
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	36,224,951
野村資産設計ファンド2040	35,771,156
野村資産設計ファンド2035	20,768,515
ネクストコア	20,474,065
野村資産設計ファンド2030	18,617,496
野村資産設計ファンド2025	18,099,489

ファンド名	当期末 元本額
野村資産設計ファンド2015	14,455,177 円
野村資産設計ファンド2020	14,376,678
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	7,233,824
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	6,860,202
野村資産設計ファンド2050	4,487,175
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	3,713,802
インデックス・ブレンド（タイプIII）	3,672,458
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	3,557,597
野村資産設計ファンド2045	3,521,491
インデックス・ブレンド（タイプV）	3,395,978
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,159,129
オールウェザー・ファクター・アロケーションオープン投信（適格機関投資家専用）	2,107,611
野村資産設計ファンド2060	1,969,610
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,582,128
インデックス・ブレンド（タイプIV）	1,066,887
インデックス・ブレンド（タイプII）	974,275
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	872,180
インデックス・ブレンド（タイプI）	838,577
野村FOF用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	449,484
多資産分散投資ファンド（バランス10）（確定拠出年金向け）	11,225

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 海外REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日2021年6月10日）

作成対象期間（2020年6月11日～2021年6月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。

当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	日本を除く世界各国のREIT（不動産投資信託証券）を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**  
東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク			投資信託券率	純総資産額
	期騰	中落	率	期騰	中落	率		
12期(2017年6月12日)	円 21,472	% 4.6		226.73		% 5.1	% 99.4	百万円 20,175
13期(2018年6月11日)	22,049	2.7		234.01		3.2	98.5	20,604
14期(2019年6月10日)	24,241	9.9		259.20		10.8	99.1	26,012
15期(2020年6月10日)	22,140	△ 8.7		237.33		△ 8.4	99.4	29,052
16期(2021年6月10日)	29,050	31.2		312.73		31.8	99.4	41,524

ベンチマーク (=S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）)は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、当社が独自に円換算した指数です（設定時を100としています。）。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指値を営業日当日の為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で円換算しております。

(出所)スタンダード・アンド・プアーズ、ブルームバーグ

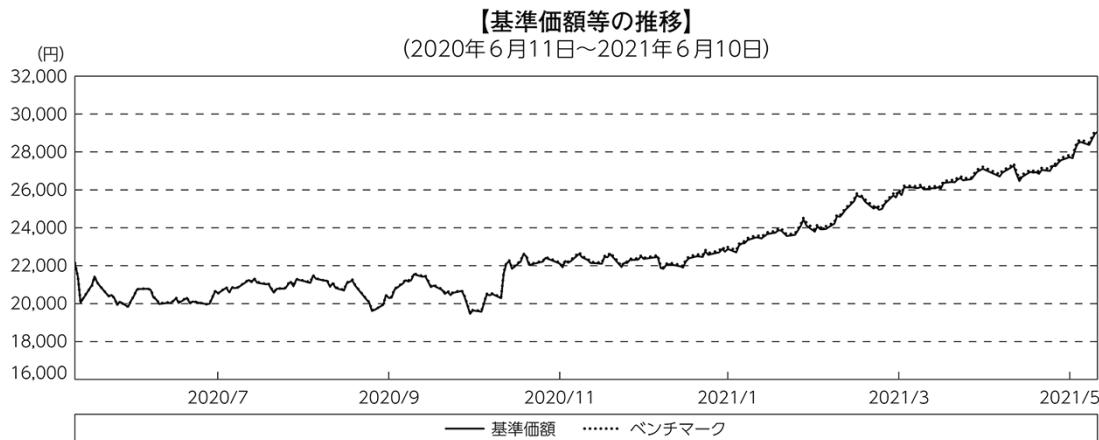
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額			ベンチマーク			投資信託券率	純総資産額
	騰	落	率	騰	落	率		
(期首) 2020年6月10日	円 22,140	% —		237.33		% —	% 99.4	
6月末	20,164	△ 8.9		216.22		△ 8.9	99.1	
7月末	20,541	△ 7.2		220.08		△ 7.3	99.2	
8月末	21,179	△ 4.3		227.27		△ 4.2	99.2	
9月末	20,305	△ 8.3		217.92		△ 8.2	99.0	
10月末	19,642	△ 11.3		210.77		△ 11.2	99.0	
11月末	22,116	△ 0.1		237.66		0.1	99.1	
12月末	22,356	1.0		240.28		1.2	99.0	
2021年1月末	22,883	3.4		246.40		3.8	99.2	
2月末	24,110	8.9		260.12		9.6	99.2	
3月末	25,899	17.0		278.58		17.4	99.0	
4月末	27,121	22.5		291.78		22.9	99.0	
5月末	27,731	25.3		298.48		25.8	99.0	
(期末) 2021年6月10日	29,050	31.2		312.73		31.8	99.4	

\*騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったことなどを受けて、主要投資国のREIT市場が上昇したことにより基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

当運用期間中のREIT市場は、期首から新型コロナウイルスのワクチン開発への期待や経済活動再開による景気回復への期待が高まる一方で、利益確定の動きや新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大への懸念などから一進一退の展開となりました。2020年11月に入ると、米大手製薬会社が新型コロナウイルスワクチンの臨床試験による高い有効性を発表したことや、米大統領・議会選挙の結果を受けて上昇しました。その後も、新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったこと、欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどを受けて上昇しました。

為替市場は、期首からFOMC（米連邦公開市場委員会）でゼロ金利政策の維持が表明され、米国の低金利が長期化するとの観測や、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大などが懸念される中、主要投資通貨である米ドルは対円で下落（円高）しました。2021年1月以降は、米長期金利が上昇し日米金利差の拡大が意識されたことや、米国で新型コロナウイルスの新規感染者数の減少傾向が見られたことなどから上昇（円安）に転じましたが、4月以降は、米長期金利の上昇一服を背景に日米金利差の拡大観測が後退したことや、新興国を中心とする新型コロナウイルスの感染拡大などから投資家のリスク回避姿勢が強まることなどを受けて下落（円高）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・ REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・ 期中の主な動き

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数（除く日本）」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+31.2%となり、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の+31.8%を0.6ポイント下回りました。

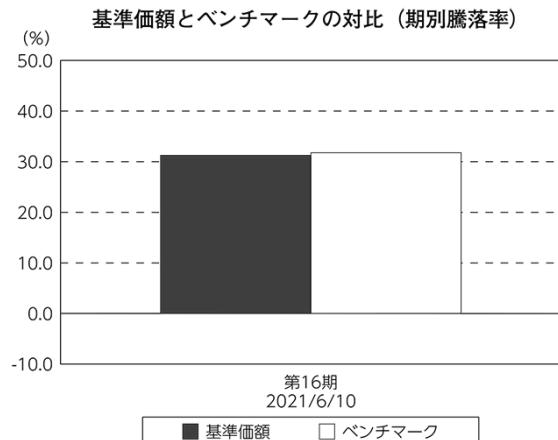
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （他の要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



(注) ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。

「S&P先進国REIT指数（除く日本）」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービシズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関する意思表明等を行なうものではありません。

(2020年6月11日～2021年6月10日)

## ○ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料  (投資信託証券)  (先物・オプション)	円  4  (4)  (0)	%  0.017  (0.016)  (0.001)	(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
(b) 有価証券取引税  (投資信託証券)	2  (2)	0.011  (0.011)	(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
(c) その他の費用  (保管費用)  (その他)	16  (4)  (11)	0.069  (0.019)  (0.050)	(c) その他の費用=期中のその他の費用÷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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	22	0.097	
期中の平均基準価額は、22,837円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

\*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おります。

## ○売買及び取引の状況

(2020年6月11日～2021年6月10日)

## 投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口 千米ドル	口 千米ドル	
	ACADIA REALTY TRUST	5,000	83	3,300
	AGREE REALTY CORP	5,800	376	1,300
	ALEXANDER & BALDWIN INC	20,300	260	3,100
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	9,470	1,580	6,300
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,000	24	—
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7,300	289	4,300
	AMERICAN FINANCE TRUST INC	3,000	22	—
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	19,800	601	11,800
	AMERICOLD REALTY TRUST	25,200	933	7,300
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	6,122	251	5,679
	( 36,357)	( 1,779)		233
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	5,800	201	3,100
	(△ 36,500)	(△ 1,515)		105
	APARTMENT INCOME REIT CO	2,200	98	2,100
	( 36,800)	( —)		89
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	4,700	59	2,200
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	15,400	136	1,200
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	—
	(△ 15,600)	(△ 23)		—
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	1,560
	( 1,560)	( 23)		3
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,420	1,196	5,090
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,800	21	—
	BOSTON PROPERTIES	7,650	688	5,690
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	—	6,000
	BRANDYWINE REALTY TRUST	9,200	103	7,200
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	16,100	235	10,200
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	9,000	167	—
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	1,500	18	6,700
	CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	—	—	40,000
	CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,600	28	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,110	503	3,070
	CARETRUST REIT INC ACQUIRES	1,500	26	—
	CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	16,000
	CITY OFFICE REIT INC	—	—	1,900
	COLONY CAPITAL INC	17,000	86	4,000
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,800	80	3,400
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	600	28	—
	CORESITE REALTY CORP	3,090	377	1,630
	CORECIVIC INC	2,400	14	30,000
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	5,400	141	2,500
				66

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
COUSINS PROPERTIES INC	8,200	258	4,300	144
CTO REALTY GROWTH INC	1,200	53	—	—
CUBESMART	12,100	416	7,000	240
CYRUSONE INC	7,250	531	3,700	265
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	10,000	82	4,000	31
DIGITAL REALTY TRUST INC	17,950	2,589	8,800	1,247
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	7,000	24	—	—
DOUGLAS EMMETT INC	9,700	273	6,700	207
DUKE REALTY CORP	22,500	887	14,700	585
EPR PROPERTIES	1,900	62	1,400	54
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	2,500	57	—	—
EASTGROUP PROPERTIES	2,160	299	1,140	160
EQUINIX INC	4,990	3,678	3,160	2,228
EQUITY COMMONWEALTH	5,800	162	3,500	100
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,200	648	10,300	655
EQUITY RESIDENTIAL	19,900	1,163	15,600	962
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	9,200	187	1,100	22
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,710	869	2,800	698
EXTRA SPACE STORAGE INC	7,910	934	5,060	599
FARMLAND PARTNERS INC	1,300	14	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,120	279	2,230	211
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	7,100	305	4,700	204
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	4,100	111	800	22
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	—	—	( 11,300)	( 97)
GEO GROUP INC/THE	2,500	28	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	16,157	648	10,957	450
( 1,700)	( 67)			
GETTY REALTY CORP	1,000	26	—	—
GLADSTONE LAND CORP	1,600	22	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	1,600	24	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,500	18	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	7,800	237	3,700	110
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	13,900	373	6,600	179
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	37,600	1,070	18,400	552
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,800	14	—	—
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,700	215	3,300	132
HOST HOTELS & RESORTS INC	213,200	2,384	202,400	2,231
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	7,900	181	6,500	168
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	5,400	69	—	—
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	1,200	24	—	—
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,320	314	370	66
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	400	28	—	—
INVITATION HOMES INC	37,700	1,115	21,000	630
IRON MOUNTAIN INC	17,300	535	12,300	391
JBG SMITH PROPERTIES	6,900	193	6,500	194

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ 外 国	口	千米ドル	口	千米ドル
KILROY REALTY CORP	6,900	403	3,000	184
KIMCO REALTY CORP	22,300	317	13,100	213
KITE REALTY GROUP TRUST	3,800	58	1,500	29
LTC PROPERTIES INC	1,300	48	1,000	37
LEXINGTON REALTY TRUST	16,600	179	4,700	51
LIFE STORAGE INC	3,680	386	1,805	185
	( 6,035)	( —)		
MACERICH CO /THE	2,158	31	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	42,000	841	18,600	379
MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,500	822	4,460	588
MONMOUTH REIT-CLASS A	1,800	25	—	—
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,200	143	1,000	67
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	9,700	373	4,900	201
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,700	97	—	—
NETSTREIT CORP	5,800	112	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	600	26	500	17
OFFICE PROPERTIES INCOME	1,000	18	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	15,300	510	7,500	268
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	749	15	—	—
	( 51)	( 0.88787)		
PS BUSINESS PARKS INC/CA	580	78	200	31
PARAMOUNT GROUP INC	—	—	4,600	35
PARK HOTELS & RESORTS INC	11,400	171	6,800	117
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	6,300	112	3,100	65
PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	—	11,500	4
PHYSICIANS REALTY TRUST	11,500	206	4,500	79
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	4,900	74	3,400	56
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,000	42	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	1,800	14	—	—
PROLOGIS INC	40,600	4,183	27,250	2,787
PUBLIC STORAGE	8,840	2,028	5,730	1,313
QTS REALTY TRUST INC CL A	4,100	260	1,700	106
RLJ LODGING TRUST	7,000	83	5,800	71
REALTY INCOME CORP	27,100	1,673	13,400	833
REGENCY CENTERS CORP	9,100	421	8,700	419
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	9,300	131	6,800	95
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	9,500	76	5,500	51
RETAIL VALUE INC	979	14	—	—
	( 201)	( 2)		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	9,300	446	3,800	186
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,000	105	900	64
SL GREEN REALTY CORP	3,400	173	3,700	198
			( 18,600)	( 1,045)
SL GREEN REALTY CORP	1,400	95	2,661	184
	( 18,561)	( 1,075)		
SABRA HEALTH CARE REIT INC	11,600	174	4,800	77

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
SAFEHOLD INC	400	24	—	—
SAUL CENTERS INC	700	17	—	—
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	2,300	28	—	—
SERVICE PROPERTIES TRUST	7,600	82	4,700	58
SIMON PROPERTY GROUP INC	22,690	1,887	12,120	1,101
SITE CENTERS CORP	13,200	142	6,700	78
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	9,300	357	3,900	163
STAG INDUSTRIAL INC	9,400	306	3,300	102
STORE CAPITAL CORP	16,200	478	5,500	177
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,000	15	—	—
SUN COMMUNITIES INC	9,730	1,426	3,490	521
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	10,600	101	8,000	85
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,000	64	1,900	30
TAUBMAN CENTERS INC	1,600	59	700	29
		( 15,100)	( 671)	
TERRENO REALTY CORP	3,800	222	2,300	133
UDR INC	16,500	615	10,600	425
UMH PROPERTIES INC	1,500	19	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	260	14	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	4,200	54	3,900	52
VENTAS INC	21,600	981	14,700	710
VEREIT INC	38,000	251	20,000	144
	(△ 261,000)	(△ 1,772)		
VEREIT INC	6,800	273	2,800	119
	( 52,200)	( 1,772)		
VICI PROPERTIES INC	44,800	1,124	18,100	491
VORNADO REALTY TRUST	8,500	319	6,200	251
WP CAREY INC	9,900	675	6,300	438
WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	—	—	—
	(△ 42,000)	(△ 59)		
WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	—	—	—
	( 4,667)	( 59)		
WASHINGTON REAL ESTATE INV	4,700	99	2,200	51
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4,500	86	2,500	61
WELLTOWER INC	23,600	1,420	13,900	920
WHITESTONE REIT	1,300	9	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,500	75	3,000	51
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	160,000	116	—	—
	( —)	(△ 1)		
EAGLE HOSPITALITY TRUST	—	—	—	—
	( —)	( 3)		
PRIME US REIT	20,000	15	—	—
	( —)	(△ 1)		
ARA US HOSPITALITY TRUST	—	—	107,000	33

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	— (—)	— (△ 5)	—	—
小計	1,606,495 (△ 196,968)	56,415 ( 1,405)	1,040,352 ( 45,000)	34,190 ( 1,814)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	3,400	125	1,700	69
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	4,000	41	—	—
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	1,700	23	1,100	16
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	5,000	245	3,200	164
CHOICE PROPERTIES REIT	11,500	148	5,000	65
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3,000	21	2,000	18
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,300	28	1,400	29
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	5,900	72	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	5,800	83	3,900	57
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,500	193	2,000	151
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	11,700	147	6,300	87
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,600	47	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	3,100	53	1,600	28
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	—	—	( 7,200)	( 251)
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	9,700	119	3,900	49
PLAZA RETAIL REIT	12,000	44	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,000	114	3,700	68
SLATE OFFICE REIT	2,100	8	—	—
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,300	148	3,800	94
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	7,000	91	2,100	27
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	10,600 (—)	189 (△ 2)	—	—
小計	117,200 (—)	1,948 (△ 2)	41,700 ( 7,200)	926 ( 251)
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
BRITISH LAND	44,000	181	29,000	136
DERWENT LONDON PLC	7,000	203	3,300	101
BIG YELLOW GROUP PLC	4,700	50	—	—
HAMMERTON PLC	— (△ 181,000)	— (△ 225)	—	—
UNITE GROUP PLC	29,100	280	13,900	141
SHAFTESBURY PLC	24,600 ( 7,120)	130 ( 36)	7,120	35
SHAFTESBURY PLC RTS	— ( 7,120)	— ( 28)	( 7,120)	( 7)
STANDARD LIFE INV PROP INC	110,000	62	—	—
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	50,000	16	—	—
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	—	—	22,000	15
SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,200	61	2,000	16
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	51,000	114	17,000	37

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
イギリス	口	千英ポンド	口	千英ポンド
SEGRO PLC	86,600	817	44,700	420
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	29,000	39	11,000	18
WORKSPACE GROUP PLC	7,500	56	5,100	38
GCP STUDENT LIVING PLC	130,000	181	12,000	18
NEWRIVER REIT PLC	17,000	14	—	—
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	52,000	56	36,000	37
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	16,000	17	—	—
	(—)	(0.21351)		
TRIPLE POINT SOCIAL HOU-ENT RTS	—	—	—	—
	(13,333)	(14)	(13,333)	(0.21351)
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	198,000	214	—	—
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	6,900	43	3,000	19
TRITAX BIG BOX REIT PLC	63,000	104	25,000	43
RDI REIT PLC	14,000	12	—	—
			(70,000)	(57)
CUSTODIAN REIT PLC	97,000	90	—	—
HOME REIT PLC	60,000	67	—	—
HAMMERSOM PLC	285,000	73	170,000	42
	(905,000)	(557)		
HAMMERSOM PLC-NIL PAID RTS	—	—	—	—
	(868,800)	(—)	(868,800)	(201)
HAMMERSOM PLC-FULL PAID	—	—	—	—
	(868,800)	(331)	(868,800)	(331)
ELITE COMMERCIAL REIT	60,000	42	60,000	36
CAPITAL & REGIONAL PLC	—	—	9,300	4
ASSURA PLC	202,000	155	94,000	70
LXI REIT PLC	—	—	11,192	14
	(14,192)	(18)		
LXI REIT PLC-ENT RTS	—	—	—	—
	(14,192)	(17)	(14,192)	(0.37929)
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	91,000	136	44,000	65
LAND SECURITIES GROUP PLC	45,800	274	34,400	225
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	74,000	76	—	—
小計	1,862,400	3,576	654,012	1,538
	(2,517,557)	(778)	(1,842,245)	(599)
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
ドイツ				
HAMBORNER REIT AG	1,600	14	—	—
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	11,200	142	3,700	50
	(—)	(△45)		
小計	12,800	156	3,700	50
イタリア				
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,000	12	—	—
小計	4,000	12	—	—

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ヨーロッパ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	ICADE	2,080	116	800
	ALTAREA	100 ( -)	11 (△ 6)	—
	KLEPIERRE	10,100 ( -)	157 (△ 39)	8,000
	GECINA SA	2,760	324	1,980
	COVIVIO	2,800	178	1,100
	MERCIALYS	4,000	21	—
	CARMILA	11,400 ( -)	103 (△ 3)	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	7,900	415	5,300
	小計	41,140 ( -)	1,330 (△ 50)	17,180
	オランダ			
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	2,200	32	1,800
	NSI NV	600	16	—
	小計	2,800	49	1,800
	スペイン			
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	13,000 ( -)	95 (△ 2)	6,100
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	— ( -)	— (△ 1)	—
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	17,200 ( -)	125 (△ 24)	18,700
	小計	30,200 ( -)	221 (△ 28)	24,800
ベルギー	小計			
	BEFIMMO S.C.A.	1,900	69	600
	COFINIMMO	2,570	320	1,280
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,600	36	900
	MONTEA	390	38	460
	AEDIFICA	1,362 ( 1,338)	132 ( 121)	640
	AEDIFICA RIGHTS	— ( 6,690)	— ( 6,690)	— ( 9)
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,100	207	2,600
	CARE PROPERTY INVEST	6,000	162	—
	XIOR STUDENT HOUSING NV	3,400 ( 680)	169 ( 31)	—
	XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	— ( 3,400)	— ( 3,400)	— ( 2)
	小計	24,322 ( 12,108)	1,137 ( 152)	6,480 ( 10,090)
	アイルランド			
	HIBERNIA REIT PLC	17,000	17	13,000
				14

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
アイルランド				
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,000	13	—	—
小計	27,000	30	13,000	14
シンガポール				
CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE	—	—	—	—
( CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE )	( 72,000 )	( 170 )		
CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE	360,000	170	—	—
( CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE )	( △ 360,000 )	( △ 170 )		
小計	360,000	170	—	—
( CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE )	( △ 288,000 )	( — )		
ユーロ 計	502,262	3,109	66,960	1,507
( CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE )	( △ 275,892 )	( 28 )	( 10,090 )	( 12 )
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	107,300	7,092	73,700	5,032
PROSPERITY REIT	40,000	97	—	—
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,000	141	—	—
CHAMPION REIT	40,000	158	—	—
FORTUNE REIT	50,000	358	20,000	145
小計	277,300	7,848	93,700	5,177
シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	251,000	497	234,000	472
( CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST )	( 450,694 )	( 966 )		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	220,000	683	152,000	471
( ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT )	( 26,002 )	( 46 )		
ASCENDAS REAL ESTATE-RTS	—	—	( 26,002 )	( 0.91 )
( ASCENDAS REAL ESTATE-RTS )	( 26,002 )	( 76 )	( 26,002 )	( 0.91 )
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	50,000	84	88,000	151
( CAPITALAND COMMERCIAL TRUST )			( 625,964 )	( 1,158 )
SUNTEC REIT	79,000	119	77,000	117
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	216,000	432	208,000	415
( MAPLETREE LOGISTICS TRUST )	( 12,008 )	( 16 )		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS	—	—	( 12,008 )	( 0.06102 )
( MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS )	( 12,008 )	( 23 )	( 12,008 )	( 0.06102 )
KEPPEL REIT	178,000	205	131,000	149
( KEPPEL REIT )	( — )	( △ 0.6645 )		
FRASERS CENTREPOINT TRUST	154,000	381	54,000	129
( FRASERS CENTREPOINT TRUST )	( 53,242 )	( 125 )		
FRASERS CENTREPOINT TRUST RTS	—	—	( 53,242 )	( 1 )
( FRASERS CENTREPOINT TRUST RTS )	( 53,242 )	( 124 )	( 53,242 )	( 1 )
ESR REIT	90,000	35	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	—	—	20,000	24
( CDL HOSPITALITY TRUSTS )	( — )	( △ 2 )		
CAPITALAND CHINA TRUST	39,000	48	—	—
( CAPITALAND CHINA TRUST )	( 10,143 )	( 9 )		
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST RTS	—	—	—	—
( CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST RTS )	( 10,143 )	( 11 )	( 10,143 )	( 0.77891 )

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
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
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	60,000 ( 176,400)	25 ( 38)	—	—
FIRST REAL ESTATE INVT-RTS	— ( 176,400)	— ( 35)	— ( 176,400)	— ( 8)
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	16,000 ( —)	64 (△ 2)	16,000	64
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	400,000 ( 560,000)	24 ( 37)	—	—
LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS	— ( 560,000)	— ( 33)	— ( 560,000)	— ( 5)
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	170,000 ( —)	512 (△ 0.4423)	62,000	179
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST-RIGHTS	— ( 20,900)	— ( 55)	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	126,000 ( —)	251 (△ 5)	91,000	185
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	50,000 ( 20,009)	30 ( 11)	—	—
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST RTS	— ( 20,009)	— ( 11)	— ( 20,009)	— (0.94077)
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	19,000 ( —)	22 (△ 1)	—	—
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	40,000 ( —)	36 (△ 12)	30,000	27
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	60,000	33	—	—
SPH REIT	40,000	35	—	—
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	60,000 ( —)	30 (△0.80554)	— ( 221,306)	— ( 97)
EC WORLD REIT	60,000	40	—	—
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	37,000	28	—	—
ASCOTT RESIDENCE TRUST	87,000 ( —)	81 (△ 4)	37,000	39
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	— ( —)	— (△0.18306)	—	—
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	220,000 ( —)	162 (△ 0.8544)	—	—
FRASERS HOSPITALITY TRUST	60,000 ( —)	25 (△ 0.385)	—	—
IREIT GLOBAL	80,000 ( 36,320)	57 ( 23)	—	—
IREIT GLOBAL-RIGHTS	— ( 36,320)	— ( 17)	— ( 36,320)	— ( 5)
KEPPEL DC REIT	59,000	170	23,000	63

銘柄	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
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	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	194,000 ( - )	268 (△ 15)	63,000	86
	小計	3,115,000 ( 2,259,842)	4,390 ( 1,618)	1,286,000 (1,741,394)	2,578 ( 1,279)
	韓国		千ウォン		千ウォン
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	19,000	76,009	—	—
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,454	30,204	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	7,000	33,259	—	—
	LOTTE REIT CO LTD	20,000 ( 8,257)	117,264 ( 41,855)	—	—
	LOTTE REIT CO LTD RTS	— ( 8,257)	— ( 40,418)	— ( 8,257)	— ( 3,089)
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	9,000	44,327	—	—
外國	JR REIT XXVII	28,000	149,975	—	—
	小計	87,454 ( 16,514)	451,042 ( 82,273)	— ( 8,257)	— ( 3,089)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	BWP TRUST	8,000	32	—	—
	MIRVAC GROUP	202,000	483	143,000	363
	CROMWELL PROPERTY GROUP	40,000	35	—	—
	CHARTER HALL RETAIL REIT	39,000	139	10,000	38
	GPT GROUP	100,000	425	55,000	252
	CENTURIA CAPITAL GROUP	113,200 ( 6,800)	249 ( 15)	—	—
	CENTURIA CAPITAL GROUP RTS	— ( 6,800)	— ( 15)	— ( 6,800)	— ( 0.2415)
国	ABACUS PROPERTY GROUP	18,000 ( - )	50 ( 2)	8,000	23
	ABACUS PROPERTY -ASX INTERNAL RTS	— ( 16,250)	— ( 47)	— ( 16,250)	— ( 2)
	STOCKLAND TRUST GROUP	159,000	653	133,000	559
	DEXUS	52,000	478	32,000	302
	GOODMAN GROUP	104,700	1,894	56,800	1,025
	CHARTER HALL GROUP	16,400	213	8,500	111
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8,000	25	6,000	20
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	15,000	69	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	81,000	186	42,000	101
	ARENA REIT	24,000	63	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	131,000	418	12,000	35
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	44,000 ( 11,610)	210 ( 55)	8,000	36
	CHARTER HALL LONG WALE REIT RTS	— ( 11,610)	— ( 53)	— ( 11,610)	— ( 1)
	NATIONAL STORAGE REIT	77,000	148	54,000	103
	NATIONAL STORAGE REIT-RTS	— ( 38,596)	— ( 77)	—	—

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	オーストラリア	口	千豪ドル	口	千豪ドル
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	28,000	74	—	—
	APN INDUSTRIAL REIT	8,000	24	—	—
	HOME CONSORTIUM	44,000	175	—	—
	IRONGATE GROUP	125,000	170	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	10,000	19	—	—
	WAYPOINT REIT LTD	34,000	93	—	—
	SCENTRE GROUP	268,000	659	211,000	568
	HOME CO DAILY NEEDS REIT	66,000	81	—	—
	( 14,000)	( —)			
	HOME CO DAILY NEEDS REIT -RTS	( 33,898)	( 43)	( 33,898)	( —)
	VICINITY CENTRES	331,000	534	129,000	205
	AVENTUS GROUP	96,000	243	—	—
	小計	2,242,300	7,856	908,300	3,749
		( 139,564)	( 311)	( 68,558)	( 4)
ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	50,000	83	40,000	67
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	20,000	65	—	—
	GOODMAN PROPERTY TRUST	45,000	104	34,000	76
	ARGOSY PROPERTY LTD	20,000	25	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	30,000	32	—	—
	小計	165,000	312	74,000	143
イスラエル		千新シェケル		千新シェケル	
	REIT 1 LTD	5,000	63	—	—
	小計	5,000	63	—	—

\* 金額は受け渡し代金。

\* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 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
外 国	REIT先物取引	百万円 1,831	百万円 1,816	百万円 —	百万円 —

\* 単位未満は切り捨て。

\* 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6月11日～2021年6月10日)

## 利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
						%
為替直物取引	百万円 7,958	百万円 46	% 0.6	百万円 5,589	百万円 46	% 0.8

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2021年6月10日現在)

## 外国投資信託証券

銘 柏	期首(前期末)		当 期 末			比 率	
	口 数	口 数	評 價 額		外貨建金額 邦貨換算金額		
			千米ドル	千円			
(アメリカ)	口	口				%	
ACADIA REALTY TRUST	20,300	22,000	500	54,928	54,928	0.1	
AGREE REALTY CORP	11,200	15,700	1,153	126,444	126,444	0.3	
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	17,200	344	37,795	37,795	0.1	
ALEXANDERS INC	500	500	142	15,582	15,582	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,130	31,300	5,960	653,530	653,530	1.6	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	11,200	12,200	470	51,596	51,596	0.1	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	31,200	34,200	1,666	182,738	182,738	0.4	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	25,000	28,000	257	28,245	28,245	0.1	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	57,900	65,900	2,556	280,366	280,366	0.7	
AMERICOLD REALTY TRUST	44,000	61,900	2,430	266,470	266,470	0.6	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	—	36,800	279	30,666	30,666	0.1	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	33,800	—	—	—	—	—	
APARTMENT INCOME REIT CO	—	36,900	1,845	202,344	202,344	0.5	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	48,800	51,300	835	91,631	91,631	0.2	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	—	14,200	190	20,895	20,895	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	—	—	—	—	—	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,040	34,370	7,243	794,284	794,284	1.9	
BRT APARTMENTS CORP	2,400	2,400	42	4,700	4,700	0.0	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	7,000	70	7,767	7,767	0.0	
BOSTON PROPERTIES	32,920	34,880	4,268	468,053	468,053	1.1	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	—	—	—	—	—	
BRANDYWINE REALTY TRUST	41,200	43,200	647	71,005	71,005	0.2	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	67,700	73,600	1,787	196,026	196,026	0.5	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	—	9,000	221	24,286	24,286	0.1	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	14,400	9,200	171	18,793	18,793	0.0	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	40,000	—	—	—	—	—	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	—	2,600	26	2,950	2,950	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	22,130	24,170	3,210	352,031	352,031	0.8	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	22,300	23,800	564	61,875	61,875	0.1	
CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	—	—	—	—	—	
CENTERSPACE	—	3,100	234	25,673	25,673	0.1	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	10,800	150	16,496	16,496	0.0	
CITY OFFICE REIT INC	12,600	10,700	137	15,076	15,076	0.0	
CLIPPER REALTY INC	2,400	2,400	18	2,071	2,071	0.0	
COLONY CAPITAL INC	112,000	125,000	1,023	112,254	112,254	0.3	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	26,600	29,000	552	60,576	60,576	0.1	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,800	5,400	272	29,919	29,919	0.1	
CORESITE REALTY CORP	9,260	10,720	1,452	159,308	159,308	0.4	
CORECIVIC INC	27,600	—	—	—	—	—	
COREPOINT LODGING INC	8,900	8,900	93	10,256	10,256	0.0	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	25,600	28,500	848	93,063	93,063	0.2	
COUSINS PROPERTIES INC	33,300	37,200	1,446	158,631	158,631	0.4	

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	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
CTO REALTY GROWTH INC	—	1,200	66	7,338	0.0	
CUBESMART	43,900	49,000	2,255	247,366	0.6	
CYRUSONE INC	25,950	29,500	2,398	262,946	0.6	
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	47,000	53,000	554	60,787	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	60,150	69,300	11,148	1,222,486	2.9	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	53,000	60,000	242	26,579	0.1	
DOUGLAS EMMETT INC	38,100	41,100	1,486	162,959	0.4	
DUKE REALTY CORP	84,200	92,000	4,491	492,486	1.2	
EPR PROPERTIES	17,900	18,400	986	108,121	0.3	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	17,300	19,800	429	47,047	0.1	
EASTGROUP PROPERTIES	8,830	9,850	1,650	180,973	0.4	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	34,600	34,600	442	48,561	0.1	
EQUINIX INC	20,190	22,020	17,836	1,955,763	4.7	
EQUITY COMMONWEALTH	28,300	30,600	857	94,015	0.2	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,700	41,600	3,163	346,897	0.8	
EQUITY RESIDENTIAL	80,100	84,400	6,697	734,341	1.8	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,600	28,700	814	89,279	0.2	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	15,090	16,000	4,960	543,934	1.3	
EXTRA SPACE STORAGE INC	29,650	32,500	5,153	565,084	1.4	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	6,800	89	9,797	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,220	17,110	2,095	229,748	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	29,200	31,600	1,679	184,126	0.4	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	16,000	19,300	559	61,392	0.1	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	25,000	141	15,460	0.0	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	11,300	—	—	—	—	
GEO GROUP INC/THE	27,600	30,100	264	29,044	0.1	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	46,800	53,700	2,601	285,283	0.7	
GETTY REALTY CORP	7,900	8,900	300	32,906	0.1	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,300	8,300	188	20,704	0.0	
GLADSTONE LAND CORP	4,200	5,800	146	16,083	0.0	
GLOBAL NET LEASE INC	20,800	22,400	444	48,754	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,200	10,700	168	18,502	0.0	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,200	34,300	1,100	120,690	0.3	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	47,000	54,300	1,579	173,201	0.4	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	113,300	132,500	4,585	502,835	1.2	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,800	9,600	115	12,684	0.0	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,700	26,100	1,257	137,913	0.3	
HOST HOTELS & RESORTS INC	163,900	174,700	3,111	341,165	0.8	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	35,700	37,100	1,098	120,494	0.3	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,500	25,900	474	52,056	0.1	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	15,200	16,400	431	47,312	0.1	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	3,950	5,900	1,114	122,257	0.3	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,700	—	—	—	—	
INVITATION HOMES INC	122,900	139,600	5,228	573,252	1.4	
IRON MOUNTAIN INC	65,900	70,900	3,333	365,542	0.9	
JBG SMITH PROPERTIES	27,400	27,800	964	105,774	0.3	
KILROY REALTY CORP	22,400	26,300	1,909	209,392	0.5	

銘柄	期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額	外貨建金額
				邦貨換算金額	比率
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円
KIMCO REALTY CORP	96,900	106,100	2,351	257,806	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	19,000	21,300	490	53,764	0.1
LTC PROPERTIES INC	9,200	9,500	374	41,062	0.1
LEXINGTON REALTY TRUST	56,600	68,500	885	97,117	0.2
LIFE STORAGE INC	10,590	18,500	1,969	215,956	0.5
MACERICH CO /THE	27,342	29,500	531	58,256	0.1
MACK-CALI REALTY CORP	20,900	20,900	370	40,654	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	119,100	142,500	3,083	338,127	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,110	28,150	4,748	520,686	1.3
MONMOUTH REIT-CLASS A	22,500	24,300	470	51,557	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	10,200	11,400	765	83,925	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	39,000	43,800	2,173	238,356	0.6
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,400	16,100	784	86,008	0.2
NETSTREIT CORP	—	5,800	137	15,091	0.0
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,000	18,000	133	14,644	0.0
NEXPPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,400	5,500	310	34,007	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME	11,200	12,200	381	41,804	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,100	57,900	2,163	237,252	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,400	4,200	120	13,171	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,570	4,950	791	86,772	0.2
PARAMOUNT GROUP INC	45,600	41,000	472	51,834	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	54,700	59,300	1,266	138,887	0.3
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,700	32,900	792	86,904	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	—	—	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	44,800	51,800	1,000	109,735	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	28,800	30,300	608	66,680	0.2
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	6,400	129	14,182	0.0
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	10,600	12,400	136	14,915	0.0
PROLOGIS INC	169,060	182,410	22,547	2,472,355	6.0
PUBLIC STORAGE	34,370	37,480	11,013	1,207,588	2.9
QTS REALTY TRUST INC CL A	13,400	15,800	1,236	135,531	0.3
RLJ LODGING TRUST	38,900	40,100	650	71,362	0.2
RPT REALTY	19,000	19,000	264	29,021	0.1
REALTY INCOME CORP	78,300	92,000	6,528	715,830	1.7
REGENCY CENTERS CORP	38,400	38,800	2,620	287,343	0.7
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENT	27,500	30,000	562	61,645	0.1
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	50,000	54,000	685	75,197	0.2
RETAIL VALUE INC	3,221	4,401	91	10,071	0.0
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	27,100	32,600	1,903	208,720	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,600	13,700	1,081	118,538	0.3
SL GREEN REALTY CORP	18,900	—	—	—	—
SL GREEN REALTY CORP	—	17,300	1,437	157,598	0.4
SABRA HEALTH CARE REIT INC	46,200	53,000	943	103,501	0.2
SAFEHOLD INC	3,100	3,500	259	28,414	0.1
SAUL CENTERS INC	2,700	3,400	157	17,302	0.0
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	7,000	9,300	177	19,507	0.0
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,000	39,900	571	62,694	0.2

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	千米ドル	千円	%
SIMON PROPERTY GROUP INC	70,400	80,970	10,978	1,203,816		2.9
SITE CENTERS CORP	34,000	40,500	638	69,987		0.2
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,700	28,100	1,412	154,859		0.4
STAG INDUSTRIAL INC	33,600	39,700	1,515	166,158		0.4
STORE CAPITAL CORP	49,200	59,900	2,158	236,711		0.6
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	24,000	27,000	274	30,079		0.1
SUN COMMUNITIES INC	21,220	27,460	4,814	527,856		1.3
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	51,600	54,200	719	78,923		0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	22,000	24,100	486	53,379		0.1
TAUBMAN CENTERS INC	14,200	—	—	—		—
TERRENO REALTY CORP	15,500	17,000	1,120	122,915		0.3
UDR INC	67,100	73,000	3,625	397,581		1.0
UMH PROPERTIES INC	8,400	9,900	227	24,923		0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,940	3,200	234	25,666		0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	27,100	27,400	553	60,689		0.1
URSTADT BIDDLE-CL A	6,900	6,900	136	14,934		0.0
VENTAS INC	85,300	92,200	5,319	583,331		1.4
VEREIT INC	243,000	—	—	—		—
VEREIT INC	—	56,200	2,769	303,679		0.7
VICI PROPERTIES INC	105,300	132,000	4,309	472,569		1.1
VORNADO REALTY TRUST	36,600	38,900	1,953	214,164		0.5
WP CAREY INC	39,500	43,100	3,323	364,368		0.9
WASHINGTON PRIME GROUP INC	42,000	—	—	—		—
WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	4,667	31	3,443		0.0
WASHINGTON REAL ESTATE INV	18,600	21,100	568	62,351		0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	27,400	29,400	997	109,348		0.3
WELLTOWER INC	93,100	102,800	8,104	888,686		2.1
WHITESTONE REIT	8,300	9,600	84	9,210		0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC	26,300	28,800	588	64,516		0.2
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	—	160,000	122	13,421		0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	100,000	—	—		—
PRIME US REIT	90,000	110,000	94	10,312		0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST	107,000	—	—	—		—
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	343,515	343,515	261	28,626		0.1
小計	口数・金額	5,756,048	6,080,223	281,346	30,849,593	
	銘柄	口数	比率	外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)				千カナダドル		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,700	15,400	703	63,699		0.2
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	16,000	183	16,595		0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL ESTATE INVEST	—	4,000	48	4,416		0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,600	5,600	225	20,385		0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,200	12,800	215	19,486		0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	18,700	20,500	1,167	105,649		0.3
CHOICE PROPERTIES REIT	33,600	40,100	586	53,098		0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,000	22,000	227	20,549		0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	10,900	10,900	197	17,906		0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,800	6,700	156	14,153		0.0

銘柄	期首(前期末)		当期末			比率	
	口数	口数	評価額		邦貨換算金額		
			外貨建金額	千円			
(カナダ)	口	口	千カナダドル	千円	千円	%	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	15,700	21,600	314	28,504	28,504	0.1	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	24,900	26,800	488	44,244	44,244	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,700	7,200	584	52,902	52,902	0.1	
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	30,400	35,800	587	53,140	53,140	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,700	17,300	279	25,256	25,256	0.1	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	11,400	12,900	256	23,211	23,211	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,000	4,000	88	8,048	8,048	0.0	
MORGARD NORTH AMERICAN RESI	4,600	4,600	78	7,111	7,111	0.0	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	7,200	—	—	—	—	—	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTY	18,200	24,000	313	28,347	28,347	0.1	
PLAZA RETAIL REIT	—	12,000	54	4,930	4,930	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	35,400	38,700	846	76,639	76,639	0.2	
SLATE OFFICE REIT	5,900	8,000	42	3,837	3,837	0.0	
SLATE RETAIL REIT	4,300	—	—	—	—	—	
SLATE GROCERY REIT	—	4,300	54	4,919	4,919	0.0	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	15,400	17,900	532	48,166	48,166	0.1	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	15,000	19,900	330	29,881	29,881	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,000	10,000	75	6,851	6,851	0.0	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	—	10,600	233	21,097	21,097	0.1	
小計	口数・金額	361,300	429,600	8,872	803,032		
	銘柄数 <比率>	25	27	<1.9%>			
(イギリス)			千英ポンド				
BRITISH LAND	218,000	233,000	1,206	186,773	186,773	0.4	
DERWENT LONDON PLC	24,200	27,900	998	154,481	154,481	0.4	
BIG YELLOW GROUP PLC	36,000	40,700	534	82,697	82,697	0.2	
HAMMERSOM PLC	181,000	—	—	—	—	—	
INTU PROPERTIES PLC	184,000	184,000	3	505	505	0.0	
UNITE GROUP PLC	82,200	97,400	1,146	177,480	177,480	0.4	
SHAFTESBURY PLC	50,400	75,000	475	73,641	73,641	0.2	
STANDARD LIFE INV PROP INC	—	110,000	79	12,273	12,273	0.0	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	160,000	75	11,686	11,686	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	131,000	131,000	117	18,163	18,163	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	198,000	176,000	142	22,033	22,033	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	47,700	52,900	504	78,056	78,056	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	191,000	225,000	533	82,520	82,520	0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	190,000	190,000	174	27,050	27,050	0.1	
SEGRO PLC	251,200	293,100	3,164	489,631	489,631	1.2	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	200,000	218,000	386	59,846	59,846	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	30,400	32,800	301	46,722	46,722	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	—	118,000	209	32,357	32,357	0.1	
NEWRIVER REIT PLC	63,000	80,000	75	11,711	11,711	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	146,000	162,000	187	29,030	29,030	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	80,000	96,000	102	15,806	15,806	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	—	198,000	231	35,772	35,772	0.1	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	58,100	62,000	465	72,102	72,102	0.2	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	386,000	424,000	854	132,277	132,277	0.3	
RDI REIT PLC	56,000	—	—	—	—	—	

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	
(イギリス)		口	口	千英ポンド	千円	%
CUSTODIAN REIT PLC		—	97,000	96	14,860	0.0
HOME REIT PLC		—	60,000	65	10,120	0.0
HAMMERSOM PLC		—	1,020,000	441	68,315	0.2
CAPITAL & REGIONAL PLC		9,300	—	—	—	—
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		146,000	146,000	125	19,430	0.0
ASSURA PLC		542,000	650,000	498	77,200	0.2
AEW UK REIT PLC		32,000	32,000	30	4,704	0.0
LXI REIT PLC		123,000	126,000	182	28,311	0.1
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		283,000	330,000	513	79,512	0.2
REGIONAL REIT LTD		100,000	100,000	87	13,494	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		172,600	184,000	1,334	206,493	0.5
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		—	74,000	82	12,711	0.0
小計	口数・金額	4,322,100	6,205,800	15,429	2,387,779	
	銘柄数<比率>	30	34	—	<5.8%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		16,000	—	—	—	—
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		35,800	43,300	669	89,418	0.2
HAMBORNER REIT AG		—	17,600	160	21,450	0.1
小計	口数・金額	51,800	60,900	830	110,868	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		10,000	14,000	62	8,372	0.0
小計	口数・金額	10,000	14,000	62	8,372	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		6,420	7,700	585	78,118	0.2
ALTAREA		840	940	171	22,937	0.1
KLEPIERRE		48,100	50,200	1,293	172,622	0.4
GECINA SA		12,520	13,300	1,809	241,545	0.6
COVIVIO		10,300	12,000	979	130,713	0.3
MERCIALYS		5,200	9,200	100	13,423	0.0
CARMILA		—	11,400	150	20,148	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		31,400	34,000	2,808	374,847	0.9
小計	口数・金額	114,780	138,740	7,898	1,054,357	
	銘柄数<比率>	7	8	—	<2.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA		8,800	9,200	226	30,260	0.1
VASTNED RETAIL NV		4,600	4,600	122	16,395	0.0
WERELDHAVE NV		10,000	10,000	156	20,944	0.1
NSI NV		3,700	4,300	150	20,147	0.0
小計	口数・金額	27,100	28,100	657	87,748	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.2%>	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		55,900	62,800	597	79,807	0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14,000	14,000	75	10,091	0.0

銘柄		期首(前期末)		当期末		
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建額	邦貨換算額	
(ユーロ…スペイン)	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	85,500	84,000	千ユーロ 812	千円 108,453	% 0.3
小計	口数・金額	155,400	160,800	1,485	198,353	
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.5%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S.C.A.		5,200	6,500	237	31,670	0.1
COFINIMMO		5,660	6,950	907	121,164	0.3
RETAIL ESTATES		2,600	2,600	186	24,954	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		5,300	6,000	147	19,623	0.0
MONTEA		2,610	2,540	257	34,313	0.1
AEDIFICA		6,160	8,220	887	118,507	0.3
WAREHOUSES DE PAUW SCA		29,400	33,900	1,092	145,805	0.4
CARE PROPERTY INVEST		—	6,000	162	21,745	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		—	4,080	202	27,068	0.1
小計	口数・金額	56,930	76,790	4,081	544,853	
	銘柄数 <比率>	7	9	—	<1.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
HIBERNIA REIT PLC		156,000	160,000	197	26,398	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		100,000	110,000	178	23,787	0.1
小計	口数・金額	256,000	270,000	375	50,186	
	銘柄数 <比率>	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…シンガポール)						
CROMWELL REIT EUR		—	72,000	164	22,009	0.1
小計	口数・金額	—	72,000	164	22,009	
	銘柄数 <比率>	—	1	—	<0.1%>	
ユ一口計	口数・金額	672,010	821,330	15,557	2,076,749	
	銘柄数 <比率>	26	30	—	<5.0%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		481,400	515,000	39,011	551,228	1.3
PROSPERITY REIT		260,000	300,000	897	12,674	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		340,000	380,000	1,573	22,229	0.1
CHAMPION REIT		460,000	500,000	2,290	32,357	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		240,000	240,000	1,082	15,294	0.0
FORTUNE REIT		320,000	350,000	3,006	42,481	0.1
小計	口数・金額	2,101,400	2,285,000	47,860	676,266	
	銘柄数 <比率>	6	6	—	<1.6%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		658,000	1,125,694	2,420	200,323	0.5
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		687,760	781,762	2,306	190,884	0.5
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		663,964	—	—	—	—
SUNTEC REIT		532,000	534,000	795	65,856	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		695,000	715,008	1,444	119,546	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		330,000	330,000	184	15,295	0.0
KEPPEL REIT		443,000	490,000	583	48,263	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		169,596	322,838	778	64,398	0.2
ESR REIT		509,760	599,760	245	20,353	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		200,000	180,000	226	18,772	0.0
CAPITALAND CHINA TRUST		181,136	230,279	315	26,112	0.1

銘柄	期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額	比 率
				外貨建金額	
(シンガポール)		口	口	千円	%
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	356,400	96	7,964	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	91,000	91,000	404	33,442	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	350,000	1,310,000	83	6,939	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	343,000	451,000	1,258	104,148	0.3
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST-RIGHTS	—	20,900	3	259	0.0
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	495,716	530,716	1,130	93,565	0.2
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	209,860	279,869	228	18,879	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	91,000	110,000	156	12,928	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	219,764	219,764	94	7,821	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	490,000	500,000	535	44,281	0.1
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	200,000	260,000	153	12,696	0.0
SPH REIT	210,000	250,000	220	18,209	0.0
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	161,306	—	—	—	—
EC WORLD REIT	—	60,000	49	4,072	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	103,000	140,000	130	10,834	0.0
ASCOTT RESIDENCE TRUST	429,956	479,956	499	41,314	0.1
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	610,216	610,216	247	20,455	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	—	220,000	172	14,294	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	200,000	106	8,773	0.0
IREIT GLOBAL	—	116,320	76	6,354	0.0
KEPPEL DC REIT	281,211	317,211	824	68,264	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	545,746	676,746	960	79,540	0.2
小計	口数・金額	10,161,991	12,509,439	16,731	1,384,848
	銘柄数<比率>	29	31	—	<3.3%>
(韓国)			千ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	—	19,000	96,900	9,534	0.0
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,546	11,000	94,050	9,254	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	—	7,000	39,270	3,864	0.0
LOTTE REIT CO LTD	—	28,257	172,650	16,988	0.0
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	—	9,000	56,250	5,535	0.0
JR REIT XXVII	—	28,000	146,440	14,409	0.0
小計	口数・金額	6,546	102,257	605,560	59,587
	銘柄数<比率>	1	6	—	<0.1%>
(オーストラリア)			千豪ドル		
BWP TRUST	111,000	119,000	510	43,235	0.1
MIRVAC GROUP	906,000	965,000	2,827	239,456	0.6
CROMWELL PROPERTY GROUP	430,000	470,000	423	35,823	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	101,000	130,000	495	41,946	0.1
GPT GROUP	438,000	483,000	2,294	194,300	0.5
CENTURIA CAPITAL GROUP	—	120,000	322	27,337	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	86,000	96,000	299	25,366	0.1
STOCKLAND TRUST GROUP	559,000	585,000	2,755	233,350	0.6
DEXUS	249,000	269,000	2,859	242,168	0.6
GOODMAN GROUP	366,100	414,000	8,383	709,998	1.7
CHARTER HALL GROUP	107,000	114,900	1,677	142,070	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	68,000	70,000	279	23,653	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,000	74,000	435	36,850	0.1

銘柄	期首(前期末)		当期末		
	口数	口数	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額
			外貨建金額		
(オーストラリア)				千豪ドル	千円
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	234,000	273,000	682	57,800	0.1
ARENA REIT	63,000	87,000	297	25,198	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	—	119,000	437	37,087	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	96,000	143,610	705	59,717	0.1
NATIONAL STORAGE REIT	219,000	242,000	491	41,604	0.1
NATIONAL STORAGE REIT-RTS	—	38,596	1	98	0.0
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	40,000	40,000	132	11,179	0.0
GDI PROPERTY GROUP	130,000	130,000	150	12,716	0.0
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	54,000	82,000	283	24,028	0.1
APN INDUSTRIAL REIT	30,000	38,000	121	10,330	0.0
HOME CONSORTIUM	—	44,000	219	18,557	0.0
RURAL FUNDS GROUP	80,000	80,000	200	16,938	0.0
IRONGATE GROUP	—	125,000	186	15,773	0.0
CENTURIA OFFICE REIT	78,000	88,000	206	17,513	0.0
WAYPOINT REIT LTD	161,000	195,000	514	43,598	0.1
SCENTRE GROUP	1,217,000	1,274,000	3,618	306,421	0.7
HOMECO DAILY NEEDS REIT	—	80,000	115	9,756	0.0
VICINITY CENTRES	748,000	950,000	1,577	133,556	0.3
AVVENTUS GROUP	—	96,000	288	24,390	0.1
小計	口数・金額	6,630,100	8,035,106	33,791	2,861,826
	銘柄数 <比率>	25	32	—	<6.9%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	250,000	260,000	417	32,795	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	80,000	100,000	306	24,048	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	259,000	270,000	618	48,592	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	180,000	200,000	310	24,362	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	360,000	390,000	464	36,473	0.1
小計	口数・金額	1,129,000	1,220,000	2,115	166,272
	銘柄数 <比率>	5	5	—	<0.4%>
(イスラエル)			千新シェケル		
REIT 1 LTD	40,000	45,000	777	26,288	0.1
小計	口数・金額	40,000	45,000	777	26,288
	銘柄数 <比率>	1	1	—	<0.1%>
合計	口数・金額	31,180,495	37,733,755	—	41,292,245
	銘柄数 <比率>	305	328	—	<99.4%>

\* 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。

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

### 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	REIT先物取引	百万円 223	百万円 —
DJREA			

\* 単位未満は切り捨て。

\* 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。

(2021年6月10日現在)

## ○投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
投資証券	千円 41,292,245	% 98.3
コール・ローン等、その他	729,520	1.7
投資信託財産総額	42,021,765	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*当期末における外貨建て純資産(41,527,344千円)の投資信託財産総額(42,021,765千円)に対する比率は98.8%です。

\*外貨建て資産は、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米ドル=109.65円、1カナダドル=90.51円、1英ポンド=154.75円、1ユーロ=133.49円、1香港ドル=14.13円、1シンガポールドル=82.77円、1ウォン=0.0984円、1豪ドル=84.69円、1ニュージーランドドル=78.59円、1新シェケル=33.8066円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年6月10日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	42,032,710,457
投資証券(評価額)	500,496,533
未収入金	41,292,245,577
未収配当金	64,652,826
差入委託証拠金	28,035,678
支払利息	147,279,843
(B) 負債	508,500,007
未払金	10,964,880
未払解約金	497,494,350
未払利息	477
その他未払費用	40,300
(C) 純資産総額(A-B)	41,524,210,450
元本	14,294,107,321
次期繰越損益金	27,230,103,129
(D) 受益権総口数	14,294,107,321口
1万口当たり基準価額(C/D)	29,050円

(注) 期首元本額は13,122,373,854円、期中追加設定元本額は4,619,259,354円、期中一部解約元本額は3,447,525,887円、1口当たり純資産額は2.9050円です。

## ○損益の状況 (2020年6月11日～2021年6月10日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取配当金	1,090,305,025
受取利息	1,068,697,093
その他収益金	18
支払利息	21,627,449
(B) 有価証券売買損益	△ 19,535
売買益	8,970,978,182
売買損	9,446,598,621
(C) 先物取引等取引損益	△ 475,620,439
取引益	58,524,817
取引損	77,667,946
(D) 保管費用等	△ 19,143,129
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 23,371,883
(F) 前期繰越損益金	10,096,436,141
(G) 追加信託差損益金	15,930,212,887
(H) 解約差損益金	5,825,476,637
(I) 計(E+F+G+H)	△ 4,622,022,536
次期繰越損益金(I)	27,230,103,129
	27,230,103,129

\*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。

\*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。

\*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	円 2,822,682,462
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,167,758,752
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,677,839,229
野村インデックスファンド・外国REIT	1,643,056,599
野村6資産均等バランス	1,460,163,971
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)REIT	1,271,383,483
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	850,239,308
野村世界6資産分散投信(成長コース)	785,749,098
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用)	663,146,453
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	375,800,678
野村DC運用戦略ファンド	292,581,430
ノムラPOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用)	75,466,885
野村資産設計ファンド2040	35,053,440
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	23,537,843
野村資産設計ファンド2035	20,352,814
野村資産設計ファンド2030	18,244,856
野村資産設計ファンド2025	17,736,574
野村資産設計ファンド2015	14,165,849
ネクストコア	14,155,829

ファンド名	当期末 元本額
野村資産設計ファンド2020	円 14,088,914
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	7,089,037
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,722,915
インデックス・ブレンド(タイプV)	5,489,221
インデックス・ブレンド(タイプIII)	5,007,817
野村資産設計ファンド2050	4,397,221
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	3,639,468
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,486,391
野村資産設計ファンド2045	3,450,965
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,095,744
野村資産設計ファンド2060	1,930,192
インデックス・ブレンド(タイプIV)	1,659,147
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,550,462
インデックス・ブレンド(タイプII)	1,162,594
インデックス・ブレンド(タイプI)	919,174
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	854,701
野村POFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	440,471
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	7,334

## ○お知らせ

該当事項はございません。