

# バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)

## 運用報告書(全体版)

第19期(決算日2020年5月11日)

作成対象期間 (2019年5月11日～2020年5月11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	バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	
信託期間	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型			
運用方針	内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。 各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3カ月毎にリバランスを行います。	国内株式マザーファンド 20%	30%	45%
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 10%	20%	25%	
	国内債券マザーファンド 55%	40%	20%	
	外国債券マザーファンド 15%	10%	10%	
主な投資対象	「国内株式マザーファンド」受益証券、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」受益証券、「国内債券マザーファンド」受益証券および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 なお、株式および公社債に直接投資する場合もあります。	バランスセレクト30/50/70 (確定拠出年金向け)		
	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。	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。	外国の株式を主要投資対象とします。		
	国内債券マザーファンド わが国の公社債を主要投資対象とします。	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 外国の公社債を主要投資対象とします。	外国の公社債を主要投資対象とします。		
主な投資制限	株式への実質投資割合 信託財産の純資産総額の50%未満	信託財産の純資産総額の70%未満	制限を設けません。	
	外貨建て資産への実質投資割合 信託財産の純資産総額の30%以内	信託財産の純資産総額の40%以内	信託財産の純資産総額の50%以内	
	国内株式マザーファンド 外貨建て資産への投資は行いません。	株式への投資割合には制限を設けません。		
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 外貨建て資産への投資は行いません。	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。		
	国内債券マザーファンド 外貨建て資産への投資は行いません。	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。		
	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。	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。		
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から、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

東京都中央区日本橋1-12-1

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/>

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指數	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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
15期(2016年5月10日)	円 15,452	円 5	% △1.8	158.62	% △2.0	% 28.8	% 0.6	% 69.7	% —	% 0.3 百万円 62
16期(2017年5月10日)	16,183	5	4.8	166.38	4.9	29.9	0.4	68.9	—	0.3 52
17期(2018年5月10日)	16,807	5	3.9	173.06	4.0	29.4	0.5	69.4	—	0.2 60
18期(2019年5月10日)	16,617	5	△1.1	171.24	△1.0	28.9	0.5	69.8	—	0.3 63
19期(2020年5月11日)	16,615	5	0.0	170.70	△0.3	29.7	0.6	68.8	—	0.3 53

\* 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。

\* 参考指數は、「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク=東証株価指数（TOPIX））、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」（ベンチマーク=MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク=NOMURA-BPI国債）、「外国債券マザーファンド」（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））の各ベンチマークから、基本投資比率（国内株式20%、外国株式10%、国内債券55%、外国債券15%）に基づいて独自に合成した指數です。設定時を100として指數化しております。

\* MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCIが開発したMSCI-KOKUSAI指数を当社が独自に円換算したものです。円換算にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指數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おります。

\* FTSE世界債券インデックス（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指數で、基準価額への反映を考慮して営業日前日の指數値をもとにしております。

(出所) MSCI、FTSE Fixed Income LLC、野村證券株式会社、東京証券取引所、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		参考指數	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						
(期首) 2019年5月10日	円 16,617	% —	% 171.24	% —	% 28.9	% 0.5	% 69.8	% — 0.3
5月末	16,544	△0.4	170.74	△0.3	28.7	0.7	69.7	— 0.3
6月末	16,781	1.0	173.03	1.0	29.5	0.4	69.3	— 0.3
7月末	16,871	1.5	173.97	1.6	29.3	0.3	69.6	— 0.3
8月末	16,824	1.2	173.61	1.4	28.5	0.6	70.1	— 0.3
9月末	16,978	2.2	174.84	2.1	30.2	0.6	68.1	— 0.3
10月末	17,195	3.5	176.94	3.3	31.0	0.5	67.5	— 0.3
11月末	17,284	4.0	178.00	3.9	29.2	0.6	69.1	— 0.3
12月末	17,356	4.4	178.80	4.4	29.3	0.4	69.3	— 0.3
2020年1月末	17,342	4.4	178.63	4.3	29.0	0.5	69.3	— 0.3
2月末	16,947	2.0	174.91	2.1	27.6	0.7	70.7	— 0.3
3月末	16,373	△1.5	168.27	△1.7	27.8	0.7	70.3	— 0.2
4月末	16,635	0.1	170.83	△0.2	29.4	0.6	69.0	— 0.3
(期末) 2020年5月11日	16,620	0.0	170.70	△0.3	29.7	0.6	68.8	— 0.3

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指數	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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
15期(2016年5月10日)	円 16,012	円 5	% △5.7	160.23	% △5.9	% 47.9	% 1.0	% 50.1	% —	% 0.5 百万円 164
16期(2017年5月10日)	17,532	5	9.5	175.31	9.4	49.3	0.7	49.1	—	0.5 160
17期(2018年5月10日)	18,588	5	6.1	185.92	6.1	48.9	0.8	49.5	—	0.5 169
18期(2019年5月10日)	18,198	5	△2.1	181.70	△2.3	48.3	0.9	50.0	—	0.5 174
19期(2020年5月11日)	18,143	5	△0.3	179.48	△1.2	49.2	0.9	48.8	—	0.5 145

\* 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。

\* 参考指數は、「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク＝東証株価指数（TOPIX））、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」（ベンチマーク＝MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク＝NOMURA-BP1国債）、「外国債券マザーファンド」（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））の各ベンチマークから、基本投資比率（国内株式30%、外国株式20%、国内債券40%、外国債券10%）に基づいて独自に合成した指數です。設定時を100として指數化しております。

\* MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCIが開発したMSCI-KOKUSAI指数を当社が独自に円換算したものです。円換算にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指數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おります。

\* FTSE世界債券インデックス（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指數で、基準価額への反映を考慮して営業日前日の指數値をもとにしております。

(出所) MSCI、FTSE Fixed Income LLC、野村證券株式会社、東京証券取引所、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		参考指數	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						
(期首) 2019年5月10日	円 18,198	% —	181.70	% —	% 48.3	% 0.9	% 50.0	% — 0.5
5月末	18,009	△1.0	180.01	△0.9	47.5	1.1	50.4	— 0.5
6月末	18,353	0.9	183.27	0.9	49.2	0.8	49.1	— 0.5
7月末	18,510	1.7	184.87	1.7	48.8	0.6	49.7	— 0.5
8月末	18,260	0.3	182.45	0.4	48.4	1.0	49.6	— 0.6
9月末	18,622	2.3	185.50	2.1	49.7	0.9	48.2	— 0.6
10月末	19,032	4.6	189.45	4.3	50.6	0.8	47.4	— 0.6
11月末	19,247	5.8	191.76	5.5	48.4	0.9	49.5	— 0.6
12月末	19,417	6.7	193.52	6.5	48.5	0.7	49.6	— 0.5
2020年1月末	19,341	6.3	192.77	6.1	48.0	0.9	50.0	— 0.5
2月末	18,532	1.8	184.83	1.7	45.5	1.1	52.3	— 0.5
3月末	17,589	△3.3	174.36	△4.0	49.3	1.1	48.3	— 0.5
4月末	18,139	△0.3	179.34	△1.3	48.9	1.0	49.1	— 0.5
(期末) 2020年5月11日	18,148	△0.3	179.48	△1.2	49.2	0.9	48.8	— 0.5

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 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。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			参考指數	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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率							
15期(2016年5月10日)	円 16,411	円 5	% △10.1	158.54	% △10.5	% 67.7	% 1.4	% 29.9	% —	% 0.7 百万円 109
16期(2017年5月10日)	18,736	5	14.2	180.70	14.0	68.8	1.0	29.3	—	0.6 124
17期(2018年5月10日)	20,314	5	8.4	195.53	8.2	68.3	1.1	29.7	—	0.6 156
18期(2019年5月10日)	19,481	5	△ 4.1	186.90	△ 4.4	67.8	1.2	30.0	—	0.6 151
19期(2020年5月11日)	19,271	5	△ 1.1	183.03	△ 2.1	68.4	1.4	29.2	—	0.6 126

\* 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。

\* 参考指數は、「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク＝東証株価指数（TOPIX））、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」（ベンチマーク＝MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク＝NOMURA-BP1国債）、「外国債券マザーファンド」（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））の各ベンチマークから、基本投資比率（国内株式45%、外国株式25%、国内債券20%、外国債券10%）に基づいて独自に合成した指數です。設定時を100として指數化しております。

\* MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCIが開発したMSCI-KOKUSAI指数を当社が独自に円換算したものです。円換算にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指數値を営業日当日の対顧客電信売買相場値で円換算しております。

\* FTSE世界債券インデックス（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指數で、基準価額への反映を考慮して営業日前日の指數値をもとにしております。

(出所) MSCI、FTSE Fixed Income LLC、野村證券株式会社、東京証券取引所、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		参考指數	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						
(期首) 2019年5月10日	円 19,481	% —	186.90	% —	% 67.8	% 1.2	% 30.0	% — 0.6
5月末	19,158	△1.7	184.02	△1.5	67.0	1.6	30.4	— 0.7
6月末	19,603	0.6	188.16	0.7	68.2	1.0	29.8	— 0.7
7月末	19,816	1.7	190.27	1.8	68.6	0.8	29.6	— 0.7
8月末	19,333	△0.8	185.76	△0.6	67.1	1.4	30.6	— 0.7
9月末	19,959	2.5	191.04	2.2	68.2	1.3	29.3	— 0.7
10月末	20,595	5.7	197.11	5.5	68.0	1.1	29.7	— 0.7
11月末	20,940	7.5	200.60	7.3	67.9	1.3	29.7	— 0.7
12月末	21,216	8.9	203.26	8.8	68.1	1.0	29.8	— 0.7
2020年1月末	21,043	8.0	201.67	7.9	67.6	1.2	30.1	— 0.7
2月末	19,724	1.2	189.12	1.2	65.0	1.6	32.4	— 0.7
3月末	18,453	△5.3	175.53	△6.1	67.3	1.6	29.8	— 0.6
4月末	19,221	△1.3	182.46	△2.4	68.3	1.4	29.3	— 0.7
(期末) 2020年5月11日	19,276	△1.1	183.03	△2.1	68.4	1.4	29.2	— 0.6

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

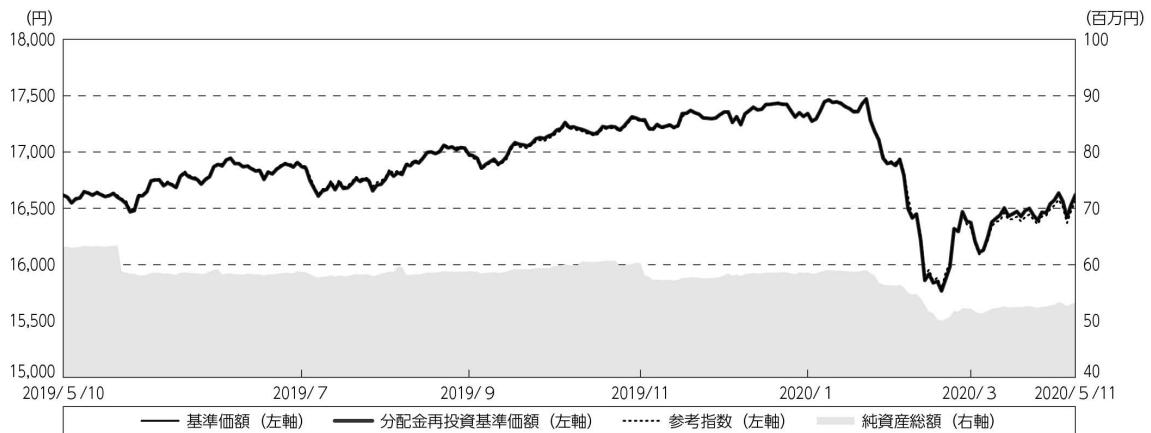
\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 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。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ◎運用経過

## ○期中の基準価額等の推移



期 首 : 16,617円

期 末 : 16,615円（既払分配金（税込み）: 5円）

騰落率 : 0.0%（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（2019年5月10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）参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。参考指数は、作成期首（2019年5月10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4本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国債券（+4.5%）が上昇し、外国株式（-3.3%）、国内株式（-1.9%）、国内債券（-0.0%）は下落しました。

外国債券の上昇が主な値上がり要因となりました。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（基本投資比率に基づいて各マザーファンドのベンチマークより合成）の騰落率が-0.3%となったのに対し、基準価額の騰落率は+0.0%となりました。

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権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。

また、外国資産のマザーファンドとそのベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額と参考指数の騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

## ◎分配金

- 収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
- 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。

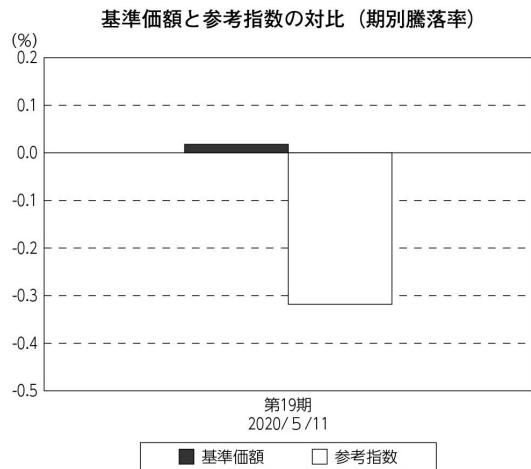
## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第19期	
	2019年5月11日～	2020年5月11日
当期分配金 (対基準価額比率)	5	0.030%
当期の収益	5	—
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	8,345	—

(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。



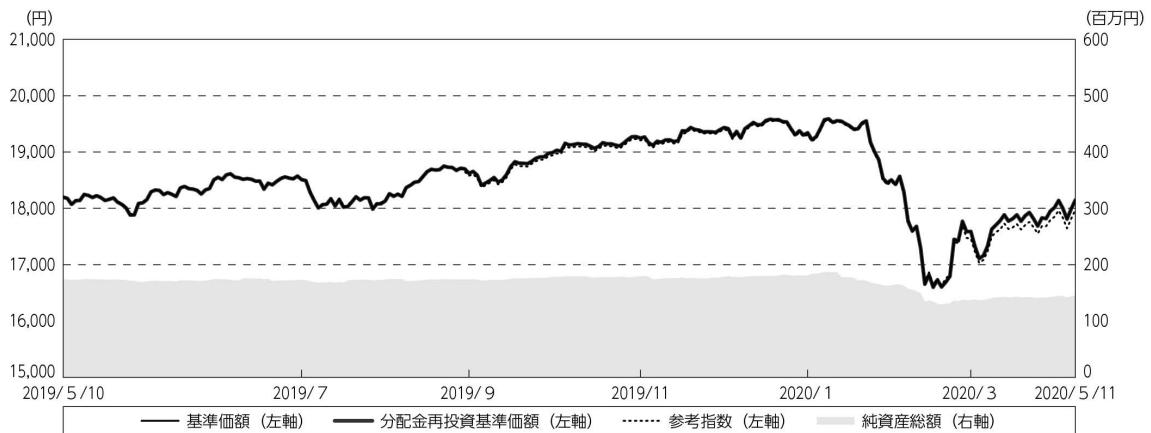
(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ◎運用経過

## ○期中の基準価額等の推移



期 首 : 18,198円

期 末 : 18,143円（既払分配金（税込み）: 5円）

騰落率 : △0.3%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2019年5月10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）参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。参考指数は、作成期首（2019年5月10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4本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国株式（-3.3%）、国内株式（-1.9%）、国内債券（-0.0%）が下落し、外国債券（+4.5%）は上昇しました。

国内株式の下落が主な値下がり要因となりました。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（基本投資比率に基づいて各マザーファンドのベンチマークより合成）の騰落率が-1.2%となったのに対し、基準価額の騰落率は-0.3%となりました。

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権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。

また、外国資産のマザーファンドとそのベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額と参考指数の騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

## ◎分配金

- 収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
- 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。

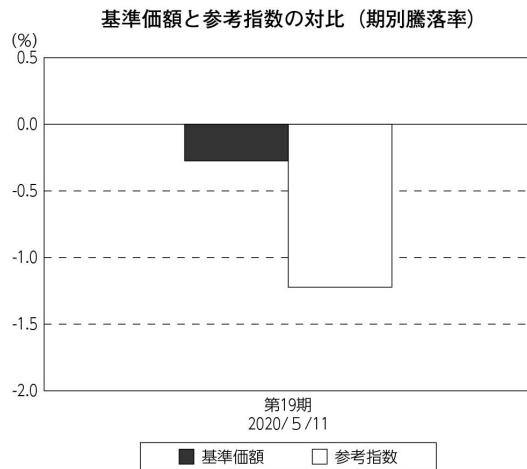
## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第19期	
	2019年5月11日～	2020年5月11日
当期分配金 (対基準価額比率)	5	0.028%
当期の収益	5	—
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	10,759	—

(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。



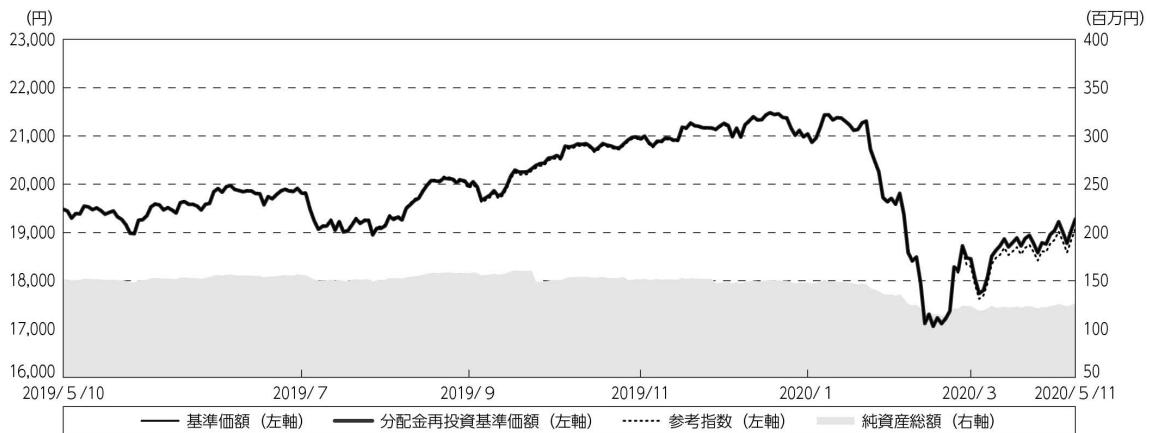
(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ◎運用経過

## ○期中の基準価額等の推移



期 首 : 19,481円

期 末 : 19,271円（既払分配金（税込み）: 5円）

騰落率 : △1.1%（分配金再投資ベース）

## ○基準価額の主な変動要因

投資対象とする4本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国株式（-3.3%）、国内株式（-1.9%）、国内債券（-0.0%）が下落し、外国債券（+4.5%）は上昇しました。

国内株式の下落が主な値下がり要因となりました。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（基本投資比率に基づいて各マザーファンドのベンチマークより合成）の騰落率が-2.1%となったのに対し、基準価額の騰落率は-1.1%となりました。

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権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。

また、外国資産のマザーファンドとそのベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額と参考指数の騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

## ◎分配金

- 収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
- 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。

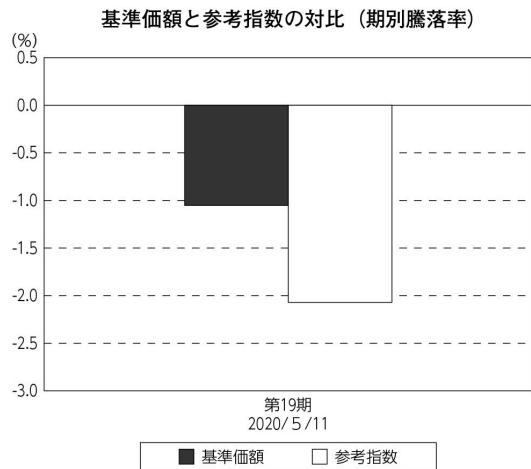
## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第19期	
	2019年5月11日～	2020年5月11日
当期分配金 (対基準価額比率)	5	0.026%
当期の収益	5	—
当期の収益以外	—	—
翌期繰越分配対象額	12,541	—

(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。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。

## &lt;バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○投資環境

資産	変動要因等
国内債券	世界的な新型肺炎の感染拡大による景気減速懸念から現金需要が急増したことや、日本政府による経済対策で国債発行が増加するとの見方が広がったことなどを背景に、国内債券利回りは上昇（価格は下落）しました。
外国債券	新型肺炎の感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から、主要国の中銀が政策金利の引き下げや金融緩和姿勢の強化を打ち出したことなどを背景に、外国債券利回りは米国を中心に低下（価格は上昇）しました。 為替レートは、新型肺炎の感染拡大による世界景気の減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや内外長期金利差縮小などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。
国内株式	新型肺炎の感染拡大に伴う非常事態宣言などを受け経済活動の停滞懸念が高まったこと、円高に伴う国内輸出関連企業の業績悪化懸念などを背景に、下落しました。
外国株式	新型肺炎の感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から3月にかけて下落しましたが、欧米で新型肺炎の感染拡大ペースに鈍化の兆しがみられ段階的な経済活動の再開が示唆されたことなどから、4月以降は回復基調となりました。当運用期間では、欧州株式市場は下落しましたが米国株式市場が上昇し、外国株式全体では上昇となりました。 為替レートは、新型肺炎の感染拡大による世界景気の減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや内外長期金利差縮小などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

各マザーファンドの日々の基準価額の動きの違いなどにより基本とする投資比率からの乖離が生じますが、原則として3ヶ月毎のリバランスや資金の追加解約に対応した売買などにより、当ファンドの基本とする投資比率からの乖離が小さくなるように運用を行いました。

なお、実質外貨建て資産については、為替ヘッジを行っておりません。

マザーファンドの運用経過については、11ページをご参照ください。

## &lt;バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）&gt;

## ◎今後の運用方針

引き続き、内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とし、これらに分散投資するバランス運用を行うことで、キャピタルゲインとインカムゲインを総合したトータルリターンの獲得を目指します。

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。

## ◎マザーファンドの運用経過

## [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對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。

## [国内債券マザーファンド]

NOMURA-BPI国債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、デュレーション（金利感応度）などを考慮して選択した日本国債に分散投資しました。指標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）を指標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。

## &lt;バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）&gt;

## [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。

TOPIXの指數値及び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、指數値の公表、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。

MSCI指數は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指數は、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指數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し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。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権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、ファンドの運用成果に関して一切の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。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○1万口当たりの費用明細

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 99	% 0.585	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	( 43)	(0.254)	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）	( 47)	(0.276)	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）	( 9)	(0.055)	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＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	( 0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	( 0)	(0.000)	
（投資信託証券）	( 0)	(0.000)	
（先物・オプション）	( 0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※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	0.006	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	( 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）	( 1)	(0.003)	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)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	100	0.593	
期中の平均基準価額は、16,927円です。			

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

\*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。

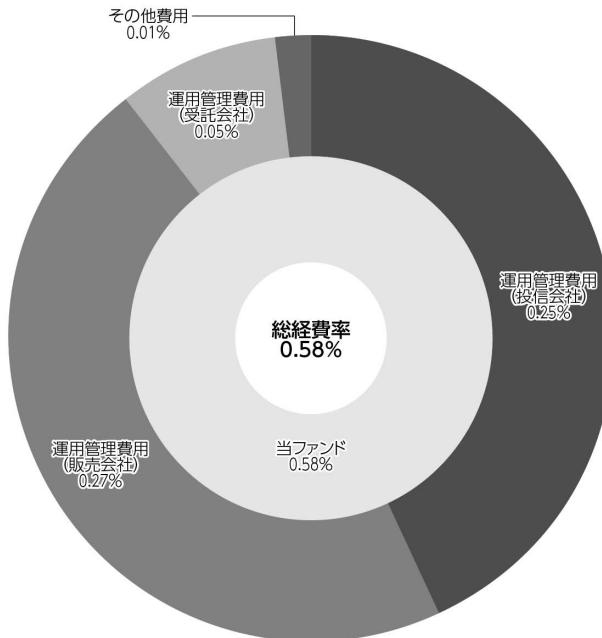
\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## （参考情報）

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.58%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。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式マザーファンド	千口 1,222	千円 1,907	千口 2,174	千円 3,511
国内債券マザーファンド	3,210	4,443	7,475	10,347
外国債券マザーファンド	269	626	1,111	2,583
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	366	946	607	1,721

\* 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2019年5月11日～2020年5月11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	
	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) 期中の株式売買金額	123,457,198千円	142,133,404千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	413,599,666千円	582,855,295千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29	0.24

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&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	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	$\frac{D}{C}$
株式	83,822	41	0.0	39,634	2	0.0
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	349,684	11,254	3.2	365,752	10,317	2.8

平均保有割合 0.0%

※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;

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	121,679	—	—	51,516	743	1.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;国内債券マザーファンド&gt;

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	17,046	—	—	13,688	30	0.2
債券先物取引	4,158	4,158	100.0	4,143	4,143	100.0

平均保有割合 0.1%

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$
		百万円	60				
為替直物取引	85,089	百万円	60	0.1	153,760	百万円	0.4

平均保有割合 0.0%

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 283	百万円 94	百万円 1,457

## 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

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種類	買付額
株式	百万円 7

## 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)	0.411千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.051千円
(B) / (A)	12.6%

\* 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。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○組入資産の明細

(2020年5月11日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式マザーファンド	千口 8,096	千口 7,144	千円 10,824
国内債券マザーファンド	25,423	21,158	29,021
外国債券マザーファンド	4,199	3,357	7,931
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,307	2,066	5,443

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式マザーファンド	千円 10,824	% 20.3
国内債券マザーファンド	29,021	54.3
外国債券マザーファンド	7,931	14.8
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5,443	10.2
コール・ローン等、その他	233	0.4
投資信託財産総額	53,452	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、当期末における外貨建て純資産（564,686,472千円）の投資信託財産総額（727,813,468千円）に対する比率は77.6%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（612,086,876千円）の投資信託財産総額（616,384,282千円）に対する比率は99.3%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=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スイスフラン=110.20円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1ズロチ=25.50円、1香港ドル=13.80円、1シンガポールドル=75.67円、1リングギ=24.68円、1豪ドル=69.88円、1ニュージーランドドル=65.61円、1新シェケル=30.44円、1メキシコペソ=4.53円、1ランド=5.83円。

## &lt;バランスセレクト30（確定拠出年金向け）&gt;

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月11日現在）

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	53,452,474
207,905	
国内株式マザーファンド(評価額)	10,824,364
国内債券マザーファンド(評価額)	29,021,674
外国債券マザーファンド(評価額)	7,931,472
外 国 株 式 M S C I - K O K U S A I マザーファンド（評価額）	5,443,461
未収入金	23,598
(B) 負債	180,789
未払収益分配金	16,031
未払解約金	605
未払信託報酬	163,280
その他未払費用	873
(C) 純資産総額(A-B)	53,271,685
元本	32,062,212
次期繰越損益金	21,209,473
(D) 受益権総口数	32,062,212口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,615円

(注) 期首元本額は38,046,437円、期中追加設定元本額は3,602,449円、期中一部解約元本額は9,586,674円、1口当たり純資産額は1.6615円です。

## ○損益の状況（2019年5月11日～2020年5月11日）

項目	当期
(A) 配当等収益	△ 1
支払利息	△ 1
(B) 有価証券売買損益	237,708
売買益	865,085
売買損	△ 627,377
(C) 信託報酬等	△ 336,839
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 99,132
(E) 前期繰越損益金	7,912,429
(F) 追加信託差損益金	13,412,207
(配当等相当額)	( 17,434,025)
(売買損益相当額)	(△ 4,021,818)
(G) 計(D+E+F)	21,225,504
(H) 収益分配金	△ 16,031
次期繰越損益金(G+H)	21,209,473
追加信託差損益金	13,412,207
(配当等相当額)	( 17,443,046)
(売買損益相当額)	(△ 4,030,839)
分配準備積立金	9,314,456
繰越損益金	△ 1,517,190

\*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(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、追加設定をした価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（2019年5月11日～2020年5月11日）は以下の通りです。

項目	当期
	2019年5月11日～ 2020年5月11日
a. 配当等収益(経費控除後)	502,480円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	17,443,046円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	8,828,007円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	26,773,533円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	8,350円
g. 分配金	16,031円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

## ＜バランスセレクト30（確定拠出年金向け）＞

### ○分配金のお知らせ

---

1万口当たり分配金（税込み）	5円
----------------	----

### ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○1万口当たりの費用明細

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 123	% 0.662	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	( 53)	(0.287)	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）	( 59)	(0.320)	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）	( 10)	(0.055)	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＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	( 0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	( 0)	(0.000)	
（投資信託証券）	( 0)	(0.000)	
（先物・オプション）	( 0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	( 0)	(0.002)	
（投資信託証券）	( 0)	(0.000)	
(d) その他の費用	1	0.007	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	( 1)	(0.003)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	( 1)	(0.003)	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)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	124	0.672	
期中の平均基準価額は、18,587円です。			

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

\*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。

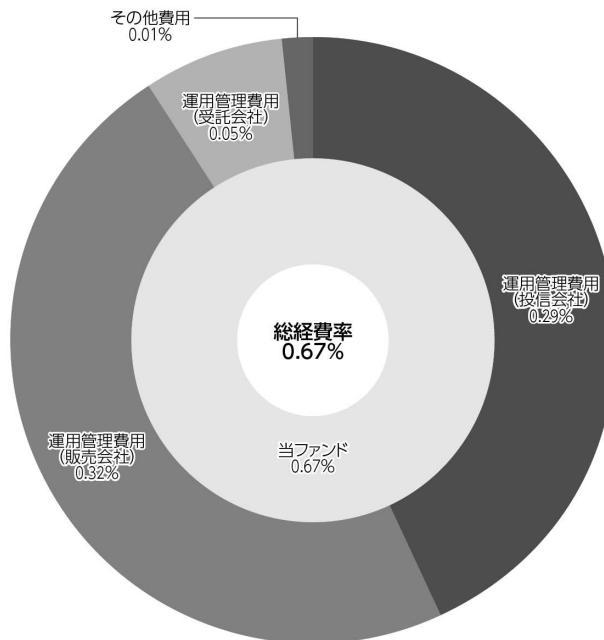
\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## （参考情報）

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.67%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。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	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 7,531	千円 12,149	千口 11,989	千円 19,285
国内債券マザーファンド	13,913	19,229	23,247	32,229
外国債券マザーファンド	1,181	2,774	2,856	6,711
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,517	6,707	4,063	11,924

\* 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2019年5月11日～2020年5月11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	
	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) 期中の株式売買金額	123,457,198千円	142,133,404千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	413,599,666千円	582,855,295千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29	0.24

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&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	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	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 83,822	百万円 41	0.0	百万円 39,634	百万円 2	0.0
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	349,684	11,254	3.2	365,752	10,317	2.8

平均保有割合 0.0%

※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;

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 121,679	—	—	百万円 51,516	百万円 743	1.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;国内債券マザーファンド&gt;

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	百万円 17,046	—	—	百万円 13,688	百万円 30	0.2
債券先物取引	4,158	4,158	100.0	4,143	4,143	100.0

平均保有割合 0.2%

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

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	%		
為替直物取引	百万円 85,089	百万円 60		0.1	百万円 153,760	百万円 598

平均保有割合 0.0%

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 283	百万円 94	百万円 1,457

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

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種類	買付額
株式	百万円 7

## 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)	1千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.106千円
(B) / (A)	5.7%

\* 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。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○組入資産の明細

(2020年5月11日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式マザーファンド	千口 33,503	千口 29,044	千円 44,002
国内債券マザーファンド	51,004	41,670	57,155
外国債券マザーファンド	7,723	6,048	14,289
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	12,729	11,183	29,465

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式マザーファンド	千円 44,002	% 30.2
国内債券マザーファンド	57,155	39.2
外国債券マザーファンド	14,289	9.8
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	29,465	20.2
コール・ローン等、その他	720	0.6
投資信託財産総額	145,631	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、当期末における外貨建て純資産（564,686,472千円）の投資信託財産総額（727,813,468千円）に対する比率は77.6%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（612,086,876千円）の投資信託財産総額（616,384,282千円）に対する比率は99.3%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=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スイスフラン=110.20円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1ズロチ=25.50円、1香港ドル=13.80円、1シンガポールドル=75.67円、1リングギ=24.68円、1豪ドル=69.88円、1ニュージーランドドル=65.61円、1新シェケル=30.44円、1メキシコペソ=4.53円、1ランド=5.83円。

## &lt;バランスセレクト50（確定拠出年金向け）&gt;

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月11日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	145,631,704
コール・ローン等	656,595
国内株式マザーファンド（評価額）	44,002,952
国内債券マザーファンド（評価額）	57,155,625
外国債券マザーファンド（評価額）	14,289,534
外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド（評価額）	29,465,428
未収入金	61,570
(B) 負債	582,154
未払収益分配金	39,974
未払信託報酬	539,542
その他未払費用	2,638
(C) 純資産総額(A-B)	145,049,550
元本	79,948,647
次期繰越損益金	65,100,903
(D) 受益権総口数	79,948,647口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,143円

（注）期首元本額は95,628,794円、期中追加設定元本額は20,713,990円、期中一部解約元本額は36,394,137円、1口当たり純資産額は1.8143円です。

## ○損益の状況（2019年5月11日～2020年5月11日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 51
支払利息	△ 51
(B) 有価証券売買損益	105,807
売買益	4,335,469
売買損	△ 4,229,662
(C) 信託報酬等	△ 1,115,246
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,009,490
(E) 前期繰越損益金	25,183,163
(F) 追加信託差損益金	40,967,204
(配当等相当額)	( 55,865,617)
(売買損益相当額)	(△14,898,413)
(G) 計(D+E+F)	65,140,877
(H) 収益分配金	△ 39,974
次期繰越損益金(G+H)	65,100,903
追加信託差損益金	40,967,204
(配当等相当額)	( 55,926,079)
(売買損益相当額)	(△14,958,875)
分配準備積立金	30,098,243
繰越損益金	△ 5,964,544

\*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(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、追加設定をした価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（2019年5月11日～2020年5月11日）は以下の通りです。

項目	当期
	2019年5月11日～ 2020年5月11日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,470,308円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	55,926,079円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	28,667,909円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	86,064,296円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	10,764円
g. 分配金	39,974円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

## ＜バランスセレクト50（確定拠出年金向け）＞

### ○分配金のお知らせ

---

1万口当たり分配金（税込み）	5円
----------------	----

### ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○1万口当たりの費用明細

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 147	% 0.739	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	( 64)	(0.320)	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）	( 73)	(0.364)	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）	( 11)	(0.055)	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＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	( 0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	( 0)	(0.000)	
（投資信託証券）	( 0)	(0.000)	
（先物・オプション）	( 0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	( 0)	(0.002)	
（投資信託証券）	( 0)	(0.000)	
(d) その他の費用	1	0.007	(d)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	( 1)	(0.003)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	( 1)	(0.003)	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)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	148	0.749	
期中の平均基準価額は、19,921円です。			

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

\*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。

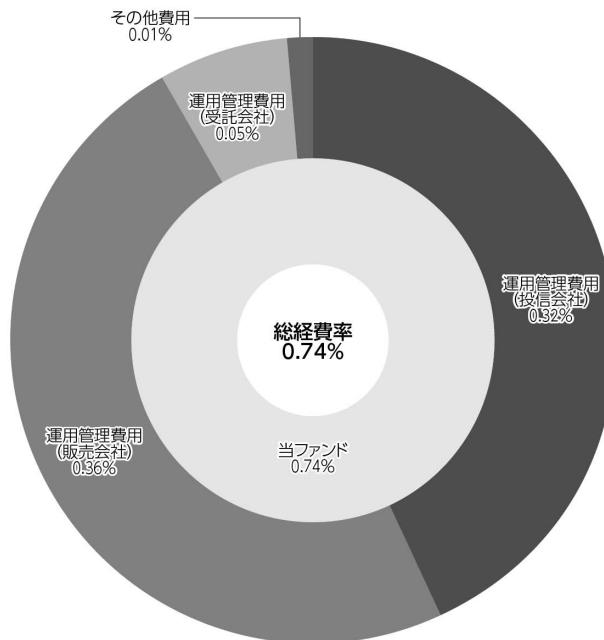
\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## （参考情報）

## ○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.74%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。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○売買及び取引の状況

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式マザーファンド	千口	千円	千口	千円
国内債券マザーファンド	3,786	6,126	9,912	16,379
外国債券マザーファンド	2,768	3,835	6,905	9,558
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	625	1,468	2,114	4,997
	1,996	4,941	3,776	11,006

\* 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2019年5月11日～2020年5月11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	
	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) 期中の株式売買金額	123,457,198千円	142,133,404千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	413,599,666千円	582,855,295千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29	0.24

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○利害関係人との取引状況等

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&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	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	$\frac{D}{C}$
株式	83,822	41	0.0	39,634	2	0.0
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	349,684	11,254	3.2	365,752	10,317	2.8

平均保有割合 0.0%

※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;

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	121,679	—	—	51,516	743	1.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;国内債券マザーファンド&gt;

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	17,046	—	—	13,688	30	0.2
債券先物取引	4,158	4,158	100.0	4,143	4,143	100.0

平均保有割合 0.1%

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

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	$\frac{D}{C}$
		百万円	60				
為替直物取引	85,089	百万円	60	0.1	153,760	百万円	0.4

平均保有割合 0.0%

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 283	百万円 94	百万円 1,457

## 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

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種類	買付額
株式	百万円 7

## 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)	2千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.048千円
(B) / (A)	2.2%

\* 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。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○組入資産の明細

(2020年5月11日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内株式マザーファンド	千口 43,888	千口 37,763	千円 57,211
国内債券マザーファンド	22,271	18,135	24,874
外国債券マザーファンド	6,745	5,256	12,418
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	13,896	12,116	31,923

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式マザーファンド	千円 57,211	% 45.0
国内債券マザーファンド	24,874	19.6
外国債券マザーファンド	12,418	9.8
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	31,923	25.1
コール・ローン等、その他	663	0.5
投資信託財産総額	127,089	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、当期末における外貨建て純資産（564,686,472千円）の投資信託財産総額（727,813,468千円）に対する比率は77.6%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（612,086,876千円）の投資信託財産総額（616,384,282千円）に対する比率は99.3%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=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スイスフラン=110.20円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1ズロチ=25.50円、1香港ドル=13.80円、1シンガポールドル=75.67円、1リングギ=24.68円、1豪ドル=69.88円、1ニュージーランドドル=65.61円、1新シェケル=30.44円、1メキシコペソ=4.53円、1ランド=5.83円。

## &lt;バランスセレクト70（確定拠出年金向け）&gt;

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2020年5月11日現在）

項目	当期末
	円
(A) 資産	
コール・ローン等	127,089,801
国内株式マザーファンド(評価額)	613,615
国内債券マザーファンド(評価額)	57,211,397
国外債券マザーファンド(評価額)	24,874,285
外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド(評価額)	12,418,100
未収入金	31,923,719
未収入金	48,685
(B) 負債	545,440
未払収益分配金	32,833
未払信託報酬	510,379
その他未払費用	2,228
(C) 純資産総額(A-B)	126,544,361
元本	65,666,205
次期繰越損益金	60,878,156
(D) 受益権総口数	65,666,205口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,271円

(注) 期首元本額は77,810,073円、期中追加設定元本額は7,204,933円、期中一部解約元本額は19,348,801円、1口当たり純資産額は1,9271円です。

## ○損益の状況（2019年5月11日～2020年5月11日）

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 38
支払利息	△ 38
(B) 有価証券売買損益	△ 616,950
売買益	3,183,790
売買損	△ 3,800,740
(C) 信託報酬等	△ 1,079,959
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 1,696,947
(E) 前期繰越損益金	17,032,038
(F) 追加信託差損益金	45,575,898
(配当等相当額)	( 57,371,086)
(売買損益相当額)	(△11,795,188)
(G) 計(D+E+F)	60,910,989
(H) 収益分配金	△ 32,833
次期繰越損益金(G+H)	60,878,156
追加信託差損益金	45,575,898
(配当等相当額)	( 57,398,645)
(売買損益相当額)	(△11,822,747)
分配準備積立金	24,954,920
繰越損益金	△ 9,652,662

\*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(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、追加設定をした価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（2019年5月11日～2020年5月11日）は以下の通りです。

項目	当期
	2019年5月11日～ 2020年5月11日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,648,971円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	57,398,645円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	23,338,782円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	82,386,398円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	12,546円
g. 分配金	32,833円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

## ＜バランスセレクト70（確定拠出年金向け）＞

### ○分配金のお知らせ

---

1万口当たり分配金（税込み）	5円
----------------	----

### ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

下記は、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド全体（232,138,550千口）の内容です。

## 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		
			千米ドル	千円		
(アメリカ)	百株	百株				
AFLAC INC	1,024	1,183	4,289	458,768	保険	
AES CORP	910	1,010	1,299	139,021	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AT & T INC	9,867	11,554	34,419	3,681,151	各種電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	2,379	2,796	26,198	2,801,931	ヘルスケア機器・用品	
ABBVIE INC	2,036	2,336	19,613	2,097,616	バイオテクノロジー	
ABIOMED INC	58	72	1,346	144,051	ヘルスケア機器・用品	
ACTIVISION BLIZZARD INC	974	1,209	8,842	945,718	娯楽	
ACUITY BRANDS INC	50	62	533	57,012	電気設備	
ADOBE INC	665	765	28,125	3,008,026	ソフトウェア	
ADVANCE AUTO PARTS	99	109	1,360	145,544	専門小売り	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,260	1,666	8,861	947,732	半導体・半導体製造装置	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	75	—	—	—	資本市場	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	426	490	3,905	417,724	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AIR PRODUCTS	296	353	8,241	881,465	化学	
AKAMAI TECHNOLOGIES	225	258	2,609	279,104	情報技術サービス	
ALBEMARLE CORP	148	167	1,072	114,754	化学	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	307	358	3,484	372,696	バイオテクノロジー	
ALIGN TECHNOLOGY INC	102	118	2,478	265,059	ヘルスケア機器・用品	
ALLEGHANY CORP	21	23	1,220	130,495	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	66	66	311	33,302	情報技術サービス	
ALLIANT ENERGY CORP	310	376	1,804	192,983	電力	
ALLSTATE CORP	466	521	5,251	561,611	保険	
ALLY FINANCIAL INC	574	574	905	96,872	消費者金融	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	127	175	2,382	254,784	バイオテクノロジー	
ALPHABET INC-CL C	426	489	67,946	7,266,913	インターネット・メディアおよびサービス	
ALPHABET INC-CL A	405	474	65,645	7,020,775	インターネット・メディアおよびサービス	
ALTICE USA INC-A	470	200	468	50,052	メディア	
ALTRIA GROUP INC	2,561	2,945	10,819	1,157,191	タバコ	
AMAZON.COM INC	564	667	158,815	16,985,282	インターネット販売・通信販売	
AMERCO	11	11	352	37,700	陸運・鉄道	
AMEREN CORPORATION	328	391	2,770	296,318	総合公益事業	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	146	146	148	15,833	旅客航空輸送業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	664	792	6,324	676,449	電力	
AMERICAN EXPRESS CO	982	1,104	9,880	1,056,751	消費者金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	108	125	821	87,886	保険	
AMERICAN INTL GROUP	1,198	1,378	3,810	407,497	保険	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	247	283	3,340	357,239	水道	
AMERISOURCEBERGEN CORP	220	239	2,105	225,167	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	192	203	2,549	272,709	資本市場	
AMETEK INC	318	355	2,993	320,139	電気設備	
AMGEN INC	862	939	22,049	2,358,204	バイオテクノロジー	
AMPHENOL CORP-CL A	413	464	4,155	444,439	電子装置・機器・部品	
ANADARKO PETE	678	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ANALOG DEVICES INC	498	581	6,381	682,461	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	115	134	3,524	376,941	ソフトウェア	
ANTHEM INC	349	403	11,055	1,182,385	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
APACHE CORPORATION	541	541	673	72,035	石油・ガス・消耗燃料	
APPLE INC	6,442	7,037	218,238	23,340,605	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	1,323	1,469	7,904	845,406	半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	354	410	1,069	114,359	ホテル・レストラン・レジャー	
ARCHER DANIELS MIDLAND	755	884	3,216	344,044	食品	
ARCONIC INC	570	—	—	—	航空宇宙・防衛	
ARISTA NETWORKS INC	74	87	1,896	202,850	通信機器	
ARROW ELECTRS INC	121	121	792	84,711	電子装置・機器・部品	
ASSURANT INC	76	90	889	95,099	保険	
ATMOS ENERGY CORP	156	184	1,790	191,533	ガス	
AUTODESK INC.	300	350	6,450	689,843	ソフトウェア	
AUTOLIV INC	119	119	727	77,813	自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESS	595	692	10,103	1,080,537	情報技術サービス	
AUTOZONE	34	38	4,041	432,203	専門小売り	
AVERY DENNISON CORP	122	134	1,464	156,583	容器・包装	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	310	—	—	—	各種金融サービス	
BB&T CORPORATION	1,049	—	—	—	銀行	
BAKER HUGHES CO	681	1,010	1,516	162,137	エネルギー・設備・サービス	
BALL CORP	429	498	3,215	343,853	容器・包装	
BANK OF AMERICA CORP	12,645	13,510	31,843	3,405,616	銀行	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,332	1,325	4,682	500,798	資本市場	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	696	772	6,799	727,236	ヘルスケア機器・用品	
BECTON, DICKINSON	362	429	10,917	1,167,593	ヘルスケア機器・用品	
BEIGENE, LTD ADR	46	63	987	105,656	バイオテクノロジー	
WR BERKLEY CORP	195	241	1,246	133,333	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,756	2,079	36,762	3,931,798	各種金融サービス	
BEST BUY COMPANY INC	338	386	3,035	324,605	専門小売り	
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	36	1,661	177,656	バイオサイエンス・ツール/サービス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	241	280	2,665	285,085	バイオテクノロジー	
BIOGEN INC	275	288	9,065	969,582	バイオテクノロジー	
BLACK KNIGHT INC	—	242	1,759	188,161	情報技術サービス	
BLACKROCK INC	161	182	9,092	972,470	資本市場	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	1,040	5,498	588,062	資本市場	
H & R BLOCK INC	279	—	—	—	各種消費者サービス	
BOEING CO	731	847	11,302	1,208,788	航空宇宙・防衛	
BOOKING HOLDINGS INC	63	66	9,515	1,017,631	インターネット販売・通信販売	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	226	1,649	176,397	情報技術サービス	
BORGWARNER INC	296	350	1,028	110,014	自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,891	2,233	8,525	911,812	ヘルスケア機器・用品	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	139	—	—	—	保険	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,222	3,705	22,619	2,419,104	医薬品	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	163	179	2,090	223,621	情報技術サービス	
BROADCOM INC	559	626	17,216	1,841,345	半導体・半導体製造装置	
BROWN & BROWN INC	—	388	1,458	156,027	保険	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	356	500	3,298	352,774	飲料	
BURLINGTON STORES INC	89	105	1,880	201,091	専門小売り	
CBS CORP-CL B	470	—	—	—	メディア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	150	179	1,793	191,785	資本市場	
CBRE GROUP INC	455	514	2,138	228,684	不動産管理・開発	
CDK GLOBAL INC	167	200	815	87,228	ソフトウェア	
CDW CORPORATION	211	224	2,431	260,027	電子装置・機器・部品	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	314	353	1,024	109,597	化学	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	183	221	1,630	174,433	航空貨物・物流サービス	
CIGNA CORP	519	592	11,204	1,198,351	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CIT GROUP INC	134	—	—	—	銀行	
CME GROUP INC	488	565	10,256	1,096,926	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		
CMS ENERGY CORP	378	456	2,521	269,644	総合公益事業	
CSX CORP	1,090	1,184	7,827	837,142	陸運・鉄道	
CVS HEALTH CORP	1,747	2,062	13,015	1,391,991	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CABOT OIL & GAS CORP	585	640	1,312	140,386	石油・ガス・消耗燃料	
CADENCE DESIGN SYS INC	378	446	3,677	393,331	ソフトウェア	
CAMPBELL SOUP CO	248	274	1,404	150,213	食品	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	638	751	4,671	499,586	消費者金融	
CARDINAL HEALTH INC	410	472	2,354	251,796	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CARMAX INC	239	261	2,001	214,072	専門小売	
CARNIVAL CORP	586	790	1,122	120,061	ホテル・レストラン・レジャー	
CARRIER GLOBAL CORP	—	1,300	2,386	255,268	建設関連製品	
CATERPILLAR INC DEL	798	871	9,764	1,044,343	機械	
CELANESE CORP-SERIES A	180	196	1,621	173,399	化学	
CELGENE CORP	944	—	—	—	バイオテクノロジー	
CENTENE CORP	558	921	6,067	648,924	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	704	754	1,401	149,910	総合公益事業	
CENTURYLINK INC	1,360	1,610	1,600	171,156	各種電気通信サービス	
CERNER CORP	406	499	3,430	366,905	ヘルスケア・テクノロジー	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	217	237	12,217	1,306,639	メディア	
CHEMOURS CO/THE	234	—	—	—	化学	
CHENIERE ENERGY INC	286	364	1,619	173,237	石油・ガス・消耗燃料	
CHEVRON CORP	2,591	2,989	28,535	3,051,923	石油・ガス・消耗燃料	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	33	41	3,814	407,952	ホテル・レストラン・レジャー	
CHURCH & DWIGHT CO INC	329	395	2,897	309,868	家庭用品	
CIMAREX ENERGY CO	138	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	216	246	1,370	146,623	保険	
CISCO SYSTEMS	6,096	6,708	28,837	3,084,191	通信機器	
CINTAS CORP	127	142	3,098	331,393	商業サービス・用品	
CITIGROUP	3,309	3,458	16,017	1,713,066	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	639	700	1,554	166,200	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	185	209	3,155	337,478	ソフトウェア	
CLOROX CO	177	201	4,101	438,645	家庭用品	
COCA COLA CO	5,481	6,436	29,676	3,173,890	飲料	
COGNEX CORP	248	278	1,599	171,019	電子装置・機器・部品	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	778	866	4,950	529,408	情報技術サービス	
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,127	1,293	8,969	959,292	家庭用品	
COMCAST CORP-CL A	6,154	7,177	26,221	2,804,354	メディア	
COMERICA INC	230	230	779	83,364	銀行	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	228	—	—	—	通信機器	
CONAGRA BRANDS INC	667	769	2,577	275,683	食品	
CONCHO RESOURCES INC	276	310	1,817	194,417	石油・ガス・消耗燃料	
CONOCOPHILLIPS	1,555	1,763	7,595	812,285	石油・ガス・消耗燃料	
CONSOLIDATED EDISON INC	423	525	3,894	416,511	総合公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	228	268	4,450	475,971	飲料	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	139	139	209	22,432	石油・ガス・消耗燃料	
THE COOPER COMPANIES, INC.	65	80	2,457	262,827	ヘルスケア機器・用品	
COPART INC	279	337	2,823	301,997	商業サービス・用品	
CORNING INC	1,080	1,190	2,572	275,158	電子装置・機器・部品	
CORTEVA INC	—	1,200	3,117	333,427	化学	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	597	698	21,357	2,284,202	食品・生活必需品小売	
COSTAR GROUP INC	48	58	3,819	408,507	専門サービス	
COTY INC-CL A	370	490	254	27,250	パーソナル用品	
CROWN HOLDINGS INC	191	212	1,337	143,001	容器・包装	
CUMMINS INC	205	235	3,790	405,374	機械	

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	
DR HORTON INC	480	538	2,667	285,336	家庭用耐久財	
DTE ENERGY COMPANY	251	305	3,088	330,307	総合公益事業	
DXC TECHNOLOGY CO	378	378	667	71,353	情報技術サービス	
DANAHER CORP	860	992	16,013	1,712,681	ヘルスケア機器・用品	
DARDEN RESTAURANTS INC	166	198	1,479	158,227	ホテル・レストラン・レジャー	
DAVITA INC	175	148	1,195	127,831	ヘルスケア・プロバイダ・ヘルスケア・サービス	
DEERE & COMPANY	412	471	6,452	690,116	機械	
DELL TECHNOLOGIES-C	207	266	1,161	124,178	コンピュータ・周辺機器	
DELTA AIR LINES INC	224	252	572	61,233	旅客航空輸送業	
DENTSPLY SIRONA INC	303	352	1,430	153,032	ヘルスケア機器・用品	
DEVON ENERGY CORP	624	624	792	84,755	石油・ガス・消耗燃料	
DEXCOM INC	116	144	5,871	627,971	ヘルスケア機器・用品	
DIAMONDBACK ENERGY INC	216	231	972	103,960	石油・ガス・消耗燃料	
DISNEY (WALT) CO	2,438	2,850	31,110	3,327,278	娯楽	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	463	496	2,118	226,617	消費者金融	
DISCOVERY INC - A	193	245	516	55,248	メディア	
DISCOVERY INC - C	398	570	1,102	117,960	メディア	
DISH NETWORK CORP-A	319	430	1,106	118,328	メディア	
DOCUSIGN INC	—	166	1,934	206,937	ソフトウェア	
DOLLAR GENERAL CORP	361	409	7,213	771,443	複合小売り	
DOLLAR TREE INC	324	376	2,934	313,864	複合小売り	
DOMINION ENERGY INC	1,024	1,306	10,239	1,095,065	総合公益事業	
DOMINOS PIZZA INC	52	62	2,318	247,911	ホテル・レストラン・レジャー	
DOVER CORP	197	229	2,112	225,885	機械	
DOW INC	1,047	1,196	4,105	439,122	化学	
DOWDUPONT INC	3,101	—	—	—	化学	
DROPBOX INC-CLASS A	—	390	853	91,262	ソフトウェア	
DUKE ENERGY CORP	973	1,163	9,511	1,017,202	電力	
DUPONT DE NEMOURS INC	—	1,194	5,603	599,288	化学	
EOG RESOURCES INC	782	939	4,831	516,692	石油・ガス・消耗燃料	
E*TRADE FINANCIAL CORP	350	350	1,442	154,259	資本市場	
EAST WEST BANCORP INC	207	207	726	77,684	銀行	
EASTMAN CHEMICAL CO.	186	208	1,300	139,101	化学	
EATON VANCE CORP	164	164	612	65,476	資本市場	
EBAY INC	1,237	1,245	5,247	561,238	インターネット販売・通信販売	
ECOLAB INC	350	413	8,167	873,512	化学	
EDISON INTERNATIONAL	450	580	3,308	353,886	電力	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	284	332	7,232	773,493	ヘルスケア機器・用品	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	361	600	1,190	127,313	医薬品	
ELECTRONIC ARTS	408	461	5,376	574,982	娯楽	
EMERSON ELEC	861	973	5,458	583,789	電気設備	
ENTERGY CORP	254	313	2,973	318,049	電力	
EPAM SYSTEMS INC	—	84	1,875	200,608	情報技術サービス	
EQUIFAX INC	161	195	2,912	311,535	専門サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	620	1,106	118,361	各種金融サービス	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	37	624	66,768	保険	
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	349	1,406	150,421	水道	
EVERGY INC	372	359	2,064	220,771	電力	
EVERSOURCE ENERGY	423	521	4,052	433,453	電力	
EXACT SCIENCES CORP	—	226	1,853	198,223	バイオテクノロジー	
EXELON CORPORATION	1,322	1,548	5,794	619,685	電力	
EXPEDIA GROUP INC	173	229	1,586	169,652	インターネット販売・通信販売	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	230	273	2,042	218,483	航空貨物・物流サービス	
EXXON MOBIL CORP	5,743	6,690	30,894	3,304,158	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
FLIR SYSTEMS INC	178	207	995	106,464		電子装置・機器・部品
FMC CORP	180	211	1,972	210,951		化学
FACEBOOK INC-A	3,260	3,809	80,884	8,650,556		インターネット・メディアおよびサービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	59	1,634	174,798		資本市場
FASTENAL CO	387	921	3,596	384,646		商社・流通業
FEDEX CORPORATION	344	391	4,709	503,649		航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	81	93	1,385	148,220		通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	451	974	12,489	1,335,762		情報技術サービス
FNF GROUP	372	454	1,173	125,466		保険
FIFTH THIRD BANCORP	1,063	1,120	2,026	216,749		銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	740	—	—	—		情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	226	271	2,815	301,167		銀行
FISERV INC	541	925	9,692	1,036,575		情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	714	866	3,515	376,031		電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	121	138	3,312	354,218		情報技術サービス
FLUOR CORP	184	—	—	—		建設・土木
FLOWSERVE CORP	172	206	551	59,000		機械
FORD MOTOR COMPANY	4,990	6,070	3,180	340,173		自動車
FORTINET INC	199	228	3,119	333,678		ソフトウェア
FORTIVE CORP	406	476	2,821	301,732		機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	194	216	1,211	129,574		建設関連製品
FOX CORP-CLASS A	480	580	1,508	161,280		メディア
FOX CORP-CLASS B	198	254	653	69,896		メディア
FRANKLIN RESOURCES INC	434	434	833	89,119		資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,870	2,250	2,072	221,627		金属・鉱業
ARTHUR J GALLAGHER & CO	249	297	2,566	274,442		保険
GAP INC	315	315	255	27,288		専門小売り
GARTNER INC	127	141	1,728	184,850		情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	345	392	5,305	567,446		航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	11,760	13,850	8,711	931,710		コングロマリット
GENERAL MILLS	805	971	5,802	620,598		食品
GENERAL MOTORS CO	1,712	2,050	4,905	524,659		自動車
GENUINE PARTS CO	196	232	1,773	189,665		販売
GILEAD SCIENCES INC	1,762	2,004	15,528	1,660,826		バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	212	473	8,279	885,480		情報技術サービス
GLOBE LIFE INC	—	157	1,220	130,551		保険
GODADDY INC - CLASS A	227	269	2,018	215,915		情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	457	502	9,306	995,338		資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	340	—	—	—		自動車部品
GRAINGER(W. W.) INC	64	74	2,135	228,356		商社・流通業
GRUBHUB INC	119	145	678	72,607		インターネット販売・通信販売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	136	1,322	141,437		ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC	375	437	4,716	504,387		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	229	268	792	84,726		商社・流通業
HP INC	2,190	2,320	3,633	388,562		コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	1,196	1,470	1,572	168,221		エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	510	510	482	51,653		繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	224	224	480	51,387		自動車
HARRIS CORP	160	—	—	—		航空宇宙・防衛
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	482	583	2,119	226,648		保険
HASBRO INC	158	214	1,491	159,524		レジャー用品
HEICO CORP	—	63	569	60,930		航空宇宙・防衛
HEICO CORP-CLASS A	—	124	895	95,750		航空宇宙・防衛
HELMERICH & PAYNE	146	—	—	—		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		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	106	125	2,284	244,367	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	190	235	3,129	334,749	食品
HESS CORP	366	432	2,094	223,989	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,000	2,020	2,070	221,439	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	377	434	3,133	335,079	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	236	236	736	78,774	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	408	433	2,251	240,762	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,531	1,725	40,439	4,324,969	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,009	1,132	15,498	1,657,533	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	391	456	2,154	230,385	食品
HOWMET AEROSPACE INC	—	570	719	76,933	航空宇宙・防衛
HUMANA INC	185	210	7,953	850,672	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	118	132	1,362	145,762	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,410	1,690	1,461	156,344	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	56	65	1,173	125,534	航空宇宙・防衛
IAC/INTERACTIVE CORP	104	126	2,959	316,503	インターネット・メディアおよびサービス
IPG PHOTONICS CORP	47	59	897	95,950	電子装置・機器・部品
IDEX CORP	103	123	1,902	203,505	機械
IDEXX LABORATORIES INC	115	136	3,915	418,756	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	405	511	8,227	879,942	機械
ILLUMINA INC	201	233	7,247	775,158	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	249	285	2,733	292,371	バイオテクノロジー
INGERSOLL-RAND INC	—	580	1,691	180,944	機械
INGREDION INC	96	112	942	100,750	食品
INSULET CORP	—	98	2,132	228,100	ヘルスケア機器・用品
INTEL CORP	6,188	6,882	41,064	4,391,890	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	767	892	8,341	892,175	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,231	1,403	17,255	1,845,475	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	115	166	2,232	238,734	化学
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	523	598	2,054	219,689	容器・包装
INTERPUBRIC GROUP	500	580	1,004	107,437	メディア
INTUIT INC	337	413	11,578	1,238,359	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	155	182	9,787	1,046,763	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	214	1,164	124,506	バイオテクノロジー
IQVIA HOLDINGS INC	214	265	3,647	390,124	ライフサイエンス・ツール/サービス
JPMORGAN CHASE & CO	4,512	4,963	46,007	4,920,449	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	179	216	1,727	184,740	建設・土木
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	420	430	606	64,843	各種金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	3,639	4,166	61,948	6,625,383	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	63	76	791	84,679	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	467	530	1,255	134,226	通信機器
KLA CORP	219	253	4,338	464,050	半導体・半導体製造装置
KKR & CO INC-A	680	784	2,090	223,540	資本市場
KANSAS CITY SOUTHERN	142	160	2,186	233,801	陸運・鉄道
KELLOGG CO	356	400	2,547	272,423	食品
KEYCORP	1,380	1,580	1,782	190,610	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	252	304	3,060	327,371	電子装置・機器・部品
KIMBERLY-CLARK CORP	469	545	7,548	807,343	家庭用品
KINDER MORGAN INC	2,730	3,260	5,004	535,188	石油・ガス・消耗燃料
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	167	208	784	83,932	陸運・鉄道
KOHL'S CORP	225	253	460	49,246	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	847	1,088	3,216	343,964	食品
KROGER CO	1,076	1,269	4,230	452,488	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	303	—	—	—	専門小売り

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LKQ CORP	450	510	1,340	143,342	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	109	—	—	—	航空宇宙・防衛
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	352	6,369	681,211	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	142	158	2,642	282,637	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	212	231	6,130	655,682	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	193	239	1,470	157,302	食品
LAS VEGAS SANDS CORP	524	538	2,740	293,104	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	299	354	6,129	655,551	パーソナル用品
LEAR CORP	84	84	851	91,068	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	189	189	563	60,236	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	200	215	2,208	236,150	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	407	430	2,322	248,383	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	51	57	1,091	116,729	建設関連製品
LIBERTY BROADBAND CORP-C	139	167	2,122	227,026	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	129	129	428	45,776	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	224	267	878	93,919	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	293	340	1,044	111,670	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,209	1,365	20,954	2,241,042	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	299	299	1,095	117,199	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	208	230	965	103,215	娯楽
LOCKHEED MARTIN	349	402	15,223	1,628,103	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	361	433	1,343	143,651	保険
LOWES COS INC	1,098	1,211	13,833	1,479,466	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	138	179	4,260	455,609	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	179	200	2,097	224,316	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	700	790	1,231	131,720	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	120	136	4,553	486,982	資本市場
MACYS INC	437	—	—	—	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	80	96	689	73,759	専門サービス
MARATHON OIL CORP	1,110	1,230	710	76,035	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	946	1,050	3,468	370,918	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	18	21	1,852	198,122	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	61	2,983	319,075	資本市場
MARSH & MCLENNAN COS	691	809	8,411	899,661	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	394	449	3,913	418,595	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	83	97	1,712	183,197	建設資材
MASCO CORP	428	463	1,951	208,668	建設関連製品
MASTERCARD INC	1,246	1,420	40,106	4,289,388	情報技術サービス
MATCH GROUP INC	—	84	671	71,861	インターネット・メディアおよびサービス
MATTEL INC	480	—	—	—	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	374	424	2,294	245,416	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	168	199	3,264	349,105	食品
MCDONALD'S CORP	1,044	1,190	21,566	2,306,523	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	270	256	3,480	372,274	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	569	60,871	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	57	71	5,625	601,594	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	3,525	4,027	30,766	3,290,453	医薬品
METLIFE INC	1,128	1,250	4,402	470,847	保険
METTLER-TOLEDO INTL	34	38	2,791	298,597	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	9,900	11,478	211,975	22,670,801	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	316	373	3,345	357,834	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,545	1,773	8,554	914,927	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	75	87	559	59,875	機械
MOHAWK INDUSTRIES	87	102	865	92,572	家庭用耐久財

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	256	314	1,221	130,601	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,985	2,283	11,620	1,242,809	食品
MONGODB INC	—	74	1,306	139,679	情報技術サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	559	638	4,196	448,843	飲料
MOODYS CORP	235	268	6,746	721,580	資本市場
MORGAN STANLEY	1,753	1,945	7,795	833,735	資本市場
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	450	450	216	23,101	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	488	560	666	71,331	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	221	268	3,518	376,253	通信機器
NRG ENERGY INC	400	405	1,327	141,942	電力
NVR INC	4	5	1,743	186,509	家庭用耐久財
NASDAQ INC	154	184	1,979	211,724	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	506	580	765	81,818	エネルギー設備・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	250	—	—	—	医薬品
NETAPP INC	352	352	1,580	169,032	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	590	693	30,183	3,228,137	娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	142	1,553	166,144	バイオテクノロジー
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,610	1,840	756	80,879	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	307	354	1,610	172,264	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	300	333	724	77,461	コングロマリット
NEWELL BRANDS INC	670	660	819	87,598	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	717	1,305	8,423	900,922	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	550	550	601	64,292	メディア
NEXTERA ENERGY INC	651	772	17,735	1,896,774	電力
NIKE INC-B	1,723	1,968	17,802	1,903,980	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	476	582	1,354	144,843	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	644	710	712	76,162	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	150	150	270	28,924	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	371	415	7,252	775,614	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	284	321	2,439	260,880	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	223	252	8,260	883,413	航空宇宙・防衛
NORTONLIFELOCK INC	—	980	2,085	223,037	ソフトウェア
NUCOR CORP	427	467	1,970	210,770	金属・鉱業
NVIDIA CORP	784	919	28,725	3,072,138	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	286	325	1,009	107,925	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	110	119	4,818	515,289	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	1,029	1,420	2,132	228,107	石油・ガス・消耗燃料
OKTA INC	—	165	2,794	298,900	情報技術サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	86	153	2,337	249,966	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	303	345	1,901	203,343	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	590	690	1,181	126,337	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	560	670	2,099	224,499	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,592	3,630	19,445	2,079,740	ソフトウェア
OTIS WORLDWIDE CORP	—	650	3,441	368,095	機械
OWENS CORNING INC	142	168	732	78,374	建設関連製品
PNC FINANCIAL	627	703	7,383	789,676	銀行
PPG INDUSTRIES	326	368	3,384	362,011	化学
PPL CORPORATION	976	1,148	2,997	320,574	電力
PVH CORP	99	116	533	57,093	繊維・アパレル・贅沢品
PTC INC	147	170	1,216	130,088	ソフトウェア
PACCAR	478	559	3,891	416,223	機械
PACKAGING CORP OF AMERICA	132	145	1,423	152,193	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	126	152	3,252	347,821	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP	181	201	3,236	346,100	機械

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	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	370	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PAYCHEX INC	433	505	3, 389	362, 459		情報技術サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	81	2, 203	235, 658		ソフトウェア
PAYPAL HOLDINGS INC	1, 526	1, 762	25, 541	2, 731, 711		情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	500	710	856	91, 577		銀行
PEPSICO INC	1, 913	2, 205	29, 597	3, 165, 475		飲料
PERKINELMER INC	—	174	1, 609	172, 098		医薬品
PFIZER INC	7, 838	8, 752	32, 574	3, 483, 890		医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2, 105	2, 457	17, 690	1, 891, 988		タバコ
PHILLIPS 66	594	703	5, 417	579, 382		石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	154	170	1, 255	134, 306		電力
PINTEREST INC- CLASS A	—	460	910	97, 360		インターネット・メディアおよびサービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	232	261	2, 348	251, 197		石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	190	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INC	83	83	605	64, 738		レジャー用品
T ROWE PRICE GROUP INC	324	366	4, 174	446, 473		資本市場
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	380	444	1, 696	181, 443		保険
PROCTER & GAMBLE CO	3, 379	3, 946	45, 753	4, 893, 376		家庭用品
PROGRESSIVE CO	785	937	6, 959	744, 275		保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	556	630	3, 715	397, 398		保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	695	810	3, 950	422, 492		総合公益事業
PULTEGROUP INC	379	430	1, 284	137, 413		家庭用耐久財
QORVO INC	176	191	1, 967	210, 402		半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1, 655	1, 810	14, 581	1, 559, 476		半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	191	220	2, 468	264, 042		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QURATE RETAIL INC - A	580	—	—	—		インターネット販売・通信販売
RPM INTERNATIONAL INC	—	211	1, 452	155, 324		化学
RALPH LAUREN CORPORATION	78	78	562	60, 129		繊維・アパレル・贅沢品
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	177	196	1, 309	140, 090		資本市場
RAYTHEON COMPANY	384	—	—	—		航空宇宙・防衛
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	—	2, 389	14, 016	1, 499, 039		航空宇宙・防衛
RED HAT INC	243	—	—	—		ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	110	127	7, 183	768, 259		バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1, 390	1, 500	1, 548	165, 558		銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	90	105	997	106, 693		保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	308	359	2, 919	312, 190		商業サービス・用品
RESMED INC	192	225	3, 661	391, 637		ヘルスケア機器・用品
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	119	3, 174	339, 468		ソフトウェア
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	171	810	86, 650		専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	168	187	3, 598	384, 893		電気設備
ROKU INC	—	142	1, 798	192, 357		娯楽
ROLLINS INC	210	239	1, 010	108, 097		商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	139	164	5, 880	628, 939		コングロマリット
ROSS STORES INC	505	577	5, 277	564, 401		専門小売り
S&P GLOBAL INC	344	385	11, 465	1, 226, 232		資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	191	191	991	106, 018		資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	306	367	2, 146	229, 616		ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	74	81	1, 505	161, 000		銀行
SABRE CORP	360	420	282	30, 208		情報技術サービス
SALESFORCE. COM INC	1, 043	1, 316	23, 148	2, 475, 725		ソフトウェア
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	123	1, 574	168, 382		バイオテクノロジー
HENRY SCHEIN INC	205	231	1, 248	133, 483		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1, 868	2, 240	4, 043	432, 420		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1, 662	1, 837	6, 706	717, 301		資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額	千円	千円	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	千円	
SEALED AIR CORP	219	265	785	84,004	84,004	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	154	187	2,948	315,334	315,334	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	371	449	5,577	596,559	596,559	総合公益事業
SERVICENOW INC	241	297	11,204	1,198,334	1,198,334	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	113	132	7,266	777,181	777,181	化学
SIGNATURE BANK	76	89	917	98,088	98,088	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,290	2,550	1,464	156,679	156,679	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	238	272	3,025	323,543	323,543	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	186	218	976	104,428	104,428	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	159	186	2,159	230,914	230,914	食品
SNAP-ON INC	74	84	1,069	114,390	114,390	機械
SNAP INC-A	—	1,170	2,132	228,114	228,114	インターネット・メディアおよびサービス
SOUTHERN CO.	1,402	1,652	9,153	978,991	978,991	電力
SOUTHWEST AIRLINES	198	198	538	57,598	57,598	旅客航空輸送業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	146	146	299	31,994	31,994	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	197	248	3,800	406,447	406,447	ソフトウェア
SPRINT CORP	1,090	—	—	—	—	無線通信サービス
SQUARE INC - A	418	557	4,235	453,038	453,038	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	202	239	2,804	299,907	299,907	機械
STARBUCKS CORP	1,678	1,872	14,577	1,559,038	1,559,038	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	522	584	3,516	376,126	376,126	資本市場
STEEL DYNAMICS	334	334	847	90,624	90,624	金属・鉱業
STRYKER CORP	455	531	10,199	1,090,830	1,090,830	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	607	—	—	—	—	銀行
SYMANTEC CORP	830	—	—	—	—	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	207	239	3,828	409,411	409,411	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	872	940	1,750	187,192	187,192	消費者金融
SYSCO CORP	678	758	4,039	432,011	432,011	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	379	412	1,561	166,956	166,956	資本市場
TJX COS INC	1,696	1,903	9,231	987,303	987,303	専門小売り
T-MOBILE US INC	472	678	6,682	714,705	714,705	無線通信サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	102	—	—	—	—	ソフトウェア
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	157	181	2,350	251,362	251,362	娯楽
TAPESTRY INC	383	450	669	71,613	71,613	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	667	805	9,324	997,235	997,235	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	299	348	480	51,361	51,361	石油・ガス・消耗燃料
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	57	1,919	205,322	205,322	航空宇宙・防衛
TELEFLEX INC	63	75	2,562	274,054	274,054	ヘルスケア機器・用品
TERADYNE INC	—	274	1,783	190,741	190,741	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	175	213	17,486	1,870,172	1,870,172	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,330	1,790	2,020	216,136	216,136	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,300	1,481	17,031	1,821,518	1,821,518	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	335	379	1,034	110,657	110,657	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	548	633	21,099	2,256,592	2,256,592	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	788	912	13,544	1,448,542	1,448,542	コングロマリット
TIFFANY & CO	144	169	2,172	232,366	232,366	専門小売り
TORCHMARK CORP	140	—	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	222	—	—	—	—	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	163	193	2,069	221,295	221,295	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	63	76	2,700	288,871	288,871	航空宇宙・防衛
TRUNION	253	290	2,294	245,363	245,363	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	356	408	3,971	424,748	424,748	保険
TRIMBLE INC	349	388	1,435	153,537	153,537	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	146	146	261	27,965	27,965	インターネット・メディアおよびサービス

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額	千円	千円	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	千円	
TRUIST FINANCIAL CORP	—	2,133	7,729	826,722	826,722	銀行
TWILIO INC - A	—	186	3,342	357,451	357,451	情報技術サービス
TWITTER INC	942	1,147	3,432	367,156	367,156	インターネット・メディアおよびサービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	61	2,014	215,440	215,440	ソフトウェア
TYSON FOODS INC-CL A	410	469	2,832	302,913	302,913	食品
UGI CORP	227	309	954	102,083	102,083	ガス
US BANCORP	2,075	2,357	8,190	875,981	875,981	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	655	2,147	229,701	229,701	陸運・鉄道
ULTA BEAUTY INC	78	92	2,116	226,375	226,375	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	240	240	239	25,616	25,616	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	250	250	223	23,903	23,903	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	1,005	1,100	17,408	1,861,849	1,861,849	陸運・鉄道
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	92	92	233	25,011	25,011	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	946	1,112	10,545	1,127,798	1,127,798	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	112	125	1,494	159,863	159,863	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	1,110	—	—	—	—	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	63	—	—	—	—	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,304	1,498	43,018	4,600,821	4,600,821	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	132	1,347	144,082	144,082	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	312	312	484	51,787	51,787	保険
V F CORP	454	550	3,202	342,523	342,523	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	54	60	1,068	114,248	114,248	ホテル・レス・トラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	580	659	4,344	464,604	464,604	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	129	142	1,685	180,268	180,268	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	167	207	3,981	425,814	425,814	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	147	170	3,570	381,884	381,884	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	5,603	6,542	37,289	3,988,101	3,988,101	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	209	251	4,005	428,356	428,356	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	350	405	11,001	1,176,558	1,176,558	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	502	—	—	—	—	娯楽
VIACOMCBS INC-CLASS B	—	880	1,591	170,161	170,161	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	2,387	2,710	50,159	5,364,546	5,364,546	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP	426	590	1,115	119,259	119,259	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A	109	130	1,824	195,080	195,080	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	217	217	974	104,181	104,181	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	175	208	2,103	224,925	224,925	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	70	81	1,084	116,040	116,040	機械
WEC ENERGY GROUP INC	435	498	4,266	456,341	456,341	総合公益事業
WABTEC CORP	179	288	1,650	176,554	176,554	機械
WALMART INC	1,968	2,249	27,649	2,957,082	2,957,082	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,101	1,209	5,037	538,803	538,803	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	352	423	3,919	419,237	419,237	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	578	668	6,744	721,355	721,355	商業サービス・用品
WATERS CORP	106	103	1,925	205,974	205,974	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A	75	106	1,993	213,186	213,186	インターネット販売・通信販売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	70	—	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WELLS FARGO CO	6,063	6,340	16,122	1,724,314	1,724,314	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	118	2,360	252,414	252,414	ヘルスケア機器・用品
WESTERN DIGITAL CORP	383	476	2,103	225,014	225,014	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	590	660	1,315	140,679	140,679	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	50	50	217	23,272	23,272	化学
WESTROCK CO	342	387	1,044	111,752	111,752	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	83	94	1,058	113,200	113,200	家庭用耐久財
WILLIAMS COS	1,625	1,910	3,718	397,722	397,722	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株	株	評価額	外貨建金額	
		数	数	邦貨換算金額	外貨建金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
WORKDAY INC-CLASS A	200	265	4,387	469,197		ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A	407	—	—	—		情報技術サービス
WYNN RESORTS LTD	138	155	1,347	144,122		ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC	180	143	978	104,609		航空貨物・物流サービス
XCEL ENERGY INC	708	836	5,041	539,232		電力
XILINX INC	349	399	3,465	370,658		半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	289	—	—	—		コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC	239	278	1,751	187,312		機械
XEROX HOLDINGS CORP	—	289	523	56,037		コンピュータ・周辺機器
YUM BRANDS INC	422	488	4,205	449,787		ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	264	—	—	—		各種電気通信サービス
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	84	2,040	218,234		電子装置・機器・部品
ZILLLOW GROUP INC - C	160	202	1,069	114,435		インターネット・メディアおよびサービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	273	332	4,045	432,693		ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORP NA	275	275	844	90,351		銀行
ZOETIS INC	660	756	9,485	1,014,477		医薬品
ALKERMES PLC	201	—	—	—		バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	136	148	1,513	161,879		建設関連製品
ALLERGAN PLC	455	521	10,056	1,075,525		医薬品
AMCOR PLC	—	2,500	2,242	239,835		容器・包装
AON PLC	—	369	7,002	748,879		保険
AON PLC	329	—	—	—		保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	560	639	1,658	177,345		保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	214	212	578	61,898		保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	292	360	705	75,502		化学
ACCENTURE PLC-CL A	870	1,003	18,912	2,022,699		情報技術サービス
BUNGE LIMITED	191	220	803	85,951		食品
CAPRI HOLDINGS LTD	199	199	298	31,945		繊維・アパレル・贅沢品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	292	351	1,382	147,905		飲料
EATON CORP PLC	582	665	5,469	584,976		電気設備
EVEREST RE GROUP LTD	56	62	1,096	117,234		保険
IHS MARKIT LTD	547	614	4,118	440,430		専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	334	—	—	—		機械
INVESCO LTD	580	580	462	49,500		資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	78	90	993	106,304		医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,271	1,246	3,713	397,113		建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	521	55,802		メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	695	640	1,368	146,410		メディア
LINDE PLC	751	851	16,033	1,714,803		化学
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	860	990	2,658	284,289		半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,818	2,118	20,974	2,243,228		ヘルスケア機器・用品
APTIV PLC	367	415	2,828	302,478		自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	472	540	764	81,720		専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	302	330	410	43,869		ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	59	67	1,074	114,915		保険
SEAGATE TECHNOLOGY	378	373	1,904	203,690		コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	232	232	814	87,091		機械
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	214	245	899	96,190		電気設備
STERIS PLC	—	138	2,045	218,803		ヘルスケア機器・用品
TECHNIPFMC PLC	610	610	483	51,669		エネルギー設備・サービス
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	376	3,173	339,359		建設関連製品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	178	202	3,986	426,352		保険
PERRIGO CO PLC	165	196	1,031	110,345		医薬品
CHUBB LTD	622	726	7,401	791,597		保険

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額	千円	千円	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
GARMIN LTD	152	205	1,667	178,335	家庭用耐久財	
TE CONNECTIVITY LTD	460	524	4,021	430,120	電子装置・機器・部品	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	172	189	2,022	216,264	ソフトウェア	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	55	599	64,151	ソフトウェア	
WIX.COM LTD	57	77	1,231	131,721	情報技術サービス	
AERCAP HOLDINGS NV	169	210	638	68,321	商社・流通業	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	437	421	2,376	254,171	化学	
MYLAN NV	693	860	1,511	161,603	医薬品	
NXP SEMICONDUCTORS NV	468	447	4,686	501,204	半導体・半導体製造装置	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	227	266	1,061	113,567	ホテル・レストラン・レジャー	
FLEX LTD	760	760	760	81,363	電子装置・機器・部品	
小計	410,916	474,742	3,960,903	423,618,661		
銘柄	株数	・	金額	597	608	—
比	率	<	率			<69.3%>
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	500	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
AGNICO EAGLE MINES LTD	331	377	3,460	265,528	金属・鉱業	
AIR CANADA	—	204	347	26,691	旅客航空輸送業	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	850	1,615	123,935	総合公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	596	1,390	5,629	432,007	食品・生活必需品小売	
ALTAGAS LTD	338	420	690	53,019	ガス	
ATCO LTD CL1	96	130	490	37,620	総合公益事業	
AURORA CANNABIS INC	970	2,000	182	13,966	医薬品	
BCE INC	198	256	1,452	111,487	各種電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	876	1,020	6,970	534,929	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,657	1,937	10,256	787,077	銀行	
BARRICK GOLD	2,366	2,830	10,790	828,085	金属・鉱業	
BAUSCH HEALTH COS INC	425	510	1,191	91,464	医薬品	
BLACKBERRY LTD	710	710	465	35,687	ソフトウェア	
BOMBARDIER B SHEARS	2,620	2,800	123	9,454	航空宇宙・防衛	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,135	2,098	9,755	748,652	資本市場	
CAE INC	360	410	903	69,313	航空宇宙・防衛	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	212	247	1,086	83,401	容器・包装	
CGI INC	338	384	3,480	267,128	情報技術サービス	
CI FINANCIAL CORP	336	336	491	37,722	資本市場	
CAMECO CORP	560	690	1,032	79,267	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	600	696	5,792	444,540	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	984	1,126	12,852	986,275	陸運・鉄道	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,631	1,870	4,271	327,762	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	191	219	6,989	536,382	陸運・鉄道	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	86	86	860	66,055	複合小売	
CANADIAN UTILITIES LTD A	157	203	655	50,302	総合公益事業	
CANOPY GROWTH CORP	275	330	704	54,041	医薬品	
CENOVUS ENERGY INC	1,400	1,560	839	64,406	石油・ガス・消耗燃料	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	27	32	4,688	359,779	ソフトウェア	
CRONOS GROUP INC	250	250	188	14,427	医薬品	
DOLLARAMA INC	418	466	2,048	157,168	複合小売	
EMERA INC	76	379	2,062	158,248	電力	
EMPIRE CO LTD A	260	260	805	61,792	食品・生活必需品小売	
ENCANA CORP	2,060	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ENBRIDGE INC	2,759	3,213	14,346	1,100,915	石油・ガス・消耗燃料	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	38	41	1,441	110,589	保険	
FINNING INTERNATIONAL INC	240	—	—	—	商社・流通業	
FIRST CAPITAL REALTY INC	250	—	—	—	不動産管理・開発	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	990	1,190	1,057	81,184	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	
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
FORTIS INC	583	712	3,791	290,952		電力
FRANCO-NEVADA CORP	254	295	5,882	451,407		金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	278	318	611	46,903		繊維・アパレル・贅沢品
GREAT-WEST LIFECHO INC	360	—	—	—		保険
GREAT-WEST LIFECHO INC	—	420	905	69,457		保険
HUSKY ENERGY INC	520	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
HUSKY ENERGY INC	—	520	212	16,321		石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	420	550	1,406	107,923		電力
IGM FINANCIAL INC	103	150	421	32,334		資本市場
IA FINANCIAL CORP INC	147	183	762	58,532		保険
IMPERIAL OIL	375	375	795	61,008		石油・ガス・消耗燃料
INTACT FINANCIAL CORP	189	227	3,133	240,465		保険
INTER PIPELINE LTD	520	600	661	50,740		石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP	285	340	706	54,244		石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,740	1,980	1,938	148,754		金属・鉱業
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	441	2,636	202,309		金属・鉱業
LOBLAW COMPANIES	261	285	1,973	151,477		食品・生活必需品小売
LUNDIN MINING CORP	950	950	602	46,220		金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC	422	451	2,491	191,218		自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,670	3,120	5,328	408,944		保険
METHANEX CORP	86	86	190	14,624		化学
METRO INC	334	396	2,283	175,253		食品・生活必需品小売
NATIONAL BANK OF CANADA	460	523	2,902	222,749		銀行
NEWMONT CORP	396	—	—	—		金属・鉱業
NUTRIEN LTD	831	900	4,446	341,186		化学
ONEX CORPORATION	109	132	871	66,855		各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	354	417	2,298	176,355		ソフトウェア
OVINTIV INC	—	410	330	25,328		石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND FUEL CORP	—	217	722	55,453		石油・ガス・消耗燃料
PEMBINA PIPELINE CORP	673	880	2,801	214,951		石油・ガス・消耗燃料
POWER CORPORATION OF CANADA	390	869	1,823	139,923		保険
POWER FINANCIAL CORP	325	—	—	—		保険
PRARIESKY ROYALTY LTD	310	310	297	22,814		石油・ガス・消耗燃料
QUEBECOR INC-CL B	—	270	807	61,972		メディア
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	320	460	3,310	254,056		ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	502	581	3,307	253,783		無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,962	2,273	19,397	1,488,585		銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	252	—	—	—		建設・土木
SAPUTO INC	321	410	1,418	108,831		食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	370	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	630	770	1,769	135,788		メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	122	163	16,151	1,239,454		情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE	230	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC	807	923	4,468	342,892		保険
SUNCOR ENERGY INC	2,180	2,440	5,814	446,206		石油・ガス・消耗燃料
TC ENERGY CORP	1,230	1,468	9,427	723,466		石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B	680	820	1,044	80,168		金属・鉱業
TELUS CORP	293	586	1,339	102,755		各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	282	317	3,012	231,199		専門サービス
TORONTO DOMINION BANK	2,495	2,872	16,379	1,256,925		銀行
TOURMALINE OIL CORP	330	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,260	—	—	—		金属・鉱業
VERMILION ENERGY INC	185	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
WSP GLOBAL INC	132	177	1,567	120,263		建設・土木

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	
WEST FRASER TIMBER	84	84	336	25,855	紙製品・林産品	
WESTON(GEORGE) LTD	107	123	1,204	92,398	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	630	716	4,323	331,762	金属・鉱業	
小計	株数・金額	57,067	64,031	268,326	20,591,394	
	銘柄数 <比率>	89	83	—	<3.4%>	
(イギリス)			千英ポンド			
ANTOFAGASTA PLC	590	590	475	63,159	金属・鉱業	
ASHTEAD GROUP PLC	633	740	1,639	217,852	商社・流通業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,450	1,590	843	112,121	家庭用耐久財	
AVIVA PLC	5,420	6,040	1,493	198,436	保険	
DIAGEO PLC	3,284	3,721	10,336	1,373,262	飲料	
SCHRODERS PLC	158	197	549	73,044	資本市場	
DCC PLC	128	160	932	123,879	コングロマリット	
BAE SYSTEMS PLC	4,410	5,020	2,571	341,589	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,125	3,637	10,827	1,438,413	タバコ	
HALMA PLC	—	590	1,317	175,025	電子装置・機器・部品	
STANDARD CHARTERED PLC	3,830	4,380	1,810	240,550	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	1,295	1,490	2,424	322,058	タバコ	
HSBC HOLDINGS PLC	27,150	32,070	13,235	1,758,308	銀行	
LEGAL & GENERAL	8,080	9,400	1,927	256,001	保険	
MEGGITT PLC	1,110	1,110	286	38,001	航空宇宙・防衛	
MORRISON SUPERMARKETS	3,150	3,700	692	91,968	食品・生活必需品小売り	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	494	541	955	126,925	食品	
PEARSON	1,090	1,260	566	75,258	メディア	
PERSIMMON PLC	426	480	1,095	145,518	家庭用耐久財	
PRUDENTIAL PLC	3,550	4,100	4,604	611,681	保険	
RIO TINTO PLC-REG	1,578	1,789	6,664	885,434	金属・鉱業	
ST JAMES S PLACE PLC	700	810	687	91,381	資本市場	
SSE PLC	1,370	1,650	2,038	270,824	電力	
BP PLC	27,170	32,130	10,149	1,348,409	石油・ガス・消耗燃料	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	97,300	110,500	3,456	459,261	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	4,500	5,000	759	100,899	家庭用耐久財	
TESCO PLC	13,140	15,770	3,742	497,154	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	1,160	1,370	2,270	301,672	ヘルスケア機器・用品	
GLAXOSMITHKLINE PLC	6,760	7,880	13,195	1,753,068	医薬品	
WEIR GROUP PLC	310	380	365	48,594	機械	
BABCOCK INTL GROUP PLC	390	—	—	—	商業サービス・用品	
ASTRAZENECA PLC	1,727	2,073	17,742	2,357,131	医薬品	
BT GROUP PLC	11,450	13,700	1,437	191,013	各種電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	229	229	214	28,506	ホテル・レストラン・レジャー	
MARKS & SPENCER PLC	2,080	3,100	294	39,173	複合小売り	
BARCLAYS PLC	23,000	27,400	2,888	383,738	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	216	256	1,208	160,593	専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	550	660	914	121,438	織維・アパレル・贅沢品	
NEXT PLC	198	221	1,078	143,334	複合小売り	
KINGFISHER PLC	3,080	3,080	480	63,893	専門小売り	
ITV PLC	5,000	6,400	469	62,339	メディア	
SAINSBURY	2,550	2,990	576	76,544	食品・生活必需品小売り	
G4S PLC	2,190	2,190	212	28,209	商業サービス・用品	
ADMIRAL GROUP PLC	270	308	743	98,816	保険	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	171	195	832	110,565	家庭用耐久財	
CENTRICA PLC	7,800	9,200	367	48,778	総合公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	6,104	6,630	8,755	1,163,178	石油・ガス・消耗燃料	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	5,107	5,880	7,429	987,071	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		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
BUNZLE	444	560	969	128,742	商社・流通業
RENTOKIL INTIAL PLC	—	2,850	1,373	182,533	商業サービス・用品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	426	493	3,859	512,695	資本市場
UNILEVER PLC	1,509	1,747	7,133	947,619	パーソナル用品
TUI AG-DI	600	700	185	24,643	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	920	—	—	—	資本市場
EXPERIAN PLC	1,218	1,452	3,776	501,728	専門サービス
MONDI PLC	494	750	1,020	135,606	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	324	370	894	118,806	水道
WHITBREAD PLC	245	211	603	80,113	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	401	520	782	103,968	資本市場
SMITHS GROUP PLC	540	610	762	101,298	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,433	1,670	2,449	325,467	金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,320	1,550	1,185	157,526	資本市場
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	913	1,127	7,492	995,351	家庭用品
RELX PLC	2,650	3,080	5,725	760,661	専門サービス
FRESNILLO PLC	260	—	—	—	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	960	1,060	953	126,682	水道
OCADO GROUP PLC	—	720	1,342	178,295	インターネット販売・通信販売
GLENCORE PLC	15,330	17,000	2,519	334,657	金属・鉱業
WOOD GROUP (JOHN) PLC	860	—	—	—	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC	710	870	689	91,631	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,260	2,770	795	105,651	航空宇宙・防衛
EVRAZ PLC	—	760	205	27,260	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	133	133	31	4,145	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EASYJET PLC	210	210	111	14,825	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	6,500	7,700	878	116,718	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,430	1,750	1,123	149,256	ソフトウェア
WPP PLC	1,690	2,000	1,210	160,748	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	290	340	644	85,663	飲料
AVEVA GROUP PLC	—	112	437	58,177	ソフトウェア
CONVATEC GROUP PLC-WI	2,100	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	2,150	2,510	3,230	429,154	ホテル・レストラン・レジャー
NATIONAL GRID PLC	4,610	5,470	5,038	669,426	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	1,360	—	—	—	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	890	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,260	3,660	803	106,727	資本市場
FERGUSON PLC	308	—	—	—	商社・流通業
BHP GROUP PLC	2,890	3,370	4,639	616,310	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	36,500	43,000	4,855	645,061	無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	237	285	1,024	136,076	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C	168,270	—	—	—	航空宇宙・防衛
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	481	481	229	30,484	ソフトウェア
CRODA INTERNATIONAL PLC	167	215	1,067	141,842	化学
FERGUSON PLC	—	366	2,086	277,151	商社・流通業
M&G PLC	—	4,400	579	76,925	各種金融サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,400	1,620	637	84,709	保険
INFORMA PLC	1,730	2,480	1,126	149,677	メディア
AUTO TRADER GROUP PLC	1,210	1,650	791	105,173	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	116	1,086	144,397	機械
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	—	85	834	110,889	ホテル・レストラン・レジャー
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,830	2,190	614	81,638	保険
JD SPORTS FASHION PLC	—	760	421	55,955	専門小売
MELROSE INDUSTRIES PLC	6,800	7,300	700	93,101	電気設備

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	
(イギリス) JOHNSON MATTHEY PLC	百株 267	百株 302	千英ポンド 590	千円 78,435	化学
小計	株数 銘柄数 <比率>	576,004	475,982	227,080	30,167,704
(スイス)		93	94	—	<4.9%>
SGS SA-REG	7	9	2,136	235,431	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG	3	4	851	93,881	食品
SWISSCOM AG-REG	35	40	2,015	222,053	各種電気通信サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	1,385	152,727	食品
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.13	0.17	1,390	153,244	食品
GIVAUDAN-REG	12	14	4,843	533,751	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	207	235	6,851	755,021	保険
NOVARTIS AG-REG	2,938	3,397	28,089	3,095,495	医薬品
ABB LTD	2,500	2,940	5,221	575,402	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	952	1,111	37,929	4,179,879	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG	215	249	1,036	114,259	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	670	774	3,068	338,193	建設資材
CLARIANT AG-REG	259	320	572	63,069	化学
NESTLE SA-REG	4,154	4,710	49,455	5,449,941	食品
BALOISE HOLDING AG	66	74	1,027	113,188	保険
TEMENOS AG-REG	84	104	1,373	151,339	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG-REG	76	88	1,642	181,054	ヘルスケア機器・用品
STRAUmann HOLDING AG-REG	14	16	1,190	131,182	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	3,470	4,130	3,367	371,109	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B	41	47	879	96,932	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	74	74	268	29,569	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG	103	118	5,296	583,630	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG	45	51	1,728	190,455	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	12	12	778	85,842	化学
SWISS PRIME SITE-REG	101	114	1,075	118,467	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	58	58	399	44,006	各種金融サービス
DUFRY AG-REG	44	65	179	19,812	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	24	29	2,357	259,776	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	55	67	1,435	158,152	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG	30	30	630	69,426	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	73	84	1,149	126,633	海運業
GEBERIT AG-REG	50	59	2,578	284,193	建設関連製品
JULIUS BAER GROUP LTD	310	358	1,345	148,259	資本市場
SWISS RE LTD	414	462	3,067	338,058	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	716	840	4,683	516,159	繊維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG	170	199	3,318	365,679	化学
ALCON INC	592	659	3,471	382,571	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG	5,190	6,150	5,915	651,840	資本市場
VIFOR PHARMA AG	57	76	1,161	128,014	医薬品
小計	株数 銘柄数 <比率>	23,826	27,775	195,169	21,507,706
(スウェーデン)		39	39	—	<3.5%>
LUNDBERGS AB-B SHS	92	126	5,269	57,540	各種金融サービス
SKANDINAViska ENSKILDA BANKEN AB	2,210	2,500	18,845	205,787	銀行
SWEDBANK AB	1,260	1,480	16,028	175,030	銀行
SWEDISH MATCH AB	234	260	16,125	176,087	タバコ
SECURITAS AB-B SHS	450	550	6,600	72,072	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	617	715	34,577	377,585	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	1,180	1,270	16,821	183,686	専門小売り
ERICSSON LM-B	4,170	4,920	41,141	449,260	通信機器

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		
(スウェーデン)	百株	百株	千円		
TELIA CO AB	3,700	4,300	14,061	153,546	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	450	510	9,419	102,863	建設・土木
LUNDIN ENERGY AB	248	288	6,514	71,138	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	389	510	9,537	104,144	機械
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	97	158	3,788	41,374	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	105	138	5,739	62,674	食品・生活必需品小売
HUSQVARNA AB-B SHS	550	760	4,430	48,384	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	340	340	4,690	51,218	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	490	580	9,088	99,247	機械
VOLVO AB-B SHS	2,140	2,340	29,636	323,626	機械
SANDVIK AB	1,510	1,780	26,700	291,564	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	250	250	5,075	55,419	各種金融サービス
HEXAGON AB-B SHS	361	423	20,003	218,440	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	690	780	9,898	108,088	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B	337	—	—	—	各種金融サービス
ATLAS COPCO AB-A	895	1,076	37,078	404,902	機械
ATLAS COPCO AB-B	529	627	19,562	213,621	機械
BOLIDEN AB	363	—	—	—	金属・鉱業
EPIROC AB - A	920	1,030	10,439	113,994	機械
EPIROC AB - B	580	580	5,881	64,222	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B	817	974	30,447	332,483	家庭用品
BOLIDEN AB	—	440	8,756	95,615	金属・鉱業
KINNEVIK AB - B	—	390	8,619	94,119	各種金融サービス
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	2,120	2,430	21,247	232,027	銀行
ASSA ABLOY AB-B	1,360	1,590	29,804	325,465	建設関連製品
NORDEA BANK ABP	4,130	5,150	30,694	335,178	銀行
小計	株数・金額	33,584	39,265	516,521	5,640,409
銘柄	数比率	32	32	—	<0.9%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	1,280	1,560	18,423	192,342	銀行
TELENOR ASA	1,020	1,160	17,440	182,079	各種電気通信サービス
EQUINOR ASA	1,610	1,580	22,238	232,169	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	232	296	9,978	104,171	化学
MOWI ASA	620	690	12,420	129,664	食品
NORSK HYDRO	1,840	2,180	5,253	54,849	金属・鉱業
AKER AB ASA	141	180	3,147	32,857	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA	1,150	1,150	9,758	101,882	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	250	310	5,514	57,575	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	129	129	2,752	28,739	メディア
小計	株数・金額	8,272	9,235	106,928	1,116,334
銘柄	数比率	10	10	—	<0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG B	145	173	14,355	223,228	飲料
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	8	10	6,593	102,530	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	5	6	3,782	58,816	海運業
DANSKE BANK AS	970	970	7,494	116,535	銀行
GENMAB A/S	84	106	19,292	299,990	バイオテクノロジー
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	268	298	17,689	275,068	電気設備
H LUNDBECK A/S	105	105	2,547	39,610	医薬品
DSV PANALPINA A/S	251	340	23,541	366,071	航空貨物・物流サービス
PANDORA A/S	137	160	4,352	67,673	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S	137	167	10,203	158,667	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES	286	337	11,774	183,097	化学
COLOPLAST-B	164	193	20,303	315,720	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		
(デンマーク)	百株	百株	千円		
NOVO NORDISK A/S-B	2,475	2,795	120,744	1,877,569	医薬品
ISS A/S	218	218	2,209	34,356	商業サービス・用品
TRYG A/S	160	199	3,631	56,473	保険
ORSTED A/S	254	300	20,880	324,684	電力
DEMANTE A/S	130	160	2,748	42,743	ヘルスケア機器・用品
小計	5,798	6,537	292,144	4,542,839	
銘柄	株数	・	金額		
	銘柄	株数	比	率	
		17	17	—	<0.7%>
(ユーロ…ドイツ)	千ユーロ				
ADIDAS AG	246	287	5,966	692,140	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA	576	673	2,703	313,599	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	536	62,264	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD	105	105	368	42,703	化学
HANNOVER RUECK SE	79	96	1,334	154,790	保険
GEA GROUP AG	242	242	537	62,319	機械
CONTINENTAL AG	146	175	1,384	160,613	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	1,328	1,581	4,233	491,134	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	59	—	—	—	メディア
MERCK KGAA	173	200	2,122	246,152	医薬品
RWE AG	720	931	2,525	292,993	総合公益事業
SAP SE	1,340	1,552	16,721	1,939,664	ソフトウェア
E.ON SE	2,940	3,550	3,256	377,702	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	144	163	1,162	134,814	家庭用品
PUMA SE	10	126	757	87,842	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG	1,273	1,548	8,976	1,041,314	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	246	290	2,308	267,774	家庭用品
BASF SE	1,254	1,444	6,677	774,538	化学
BEIERSDORF AG	137	160	1,508	174,983	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	26	38	269	31,274	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	203	226	1,000	116,005	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	294	333	2,390	277,271	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	574	662	10,438	1,210,856	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	310	420	326	37,894	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	201	228	4,355	505,289	保険
VOLKSWAGEN AG	45	51	708	82,232	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	252	299	3,854	447,146	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,227	1,453	4,599	533,538	自動車
THYSSENKRUPP AG	620	620	327	37,973	金属・鉱業
SIEMENS AG	1,042	1,206	10,652	1,235,701	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG	80	—	—	—	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,750	3,140	2,052	238,103	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	449	521	2,678	310,761	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	78	102	433	50,262	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	4,500	5,300	7,239	839,816	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	45	58	1,661	192,689	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,550	1,990	3,643	422,668	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	—	60	571	66,328	ヘルスケア機器・用品
DEUTSCHE BOERSE AG	256	304	4,515	523,846	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	203	254	1,193	138,480	自動車
FRAPORT AG	63	63	237	27,595	運送インフラ
WIRECARD AG	159	190	1,599	185,532	情報技術サービス
LANXESS	120	120	561	65,159	化学
MTU AERO ENGINES AG	69	84	1,043	121,020	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE	484	562	2,157	250,272	不動産管理・開発
SYMRISE AG	163	210	1,997	231,663	化学

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)					
BRENNETAG AG	百株	百株	千ユーロ	千円	
	206	238	1,059	122,910	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG		227	330	737	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	970	1,500	411	47,710	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG	93	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG	1,350	1,580	512	59,456	銀行
OSRAM LICHT AG	143	—	—	—	電気設備
KION GROUP AG	99	99	455	52,780	機械
VONOVIA SE	664	824	4,004	464,538	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	340	—	—	—	メディア
KNORR-BREMSE AG	—	71	577	66,999	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	199	239	976	113,224	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	250	250	190	22,098	食品・生活必需品小売
INNOGY SE	195	—	—	—	総合公益事業
ZALANDO SE	142	215	1,148	133,179	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	270	269	833	96,701	化学
QIAGEN NV	314	354	1,396	161,997	ライフサイエンス・ツール/サービス
UNIPER SE	262	311	784	90,983	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	119	179	1,564	181,518	インターネット販売・通信販売
小計	株数	・	金額	32,792	38,244
	銘柄	数	<比率>	62	58
				—	<2.8%>
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,620	1,750	2,270	263,392	保険
INTESA SANPAOLO	20,010	24,000	3,393	393,657	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.	880	1,070	555	64,492	銀行
ENEL SPA	11,040	12,910	8,004	928,487	電力
ENI SPA	3,450	4,030	3,478	403,481	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA	2,980	3,200	1,288	149,445	ガス
TENARIS SA	600	710	442	51,310	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA	15,300	15,500	536	62,210	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	8,800	8,800	307	35,615	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	653	790	1,102	127,837	運送インフラ
TERNA SPA	1,850	2,220	1,282	148,743	電力
RECORDATI SPA	141	168	695	80,680	医薬品
LEONARDO SPA	550	640	390	45,286	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA	309	370	671	77,856	電気設備
FERRARI NV	171	189	2,767	321,076	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	1,410	1,540	796	92,356	機械
MONCLER SPA	252	281	921	106,849	繊維・アパレル・贅沢品
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	—	1,020	987	114,510	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,500	1,700	1,320	153,224	自動車
UNICREDIT SPA	2,710	3,110	2,046	237,380	銀行
EXOR NV	151	172	834	96,767	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	770	880	651	75,518	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	760	910	654	75,939	飲料
PIRELLI & C. SPA	530	530	194	22,557	自動車部品
小計	株数	・	金額	76,437	86,490
	銘柄	数	<比率>	23	24
				—	<0.7%>
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES	314	348	960	111,456	建設・土木
AIRBUS SE	793	918	5,147	597,078	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	710	870	1,708	198,156	総合公益事業
LOREAL-ORD	344	398	10,099	1,171,535	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	378	439	15,463	1,793,797	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	3	3	238	27,657	航空宇宙・防衛

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
THALES SA	141	163	1,139	132,204	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	219	259	2,304	267,271	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	83	83	292	33,986	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	81	95	1,173	136,097	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	292	363	952	110,491	メディア
FAURECIA	105	105	345	40,072	自動車部品
BOLLORE	1,060	1,380	349	40,500	娯楽
MICHELIN (CGDE)	228	267	2,383	276,518	自動車部品
PERNOD RICARD SA	291	335	4,579	531,216	飲料
RENAULT SA	255	281	492	57,127	自動車
REMY COINTREAU	30	40	401	46,539	飲料
SEB SA	30	38	425	49,369	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	741	870	6,996	811,598	電気設備
VIVENDI SA	1,437	1,300	2,594	300,996	娯楽
ORANGE SA	2,680	3,220	3,453	400,600	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	42	50	3,405	395,072	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	38	—	—	—	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	178	209	2,933	340,264	ソフトウェア
KERING SA	102	120	5,396	626,034	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	212	280	257	29,914	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	800	950	1,263	146,510	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	136	153	1,011	117,385	情報技術サービス
SANOFI	1,536	1,781	15,952	1,850,480	医薬品
ACCOR SA	262	262	601	69,810	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	900	1,100	2,571	298,328	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	1,043	1,270	1,685	195,464	銀行
TELEPERFORMANCE	77	96	2,160	250,671	専門サービス
EURAZEO SE	59	59	263	30,591	各種金融サービス
SODEXO	121	132	864	100,232	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	2,650	3,080	4,997	579,722	保険
PEUGEOT CITROEN	820	970	1,302	151,058	自動車
JC DECAUX SA	93	150	286	33,234	メディア
ESSILORLUXOTTICA	387	453	5,014	581,706	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	1,540	1,840	1,335	154,957	銀行
BNP PARIBAS	1,529	1,792	5,163	598,983	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	669	790	2,006	232,765	建設関連製品
WENDEL	34	43	323	37,484	各種金融サービス
ILIAS SA	39	24	343	39,894	各種電気通信サービス
SES FDR	480	560	343	39,885	メディア
IMERYS	38	—	—	—	建設資材
SAFRAN SA	457	522	4,234	491,197	航空宇宙・防衛
ENGIE	2,510	2,900	2,841	329,604	総合公益事業
ALSTOM	205	303	1,100	127,657	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	241	241	222	25,792	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	820	940	676	78,508	電力
IPSEN	55	55	376	43,703	医薬品
ARKEMA	99	117	886	102,875	化学
LEGRAND SA	370	429	2,569	298,086	電気設備
EIFFAGE SA	108	121	939	108,975	建設・土木
TOTAL SA	3,270	3,803	12,544	1,455,126	石油・ガス・消耗燃料
ADP	39	47	380	44,161	運送インフラ
NATIXIS	1,280	1,580	343	39,845	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT	111	144	1,064	123,442	娯楽
SCOR SE	232	232	561	65,127	保険

銘柄	期首(前期末)	当期末				業種等
		株数	株数	評価額	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額	千円	千円	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
REXEL SA	450	—	—	—	—	商社・流通業
VINCI	684	808	6,205	719,831	719,831	建設・土木
DANONE	844	970	6,213	720,803	720,803	食品
AIR LIQUIDE SA	578	751	9,004	1,044,520	1,044,520	化学
BUREAU VERITAS SA	342	470	880	102,143	102,143	専門サービス
GETLINK	620	720	820	95,212	95,212	運送インフラ
SUEZ	520	520	535	62,159	62,159	総合公益事業
EDENRED	328	382	1,506	174,722	174,722	情報技術サービス
VALEO SA	331	373	772	89,564	89,564	自動車部品
BIOMERIEUX	59	69	834	96,768	96,768	ヘルスケア機器・用品
WORLDLINE SA	104	198	1,309	151,910	151,910	情報技術サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	41	46	1,085	125,929	125,929	ライフサイエンス・ツール/サービス
AMUNDI SA	82	100	600	69,600	69,600	資本市場
小計	株数・金額	38,782	44,781	179,499	20,821,994	
銘柄	株数・金額	73	70	—	<3.4%>	
(ユーロ…オランダ)						
RANDSTAD NV	153	184	669	77,606	77,606	専門サービス
WOLTERS KLUWER	372	438	2,955	342,852	342,852	専門サービス
VOPAK	90	114	568	65,948	65,948	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV	2,460	2,930	644	74,739	74,739	保険
KONINKLIJKE KPN NV	4,460	5,600	1,184	137,455	137,455	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,259	1,426	5,646	655,047	655,047	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV	357	404	3,030	351,480	351,480	飲料
HEINEKEN HOLDING NV	160	190	1,329	154,169	154,169	飲料
KONINKLIJKE DSM NV	247	285	3,274	379,859	379,859	化学
UNILEVER NV-CVA	2,102	—	—	—	—	パーソナル用品
UNILEVER NV	—	2,327	10,471	1,214,694	1,214,694	パーソナル用品
ASML HOLDING NV	554	672	18,722	2,171,798	2,171,798	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,606	1,760	3,984	462,218	462,218	食品・生活必需品小売
AKZO NOBEL	310	324	2,291	265,794	265,794	化学
PROSUS NV	—	768	5,652	655,687	655,687	インターネット販売・通信販売
NN GROUP NV	429	470	1,210	140,389	140,389	保険
ARCELORMITTAL	885	990	1,019	118,216	118,216	金属・鉱業
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	—	189	1,853	215,030	215,030	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV-CVA	581	700	477	55,362	55,362	銀行
ALTICE EUROPE N.V.	—	990	370	42,950	42,950	メディア
ADYEN NV	13	16	1,618	187,763	187,763	情報技術サービス
ING GROEP NV	5,280	6,170	3,128	362,870	362,870	銀行
小計	株数・金額	21,318	26,948	70,102	8,131,932	
銘柄	株数・金額	18	21	—	<1.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA S.A.	444	500	1,014	117,624	117,624	電力
BANKINTER S.A.	880	1,210	425	49,322	49,322	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	8,970	10,560	2,879	334,046	334,046	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	493	490	815	94,553	94,553	ガス
REPSOL SA	1,882	2,204	1,903	220,824	220,824	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA	22,110	26,100	5,214	604,914	604,914	銀行
TELEFONICA SA	6,400	7,320	3,085	357,904	357,904	各種電気通信サービス
ENAGAS SA	304	390	803	93,149	93,149	ガス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	300	380	516	59,948	59,948	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	350	403	958	111,238	111,238	建設・土木
FERROVIAL SA	665	770	1,809	209,902	209,902	建設・土木
MAPFRE SA	1,630	1,630	263	30,555	30,555	保険
BANCO DE SABADELL SA	7,900	8,019	265	30,800	30,800	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		
(ユーロ…スペイン)					
CAIXABANK	4,710	5,900	973	112,926	銀行
IBERDROLA SA	8,380	9,770	8,597	997,321	電力
AMADEUS IT GROUP SA	595	691	2,811	326,154	情報技術サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA	590	700	1,085	125,860	電力
INDITEX SA	1,480	1,740	4,022	466,654	専門小売り
AENA SME SA	93	107	1,154	133,925	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SA	—	409	2,094	242,913	各種電気通信サービス
GRIFOLS SA	401	468	1,367	158,629	バイオテクノロジー
BANKIA SA	1,510	1,510	137	15,939	銀行
小計	株数・金額	70,087	81,273	42,199	4,895,107
銘柄数<比率>		21	22	—	<0.8%>
(ユーロ…ベルギー)					
KBC GROEP NV	332	406	1,981	229,875	銀行
SOLVAY SA	103	114	840	97,540	化学
UCB SA	165	207	1,745	202,421	医薬品
COLRUYT SA	87	87	482	55,970	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM	110	124	880	102,183	各種金融サービス
PROXIMUS	216	260	472	54,830	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	—	70	1,409	163,536	バイオテクノロジー
TELENET GROUP HOLDING NV	67	67	238	27,621	メディア
AGEAS	258	289	943	109,489	保険
UMICORE	280	310	1,146	132,944	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,036	1,201	4,799	556,776	飲料
小計	株数・金額	2,654	3,135	14,941	1,733,190
銘柄数<比率>		10	11	—	<0.3%>
(ユーロ…オーストリア)					
OMV AG	210	252	779	90,443	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	90	110	491	56,986	電力
VOESTALPINE AG	165	200	379	43,975	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	400	480	941	109,188	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	201	201	318	36,909	銀行
ANDRITZ AG	92	117	361	41,883	機械
小計	株数・金額	1,158	1,360	3,270	379,386
銘柄数<比率>		6	6	—	<0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)					
EUROFINS SCIENTIFIC SE	14	19	1,098	127,395	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP	54	—	—	—	メディア
AROUNDOWN SA	1,070	1,850	938	108,888	不動産管理・開発
小計	株数・金額	1,138	1,869	2,036	236,283
銘柄数<比率>		3	2	—	<0.0%>
(ユーロ…フィンランド)					
WARTSILA OYJ	630	630	422	49,022	機械
UPM-KYMMENE OYJ	733	832	2,107	244,464	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R	730	970	1,032	119,721	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	612	718	2,158	250,363	保険
FORTUM OYJ	600	720	1,122	130,207	電力
ELISA OYJ	195	221	1,207	140,023	各種電気通信サービス
METSO OYJ	162	162	427	49,629	機械
NOKIA OYJ	7,550	8,780	2,892	335,538	通信機器
NESTE OYJ	528	668	2,089	242,382	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ	158	210	400	46,478	自動車部品
KONE OYJ	456	540	3,045	353,289	機械

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…フィンランド) ORION OYJ	百株 130	百株 165	千ユーロ 747	千円 86,761	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,484	14,616	17,654	2,047,883
		12	12	—	<0.3%>
(ユーロ…アイルランド)					
CRH PLC	1,111	1,253	3,393	393,602	建設資材
KINGSPAN GROUP PLC	222	245	1,212	140,679	建設関連製品
KERRY GROUP PLC-A	221	255	2,588	300,237	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	1,398	—	—	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	320	353	1,031	119,650	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,330	1,330	218	25,363	銀行
AIB GROUP PLC	1,250	1,250	135	15,732	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	109	119	1,357	157,434	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,961	6,203	9,937	1,152,699
		8	8	—	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL	3,610	4,170	1,719	199,486	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	670	810	831	96,402	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS	310	380	587	68,103	食品・生活必需品小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,590	5,360	3,137	363,992
		3	3	—	<0.1%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	267,403	310,280	526,617	61,087,578
		239	237	—	<10.0%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	380	480	3,967	54,747	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,510	3,100	5,152	71,100	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,670	2,200	3,556	49,075	銀行
CLP HLDGS	2,270	2,650	21,200	292,560	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	1,624	1,881	45,670	630,255	資本市場
MTR CORP	2,010	2,430	10,376	143,190	陸運・鉄道
HANG LUNG GROUP LTD	1,030	—	—	—	不動産管理・開発
HANG SENG BANK	1,058	1,190	16,088	222,025	銀行
HENDERSON LAND	1,858	2,294	6,998	96,572	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,910	2,250	11,340	156,492	電力
WHARF (HOLDING)	1,740	—	—	—	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	12,403	16,403	22,603	311,935	ガス
HYSAN DEVELOPMENT	830	—	—	—	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	3,160	3,350	17,989	248,255	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES	790	1,140	2,485	34,295	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,950	6,060	14,574	201,125	銀行
NWS HOLDINGS LTD	2,205	2,205	1,711	23,612	コングロマリット
PCCW LTD	5,500	7,500	3,570	49,266	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	970	970	1,264	17,455	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	8,396	9,396	8,560	118,132	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,603	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO. LTD	4,800	4,800	5,232	72,201	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,170	2,560	26,214	361,758	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A	640	750	3,738	51,594	不動産管理・開発
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	—	1,300	3,666	50,590	食品
WHEELOCK & COMPANY LTD	1,170	1,340	7,738	106,791	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	1,790	2,120	13,758	189,871	機械
MINTH GROUP LTD	1,120	—	—	—	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED	2,700	2,700	2,187	30,180	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	2,280	2,280	3,223	44,490	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD	1,240	—	—	—	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		
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
AIA GROUP LTD	16,350	19,090	132,961	1,834,873	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD	5,196	5,996	7,590	104,754	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	3,360	3,840	11,942	164,805	ホテル・レストラン・レジャー	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,730	1,730	3,728	51,448	不動産管理・開発	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,640	1,830	6,148	84,853	不動産管理・開発	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	2,160	4,827	66,620	飲料	
WH GROUP LIMITED	11,700	15,800	11,265	155,462	食品	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,710	4,250	24,142	333,163	コングロマリット	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	890	1,070	4,857	67,037	電力	
CK ASSET HOLDINGS LTD	3,450	4,090	19,920	274,899	不動産管理・開発	
小計	株数・金額	124,806	143,207	490,253	6,765,495	
	銘柄数<比率>	39	35	—	<1.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,980	2,490	824	62,366	航空宇宙・防衛	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,400	—	—	—	食品	
DBS GROUP HLDGS	2,430	2,840	5,594	423,358	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	510	700	560	42,375	不動産管理・開発	
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	140	140	284	21,547	販売	
SATS LTD	770	1,150	341	25,845	運送インフラ	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,110	1,290	1,265	95,759	資本市場	
CAPITALAND LIMITED	3,300	4,300	1,259	95,336	不動産管理・開発	
COMFORTDELGRO CORP LTD	3,100	3,100	492	37,297	陸運・鉄道	
SINGAPORE AIRLINES LTD	770	770	339	25,708	旅客航空輸送業	
SINGAPORE AIRLINE-MCB RIGHTS	—	2,272	—	—	旅客航空輸送業	
SINGAPORE AIRLINES LT-RIGHTS	—	1,155	162	12,329	旅客航空輸送業	
UNITED OVERSEAS BANK	1,850	2,000	3,976	300,863	銀行	
UOL GROUP LIMITED	650	850	591	44,766	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	350	450	708	53,597	電子装置・機器・部品	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	2,400	2,400	369	27,967	メディア	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	11,100	12,900	3,508	265,510	各種電気通信サービス	
SEMCORP INDUSTRIES	1,400	1,400	224	16,954	コングロマリット	
OCBC-ORD	4,330	5,240	4,653	352,101	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,470	2,890	1,002	75,884	食品	
KEPPEL CORP.	2,020	2,320	1,401	106,034	コングロマリット	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	2,800	4,400	435	32,961	機械	
GENTING SINGAPORE LTD	8,700	10,600	810	61,360	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額	61,581	65,659	28,808	2,179,929	
	銘柄数<比率>	21	22	—	<0.4%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	205	250	1,522	106,409	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	3,870	4,530	7,125	497,943	銀行	
AMCOR PLC-CDI	1,550	—	—	—	容器・包装	
WESTPAC BANKING CORP	4,690	5,630	8,732	610,201	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	560	—	—	—	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,010	2,190	2,636	184,256	金属・鉱業	
TELSTRA CORP LTD	5,400	6,500	1,969	137,628	各種電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	670	920	541	37,866	銀行	
COCA-COLA AMATIL LTD	770	770	666	46,597	飲料	
ASX LTD	263	307	2,526	176,559	資本市場	
BHP GROUP LIMITED	4,010	4,680	14,695	1,026,900	金属・鉱業	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	333	400	980	68,482	石油・ガス・消耗燃料	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	971	971	294	20,563	複合小売り	
COMPUTERSHARE LTD	630	760	868	60,703	情報技術サービス	
CSL LIMITED	618	716	21,564	1,506,926	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	千円	
		外貨建金額	邦貨換算金額	千円	千円	
(オーストラリア)						
REA GROUP LTD	百株	百株	千豪ドル	千円	58,524	インターネット・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	69	88	837	837		運送インフラ
COCHLEAR LTD	3,570	4,340	5,902	412,459		ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	81	103	1,871	130,752		石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,390	2,650	1,465	102,405		銀行
BORAL LTD	2,394	2,808	16,735	1,169,489		建設資材
RIO TINTO LTD	1,530	2,000	550	38,434		金属・鉱業
APA GROUP	512	596	4,946	345,682		ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,590	1,800	2,026	141,632		ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	760	880	2,198	153,613		保険
TPG TELECOM LTD	3,080	3,610	1,906	133,196		各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	520	520	377	26,381		ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD	73	290	312	21,805		化学
BLUESCOPE STEEL LTD	500	590	959	67,038		金属・鉱業
WORLEY LTD	680	880	886	61,924		エネルギー設備・サービス
WORLEY LTD	470	470	402	28,114		
SUNCORP GROUP LTD	1,810	1,900	1,692	118,299		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	3,710	5,110	8,216	574,195		
NEWCREST MINING	1,030	1,250	3,450	241,086		
OIL SEARCH LTD	1,790	2,800	803	56,155		
INCITEC PIVOT LTD	2,330	2,330	510	35,657		
AMP LIMITED	3,900	5,300	747	52,221		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	1,080	367	25,659		
QBE INSURANCE	1,790	2,410	1,821	127,318		
CHALLENGER LIMITED	800	800	380	26,610		
SANTOS LTD.	2,320	3,010	1,459	102,014		
SONIC HEALTHCARE LTD	620	690	1,787	124,882		
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	170	170	301	21,074		
TABCOR HOLDINGS	2,470	3,400	1,067	74,603		
WESFARMERS LIMITED	1,540	1,810	6,778	473,678		
ALUMINA LTD	3,500	3,500	533	37,298		
WOODSIDE PETROLEUM	1,270	1,520	3,327	232,510		
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,810	2,010	6,974	487,392		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	192	1,056	73,793		
SEEK LTD	480	480	835	58,397		
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES LTD	85	—	—	—		
BRAMBLES LTD	2,180	2,510	2,655	185,571		
MACQUARIE GROUP LIMITED	439	530	5,575	389,585		
CROWN RESORTS LTD	550	550	513	35,897		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	580	670	1,449	101,270		
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,000	1,110	1,092	76,325		
SYDNEY AIRPORT	1,440	1,680	915	63,982		
AURIZON HOLDINGS LTD	2,730	3,050	1,369	95,697		
AUSNET SERVICES	2,300	3,300	645	45,083		
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,500	4,500	1,273	88,992		
AGL ENERGY LTD	860	1,050	1,731	120,993		
SOUTH32 LTD	7,000	7,800	1,443	100,836		
CIMIC GROUP LTD	117	180	414	28,968		
COLES GROUP LTD	1,480	2,130	3,237	226,243		
WISETECH GLOBAL LTD	—	210	418	29,217		
小計	株数	金額	100,370	119,281	170,349	11,904,008
	銘柄	数	比	率	—	<1.9%>
(ニュージーランド)						
RYMAN HEALTHCARE LTD	580	580	704	46,197	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
A2 MILK CO LTD	1,060	1,170	2,285	149,919	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	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION LTD	740	950	2,831	185,741	ヘルスケア機器・用品	
FLETCHER BUILDING LTD	1,126	1,500	510	33,461	建設資材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,600	3,070	1,412	92,654	各種電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	—	1,000	480	31,492	電力	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,300	1,520	863	56,645	運送インフラ	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,590	2,010	944	61,981	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小計	株数・金額	8,996	11,800	10,030	658,093	
	銘柄数 <比率>	7	8	—	<0.1%>	
(イスラエル)		千新シェケル				
BANK HAPOALIM BM	1,410	1,830	4,210	128,177	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,950	2,380	4,624	140,764	銀行	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	2,800	—	—	—	各種電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	36	36	1,740	52,994	航空宇宙・防衛	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	1,720	1,995	60,733	銀行	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	910	1,250	1,606	48,894	化学	
NICE LTD	86	101	6,230	189,662	ソフトウェア	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	170	230	1,638	49,890	銀行	
AZRIELI GROUP	65	65	1,293	39,374	不動産管理・開発	
小計	株数・金額	7,427	7,612	23,340	710,492	
	銘柄数 <比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,686,053	1,755,410	—	590,490,650	
	銘柄数 <比率>	1,252	1,254	—	<96.5%>	

\* 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。

\* 邦貨換算金額欄の<>内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各別銘柄評価額の比率。

\* 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 柏	期首(前期末) 口 数	当 期 末				比 率	
		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		%	
AGNC INVESTMENT CORP	71,000	80,000	1,016	108,703	0.0		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	17,900	2,720	290,989	0.0		
AMERICAN TOWER CORP	60,200	70,200	16,732	1,789,580	0.3		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	237,000	1,471	157,405	0.0		
AVALONBAY COMMUNITIES INC	18,500	21,900	3,590	384,027	0.1		
BOSTON PROPERTIES	20,700	24,700	2,146	229,587	0.0		
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	15,000	—	—	—	—		
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	16,000	1,415	151,372	0.0		
CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	66,000	10,408	1,113,156	0.2		
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	41,900	6,078	650,043	0.1		
DUKE REALTY CORP	47,800	56,600	1,919	205,330	0.0		
EQUINIX INC	10,930	13,540	9,182	982,045	0.2		
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	26,500	1,626	173,904	0.0		
EQUITY RESIDENTIAL	49,400	59,900	3,846	411,412	0.1		
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	10,700	2,639	282,257	0.0		
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	20,700	1,897	202,989	0.0		
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	11,100	867	92,739	0.0		
HCP INC	66,100	—	—	—	—		
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	81,000	1,964	210,076	0.0		
HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	109,000	1,205	128,932	0.0		
INVITATION HOMES INC	45,000	85,000	2,119	226,632	0.0		
IRON MOUNTAIN INC	38,300	43,100	1,058	113,256	0.0		
KIMCO REALTY CORP	58,000	65,000	708	75,774	0.0		
LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	—	—	—	—		
MACERICH CO /THE	14,200	—	—	—	—		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	83,000	1,485	158,895	0.0		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	17,600	2,034	217,539	0.0		
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	27,900	921	98,528	0.0		
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	36,500	1,006	107,663	0.0		
PROLOGIS INC	86,300	117,000	10,526	1,125,808	0.2		
PUBLIC STORAGE	21,500	25,300	4,815	515,028	0.1		
REALTY INCOME CORP	39,300	52,400	2,874	307,445	0.1		
REGENCY CENTERS CORP	21,000	26,200	1,099	117,575	0.0		
SBA COMMUNICATIONS CORP	15,200	17,770	5,186	554,680	0.1		
SL GREEN REALTY CORP	12,500	12,500	606	64,851	0.0		
SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	47,900	2,779	297,230	0.0		
SUN COMMUNITIES INC	—	14,300	1,918	205,197	0.0		
UDR INC	36,700	46,300	1,775	189,851	0.0		
VENTAS INC	49,200	61,100	1,839	196,692	0.0		
VEREIT INC	125,000	160,000	876	93,773	0.0		
VICI PROPERTIES INC	—	76,000	1,298	138,910	0.0		
VORNADO REALTY TRUST	24,200	27,000	1,064	113,802	0.0		
WP CAREY INC	21,500	27,400	1,714	183,415	0.0		
WELLTOWER INC	51,700	63,100	2,811	300,647	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	邦貨換算金額		
(アメリカ) WEYERHAEUSER CO		100,500	115,000	千米ドル 2,282	千円 244,140	% 0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,663,660 39	2,212,010 41	123,533 —	13,211,901 <2.2%>		
(カナダ) CAN APARTMENT PROP REAL ESTA FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS RIOCAN REAL ESTATE INVST TR SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		—	14,900 16,000 20,000 22,000 11,000	千カナダドル 732 208 188 328 221	56,187 15,998 14,442 25,206 17,034	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	53,000 3	83,900 5	1,679 —	128,869 <0.0%>		
(イギリス) BRITISH LAND HAMMERSON PLC SEGRO PLC LAND SECURITIES GROUP PLC		128,000 108,000 145,000 99,000	128,000 — 176,000 111,000	千英ポンド 497 — 1,447 714	66,148 — 192,290 94,937	0.0 — 0.0 0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	480,000 4	415,000 3	2,659 —	353,375 <0.1%>		
(ユーロ…フランス) ICADE KLEPIERRE GECINA SA COVIVIO UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		5,100 28,000 6,400 6,600 19,100	5,200 32,300 7,100 8,500 21,400	千ユーロ 347 555 798 457 1,081	40,354 64,388 92,572 53,046 125,410	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0	
ユ一口計	口数・金額 銘柄数<比率>	65,200 5	74,500 5	3,239 —	375,773 <0.1%>		
(香港) LINK REIT HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		288,000 370,000	330,000 470,000	千香港ドル 22,588 3,764	311,721 51,952	0.1 0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	658,000 2	800,000 2	26,353 —	363,674 <0.1%>		
(シンガポール) CAPITALAND MALL TRUST ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT CAPITALAND COMMERCIAL TRUST SUNTEC REIT MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		320,000 380,000 369,972 300,000 —	390,000 440,800 439,972 300,000 370,000	千シンガポールドル 721 1,291 699 405 703	54,595 97,731 52,935 30,646 53,196	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,369,972 4	1,940,772 5	3,820 —	289,104 <0.0%>		
(オーストラリア) MIRVAC GROUP GPT GROUP LENDLEASE GROUP STOCKLAND TRUST GROUP DEXUS GOODMAN GROUP SCENTRE GROUP		490,000 256,000 77,000 348,000 140,000 227,000 723,000	660,000 330,000 88,000 410,000 171,000 254,000 870,000	千豪ドル 1,445 1,323 987 1,123 1,513 3,647 1,914	101,004 92,472 68,996 78,503 105,752 254,883 133,750	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0	

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
(オーストラリア) VICINITY CENTRES			口 410,000	口 470,000	千豪ドル 672	千円 46,966
小計	口数・金額	2,671,000	3,253,000	12,626	882,329	% 0.0
	銘柄数 <比率>	8	8	—	<0.1%>	
合計	口数・金額	6,960,832	8,779,182	—	15,605,028	
	銘柄数 <比率>	65	69	—	<2.6%>	

\*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、このファンドが組み入れているマザーファンドの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 179	百万円 —
		EURO50	536	—
		FT100	275	—
		SPI200	113	—
		SPEMINI	3,821	—
		SWISSMKT	190	—

\*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。

# 国内株式マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11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**

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額	ベンチマーク指數					株組入式率	株先物比率	純資産額
		東証(	T	O	P	I	X)		
	期騰落率	期騰落率	期騰落率	期騰落率	期騰落率	期騰落率	期騰落率	期騰落率	期騰落率
15期(2016年5月10日)	円 12,439	% △14.8	1,334.90	% △16.5	97.7	% 2.3	百万円 279,492		
16期(2017年5月10日)	15,104	21.4	1,585.19	18.7	98.6	1.4	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		

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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	ベンチマーク指數					株組入式率	株先物比率	
		東証(	T	O	P	I	X)		
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率
(期首) 2019年5月10日	円 15,442	% —	1,549.42	% —	97.9	% 2.1			
5月末	15,075	△ 2.4	1,512.28	△ 2.4	97.4	2.6			
6月末	15,487	0.3	1,551.14	0.1	98.7	1.3			
7月末	15,629	1.2	1,565.14	1.0	99.0	1.0			
8月末	15,103	△ 2.2	1,511.86	△ 2.4	97.7	2.3			
9月末	16,014	3.7	1,587.80	2.5	97.6	2.2			
10月末	16,816	8.9	1,667.01	7.6	98.1	1.6			
11月末	17,143	11.0	1,699.36	9.7	97.9	2.1			
12月末	17,391	12.6	1,721.36	11.1	98.5	1.4			
2020年1月末	17,019	10.2	1,684.44	8.7	98.2	1.8			
2月末	15,269	△ 1.1	1,510.87	△ 2.5	97.2	2.8			
3月末	14,357	△ 7.0	1,403.04	△ 9.4	96.9	2.6			
4月末	14,978	△ 3.0	1,464.03	△ 5.5	97.7	2.3			
(期末) 2020年5月11日	15,150	△ 1.9	1,480.62	△ 4.4	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世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

国内株式市場は、期首から米中貿易摩擦懸念や協議の進展期待などから、一進一退の展開となりました。

2019年9月以降は、米中貿易協議の進展への期待や、英国の総選挙において保守党が大勝し英国のEU（欧州連合）離脱を巡る不透明感が薄らいだことなどを受けて堅調に推移しました。

2020年2月下旬以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に対する警戒感などを受けて大きく下落しました。3月下旬以降は、各国中央銀行が金融市场への大規模な下支え策を発表したことで先行きに対する過度な不安が和らいだことなどを受けて、上昇に転じました。

## ○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。

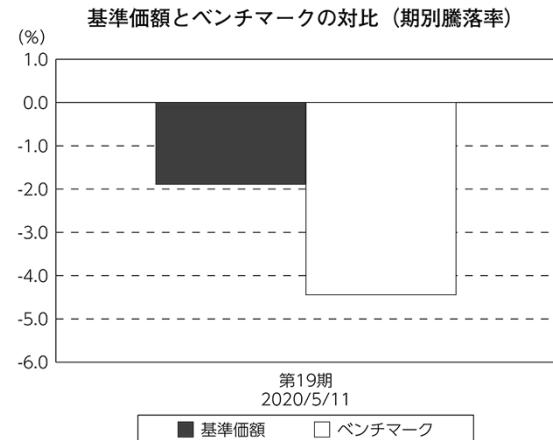
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

## ○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-1.9%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の-4.4%を2.5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未収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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (先物・オプション)	円 0 (0) (0)	% 0.002 (0.000) (0.000)	(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	0.002	
期中の平均基準価額は、15,856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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 株式

国内	上場	買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		千株 46,368 ( 3,368)	千円 83,822,209 ( -)	千株 19,754	千円 39,634,988

\*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

国内	内	買付		売付	
		証券数 — (322,700)	金額 千円 — (—)	証券数 269,800	金額 千円 1,078

\*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 135,157	百万円 132,342	百万円 —	百万円 —

\* 単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2019年5月11日～2020年5月11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	123,457,198千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	413,599,666千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29

\*(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

(2019年5月11日～2020年5月11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 83,822	百万円 41	% 0.0	百万円 39,634	百万円 2	% 0.0
新株予約権証券	—	—	—	1	1	100.0
貸付有価証券(株式)	349,684	11,254	3.2	365,752	10,317	2.8

\* 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
	百万円	百万円	百万円
株式	283	94	1,457

## 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
	百万円
株式	7

## 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)	8,406千円
うち利害関係人への支払額 (B)	18千円
(B) / (A)	0.2%

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

(2020年5月11日現在)

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
水産・農林業 (0.1%)		千株	千株	千円
極洋	7.7	9.4	24,270	
日本水産	235.6	269	128,851	
マルハニチロ	34	38.9	90,131	
カネコ種苗	7.1	8.1	11,574	
サカタのタネ	28.7	32.1	115,560	
ホクト	19.8	20.5	40,262	
ホクリヨウ	3.2	4.2	2,494	
鉱業 (0.2%)				
住石ホールディングス	50.8	54.3	6,190	
日鉄鉱業	5.4	6.2	28,117	
三井松島ホールディングス	9.9	10.4	9,058	
国際石油開発帝石	945.3	1,079.2	752,202	
石油資源開発	33.9	35.1	66,619	
K&Oエナジーグループ	11.4	13.1	20,462	
建設業 (2.7%)				
ヒノキヤグループ	6.6	6.7	11,999	
ショーボンドホールディングス	16.8	41.9	188,131	
ミライト・ホールディングス	66.3	79.9	115,775	
タマホーム	11.3	14.5	20,010	
サンヨーホームズ	3.4	2.3	1,414	
日本アクリ	7.5	10.7	6,794	
ファーストコーポレーション	7.2	8.2	4,075	
ベステラ	4.5	4.6	4,636	
TATERU	28.7	55.5	6,493	
キャンディル	—	4.5	2,254	
スペースパリューホールディングス	28.7	32.8	11,972	
ダイセキ環境ソリューション	4.5	5.2	5,610	
第一カッターアニメ	2.9	3.3	5,649	
明豊ファシリティワークス	—	8.6	5,160	
安藤・間	151.1	160.2	114,543	
東急建設	69	78.8	46,334	
コムシスホールディングス	83.6	95.4	285,436	
ミサワホーム	18.6	—	—	
ビーアールホールディングス	25.7	29.3	14,474	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
高松コンストラクショングループ	千株	千株	千円	
東建コーポレーション	14.7	16.7	39,194	
ソネック	7.3	8.3	61,171	
ヤマウラ	2.4	2.8	2,130	
大成建設	9.1	11.7	9,009	
大林組	193.5	207.1	732,098	
清水建設	583	621.2	591,382	
飛島建設	594.7	630.4	551,600	
長谷工コーポレーション	16.6	17.8	19,722	
松井建設	243.1	240.5	290,524	
錢高組	21.4	24.4	16,274	
鹿島建設	2.4	2.7	9,193	
不動テトラ	455.7	487.7	569,145	
大末建設	13.3	16.2	22,777	
鉄建建設	6.9	7.2	5,450	
西松建設	11.8	13.5	30,064	
三井住友建設	41.9	47.9	107,200	
大豊建設	140.2	150.1	69,646	
前田建設工業	13.2	13.9	32,873	
佐田建設	138.6	155.6	138,795	
ナカノフード建設	12.5	13.4	5,373	
奥村組	44.9	47.9	6,273	
東鉄工業	32	33.7	82,126	
イチケン	23.3	26.6	73,948	
富士ビー・エス	3.5	4.5	5,719	
浅沼組	8	9.2	4,802	
戸田建設	6.9	7	25,060	
熊谷組	226	258	168,216	
青木あすなろ建設	27.7	28.8	73,094	
北野建設	9.6	—	—	
植木組	4.1	3.8	9,750	
矢作建設工業	2.4	2.7	6,717	
ビーエス三義	26.4	27.4	22,057	
日本ハウスホールディングス	20.5	20.4	11,362	
大東建託	37.1	42.4	12,296	
	69.3	67.8	779,361	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新日本建設	23.1	26.4	20,354
N I P P O	51.5	51.4	127,369
東亜道路工業	3.7	3.9	11,469
前田道路	60.9	54.8	113,819
日本道路	5.3	6	40,080
東亜建設工業	17	19.4	28,518
日本国土開発	31.8	60.4	34,367
若築建設	9.8	11.2	13,496
東洋建設	71.2	69.6	31,250
五洋建設	231.1	246.3	138,420
世紀東急工業	28.3	29.8	24,078
福田組	6.3	7.2	30,528
住友林業	137.8	157.3	210,310
日本基礎技術	19.9	20.9	8,464
巴コーポレーション	24.2	27.6	10,846
大和ハウス工業	538.4	614.6	1,707,666
ライト工業	37.4	35.5	51,120
積水ハウス	595.3	679.6	1,277,987
日特建設	16.6	16.2	11,777
北陸電気工事	9.4	10.7	9,779
ユアテック	31.1	35.5	22,010
日本リーテック	—	13	26,000
四電工	3	3.4	7,850
中電工	25.1	25	55,500
関電工	88.5	88.4	81,681
きんでん	129.3	147.6	259,923
東京エネシス	20.1	20.6	15,594
トーエネック	5.5	6.2	21,235
住友電設	13.4	17.5	41,405
日本電設工業	33.2	34.1	72,394
協和エクシオ	76.2	94.2	251,043
新日本空調	16.3	16.4	36,834
九電工	38.3	43.6	132,326
三機工業	43.9	44.8	59,270
日揮ホールディングス	167.5	191.2	203,628
中外炉工業	5.5	6.7	10,612
ヤマト	17.4	19.9	12,636
太平電業	13.1	15	36,135
高砂熱学工業	47.3	54	92,556
三晃金属工業	2.3	2.7	5,767

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
朝日工業社	4	4.2	12,180
明星工業	35.2	40.2	31,758
大氣社	26.5	30.2	96,187
ダイダン	13	14.8	41,292
日比谷総合設備	17.5	20	36,820
東芝プラントシステム	42.1	—	—
フィル・カンパニー	—	3.6	10,310
O S J B ホールディングス	85.8	97.9	24,572
千代田化工建設	140.2	—	—
レイズネクスト	34.9	33.3	40,126
<b>食料品(4.0%)</b>			
日本製粉	55.2	58.2	100,045
日清製粉グループ本社	196.8	224.6	383,841
日東富士製粉	1.3	1.4	8,246
昭和産業	16	18.2	59,514
鳥越製粉	15.4	17.6	15,875
中部飼料	21.3	24.3	39,438
フィード・ワン	117	133.5	24,697
東洋精糖	2.6	3.4	4,090
日本甜菜製糖	9.9	10.4	17,981
三井製糖	13.7	17.4	38,367
塩水港精糖	18.9	21.5	4,493
日新製糖	8.2	9.4	17,954
森永製菓	43.8	46.7	208,282
中村屋	4.5	5.1	20,247
江崎グリコ	52.4	58.9	285,076
名糖産業	8.4	9.6	12,144
井村屋グループ	7.4	11.3	21,797
不二家	9.7	11.1	22,466
山崎製パン	142.4	149	279,226
第一屋製パン	3	3.4	3,107
モロゾフ	3	3.4	19,040
亀田製菓	10.8	11.3	57,630
寿スピリッツ	18.4	19.1	93,972
カルビー	79.4	90.6	296,262
森永乳業	34.9	36.8	150,880
六甲バター	12.7	13.2	18,559
ヤクルト本社	129	136.7	877,614
明治ホールディングス	123.4	131.5	992,825
雪印メグミルク	41.9	47.9	119,175

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
プリマハム	24.5	31.1	75,168	
日本ハム	72.1	76	286,520	
林兼産業	5.8	6.6	3,880	
丸大食品	18.6	21.2	42,103	
S Foods	15.6	15.9	38,160	
柿安本店	—	6.9	16,560	
伊藤ハム米久ホールディングス	112.1	128	81,536	
サッポロホールディングス	63.7	67.8	140,413	
アサヒグループホールディングス	364.7	416.4	1,587,733	
キリンホールディングス	787.8	843.1	1,751,540	
宝ホールディングス	130.4	147.4	121,310	
オエノンホールディングス	49.5	52.4	20,698	
養命酒製造	5.3	6.1	11,699	
コカ・コーラ ポトラーズジャパンホールディングス	133.3	139.5	287,509	
サンタリー食品インターナショナル	116.5	133	569,905	
ダイドーグループホールディングス	9.8	10.2	45,747	
伊藤園	52.9	60.4	367,836	
キーコーヒー	17.1	19.5	44,343	
ユニカフェ	4.8	5.1	4,676	
ジャパンフーズ	2.5	2.8	3,228	
日清オイオリグループ	22.4	25.6	91,904	
不二製油グループ本社	42.5	48.5	123,917	
かどや製油	1.9	2.2	8,261	
J-オイルミルズ	9	10.3	43,260	
キッコーマン	114.9	143.1	686,164	
味の素	384.6	439	833,880	
キユーピー	97	110.7	236,455	
ハウス食品グループ本社	65.1	74.4	261,516	
カゴメ	69.8	75.4	208,858	
焼津水産化学工業	8.4	9.6	8,966	
アリアケジャパン	15.9	18.2	113,568	
ピエトロ	2.3	2.6	4,186	
エバラ食品工業	4.2	4.8	10,689	
やまみ	—	1.7	3,468	
ニチレイ	90.5	94.7	255,500	
東洋水産	89.6	102.3	519,684	
イートアンド	6	6.9	12,233	
大冷	1.9	2.6	4,797	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4.7	11	12,584	
日清食品ホールディングス	74	84.5	744,445	

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	9.3	9.7	21,388	
一正蒲鉾	6.8	7.7	7,284	
フジッコ	18.9	21.5	41,710	
ロック・フィールド	18.8	21.4	28,119	
日本たばこ産業	1,005.6	1,148	2,333,884	
ケンコーマヨネーズ	9.8	11.1	22,200	
わらべや日洋ホールディングス	11.4	13	21,775	
なとり	9.7	11.1	19,869	
イフジ産業	3	3.5	2,758	
ピックルスコーポレーション	4.1	4.3	9,408	
北の達人コーポレーション	68.4	69.4	36,990	
ユーグレナ	74.3	85.7	57,076	
ミヨン油脂	6.7	7.6	8,664	
理研ビタミン	8.2	18.8	40,194	
繊維製品(0.5%)				
片倉工業	20.9	28.2	29,525	
グンゼ	11.4	14.2	53,605	
東洋紡	72	76.7	106,152	
ユニチカ	49.8	56.8	19,198	
富士紡ホールディングス	8.8	9.4	29,046	
倉敷紡績	16.2	19.2	47,539	
シキボウ	8.9	10.2	10,791	
日本毛織	55.9	63.8	60,673	
ダイトウボウ	27.5	31.4	4,082	
トーア紡コーポレーション	7.2	7.7	3,773	
ダイドーリミテッド	20.3	25.5	5,227	
帝国繊維	19.1	21.8	49,725	
帝人	138.6	158.3	267,210	
東レ	1,318.3	1,404.7	715,694	
サカイオーベックス	4.2	5.1	9,848	
住江織物	5	4.3	7,998	
日本フエルト	9.6	11	5,137	
イチカワ	2.4	2.7	3,728	
日東製綱	2	2.2	3,124	
アツギ	14	16	10,048	
ダイニック	6.9	7.3	5,416	
セーレン	41.8	47.7	62,296	
ゾトー	6.8	7.7	7,060	
東海染工	2.3	2.7	3,007	
小松マテーレ	27.9	31.8	22,705	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ワコールホールディングス	49.5	50.6	111,573	
ホギメディカル	21.1	22.1	75,140	
レナウン	49.1	49.8	3,834	
クラウディアホールディングス	4.2	4.8	2,006	
T S I ホールディングス	62.7	65.1	28,513	
マツオカコーポレーション	5.4	5.6	11,334	
ワールド	22.2	27.5	37,345	
三陽商会	10.2	10.1	9,908	
ナイガイ	6.2	7.1	2,953	
オンワードホールディングス	102.1	116.5	40,658	
ルックホールディングス	6.2	6.6	5,491	
ゴールドワイン	15.4	35.2	208,032	
デサント	41.4	37.8	53,865	
キング	9	9.1	4,495	
ヤマトイターナショナル	10.3	17	5,916	
パルプ・紙 (0.3%)				
特種東海製紙	10.8	12.3	50,614	
王子ホールディングス	765	811	475,246	
日本製紙	81.4	85.8	135,135	
三菱製紙	27.7	22	8,470	
北越コーポレーション	112.7	115.6	49,823	
中越パルプ工業	7.2	8.2	11,193	
巴川製紙所	5.6	5.8	5,080	
大王製紙	82.8	85.5	125,856	
阿波製紙	4.4	5	2,560	
レンゴー	175.2	183.4	160,841	
トーモク	10.4	11.9	21,086	
ザ・パック	12.9	14.7	49,024	
化学 (7.4%)				
クラレ	286.8	305.5	340,021	
旭化成	1,209	1,285.9	985,770	
共和レザー	10.6	10.5	7,045	
昭和電工	112.9	138.1	325,501	
住友化学	1,337.7	1,425.3	484,602	
住友精化	8.3	8.6	25,662	
日産化学	104.3	107.7	435,646	
ラサ工業	6	6.8	9,322	
クレハ	15.7	16.6	73,538	
多木化学	5	7.6	43,016	
ティカ	13.9	14.2	22,563	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
石原産業	32.6	34.8	23,698	
片倉コーブアグリ	4.9	5	5,875	
日東エフシー	11.8	—	—	
日本曹達	26.8	28.7	80,991	
東ソーラ	262.7	299.9	403,365	
トクヤマ	49	55.9	131,420	
セントラル硝子	37	39.6	75,081	
東亞合成	106.7	121.8	122,165	
大阪ソーダ	18.3	19.7	49,250	
関東電化工業	40.3	46	41,354	
デンカ	66.8	70.8	189,531	
信越化学工業	299.5	333.1	4,037,172	
日本カーバイド工業	5.7	6.6	7,425	
堺化学工業	11.3	12.5	23,287	
第一稀元素化学工業	18.4	21	15,960	
エア・ウォーター	139.2	180.4	273,125	
大陽日酸	140	186.4	309,610	
日本化学工業	5.8	6	14,274	
東邦アセチレン	2.5	2.9	3,726	
日本バカライジング	92.9	97.9	112,193	
高圧ガス工業	26.9	30.8	24,301	
チタン工業	2.1	2.4	4,216	
四国化成工業	28.6	29.9	32,142	
戸田工業	3.6	4.5	6,295	
ステラ ケミファ	10	10.6	25,249	
保土谷化学工業	5.9	7.2	26,532	
日本触媒	28.6	30.1	154,413	
大日精化工業	14	17.2	40,540	
カネカ	44	50.2	142,919	
三菱瓦斯化学	174.8	180.5	243,675	
三井化学	154.2	176.1	375,621	
J S R	170.5	180.8	359,068	
東京応化工業	29.2	33.3	152,514	
大阪有機化学工業	15.7	17.9	31,450	
三菱ケミカルホールディングス	1,136	1,296.9	806,282	
K H ネオケム	25.9	34.2	68,297	
ダイセル	250.3	252.6	224,056	
住友ベークライト	29.4	30.5	88,053	
積水化学工業	371.4	417.1	599,789	
日本ゼオン	153.3	175	169,400	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
アイカ工業	51	58.2	175,764	
宇部興産	85.8	98	179,536	
積水樹脂	28	34.9	79,327	
タキロンシーアイ	36.8	42	27,006	
旭有機材	11.7	11	14,850	
日立化成	78.6	89.7	413,517	
ニチバン	8.9	10.2	14,800	
リケンテクノス	46.3	48.8	20,935	
大倉工業	8.7	9.2	14,609	
積水化成品工業	25.3	26	16,744	
群栄化学工業	4.4	4.4	11,642	
タイガースポリマー	8.9	10.2	4,345	
ミライアル	4.9	6.8	7,813	
ダイキアクシス	6	6.9	5,161	
ダイキヨーニシカワ	35.8	40.9	23,313	
竹本容器	6.1	6.9	5,306	
森六ホールディングス	9.1	10.4	15,901	
日本化薬	108.1	120.1	124,663	
カーリットホールディングス	18.1	20.7	10,515	
日本精化	13.7	15.6	21,060	
扶桑化学工業	17.2	19.7	67,571	
トリケミカル研究所	3.8	4.3	41,280	
ADEKA	83.8	89.3	127,431	
日油	64	73	259,880	
新日本理化	30.7	32.1	5,906	
ハリマ化成グループ	14	16	15,264	
花王	421.2	474.3	4,007,835	
第一工業製薬	6.3	7.2	34,236	
石原ケミカル	4.3	5.3	10,128	
日華化学	5.7	6.5	5,837	
ニイタカ	2.6	4	11,036	
三洋化成工業	11.4	11.6	50,808	
有機合成薬品工業	13	14.9	5,289	
大日本塗料	19.2	21.9	21,177	
日本ペイントホールディングス	140.2	160.1	1,040,650	
関西ペイント	190.9	218	458,890	
神東塗料	13.4	15.3	2,799	
中国塗料	55.8	55.2	44,601	
日本特殊塗料	12.7	14.5	13,441	
藤倉化成	22.9	26.2	13,257	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
太陽ホールディングス	14	14.3	63,563	
D I C	76.9	81.9	205,487	
サカタインクス	37.1	42.3	42,003	
東洋インキ S C ホールディングス	35.9	41	81,713	
T & K TOKA	13.2	15	10,890	
富士フィルムホールディングス	360.4	379.8	1,979,897	
資生堂	344.8	393.6	2,559,580	
ライオン	241.7	257.5	601,262	
高砂香料工業	11.9	12.4	27,416	
マンダム	39	44.5	94,740	
ミルボン	21.4	26.5	130,645	
ファンケル	77.2	80.2	229,933	
コーセー	29.4	37.3	501,312	
コタ	9.1	11.4	13,668	
シーボン	2.1	2.6	5,655	
ボーラ・オルビスホールディングス	74.1	84.5	166,887	
ノエビアホールディングス	16.6	16.8	84,504	
アジュバンコスメジャパン	3.9	4.4	4,166	
エステー	12.4	12.7	19,799	
アグロ カネショウ	7	8.2	11,840	
コニシ	30.7	32.5	48,490	
長谷川香料	23	34.1	72,223	
星光PMC	11.6	11.3	7,548	
小林製薬	48.6	55.5	539,460	
荒川化学工業	15.6	17.8	24,208	
メック	11.9	13.6	23,296	
日本高純度化学	4.8	5.4	14,347	
タカラバイオ	45.4	51.8	129,189	
J C U	22.5	24	70,224	
新田ゼラチン	10.9	12.4	8,717	
O A T アグリオ	2.4	3.4	3,655	
デクセリアルズ	44.7	51.1	38,069	
アース製薬	13.1	14.9	91,188	
北興化学工業	17.8	20.3	11,652	
大成ラミック	5.7	6.5	17,355	
クミアイ化成工業	71.7	81.9	69,615	
日本農薬	30.9	35.3	15,355	
アキレス	12.6	13.7	22,454	
有沢製作所	27.3	31.3	24,914	
日東電工	119.7	136.7	740,914	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
レック	18.5	21.1	28,759	
三光合成	19.8	22.6	7,073	
きもと	29.5	33.7	4,886	
藤森工業	15.6	17.8	58,918	
前澤化成工業	11.9	12.6	13,406	
未来工業	9.3	10.6	20,288	
ウェーブロックホールディングス	4.8	6.8	5,038	
J S P	10.2	11.6	16,425	
エフピコ	19.1	21.8	173,310	
天馬	12	13.2	20,064	
信越ボリマー	31.2	35.6	30,046	
東リ	43.2	49.3	12,818	
ニフコ	69.5	72.7	153,542	
バルカー	14.1	16.1	30,058	
ユニ・チャーム	367.9	381.8	1,494,365	
ショーエイコーポレーション	1.4	2.9	2,146	
医薬品 (6.5%)				
協和キリン	203.6	199.3	514,592	
武田薬品工業	1,514.8	1,648.1	6,203,448	
アステラス製薬	1,599.8	1,717.5	3,100,087	
大日本住友製薬	128.6	146.8	222,989	
塩野義製薬	221.9	253.3	1,427,598	
田辺三菱製薬	181.5	—	—	
わかもと製薬	20.6	23.6	5,664	
あすか製薬	21.4	22.6	25,447	
日本新薬	45.4	51.8	367,262	
ビオフェルミン製薬	2.9	3.4	8,000	
中外製薬	180.9	206.5	2,627,712	
科研製薬	31.3	33.9	195,264	
エーザイ	207.7	237.1	1,764,024	
ロート製薬	89	101.7	310,185	
小野薬品工業	409.8	454.9	1,197,069	
久光製薬	51.3	52.4	265,144	
持田製薬	26.3	27.5	114,537	
参天製薬	323	369	707,004	
扶桑薬品工業	6.1	7	16,590	
日本ケミファ	2.3	2.6	6,689	
ツムラ	53.8	61.4	181,130	
日医工	45.6	56.1	81,569	
キッセイ薬品工業	30.7	35	91,420	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
生化学工業	33.7	38.4	42,777	
榮研化学	30.5	34.8	64,032	
日水製薬	7.3	8.3	10,275	
鳥居薬品	9.3	12.4	36,815	
J C R フアーマ	12.2	14	150,080	
東和薬品	25	25.3	57,937	
富士製薬工業	11.8	13.5	15,565	
沢井製薬	35.6	40.7	246,642	
ゼリア新薬工業	34.3	35.9	74,061	
第一三共	496.5	566.8	4,327,518	
キヨーリン製薬ホールディングス	38.3	43.7	97,888	
大幸薬品	7.7	24.2	41,285	
ダイト	10.1	11.9	47,540	
大塚ホールディングス	330.6	377.4	1,600,930	
大正製薬ホールディングス	38.8	41.9	285,758	
ペプチドリーム	86.9	100.7	428,982	
石油・石炭製品 (0.4%)				
日本コクス工業	146.6	167.3	10,038	
ニチレキ	22.2	23.4	34,725	
ニシロ化学工業	9	11.1	12,776	
ビービー・カストロール	6.2	7.1	8,356	
富士石油	42.1	52.9	9,363	
M O R E S C O	6.3	7.2	6,760	
出光興産	200.3	219.8	541,587	
J X T G ホールディングス	2,918.5	2,979.9	1,135,639	
コスモエネルギーホールディングス	50.2	57.3	92,081	
ゴム製品 (0.6%)				
横浜ゴム	100.5	114.7	161,153	
T O Y O T I R E	89.1	113.7	147,696	
ブリヂストン	533.3	570.6	1,952,593	
住友ゴム工業	155.9	177.9	187,506	
藤倉コンポジット	15.2	17.3	6,452	
オカモト	12.1	12.1	51,727	
フコク	7.6	8.7	5,385	
ニッタ	19.6	22.3	46,807	
住友理工	33.6	38.4	22,195	
三ツ星ベルト	22.8	26.1	39,202	
バンドー化学	33.1	34.8	22,898	
ガラス・土石製品 (0.8%)				
日東紡績	25.8	29.5	151,040	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
A G C	171.5	195.8	538,450	
日本板硝子	83	94.8	36,024	
石塚硝子	2.9	3.6	7,700	
日本山村硝子	7.2	8.2	7,101	
日本電気硝子	75.1	79.6	129,111	
オハラ	6.9	7.8	7,246	
住友大阪セメント	35	37.5	137,812	
太平洋セメント	109.6	125.1	283,101	
日本ヒューム	17.4	19.9	13,114	
日本コンクリート工業	37.3	42.6	11,161	
三谷セキサン	8.1	9.2	44,160	
アジアパイルホールディングス	24.6	28.1	12,195	
東海カーボン	157.5	207.5	179,902	
日本カーボン	8.3	10.2	34,782	
東洋炭素	10.2	11.6	18,200	
ノリタケカンパニーリミテド	10.4	11	39,435	
T O T O	133.5	141.5	566,000	
日本碍子	211.7	237.8	340,054	
日本特殊陶業	146.3	150.7	247,750	
ダントーホールディングス	14.5	14.8	1,272	
MARUWA	6	7.6	59,584	
品川リフラクトリーズ	4.6	5.2	12,048	
黒崎播磨	3.4	3.9	15,697	
ヨータイ	15.2	15.7	9,498	
イソライト工業	8.9	10.2	4,732	
東京窯業	22	25.2	7,560	
ニッカトー	7.8	9	5,409	
フジミインコーポレーテッド	15.5	17.6	53,944	
クニミネ工業	7.8	8	8,472	
エーアンドエーマテリアル	3.4	3.3	3,930	
ニチアス	47.5	54.2	120,324	
ニチハ	24.1	27.5	63,057	
鉄鋼 (0.6%)				
日本製鉄	797.3	876.6	862,136	
神戸製鋼所	314.1	358.5	134,796	
中山製鋼所	23.8	27.2	10,444	
合同製鐵	8.3	10.5	21,840	
ジェイ エフ イー ホールディングス	463.4	529	395,692	
東京製鐵	91.9	95.4	74,030	
共英製鋼	19.3	22.1	31,315	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
大和工業	36.5	41.6	90,355	
東京鐵鋼	7.1	8.1	10,230	
大阪製鐵	11.4	10.4	12,864	
淀川製鋼所	23.2	26.4	46,728	
丸一鋼管	60.8	63.6	160,590	
モリ工業	5.1	5.9	14,030	
大同特殊鋼	28.1	32.1	116,683	
日本高周波鋼業	6.3	7.2	2,764	
日本冶金工業	141.9	16.2	28,755	
山陽特殊製鋼	21.6	13.4	14,070	
愛知製鋼	9.6	11	31,306	
日立金属	184.8	211	226,192	
日本金属	4	4.5	2,920	
大平洋金属	11.6	13.2	21,832	
新日本電工	102.8	126.2	19,813	
栗本鐵工所	8.7	9.7	17,945	
虹技	2.5	2.9	3,355	
日本鑄鐵管	1.8	2	2,674	
三菱製鋼	12.7	14.5	10,889	
日亜鋼業	25.1	28.6	7,807	
日本精線	2.4	3.2	9,497	
エンビプロ・ホールディングス	6.5	8.4	4,989	
シンニッタン	26.7	30.4	8,177	
新家工業	3.9	4.5	5,008	
非鉄金属 (0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	28.2	32.2	18,998	
日本軽金属ホールディングス	467.5	495.6	86,234	
三井金属鉱業	46.3	52.9	113,153	
東邦亜鉛	9.5	10	14,440	
三菱マテリアル	113.3	129.4	294,385	
住友金属鉱山	235	250.4	718,147	
D O W A ホールディングス	40.1	49.6	154,752	
古河機械金属	28.3	34.8	37,932	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19.8	20.4	20,359	
東邦チタニウム	30.7	35.1	22,358	
U A C J	26	29.7	53,014	
C Kサンエツ	3.2	4.1	12,279	
古河電気工業	49.5	60.8	126,524	
住友電気工業	641.5	732.4	830,541	
フジクラ	207.2	236.5	77,808	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
昭和電線ホールディングス	19.9	22.7	27,603	
東京特殊電線	2.2	2.9	7,136	
タツタ電線	34	38.8	21,301	
カナレ電気	2.8	3.2	5,280	
平河ヒューテック	7.1	9.8	10,476	
リヨービ	21.1	24.1	32,077	
アーレスティ	21.1	25.7	10,125	
アサヒホールディングス	32.2	34.3	90,483	
<b>金属製品 (0.69%)</b>				
稻葉製作所	9.7	11	15,059	
宮地エンジニアリンググループ	5.2	6	9,900	
トーカロ	44.3	54.4	61,254	
アルファCo	6	6.9	6,520	
SUMCO	189.6	234.5	384,345	
川田テクロジーズ	3.8	4	20,400	
R S T e c h n o l o g i e s	3.4	5.5	16,043	
信和	9	11.3	8,181	
東洋製罐グループホールディングス	109.3	124.8	138,652	
ホッカンホールディングス	8.7	10.8	16,977	
コロナ	9.5	10.8	10,584	
横河ブリッジホールディングス	31.9	36.4	68,432	
駒井ハルティック	3.2	3.7	5,679	
高田機工	1.6	1.8	4,068	
三和ホールディングス	177.2	184.7	158,842	
文化シヤッター	50.6	57.7	46,621	
三協立山	23.8	25.2	23,360	
アルインコ	13.6	14.2	13,461	
東洋シヤッター	4.1	4.7	3,290	
LIXILグループ	253.2	289	404,889	
日本フイルコン	13.1	15	7,860	
ノーリツ	38.3	40.6	51,480	
長府製作所	17.4	19.9	46,685	
リンナイ	30.6	38.1	335,280	
ダイニチ工業	9.2	10.5	7,308	
日東精工	23.7	27	12,798	
三洋工業	2.3	2.6	4,893	
岡部	34.8	39.7	31,283	
ジーテクト	18.9	24.3	27,604	
中国工業	2.6	—	—	
東プレ	32	36.5	48,691	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
高周波熱鍊		33	37.7	22,582
東京製綱		10.5	14	7,980
サンコール		9.6	14.7	6,056
モリテック スチール		13.4	15.3	4,452
パイオラックス		27.5	29	47,357
エイチワン		16.8	19.2	10,867
日本発條		170.9	210.1	153,373
中央発條		2.1	2.4	6,604
アドバネクス		2.2	2.8	3,838
立川ブライド工業		7.6	8.6	9,442
三益半導体工業		15.3	15.3	33,537
<b>機械 (5.19%)</b>				
日本ドライケミカル		4.6	4.9	6,982
日本製鋼所		52	59.4	81,199
三浦工業		74.2	84.8	376,512
タクマ		62.6	66.4	81,672
ツガミ		38.5	40.6	41,533
オーカマ		21.8	22.8	100,548
芝浦機械		19.4	22.1	48,818
アマダ		257.8	242.9	238,284
アイダエンジニアリング		46.3	51.3	37,500
滝澤鉄工所		5.3	6.1	6,612
F U J I		68.5	84.2	150,886
牧野フライス製作所		20.1	23	79,350
オーエスジー		84.5	90.5	132,311
ダイジェット工業		1.9	2.2	2,730
旭ダイヤモンド工業		45	51.4	25,854
DMG森精機		108.6	123.9	149,299
ゾディック		37.4	46	36,202
ディスコ		23.2	26.5	664,090
日東工器		9.4	10.7	21,260
日進工具		5.1	7.7	21,444
パンチ工業		11.9	17.7	6,460
富士ダイス		7.5	8.6	5,142
豊和工業		9.5	10.8	7,808
O K K		7	8	3,952
東洋機械金属		12.3	14	5,796
津田駒工業		3.7	3.8	3,062
エンシュウ		4.4	4.7	4,826
島精機製作所		23.7	30.8	51,374

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
オプトラン	16.7	21.8	67,362	
NCホールディングス	5.5	5.9	3,180	
イワキポンプ	7.3	12.4	12,238	
フリュー	13.7	19.1	16,999	
ヤマシンフィルタ	29.8	42.6	36,678	
日阪製作所	21.2	24.2	17,787	
やまびこ	33.3	38	33,098	
平田機工	8.1	9.3	50,034	
ペガサスミシン製造	16.1	19.8	6,652	
マルマエ	7	7.2	6,436	
タツモ	7.1	9.1	11,356	
ナブテスコ	94.4	115.4	380,820	
三井海洋開発	18.2	20.8	34,715	
レオン自動機	16.8	19.2	25,382	
SMC	50.8	62.1	3,174,552	
ヤマハモーターロボティクスホールディング	13	—	—	
ホソカワミクロン	6	6.9	35,259	
ユニオントール	7.5	7.3	20,921	
オイレス工業	24	25.3	34,762	
日精エー・エス・ピー機械	5.8	5.7	17,556	
サトーホールディングス	20.7	27.9	64,170	
技研製作所	15	17.2	70,004	
日本エアーテック	5.4	6.6	7,590	
カワタ	4.7	5.8	4,355	
日精樹脂工業	14.4	16.4	15,908	
オカダアイヨン	5.9	6.2	5,487	
ワイエイシホールディングス	6.8	8.4	3,872	
小松製作所	785.6	897.2	1,883,222	
住友重機械工業	99.3	113.4	263,314	
日立建機	69.5	79.4	206,360	
日工	4.7	27.1	15,880	
巴工業	7.4	8.4	15,909	
井関農機	17.3	19.8	23,799	
TOWA	14.8	20	19,180	
丸山製作所	3.8	4	5,388	
北川鉄工所	7.8	8.9	14,596	
ローツェ	7.6	8.7	41,716	
タカキタ	6	6.9	3,670	
クボタ	929.6	1,050.9	1,434,478	
荏原実業	5.1	5	11,295	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
三菱化工機	6	6.8	10,880	
月島機械	34.4	36.5	45,807	
帝国電機製作所	12.1	16.3	21,271	
東京機械製作所	6.8	8.1	1,984	
新東工業	41.2	47	36,613	
澁谷工業	15.2	17.3	46,450	
アイチ コーポレーション	30	34.2	24,042	
小森コーポレーション	47	50.2	38,854	
鶴見製作所	13.5	15.2	28,469	
住友精密工業	2.9	2.9	6,391	
日本ギア工業	—	7.9	2,117	
酒井重工業	3.2	3.7	7,788	
荏原製作所	76.9	81.9	199,098	
石井鐵工所	2.6	2.6	6,299	
西島製作所	17.7	20	14,780	
北越工業	17.9	20.4	20,930	
ダイキン工業	236.9	252.4	3,546,220	
オルガノ	6.2	7.1	41,606	
トヨーカネツ	6.5	8.6	16,692	
栗田工業	93.9	107.2	330,176	
椿本チエイン	22.7	28.3	74,259	
大同工業	8.2	9.4	5,969	
木村化工機	14.4	16.5	7,293	
アネスト岩田	27	30.8	26,210	
ダイフク	95.5	101.2	750,904	
サムコ	4.8	4.9	9,167	
加藤製作所	8.9	10.8	13,262	
油研工業	2.9	3.3	4,662	
タダメ	83.7	95.6	78,965	
フジテック	63.1	72	114,264	
C K D	48.3	54.3	101,866	
キトー	13.1	15	16,860	
平和	48.4	55.2	106,536	
理想科学工業	15.3	17.5	26,425	
SANKYO	43.4	44.1	133,623	
日本金銭機械	19.2	21.9	13,030	
マースグループホールディングス	11	12.6	21,470	
フクシマガリレイ	10.7	12.2	39,650	
オービズミ	7.3	8.3	3,452	
ダイコク電機	8	9.1	11,784	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
竹内製作所	29	33.1	56,567	
アマノ	49.6	51.9	117,761	
J U K I	24.1	27.6	17,884	
サンデンホールディングス	21.2	25.9	9,531	
蛇の目ミシン工業	15.8	18	8,046	
マックス	26.5	30.2	50,041	
グローリー	48.1	50.9	127,962	
新晃工業	16.1	18.4	25,778	
大和冷機工業	25.1	28.6	27,742	
セガサミーホールディングス	172.1	196.5	271,366	
日本ピストンリング	6.3	7.2	8,503	
リケン	8	9.2	25,695	
T P R	23.3	26.6	34,766	
ツバキ・ナカシマ	26.3	40.4	32,966	
ホシザキ	50.7	57.9	485,202	
大豊工業	14.1	16.1	8,983	
日本精工	356.4	372.9	295,709	
N T N	372.9	458.4	100,848	
ジェイテクト	166.4	190	155,040	
不二越	16.1	18.4	61,732	
日本トムソン	51.5	58.8	23,167	
T H K	108.2	115.2	309,657	
ユーシン精機	13.4	15.3	10,725	
前澤給装工業	6.8	7.2	15,177	
イーグル工業	21.4	24.5	17,787	
前澤工業	11.5	13.2	4,659	
日本ピラー工業	17.5	20	25,900	
キツツ	70.3	80.3	57,013	
マキタ	211.2	258.3	891,135	
日立造船	137.5	157	56,834	
三菱重工業	290.8	332	910,510	
I H I	133.3	142.7	197,068	
スター精密	29.6	30.5	37,423	
電気機器 (14.7%)				
日清紡ホールディングス	96.3	132	101,640	
イビデン	106.2	121.3	346,190	
コニカミノルタ	379.1	432.8	175,716	
プラザー工業	226	241.9	465,415	
ミネベアミツミ	322.1	367.7	689,437	
日立製作所	781.1	951.8	3,110,482	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
三菱電機	1,735.1	1,980.7	2,697,713	
富士電機	112.6	119.4	329,305	
東洋電機製造	6.8	7.2	9,172	
安川電機	201.1	213.2	750,464	
シンフォニアテクノロジー	24.1	25.6	27,520	
明電舎	34.3	36.4	63,299	
オリジン	4.7	5.4	8,040	
山洋電気	8.4	9.6	46,128	
デンヨー	16	16.9	33,935	
東芝テック	21.7	24.8	88,164	
芝浦メカトロニクス	3.1	3.5	10,433	
マブチモーター	48	54.8	179,470	
日本電産	208.8	476.7	2,975,561	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9.4	11.9	3,974	
トレックス・セミコンダクター	7.8	11.4	12,346	
東光高岳	8.8	11	10,593	
ダブル・スコープ	25.3	31.3	13,333	
ダイヘン	19	21.7	71,067	
ヤーマン	25.1	32.3	23,094	
J V Cケンウッド	132.5	161.4	28,245	
ミマキエンジニアリング	15.5	17.7	7,434	
第一精工	7.2	8.1	17,973	
日新電機	40.7	46.4	50,808	
大崎電気工業	34.5	39.4	20,645	
オムロン	184.4	177.6	1,193,472	
日東工業	27.8	29.1	53,253	
I D E C	23.3	28.6	48,791	
正興電機製作所	3.1	4.7	4,352	
不二電機工業	1.9	3.3	4,128	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62.4	66.1	105,693	
サクサホールディングス	4.4	4.6	8,105	
メルコホールディングス	7.2	6.8	17,795	
テクノメディカ	3.9	4.4	8,276	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	—	4.3	2,154	
日本電気	224.5	240.3	1,030,887	
富士通	167.3	191	2,026,510	
沖電気工業	75.2	80.5	87,503	
岩崎通信機	8.1	8.7	7,334	
電気興業	9.1	9.5	25,099	
サンケン電気	20.3	21.6	50,004	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ナカヨ	3.4	3.8	5,152	
アイホン	9.8	11.2	17,841	
ルネサスエレクトロニクス	179.8	947.1	558,789	
セイコーエプソン	215.3	245.8	296,434	
ワコム	125.6	133.2	60,872	
アルパック	34.6	36.4	109,382	
アクセル	7.2	8.3	6,083	
E I Z O	15.9	15.4	54,901	
ジャパンディスプレイ	410.3	—	—	
日本信号	44.2	50.4	53,928	
京三製作所	37.2	46.4	23,896	
能美防災	22.9	26.2	54,365	
ホーチキ	11	14.4	19,339	
星和電機	9.3	9.8	5,880	
エレコム	16.4	21.9	97,893	
パナソニック	1,982.2	2,263.1	1,856,647	
シャープ	172.1	229.2	259,912	
アンリツ	111.7	127.5	281,137	
富士通ゼネラル	53	53.8	100,121	
ソニー	1,164.2	1,240.8	8,758,807	
T D K	90.8	95.6	912,980	
帝国通信工業	7.6	8.7	10,413	
タムラ製作所	66.9	66.2	30,584	
アルプスアルバイン	180.6	175.3	221,403	
池上通信機	5.5	6.3	5,607	
日本電波工業	15.7	17.9	7,374	
鈴木	9.3	9.7	7,071	
日本トリム	3.3	2.7	9,166	
ローランド ディー. ジー.	8.9	10.9	15,467	
フォスター電機	19.6	20.8	25,480	
S MK	4.8	5.1	13,402	
ヨコオ	12.4	12.8	33,446	
ティアック	12.5	14.2	2,158	
ホシデン	51.1	54.1	48,149	
ヒロセ電機	24.9	30.7	372,084	
日本航空電子工業	39.8	45.4	67,827	
T O A	18.6	21.2	15,348	
マクセルホールディングス	37.4	42.6	43,409	
古野電気	22.3	25.5	21,471	
ユニデンホールディングス	5.1	5.4	10,449	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
スマダコーポレーション	14.8	15.2	10,852	
アイコム	9.6	11	28,600	
リオン	7.9	8.3	19,148	
本多通信工業	14.8	16.9	7,081	
船井電機	17.5	20	8,440	
横河電機	173.7	181.7	273,821	
新電元工業	6.1	7	17,549	
アズビル	112	125	354,500	
東亜ディーケーケー	8.6	9.8	8,633	
日本光電工業	76.5	81.9	316,134	
チノー	6	6.8	9,520	
共和電業	18.1	20.7	8,010	
日本電子材料	6.9	7.8	7,581	
堀場製作所	34.4	39.2	229,320	
アドバンテスト	118.3	147.3	780,690	
小野測器	7.9	8.3	4,150	
エスパック	15.4	17.6	31,275	
キーエンス	85.2	179.5	7,178,205	
日置電機	9.1	10.3	33,114	
シスメックス	135.2	141.6	1,054,920	
日本マイクロニクス	30.2	34.5	31,878	
メガチップス	13.7	18.4	29,311	
O B A R A G R O U P	9	11.6	34,104	
澤藤電機	2.1	2.4	6,024	
原田工業	7	9.4	7,961	
コーセル	22.1	26.4	23,311	
イリソ電子工業	15.9	16.6	55,693	
オブテックスグループ	30.5	32.5	42,380	
千代田インテグレ	7.3	9.2	16,311	
アイ・オー・データ機器	6.4	6.4	6,483	
レーザーテック	35.6	87	662,070	
スタンレー電気	122.7	139.3	346,578	
岩崎電気	6.7	7.7	11,881	
ウシオ電機	100.8	109.3	126,678	
岡谷電機産業	12.3	15.5	4,944	
ヘリオス テクノ ホールディング	16	18.2	6,133	
エノモト	4.8	5.9	6,389	
日本セラミック	17.6	20.1	40,843	
達藤照明	8.8	10	5,750	
古河電池	12.4	14.1	7,994	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
双信電機	8.4	9.6	3,321	
山一電機	12.6	14.3	22,350	
岡研	11.3	12.9	33,810	
日本電子	34.2	39.1	134,113	
カシオ計算機	153.5	175.2	296,964	
ファナック	164.9	188.2	3,356,547	
日本シエムケイ	44.2	46.5	20,506	
エンプラス	7.9	10.1	23,674	
大真空	6.3	7.2	12,960	
ローム	83	87.9	626,727	
浜松ホトニクス	124.4	142.1	668,580	
三井ハイテック	19.1	21.8	28,776	
新光電気工業	58.3	66.5	91,437	
京セラ	264.5	278.7	1,609,771	
太陽誘電	77.2	88.1	276,634	
村田製作所	546.1	581.9	3,521,076	
ユーシン	9.1	—	—	
双葉電子工業	28.4	31.3	31,800	
北陸電気工業	6.5	8	7,536	
ニチコン	54.6	67.2	48,249	
日本ケミコン	12.3	15.1	19,222	
K O A	26.2	29.9	28,345	
市光工業	25.9	29.6	15,155	
小糸製作所	103.9	118.7	494,979	
ミツバ	31.9	36.4	17,544	
S C R E E Nホールディングス	30.1	34.4	184,040	
キヤノン電子	15.9	20.8	32,676	
キヤノン	934.1	1,066.3	2,402,373	
リコー	521.7	503.9	389,514	
象印マホービン	43	58	95,410	
MUTOHホールディングス	2.4	2.5	3,382	
東京エレクトロン	115.7	125.7	2,855,904	
輸送用機器 (7.4%)				
トヨタ紡織	60.7	57.7	79,626	
芦森工業	3.6	4.1	3,509	
ユニプレス	33.6	38.4	38,092	
豊田自動織機	140.4	160.3	883,253	
モリタホールディングス	30.3	34.6	57,332	
三櫻工業	22	25.1	18,423	
デンソー	382	436.1	1,685,526	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
東海理化電機製作所	45.7	52.2	75,637	
三井E & Sホールディングス	62.7	71.5	45,402	
川崎重工業	135	154.1	258,888	
名村造船所	52.1	63.7	11,147	
サノヤスホールディングス	22.8	24.1	3,783	
日本車輌製造	6.3	7.2	19,015	
三菱ロジスネクスト	20.6	26.2	28,086	
近畿車輛	2.6	3	3,342	
日産自動車	2,046.3	2,336.1	887,718	
いすゞ自動車	548.5	573.9	513,238	
トヨタ自動車	1,933.6	2,210.2	14,715,511	
日野自動車	216.7	247.4	168,974	
三菱自動車工業	642.3	733.2	226,558	
エフテック	12.1	13.8	6,624	
レシップホールディングス	6.2	7.7	3,749	
G M B	3.4	3.5	2,320	
ファルテック	3	3.5	2,397	
武蔵精密工業	42.1	44.1	40,042	
日産車体	33.9	38.7	35,062	
新明和工業	72.7	53.4	59,487	
極東開発工業	34.5	36.8	45,411	
日信工業	31.7	40.3	89,345	
トピー工業	14.3	16.3	21,499	
ティラド	6.3	7.2	10,332	
タチエス	28.5	32.5	31,850	
N O K	93.3	106.5	134,829	
フタバ産業	48.3	55.1	27,880	
K Y B	18	22.2	49,483	
大同メタル工業	28.2	38	21,128	
プレス工業	86	98.2	25,433	
ミクニ	22	25.1	6,576	
太平洋工業	36.3	41.5	41,873	
ケーヒン	39.9	45.5	116,025	
河西工業	21.3	26.7	14,444	
アイシン精機	142.9	163.1	525,997	
マツダ	544.6	582.8	368,329	
今仙電機製作所	16.1	18.4	14,444	
本田技研工業	1,463.7	1,559.6	4,076,794	
スズキ	317.4	392.6	1,414,537	
S U B A R U	538.7	614.9	1,365,385	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
安永	8.4	9.5	9,661	
ヤマハ発動機	245.1	258.3	372,468	
ショーワ	41	46.8	105,674	
T B K	20.6	23.5	10,739	
エクセディ	23.6	26.9	45,541	
豊田合成	56	64	135,424	
愛三工業	27.2	31	17,515	
盟和産業	2.6	3	2,832	
日本プラスチ	13.6	15.5	7,238	
ヨロズ	16.2	18.5	21,589	
エフ・シー・シー	31.2	32.4	53,006	
シマノ	69.9	74.1	1,336,023	
ティ・エス・テック	40.3	46	134,964	
ジャムコ	8.7	9.9	6,840	
精密機器 (2.5%)				
テルモ	491	560.5	1,967,915	
クリエートメディック	5.7	6.5	6,435	
日機装	56	59.4	50,905	
日本エム・ディ・エム	—	11.4	18,433	
島津製作所	223.3	236.7	639,800	
J M S	16	16.7	13,961	
クボテック	3.7	5.1	1,749	
長野計器	13.6	14.3	11,640	
ブイ・テクノロジー	4.1	9.3	39,199	
東京計器	11	12.6	9,664	
愛知時計電機	2.3	2.6	11,479	
インターラクション	8.8	10.6	25,853	
オーバル	16.9	17.7	4,088	
東京精密	31.4	35.9	127,804	
マニー	23	78.9	194,251	
ニコン	302.3	302.5	300,685	
トブコン	93.2	99.7	87,536	
オリンパス	1,033.9	1,096	1,828,128	
理研計器	15.3	17.5	34,597	
タムロン	15.4	16	29,616	
HO Y A	349.3	395.6	3,849,979	
シード	7.4	8.4	6,804	
ノーリツ鋼機	13.6	13.4	16,723	
エー・アンド・ディ	15.8	18.1	14,208	
朝日インテック	73.6	224.3	627,367	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
シチズン時計	189.8	232	89,552	
リズム時計工業	5.9	6.2	3,906	
大研医器	13.7	13.7	8,987	
メニコン	23.8	28.1	126,309	
シンシア	2.6	2.1	758	
松風	8.5	8.9	14,409	
セイコーアーモンド	26.8	28	52,472	
ニプロ	120.1	137.1	168,495	
その他製品 (2.4%)				
中本パックス	4.8	5	7,425	
スノーピーク	6.7	10.6	9,709	
バラマウントベッドホールディングス	20	20.9	94,259	
トランザクション	11	10.8	10,594	
粧美堂	5.1	5.8	2,122	
ニホンフラッシュ	7.4	18.5	22,995	
前田工織	19.1	21.8	45,147	
永大産業	22.7	25.9	7,329	
アートネイチャー	18.5	21.2	14,691	
バンダイナムコホールディングス	179.4	204.8	1,122,918	
アイフィスジャパン	3.9	5	3,575	
共立印刷	28.8	33	4,785	
S H O E I	8.3	17.3	40,897	
フランスベッドホールディングス	24.5	28	24,920	
バイロットコーポレーション	30.3	32.3	119,510	
萩原工業	9.6	11	14,674	
トッパン・フォームズ	37.2	42.4	40,831	
フジシールインターナショナル	38.9	44.4	83,028	
タカラトミー	72.6	88.8	81,607	
廣済堂	16.1	13.8	11,040	
エステールホールディングス	4.6	5.3	3,238	
アーク	66.2	75.6	6,804	
タカノ	6.8	7.7	5,490	
プロネクサス	14.9	17	18,938	
ホクシン	10.7	12.2	1,427	
ウッドワン	5.8	6.7	7,162	
大建工業	13.1	13.3	21,679	
凸版印刷	244.9	279.6	434,498	
大日本印刷	244.5	259.2	572,054	
図書印刷	16.3	—	—	
共同印刷	5.3	6.1	17,293	

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	千 株	千 株	千 円
N I S S H A		35.6	40.7	33,414			
光村印刷		1.5	1.7	2,721			
TAKARA & COMPANY		8.4	9.5	17,774			
アシックス		163.7	163.5	173,800			
ツツミ		5.4	6.2	10,056			
小松オール工業		5.3	6	11,304			
ヤマハ		103.2	117.8	526,566			
河合楽器製作所		5.3	6.1	18,696			
クリナップ		16.1	18.4	9,733			
ビジョン		104.9	119.7	490,171			
オリバー		—	4.2	11,550			
兼松サステック		1.1	1.3	1,968			
キングジム		14.4	16.5	14,850			
リンテック		41.3	47.1	113,463			
イトーキ		31.9	42.1	14,524			
任天堂		99.3	121.5	5,302,260			
三菱鉛筆		28.6	32.6	46,063			
タカラスタンダード		35.8	40.9	65,071			
コクヨ		83.2	95	128,155			
ナカバヤシ		17.1	19.5	10,666			
グローブライド		8.4	8.9	19,482			
オカムラ		60.5	69.1	55,971			
美津濃		17.2	18	34,668			
電気・ガス業 (1.7%)							
東京電力ホールディングス		1,385.1	1,581.3	580,337			
中部電力		530.8	606	867,792			
関西電力		708	750.5	789,526			
中国電力		239.9	285.7	410,836			
北陸電力		170	181.1	131,659			
東北電力		406.4	494.8	517,066			
四国電力		156.2	178.4	144,325			
九州電力		357.6	408.3	353,587			
北海道電力		162.4	185.4	77,682			
沖縄電力		32.1	36.7	76,592			
電源開発		138.1	157.6	315,515			
エフオン		8.2	10.6	5,713			
イーレックス		30.1	28.2	43,005			
レノバ		28.5	33.1	28,399			
東京瓦斯		340.4	380.9	958,153			
大阪瓦斯		336.7	384.4	785,329			

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	千 株	千 株	千 円
東邦瓦斯		85.9	97.4	540,570			
北海道瓦斯		9.3	10.6	16,642			
広島ガス		35.7	40.8	14,647			
西部瓦斯		19.5	22.3	58,582			
静岡ガス		53.4	56.2	53,727			
メタウォーター		8.4	9.6	41,616			
陸運業 (4.4%)							
S B S ホールディングス		17.1	17.1	32,712			
東武鉄道		183	206.5	758,887			
相鉄ホールディングス		59.5	63.4	179,929			
東急		471.3	499.6	832,333			
京浜急行電鉄		237.7	254.4	464,280			
小田急電鉄		277.9	294.6	706,156			
京王電鉄		97	102.8	599,324			
京成電鉄		130	137.8	438,204			
富士急行		23.7	27	88,290			
新京成電鉄		4.5	5.1	10,924			
東日本旅客鉄道		308.5	348.6	2,861,308			
西日本旅客鉄道		155.5	176.5	1,186,962			
東海旅客鉄道		155.4	164.7	2,951,424			
西武ホールディングス		214.9	265.8	351,121			
鴻池運輸		27.6	31.5	37,075			
西日本鉄道		48.1	54.9	146,308			
ハマキヨウレックス		13.3	15.2	48,032			
サカイ引越センター		9.1	10.4	58,240			
近鉄グループホールディングス		164.3	187.6	994,280			
阪急阪神ホールディングス		219.2	250.2	979,533			
南海電気鉄道		73.3	88.9	222,872			
京阪ホールディングス		73.2	83.5	403,305			
神戸電鉄		4.2	4.5	17,257			
名古屋鉄道		134.8	154.2	486,501			
山陽電気鉄道		12.6	13.4	28,984			
日本通運		63.4	64.9	340,076			
ヤマトホールディングス		288.1	328.9	632,145			
山九		45.7	52.1	218,299			
丸運		9.4	10.7	2,428			
丸全昭和運輸		13.3	15.2	37,665			
センコーグループホールディングス		90.6	103.4	91,715			
トナミホールディングス		3.9	4.5	23,130			
ニッコンホールディングス		62.5	67.1	142,654			

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
日本石油輸送	2	2	6,210	
福山通運	21	24	90,480	
セイノーホールディングス	123.1	140.5	184,055	
エスライン	4.9	5.6	5,572	
神奈川中央交通	4.1	4.6	18,791	
日立物流	36.1	34.4	92,742	
丸和運輸機関	8.7	19.8	65,538	
C & F ロジホールディングス	16.6	19	26,524	
九州旅客鉄道	137.9	164.5	491,032	
S G ホールディングス	155.2	196.9	599,560	
<b>海運業 (0.1%)</b>				
日本郵船	137.4	156.9	227,191	
商船三井	97.5	118.7	227,904	
川崎汽船	50.6	57.8	64,793	
N S ユナイテッド海運	9	10.3	15,408	
明治海運	17.5	19.9	6,666	
飯野海運	77.8	88.8	28,860	
共栄タンカー	1.4	3.3	2,956	
乾汽船	14.7	10.8	12,895	
<b>空運業 (0.4%)</b>				
日本航空	300.8	331.7	652,453	
ANAホールディングス	300.4	342.9	829,132	
バスコ	3.2	3.6	5,637	
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>				
トランコム	4.6	5.2	34,424	
日新	14.2	16.2	26,341	
三菱倉庫	56.9	59.5	147,857	
三井倉庫ホールディングス	20.1	21.4	31,244	
住友倉庫	60.5	67.5	86,062	
濱澤倉庫	9	10.3	22,824	
東陽倉庫	29.7	33.9	11,526	
日本トランシティ	36.2	41.3	20,195	
ケイヒン	3.2	3.6	4,590	
中央倉庫	10	11.4	12,038	
川西倉庫	3.3	3.4	3,485	
安田倉庫	13.5	15.4	13,213	
ファイズホールディングス	2.9	4	4,416	
東洋埠頭	5	5.7	7,375	
宇徳	14	16	7,392	
上組	101.4	104.7	206,573	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
サンリツ	3.9	4.4	2,464	
キムラユニティー	4.4	5	5,020	
キユーソー流通システム	4.1	4.7	8,243	
近鉄エクスプレス	31	39.9	61,685	
東海運	9.3	10.7	2,749	
エーアイティー	10.6	13.2	9,926	
内外トランスライン	5.2	6.6	7,464	
日本コンセプト	6	6	8,646	
<b>情報・通信業 (9.8%)</b>				
N E C ネッツエスアイ	18.8	18.4	88,044	
クロスキャット	4.5	5.1	5,355	
システィナ	60.7	69.3	111,157	
デジタルアーツ	9.1	9.6	71,328	
日鉄ソリューションズ	25.5	29.1	79,297	
キユーブシステム	9.1	10.3	7,622	
エイジア	3.3	3.5	4,809	
コア	7.2	8.2	9,643	
ラクーンホールディングス	—	8.7	5,959	
ソリトンシステムズ	9.6	8.5	11,152	
ソフトクリエイトホールディングス	7.4	8.5	15,725	
T I S	56.8	194.4	412,711	
ネオス	6.5	7.8	5,210	
電算システム	6.5	7.4	23,791	
グリー	117.4	119.2	52,328	
コーエーテクモホールディングス	34.8	39.7	118,107	
三菱総合研究所	7.3	8.3	34,154	
ボルテージ	3.1	4.5	1,890	
電算	1.9	2.2	4,514	
A G S	9.6	11	8,272	
ファインデックス	14.3	16.4	14,776	
ブレインバッド	3.3	5	28,250	
K L a b	30.5	37.7	28,011	
ポールトウイン・ピットクルーホールディ	22.6	23.4	22,066	
イーブックイニシアティブジャパン	2.7	2.8	6,022	
ネクソン	434.3	542.1	918,317	
アイスタイル	43.5	54.4	16,864	
エムアップホールディングス	5.8	5.6	14,476	
エイチーム	11.7	13.4	10,452	
エニグモ	—	18.4	16,762	
テクノスジャパン	14.3	15.1	7,550	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
e n i s h	6.5	8.9	3,631	
コロプラ	55.7	63.7	59,559	
オルトプラス	11.3	11.8	5,074	
ブロードリーフ	84.4	96.3	51,905	
クロス・マーケティンググループ	6.3	8.6	2,666	
デジタルハーツホールディングス	7.7	10.3	7,879	
システム情報	8.6	14.6	13,183	
メディアドゥホールディングス	5.2	6.1	23,851	
じげん	24.1	48.1	17,171	
ブイキューブ	9.1	11.9	13,423	
エンカレッジ・テクノロジ	2.2	4.3	3,822	
サイバーリンクス	2.6	3	3,894	
ディー・エル・イー	12.1	15.6	2,043	
フィックスターズ	18.1	20.7	26,910	
CARTA HOLDINGS	8.2	9.4	8,225	
オプティム	7.4	10.2	21,950	
セレス	5.5	6.4	5,600	
S H I F T	—	7.8	65,208	
ティーガイア	17	17.2	37,977	
セック	2.8	2.8	10,402	
日本アジアグループ	17.9	20.5	5,125	
豆蔵ホールディングス	11.6	2.4	4,507	
テクマトリックス	12	13.7	37,428	
プロシップ	4.9	5.6	6,960	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	410.3	46.8	79,513	
GMOペイメントゲートウェイ	28	41.1	417,165	
ザッパラス	8.8	8.4	2,906	
システムリサーチ	2.3	5.1	9,027	
インターネットイニシアティブ	27.7	28.7	109,203	
さくらインターネット	20.3	20.8	12,230	
ヴィンクス	5.7	5.4	5,977	
GMOクラウド	3.8	3.6	11,898	
S R A ホールディングス	9	10.3	22,979	
M i n o r i ゾリューションズ	3.3	—	—	
システムインテグレータ	4.8	6.1	4,550	
朝日ネット	13.8	13.8	13,372	
e B A S E	10.2	23.2	24,499	
アベント	6.1	18.5	18,426	
アドソル日進	6	6.9	17,733	
フリービット	10.1	10.1	8,423	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
コムチュア	9.6	21.8	48,461	
サイバーコム	3	3.5	6,702	
アステリア	11.3	11.8	5,404	
アイル	—	10.8	18,478	
マークライズ	7.8	9.7	17,333	
メディカル・データ・ビジョン	15.1	14.8	12,313	
g u m i	21.8	24.9	19,048	
ショーケース	3.7	4.6	2,493	
モバイルファクトリー	4.7	4.3	4,798	
テラスカイ	2.7	7	18,319	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	7.5	7.6	10,602	
P C I ホールディングス	3.4	7.3	6,664	
パイプドHD	2.6	2.5	3,917	
アイビーシー	3.1	3.2	3,155	
ネオジャパン	3.2	3.7	4,647	
P R T I M E S	1.4	1.7	4,012	
ランドコンピュータ	2.6	2.9	3,190	
ダブルスタンダード	1.5	2.5	10,625	
オープンドア	8.4	9.6	11,193	
マイネット	5.5	6.3	5,733	
アカツキ	6	6.9	29,670	
ペネフィットジャパン	1.3	1.5	2,461	
U b i c o m ホールディングス	3.1	4.3	5,770	
L I N E	51.9	44.5	236,295	
カナミックネットワーク	3.5	17.8	13,243	
ノムラシステムコーポレーション	1.8	4.2	1,654	
チェンジ	3	6.8	28,968	
シンクロ・フード	7.2	8.3	2,606	
オークネット	8.9	12	13,080	
セグエグループ	—	4.2	3,746	
エイトレッド	1.8	3.2	6,172	
AO I T Y O H o l d i n g s	18.5	19.6	9,133	
マクロミル	30.1	39.7	28,703	
ビーグリー	4.3	3.8	5,597	
オロ	2.2	5.1	16,600	
ユーザーローカル	—	1.9	5,757	
デモナ	—	4.1	2,988	
ニーズウェル	—	3.7	2,471	
サインポスト	—	4	5,960	
ソルクシーズ	7.2	8.2	5,559	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
フェイス	6.7	6.8	4,318	
プロトコードボレーション	7.6	17.4	16,895	
ハイマックス	2	2.3	4,491	
野村総合研究所	108.3	275.5	704,453	
サイバネットシステム	13.8	13.8	9,370	
C E ホールディングス	4.9	10.2	4,263	
日本システム技術	2.7	3.1	3,937	
インテージホールディングス	21.8	24.2	19,602	
東邦システムサイエンス	5	5.1	4,712	
ソースネクスト	66	92.2	31,255	
インフォコム	18.6	21.3	55,017	
HEROZ	—	2.8	10,458	
ラクスル	—	15.6	42,510	
F I G	15.1	21	5,523	
システムサポート	—	2.2	6,578	
イーソル	—	9.2	11,987	
アルテリア・ネットワークス	18.9	21.5	45,967	
東海ソフト	—	1.3	1,645	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3.9	3.3	3,346	
トビラシステムズ	—	2.3	3,949	
フォーカスシステムズ	11.4	12	9,612	
クレスコ	5.2	11.8	17,464	
フジ・メディア・ホールディングス	176.6	187.2	208,166	
オーピック	59	67.4	1,137,038	
ジャストシステム	24.2	31.6	217,092	
T D C ソフト	14.9	17	14,620	
Z ホールディングス	1,110.1	2,669.2	1,166,440	
トレンドマイクロ	90.8	86.4	463,968	
I D ホールディングス	6.5	7.4	11,248	
日本オラクル	34.5	39.4	473,982	
アルファシステムズ	5.3	6	21,030	
フューチャー	23.1	23.5	38,352	
C A C Holdings	12.2	12.6	14,956	
S B テクノロジー	7.2	7	18,340	
トーセ	4.6	5.3	4,139	
オーピックビジネスコンサルタント	17.4	19.9	100,495	
伊藤忠テクノソリューションズ	77.6	88.6	296,810	
アイティフォー	20.6	23.5	16,638	
東計電算	2.5	2.9	11,295	
エックスネット	3.1	3	2,943	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
大塚商会	92.1	105.2	502,856	
サイボウズ	19.9	22.7	49,122	
ソフトブレーン	13.3	11.4	5,289	
電通国際情報サービス	10.5	12	54,180	
A C C E S S	—	18.2	16,107	
デジタルガレージ	33.2	35	139,825	
E M システムズ	13.8	27.3	21,785	
ウェザーニューズ	5.7	6.6	25,575	
C I J	13.3	13.2	10,665	
ビジネスエンジニアリング	1.7	2.2	5,645	
日本エンターブライズ	17.5	19.7	4,629	
WOWOW	8.2	9.3	23,556	
スカラ	11.9	12.9	7,249	
インテリジェント ウエイブ	6.4	11.3	6,994	
I M A G I C A G R O U P	14.4	16.5	6,369	
ネットワンシステムズ	60.2	74	231,620	
システムソフト	40.3	41.8	3,135	
アルゴグラフィックス	14.5	16.5	57,420	
マーべラス	26	29.7	17,285	
エイベックス	29.2	33.4	30,093	
日本ユニシス	53.2	60.7	192,115	
兼松エレクトロニクス	9.3	10.6	39,962	
東京放送ホールディングス	112.9	118.2	198,221	
日本テレビホールディングス	156.3	162.2	197,073	
朝日放送グループホールディングス	16.9	19.3	13,760	
テレビ朝日ホールディングス	46.8	53.4	87,415	
スカパーJ S A T ホールディングス	129.9	127.9	52,566	
テレビ東京ホールディングス	14	15.9	38,414	
日本B S 放送	5.8	6.6	6,976	
ビジョン	5.3	18.1	15,457	
スマートバリュー	5	5.1	4,258	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	6.5	7.4	10,204	
ワイヤレスゲート	7.4	9.2	5,253	
コネクシオ	12.1	11	17,105	
日本通信	146.9	151.5	24,240	
クロップス	3.1	3.5	2,488	
日本電信電話	1,164.5	2,598.2	6,286,344	
K D D I	1,500.4	1,448.5	4,574,363	
ソフトバンク	1,805.2	1,766.4	2,596,608	
光通信	20.1	20	448,800	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
NTTドコモ	1,078	1,435.8	4,420,828	
エムティーアイ	16.4	18.8	10,828	
GMOインターネット	62	76.6	178,784	
ファイバーゲート	—	6.2	8,742	
アイドマーチテイニアングコミュニケーション	3.6	5.8	2,592	
KADOKAWA	49.6	52.3	86,608	
学研ホールディングス	5.7	26.1	46,170	
ゼンリン	34	38.8	51,681	
昭文社ホールディングス	7.8	8.9	3,497	
インプレスホールディングス	14.1	16.1	2,640	
アイネット	9.6	10	15,530	
松竹	11.3	12.9	165,120	
東宝	112	114.7	423,816	
東映	7.2	7.3	103,076	
エヌ・ティ・ティ・データ	453.3	517.5	602,370	
ピー・シー・エー	2.2	3.3	12,589	
ビジネスプレイン太田昭和	2.9	3.3	9,117	
DTS	19	43.4	94,091	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	79.2	82.9	387,557	
シーアーシー	18.2	20.8	35,401	
カブコン	73	91.6	328,386	
アイ・エス・ピー	3.3	3.8	6,615	
ジャステック	9.9	12.4	14,433	
SCSK	44.9	44.8	217,056	
日本システムウェア	5.6	6.4	13,958	
アイネス	21.6	19.1	26,529	
TKC	14.4	16.4	84,460	
富士ソフト	25.4	24.9	97,608	
NSD	28	62.5	101,062	
コナミホールディングス	69.6	70.6	247,100	
福井コンピュータホールディングス	5.6	7.6	22,268	
JBCCホールディングス	13.4	13.1	26,920	
ミロク情報サービス	16.9	17.1	45,981	
ソフトバンクグループ	711.5	1,542.2	7,225,207	
卸売業(4.8%)				
ホウスイ	1.4	1.5	1,369	
高千穂交易	6.6	7.5	7,050	
カワニシホールディングス	—	2.3	2,918	
伊藤忠食品	4.2	4.8	22,200	
エレマテック	8	18.2	15,069	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
JALUX	4.8	5.5	9,075	
あらた	12.6	15.5	72,462	
トーメンデバイス	2.6	2.9	11,049	
東京エレクトロン デバイス	6.2	7.1	20,164	
フィールズ	15	14.9	5,185	
双日	943.9	1,077.5	269,375	
アルフレッサ ホールディングス	189.9	216.8	453,545	
横浜冷凍	47.9	51	45,543	
神栄	2.3	2.7	1,455	
ラサ商事	9	10.3	8,672	
ラクーンホールディングス	8.2	—	—	
アルコニックス	18.1	20.7	24,508	
神戸物産	25.8	67.3	347,268	
ハイパー	—	2.9	1,728	
あい ホールディングス	24.4	27.8	39,420	
ディープイエックス	6.7	6.9	6,313	
ダイワボウホールディングス	15.6	16.6	117,528	
マクニカ・富士エレホールディングス	47.4	46.5	73,888	
ラクト・ジャパン	7.4	7.3	27,448	
バителケーエスケー・ホールディングス	32.2	36.7	39,929	
八洲電機	13.2	15.1	12,940	
メディアスホールディングス	9.7	11.1	10,212	
レスターホールディングス	18.7	20.3	36,661	
ジューーテックホールディングス	3.9	4.4	4,400	
大光	7.2	8.3	5,818	
OCHIホールディングス	4.9	5.7	7,905	
TOKAIホールディングス	90.3	103.1	98,769	
黒谷	3.9	5.3	2,326	
Cominx	3	3.4	2,529	
三洋貿易	8.6	19.6	17,992	
ピューティガレージ	2.7	3.1	5,307	
ワイン・パートナーズ	11.1	14.1	12,929	
ミタチ産業	5.1	5.8	3,584	
シップヘルスケアホールディングス	35.6	31.3	149,301	
明治電機工業	5.4	6.1	7,875	
デリカフーズホールディングス	3	6.9	4,298	
スター・ティアホールディングス	3.3	4.4	2,600	
コメダホールディングス	39.5	42.5	76,967	
ビーパン・ドットコム	—	1.9	1,837	
アセンテック	—	2.1	6,300	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
富士興産	6.6	5.9	2,436	
協栄産業	2.1	2.2	2,521	
小野建	15.3	17.5	20,772	
南陽	3.5	4.3	6,239	
佐鳥電機	12.6	13.2	11,101	
エコートレーディング	3.9	4.5	2,286	
伯東	11.7	11.9	11,709	
コンドーテック	13.2	15.1	14,752	
中山福	9.8	11.2	5,297	
ナガイレーベン	24.7	25.9	66,200	
三菱食品	18.8	21.4	55,105	
松田産業	12.5	14.2	19,780	
第一興商	25.4	29	103,965	
メディバルホールディングス	184.4	210.5	440,787	
S P K	3.7	8.4	11,163	
萩原電気ホールディングス	6.3	7.2	15,818	
アズワン	12.3	12.7	126,746	
スズデン	5.9	6.8	8,153	
尾家産業	5.5	5.7	8,208	
シモジマ	10.5	11.9	14,470	
ドウシシャ	16.1	18.4	27,931	
小津産業	3.7	4.3	8,359	
高速	10.2	11.6	16,750	
たけびし	6	6.8	9,513	
リックス	3.8	4.4	6,547	
丸文	15.1	17.3	8,978	
ハビネット	14.3	16.3	17,897	
橋本総業ホールディングス	3.4	3.9	7,207	
日本ライフライン	53.6	57.8	75,371	
タカショ一	8.3	12.6	5,972	
エクセル	6.4	—	—	
マルカ	5.5	6.9	12,820	
I DOM	57.6	52.6	24,774	
日本エム・ディ・エム	10	—	—	
進和	10.1	11.5	20,205	
エスケイジャパン	4.1	4.2	1,306	
ダイトロン	7.8	8.2	13,185	
シーケス	21.7	24.8	24,180	
田中商事	5.7	6	4,218	
オーハシテクニカ	9.6	11	16,280	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
白銅		5.5	7	9,331
伊藤忠商事		1,195.3	1,364.6	3,049,881
丸紅		1,685.2	2,030.7	1,010,273
高島		2.7	3.1	4,854
長瀬産業		96.1	109.7	144,474
蝶理		10.9	12.4	21,439
豊田通商		190.7	217.7	566,020
三共生興		29.1	29.5	13,953
兼松		68.3	72.8	86,632
ツカモトコーポレーション		3.1	3.5	3,895
三井物産		1,407.9	1,714.8	2,810,557
日本紙パルプ商事		9.7	11.1	40,848
日立ハイテク		51.9	—	—
カメリ		22.3	25.4	27,051
東都水産		2.4	2.5	7,342
O U G ホールディングス		2.7	3.1	8,370
スター・ゼン		6.3	7.2	31,608
山善		66.7	76.2	71,475
椿本興業		3.9	3.6	11,952
住友商事		1,010.7	1,230.9	1,632,788
内田洋行		7.3	7.7	44,506
三菱商事		1,199.2	1,369	3,308,873
第一実業		7.8	9.5	34,675
キヤノンマーケティングジャパン		48.8	48.4	103,914
西華産業		9.7	11	12,683
佐藤商事		15.3	16.1	14,248
菱洋エレクトロ		17.3	19.8	48,846
東京産業		17	17.6	8,976
ユアサ商事		17.5	18.5	55,870
神鋼商事		3.8	4.9	8,957
トルク		10.2	11.6	3,329
阪和興業		29.6	36.4	65,265
正栄食品工業		12	12.6	48,825
カナデン		15.4	15.8	19,908
菱電商事		13.5	14	19,600
フルサト工業		9.4	10.8	15,120
岩谷産業		37.9	43.3	161,725
ナイス		7.3	8.3	6,781
昭光通商		6.1	6.2	3,658
ニチモウ		2.7	3	5,322

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
極東貿易	5.2	5.6	7,924	
イワキ	20.4	25.6	11,520	
三愛石油	45.9	48	54,672	
稻畑産業	41	43	51,815	
G S I クレオス	4.5	4.8	5,136	
明和産業	15.8	18	9,216	
クワザワ	6.1	6.9	3,588	
ヤマエ久野	—	14.2	18,602	
ワキタ	36.4	41.6	41,184	
東邦ホールディングス	50.6	62.6	137,594	
サンゲツ	50.8	53.2	84,481	
ミツウロコグループホールディングス	22.7	28.8	33,782	
シナネンホールディングス	7	8	22,000	
伊藤忠エネクス	37.8	43.1	35,083	
サンリオ	52.8	54.8	96,996	
サンワテクノス	10.4	13.8	11,191	
リヨーサン	18.9	21.5	52,546	
新光商事	16.1	30.6	27,172	
トーホー	7.7	8.8	15,884	
三信電気	11.8	10.5	16,443	
東陽テクニカ	19.7	20.9	22,049	
モスフードサービス	22.4	25.6	72,806	
加賀電子	17	19.4	39,847	
ソーダニッカ	17.6	20.1	12,381	
立花エレテック	12.6	14.4	22,579	
フォーパル	7.5	8.5	9,945	
P A L T A C	30.8	31.3	165,890	
三谷産業	20	25.6	10,470	
太平洋興発	6.7	7.7	4,635	
西本Wi s m e t t a c ホールディングス	3.9	3.5	7,350	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.4	1.7	3,323	
国際紙パルプ商事	39.9	46.2	14,599	
ヤマタネ	8.6	9.8	12,240	
丸紅建材リース	1.7	1.9	2,745	
日鉄物産	12.2	13.9	47,607	
泉州電業	5.7	6	15,216	
ト拉斯中山	35.6	40.6	100,485	
オートバックスセブン	67.9	72.4	95,640	
モリト	12.4	14.2	9,599	
加藤産業	26.7	28.2	102,507	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
北恵	3.2	4.9	4,218	
イノテック	10.1	10.1	9,786	
イエローハット	32.3	36.8	54,979	
J K ホールディングス	15.4	17.6	13,288	
日伝	14.2	17.6	36,168	
北沢産業	12.8	14.6	4,073	
杉本商事	9.2	10.5	18,690	
因幡電機産業	24.3	55.5	126,928	
東テク	5.7	6.5	14,300	
ミスミグループ本社	214	244.5	645,480	
アルテック	12.5	15.5	3,177	
タキヒヨー	5.2	5.9	10,071	
藏王産業	2.8	3.8	5,453	
スズケン	77.9	82.6	328,335	
ジェコス	11.8	13.4	12,113	
グローセル	15.7	19.5	8,346	
<b>小売業 (4.8%)</b>				
ローソン	43.2	49.3	274,601	
サンエー	12.9	16.2	67,392	
カワチ薬品	13.2	15.1	36,300	
エービーシー・マート	26.7	30.5	180,865	
ハードオフコーポレーション	6.8	7.7	5,228	
アスクル	17.9	20.4	69,768	
ゲオホールディングス	26	35.1	47,981	
アダストリア	23.7	27	46,143	
ジーフット	10.3	11.8	5,581	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	2.2	2.8	1,128	
くら寿司	10	10.2	48,552	
キヤンドウ	8.1	9.3	17,632	
パルグループホールディングス	8.7	19.9	27,064	
エディオン	72.4	89.5	87,352	
サーラコーポレーション	34.7	39.6	22,334	
ワッツ	7.5	8.6	5,873	
ハローズ	6.4	7.3	21,097	
フジオフードシステム	7.2	16.4	23,944	
あみやき亭	3.7	4.2	12,957	
ひらまつ	34	35.9	5,887	
大黒天物産	4.1	4.7	19,223	
ハニーズホールディングス	15	17.2	20,949	
ファーマライズホールディングス	4	4.7	3,144	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
アルペン	13.1	14.9	24,689	
ハブ	5.5	5.5	3,811	
クオールホールディングス	25.1	28.7	34,583	
ジンズホールディングス	9	10.3	65,302	
ビックカメラ	101.4	115.7	120,906	
DCMホールディングス	92.2	108.1	118,477	
ペッパーードサービス	13.5	—	—	
MonotaRO	108	138.7	509,029	
東京一番フーズ	4.3	4.9	2,332	
DDホールディングス	3.8	7.7	7,584	
きちらホールディングス	4.5	5.2	3,166	
アークランドサービスホールディングス	12.5	14.2	26,227	
J. フロント リテイリング	218.6	233	219,719	
ドトール・日レスホールディングス	30	31.1	55,264	
マツモトキヨシホールディングス	70.6	80.6	290,966	
プロンコビリー	8.9	10.2	22,531	
ZOZO	184.7	134.2	261,690	
トレジャー・ファクトリー	5	5.7	4,075	
物語コーポレーション	4.2	5.2	40,144	
ココカラファイン	19.2	20.4	100,980	
三越伊勢丹ホールディングス	319.7	341	235,290	
Hamee	5.2	6.9	9,687	
ウェルシアホールディングス	45.2	58	435,000	
クリエイトＳＤホールディングス	25.2	32.9	101,167	
丸善CHIホールディングス	19.9	22.8	8,686	
ミサワ	3.1	3.9	2,176	
ティーライフ	2.3	2.9	2,731	
エー・ピーカンパニー	3.2	3.7	1,609	
チムニー	5.2	5.9	10,838	
ショッピング	11.6	13.3	11,025	
オイシックス・ラ・大地	—	17.4	27,718	
ネクステージ	26.6	28	23,268	
ジョイフル本田	50	57.1	73,202	
鳥貴族	5.6	5.7	10,596	
キリン堂ホールディングス	6.7	7.7	15,584	
ホットランド	9	13	15,366	
すかいらーくホールディングス	159.3	218.6	388,670	
SFPホールディングス	7.3	11.1	17,582	
綿半ホールディングス	6.4	7.3	13,307	
ヨシックス	2.8	3.2	6,761	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	49.7	56.7	57,323	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.9	9	4,608	
B E E N O S	6	9	9,270	
あさひ	14.1	14.5	19,850	
日本調剤	6	11.8	19,824	
コスマス薬品	7.5	8.6	240,972	
トーエル	8.2	9.4	6,645	
オンリー	2.9	3.3	1,927	
セブン＆アイ・ホールディングス	716.3	763.2	2,638,382	
薬王堂	7.4	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホールディング	45.9	104.9	79,199	
ツルハホールディングス	37.1	42.4	588,936	
サンマルクホールディングス	13.5	15.4	29,337	
フェリシモ	3.8	4.3	4,214	
トリドールホールディングス	21.1	48.2	65,985	
TOKYO BASE	15.3	17.6	6,652	
ウイルプラスホールディングス	2.6	2.4	1,668	
JMホールディングス	8.6	14.8	36,156	
サツドラホールディングス	2.6	2.9	5,901	
デファクトスタンダード	1.5	—	—	
アレンザホールディングス	9.2	9.7	8,594	
串カツ田中ホールディングス	—	4	6,996	
パロックジャパンリミテッド	13.8	13.5	8,437	
クスリのアオキホールディングス	17	17.5	142,450	
力の源ホールディングス	6.4	8.8	6,204	
スリーグローバルホールディングス	18.8	107.1	217,413	
LIXILビバ	14.5	19.3	39,507	
メディカルシステムネットワーク	18.2	18.8	8,836	
はるやまホールディングス	8	9.1	7,070	
ノジマ	30.4	34.7	67,248	
カッパ・クリエイト	24	27.4	38,688	
ライトオン	12.8	14.6	7,767	
ジーンズメイト	5.2	5.9	1,427	
良品計画	24.2	259	370,111	
三城ホールディングス	21.1	20.7	5,589	
アドヴァン	26.1	29.8	32,839	
アルビス	6.5	7.4	15,281	
コナカ	20.1	23	7,728	
ハウス オブ ローゼ	2.1	2.4	3,772	
G-7ホールディングス	5	11.5	27,784	

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	千 株	千 株	千 円
イオン北海道		17.2	25.7	20,277			
コジマ		29.4	33.5	14,137			
ヒマラヤ		6	6.8	5,317			
コーナン商事		22.4	27.7	74,623			
エコス		6.3	7.2	13,651			
ワタミ		22.5	23.1	26,495			
マルシェ		4.5	5.1	3,172			
パン・パシフィック・インターナショナルホ	102.3	428.8	872,179				
西松屋チェーン		37.5	42.8	37,107			
ゼンショーホールディングス		80.6	93.5	215,704			
幸楽苑ホールディングス		10.8	12.4	20,162			
ハーツスレイ		3.6	4.1	4,214			
サイゼリヤ		28.2	28.9	68,637			
V T ホールディングス		77.2	80.8	24,724			
魚力		4.7	5.4	8,148			
ボプラ		4.4	5.1	2,376			
フジ・コーポレーション		4.5	5.2	9,739			
ユナイテッドアローズ		19.5	20.4	36,495			
ハイディ日高		24.7	28.2	51,098			
京都きもの友禅		10.9	12.4	2,889			
コロワイド		56.8	64.8	106,920			
ピーシーデボコーポレーション		22.7	25.9	14,814			
壱番屋		12	13.7	65,760			
トップカルチャー		6.2	7	2,128			
P L A N T		4.4	5	3,025			
スギホールディングス		37.5	38.9	243,903			
薬王堂ホールディングス		—	8.5	22,508			
ヴィア・ホールディングス		20.9	23.9	11,663			
スクロール		26.3	30	10,500			
ヨンドシーホールディングス		19	19.8	33,976			
ファミリーマート		191.1	155.9	290,129			
木曽路		20.9	25.5	61,047			
S R S ホールディングス		20.1	23	21,321			
千趣会		31	35.2	12,496			
タカキュー		13.2	15	1,995			
リテールパートナーズ		—	25.8	34,752			
ケーヨー		31.6	40.1	23,578			
上新電機		20.2	22.9	50,288			
日本瓦斯		27.8	30.8	117,502			
ロイヤルホールディングス		29.8	34.1	66,392			

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末			
		株 数	株 数	評 価 額	千 株	千 株	千 円
東天紅		1.2	1.4	1,282			
いなげや		19	24.2	39,905			
島忠		36.1	36.7	103,457			
チヨダ		17.9	20.5	22,160			
ライフコーポレーション		13	14.8	44,992			
リンガーハット		21.1	24	55,728			
M r M a x H D		23.5	26.8	11,550			
デンアライド		15.8	18	6,930			
A O K I ホールディングス		34.2	39	26,988			
オークワ		24.4	30.6	41,860			
コメリ		26.4	30.1	69,350			
青山商事		29.9	40.3	38,123			
しまむら		19.9	22.7	161,170			
はせがわ		9	10.3	4,181			
高島屋		134.1	142.1	144,089			
松屋		34.4	39.3	25,309			
エイチ・ツー・オー リテイリング		87.7	92.4	79,926			
近鉄百貨店		6.5	7.5	20,647			
パルコ		16.4	—	—			
丸井グループ		144.6	178.8	325,773			
アクシアル リテイリング		14.2	16.2	63,828			
井筒屋		8.7	10.6	1,770			
イオン		657.6	750.7	1,661,299			
イズミ		34.7	39.7	131,804			
平和堂		34.7	39.6	72,230			
フジ		20.6	23.5	41,031			
ヤオコー		19.4	22.1	142,766			
ゼビオホールディングス		20.6	23.6	22,042			
ケーズホールディングス		177.6	188.2	228,663			
O l y m p i c グループ		10.1	10.1	6,676			
日産東京販売ホールディングス		25.1	28.7	6,170			
シルバーライフ		—	2.6	5,517			
一家ダイニングプロジェクト		—	2	1,288			
G e n k y D r u g S t o r e s		8.3	8.6	20,855			
ナルミヤ・インターナショナル		—	4.4	2,868			
総合メディカルホールディングス		14.9	—	—			
ブックオフグループホールディングス		8.9	11.4	9,336			
AINホールディングス		22.9	24	151,200			
元気寿司		4.8	4.9	12,382			
ヤマダ電機		520.7	594.4	309,682			

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
アークランドサカモト	29	30.5	33,367	
ニトリホールディングス	74	84.5	1,423,825	
グルメ杵屋	12.2	13.9	13,483	
愛眼	13.6	15.6	3,369	
ケーユーホールディングス	8.9	10.2	8,058	
吉野家ホールディングス	59.6	64.1	152,301	
松屋フーズホールディングス	8.2	9.4	37,224	
サガミホールディングス	22.8	26.1	34,269	
関西スーパーマーケット	12.9	16.2	17,172	
王将フードサービス	12.5	14.3	86,658	
プレナス	19.1	21.8	40,853	
ミニストップ	12.7	14.5	22,083	
アークス	32	39.9	81,196	
パローホールディングス	36.9	43.2	87,609	
藤久	1.4	2.1	1,648	
ベルク	8.4	9.6	57,024	
大庄	9.1	10.4	13,800	
ファーストリテイリング	22.9	26.1	1,398,438	
サンドラッグ	64.3	73.4	268,277	
サックスパー ホールディングス	14.5	16.5	9,306	
ヤマザワ	3.5	4.5	7,731	
やまや	2.9	4	8,952	
ベルーナ	41.9	41.9	21,871	
銀行業 (5.0%)				
島根銀行	3.6	5.1	2,488	
じもとホールディングス	115.6	132	12,276	
めぶきフィナンシャルグループ	889.2	1,015.1	235,503	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	23.1	26.4	27,561	
九州フィナンシャルグループ	280.8	427.5	187,672	
ゆうちょ銀行	484.8	553.5	570,105	
富山第一銀行	40.8	46.6	12,675	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,073.6	1,115.8	363,750	
西日本フィナンシャルホールディングス	107.7	130	80,080	
関西みらいフィナンシャルグループ	80.3	114.7	41,521	
三十三フィナンシャルグループ	14.8	18.1	27,457	
第四北越フィナンシャルグループ	29.7	33.9	77,325	
新生銀行	125.6	143.4	192,156	
あおぞら銀行	95.6	116.4	227,212	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,780.6	13,364.3	5,663,790	
りそなホールディングス	1,878	2,143.9	703,842	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
三井住友トラスト・ホールディングス	336.5	369.3	1,129,319	
三井住友フィナンシャルグループ	1,206.2	1,351.2	3,804,979	
千葉銀行	588.6	652	321,436	
群馬銀行	342.3	375.3	125,725	
武蔵野銀行	25.5	29.1	39,576	
千葉興業銀行	46.9	53.6	12,756	
筑波銀行	71.2	81.2	13,560	
七十七銀行	53.7	66	91,212	
青森銀行	13.3	15.1	34,926	
秋田銀行	11	12.5	18,850	
山形銀行	19.2	22	28,160	
岩手銀行	12	12.8	32,153	
東邦銀行	153	174.7	41,403	
東北銀行	8.7	9.4	8,535	
みちのく銀行	11	12.5	13,637	
ふくおかフィナンシャルグループ	150.7	164.6	268,133	
静岡銀行	430.8	483.8	314,470	
十六銀行	23	24.5	46,599	
スルガ銀行	175.1	199.9	75,162	
八十二銀行	413	471.5	169,268	
山梨中央銀行	20.6	22.7	18,659	
大垣共立銀行	36.1	38.6	83,762	
福井銀行	14.6	16.7	26,486	
北國銀行	17.6	20.1	60,702	
清水銀行	7.1	8.1	14,442	
富山銀行	3.3	3.8	8,508	
滋賀銀行	34.3	39.2	99,764	
南都銀行	26.7	32.5	72,312	
百五銀行	154	175.8	53,619	
京都銀行	61.3	70	257,600	
紀陽銀行	60.6	69.2	108,298	
ほくほくフィナンシャルグループ	113.9	130	113,490	
広島銀行	252.6	288.4	128,626	
山陰合同銀行	101.5	115.8	62,647	
中国銀行	147.3	168.1	166,082	
鳥取銀行	5.8	6.7	7,624	
伊予銀行	226.7	278.8	162,261	
百十四銀行	18.2	20.8	40,310	
四国銀行	24.3	29.7	25,245	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
阿波銀行	26.2	31.9	72,030	
大分銀行	10.5	11.2	24,214	
宮崎銀行	11.4	13	30,043	
佐賀銀行	10.4	11.9	13,863	
沖縄銀行	15.7	17.9	54,863	
琉球銀行	39.5	45.1	45,686	
セブン銀行	578.1	652.6	184,033	
みずほフィナンシャルグループ	23,254.4	26,547.1	3,273,257	
高知銀行	6.2	7.1	5,119	
山口フィナンシャルグループ	213.6	243.9	139,510	
長野銀行	5.6	6.4	7,334	
名古屋銀行	13.8	14.6	33,492	
北洋銀行	258	294.5	55,660	
愛知銀行	6.2	7.1	22,507	
中京銀行	7	8	16,608	
大光銀行	5.9	6.7	10,090	
愛媛銀行	23.9	27.3	30,139	
トマト銀行	6.6	7.5	7,545	
京葉銀行	75.6	83.3	42,982	
栃木銀行	88.6	94.4	14,915	
北日本銀行	5.3	6.1	11,730	
東和銀行	30	34.3	22,535	
福島銀行	14.9	18.4	3,109	
大東銀行	8.2	10.2	6,089	
トモニホールディングス	132.3	151	51,491	
フィデアホールディングス	166.1	189.7	20,487	
池田泉州ホールディングス	181.7	224.7	38,423	
証券、商品先物取引業 (0.8%)				
F P G	53.7	60.3	32,923	
マーキュリアインベストメント	6.6	8.7	5,106	
S B I ホールディングス	203.9	218.2	472,184	
日本アジア投資	14.5	16.5	3,762	
ジャフコ	28.1	30	104,850	
大和証券グループ本社	1,373.2	1,567.6	678,927	
野村ホールディングス	3,011.2	3,437.6	1,457,886	
岡三証券グループ	145.8	166.5	54,445	
丸三証券	50.8	58	24,186	
東洋証券	61.2	69.8	8,585	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	204.1	224.4	52,060	
光世証券	4.1	4.7	2,420	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
水戸証券	49.5	56.5	11,074	
いちよし証券	35.9	36.5	17,447	
松井証券	83.8	111.6	86,378	
だいこう証券ビジネス	6.9	9.5	8,721	
マネックスグループ	157.8	143.4	33,125	
カブドットコム証券	127.7	—	—	
極東証券	23	26.2	13,728	
岩井コスモホールディングス	17.5	18.5	17,612	
藍澤證券	30.7	35.1	24,394	
マネーパートナーズグループ	20	20.8	4,243	
スパークス・グループ	67.7	90.2	17,318	
小林洋行	4.9	5.6	1,344	
保険業 (2.0%)				
かんぽ生命保険	64.6	69.2	95,357	
S O M P O ホールディングス	301.7	367.3	1,198,499	
アニコム ホールディングス	14.1	16.2	64,314	
M S & A D インシュアラントグループホール	447.5	510.8	1,530,356	
ソニーフィナンシャルホールディングス	140.6	160.5	334,000	
第一生命ホールディングス	968.2	1,105.5	1,472,526	
東京海上ホールディングス	612	690.7	3,112,984	
T & D ホールディングス	529.3	583.9	530,765	
アドバンスクリエイト	4	4.1	8,482	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	48.2	55.1	189,544	
ジェイリース	4.7	5.4	1,258	
イントラスト	4.8	6.9	4,540	
日本モーゲージサービス	3.1	4	6,832	
C a s a	7.7	6.8	8,160	
アルヒ	15.5	31.1	42,638	
プレミアグループ	9.8	10.6	18,762	
クレディセゾン	119.9	136.9	169,482	
芙蓉総合リース	19.6	20.5	116,850	
みずほリース	32.2	30.1	63,691	
東京センチュリー	34.5	39.3	149,929	
日本証券金融	75.4	86.1	41,500	
アイフル	261.1	298	73,010	
リコーリース	13.5	15.4	44,921	
イオンフィナンシャルサービス	109.3	119.6	133,712	
アコム	344	392.7	174,358	
ジャックス	18.9	21.6	39,528	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
オリエントコーポレーション	462.9	528.4	63,936	
日立キャピタル	40.3	46.1	97,317	
アプラスフィナンシャル	82.1	93.7	5,996	
オリックス	1,141.7	1,221.9	1,612,297	
三菱UFJリース	386.1	495.8	253,849	
九州リースサービス	8.4	9.6	4,348	
日本取引所グループ	462.3	560.7	1,176,909	
イー・ギャランティ	16	20.9	38,497	
アサックス	7.1	10.1	6,443	
NECキャピタルソリューション	7	7.9	15,112	
不動産業(2.2%)				
いちご	217.7	248.6	71,596	
日本駐車場開発	187.7	192.8	25,064	
スター・マイカ・ホールディングス	—	10.1	15,412	
ADワークスグループ	—	36.2	6,443	
ヒューリック	357.2	417.2	433,470	
三栄建築設計	6.9	7.8	8,977	
スター・マイカ	7.9	—	—	
野村不動産ホールディングス	114	118.6	225,458	
三重交通グループホールディングス	34.7	39.6	19,681	
サムティ	23.8	27.7	40,608	
ディア・ライフ	21.9	27.6	12,116	
ヨーセーアールイー	5	5.7	2,690	
エー・ディー・ワークス	263.8	—	—	
日本商業開発	10.7	12.4	18,042	
プレサンスコーポレーション	27.1	32.1	37,492	
ユニゾホールディングス	25.8	6.3	37,674	
THEグローバル社	8.7	9.2	3,201	
ハウスコム	—	3.4	4,498	
日本管理センター	11.3	12.9	13,854	
サンセイランディック	4.6	5.7	4,360	
エストラスト	2.3	2.7	1,638	
フージャースホールディングス	37.2	38.9	24,195	
オープンハウス	24.8	56.8	138,592	
東急不動産ホールディングス	460.3	531.2	294,816	
飯田グループホールディングス	142.8	163	240,425	
イーグランド	2.4	3.1	2,042	
ムゲンエステート	11.8	13.5	6,574	
ビーロット	3.5	9.1	6,224	
ファーストプラザーズ	4.7	4.4	2,890	

銘 柄	期首(前期末)	当期末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ハウスドゥ	9.4	9.6	8,592	
シーアールイー	4.2	4.8	5,736	
プロパティエージェント	2.3	3.1	2,976	
ケイアイスター不動産	4.6	6.1	7,185	
アグレ都市デザイン	2.8	3.2	1,401	
グッドコムアセット	3.9	4.7	7,247	
ジェイ・エス・ピー	0.8	4.2	10,084	
テンポイノベーション	1.9	4.4	3,102	
グローバル・リンク・マネジメント	1.6	3.3	1,999	
パーク24	100.1	104.9	196,897	
バラカ	4.4	5	8,375	
三井不動産	907.9	963.6	1,923,827	
三菱地所	1,199	1,368.9	2,457,859	
平和不動産	32.4	35.8	105,645	
東京建物	187	205.8	263,424	
ダイビル	50.4	50.3	50,953	
京阪神ビルディング	30.5	31.7	45,901	
住友不動産	384.7	439.2	1,313,866	
テーオーシー	39.2	38.3	26,695	
東京楽天地	2.5	3.2	13,696	
レオパレス21	211.1	256	66,048	
スターシーコーポレーション	23.3	26.6	55,886	
フジ住宅	21.8	22.7	11,327	
空港施設	20	19.5	8,404	
明和地所	9.4	10.7	4,633	
ゴールドクリスト	13.5	15.4	25,764	
エスリード	6.7	7.6	10,564	
日神グループホールディングス	25.3	28.9	11,733	
日本エスコン	30.9	35.3	26,757	
タカラレーベン	78.2	89.3	32,862	
AVANTIA	9.6	11	8,041	
イオンモール	85.8	97.9	149,199	
毎日コムネット	3.6	5	4,055	
ファースト住建	6.4	8.3	7,677	
カチタス	19.1	48.4	102,898	
トーセイ	23.5	26.9	27,357	
穴吹興産	1.9	4.3	6,789	
サンフロンティア不動産	23.6	27	24,678	
エフ・ジー・ネクスト	14.9	17	13,804	
インテリックス	4.8	5.5	3,118	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ランドビジネス	7.2	6.6	2,006	
日本社宅サービス	—	6	6,228	
グランディハウス	14.9	15.2	5,380	
日本空港ビルディング	54.6	62.3	265,086	
<b>サービス業 (5.2%)</b>				
日本工営	11.1	12.7	38,862	
L I F U L L	57.9	66	25,344	
ジェイエイシリクルートメント	13.3	12.7	15,570	
日本M&Aセンター	123.6	143	523,380	
メンバーズ	5.5	5.6	10,264	
中広	1.7	2.6	1,362	
UTグループ	—	29.8	54,534	
アイティメディア	3.3	7.6	7,288	
タケエイ	17.2	18.1	15,928	
E・Jホールディングス	2.1	3.3	5,204	
ビーネックスグループ	9.1	23.7	17,917	
コシダカホールディングス	39.9	45.6	23,028	
アルトナー	4	4.6	3,201	
パソナグループ	20.2	20.5	24,292	
C D S	4.1	4.7	6,490	
リンクアンドモチベーション	30.5	41.7	15,804	
G C A	16.8	22.9	15,801	
エス・エム・エス	60.9	58.9	143,244	
サニーサイドアップグループ	1.8	6.5	5,070	
パーソルホールディングス	165.8	189.2	249,554	
リニカル	9.3	9.1	8,854	
クックパッド	52.1	66.1	20,226	
エスクリ	4.5	5.9	2,696	
アイ・ケイ・ケイ	8.1	9.2	5,750	
学情	6.7	6.7	8,716	
スタジオアリス	8.3	9.5	14,981	
シミックホールディングス	9.2	9.3	14,498	
エブコ	—	4	3,820	
N J S	3.7	4.2	7,350	
綜合警備保障	66	75.3	388,548	
カカクコム	124.1	139.8	348,521	
セントケア・ホールディング	12	12.2	5,124	
サイネックス	2.8	3.2	1,987	
ルネサンス	9.2	10.5	12,484	
ディップ	26.7	26.7	68,191	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
オプトホールディング	10.1	10.3	15,728	
新日本科学	22.4	20.5	14,411	
ツクイ	39	44.6	21,497	
キャリアデザインセンター	4.2	4.3	3,895	
ベネフィット・ワン	45.9	68.9	137,800	
エムスリー	349	417.4	1,542,293	
ツカダ・グローバルホールディング	10.5	12	4,332	
プラス	1.8	2.5	1,155	
アウトソーシング	87.4	108.3	67,579	
ウェルネット	15.7	19.1	12,510	
ワールドホールディングス	4.6	6.4	9,894	
ディー・エヌ・エー	89.4	92.7	123,661	
博報堂D Yホールディングス	230.5	263.3	318,329	
ぐるなび	23.6	32.9	22,569	
タカミヤ	17.1	20.1	9,145	
ジャパンベストレスキューシステム	11.2	14.9	10,832	
ファンコミュニケーションズ	45.6	52	24,128	
ライク	6.5	6.2	10,850	
ビジネス・ブレークスルー	6.9	7.9	3,325	
エスプール	—	48.6	36,109	
W D Bホールディングス	7.6	8.6	22,050	
手間いらす	—	1.2	5,730	
ティア	9.7	11	5,753	
C D G	1.5	2	2,908	
バリューコマース	11.1	10.6	26,213	
インフォマート	90.8	207.4	167,579	
J Pホールディングス	47.3	59.4	16,632	
E P Sホールディングス	24.9	25.6	28,928	
レッグス	4.1	4.7	4,441	
プレステージ・インターナショナル	31	70.9	61,683	
アミューズ	10	10.3	23,473	
ドリームインキュベータ	5	5.7	7,415	
クイック	10.3	11.7	12,764	
T A C	9	11.4	2,314	
ケネディクス	145.6	176.3	88,678	
電通グループ	202	195.1	460,045	
ティクアンドギヴ・ニーズ	6.3	7.2	5,025	
びあ	4.7	5.4	17,982	
イオンファンタジー	5.3	7.3	14,439	
シーティーエス	18.7	21.4	14,894	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ネクシィーズグループ	5.8	5.8	6,159	
みらかホールディングス	46.4	52.9	161,345	
アルプス技研	14.5	16.7	30,260	
ダイオーズ	3.8	3.7	4,040	
日本空調サービス	18.8	19.8	14,236	
オリエンタルランド	195.9	201.3	2,874,564	
ダスキン	42.6	47	130,613	
明光ネットワークジャパン	19.5	23.9	19,765	
ファルコホールディングス	9.1	10.4	16,640	
秀英予備校	3.6	4.1	1,742	
田谷	3	3.5	1,785	
ラウンドワン	51.4	52.8	50,265	
リゾートトラスト	70.2	86.8	105,028	
ビー・エム・エル	21.3	24.4	74,176	
ワタベウェディング	2.7	3	1,167	
りらいあコミュニケーションズ	30	34.2	40,971	
リゾー教育	84.2	86.5	24,479	
早稲田アカデミー	4.7	8.2	8,200	
ユー・エス・エス	202.5	211.9	372,732	
東京個別指導学院	5.8	6.7	3,926	
サイバーエージェント	95.3	116.6	517,121	
楽天	772.8	882.2	876,024	
クリーク・アンド・リバー社	9.7	9.7	9,777	
ティー・オー・ダブリュー	14.5	30.1	9,270	
山田コンサルティンググループ	8	12.2	14,591	
セントラルスポーツ	6.2	7.1	17,679	
フルキャストホールディングス	16.6	18.9	29,087	
エン・ジャパン	24.1	33.6	88,905	
リソルホールディングス	1.8	2.1	7,213	
テクノプロ・ホールディングス	33.2	37.8	238,896	
アトラ	3.3	4.3	1,156	
インターワークス	3.2	3.6	1,429	
アイ・アールジャパンホールディングス	6.7	7.7	51,051	
KeePer技研	6.1	7	11,102	
ファーストロジック	3.8	3.6	2,041	
三機サービス	3.4	3.6	4,150	
Gunosy	11.5	11.7	11,173	
デザインワン・ジャパン	3.3	5.6	1,226	
イー・ガーディアン	8.4	8.3	16,500	
リブセンス	9.1	12.1	3,412	

銘 柄	期首(前期末)	当期 末		
		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ジャパンマテリアル	45.3	58.2	90,035	
ベクトル	20.2	23.6	18,337	
ウチヤマホールディングス	8.2	9.3	3,282	
チャーム・ケア・コーポレーション	5.3	16.1	14,763	
ライクキッズ	4	3.2	2,089	
キャリアリンク	6.1	6.2	3,106	
I B J	11.1	12.9	11,352	
アサンテ	6.6	7.6	11,871	
N・フィールド	10.7	13	6,708	
バリューHR	3.6	7.5	10,950	
M&Aキャピタルパートナーズ	5.9	15.4	51,051	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.9	7.2	10,389	
E R I ホールディングス	4.6	5.3	3,582	
アビスト	2.6	2.9	6,229	
シグマクシス	7.9	13	21,541	
ウィルグループ	10.8	12.4	8,568	
エスクロー・エージェント・ジャパン	22.8	26.1	5,167	
日本ビューホテル	5.2	—	—	
リクルートホールディングス	1,187.7	1,355.9	4,490,740	
エラン	11.4	11.2	19,712	
土木管理総合試験所	7.2	8.2	2,738	
ネットマーケティング	—	7.3	5,292	
日本郵政	1,358.9	1,551.4	1,344,132	
ベルシステム24ホールディングス	27.8	31.7	40,322	
鎌倉新書	12.1	14.2	16,145	
SMN	2.1	4	3,564	
一蔵	1.8	2	778	
L I T A L I C O	3.8	6.5	15,665	
グローバルキッズCOMPANY	2.5	3.4	2,261	
エアトリ	7.1	9.9	10,692	
アトラエ	4.3	5.7	15,720	
ストライク	6.3	7.1	30,956	
ソラスト	40.6	52.2	60,656	
セラク	5.2	5.9	5,451	
インソース	6.4	7.9	21,172	
ペイカレント・コンサルティング	11.7	11.5	73,715	
O r c h e s t r a H o l d i n g s	2.8	3.9	3,549	
アイモバイル	5.2	6.7	4,495	
キャリアインデックス	5.6	7.7	2,571	
M S - J a p a n	6.7	6.1	5,056	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
千株	千株	千円		
船場	2.7	3.1	2,901	
グレイステクノロジー	6	8.7	28,144	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	13	19.9	53,988	
フルテック	2.3	2.6	3,328	
グリーンズ	6.2	4.8	2,313	
ソナググループ・ホールディングス	2	3.2	1,513	
G a m e W i t h	—	5.6	3,757	
ソウルドアウト	1.7	3.9	8,482	
MS & Consulting	2.6	3.5	2,124	
ミダック	—	2.5	2,962	
日総工産	11	12.6	7,194	
キュービーネットホールディングス	10	7.8	15,584	
R P A ホールディングス	3.3	14.4	12,196	
スプリックス	5.5	5.3	5,130	
マネジメントソリューションズ	—	8.2	8,601	
プロレド・パートナーズ	—	2.5	11,237	
a n d f a c t o r y	—	1.8	2,014	
ギークス	—	1.9	2,547	
カーブスホールディングス	—	51.9	31,814	
フォーラムエンジニアリング	—	9.8	7,487	
アドバンテッジリスクマネジメント	6.5	9.5	7,742	
リログループ	90.6	103.5	244,156	
東洋	10.3	11.8	14,219	
エイチ・アイ・エス	29.5	29.5	50,769	
ラックランド	3.3	4.4	8,778	
共立メンテナンス	25.4	31.4	100,166	
イチネンホールディングス	17.2	21.2	24,676	
建設技術研究所	11.4	13.1	23,383	
スペース	10.7	12.3	12,570	
長大	6.1	7.5	6,555	
燐ホールディングス	3.6	8.2	10,553	
スバル興業	1.1	1.1	8,657	
東京テアトル	6.5	7.4	9,065	
タナベ経営	3.2	3.6	4,435	
ナガワ	4.6	6	45,060	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
千株	千株	千円		
よみうりランド	3.6	4.1	14,022	
東京都競馬	10.8	12.4	46,004	
常磐興産	6.6	7.6	10,700	
カナモト	24.8	31	68,417	
東京ドーム	62	76.6	64,803	
西尾レントオール	16.8	17.5	39,602	
トランス・コスモス	18.4	18	39,636	
乃村工藝社	38.8	81.1	69,827	
藤田観光	6.6	8.3	16,143	
K N T - C T ホールディングス	8.8	11.8	12,331	
日本管財	17.7	20.3	37,412	
トーカイ	16	18.3	48,385	
白洋舎	1.9	2.2	6,168	
セコム	175.9	200.9	1,823,167	
セントラル警備保障	8	9.1	41,177	
丹青社	31.3	35.7	25,918	
マイティック	20.5	23.2	112,520	
応用地質	17.8	20.4	26,479	
船井総研ホールディングス	34.3	39.1	96,146	
進学会ホールディングス	7.6	7.4	3,907	
オオバ	13	13.7	9,233	
いであ	3.3	4.6	7,176	
学究社	5.4	5.5	6,193	
ベネッセホールディングス	60.7	63	197,820	
イオンディライト	20.4	23.3	74,327	
ナック	10.5	10.5	9,355	
ニチイ学館	23.6	26.9	39,139	
ダイセキ	27.8	31.7	79,440	
ステップ	6.1	6.9	9,646	
合計	株数・金額	202,678	232,660	412,360,856
	銘柄数 <比率>	2,124	2,155	<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

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	証券数	証券数	評価額
千葉興業銀行	証券 —	証券 52,900	千円 —
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 T O P I X	百万円 10,688	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年5月11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 11,118,000 ( 1,363,100 )	

\* ( ) 内は利害関係人との貸付状況です。

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 412,360,856	% 91.6
コール・ローン等、その他	38,028,810	8.4
投資信託財産総額	450,389,666	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 (2020年5月11日現在)

項目	当期末
(A) 資産	
コレ・ローン等	450,389,666,393
株式(評価額)	32,266,982,653
未収入金	412,360,856,640
未収配当金	462,664,018
その他未収収益	4,886,600,988
差入委託証拠金	58,445,062
△	354,117,032
(B) 負債	27,333,027,419
未払金	5,053,891,310
未払解約金	3,602,490,602
未払利息	△ 583,670
受入担保金	18,677,229,177
(C) 純資産額(A-B)	423,056,638,974
元本	279,253,369,640
次期繰越損益金	143,803,269,334
(D) 受益権総口数	279,253,369,640口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,150円

(注) 期首元本額は255,168,558,362円、期中追加設定元本額は73,781,499,388円、期中一部解約元本額は49,696,688,110円、1口当たり純資産額は1.5150円です。

## ○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円 10,667,621,426
受取配当金	10,394,470,597
その他収益金	258,471,294
支払利息	14,679,535
(B) 有価証券売買損益	△ 17,691,027,053
売買益	29,568,751,490
売買損	△ 47,259,778,543
(C) 先物取引等取引損益	△ 269,517,299
取引益	1,925,063,700
取引損	△ 2,194,580,999
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 7,292,922,926
(E) 前期繰越損益金	138,857,187,954
(F) 追加信託差損益金	41,889,848,042
(G) 解約差損益金	△ 29,650,843,736
(H) 計(D+E+F+G)	143,803,269,334
次期繰越損益金(H)	143,803,269,334

\*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
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	円 94,157,564,115
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)	32,085,955,315
マイバランス70(確定拠出年金向け)	27,919,846,709
マイバランス50(確定拠出年金向け)	26,457,874,658
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,674,352,325
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,062,157,032
のむラップ・ファンド(普通型)	9,189,478,315
野村世界6資産分散投信(成長コース)	7,863,614,146
マイバランスDC50	5,457,529,791
マイバランスDC70	4,913,830,997
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)	4,642,419,189
マイ・ロード	4,109,666,209
マイバランスDC30	3,701,747,418
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,691,323,735
野村TOPIXインデックス(野村SMA・EW向け)	3,541,234,048
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,208,719,300
ノムラFOFsインデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	3,136,113,211
のむラップ・ファンド(保守型)	3,058,867,699
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,818,195,426

ファンド名	当期末
	元本額
のむラップ・ファンド(積極型)	円 2,390,153,730
野村インデックスファンド・TOPIX	1,999,544,011
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	1,455,387,497
野村6資産均等バランス	1,232,089,158
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	917,105,017
野村国内マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	821,049,059
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)	778,537,788
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	706,306,543
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)	696,225,584
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	683,070,338
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	541,536,129
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)日本株式	523,012,371
バランスセレクト70	487,539,195
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)	455,132,321
バランスセレクト50	391,792,038
のむラップ・ファンド(やや積極型)	322,305,058
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)	320,719,884
のむラップ・ファンド(やや保守型)	317,600,976
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)	281,167,497

ファンド名	当期末
	元本額
マイターゲット 2035 (確定拠出年金向け)	円 272,606,749
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)	258,261,402
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)	222,199,276
野村DC運用戦略ファンド	219,548,236
マイターゲット 2045 (確定拠出年金向け)	201,415,706
野村資産設計ファンド2040	184,582,895
バランスセレクト30	174,404,657
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	130,096,489
世界6資産分散ファンド	123,395,549
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)	122,170,294
野村資産設計ファンド2030	115,260,089
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)	111,611,612
マイターゲット 2060 (確定拠出年金向け)	110,036,463
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)	99,061,597
マイターゲット 2055 (確定拠出年金向け)	94,828,263
野村資産設計ファンド2025	93,797,402
野村資産設計ファンド2035	88,424,529
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	82,790,501
野村資産設計ファンド2020	57,296,113
野村資産設計ファンド2015	50,800,584
野村資産設計ファンド2050	45,352,971
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	43,639,787
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,763,299
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	34,210,355
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,044,853

ファンド名	当期末
	元本額
野村資産設計ファンド2045	円 27,639,246
インデックス・ブレンド(タイプV)	21,896,967
インデックス・ブレンド(タイプIII)	20,345,274
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	17,483,123
野村資産設計ファンド2060	15,955,479
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	15,391,799
ネクストコア	14,802,055
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)	14,032,340
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)	10,121,129
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	9,174,970
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	7,293,128
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,144,795
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	7,036,490
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	7,022,777
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,968,835
インデックス・ブレンド(タイプIV)	6,212,095
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	5,554,515
インデックス・ブレンド(タイプII)	5,107,703
インデックス・ブレンド(タイプI)	5,103,034
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)	4,309,313
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,566,305
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,470,954
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	3,084,725
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)	1,008,222
野村FIRE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)	280,864

## ○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18期（決算日2020年3月31日）

作成対象期間（2019年4月2日～2020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、お願ひ申し上げます。

#### ●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**  
東京都中央区日本橋 1-12-1

<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		株式組入比率	株式先物比率	投資信託券組入比率	純資産額
		期騰落率	MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)				
14期(2016年3月31日)	円 20,145	% △ 9.6	214.69	% △ 9.2	% 94.8	% 2.5	% 2.7 百万円 326,431
15期(2017年3月31日)	23,082	14.6	246.86	15.0	95.0	2.4	2.5 364,352
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

\*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はなく、ここに記載されたいかなるファンドに関し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。

(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

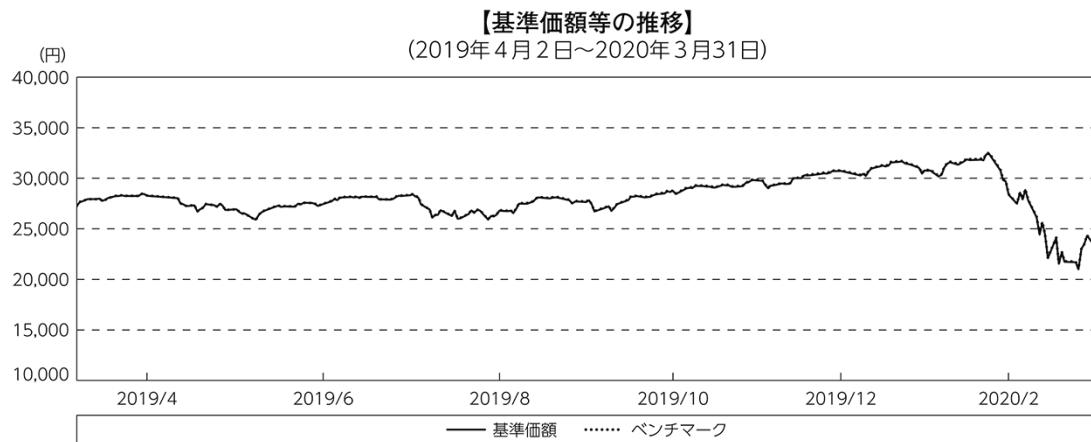
年月日	基準価額	ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託券組入比率
		騰落率	MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)			
(期首) 2019年4月1日	円 27,269	% —	293.26	% —	% 95.6	% 1.7 2.6
4月末	28,277	3.7	304.29	3.8	96.4	1.0 2.6
5月末	26,495	△ 2.8	285.11	△ 2.8	95.7	1.6 2.7
6月末	27,450	0.7	295.47	0.8	95.5	1.8 2.6
7月末	28,200	3.4	303.50	3.5	95.8	1.3 2.6
8月末	26,799	△ 1.7	288.66	△ 1.6	95.7	1.4 2.8
9月末	27,658	1.4	297.96	1.6	96.1	1.0 2.8
10月末	28,756	5.5	309.47	5.5	95.9	1.3 2.8
11月末	29,826	9.4	321.33	9.6	95.7	1.5 2.7
12月末	30,730	12.7	331.01	12.9	95.8	1.5 2.7
2020年1月末	30,768	12.8	331.59	13.1	95.5	1.7 2.7
2月末	28,354	4.0	305.63	4.2	95.8	1.3 2.8
(期末) 2020年3月31日	24,094	△11.6	260.14	△11.3	95.8	1.5 2.7

\*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、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

基準価額は、期首27,269円から期末24,094円に3,175円の値下がりとなりました。

中国発の新型肺炎の世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどを受けて、基準価額は下落しました。

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測の高まりなどを巡り一進一退となりましたが、2019年10月以降は、堅調な米企業の決算や市場予想を上回る米国の経済指標の発表、米中貿易協議の進展への期待などから上昇しました。2020年2月下旬には、中国発の新型肺炎の世界的な感染拡大への懸念から投資家のリスク回避姿勢が強まる中、下落に転じました。その後も、新型肺炎の世界的な感染拡大に歯止めがかからず、世界景気の先行き懸念が強まつたことや、OPEC（石油輸出国機構）とロシアなど非加盟産油国の減産交渉決裂を受けた原油価格の急落などを受けて、一段と下落しました。

為替市場は、期首から米中貿易摩擦への警戒感から投資家のリスク回避姿勢が強まつたことや、米利下げ観測が高まつたことなどを受けて主要通貨は対円で下落（円高）しました。2019年6月以降は、米中貿易摩擦の行方や米利下げ観測を巡り一進一退となりましたが、8月上旬には、米大統領による対中追加関税の発動表明を受けて下落（円高）しました。9月以降は、米中貿易協議の進展への期待などを受け投資家のリスク回避姿勢が和らぐ中、一進一退を繰り返しながら上昇（円安）しました。2020年2月下旬から3月にかけては、新型肺炎の世界的な感染拡大に対する警戒感などから一時的に大きく下落（円高）する場面もありました。

## ○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-11.6%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-11.3%を0.3ポイント下回りました。

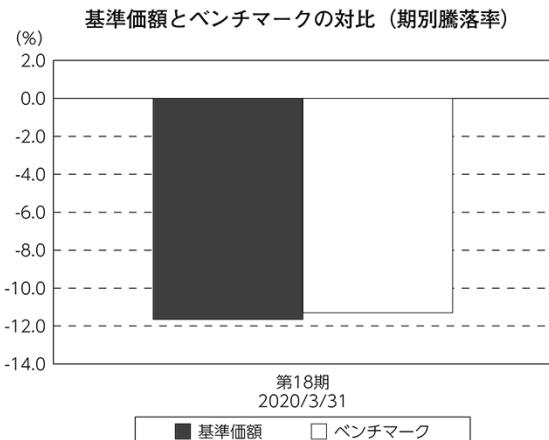
主な差異要因は以下の通りです。

### （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。

(2019年4月2日～2020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	%	
(株式)	1	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
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	2	0.008	(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)	(2)	(0.008)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他の費用	3	0.010	(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)	(3)	(0.009)	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)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	6	0.020	
期中の平均基準価額は、28,483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。

(2019年4月2日～2020年3月31日)

## ○売買及び取引の状況

## 株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	アメリカ	百株 79,777 ( 9,263)	千米ドル 641,771 ( 35,140)	百株 27,997 ( 8,405)	千米ドル 198,584 ( 47,724)
	カナダ	12,595 ( 109)	千カナダドル 52,239 ( 3,059)	5,978 ( 2,246)	千カナダドル 14,214 ( 5,445)
	イギリス	76,298 (289,640)	千英ポンド 46,418 ( 551)	21,076 (286,677)	千英ポンド 12,519 ( 1,427)
	スイス	4,433 ( 592)	千スイスフラン 31,526 (△ 793)	1,247	千スイスフラン 9,128
	スウェーデン	5,916 ( 1,740)	千スウェーデンクローナ 83,865 ( 17,719)	2,310 ( 700)	千スウェーデンクローナ 23,975 ( 17,719)
	ノルウェー	1,289 ( 129)	千ノルウェークローネ 17,555 ( 一)	669	千ノルウェークローネ 10,486
	デンマーク	962 ( 28)	千デンマーククローネ 46,598 ( 一)	364	千デンマーククローネ 15,937
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	6,566 ( 95)	26,839 (△ 333)	1,927 ( 59)	8,324 ( 271)
	イタリア	13,204	7,480	5,178	2,028
	フランス	7,145 ( 120)	32,504 (△ 20)	2,040	9,026
	オランダ	5,950	17,633	534	3,393
	スペイン	11,899 ( 24,179)	9,106 ( 854)	3,328 ( 23,448)	2,614 ( 622)
	ベルギー	512	3,812	81	648
	オーストリア	218 ( 一)	673 (△ 56)	58	223
	ルクセンブルグ	782	742	54	228
	フィンランド	2,142 ( 413)	3,096 ( 一)	467	735
	アイルランド	300	1,311	102	521
	ポルトガル	620	540	150	217
	香港	24,871 ( 1,426)	千香港ドル 91,240 ( 一)	11,229	千香港ドル 31,614

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外 国	シンガポール	百株 8,940	千シンガポールドル 5,481	百株 11,890	千シンガポールドル 1,646
	オーストラリア	20,306 ( 1,903)	千豪ドル 34,833 ( 2,517)	5,798 ( 1,903)	千豪ドル 10,804 ( 2,622)
	ニュージーランド	2,713	千ニュージーランドドル 1,553	—	千ニュージーランドドル —
	イスラエル	2,988 ( 82)	千新シェケル 6,260 ( —)	3,081	千新シェケル 1,711

\* 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。

## 投資信託証券

銘 柏	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
	AGNC INVESTMENT CORP	9,000	140	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,500	503	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	12,600	2,768	3,400	760
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	18,000	158	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,100	804	1,400	288
	BOSTON PROPERTIES	5,200	639	1,200	167
	BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	—	—	15,000	292
	CAMDEN PROPERTY TRUST	1,400	153	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	10,000	1,414	2,300	326
	DIGITAL REALTY TRUST INC	12,900	1,680	—	—
	DUKE REALTY CORP	8,800	288	—	—
	EQUINIX INC	2,320	1,297	—	—
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,400 ( 12,100)	1,617 ( —)	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL	10,300	783	3,900	310
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,040	319	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,800	300	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1,300	168	—	—
	HCP INC	4,400 (△ 70,500)	157 (△ 2,226)	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,200 ( 70,500)	167 ( 2,226)	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	9,000	142	—	—
	INVITATION HOMES INC	40,000	1,052	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	4,800	156	—	—
	KIMCO REALTY CORP	7,000	146	—	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,600 (△ 22,400)	137 (△ 1,096)	—	—
	MACERICH CO /THE	4,300	139	18,500	494
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,670	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	327	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,900	236	—	—
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,200	1,354	—	—
	PROLOGIS INC	16,780 ( 15,120)	1,374 ( 1,096)	3,700	320
	PUBLIC STORAGE	3,000	687	—	—
	REALTY INCOME CORP	10,600	780	—	—
	REGENCY CENTERS CORP	5,200	320	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,570	649	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	7,800	944	2,200	329
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	1,861	—	—
	UDR INC	9,600	396	—	—
	VENTAS INC	7,600	502	—	—
	VEREIT INC	35,000	330	—	—
	VICI PROPERTIES INC	68,000	1,672	—	—
	VORNADO REALTY TRUST	2,800	135	—	—
	WP CAREY INC	5,900	424	—	—
	WELLTOWER INC	13,500	1,073	2,100	173

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外 国	アメリカ WEYERHAEUSER CO	20,000	511	5,500
	小計	541,310 ( 4,820)	30,390 ( —)	59,200
	カナダ CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	629	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	( 25,000)	( 535)	9,000
	小計	11,500 ( 25,000)	629 ( 535)	9,000
	イギリス HAMMERSON PLC	—	—	108,000
	SEGRO PLC	31,000	238	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	12,000	91	—
	小計	43,000	329	108,000
	ユーロ フランス ICADE	1,400	98	1,300
外 国	KLEPIERRE	4,300	88	—
	GECINA SA	700	121	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,300	243	—
	小計	8,700	551	1,300
	ユーロ計	8,700	551	1,300
	香港 LINK REIT	55,000	4,384	13,000
	小計	55,000	4,384	13,000
	シンガポール CAPITALAND MALL TRUST	70,000	178	60,000
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	( 60,800)	( 170)	—
	ASCENDAS REAL ESTATE-RTS	( 60,800)	( 159)	( 60,800)
外 国	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	70,000	138	—
	SUNTEC REIT	( —)	(△ 2)	—
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000 ( —)	845 (△ 0.09)	—
	小計	510,000 ( 121,600)	1,162 ( 327)	60,000 ( 60,800)
	オーストラリア MIRVAC GROUP	170,000	433	—
	GPT GROUP	29,000	178	—
	LENDLEASE GROUP	11,000	195	—
	DEXUS	31,000	390	—
	GOODMAN GROUP	27,000	378	—
	SCENTRE GROUP	147,000	330	—
外 国	VICINITY CENTRES	60,000	159	70,000
	小計	475,000	2,067	70,000
* 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 104,098	百万円 105,073	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。

## ○株式売買比率

(2019年4月2日～2020年3月31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	133,290,598千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	580,156,228千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22

\*(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

(2019年4月2日～2020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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 112,554	百万円 —	% —	百万円 54,520	百万円 743	% 1.4

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。

(2020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)	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		
AFLAC INC	1,053	1,147	4,159	452,626		保険	
AES CORP	910	1,010	1,379	150,148		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AT & T INC	9,938	11,424	34,534	3,758,417		各種電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	2,396	2,768	21,961	2,390,049		ヘルスケア機器・用品	
ABBVIE INC	2,059	2,316	17,425	1,896,426		バイオテクノロジー	
ABIOMED INC	58	72	1,072	116,744		ヘルスケア機器・用品	
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,004	1,208	7,063	768,685		娯楽	
ACUITY BRANDS INC	50	62	531	57,866		電気設備	
ADOBE INC	665	757	24,121	2,625,113		ソフトウェア	
ADVANCE AUTO PARTS	99	109	1,051	114,472		専門小売り	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,260	1,663	7,959	866,190		半導体・半導体製造装置	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	75	—	—	—		資本市場	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	444	490	3,560	387,525		ライフサイエンス・ツール/サービス	
AIR PRODUCTS	304	347	7,166	779,940		化学	
AKAMAI TECHNOLOGIES	225	258	2,430	264,468		情報技術サービス	
ALBEMARLE CORP	148	167	928	101,050		化学	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	307	342	2,984	324,780		バイオテクノロジー	
ALIGN TECHNOLOGY INC	102	118	2,123	231,052		ヘルスケア機器・用品	
ALLEGHANY CORP	21	23	1,300	141,574		保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	66	66	226	24,636		情報技術サービス	
ALLIANT ENERGY CORP	310	376	1,901	206,932		電力	
ALLSTATE CORP	466	506	4,788	521,163		保険	
ALLY FINANCIAL INC	574	574	879	95,701		消費者金融	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	127	175	1,904	207,269		バイオテクノロジー	
ALPHABET INC-CL C	429	483	55,425	6,031,990		インターネット・メディアおよびサービス	
ALPHABET INC-CL A	408	468	53,693	5,843,426		インターネット・メディアおよびサービス	
ALTICE USA INC-A	470	200	458	49,865		メディア	
ALTRIA GROUP INC	2,561	2,931	10,935	1,190,117		タバコ	
AMAZON.COM INC	568	658	129,306	14,072,422		インターネット販売・通信販売	
AMERCO	11	11	346	37,687		陸運・鉄道	
AMEREN CORPORATION	328	391	3,056	332,633		総合公益事業	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	146	146	178	19,464		旅客航空輸送業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	683	777	6,504	707,859		電力	
AMERICAN EXPRESS CO	999	1,079	9,740	1,060,018		消費者金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	108	125	894	97,348		保険	
AMERICAN INTL GROUP	1,198	1,378	3,542	385,567		保険	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	247	283	3,586	390,283		水道	
AMERISOURCEBERGEN CORP	220	239	2,105	229,151		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	192	203	2,215	241,139		資本市場	
AMETEK INC	318	355	2,617	284,814		電気設備	
AMGEN INC	872	930	19,388	2,110,065		バイオテクノロジー	
AMPHENOL CORP-CL A	413	464	3,518	382,919		電子装置・機器・部品	
ANADARKO PETE	678	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料	
ANALOG DEVICES INC	510	581	5,285	575,205		半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	115	134	3,150	342,895		ソフトウェア	
ANTHEM INC	354	394	9,084	988,704		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
APACHE CORPORATION	541	541	222	24,198		石油・ガス・消耗燃料	
APPLE INC	6,488	6,940	176,855	19,247,235		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		
				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	1,363	1,436	6,792	739,203		半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	354	410	864	94,104		ホテル・レストラン・レジャー	
ARCHER DANIELS MIDLAND	755	884	3,167	344,705		食品	
ARCONIC INC	570	570	934	101,734		航空宇宙・防衛	
ARISTA NETWORKS INC	74	81	1,666	181,355		通信機器	
ARROW ELECTRS INC	121	121	650	70,740		電子装置・機器・部品	
ASSURANT INC	76	90	965	105,126		保険	
ATMOS ENERGY CORP	156	184	1,891	205,894		ガス	
AUTODESK INC.	300	342	5,332	580,294		ソフトウェア	
AUTOLIV INC	119	119	555	60,505		自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESS	595	679	9,357	1,018,428		情報技術サービス	
AUTOZONE	34	36	3,216	350,028		専門小売り	
AVERY DENNISON CORP	122	134	1,403	152,788		容器・包装	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	310	—	—	—		各種金融サービス	
BB&T CORPORATION	1,049	—	—	—		銀行	
BAKER HUGHES CO	681	1,010	1,106	120,470		エネルギー設備・サービス	
BALL CORP	454	475	3,134	341,130		容器・包装	
BANK OF AMERICA CORP	12,735	13,370	29,467	3,206,945		銀行	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,368	1,279	4,348	473,258		資本市場	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	696	755	6,205	675,327		ヘルスケア機器・用品	
BECTON, DICKINSON	369	420	9,360	1,018,707		ヘルスケア機器・用品	
BEIGENE, LTD ADR	46	63	789	85,971		バイオテクノロジー	
WR BERKLEY CORP	130	217	1,182	128,731		保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,768	2,055	37,643	4,096,741		各種金融サービス	
BEST BUY COMPANY INC	338	363	2,168	236,044		専門小売り	
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	36	1,270	138,296		ライフサイエンス・ツール/サービス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	241	280	2,309	251,366		バイオテクノロジー	
BIOGEN INC	275	283	8,959	975,021		バイオテクノロジー	
BLACK KNIGHT INC	—	242	1,426	155,255		情報技術サービス	
BLACKROCK INC	161	181	8,282	901,418		資本市場	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	1,040	4,917	535,130		資本市場	
H & R BLOCK INC	279	—	—	—		各種消費者サービス	
BOEING CO	739	838	12,761	1,388,786		航空宇宙・防衛	
BOOKING HOLDINGS INC	63	65	8,503	925,435		インターネット販売・通信販売	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	226	1,610	175,317		情報技術サービス	
BORGWARNER INC	296	296	727	79,181		自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,891	2,193	6,938	755,133		ヘルスケア機器・用品	
BRIGHOUSE FINANCIAL INC	139	—	—	—		保険	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,222	3,670	19,961	2,172,369		医薬品	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	163	179	1,735	188,844		情報技術サービス	
BROADCOM INC	565	622	14,934	1,625,358		半導体・半導体製造装置	
BROWN & BROWN INC	—	388	1,447	157,503		保険	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	356	478	2,706	294,593		飲料	
BURLINGTON STORES INC	89	105	1,706	185,725		専門小売り	
CBS CORP-CL B	470	—	—	—		メディア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	150	179	1,665	181,227		資本市場	
CBRE GROUP INC	455	483	1,981	215,673		不動産管理・開発	
CDK GLOBAL INC	167	200	683	74,330		ソフトウェア	
CDW CORPORATION	211	224	2,170	236,246		電子装置・機器・部品	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	314	353	939	102,266		化学	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	183	201	1,310	142,602		航空貨物・物流サービス	
CIGNA CORP	519	580	10,339	1,125,202		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CIT GROUP INC	134	—	—	—		銀行	
CME GROUP INC	488	562	9,778	1,064,165		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		
				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			
CMS ENERGY CORP	378	433	2,682	291,882		総合公益事業	
CSX CORP	1,090	1,162	6,741	733,723		陸運・鉄道	
CVS HEALTH CORP	1,781	2,040	12,174	1,324,974		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CABOT OIL & GAS CORP	585	640	1,120	121,959		石油・ガス・消耗燃料	
CAENCE DESIGN SYS INC	378	446	2,984	324,768		ソフトウェア	
CAMPBELL SOUP CO	248	248	1,153	125,583		食品	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	656	723	3,894	423,871		消費者金融	
CARDINAL HEALTH INC	410	443	2,145	233,537		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CARMAX INC	239	261	1,455	158,355		専門小売り	
CARNIVAL CORP	586	621	794	86,506		ホテル・レストラン・レジャー	
CATERPILLAR INC DEL	811	868	9,696	1,055,262		機械	
CELANESE CORP-SERIES A	180	196	1,452	158,060		化学	
CELGENE CORP	962	—	—	—		バイオテクノロジー	
CENTENE CORP	558	921	5,315	578,441		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	704	754	1,223	133,179		総合公益事業	
CENTURYLINK INC	1,360	1,480	1,456	158,491		各種電気通信サービス	
CERNER CORP	406	499	3,205	348,862		ヘルスケア・テクノロジー	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	217	235	10,633	1,157,287		メディア	
CHEMOURS CO/THE	234	—	—	—		化学	
CHENIERE ENERGY INC	286	364	1,184	128,904		石油・ガス・消耗燃料	
CHEVRON CORP	2,619	2,960	21,297	2,317,774		石油・ガス・消耗燃料	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	33	41	2,636	286,949		ホテル・レストラン・レジャー	
CHURCH & DWIGHT CO INC	329	375	2,430	264,497		家庭用品	
CIMAREX ENERGY CO	138	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	216	246	1,961	213,481		保険	
CISCO SYSTEMS	6,163	6,638	26,764	2,912,771		通信機器	
CINTAS CORP	127	134	2,418	263,154		商業サービス・用品	
CITIGROUP	3,345	3,421	15,079	1,641,131		銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	639	700	1,375	149,695		銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	185	199	2,903	315,999		ソフトウェア	
CLOROX CO	177	193	3,367	366,481		家庭用品	
COCA COLA CO	5,520	6,368	28,656	3,118,632		飲料	
COGNEX CORP	248	278	1,263	137,538		電子装置・機器・部品	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	804	866	4,103	446,541		情報技術サービス	
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,127	1,265	8,422	916,606		家庭用品	
COMCAST CORP-CL A	6,220	7,104	25,212	2,743,832		メディア	
COMERICA INC	230	230	713	77,670		銀行	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	228	—	—	—		通信機器	
CONAGRA BRANDS INC	667	769	2,170	236,257		食品	
CONCHO RESOURCES INC	276	310	1,273	138,592		石油・ガス・消耗燃料	
CONOCOPHILLIPS	1,586	1,710	5,008	545,084		石油・ガス・消耗燃料	
CONSOLIDATED EDISON INC	423	525	4,238	461,256		総合公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	228	259	3,792	412,769		飲料	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	139	139	107	11,663		石油・ガス・消耗燃料	
THE COOPER COMPANIES, INC.	65	75	2,123	231,104		ヘルスケア機器・用品	
COPART INC	279	319	2,291	249,405		商業サービス・用品	
CORNING INC	1,080	1,190	2,532	275,592		電子装置・機器・部品	
CORTEVA INC	—	1,150	2,770	301,497		化学	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	597	691	20,133	2,191,167		食品・生活必需品小売り	
COSTAR GROUP INC	51	58	3,485	379,375		専門サービス	
COTY INC-CL A	650	490	265	28,849		パーソナル用品	
CROWN HOLDINGS INC	191	212	1,240	135,017		容器・包装	
CUMMINS INC	205	226	3,039	330,761		機械	
DR HORTON INC	480	538	1,981	215,700		家庭用耐久財	

銘	柄	期首(前期末)		当期末		業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
DTE ENERGY COMPANY		251	305	3,032	330,039	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO		378	378	545	59,402	情報技術サービス
DANAHER CORP		860	981	13,814	1,503,425	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC		166	198	1,125	122,502	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC		175	148	1,130	123,072	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY		422	471	6,651	723,929	機械
DELL TECHNOLOGIES-C		207	266	1,058	115,216	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC		224	252	722	78,627	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC		303	352	1,379	150,167	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP		624	624	396	43,122	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC		116	144	4,025	438,088	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC		216	231	544	59,304	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO		2,459	2,820	28,143	3,062,867	娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		463	496	1,864	202,909	消費者金融
DISCOVERY INC - A		193	245	490	53,353	メディア
DISCOVERY INC - C		398	570	1,023	111,349	メディア
DISH NETWORK CORP-A		319	371	769	83,699	メディア
DOCUSIGN INC		—	166	1,463	159,231	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP		361	397	5,826	634,127	複合小売り
DOLLAR TREE INC		324	376	3,002	326,746	複合小売り
DOMINION ENERGY INC		1,024	1,278	9,816	1,068,309	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC		52	59	2,045	222,647	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP		197	229	1,961	213,432	機械
DOW INC		—	1,152	3,300	359,191	化学
DOWDUPONT INC		3,141	—	—	—	化学
DROPBOX INC-CLASS A		—	390	707	77,035	ソフトウェア
DUKE ENERGY CORP		973	1,138	9,497	1,033,639	電力
DUPONT DE NEMOURS INC		—	1,150	3,866	420,769	化学
EOG RESOURCES INC		800	904	3,162	344,141	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP		350	350	1,235	134,497	資本市場
EAST WEST BANCORP INC		207	207	556	60,577	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.		186	208	990	107,773	化学
EATON VANCE CORP		164	164	553	60,290	資本市場
EBAY INC		1,237	1,200	3,742	407,328	インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC		360	401	6,472	704,362	化学
EDISON INTERNATIONAL		450	555	3,125	340,116	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		284	325	6,371	693,459	ヘルスケア機器・用品
ELANCO ANIMAL HEALTH INC		361	600	1,355	147,508	医薬品
ELECTRONIC ARTS		408	461	4,503	490,116	娯楽
EMERSON ELEC		861	938	4,373	476,010	電気設備
ENTERGY CORP		254	313	3,132	340,876	電力
EPAM SYSTEMS INC		—	84	1,581	172,065	情報技術サービス
EQUIifax INC		161	185	2,258	245,830	専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC		—	620	958	104,315	各種金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		—	37	645	70,201	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC		—	349	1,502	163,511	水道
EVERY INC		372	359	2,122	230,942	電力
EVERSOURCE ENERGY		442	503	4,207	457,912	電力
EXACT SCIENCES CORP		—	226	1,320	143,711	バイオテクノロジー
EXELON CORPORATION		1,322	1,515	5,640	613,838	電力
EXPEDIA GROUP INC		173	207	1,167	127,034	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC		230	273	1,828	198,971	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP		5,784	6,621	24,828	2,702,112	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC		178	207	665	72,404	電子装置・機器・部品

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		
			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		
FMC CORP	180	196	1,619	176,276	化学	
FACEBOOK INC-A	3,283	3,761	62,413	6,792,493	インターネット・メディアおよびサービス	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	59	1,586	172,710	資本市場	
FASTENAL CO	387	874	2,779	302,473	商社・流通業	
FEDEX CORPORATION	344	391	4,860	528,970	航空貨物・物流サービス	
F5 NETWORKS INC	81	93	1,021	111,140	通信機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	451	964	12,077	1,314,443	情報技術サービス	
FNF GROUP	372	405	1,069	116,361	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	1,063	1,120	1,776	193,377	銀行	
FIRST DATA CORP- CLASS A	740	—	—	—	情報技術サービス	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	226	257	2,220	241,654	銀行	
FISERV INC	541	908	8,928	971,673	情報技術サービス	
FIRSTENERGY CORP	714	834	3,376	367,504	電力	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	121	138	2,677	291,389	情報技術サービス	
FLUOR CORP	184	—	—	—	建設・土木	
FLOWSERVE CORP	172	206	463	50,420	機械	
FORD MOTOR COMPANY	5,160	6,070	3,053	332,280	自動車	
FORTINET INC	199	228	2,301	250,489	ソフトウェア	
FORTIVE CORP	406	476	2,479	269,894	機械	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	194	216	961	104,630	建設関連製品	
FOX CORP-CLASS A	480	528	1,283	139,690	メディア	
FOX CORP-CLASS B	198	254	603	65,706	メディア	
FRANKLIN RESOURCES INC	434	434	770	83,884	資本市場	
FREEPORT-MCMORAN INC	1,870	2,250	1,404	152,797	金属・鉱業	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	249	297	2,471	268,987	保険	
GAP INC	315	315	233	25,436	専門小売り	
GARTNER INC	127	141	1,520	165,434	情報技術サービス	
GENERAL DYNAMICS	345	383	5,116	556,870	航空宇宙・防衛	
GENERAL ELEC CO	11,980	13,550	10,690	1,163,496	コングロマリット	
GENERAL MILLS	805	943	5,101	555,210	食品	
GENERAL MOTORS CO	1,757	1,990	4,242	461,730	自動車	
GENUINE PARTS CO	196	232	1,533	166,842	販売	
GILEAD SCIENCES INC	1,762	1,982	15,049	1,637,818	バイオテクノロジー	
GLOBAL PAYMENTS INC	212	473	7,153	778,480	情報技術サービス	
GLOBE LIFE INC	—	157	1,165	126,814	保険	
GODADDY INC - CLASS A	227	269	1,591	173,192	情報技術サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP	457	501	7,996	870,309	資本市場	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	340	—	—	—	自動車部品	
GRAINGER (W. W. ) INC	64	70	1,785	194,368	商社・流通業	
GRUBHUB INC	119	145	573	62,411	インターネット販売・通信販売	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	121	1,005	109,403	ソフトウェア	
HCA HEALTHCARE INC	375	424	3,856	419,725	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	229	268	740	80,616	商社・流通業	
HP INC	2,190	2,320	4,138	450,434	コンピュータ・周辺機器	
HALLIBURTON CO	1,196	1,280	815	88,735	エネルギー・設備・サービス	
HANESBRANDS INC	510	510	411	44,735	繊維・アパレル・贅沢品	
HARLEY-DAVIDSON INC	224	224	401	43,685	自動車	
HARRIS CORP	160	—	—	—	航空宇宙・防衛	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	482	545	1,953	212,575	保険	
HASBRO INC	158	196	1,401	152,471	レジャー用品	
HEICO CORP	—	63	484	52,718	航空宇宙・防衛	
HEICO CORP-CLASS A	—	124	818	89,079	航空宇宙・防衛	
HELMERICH & PAYNE	146	—	—	—	エネルギー・設備・サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	106	117	1,825	198,700	情報技術サービス	

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		
				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			
HERSHEY CO/THE	190	235	3,237	352,373		食品	
HESS CORP	366	432	1,379	150,117		石油・ガス・消耗燃料	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,000	2,020	2,030	220,935		コンピュータ・周辺機器	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	395	416	2,857	310,936		ホテル・レストラン・レジャー	
HOLLYFRONTIER CORP	236	236	614	66,829		石油・ガス・消耗燃料	
HOLOGIC INC	408	433	1,515	164,931		ヘルスケア機器・用品	
HOME DEPOT	1,548	1,706	33,454	3,640,870		専門小売り	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,009	1,120	14,756	1,605,895		コングロマリット	
HORMEL FOODS CORP	391	456	2,133	232,152		食品	
HUMANA INC	185	204	6,377	694,020		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	118	132	1,234	134,404		陸運・鉄道	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,410	1,540	1,289	140,363		銀行	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	56	65	1,232	134,079		航空宇宙・防衛	
IAC/INTERACTIVE CORP	104	126	2,268	246,840		インターネット・メディアおよびサービス	
IPG PHOTONICS CORP	47	59	644	70,116		電子装置・機器・部品	
IDEX CORP	103	123	1,683	183,228		機械	
IDEXX LABORATORIES INC	121	136	3,277	356,730		ヘルスケア機器・用品	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	405	500	7,117	774,597		機械	
ILLUMINA INC	201	228	6,320	687,821		ライフサイエンス・ツール/サービス	
INCYTE CORP	249	285	2,056	223,846		バイオテクノロジー	
INGERSOLL-RAND INC	—	528	1,254	136,581		機械	
INGREDION INC	96	96	741	80,739		食品	
INSULTEC CORP	—	98	1,710	186,195		ヘルスケア機器・用品	
INTEL CORP	6,256	6,802	37,744	4,107,711		半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	785	876	7,341	799,003		資本市場	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,244	1,388	15,674	1,705,875		情報技術サービス	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	115	155	1,674	182,198		化学	
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	523	598	1,873	203,896		容器・包装	
INTERPUBRIC GROUP	500	580	939	102,256		メディア	
INTUIT INC	337	404	9,617	1,046,642		ソフトウェア	
INTUITIVE SURGICAL INC	155	181	9,151	995,967		ヘルスケア機器・用品	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	214	1,031	112,279		バイオテクノロジー	
IQVIA HOLDINGS INC	224	252	2,847	309,849		ライフサイエンス・ツール/サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	4,544	4,903	45,843	4,989,099		銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	179	200	1,559	169,753		建設・土木	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	420	430	602	65,515		各種金融サービス	
JOHNSON & JOHNSON	3,665	4,114	54,720	5,955,211		医薬品	
JONES LANG LASALLE INC	63	76	816	88,864		不動産管理・開発	
JUNIPER NETWORKS INC	467	530	1,073	116,801		通信機器	
KLA CORP	219	244	3,648	397,043		半導体・半導体製造装置	
KKR & CO INC-A	680	784	1,922	209,211		資本市場	
KANSAS CITY SOUTHERN	142	151	1,953	212,614		陸運・鉄道	
KELLOGG CO	356	400	2,436	265,153		食品	
KEYCORP	1,460	1,580	1,704	185,535		銀行	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	252	289	2,475	269,416		電子装置・機器・部品	
KIMBERLY-CLARK CORP	469	533	7,058	768,178		家庭用品	
KINDER MORGAN INC	2,730	3,150	4,180	454,914		石油・ガス・消耗燃料	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	167	208	692	75,357		陸運・鉄道	
KOHLS CORP	225	253	405	44,136		複合小売り	
KRAFT HEINZ CO/THE	847	1,041	2,620	285,156		食品	
KROGER CO	1,076	1,269	3,762	409,482		食品・生活必需品小売り	
L BRANDS, INC	303	—	—	—		専門小売り	
LKQ CORP	450	450	945	102,844		販売	
L3 TECHNOLOGIES INC	109	—	—	—		航空宇宙・防衛	

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	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		—	344	6,259	681,213	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		142	149	1,966	213,965	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH		212	224	5,718	622,368	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC		193	217	1,250	136,123	食品
LAS VEGAS SANDS CORP		549	538	2,339	254,636	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		299	344	5,683	618,580	パーソナル用品
LEAR CORP		93	84	743	80,949	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC		189	189	530	57,736	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC		200	215	2,008	218,611	情報技術サービス
LENNAR CORP-A		407	430	1,718	187,000	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC		51	51	954	103,891	建設関連製品
LIBERTY BROADBAND CORP-C		139	167	1,904	207,263	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP		129	129	390	42,482	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C		224	267	815	88,800	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		293	293	778	84,756	娯楽
ELI LILLY & CO.		1,224	1,353	18,730	2,038,487	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP		299	299	815	88,769	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN		208	230	1,040	113,214	娯楽
LOCKHEED MARTIN		349	397	13,880	1,510,641	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP		361	433	1,534	166,958	保険
LOWES COS INC		1,098	1,205	10,689	1,163,344	専門小売り
LUULULEMON ATHLETICA INC		138	172	3,335	363,031	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP		179	200	2,138	232,678	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL		700	790	910	99,129	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC		120	131	3,865	420,666	資本市場
MACYS INC		437	—	—	—	複合小売り
MANPOWERGROUP INC		80	96	529	57,650	専門サービス
MARATHON OIL CORP		1,110	1,230	398	43,370	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP		946	985	2,396	260,811	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP		18	21	2,017	219,519	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC		—	58	2,051	223,287	資本市場
MARSH & MCLENNAN COS		691	794	7,110	773,810	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA		394	432	3,290	358,062	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS		89	97	1,741	189,510	建設資材
MASCO CORP		428	428	1,509	164,284	建設関連製品
MASTERCARD INC		1,259	1,403	35,553	3,869,316	情報技術サービス
MATCH GROUP INC		—	84	560	60,947	インターラクティブ・メディアおよびサービス
MATTEL INC		480	—	—	—	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		374	424	2,116	230,304	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.		168	189	2,705	294,443	食品
MCDONALD'S CORP		1,056	1,179	19,822	2,157,285	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP		270	256	3,533	384,530	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	423	46,141	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC		57	69	3,270	355,921	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC		3,564	3,983	30,649	3,335,550	医薬品
METLIFE INC		1,159	1,206	3,862	420,390	保険
METTLER-TOLEDO INTL		34	38	2,659	289,417	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP		9,970	11,321	181,396	19,741,368	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY		330	373	2,573	280,055	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY		1,545	1,740	7,746	843,049	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP		75	87	495	53,968	機械
MOHAWK INDUSTRIES		87	87	697	75,887	家庭用耐久財
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B		256	284	1,144	124,558	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC		1,985	2,259	11,550	1,257,015	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		
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円		
MONGODB INC		—	74	1,009	109,872	情報技術サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP		559	638	3,700	402,714	飲料	
MOODYS CORP		235	268	5,955	648,136	資本市場	
MORGAN STANLEY	1,753	1,910	6,654	724,202		資本市場	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	450	450	199	21,744		食品・生活必需品小売	
MOSAIC CO/THE	488	560	560	60,944		化学	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	221	268	3,574	388,992		通信機器	
NRG ENERGY INC	400	405	1,152	125,396		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
NVR INC	4	5	1,517	165,127		家庭用耐久財	
NASDAQ INC	154	184	1,829	199,125		資本市場	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	506	580	545	59,334		エネルギー設備・サービス	
NEKTAR THERAPEUTICS	250	—	—	—		医薬品	
NETAPP INC	352	352	1,433	155,990		コンピュータ・周辺機器	
NETFLIX INC	595	685	25,440	2,768,682		娯楽	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	142	1,300	141,541		バイオテクノロジー	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,610	1,840	697	75,893		不動産管理・開発	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	307	354	1,663	181,071		コングロマリット	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	300	333	690	75,198		コングロマリット	
NEWELL BRANDS INC	670	660	900	97,973		家庭用耐久財	
NEWMONT CORP	717	1,276	5,915	643,787		金属・鉱業	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	550	550	485	52,793		メディア	
NEXTERA ENERGY INC	651	765	18,819	2,048,155		電力	
NIKE INC-B	1,742	1,952	16,666	1,813,779		繊維・アパレル・贅沢品	
NISOURCE INC	476	582	1,517	165,188		総合公益事業	
NOBLE ENERGY INC	644	710	377	41,029		石油・ガス・消耗燃料	
NORDSTROM INC	150	150	236	25,760		複合小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	371	403	5,976	650,377		陸運・鉄道	
NORTHERN TRUST CORP	284	321	2,432	264,768		資本市場	
NORTHROP GRUMMAN CORP	223	251	7,893	859,016		航空宇宙・防衛	
NORTONLIFELOCK INC	—	980	1,871	203,707		ソフトウェア	
NUCOR CORP	427	467	1,630	177,476		金属・鉱業	
NVIDIA CORP	796	909	24,166	2,629,989		半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	286	325	1,036	112,829		電力	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	110	119	3,808	414,504		専門小売	
OCCIDENTAL PETE CORP	1,029	1,420	1,563	170,146		石油・ガス・消耗燃料	
OKTA INC	—	165	2,061	224,354		情報技術サービス	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	86	153	2,060	224,238		陸運・鉄道	
OMNICOM GROUP	303	345	1,894	206,204		メディア	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	590	590	765	83,279		半導体・半導体製造装置	
ONEOK INC	560	670	1,342	146,123		石油・ガス・消耗燃料	
ORACLE CORPORATION	3,631	3,598	18,119	1,971,948		ソフトウェア	
OWENS CORNING INC	142	168	669	72,914		建設関連製品	
PNC FINANCIAL	627	689	6,956	757,112		銀行	
PPG INDUSTRIES	326	368	3,161	344,104		化学	
PPL CORPORATION	976	1,148	2,965	322,711		電力	
PVH CORP	99	116	443	48,249		繊維・アパレル・贅沢品	
PTC INC	147	170	1,007	109,656		ソフトウェア	
PACCAR	478	538	3,350	364,594		機械	
PACKAGING CORP OF AMERICA	132	145	1,316	143,222		容器・包装	
PALO ALTO NETWORKS INC	126	152	2,530	275,377		ソフトウェア	
PARKER HANNIFIN CORP	181	201	2,620	285,138		機械	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	370	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料	
PAYCHEX INC	450	505	3,253	354,046		情報技術サービス	
PAYCOM SOFTWARE INC	—	75	1,606	174,881		ソフトウェア	

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		
				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		
PAYPAL HOLDINGS INC	1,526	1,747	16,951	1,844,792		情報技術サービス	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	500	710	817	88,936		銀行	
PEPSICO INC	1,926	2,182	27,379	2,979,736		飲料	
PERKINELMER INC	—	174	1,331	144,882		ライフサイエンス・ツール/サービス	
PFIZER INC	7,924	8,658	28,285	3,078,331		医薬品	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,121	2,437	17,680	1,924,161		タバコ	
PHILLIPS 66	594	703	3,807	414,364		石油・ガス・消耗燃料	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	154	170	1,332	144,974		電力	
PINTEREST INC- CLASS A	—	460	709	77,195		インターネット・メディアおよびサービス	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	232	261	1,735	188,862		石油・ガス・消耗燃料	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	190	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料	
POLARIS INC	83	83	391	42,608		レジャー用品	
T ROWE PRICE GROUP INC	324	366	3,617	393,657		資本市場	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	380	444	1,474	160,472		保険	
PROCTER & GAMBLE CO	3,403	3,899	44,838	4,879,773		家庭用品	
PROGRESSIVE CO	808	920	7,008	762,741		保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	572	630	3,386	368,525		保険	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	695	781	3,476	378,318		総合公益事業	
PULTEGROUP INC	379	379	900	98,001		家庭用耐久財	
QORVO INC	176	176	1,434	156,067		半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	1,655	1,791	12,363	1,345,495		半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS INC	191	205	1,702	185,308		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
QURATE RETAIL INC - A	580	—	—	—		インターネット販売・通信販売	
RPM INTERNATIONAL INC	—	211	1,289	140,304		化粧	
RALPH LAUREN CORPORATION	78	78	555	60,490		繊維・アパレル・贅沢品	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	177	196	1,262	137,369		資本市場	
RAYTHEON COMPANY	394	433	6,114	665,429		航空宇宙・防衛	
RED HAT INC	243	—	—	—		ソフトウェア	
REGENERON PHARMACEUTICALS	110	127	6,030	656,326		バイオテクノロジー	
REGIONS FINANCIAL CORP	1,390	1,500	1,425	155,082		銀行	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	90	90	782	85,135		保険	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	308	343	2,629	286,124		商業サービス・用品	
RESMED INC	192	225	3,469	377,610		ヘルスケア機器・用品	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	119	2,713	295,316		ソフトウェア	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	171	171	689	75,016		専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	168	178	2,710	294,954		電気設備	
ROKU INC	—	142	1,272	138,482		娯楽	
ROLLINS INC	210	239	856	93,221		商業サービス・用品	
ROPER TECHNOLOGIES INC	143	164	5,209	566,951		コングロマリット	
ROSS STORES INC	505	561	4,761	518,162		専門小売り	
S&P GLOBAL INC	344	384	9,484	1,032,188		資本市場	
SEI INVESTMENTS COMPANY	191	191	887	96,532		資本市場	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	306	367	1,604	174,660		ソフトウェア	
SVB FINANCIAL GROUP	74	81	1,261	137,323		銀行	
SABRE CORP	360	420	261	28,476		情報技術サービス	
SALESFORCE. COM INC	1,043	1,304	19,540	2,126,586		ソフトウェア	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	112	1,103	120,085		バイオテクノロジー	
HENRY SCHEIN INC	205	231	1,203	130,952		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
SCHLUMBERGER LTD	1,911	2,140	2,841	309,286		エネルギー・設備・サービス	
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,662	1,797	6,169	671,383		資本市場	
SEALED AIR CORP	219	219	563	61,324		容器・包装	
SEATTLE GENETICS INC	154	187	2,155	234,629		バイオテクノロジー	
SEMPRA ENERGY	371	436	5,231	569,351		総合公益事業	
SERVICENOW INC	248	296	8,485	923,502		ソフトウェア	

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	
SHERWIN-WILLIAMS	116	129	6,230	678,017	化学
SIGNATURE BANK	76	89	738	80,412	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,290	2,290	1,101	119,875	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	238	272	2,450	266,741	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	186	218	841	91,578	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	159	174	1,924	209,493	食品
SNAP-ON INC	74	84	949	103,328	機械
SNAP INC-A	—	1,170	1,386	150,887	インターネット・メディアおよびサービス
SOUTHERN CO.	1,402	1,647	9,550	1,039,430	電力
SOUTHWEST AIRLINES	198	198	694	75,634	旅客航空輸送業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	146	146	354	38,531	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	197	237	3,015	328,134	ソフトウェア
SPRINT CORP	1,090	1,290	1,088	118,489	無線通信サービス
SQUARE INC - A	418	531	2,920	317,838	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	211	239	2,399	261,092	機械
STARBUCKS CORP	1,696	1,852	12,567	1,367,739	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	522	559	2,893	314,947	資本市場
STEEL DYNAMICS	334	334	729	79,350	金属・鉱業
STRYKER CORP	465	529	8,620	938,178	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	607	—	—	—	銀行
SYMANTEC CORP	830	—	—	—	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	207	239	3,090	336,340	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	872	940	1,576	171,557	消費者金融
SYSCO CORP	678	758	3,513	382,355	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	379	412	1,460	158,905	資本市場
TJX COS INC	1,696	1,898	9,024	982,189	専門小売り
T-MOBILE US INC	472	530	4,405	479,435	無線通信サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	102	—	—	—	ソフトウェア
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	157	181	2,145	233,443	娯楽
TAPESTRY INC	383	450	594	64,693	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	686	788	7,565	823,362	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	299	348	225	24,541	石油・ガス・消耗燃料
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	57	1,704	185,483	航空宇宙・防衛
TELEFLEX INC	63	71	2,058	224,053	ヘルスケア機器・用品
TERADYNE INC	—	250	1,381	150,294	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	175	212	10,650	1,159,058	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,330	1,670	1,421	154,665	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,314	1,465	14,945	1,626,565	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	335	335	926	100,879	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	548	628	17,895	1,947,565	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	797	902	12,424	1,352,120	コングロマリット
TIFFANY & CO	144	169	2,171	236,322	専門小売り
TORCHMARK CORP	140	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	222	—	—	—	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	163	178	1,522	165,725	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	63	76	2,625	285,729	航空宇宙・防衛
TRUNION	253	290	1,977	215,180	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	367	408	4,185	455,526	保険
TRIMBLE INC	349	388	1,203	131,027	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	146	146	260	28,393	インターネット・メディアおよびサービス
TRUIST FINANCIAL CORP	—	2,085	6,788	738,820	銀行
TWILIO INC - A	—	186	1,804	196,351	情報技術サービス
TWITTER INC	942	1,147	2,935	319,434	インターネット・メディアおよびサービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	61	1,834	199,696	ソフトウェア

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	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
TYSON FOODS INC-CL A		410	469	2,774	301,909	食品
UGI CORP		227	309	831	90,494	ガス
US BANCORP		2,112	2,305	8,268	899,810	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC		—	655	1,822	198,382	陸運・鉄道
ULTA BEAUTY INC		78	85	1,527	166,241	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		240	240	229	24,996	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		250	250	210	22,881	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP		1,005	1,088	15,253	1,660,066	陸運・鉄道
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC		92	92	277	30,197	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		946	1,099	10,752	1,170,207	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC		112	112	1,065	115,990	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES		1,128	1,286	12,665	1,378,420	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP		63	—	—	—	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC		1,313	1,482	37,239	4,052,796	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	118	1,181	128,586	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP		312	312	497	54,124	保険
V F CORP		454	525	3,136	341,386	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC		54	60	893	97,267	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP		580	628	2,963	322,521	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		129	142	1,472	160,287	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		167	207	3,269	355,804	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC		147	162	3,054	332,422	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS		5,643	6,468	35,425	3,855,328	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC		219	242	3,554	386,809	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS		350	404	9,369	1,019,690	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B		502	—	—	—	娯楽
VIACOMCBS INC-CLASS B		—	880	1,239	134,892	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES		2,404	2,678	44,339	4,825,483	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP		482	590	947	103,120	独立系電力事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A		116	130	1,566	170,510	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC		217	217	899	97,936	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO		186	208	2,118	230,576	建設資材
WABCO HOLDINGS INC		70	81	1,094	119,111	機械
WEC ENERGY GROUP INC		435	498	4,576	498,019	総合公益事業
WABTEC CORP		179	288	1,417	154,270	機械
WALMART INC		1,989	2,225	25,629	2,789,288	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		1,101	1,182	5,337	580,924	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC		368	403	3,118	339,420	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC		578	668	6,319	687,727	商業サービス・用品
WATERS CORP		106	103	1,937	210,895	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A		75	86	447	48,678	インターネット販売・通信販売
WELLCARE HEALTH PLANS INC		70	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WELLS FARGO CO		6,129	6,291	18,822	2,048,471	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES		—	118	1,791	194,953	ヘルスケア機器・用品
WESTERN DIGITAL CORP		383	476	2,071	225,395	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO		590	660	1,248	135,826	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP		50	50	189	20,606	化学
WESTROCK CO		342	387	1,122	122,139	容器・包装
WHIRLPOOL CORP		93	94	824	89,727	家庭用耐久財
WILLIAMS COS		1,681	1,910	2,639	287,269	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A		207	254	3,487	379,535	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A		407	—	—	—	情報技術サービス
WYNN RESORTS LTD		138	155	947	103,067	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC		180	143	735	80,038	航空貨物・物流サービス

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		
				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		
XCEL ENERGY INC	708	812	5,079	552,842		電力	
XILINX INC	349	399	3,166	344,562		半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	289	—	—	—		コンピュータ・周辺機器	
XYLEM INC	239	278	1,841	200,407		機械	
XEROX HOLDINGS CORP	—	289	518	56,456		コンピュータ・周辺機器	
YUM BRANDS INC	422	471	3,328	362,246		ホテル・レストラン・レジャー	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	264	—	—	—		各種電気通信サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	84	1,582	172,184		電子装置・機器・部品	
ZILLLOW GROUP INC - C	160	202	748	81,471		インターネット・メディアおよびサービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	284	319	3,135	341,196		ヘルスケア機器・用品	
ZIONS BANCORP NA	275	275	756	82,362		銀行	
ZOETIS INC	660	740	8,634	939,673		医薬品	
ALKERMES PLC	201	—	—	—		バイオテクノロジー	
ALLEGION PLC	136	148	1,406	153,031		建設関連製品	
ALLERGAN PLC	464	510	8,991	978,578		医薬品	
AMCOR PLC	—	2,500	2,070	225,278		容器・包装	
AON PLC	329	369	6,311	686,826		保険	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	560	639	1,951	212,382		保険	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	214	212	557	60,702		保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	292	292	527	57,423		化学	
ACCENTURE PLC-CL A	870	995	16,897	1,838,910		情報技術サービス	
BUNGE LIMITED	191	220	870	94,788		食品	
CAPRI HOLDINGS LTD	199	199	223	24,364		繊維・アパレル・贅沢品	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	292	351	1,291	140,573		飲料	
EATON CORP PLC	601	645	5,051	549,769		電気設備	
EVEREST RE GROUP LTD	56	62	1,230	133,930		保険	
IHS MARKIT LTD	547	593	3,668	399,220		専門サービス	
INGERSOLL-RAND PLC	334	—	—	—		機械	
INVESCO LTD	580	580	554	60,344		資本市場	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	78	90	896	97,555		医薬品	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,271	1,200	3,178	345,948		建設関連製品	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	400	43,592		メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	695	640	1,004	109,352		メディア	
LINDE PLC	751	842	14,886	1,620,104		化学	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	860	990	2,247	244,573		半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,838	2,099	19,321	2,102,736		ヘルスケア機器・用品	
APTIV PLC	367	392	1,956	212,965		自動車部品	
NIELSEN HOLDINGS PLC	472	540	706	76,927		専門サービス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	302	330	352	38,356		ホテル・レストラン・レジャー	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	59	67	1,019	110,912		保険	
SEAGATE TECHNOLOGY	378	373	1,860	202,440		コンピュータ・周辺機器	
PENTAIR PLC	232	232	687	74,811		機械	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	214	245	719	78,283		電気設備	
STERIS PLC	—	129	1,805	196,532		ヘルスケア機器・用品	
TECHNIPFMC PLC	610	610	430	46,802		エネルギー設備・サービス	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	376	3,169	344,956		機械	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	178	202	3,493	380,207		保険	
PERRIGO CO PLC	165	196	956	104,115		医薬品	
CHUBB LTD	633	712	8,119	883,661		保険	
GARMIN LTD	152	205	1,572	171,096		家庭用耐久財	
TE CONNECTIVITY LTD	479	524	3,338	363,375		電子装置・機器・部品	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	172	189	1,874	204,022		ソフトウェア	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	55	477	51,931		ソフトウェア	
WIX.COM LTD	57	77	804	87,553		情報技術サービス	

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	外貨建金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
AERCAP HOLDINGS NV	169	170	387	42,145		商社・流通業
LYONDELLBASELL INDU-CL A	455	421	2,087	227,162		化学
MYLAN NV	693	770	1,160	126,285		医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV	468	432	3,668	399,294		半導体・半導体製造装置
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	227	266	791	86,180		ホテル・レストラン・レジャー
FLEX LTD	760	760	638	69,477		電子装置・機器・部品
小計	413,057	465,696	3,471,191	377,769,781		
銘柄	596	608	—	<67.9%>		
(カナダ)		千カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	500	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD	331	377	2,134	163,537		金属・鉱業
AIR CANADA	—	204	328	25,127		旅客航空輸送業
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	850	1,518	116,351		総合公益事業
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	596	1,342	4,412	337,997		食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	338	420	494	37,866		ガス
ATCO LTD CL1	96	130	487	37,352		総合公益事業
AURORA CANNABIS INC	970	2,000	258	19,762		医薬品
BCE INC	198	227	1,251	95,895		各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	876	990	6,713	514,230		銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,682	1,893	10,375	794,765		銀行
BARRICK GOLD	2,366	2,770	7,559	579,044		金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC	425	510	1,101	84,382		医薬品
BLACKBERRY LTD	710	710	393	30,129		ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS	2,620	2,800	119	9,115		航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	1,168	1,402	8,759	670,992		資本市場
CAE INC	360	410	741	56,782		航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	212	247	976	74,810		容器・包装
CGI INC	338	384	2,848	218,225		情報技術サービス
CI FINANCIAL CORP	336	336	442	33,922		資本市場
CAMECO CORP	560	560	584	44,783		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	600	696	5,498	421,177		銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,001	1,124	12,176	932,703		陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,631	1,870	2,939	225,176		石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	198	213	6,558	502,379		陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	86	86	738	56,567		複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	157	203	675	51,765		総合公益事業
CANOPY GROWTH CORP	275	330	677	51,895		医薬品
CENOVUS ENERGY INC	1,400	1,560	375	28,798		石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	27	32	4,082	312,748		ソフトウェア
CRONOS GROUP INC	250	250	225	17,273		医薬品
DOLLARAMA INC	418	466	1,900	145,566		複合小売り
EMERA INC	76	379	2,046	156,769		電力
EMPIRE CO LTD A	260	260	711	54,470		食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	2,060	—	—	—		石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	2,759	3,178	12,696	972,522		石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	38	41	1,695	129,884		保険
FINNING INTERNATIONAL INC	240	—	—	—		商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	250	—	—	—		不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	990	990	692	53,007		金属・鉱業
FORTIS INC	583	682	3,579	274,214		電力
FRANCO-NEVADA CORP	254	293	4,057	310,801		金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	278	318	572	43,870		繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	1,210	—	—	—		金属・鉱業
GREAT-WEST LIFECO INC	420	—	—	—		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		
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
GREAT-WEST LIFECO INC		—	420	987	75,604	保険
HUSKY ENERGY INC		520	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
HUSKY ENERGY INC		—	520	166	12,786	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD		420	490	1,236	94,735	電力
IGM FINANCIAL INC		103	150	350	26,875	資本市場
IA FINANCIAL CORP INC		147	183	780	59,757	保険
IMPERIAL OIL		375	375	557	42,685	石油・ガス・消耗燃料
INTACT FINANCIAL CORP		189	215	2,483	190,249	保険
INTER PIPELINE LTD		520	600	470	36,032	石油・ガス・消耗燃料
KEYERA CORP		285	340	398	30,523	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP		1,740	1,980	1,140	87,360	金属・鉱業
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		—	441	1,908	146,202	金属・鉱業
LOBLAW COMPANIES		261	285	1,970	150,939	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP		950	950	477	36,603	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC		445	451	2,028	155,390	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP		2,750	3,030	5,151	394,566	保険
METHANEX CORP		86	86	147	11,310	化学
METRO INC		334	396	2,250	172,385	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA		460	523	2,721	208,441	銀行
NUTRIEN LTD		831	900	4,134	316,710	化学
ONEX CORPORATION		109	132	673	51,567	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP		354	417	2,023	155,015	ソフトウェア
OVINTIV INC		—	410	141	10,803	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND FUEL CORP		—	217	543	41,638	石油・ガス・消耗燃料
PEMBINA PIPELINE CORP		706	880	2,081	159,419	石油・ガス・消耗燃料
POWER CORPORATION OF CANADA		460	869	1,868	143,131	保険
POWER FINANCIAL CORP		325	—	—	—	保険
PRARIESKY ROYALTY LTD		310	310	218	16,764	石油・ガス・消耗燃料
QUEBECOR INC-CL B		—	270	844	64,713	メディア
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		320	433	2,468	189,122	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B		502	555	3,174	243,174	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		1,962	2,248	19,063	1,460,228	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC		252	—	—	—	建設・土木
SAPUTO INC		321	366	1,218	93,330	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		370	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		630	770	1,711	131,116	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A		122	163	9,967	763,531	情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE		230	380	978	74,953	ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC		838	923	4,079	312,501	保険
SUNCOR ENERGY INC		2,180	2,440	4,628	354,556	石油・ガス・消耗燃料
TC ENERGY CORP		—	1,470	8,565	656,131	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B		680	820	801	61,430	金属・鉱業
TELUS CORP		293	586	1,257	96,328	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP		282	317	2,987	228,859	専門サービス
TORONTO DOMINION BANK		2,495	2,841	16,608	1,272,210	銀行
TOURMALINE OIL CORP		330	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP		1,257	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		1,260	—	—	—	金属・鉱業
VERMILION ENERGY INC		185	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WSP GLOBAL INC		132	157	1,186	90,906	建設・土木
WEST FRASER TIMBER		84	84	224	17,186	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE) LTD		107	123	1,216	93,191	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等	
		株数	評価額	外貨建金額 邦貨換算金額		
(カナダ) WHEATON PRECIOUS METALS CORP	百株 630	百株 716	千カナダドル 2,826	千円 216,475	金属・鉱業	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	58,286	62,765	234,126	17,934,123	
(イギリス)	89	84	—	<3.2%>		
ANTOFAGASTA PLC	590	590	431	57,562	金属・鉱業	
ASHTEAD GROUP PLC	680	687	1,121	149,567	商社・流通業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,450	1,590	708	94,436	家庭用耐久財	
AVIVA PLC	5,420	6,040	1,617	215,646	保険	
DIAGEO PLC	3,319	3,681	9,476	1,263,438	飲料	
SCHRODERS PLC	158	197	496	66,185	資本市場	
DCC PLC	128	160	828	110,495	コングロマリット	
BAE SYSTEMS PLC	4,410	5,020	2,552	340,255	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,125	3,597	9,478	1,263,619	タバコ	
HALMA PLC	—	590	1,103	147,091	電子装置・機器・部品	
STANDARD CHARTERED PLC	3,830	4,140	1,885	251,410	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	1,295	1,490	1,986	264,796	タバコ	
HSBC HOLDINGS PLC	27,340	31,810	14,716	1,962,056	銀行	
LEGAL & GENERAL	8,080	9,400	1,807	240,929	保険	
MEGGITT PLC	1,110	1,110	298	39,808	航空宇宙・防衛	
MORRISON SUPERMARKETS	3,150	3,700	674	89,975	食品・生活必需品小売	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	494	541	942	125,715	食品	
PEARSON	1,090	1,260	706	94,204	メディア	
PERSIMMON PLC	426	480	875	116,756	家庭用耐久財	
PRUDENTIAL PLC	3,550	4,100	4,110	547,978	保険	
RIO TINTO PLC-REG	1,578	1,749	6,425	856,691	金属・鉱業	
ST JAMES'S PLACE PLC	700	810	610	81,445	資本市場	
SSE PLC	1,370	1,650	2,085	278,052	電力	
BP PLC	27,490	31,780	10,284	1,371,063	石油・ガス・消耗燃料	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	97,300	110,500	3,701	493,517	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	4,500	5,000	586	78,192	家庭用耐久財	
TESCO PLC	13,620	15,300	3,566	475,476	食品・生活必需品小売	
SMITH & NEPHEW PLC	1,230	1,370	1,972	262,922	ヘルスケア機器・用品	
GLAXOSMITHKLINE PLC	6,760	7,820	11,589	1,545,077	医薬品	
WEIR GROUP PLC	370	380	253	33,750	機械	
BABCOCK INTL GROUP PLC	390	—	—	—	商業サービス・用品	
ASTRAZENECA PLC	1,727	2,055	14,596	1,946,027	医薬品	
BT GROUP PLC	11,450	12,900	1,540	205,381	各種電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	229	229	208	27,758	ホテル・レストラン・レジャー	
MARKS & SPENCER PLC	2,080	3,100	306	40,899	複合小売	
BARCLAYS PLC	23,700	27,400	2,575	343,378	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	216	256	1,186	158,123	専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	550	660	864	115,268	織維・アパレル・贅沢品	
NEXT PLC	198	198	784	104,639	複合小売	
KINGFISHER PLC	3,080	3,080	439	58,534	専門小売	
ITV PLC	5,000	5,000	311	41,582	メディア	
SAINSBURY	2,550	2,550	536	71,460	食品・生活必需品小売	
G4S PLC	2,190	2,190	191	25,529	商業サービス・用品	
ADMIRAL GROUP PLC	270	308	677	90,378	保険	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	171	195	702	93,590	家庭用耐久財	
CENTRICA PLC	7,800	9,200	353	47,074	総合公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	6,170	6,560	8,693	1,158,992	石油・ガス・消耗燃料	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	5,107	5,860	7,395	985,944	石油・ガス・消耗燃料	
BUNZLE	444	500	777	103,622	商社・流通業	
RENTOKIL INTL PLC	—	2,850	1,100	146,665	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		
				千英ポンド	千円		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円			
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	426	492	3,602	480,275		資本市場	
UNILEVER PLC	1,509	1,742	6,995	932,689		バーソナル用品	
TUI AG-DI	600	700	256	34,137		ホテル・レストラン・レジャー	
INVESTEC PLC	920	—	—	—		資本市場	
EXPERIAN PLC	1,262	1,411	3,313	441,692		専門サービス	
MONDI PLC	494	750	1,003	133,836		紙製品・林産品	
SEVERN TRENT PLC	324	370	862	114,984		水道	
WHITBREAD PLC	245	211	626	83,491		ホテル・レストラン・レジャー	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	401	520	708	94,491		資本市場	
SMITHS GROUP PLC	540	610	680	90,718		コングロマリット	
ANGLO AMERICAN PLC	1,433	1,600	2,140	285,368		金属・鉱業	
3I GROUP PLC	1,320	1,550	1,183	157,836		資本市場	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	913	1,102	6,832	910,895		家庭用品	
RELX PLC	2,710	3,000	5,181	690,730		専門サービス	
FRESNILLO PLC	260	—	—	—		金属・鉱業	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	960	1,060	1,004	133,885		水道	
OCADO GROUP PLC	—	720	889	118,644		インターネット販売・通信販売	
GLENCORE PLC	15,330	17,000	2,023	269,706		金属・鉱業	
WOOD GROUP (JOHN) PLC	860	—	—	—		エネルギー設備・サービス	
GVC HOLDINGS PLC	710	870	435	57,994		ホテル・レストラン・レジャー	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	2,370	2,770	890	118,654		航空宇宙・防衛	
EVRAZ PLC	—	760	172	22,969		金属・鉱業	
NMC HEALTH PLC	133	133	31	4,159		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
EASYJET PLC	210	210	115	15,454		旅客航空輸送業	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	6,500	7,700	903	120,518		銀行	
SAGE GROUP PLC (THE)	1,430	1,750	1,050	139,986		ソフトウェア	
WPP PLC	1,690	2,000	1,031	137,532		メディア	
COCA-COLA HBC AG-DI	290	290	477	63,638		飲料	
AVEVA GROUP PLC	—	112	387	51,664		ソフトウェア	
CONVATEC GROUP PLC-WI	2,100	—	—	—		ヘルスケア機器・用品	
COMPASS GROUP PLC	2,150	2,510	2,988	398,380		ホテル・レストラン・レジャー	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	580	—	—	—		ソフトウェア	
NATIONAL GRID PLC	4,610	5,480	5,228	697,059		総合公益事業	
ROYAL MAIL PLC	1,360	—	—	—		航空貨物・物流サービス	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	890	—	—	—		ホテル・レストラン・レジャー	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	3,590	3,660	815	108,715		資本市場	
FERGUSON PLC	325	—	—	—		商社・流通業	
BHP GROUP PLC	2,890	3,290	4,007	534,330		金属・鉱業	
VODAFONE GROUP PLC	36,500	42,100	4,813	641,764		無線通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	237	258	875	116,741		ホテル・レストラン・レジャー	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	—	481	192	25,659		ソフトウェア	
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	193	812	108,275		化学	
FERGUSON PLC	—	346	1,705	227,414		商社・流通業	
M&G PLC	—	3,780	444	59,214		各種金融サービス	
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,400	1,620	677	90,365		保険	
INFORMA PLC	1,730	1,860	786	104,893		メディア	
AUTO TRADER GROUP PLC	1,380	1,410	625	83,332		インターネット・メディアおよびサービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	116	948	126,504		機械	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,830	2,190	606	80,875		保険	
JD SPORTS FASHION PLC	—	760	348	46,497		専門小売り	
CRODA INTERNATIONAL PLC	172	—	—	—		化学	
MELROSE INDUSTRIES PLC	6,800	7,300	638	85,158		電気設備	

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	
				邦貨換算額	千英ポンド	
(イギリス) JOHNSON MATTHEY PLC		百株 267	百株 302	千円 71,949	千英ポンド 539	化学
小計	株数・金額	410,536	468,722	209,991	27,996,065	
	銘柄 数 < 比率 >	92	93	—	<5.0%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SGS SA-REG		7	9	2,070	234,344	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		3	4	896	101,497	食品
SWISSCOM AG-REG		35	40	2,160	244,542	各種電気通信サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		1	1	1,221	138,250	食品
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.15	0.17	1,390	157,429	食品
GIVAUDAN-REG		12	14	4,337	491,054	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		207	235	7,814	884,704	保険
NOVARTIS AG-REG		2,960	3,361	26,148	2,960,280	医薬品
ABB LTD		2,500	2,850	4,742	536,887	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		959	1,098	33,927	3,840,972	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		215	249	915	103,680	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		670	774	2,650	300,114	建設資材
CLARIANT AG-REG		259	320	508	57,546	化学
NESTLE SA-REG		4,184	4,652	46,426	5,255,996	食品
BALOISE HOLDING AG		66	74	922	104,467	保険
TEMENOS AG-REG		84	104	1,284	145,406	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG-REG		76	88	1,518	171,852	ヘルスケア機器・用品
STRAUmann HOLDING AG-REG		14	16	1,130	128,026	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		3,470	3,960	3,167	358,559	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		41	47	886	100,378	織維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		74	74	274	31,047	織維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		103	115	4,544	514,477	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		45	51	1,678	190,016	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		12	12	725	82,110	化学
SWISS PRIME SITE-REG		101	114	1,070	121,186	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		58	58	370	41,957	各種金融サービス
DUFRY AG-REG		44	65	194	22,024	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		24	29	1,990	225,371	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		55	61	1,266	143,433	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		30	30	589	66,771	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		73	84	1,108	125,479	海運業
GEBERIT AG-REG		50	56	2,396	271,269	建設関連製品
JULIUS BAER GROUP LTD		310	358	1,181	133,786	資本市場
SWISS RE LTD		414	462	3,247	367,690	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		716	815	4,246	480,706	織維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG		180	199	3,143	355,842	化学
ALCON INC		—	659	3,211	363,589	ヘルスケア機器・用品
UBS GROUP AG		5,330	6,010	5,447	616,707	資本市場
VIFOR PHARMA AG		57	67	853	96,595	医薬品
小計	株数・金額	23,443	27,221	181,662	20,566,059	
	銘柄 数 < 比率 >	38	39	—	<3.7%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		92	126	5,057	54,673	各種金融サービス
SKANDINAViska ENSKILDA BANKEN AB		2,210	2,510	16,586	179,295	銀行
SEWBANK AB		1,260	1,370	14,782	159,796	銀行
SWEDISH MATCH AB		234	260	13,951	150,816	タバコ
SECURITAS AB-B SHS		450	450	4,736	51,198	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		617	715	32,053	346,497	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B		1,180	1,270	15,527	167,847	専門小売り
ERICSSON LM-B		4,170	4,740	37,294	403,151	通信機器

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	千円	
(スウェーデン)						
TELIA CO AB	百株	百株	千スウェーデンクローネ			
SKANSKA AB-B SHS	3,960	4,300	15,265	165,014	各種電気通信サービス	
LUNDIN PETROLEUM AB	450	510	7,494	81,015	建設・土木	
ALFA LAVAL AB	248	288	4,968	53,704	石油・ガス・消耗燃料	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	389	510	8,774	94,852	機械	
ICA GRUPPEN AB	97	158	4,392	47,481	無線通信サービス	
HUSQVARNA AB-B SHS	105	138	5,662	61,207	食品・生活必需品小売	
ELECTROLUX AB-B	550	550	2,698	29,174	家庭用耐久財	
SKF AB-B SHARES	340	340	4,125	44,600	家庭用耐久財	
VOLVO AB-B SHS	550	580	7,682	83,043	機械	
SANDVIK AB	2,140	2,340	26,617	287,735	機械	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	1,510	1,780	25,026	270,539	機械	
HEXAGON AB-B SHS	250	250	4,817	52,077	各種金融サービス	
TELE 2 AB-B SHS	361	423	17,359	187,660	電子装置・機器・部品	
KINNEVIK AB - B	690	780	10,327	111,637	無線通信サービス	
ATLAS COPCO AB-A	337	—	—	—	各種金融サービス	
ATLAS COPCO AB-B	940	1,045	34,589	373,912	機械	
BOLIDEN AB	529	627	18,139	196,083	機械	
EPIROC AB - A	363	—	—	—	金属・鉱業	
EPIROC AB - B	920	1,030	10,164	109,873	機械	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	580	580	5,738	62,033	機械	
BOLIDEN AB	817	925	28,203	304,877	家庭用品	
KINNEVIK AB - B	—	440	7,508	81,167	金属・鉱業	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	—	390	6,312	68,234	各種金融サービス	
ASSA ABLOY AB-B	2,120	2,430	19,371	209,410	銀行	
NORDEA BANK ABP	1,360	1,590	28,866	312,046	建設関連製品	
	4,130	5,150	28,041	303,131	銀行	
小計	株数・金額	33,949	38,595	472,136	5,103,793	
銘柄	銘柄数 <比率>	32	32	—	<0.9%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	1,350	1,450	16,363	167,886	銀行	
TELENOR ASA	1,020	1,160	17,649	181,082	各種電気通信サービス	
EQUINOR ASA	1,610	1,580	18,999	194,934	石油・ガス・消耗燃料	
YARA INTERNATIONAL ASA	232	262	8,499	87,202	化学	
MOWI ASA	620	690	10,746	110,261	食品	
NORSK HYDRO	1,840	2,180	4,843	49,699	金属・鉱業	
AKER AB ASA	141	180	2,151	22,069	石油・ガス・消耗燃料	
ORKLA ASA	1,150	1,150	10,589	108,645	食品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	250	310	5,380	55,199	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	129	129	2,394	24,564	メディア	
小計	株数・金額	8,342	9,091	97,616	1,001,546	
銘柄	銘柄数 <比率>	10	10	—	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG B	145	162	12,198	195,299	飲料	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	8	10	6,050	96,872	海運業	
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	5	6	3,468	55,535	海運業	
DANSKE BANK AS	970	970	7,119	113,987	銀行	
GENMAB A/S	84	100	13,505	216,215	バイオテクノロジー	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	268	298	16,229	259,827	電気設備	
H LUNDBECK A/S	105	105	2,025	32,427	医薬品	
DSV PANALPINA A S	251	325	19,805	317,086	航空貨物・物流サービス	
PANDORA A/S	162	160	3,433	54,971	繊維・アパレル・贅沢品	
CHR HANSEN HOLDING A/S	137	167	8,348	133,656	化学	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	311	337	10,312	165,098	化学	
COOPLAST-B	164	185	17,793	284,870	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	千円	
(デンマーク)					
NOVO NORDISK A/S-B	百株 2,475	百株 2,772	112,224	1,796,712	医薬品
ISS A/S	218	218	1,973	31,600	商業サービス・用品
TRYG A/S	160	199	3,275	52,441	保険
ORSTED A/S	254	300	20,250	324,202	電力
DEMANIT A/S	130	160	2,342	37,501	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	5,848 17	6,474 17	260,356 —	4,168,307 <0.7%>
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	246	281	5,811	694,714	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA	576	642	2,175	260,071	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	438	52,460	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD	105	105	336	40,168	化学
HANNOVER RUECK SE	79	96	1,237	147,935	保険
GEA GROUP AG	242	242	442	52,871	機械
CONTINENTAL AG	154	175	1,120	133,958	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	1,371	1,534	3,767	450,405	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	59	—	—	—	メディア
MERCK KGAA	173	199	1,781	212,924	医薬品
RWE AG	720	931	2,149	256,994	総合公益事業
SAP SE	1,340	1,539	15,725	1,879,983	ソフトウェア
E.ON SE	3,070	3,550	3,389	405,177	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	144	163	1,052	125,883	家庭用品
PUMA SE	10	126	682	81,567	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG	1,273	1,543	8,128	971,765	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	246	277	1,974	236,046	家庭用品
BASF SE	1,254	1,445	6,134	733,409	化学
BEIERSDORF AG	137	160	1,497	179,076	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	26	38	218	26,167	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	203	226	834	99,778	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	294	333	1,950	233,207	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	580	654	9,995	1,194,990	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	310	420	364	43,593	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	207	228	4,135	494,449	保険
VOLKSWAGEN AG	45	51	605	72,371	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	252	289	3,035	362,843	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	1,257	1,403	3,816	456,305	自動車
THYSSENKRUPP AG	620	620	287	34,355	金属・鉱業
SIEMENS AG	1,042	1,201	9,038	1,080,579	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG	80	—	—	—	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,750	3,140	1,828	218,625	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	449	521	2,382	284,831	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	78	78	291	34,800	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	4,600	5,180	6,208	742,255	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	45	53	1,166	139,395	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,550	1,990	2,693	322,027	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	—	60	533	63,767	ヘルスケア機器・用品
DEUTSCHE BOERSE AG	256	295	3,702	442,603	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	203	227	852	101,929	自動車
FRAPORT AG	63	63	232	27,799	運送インフラ
WIRECARD AG	159	180	1,798	215,060	情報技術サービス
LANXESS	120	120	436	52,190	化学
MTU AERO ENGINES AG	69	84	1,132	135,419	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE	484	562	1,924	230,115	不動産管理・開発
SYMRISE AG	163	198	1,626	194,480	化学

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)					
BRENNTAG AG	百株	百株	千ユーロ	千円	
	206	238	773	92,443	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG		227	330	613	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	970	1,500	329	39,361	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG	93	—	—	—	織維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG	1,350	1,580	527	63,051	銀行
OSRAM LICHT AG	143	—	—	—	電気設備
KION GROUP AG	99	99	389	46,548	機械
VONOVIA SE	664	795	3,578	427,785	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	340	—	—	—	メディア
KNORR-BREMSE AG	—	71	541	64,763	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	199	239	851	101,817	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	250	250	178	21,393	食品・生活必需品小売
INNOGY SE	195	—	—	—	総合公益事業
ZALANDO SE	171	215	709	84,872	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	270	269	736	88,019	化学
QIAGEN NV	314	354	1,295	154,851	ライフサイエンス・ツール/サービス
UNIPER SE	262	311	713	85,253	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	119	179	1,193	142,734	インターネット販売・通信販売
小計	株数・金額	33,144	37,820	131,372	15,705,597
銘柄	数 <比率>	62	58	<2.8%>	
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,620	1,750	2,163	258,691	保険
INTESA SANPAOLO	20,620	23,300	3,426	409,693	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.	880	880	437	52,338	銀行
ENEL SPA	11,040	12,630	8,065	964,232	電力
ENI SPA	3,450	4,030	3,462	413,999	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA	2,980	3,200	1,323	158,226	ガス
TENARIS SA	600	710	393	47,006	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA	15,300	15,500	558	66,727	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	8,800	8,800	315	37,747	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	700	790	841	100,630	運送インフラ
TERNA SPA	1,850	2,220	1,281	153,242	電力
RECORDATI SPA	141	168	657	78,590	医薬品
LEONARDO SPA	550	640	381	45,631	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA	309	370	566	67,743	電気設備
FERRARI NV	171	189	2,629	314,408	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	1,410	1,540	790	94,520	機械
MONCLER SPA	252	281	955	114,218	織維・アパレル・贅沢品
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	—	910	766	91,623	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	1,500	1,700	1,072	128,241	自動車
UNICREDIT SPA	2,710	3,130	2,276	272,186	銀行
EXOR NV	151	172	803	96,089	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA	770	770	609	72,869	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	760	910	605	72,345	飲料
PIRELLI & C. SPA	530	530	177	21,169	自動車部品
小計	株数・金額	77,094	85,120	34,564	4,132,174
銘柄	数 <比率>	23	24	—	<0.7%>
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES	314	348	958	114,534	建設・土木
AIRBUS SE	793	918	5,593	668,687	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	710	820	1,617	193,366	総合公益事業
LOREAL-ORD	344	394	9,704	1,160,139	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	378	435	15,239	1,821,822	織維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	3	3	232	27,813	航空宇宙・防衛

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)			千ユーロ	千円	
THALES SA	百株	百株			
	141	163	1, 189	142, 252	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	219	245	1, 911	228, 460	情報技術サービス
CASINO GUILCHARD-PERRACHON SA	83	83	289	34, 580	食品・生活必需品小売
INGENICO GROUP	81	95	902	107, 939	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	292	321	748	89, 530	メディア
FAURECIA	105	105	281	33, 628	自動車部品
BOLLORE	1, 060	1, 380	332	39, 759	娯楽
MICHELIN (CGDE)	238	267	2, 042	244, 123	自動車部品
PERNOD RICARD SA	291	335	4, 380	523, 643	飲料
RENAULT SA	255	281	483	57, 807	自動車
REMY COINTREAU	30	40	408	48, 776	飲料
SEB SA	30	38	405	48, 518	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	754	869	6, 884	823, 008	電気設備
VIVENDI SA	1, 437	1, 300	2, 363	282, 544	娯楽
ORANGE SA	2, 770	3, 120	3, 497	418, 128	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	44	50	3, 205	383, 205	織維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	38	—	—	—	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	178	209	2, 777	332, 063	ソフトウェア
KERING SA	105	117	5, 676	678, 671	織維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	212	280	244	29, 189	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	800	950	1, 349	161, 386	食品・生活必需品小売
ATOS SE	136	153	918	109, 783	情報技術サービス
SANOFI	1, 536	1, 767	14, 226	1, 700, 732	医薬品
ACCOR SA	262	262	653	78, 179	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	970	1, 050	2, 037	243, 523	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	1, 043	1, 270	1, 960	234, 362	銀行
TELEPERFORMANCE	77	90	1, 618	193, 455	専門サービス
EURAZEO SE	56	59	244	29, 264	各種金融サービス
SODEXO	121	132	785	93, 863	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	2, 650	3, 010	4, 619	552, 218	保険
PEUGEOT CITROEN	820	880	1, 035	123, 825	自動車
JC DECAUX SA	93	150	235	28, 100	メディア
ESSILORLUXOTTICA	399	439	4, 364	521, 780	織維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	1, 540	1, 840	1, 232	147, 337	銀行
BNP PARIBAS	1, 529	1, 739	4, 912	587, 310	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	669	790	1, 694	202, 536	建設関連製品
WENDEL	34	43	316	37, 886	各種金融サービス
ILLIAD SA	39	24	305	36, 481	各種電気通信サービス
SES FDR	480	560	294	35, 201	メディア
IMERYS	38	—	—	—	建設資材
SAFRAN SA	457	508	4, 312	515, 609	航空宇宙・防衛
ENGIE	2, 510	2, 900	2, 740	327, 626	総合公益事業
ALSTOM	205	303	1, 129	135, 077	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	241	241	218	26, 120	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	820	940	653	78, 169	電力
IPSEN	55	55	259	31, 048	医薬品
ARKEMA	99	99	596	71, 320	化学
LEGRAND SA	370	410	2, 360	282, 231	電気設備
EIFFAGE SA	108	121	798	95, 472	建設・土木
TOTAL SA	3, 294	3, 762	12, 629	1, 509, 801	石油・ガス・消耗燃料
ADP	39	47	416	49, 783	運送インフラ
NATIXIS	1, 280	1, 580	492	58, 914	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT	111	144	985	117, 786	娯楽
SCOR SE	232	232	465	55, 637	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…フランス)					
REXEL SA	百株	百株	千ユーロ	千円	
VINCI	450	—	—	—	商社・流通業
DANONE	702	810	5,913	706,899	建設・土木
AIR LIQUIDE SA	844	972	5,552	663,749	食品
BUREAU VERITAS SA	592	734	8,264	988,061	化学
GETLINK	342	470	799	95,520	専門サービス
SUEZ	620	720	770	92,101	運送インフラ
EDENRED	520	520	493	59,032	総合公益事業
VALEO SA	328	382	1,452	173,630	情報技術サービス
BIOMERIEUX	331	373	540	64,658	自動車部品
WORLDLINE SA	59	69	691	82,654	ヘルスケア機器・用品
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	—	198	1,070	127,941	情報技術サービス
AMUNDI SA	41	41	732	87,541	ライフサイエンス・ツール/サービス
	82	100	529	63,301	資本市場
小計	株数・金額	38,931	44,157	169,043	20,209,116
銘柄	数比	72	70	—	<3.6%>
(ユーロ…オランダ)					
RANDSTAD NV	174	184	571	68,367	専門サービス
WOLTERS KLUWER	390	418	2,606	311,624	専門サービス
VOPAK	90	114	533	63,727	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV	2,460	2,930	684	81,825	保険
KONINKLIJKE KPN NV	4,460	5,600	1,201	143,603	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,259	1,426	5,233	625,655	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV	357	400	2,920	349,181	飲料
HEINEKEN HOLDING NV	160	172	1,158	138,489	飲料
KONINKLIJKE DSM NV	247	285	2,958	353,664	化学
UNILEVER NV-CVA	2,102	—	—	—	パーソナル用品
UNILEVER NV	—	2,276	9,957	1,190,419	パーソナル用品
ASML HOLDING NV	560	666	16,317	1,950,755	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOOLD DELHAIZE NV	1,606	1,706	3,665	438,191	食品・生活必需品小売
AKZO NOBEL	310	324	2,002	239,377	化学
PROSUS NV	—	768	4,798	573,656	インターネット販売・通信販売
NN GROUP NV	429	470	1,148	137,268	保険
ARCELORMITTAL	885	990	789	94,387	金属・鉱業
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	—	175	1,193	142,682	インターネット販売・通信販売
ABN AMRO BANK NV-CVA	581	700	513	61,424	銀行
ALTICE EUROPE N.V.	—	990	340	40,666	メディア
ADYEN NV	14	16	1,293	154,610	情報技術サービス
ING GROEP NV	5,280	6,170	3,080	368,258	銀行
小計	株数・金額	21,365	26,781	62,968	7,527,838
銘柄	数比	18	21	—	<1.4%>
(ユーロ…スペイン)					
ENDESA S.A.	444	500	969	115,903	電力
BANKINTER S.A.	880	910	286	34,279	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	9,230	10,560	3,083	368,634	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	493	490	773	92,467	ガス
REPSOL SA	1,882	2,204	1,673	200,116	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA	22,110	26,140	5,788	692,039	銀行
TELEFONICA SA	6,400	7,320	3,029	362,118	各種電気通信サービス
ENAGAS SA	304	390	697	83,411	ガス
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	300	380	513	61,329	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	350	403	658	78,666	建設・土木
FERROVIAL SA	665	770	1,650	197,362	建設・土木
MAPFRE SA	1,630	1,630	254	30,389	保険
BANCO DE SABADELL SA	7,900	8,019	365	43,707	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		
(ユーロ…スペイン)						
CAIXABANK	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	5,050	5,300	885	105,908	銀行	
AMADEUS IT GROUP SA	8,586	9,660	8,413	1,005,876	電力	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	595	667	2,910	347,904	情報技術サービス	
INDITEX SA	590	700	1,184	141,636	電力	
AENA SME SA	1,480	1,680	3,815	456,116	専門小売り	
CELLNEX TELECOM SA	93	107	1,073	128,302	運送インフラ	
GRIFOLS SA	—	386	1,638	195,844	各種電気通信サービス	
BANKIA SA	401	468	1,452	173,610	バイオテクノロジー	
	1,510	1,510	157	18,864	銀行	
小計	株数・金額	70,894	80,196	41,275	4,934,493	
銘柄数 <比率>		21	22	—	<0.9%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	346	382	1,542	184,362	銀行	
SOLVAY SA	103	114	745	89,077	化学	
UCB SA	165	195	1,472	176,054	医薬品	
COLRUYT SA	87	87	427	51,068	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAM	110	124	871	104,184	各種金融サービス	
PROXIMUS	216	260	562	67,263	各種電気通信サービス	
GALAPAGOS NV	—	70	1,221	145,988	バイオテクノロジー	
TELENET GROUP HOLDING NV	67	67	190	22,828	メディア	
AGEAS	258	289	1,013	121,166	保険	
UMICORE	280	310	952	113,812	化学	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,036	1,201	4,672	558,596	飲料	
小計	株数・金額	2,668	3,099	13,671	1,634,401	
銘柄数 <比率>		10	11	—	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	210	210	527	63,090	石油・ガス・消耗燃料	
VERBUND AG	90	110	357	42,712	電力	
VOESTALPINE AG	165	200	360	43,038	金属・鉱業	
ERSTE GROUP BANK AG	400	480	819	97,954	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	201	201	276	33,028	銀行	
ANDRITZ AG	92	117	320	38,353	機械	
小計	株数・金額	1,158	1,318	2,661	318,177	
銘柄数 <比率>		6	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE	14	17	719	85,968	ライフサイエンス・ツール/サービス	
RTL GROUP	54	—	—	—	メディア	
AROUNDOWN SA	1,070	1,850	798	95,433	不動産管理・開発	
小計	株数・金額	1,138	1,867	1,517	181,402	
銘柄数 <比率>		3	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ	630	630	406	48,594	機械	
UPM-KYMMENE OYJ	733	832	1,941	232,152	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R	730	850	747	89,342	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A SHS	612	682	1,756	209,947	保険	
FORTUM OYJ	600	720	943	112,845	電力	
ELISA OYJ	195	221	1,217	145,524	各種電気通信サービス	
METSO OYJ	162	162	334	39,934	機械	
NOKIA OYJ	7,810	8,800	2,409	287,995	通信機器	
NESTE OYJ	176	668	1,881	224,963	石油・ガス・消耗燃料	
NOKIAN RENKAAT OYJ	158	210	393	47,047	自動車部品	
KONE OYJ	456	540	2,732	326,658	機械	

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…フィンランド) ORION OYJ	百株 130	百株 165	千ユーロ 603	千円 72,117	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	12,392	14,480	15,367	1,837,125
(ユーロ…アイルランド)		12	12	—	<0.3%>
CRH PLC	1,136	1,253	2,927	349,923	建設資材
KINGSPAN GROUP PLC	222	245	1,127	134,732	建設関連製品
KERRY GROUP PLC-A	221	244	2,508	299,869	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	1,398	—	—	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	320	353	869	103,899	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC	1,330	1,330	238	28,508	銀行
AIB GROUP PLC	1,250	1,250	126	15,108	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	119	121	891	106,611	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	5,996	6,194	8,688	1,038,653
—	—	8	8	—	<0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL	3,610	3,870	1,371	163,966	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	670	810	808	96,641	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS	310	380	608	72,686	食品・生活必需品小売
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	4,590	5,060	2,787	333,294
—	—	3	3	—	<0.1%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数 <比率>	269,371	306,092	483,916	57,852,275
—	—	238	237	—	<10.4%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	380	480	3,288	46,163	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,510	3,100	4,588	64,415	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,670	2,200	3,573	50,175	銀行
CLP HLDGS	2,270	2,530	17,760	249,358	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	1,624	1,887	43,778	614,648	資本市場
MTR CORP	2,010	2,430	9,598	134,762	陸運・鉄道
HANG LUNG GROUP LTD	1,030	—	—	—	不動産管理・開発
HANG SENG BANK	1,058	1,190	15,589	218,869	銀行
HENDERSON LAND	1,858	2,294	6,607	92,775	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,910	2,250	10,260	144,050	電力
WHARF (HOLDING)	1,740	—	—	—	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	12,403	15,603	18,911	265,516	ガス
HYSAN DEVELOPMENT	830	—	—	—	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	3,330	3,350	13,601	190,958	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES	790	1,140	2,184	30,666	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	4,950	5,690	12,005	168,562	銀行
NWS HOLDINGS LTD	2,205	2,205	1,664	23,373	コングロマリット
PCCW LTD	5,500	7,500	3,135	44,015	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	970	970	1,138	15,988	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	8,396	9,396	7,658	107,522	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,603	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO. LTD	4,800	4,800	4,396	61,731	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,170	2,480	24,552	344,710	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A	640	750	3,648	51,228	不動産管理・開発
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	—	1,300	3,016	42,344	食品
WHEELOCK & COMPANY LTD	1,170	1,340	6,934	97,360	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	1,950	2,120	10,366	145,549	機械
MINTH GROUP LTD	1,120	—	—	—	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED	2,700	2,700	1,741	24,450	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	2,280	2,280	2,708	38,029	ホテル・レストラン・レジャー
MGH CHINA HOLDINGS LTD	1,240	—	—	—	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		
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円
AIA GROUP LTD	16,470	18,930	129,007	1,811,271	保険
HKT TRUST AND HKT LTD	5,196	5,996	6,259	87,887	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	3,360	3,840	10,752	150,958	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,730	1,730	3,607	50,642	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,640	1,830	5,572	78,235	不動産管理・開発
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	2,160	4,315	60,592	飲料
WH GROUP LIMITED	11,700	14,600	10,278	144,308	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	3,710	4,250	21,868	307,031	コングロマリット
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	890	1,070	4,242	59,565	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD	3,610	4,090	16,647	233,736	不動産管理・開発
小計	125,416	140,483	445,260	6,251,459	
銘柄数	39	35	—	<1.1%>	
(シンガポール)		千シンガポールドル			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,980	2,490	739	56,477	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,400	—	—	—	食品
DBS GROUP HLDGS	2,430	2,840	5,197	396,910	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	510	700	490	37,421	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	140	140	265	20,282	販売
SATS LTD	770	1,150	368	28,104	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,110	1,290	1,150	87,877	資本市場
CAPITALAND LIMITED	3,300	3,800	1,048	80,096	不動産管理・開発
COMFORTDELGRO CORP LTD	3,100	3,100	458	35,038	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD	770	770	446	34,124	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK	1,850	2,000	3,842	293,413	銀行
UOL GROUP LIMITED	650	650	416	31,819	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	350	450	594	45,363	電子装置・機器・部品
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	2,400	2,400	424	32,441	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	11,100	12,900	3,121	238,411	各種電気通信サービス
SEMCORP INDUSTRIES	1,400	1,400	219	16,790	コングロマリット
OCBC-ORD	4,330	5,240	4,464	340,952	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	2,470	2,890	887	67,757	食品
KEPPEL CORP.	2,020	2,320	1,215	92,841	コングロマリット
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	3,800	4,400	365	27,890	機械
GENTING SINGAPORE LTD	8,700	8,700	556	42,522	ホテル・レストラン・レジャー
小計	62,581	59,630	26,273	2,006,539	
銘柄数	21	20	—	<0.4%>	
(オーストラリア)		千豪ドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	205	250	1,458	96,375	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	3,930	4,390	7,366	486,846	銀行
AMCOR PLC-CDI	1,550	—	—	—	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP	4,690	5,630	9,098	601,292	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	560	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,230	2,190	2,211	146,184	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	5,900	6,500	2,112	139,615	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	670	920	592	39,157	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	770	770	668	44,171	飲料
ASX LTD	263	307	2,379	157,244	資本市場
BHP GROUP LIMITED	4,010	4,580	13,831	914,130	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	333	400	892	58,952	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	971	971	295	19,512	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	630	760	737	48,771	情報技術サービス
CSL LIMITED	618	712	22,262	1,471,349	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	69	88	714	47,225	インターネット・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	3,720	4,340	5,273	348,499	運送インフラ

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)		百株	百株	千豪ドル	千円	
COCHLEAR LTD	81	89	1,627	107,529	ヘルスケア機器・用品	
ORIGIN ENERGY LTD	2,390	2,650	1,173	77,586	石油・ガス・消耗燃料	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,424	2,778	17,765	1,174,109	銀行	
BORAL LTD	1,530	2,000	404	26,700	建設資材	
RIO TINTO LTD	512	575	5,033	332,667	金属・鉱業	
APA GROUP	1,590	1,800	1,873	123,839	ガス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	760	880	1,899	125,565	ホテル・レストラン・レジャー	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	3,080	3,610	2,310	152,694	保険	
TPG TELECOM LTD	520	520	369	24,400	各種電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	73	73	72	4,781	ホテル・レストラン・レジャー	
ORICA LTD	500	590	962	63,597	化学	
BLUESCOPE STEEL LTD	680	880	806	53,273	金属・鉱業	
WORLEY LTD	470	470	280	18,513	エネルギー設備・サービス	
SUNCORP GROUP LTD	1,810	1,903	1,731	114,459	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	3,710	4,560	7,437	491,535	銀行	
NEWCREST MINING	1,030	1,170	2,867	189,524	金属・鉱業	
OIL SEARCH LTD	1,790	2,040	475	31,413	石油・ガス・消耗燃料	
INCITEC PIVOT LTD	2,330	2,330	456	30,181	化学	
AMP LIMITED	3,900	5,300	707	46,761	各種金融サービス	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	—	1,080	345	22,840	旅客航空輸送業	
QBE INSURANCE	1,790	1,950	1,677	110,832	保険	
CHALLENGER LIMITED	800	800	321	21,254	各種金融サービス	
SANTOS LTD.	2,320	2,610	882	58,303	石油・ガス・消耗燃料	
SONIC HEALTHCARE LTD	620	690	1,689	111,633	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	170	170	299	19,774	石油・ガス・消耗燃料	
TABCORP HOLDINGS	2,470	3,400	833	55,052	ホテル・レストラン・レジャー	
WESFARMERS LIMITED	1,540	1,750	6,280	415,094	複合小売業	
ALUMINA LTD	3,500	3,500	549	36,316	金属・鉱業	
WOODSIDE PETROLEUM	1,270	1,520	2,731	180,520	石油・ガス・消耗燃料	
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,810	1,970	7,513	496,572	食品・生活必需品小売業	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	192	810	53,574	資本市場	
SEEK LTD	480	480	717	47,394	専門サービス	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	85	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
BRAMBLES LTD	2,180	2,510	2,663	176,004	商業サービス・用品	
MACQUARIE GROUP LIMITED	439	530	4,539	300,012	資本市場	
CROWN RESORTS LTD	550	550	396	26,171	ホテル・レストラン・レジャー	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	580	670	1,255	82,981	建設資材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,000	1,110	1,091	72,112	飲料	
SYDNEY AIRPORT	1,440	1,680	999	66,063	運送インフラ	
AURIZON HOLDINGS LTD	2,730	3,050	1,473	97,360	陸運・鉄道	
AUSNET SERVICES	2,300	3,300	572	37,839	電力	
MEDIBANK PRIVATE LTD	3,500	4,500	1,269	83,868	保険	
AGL ENERGY LTD	930	1,050	1,782	117,831	総合公益事業	
SOUTH32 LTD	7,000	7,800	1,450	95,883	金属・鉱業	
CIMIC GROUP LTD	117	180	411	27,182	建設・土木	
COLES GROUP LTD	1,610	1,760	2,960	195,647	食品・生活必需品小売業	
WISETECH GLOBAL LTD	—	210	332	21,998	ソフトウェア	
小計	株数	金額	101,530	116,038	163,997	10,838,587
銘柄	数	比	61	61	< 1.9% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD	580	580	593	38,424	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
A2 MILK CO LTD	1,060	1,170	1,979	128,201	食品	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	740	860	2,610	169,030	ヘルスケア機器・用品	
FLETCHER BUILDING LTD	1,126	1,500	480	31,084	建設資材	

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		
(ニュージーランド)		百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
SPARK NEW ZEALAND LTD	2,600	3,070	1,252	81,115	各種電気通信サービス		
MERCURY NZ LTD	—	1,000	424	27,458	電力		
AUCKLAND INT'L AIRPORT LTD	1,300	1,520	796	51,580	運送インフラ		
MERIDIAN ENERGY LTD	1,590	2,010	810	52,457	独立系発電事業者・エネルギー販売業者		
小計	株数・金額	8,996	11,710	8,946	579,352		
	銘柄数 <比率>	7	8	—	<0.1%>		
(イスラエル)				千新シェケル			
BANK HAPOALIM BM	1,410	1,830	3,806	115,942	銀行		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,140	2,380	4,522	137,740	銀行		
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	2,800	—	—	—	各種電気通信サービス		
ELBIT SYSTEMS LTD	36	36	1,641	50,003	航空宇宙・防衛		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	1,720	1,752	53,386	銀行		
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	910	1,250	1,368	41,692	化学		
NICE LTD	86	95	5,147	156,780	ソフトウェア		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	170	230	1,499	45,677	銀行		
AZRIELI GROUP	65	65	1,300	39,598	不動産管理・開発		
小計	株数・金額	7,617	7,606	21,038	640,821		
	銘柄数 <比率>	8	8	—	<0.1%>		
合計	株数・金額	1,528,975	1,720,128	—	532,708,715		
	銘柄数 <比率>	1,248	1,252	—	<95.8%>		

\*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) 口 数	当 期 末			
		口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	71,000	80,000	934	101,690	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	17,900	2,589	281,786	0.1
AMERICAN TOWER CORP	60,200	69,400	16,002	1,741,525	0.3
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	214,000	1,213	132,052	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,200	21,900	3,330	362,511	0.1
BOSTON PROPERTIES	20,700	24,700	2,296	249,885	0.0
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	15,000	—	—	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	14,500	1,208	131,513	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	64,500	9,549	1,039,312	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	40,700	5,690	619,271	0.1
DUKE REALTY CORP	47,800	56,600	1,870	203,580	0.0
EQUINIX INC	10,930	13,250	8,544	929,900	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	26,500	1,499	163,234	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	51,300	57,700	3,610	392,970	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	10,070	2,270	247,140	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	20,700	2,002	217,956	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	11,100	832	90,600	0.0
HCP INC	66,100	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	75,700	1,843	200,605	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	109,000	1,244	135,469	0.0
INVITATION HOMES INC	45,000	85,000	1,801	196,019	0.0
IRON MOUNTAIN INC	38,300	43,100	1,071	116,560	0.0
KIMCO REALTY CORP	58,000	65,000	656	71,446	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	—	—	—	—
MACERICH CO /THE	14,200	—	—	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	83,000	1,459	158,888	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	17,600	1,885	205,197	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	27,900	919	100,017	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	32,200	856	93,180	0.0
PROLOGIS INC	86,300	114,500	9,489	1,032,770	0.2
PUBLIC STORAGE	21,500	24,500	4,939	537,613	0.1
REALTY INCOME CORP	39,300	49,900	2,651	288,528	0.1
REGENCY CENTERS CORP	21,000	26,200	1,046	113,911	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	15,200	17,770	4,951	538,903	0.1
SL GREEN REALTY CORP	12,500	12,500	576	62,686	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	47,900	2,695	293,333	0.1
SUN COMMUNITIES INC	—	14,300	1,749	190,362	0.0
UDR INC	36,700	46,300	1,746	190,064	0.0
VENTAS INC	49,200	56,800	1,635	177,966	0.0
VEREIT INC	125,000	160,000	796	86,715	0.0
VICI PROPERTIES INC	—	68,000	1,090	118,703	0.0
VORNADO REALTY TRUST	24,200	27,000	1,015	110,484	0.0
WP CAREY INC	21,500	27,400	1,625	176,858	0.0
WELLTOWER INC	51,700	63,100	2,977	323,993	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	邦貨換算金額	
(アメリカ) WEYERHAEUSER CO		100,500	115,000	1,949	212,136	0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,666,260 39	2,153,190 41	116,120	12,637,351 <2.3%>	
(カナダ) CAN APARTMENT PROP REAL ESTA FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS RIOCAN REAL ESTATE INVST TR SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		—	11,500 16,000 20,000 22,000 11,000	481 216 171 357 204	36,909 16,570 13,113 27,350 15,647	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	53,000 3	80,500 5	1,430	109,591 <0.0%>	
(イギリス) BRITISH LAND HAMMERSON PLC SEGRO PLC LAND SECURITIES GROUP PLC		128,000 108,000 145,000 99,000	128,000 — 176,000 111,000	416 — 1,319 607	55,495 — 175,935 80,947	0.0 — 0.0 0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	480,000 4	415,000 3	2,343	312,378 <0.1%>	
(ユーロ…フランス) ICADE KLEPIERRE GECINA SA COVIVIO UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		5,100 28,000 6,400 6,600 19,100	5,200 32,300 7,100 6,600 21,400	378 590 864 346 1,049	45,256 70,587 103,299 41,384 125,513	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0
ユ一口計	口数・金額 銘柄数<比率>	65,200 5	72,600 5	3,229	386,042 <0.1%>	
(香港) LINK REIT HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		288,000 370,000	330,000 370,000	21,285 2,797	298,841 39,272	0.1 0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	658,000 2	700,000 2	24,082	338,114 <0.1%>	
(シンガポール) CAPITALAND MALL TRUST ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT CAPITALAND COMMERCIAL TRUST SUNTEC REIT MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		380,000 380,000 369,972 300,000 —	390,000 440,800 439,972 300,000 370,000	682 1,194 655 372 673	52,122 91,229 50,064 28,409 51,427	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,429,972 4	1,940,772 5	3,578	273,253 <0.0%>	
(オーストラリア) MIRVAC GROUP GPT GROUP LENDLEASE GROUP STOCKLAND TRUST GROUP DEXUS GOODMAN GROUP SCENTRE GROUP		490,000 256,000 77,000 348,000 140,000 227,000 723,000	660,000 285,000 88,000 348,000 171,000 254,000 870,000	1,320 1,014 902 803 1,539 3,030 1,283	87,238 67,054 59,671 53,128 101,712 200,267 84,809	0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 0.0 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	
(オーストラリア) VICINITY CENTRES		480,000	470,000	千豪ドル 458	千円 30,285 %
小計	口数・金額	2,741,000	3,146,000	10,352	684,168
	銘柄数 <比率>	8	8	—	<0.1%>
合計	口数・金額	7,093,432	8,508,062	—	14,740,901
	銘柄数 <比率>	65	69	—	<2.7%>

\*邦貨換算額は、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	当期末	
		買建額	売建額
外 国	百万円		百万円
株式先物取引	CAN60	279	—
	EURO50	905	—
	FT100	436	—
	SPI200	180	—
	SPEMINI	5,996	—
	SWISSMKT	314	—

\*単位未満は切り捨て。

\*邦貨換算額は、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

(2020年3月31日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 532,708,715	% 94.0
投資証券	14,740,901	2.6
コール・ローン等、その他	19,044,821	3.4
投資信託財産総額	566,494,437	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(549,961,136千円)の投資信託財産総額(566,494,437千円)に対する比率は97.1%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=108.83円、1カナダドル=76.60円、1英ポンド=133.32円、1スイスフラン=113.21円、1スウェーデンクローナ=10.81円、1ノルウェークローネ=10.26円、1デンマーククローネ=16.01円、1ユーロ=119.55円、1香港ドル=14.04円、1シンガポールドル=76.37円、1豪ドル=66.09円、1ニュージーランドドル=64.76円、1新シェケル=30.46円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年3月31日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コレ・ローン等	572,404,457,892
株式(評価額)	15,096,264,525
投資証券(評価額)	532,708,715,674
未収入金	14,740,901,142
未収配当金	6,512,762,172
差入委託証拠金	962,507,146
(B) 負債	2,383,307,233
未払金	16,380,641,803
未払解約金	16,130,112,047
未払利息	245,599,738
その他未払費用	11,518
(C) 純資産総額(A-B)	4,918,500
元本	556,023,816,089
次期繰越損益金	230,777,414,749
(D) 受益権総口数	325,246,401,340
1万口当たり基準価額(C/D)	230,777,414,749円
	24,094円

(注) 期首元本額は207,721,483,594円、期中追加設定元本額は56,924,689,531円、期中一部解約元本額は33,868,758,376円、1口当たり純資産額は2,4094円です。

## ○損益の状況 (2019年4月2日~2020年3月31日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円
受取配当金	12,940,662,190
受取利息	12,855,664,954
その他収益金	42,925,608
支払利息	45,462,550
(B) 有価証券売買損益	△ 3,390,922
売買益	△ 80,856,550,657
売買損	31,778,609,458
(C) 先物取引等取引損益	△112,635,160,115
取引益	△ 563,715,596
取引損	2,176,335,441
(D) 保管費用等	△ 2,740,051,037
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 60,024,967
(F) 前期繰越損益金	△ 68,539,629,030
(G) 追加信託差損益金	358,713,626,420
(H) 解約差損益金	97,476,543,113
(I) 計(E+F+G+H)	△ 62,404,139,163
	325,246,401,340
	325,246,401,340

\*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
野村外国株インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	円 67,352,314,919
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)	36,321,368,128
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	22,255,621,713
野村Fops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)	16,200,200,467
マイバランス50(確定拠出年金向け)	10,232,027,680
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,902,069,455
のむラップ・ファンド(普通型)	8,834,948,702
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,135,950,276
のむラップ・ファンド(積極型)	5,764,474,434
野村インデックスファンド・外国株式	5,085,341,526
野村世界6資産分散投信(安定コース)	4,660,174,843
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,420,419,039
野村つみたて外国株投信	4,278,259,185
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)	3,653,207,390
マイバランス30(確定拠出年金向け)	3,019,550,038
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)	2,961,246,485
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)	2,177,660,268
マイバランスDC50	2,046,408,931

ファンド名	当期末
	元本額
マイ・ロード	円 1,600,015,897
マイバランスDC70	1,584,081,235
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,570,017,565
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)外国株式	1,246,658,042
ノムコP用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	1,240,519,467
のむラップ・ファンド(保守型)	1,222,162,509
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)	1,151,069,845
マイバランスDC30	1,099,765,570
野村6資産均等バランス	643,512,929
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	607,510,683
野村外国株式インデックスファンド	518,274,940
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指數(為替ヘッジなし)連動型上場投信	485,371,313
のむラップ・ファンド(やや積極型)	440,681,091
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	275,786,534
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)	246,564,408
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	228,702,850
のむラップ・ファンド(やや保守型)	223,325,959
野村DC運用戦略ファンド	216,326,337

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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)	180,296,083
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	174,633,368
バランスセレクト70	155,428,916
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)	153,679,384
バランスセレクト50	144,817,704
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	129,365,827
マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)	93,721,552
世界6資産分散ファンド	67,538,180
マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)	62,582,474
野村資産設計ファンド2040	60,883,618
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)	49,066,901
バランスセレクト30	45,606,729
野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)	44,016,998
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)	41,225,030
野村資産設計ファンド2030	37,195,280
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド (適格機関投資家専用)	30,720,896
野村資産設計ファンド2025	30,275,301
マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)	30,055,352
インデックス・ブレンド (タイプV)	29,087,179
野村資産設計ファンド2035	28,812,214
マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)	26,822,093
野村世界6資産分散投信 (D C) 成長コース	23,250,293
インデックス・ブレンド (タイプIII)	22,713,083
野村資産設計ファンド2020	18,389,209
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)	16,933,862
野村資産設計ファンド2015	16,224,931
野村DC運用戦略ファンド (マイルド)	15,363,144

ファンド名	当期末
	元本額
	円
ネクストコア	15,297,514
野村資産設計ファンド2050	14,984,107
野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	14,057,350
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	12,569,368
バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	11,389,463
野村世界6資産分散投信 (D C) 安定コース	10,685,299
野村資産設計ファンド2045	9,067,287
インデックス・ブレンド (タイプIV)	7,480,531
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)	6,606,701
野村世界6資産分散投信 (D C) インカムコース	5,768,243
野村資産設計ファンド2060	4,928,471
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,900,497
インデックス・ブレンド (タイプII)	3,672,056
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)	3,286,325
インデックス・ブレンド (タイプI)	2,914,635
野村資産設計ファンド (D C・みたてN I S A) 2030	2,756,083
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)	2,662,077
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,203,199
野村資産設計ファンド (D C・みたてN I S A) 2050	2,110,719
野村資産設計ファンド (D C・みたてN I S A) 2040	2,088,740
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	1,982,969
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,775,244
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)	1,595,704
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,124,486
野村資産設計ファンド (D C・みたてN I S A) 2060	667,236
野村スリーゼロ先進国株式投信	415,117
野村FII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)	129,074

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 国内債券マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11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	NOMURA-BP1国債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	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**  
東京都中央区日本橋 1-12-1

<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
		期騰落率	中騰落率			
15期(2016年5月10日)	円 13,701	% 7.5	%	% 99.5	%	百万円 8,223
16期(2017年5月10日)	13,380	△2.3	392.235	△2.3	99.5	16,780
17期(2018年5月10日)	13,482	0.8	395.239	0.8	99.6	23,470
18期(2019年5月10日)	13,719	1.8	402.339	1.8	99.6	28,594
19期(2020年5月11日)	13,716	△0.0	402.294	△0.0	99.2	31,736

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

NOMURA-BPI国債は、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。  
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権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、ファンドの運用成果に関して一切の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	純資産額
		騰落率	中騰落率			
(期首) 2019年5月10日	円 13,719	% —	%	% 99.6	%	%
5月末	13,800	0.6	404.594	0.6	99.4	—
6月末	13,892	1.3	407.287	1.2	99.6	—
7月末	13,910	1.4	407.796	1.4	99.5	—
8月末	14,121	2.9	414.035	2.9	99.5	—
9月末	13,955	1.7	409.066	1.7	99.1	—
10月末	13,886	1.2	407.089	1.2	99.1	—
11月末	13,834	0.8	405.583	0.8	98.9	—
12月末	13,785	0.5	404.208	0.5	99.2	—
2020年1月末	13,849	0.9	406.037	0.9	98.9	—
2月末	13,967	1.8	409.466	1.8	99.2	—
3月末	13,727	0.1	402.569	0.1	99.1	—
4月末	13,776	0.4	404.036	0.4	99.2	—
(期末) 2020年5月11日	13,716	△0.0	402.294	△0.0	99.2	—

\*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国債です。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

国内債券利回りが上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

当作成期首から2019年8月末にかけては、FOMC（米連邦公開市場委員会）による政策金利の引き下げなどを背景に、国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

9月から12月末にかけては、国内株式市場の上昇を受けて安全資産としての国債需要が減少したことや、外国債券利回りが上昇（価格は下落）したことなどを背景に、国内債券利回りは上昇しました。

2020年1月から2月末にかけては、中国で発生した新型肺炎の感染拡大に対する警戒感や国内株式市場の下落などを受けて、安全資産としての国債需要が高まったことなどを背景に、国内債券利回りは低下しました。3月以降は、新型肺炎の感染が米欧にも広がり景気減速懸念が高まったことで現金需要が急増したことなどを背景に、国内債券利回りは上昇しました。

当運用期間では、国内債券利回りは上昇しました。

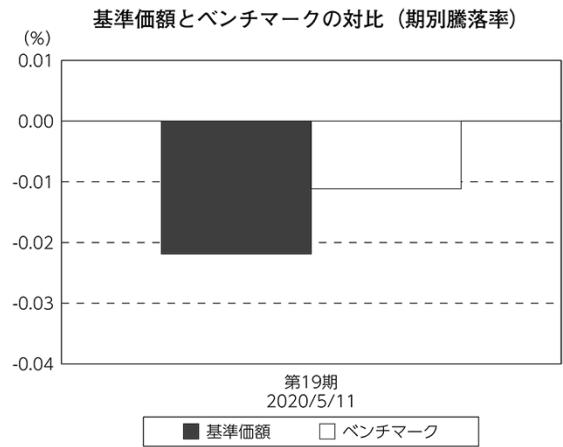
## ○当ファンドのポートフォリオ

NOMURA-BPI国債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、デュレーション（金利感応度）などを考慮して選択した日本国債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。債券組入比率は期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

今期の基準価額の騰落率は-0.0%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の-0.0%と同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

- ・資金流入入に伴う取引で価格差や取引コストが生じること
- ・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 国債です。

## ○今後の運用方針

引き続き、債券組入比率を高位に保ち、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した日本国債に分散投資することでNOMURA-BPI国債との連動を高めるように運用を行ってまいります。

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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(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	0.000	
期中の平均基準価額は、13,875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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 公社債

国 内	国債証券	買付額	売付額
		千円 17,046,031	千円 13,688,158

\*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。

## 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 債券先物取引	百万円 4,158	百万円 4,143	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

(2019年5月11日～2020年5月11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	17,046	—	—	13,688	30	0.2
債券先物取引	4,158	4,158	100.0	4,143	4,143	100.0

## 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)	59千円
うち利害関係人への支払額 (B)	59千円
(B) / (A)	100.0%

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。

## ○組入資産の明細

(2020年5月11日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当期			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 28,817,000 ( 30,000)	千円 31,490,239 ( 45,150)	% 99.2 ( 0.1)	% — (—)	% 66.3 ( 0.1)	% 24.0 ( 0.1)	% 8.9 (—)
合計	28,817,000 ( 30,000)	31,490,239 ( 45,150)	99.2 ( 0.1)	— (—)	66.3 ( 0.1)	24.0 ( 0.1)	8.9 (—)

\* ( ) 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	評価額	千円	
国債証券	%			千円	
国庫債券 利付(2年) 第402回	0.1	370,000	371,180	千円	2021/7/1
国庫債券 利付(2年) 第403回	0.1	230,000	230,786	千円	2021/8/1
国庫債券 利付(2年) 第404回	0.1	200,000	200,732	千円	2021/9/1
国庫債券 利付(2年) 第405回	0.1	200,000	200,848	千円	2021/10/1
国庫債券 利付(2年) 第409回	0.1	100,000	100,484	千円	2022/2/1
国庫債券 利付(5年) 第129回	0.1	420,000	421,570	千円	2021/9/20
国庫債券 利付(5年) 第130回	0.1	410,000	411,816	千円	2021/12/20
国庫債券 利付(5年) 第131回	0.1	200,000	201,042	千円	2022/3/20
国庫債券 利付(5年) 第132回	0.1	420,000	422,486	千円	2022/6/20
国庫債券 利付(5年) 第133回	0.1	380,000	382,519	千円	2022/9/20
国庫債券 利付(5年) 第134回	0.1	470,000	473,445	千円	2022/12/20
国庫債券 利付(5年) 第135回	0.1	150,000	151,183	千円	2023/3/20
国庫債券 利付(5年) 第136回	0.1	240,000	242,023	千円	2023/6/20
国庫債券 利付(5年) 第137回	0.1	100,000	100,895	千円	2023/9/20
国庫債券 利付(5年) 第138回	0.1	350,000	353,300	千円	2023/12/20
国庫債券 利付(5年) 第139回	0.1	620,000	626,125	千円	2024/3/20
国庫債券 利付(5年) 第140回	0.1	190,000	191,962	千円	2024/6/20
国庫債券 利付(5年) 第141回	0.1	40,000	40,420	千円	2024/9/20
国庫債券 利付(5年) 第142回	0.1	200,000	202,132	千円	2024/12/20
国庫債券 利付(40年) 第1回	2.4	30,000	45,150	千円	2048/3/20
国庫債券 利付(40年) 第2回	2.2	30,000	43,969	千円	2049/3/20
国庫債券 利付(40年) 第3回	2.2	60,000	88,803	千円	2050/3/20
国庫債券 利付(40年) 第4回	2.2	75,000	112,077	千円	2051/3/20
国庫債券 利付(40年) 第5回	2.0	60,000	87,001	千円	2052/3/20
国庫債券 利付(40年) 第6回	1.9	90,000	129,014	千円	2053/3/20
国庫債券 利付(40年) 第7回	1.7	100,000	138,144	千円	2054/3/20
国庫債券 利付(40年) 第8回	1.4	160,000	207,356	千円	2055/3/20
国庫債券 利付(40年) 第9回	0.4	30,000	29,220	千円	2056/3/20
国庫債券 利付(40年) 第10回	0.9	70,000	79,831	千円	2057/3/20
国庫債券 利付(40年) 第11回	0.8	80,000	88,768	千円	2058/3/20
国庫債券 利付(40年) 第12回	0.5	70,000	70,457	千円	2059/3/20
国庫債券 利付(10年) 第315回	1.2	70,000	71,066	千円	2021/6/20
国庫債券 利付(10年) 第317回	1.1	30,000	30,520	千円	2021/9/20
国庫債券 利付(10年) 第318回	1.0	80,000	81,280	千円	2021/9/20
国庫債券 利付(10年) 第319回	1.1	70,000	71,444	千円	2021/12/20
国庫債券 利付(10年) 第320回	1.0	90,000	91,712	千円	2021/12/20
国庫債券 利付(10年) 第321回	1.0	150,000	153,292	千円	2022/3/20
国庫債券 利付(10年) 第322回	0.9	130,000	132,611	千円	2022/3/20
国庫債券 利付(10年) 第323回	0.9	70,000	71,605	千円	2022/6/20
国庫債券 利付(10年) 第324回	0.8	150,000	153,124	千円	2022/6/20
国庫債券 利付(10年) 第325回	0.8	330,000	337,659	千円	2022/9/20
国庫債券 利付(10年) 第326回	0.7	240,000	245,500	千円	2022/12/20
国庫債券 利付(10年) 第327回	0.8	230,000	235,874	千円	2022/12/20
国庫債券 利付(10年) 第328回	0.6	230,000	235,112	千円	2023/3/20
国庫債券 利付(10年) 第329回	0.8	350,000	360,545	千円	2023/6/20
国庫債券 利付(10年) 第330回	0.8	220,000	227,169	千円	2023/9/20

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331回	0.6	190,000	194,907	2023/9/20	
国庫債券 利付 (10年) 第332回	0.6	350,000	359,653	2023/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第333回	0.6	250,000	257,317	2024/3/20	
国庫債券 利付 (10年) 第334回	0.6	340,000	350,536	2024/6/20	
国庫債券 利付 (10年) 第335回	0.5	200,000	205,612	2024/9/20	
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	120,000	123,532	2024/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	220,000	224,384	2024/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第338回	0.4	400,000	410,356	2025/3/20	
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	300,000	308,094	2025/6/20	
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	465,000	478,168	2025/9/20	
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	250,000	256,000	2025/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	520,000	526,744	2026/3/20	
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	350,000	354,735	2026/6/20	
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	300,000	304,131	2026/9/20	
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	560,000	568,013	2026/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第346回	0.1	370,000	375,365	2027/3/20	
国庫債券 利付 (10年) 第347回	0.1	210,000	213,158	2027/6/20	
国庫債券 利付 (10年) 第348回	0.1	220,000	223,344	2027/9/20	
国庫債券 利付 (10年) 第349回	0.1	400,000	406,132	2027/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第350回	0.1	500,000	507,515	2028/3/20	
国庫債券 利付 (10年) 第351回	0.1	330,000	334,844	2028/6/20	
国庫債券 利付 (10年) 第352回	0.1	450,000	456,430	2028/9/20	
国庫債券 利付 (10年) 第353回	0.1	340,000	344,705	2028/12/20	
国庫債券 利付 (10年) 第354回	0.1	100,000	101,289	2029/3/20	
国庫債券 利付 (10年) 第355回	0.1	50,000	50,593	2029/6/20	
国庫債券 利付 (10年) 第357回	0.1	150,000	151,513	2029/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	40,000	49,146	2030/5/20	
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	10,000	12,349	2031/5/20	
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	10,000	12,656	2031/11/20	
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	15,000	18,931	2032/5/20	
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	20,000	24,163	2032/11/22	
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	20,000	23,179	2032/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	30,000	33,679	2033/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	10,000	12,007	2033/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	10,000	12,562	2033/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	10,000	12,458	2033/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	30,000	39,081	2034/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	70,000	92,469	2034/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	10,000	13,247	2034/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	20,000	26,282	2034/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	120,000	156,354	2035/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	10,000	13,069	2035/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	10,000	13,407	2035/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	60,000	78,832	2035/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	50,000	67,413	2036/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	40,000	54,102	2036/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	80,000	108,459	2036/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	50,000	66,344	2036/12/20	

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26回	2.4	80,000	107,730	2037/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	100,000	136,977	2037/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	30,000	41,325	2038/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	120,000	164,134	2038/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	80,000	108,648	2039/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	40,000	53,904	2039/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	110,000	151,224	2040/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	130,000	172,071	2040/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	110,000	150,576	2041/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	122,000	162,812	2041/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	130,000	174,254	2042/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	130,000	172,139	2042/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	140,000	182,957	2043/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	80,000	106,508	2043/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	120,000	157,401	2043/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	100,000	129,156	2043/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	110,000	142,224	2044/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	90,000	116,621	2044/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	110,000	142,689	2044/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	90,000	112,683	2044/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	150,000	187,938	2045/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	110,000	140,597	2045/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	110,000	135,481	2045/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	120,000	147,873	2045/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	40,000	43,494	2046/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第51回	0.3	80,000	77,196	2046/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第52回	0.5	90,000	91,167	2046/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第53回	0.6	100,000	103,811	2046/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第54回	0.8	130,000	141,408	2047/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第55回	0.8	80,000	86,974	2047/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第56回	0.8	80,000	87,032	2047/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第57回	0.8	110,000	119,600	2047/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第58回	0.8	180,000	195,593	2048/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第59回	0.7	110,000	116,715	2048/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第60回	0.9	100,000	111,317	2048/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第61回	0.7	100,000	106,067	2048/12/20	
国庫債券 利付 (30年) 第62回	0.5	50,000	50,381	2049/3/20	
国庫債券 利付 (30年) 第63回	0.4	40,000	39,232	2049/6/20	
国庫債券 利付 (30年) 第64回	0.4	60,000	58,840	2049/9/20	
国庫債券 利付 (30年) 第65回	0.4	100,000	98,053	2049/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第52回	2.1	25,000	25,778	2021/9/21	
国庫債券 利付 (20年) 第53回	2.1	10,000	10,366	2021/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第54回	2.2	10,000	10,383	2021/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第55回	2.0	10,000	10,406	2022/3/21	
国庫債券 利付 (20年) 第56回	2.0	10,000	10,462	2022/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第57回	1.9	10,000	10,440	2022/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	10,000	10,492	2022/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	30,000	31,477	2022/12/20	

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60回	1.4	10,000	10,414	2022/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	10,000	10,337	2023/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	80,000	82,410	2023/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	10,000	10,613	2023/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	10,000	10,695	2023/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	10,000	10,745	2023/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	20,000	21,418	2023/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	10,000	10,794	2024/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	10,000	10,911	2024/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	30,000	32,616	2024/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	40,000	44,205	2024/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	10,000	10,968	2024/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	20,000	21,959	2024/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	10,000	10,987	2024/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	10,000	11,033	2024/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	40,000	44,346	2025/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	17,000	18,681	2025/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	15,000	16,556	2025/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	10,000	11,037	2025/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	10,000	11,089	2025/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	10,000	11,140	2025/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	10,000	11,143	2025/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	15,000	16,795	2025/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	15,000	16,880	2025/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	50,000	55,984	2025/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	13,000	14,697	2026/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	10,000	11,423	2026/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	20,000	22,970	2026/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	20,000	22,958	2026/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	10,000	11,543	2026/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	30,000	34,413	2026/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	20,000	22,906	2027/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	20,000	23,044	2027/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	10,000	11,722	2027/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	15,000	17,368	2027/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	50,000	58,525	2027/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	30,000	35,046	2027/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	20,000	23,613	2028/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	20,000	23,930	2028/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	20,000	24,037	2028/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	25,000	29,842	2028/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	10,000	11,774	2028/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	70,000	82,736	2028/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	100,000	119,036	2028/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	100,000	118,638	2028/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	80,000	93,527	2028/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	30,000	35,171	2029/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	90,000	107,114	2029/3/20	

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111回	2.2	10,000	12,036	2029/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	85,000	101,532	2029/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	160,000	191,713	2029/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	100,000	120,235	2029/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	50,000	60,598	2029/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	110,000	133,782	2030/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	60,000	72,381	2030/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	40,000	47,988	2030/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	50,000	58,976	2030/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	110,000	127,529	2030/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	100,000	119,311	2030/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	130,000	153,761	2030/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	100,000	121,760	2030/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	100,000	120,704	2030/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	100,000	123,211	2031/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	30,000	36,315	2031/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	120,000	143,966	2031/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	100,000	120,301	2031/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	50,000	59,598	2031/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	90,000	107,545	2031/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	35,000	41,428	2031/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	60,000	71,179	2031/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	120,000	143,738	2031/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	70,000	84,039	2032/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	60,000	71,330	2032/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	30,000	35,313	2032/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	40,000	47,655	2032/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	50,000	58,373	2032/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	60,000	70,765	2032/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	140,000	167,141	2032/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	100,000	119,624	2032/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	100,000	120,866	2032/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	130,000	154,160	2033/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	80,000	93,856	2033/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	190,000	228,148	2033/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	140,000	168,418	2033/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	150,000	178,767	2033/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	170,000	200,603	2034/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	100,000	118,159	2034/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	220,000	257,206	2034/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	170,000	194,128	2034/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第152回	1.2	130,000	148,539	2035/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	120,000	139,050	2035/6/20	
国庫債券 利付 (20年) 第154回	1.2	160,000	183,158	2035/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	160,000	178,427	2035/12/20	
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	140,000	143,092	2036/3/20	
国庫債券 利付 (20年) 第158回	0.5	60,000	62,161	2036/9/20	
国庫債券 利付 (20年) 第159回	0.6	220,000	231,354	2036/12/20	

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
国債証券	%			千円	
国庫債券 利付 (20年) 第160回	0.7	130,000	138,786	千円	2037/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第161回	0.6	110,000	115,557		2037/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第163回	0.6	190,000	199,365		2037/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第164回	0.5	230,000	237,192		2038/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第165回	0.5	190,000	195,852		2038/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第166回	0.7	160,000	170,542		2038/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第167回	0.5	130,000	133,874		2038/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第168回	0.4	70,000	70,806		2039/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第169回	0.3	40,000	39,712		2039/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第171回	0.3	50,000	49,632		2039/12/20
合 計		28,817,000	31,490,239		

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項 目	当 期 末		比 率 %
	評 価 額	千円	
公社債	31,490,239	千円	99.1
コール・ローン等、その他	273,011		0.9
投資信託財産総額	31,763,250		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 (2020年5月11日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	31,763,250,140
公社債(評価額)	212,757,413
未収利息	31,490,239,890
前払費用	59,902,815
前払費用	350,022
(B) 負債	26,287,190
未払解約金	26,287,037
未払利息	153
(C) 純資産総額(A-B)	31,736,962,950
元本	23,138,175,064
次期繰越損益金	8,598,787,886
(D) 受益権総口数	23,138,175,064口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,716円

(注) 期首元本額は20,842,266,404円、期中追加設定元本額は20,051,157,443円、期中一部解約元本額は17,755,248,783円、1口当たり純資産額は1.3716円です。

## ○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円
受取利息	253,610,721
支払利息	253,839,978
(B) 有価証券売買損益	△ 229,257
売買益	△ 338,273,030
売買損	60,025,850
(C) 先物取引等取引損益	△ 398,298,880
取引損	△ 15,259,300
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 15,259,300
(E) 前期繰越損益金	△ 99,921,609
(F) 追加信託差損益金	7,751,737,037
(G) 解約差損益金	7,728,674,028
(H) 計(D+E+F+G)	△ 6,781,701,570
次期繰越損益金(H)	8,598,787,886
次期繰越損益金(H)	8,598,787,886

\*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(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)	円 8,307,207,930
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	5,067,330,497
野村DC運用戦略ファンド	4,799,958,279
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)	2,582,897,201
バランスセレクト50	562,024,328
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	523,477,407
バランスセレクト30	515,282,929
ネクストコア	324,702,450
バランスセレクト70	232,987,782
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	141,341,267
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	41,670,768
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	21,158,993
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	18,135,233

## ○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19期（決算日2020年5月11日）

作成対象期間（2019年5月11日～2020年5月11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、お願ひ申し上げます。

#### ●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**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<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	中落率			
15期(2016年5月10日)	円 21,725	% △6.6		% △6.8	% 99.0	% 632,898
16期(2017年5月10日)	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	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

\*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数值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

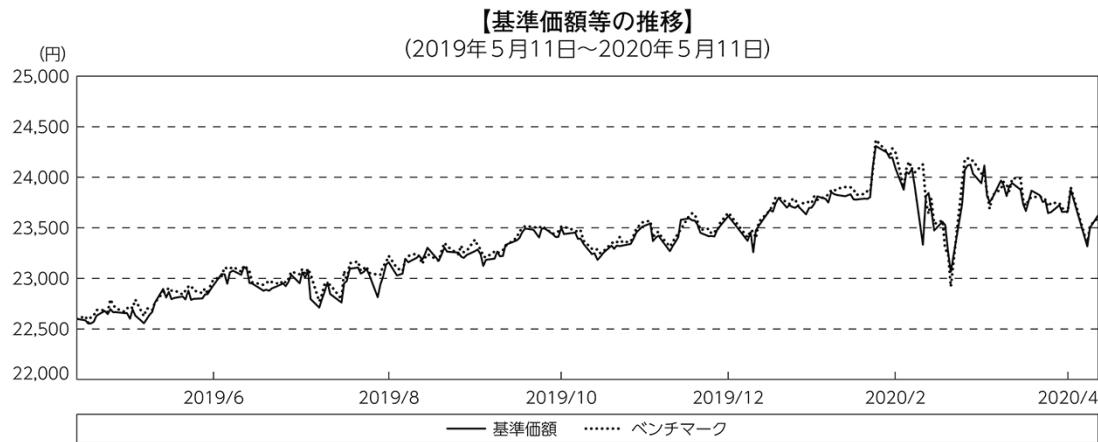
年月日	基準価額	ベンチマーク		債組入比率	債先物比率	純資産額
		騰	落率			
(期首) 2019年5月10日	円 22,598	% —		% —	% 99.0	% —
5月末	22,633	0.2	230.56	0.9	98.8	—
6月末	22,930	1.5	232.54	1.7	99.1	—
7月末	23,004	1.8	233.12	2.0	99.0	—
8月末	23,160	2.5	234.94	2.8	99.2	—
9月末	23,270	3.0	236.55	3.5	99.1	—
10月末	23,500	4.0	237.86	4.0	99.0	—
11月末	23,510	4.0	238.28	4.2	99.2	—
12月末	23,618	4.5	239.25	4.7	99.0	—
2020年1月末	23,811	5.4	240.53	5.2	98.9	—
2月末	24,091	6.6	245.31	7.3	98.8	—
3月末	24,116	6.7	243.18	6.4	98.5	—
4月末	23,661	4.7	239.28	4.7	98.8	—
(期末) 2020年5月11日	23,625	4.5	238.73	4.4	98.9	—

\*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

主要通貨が対円で下落（円高）したことはマイナスに影響しましたが、外国債券利回りが米国を中心に低下（価格は上昇）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、新型肺炎の感染拡大に伴う世界景気の減速懸念から、主要国の中銀が政策金利の引き下げや金融緩和姿勢の強化を打ち出したことなどを背景に、外国債券利回りは米国を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、新型肺炎の感染拡大による世界景気の減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことや内外長期金利差縮小などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）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

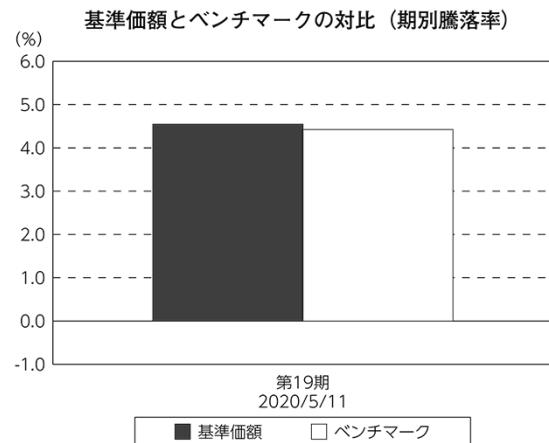
当運用期間の基準価額の騰落率は+4.5%となり、ベンチマークの+4.4%を0.1ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです

### （マイナス要因）

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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他の費用	円 3	% 0.014	(a) 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 )	(2)	(0.010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
( その他の )	(1)	(0.003)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	3	0.014	
期中の平均基準価額は、23,442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

(2019年5月11日～2020年5月11日)

## 公社債

外 国	買付額		売付額	
	国	額	国	額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 959,762	千米ドル 1,365,556
	カナダ	国債証券	千カナダドル 63,239	千カナダドル 71,933
	イギリス	国債証券	千英ポンド 82,647	千英ポンド 109,068
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 11,477	千スウェーデンクローナ 46,143
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 16,323	千ノルウェークローネ 6,545
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 30,988	千デンマーククローネ 37,425
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	119,181	104,445
	イタリア	国債証券	93,145	79,272
	フランス	国債証券	104,604	121,403

		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	27,745	40,250
	オーストリア 国債証券	29,649	34,208
	フィンランド 国債証券	8,989	17,756
	アイルランド 国債証券	14,124	12,595
	ポーランド 国債証券	千ズロチ 202,225	千ズロチ 202,670
	シンガポール 国債証券	千シンガポールドル 7,842	千シンガポールドル 6,446
	マレーシア 国債証券	千リンギ 10,594	千リンギ 18,952
	オーストラリア 国債証券	千豪ドル 28,634	千豪ドル 29,248
	イスラエル 国債証券	千新シェケル 73,083	千新シェケル —
	メキシコ 国債証券	千メキシコペソ 195,362	千メキシコペソ 193,677
	南アフリカ 国債証券	千ランド 66,322	千ランド 465,650

\* 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

(2019年5月11日～2020年5月11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		
				百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	85,089	60	0.1	153,760	598	0.4			

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

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区分	額面金額	当期末						
		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 2,126,950	千米ドル 2,437,268	千円 260,665,884	% 46.2	% —	% 21.2	% 15.1	% 9.8
カナダ	千カナダドル 116,290	千カナダドル 142,546	千円 10,939,051	1.9	—	1.0	0.6	0.4
イギリス	千英ポンド 194,290	千英ポンド 286,143	千円 38,014,149	6.7	—	5.6	1.1	0.0
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 129,800	千スウェーデンクローナ 147,275	千円 1,608,244	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 121,700	千ノルウェークローネ 133,149	千円 1,390,080	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 140,570	千デンマーククローネ 183,151	千円 2,848,012	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	218,070	304,169	35,283,643	6.2	—	4.7	1.4	0.2
イタリア	386,250	460,218	53,385,370	9.5	—	5.3	2.5	1.6
フランス	354,370	463,352	53,748,894	9.5	—	7.3	1.8	0.4
オランダ	54,050	71,738	8,321,625	1.5	—	1.2	0.2	0.0
スペイン	256,750	323,955	37,578,841	6.7	—	4.3	1.2	1.2
ベルギー	85,400	112,907	13,097,321	2.3	—	1.9	0.4	0.0
オーストリア	49,900	63,919	7,414,659	1.3	—	1.2	0.1	0.1
フィンランド	16,900	19,298	2,238,592	0.4	—	0.4	0.0	0.0
アイルランド	41,580	46,972	5,448,814	1.0	—	0.5	0.4	0.0
ポーランド	千ズロチ 121,600	千ズロチ 129,394	千円 3,299,550	0.6	—	0.3	0.0	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 30,330	千シンガポールドル 34,287	千円 2,594,561	0.5	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千リンギ 94,780	千リンギ 103,313	千円 2,549,773	0.5	—	0.3	0.1	0.0
オーストラリア	千豪ドル 138,300	千豪ドル 163,458	千円 11,422,475	2.0	—	1.4	0.4	0.2
イスラエル	千新シェケル 61,500	千新シェケル 72,402	千円 2,203,927	0.4	—	0.2	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコペソ 870,100	千メキシコペソ 961,590	千円 4,356,003	0.8	—	0.4	0.2	0.1
合計	—	—	558,409,476	98.9	—	58.1	26.3	14.5

\*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	利率	額面金額	当期末		
			外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
アメリカ	%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY BOND	8.0	36,200	40,525	4,334,214 2021/11/15
	US TREASURY BOND	6.25	38,800	46,438	4,966,624 2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	45,100	49,070	5,248,133 2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	72,200	95,270	10,189,142 2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.125	10,800	15,267	1,632,875 2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	46,200	64,542	6,902,856 2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	49,300	68,376	7,312,897 2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	27,500	38,424	4,109,532 2029/2/15
	US TREASURY BOND	4.375	100	155	16,639 2038/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	17,500	22,847	2,443,494 2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	2,000	2,978	318,577 2043/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	34,400	35,438	3,790,170 2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,025	109,644 2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	6,300	6,423	687,023 2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	900	924	98,898 2021/6/15
	US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,770	3,718,684 2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.125	1,600	1,618	173,065 2021/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	28,300	28,785	3,078,587 2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.625	3,500	3,602	385,335 2021/7/15
	US TREASURY N/B	2.25	11,400	11,694	1,250,758 2021/7/31
	US TREASURY N/B	1.125	4,300	4,352	465,453 2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	26,100	26,741	2,859,980 2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	12,200	12,495	1,336,441 2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	17,900	18,389	1,966,751 2021/9/30
	US TREASURY N/B	1.125	9,650	9,779	1,045,935 2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	30,400	31,212	3,338,149 2021/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,931	206,554 2021/10/31
	US TREASURY N/B	2.0	7,500	7,709	824,496 2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,026	109,803 2021/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	3,700	3,791	405,484 2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,799	1,368,866 2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	6,700	6,899	737,949 2021/12/31
	US TREASURY N/B	2.5	80,000	83,134	8,891,220 2022/1/15
	US TREASURY N/B	1.5	6,400	6,546	700,148 2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.875	14,000	14,411	1,541,283 2022/1/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,300	2,347	251,068 2022/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	32,800	33,864	3,621,831 2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	6,800	6,994	748,055 2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.875	3,500	3,608	385,876 2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	3,900	4,017	429,618 2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.875	500	516	55,212 2022/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,352	144,601 2022/4/15
	US TREASURY N/B	1.75	32,800	33,830	3,618,131 2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.875	25,300	26,149	2,796,734 2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	8,800	9,080	971,196 2022/5/15
	US TREASURY N/B	1.875	200	207	22,141 2022/5/31
	US TREASURY N/B	1.75	900	929	99,383 2022/5/31

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			
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
国債証券	US TREASURY N/B	2.125	17,600	18,338	1,961,289	2022/6/30	
	US TREASURY N/B	1.75	100	103	11,056	2022/6/30	
	US TREASURY N/B	2.0	100	104	11,129	2022/7/31	
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	1,037	111,002	2022/7/31	
	US TREASURY N/B	1.625	900	929	99,356	2022/8/15	
	US TREASURY N/B	1.875	19,100	19,850	2,123,018	2022/8/31	
	US TREASURY N/B	1.75	900	933	99,849	2022/9/30	
	US TREASURY N/B	2.0	1,500	1,567	167,606	2022/10/31	
	US TREASURY N/B	1.625	7,600	7,874	842,125	2022/11/15	
	US TREASURY N/B	2.125	10,200	10,718	1,146,371	2022/12/31	
	US TREASURY N/B	1.75	47,900	49,917	5,338,626	2023/1/31	
	US TREASURY N/B	2.0	400	419	44,905	2023/2/15	
	US TREASURY N/B	1.5	20,000	20,731	2,217,207	2023/2/28	
	US TREASURY N/B	2.625	14,300	15,270	1,633,215	2023/2/28	
	US TREASURY N/B	1.5	400	415	44,390	2023/3/31	
	US TREASURY N/B	1.625	15,000	15,628	1,671,427	2023/4/30	
	US TREASURY N/B	1.75	34,800	36,406	3,893,704	2023/5/15	
	US TREASURY N/B	1.625	9,200	9,594	1,026,141	2023/5/31	
	US TREASURY N/B	1.25	4,800	4,957	530,204	2023/7/31	
	US TREASURY N/B	2.75	41,100	44,429	4,751,760	2023/7/31	
	US TREASURY N/B	2.5	6,500	6,979	746,444	2023/8/15	
	US TREASURY N/B	1.375	10,900	11,307	1,209,288	2023/8/31	
	US TREASURY N/B	1.375	35,200	36,542	3,908,166	2023/9/30	
	US TREASURY N/B	1.625	11,800	12,361	1,322,054	2023/10/31	
	US TREASURY N/B	2.75	42,600	46,334	4,955,437	2023/11/15	
	US TREASURY N/B	2.125	9,200	9,811	1,049,356	2023/11/30	
	US TREASURY N/B	2.875	30,000	32,793	3,507,291	2023/11/30	
	US TREASURY N/B	2.25	43,000	46,114	4,931,906	2023/12/31	
	US TREASURY N/B	2.5	1,300	1,408	150,592	2024/1/31	
	US TREASURY N/B	2.75	800	874	93,541	2024/2/15	
	US TREASURY N/B	2.125	1,700	1,822	194,882	2024/3/31	
	US TREASURY N/B	2.5	20,100	21,876	2,339,640	2024/5/15	
	US TREASURY N/B	2.0	17,700	18,950	2,026,709	2024/6/30	
	US TREASURY N/B	2.125	3,800	4,090	437,525	2024/7/31	
	US TREASURY N/B	2.125	42,700	46,095	4,929,965	2024/9/30	
	US TREASURY N/B	2.25	3,600	3,909	418,167	2024/10/31	
	US TREASURY N/B	2.25	34,200	37,171	3,975,451	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	2.125	2,300	2,488	266,144	2024/11/30	
	US TREASURY N/B	2.0	16,900	18,238	1,950,639	2025/2/15	
	US TREASURY N/B	2.75	3,400	3,792	405,561	2025/2/28	
	US TREASURY N/B	2.625	32,700	36,330	3,885,515	2025/3/31	
	US TREASURY N/B	2.875	30,000	33,742	3,608,810	2025/4/30	
	US TREASURY N/B	2.125	6,500	7,074	756,600	2025/5/15	
	US TREASURY N/B	2.75	4,100	4,599	491,902	2025/6/30	
	US TREASURY N/B	2.0	27,000	29,286	3,132,197	2025/8/15	
	US TREASURY N/B	3.0	19,200	21,878	2,339,958	2025/9/30	
	US TREASURY N/B	2.25	50,300	55,349	5,919,644	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,136	228,488	2026/2/15	

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			
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
国債証券	US TREASURY N/B	2.375	8,600	9,577	1,024,321	2026/4/30	
	US TREASURY N/B	1.625	1,800	1,925	205,955	2026/5/15	
	US TREASURY N/B	1.5	21,100	22,435	2,399,448	2026/8/15	
	US TREASURY N/B	1.375	12,000	12,666	1,354,688	2026/8/31	
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	6,003	642,060	2026/10/31	
	US TREASURY N/B	2.0	13,000	14,252	1,524,279	2026/11/15	
	US TREASURY N/B	1.625	30,000	32,177	3,441,366	2026/11/30	
	US TREASURY N/B	2.25	11,300	12,605	1,348,177	2027/2/15	
	US TREASURY N/B	2.375	38,000	42,856	4,583,542	2027/5/15	
	US TREASURY N/B	2.25	8,400	9,429	1,008,431	2027/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	500	582	62,344	2028/2/15	
	US TREASURY N/B	2.875	1,800	2,122	227,041	2028/5/15	
	US TREASURY N/B	3.125	1,200	1,449	155,040	2028/11/15	
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,154	230,427	2030/2/15	
	US TREASURY N/B	6.25	3,900	6,019	643,775	2030/5/15	
	US TREASURY N/B	5.375	36,700	54,654	5,845,280	2031/2/15	
	US TREASURY N/B	4.5	2,200	3,372	360,637	2036/2/15	
	US TREASURY N/B	5.0	200	328	35,122	2037/5/15	
	US TREASURY N/B	4.5	100	157	16,889	2038/5/15	
	US TREASURY N/B	3.5	100	142	15,192	2039/2/15	
	US TREASURY N/B	4.25	100	155	16,578	2039/5/15	
	US TREASURY N/B	4.5	100	159	17,095	2039/8/15	
	US TREASURY N/B	4.375	100	157	16,861	2039/11/15	
	US TREASURY N/B	4.625	100	162	17,378	2040/2/15	
	US TREASURY N/B	4.375	100	158	16,929	2040/5/15	
	US TREASURY N/B	3.875	200	298	31,884	2040/8/15	
	US TREASURY N/B	4.25	100	156	16,713	2040/11/15	
	US TREASURY N/B	4.75	100	165	17,728	2041/2/15	
	US TREASURY N/B	4.375	100	159	17,009	2041/5/15	
	US TREASURY N/B	3.75	100	147	15,750	2041/8/15	
	US TREASURY N/B	3.125	300	405	43,397	2041/11/15	
	US TREASURY N/B	3.125	100	135	14,513	2042/2/15	
	US TREASURY N/B	3.0	100	133	14,233	2042/5/15	
	US TREASURY N/B	2.75	200	255	27,364	2042/8/15	
	US TREASURY N/B	2.75	800	1,023	109,470	2042/11/15	
	US TREASURY N/B	3.125	2,600	3,524	376,893	2043/2/15	
	US TREASURY N/B	3.625	100	146	15,620	2043/8/15	
	US TREASURY N/B	3.625	7,400	10,846	1,160,063	2044/2/15	
	US TREASURY N/B	3.375	15,200	21,524	2,301,994	2044/5/15	
	US TREASURY N/B	3.125	23,000	31,395	3,357,695	2044/8/15	
	US TREASURY N/B	3.0	36,900	49,474	5,291,332	2044/11/15	
	US TREASURY N/B	2.5	39,400	48,671	5,205,396	2045/2/15	
	US TREASURY N/B	3.0	21,900	29,455	3,150,265	2045/5/15	
	US TREASURY N/B	2.875	17,500	23,114	2,472,080	2045/8/15	
	US TREASURY N/B	3.0	3,700	5,000	534,756	2045/11/15	
	US TREASURY N/B	2.5	51,500	63,962	6,840,799	2046/2/15	
	US TREASURY N/B	2.5	28,200	35,056	3,749,252	2046/5/15	
	US TREASURY N/B	2.25	31,500	37,462	4,006,651	2046/8/15	

銘 柄		当 期 末				償 還 年 月 日	
		利 率	額面金額	評 価 金 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 N/B	2.875	14,200	18,935	2,025,196	2046/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	1,700	2,323	248,482	2047/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	11,400	14,929	1,596,714	2047/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	12,197	1,304,525	2047/11/15
		US TREASURY N/B	3.0	9,500	13,033	1,393,978	2048/2/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,100	8,570	916,614	2048/5/15
		US TREASURY N/B	3.0	10,500	14,465	1,547,117	2048/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,400	4,705	503,286	2049/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	100	135	14,509	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,621	387,326	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	1,000	1,239	132,584	2049/11/15
小	計				260,665,884		
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	5,500	5,784	443,899	2022/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	11,750	12,129	930,819	2021/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	12,200	12,389	950,739	2021/8/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	1,000	1,006	77,253	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	300	301	23,133	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	6,700	6,816	523,109	2022/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	300	312	24,007	2023/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,460	4,632	355,495	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,100	1,163	89,260	2023/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	500	537	41,212	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	6,800	7,401	568,019	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	17,000	17,725	1,360,285	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	3,700	4,050	310,863	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	300	320	24,564	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	7,250	11,063	849,029	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	200	207	15,929	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	100	112	8,595	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	10,080	14,776	1,133,962	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	4,200	6,806	522,332	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	3,800	6,234	478,409	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	7,100	10,979	842,534	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,950	15,097	1,158,584	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,804	138,463	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	600	737	56,591	2051/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	100	155	11,953	2064/12/1
小	計				10,939,051		
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	8.0	40	43	5,766	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	470	493	65,506	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	350	375	49,900	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	300	303	40,298	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	400	416	55,307	2022/9/7
		UK TREASURY	0.125	6,000	6,008	798,215	2023/1/31
		UK TREASURY	0.75	14,000	14,327	1,903,359	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	4,800	5,157	685,128	2023/9/7

銘 柄	利 率	額面金額	当 期 末		
			評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額
			償還年月日		
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円
国債証券	UK TREASURY	1.0	1,600	1,660	220,650
	UK TREASURY	2.75	7,450	8,321	1,105,550
	UK TREASURY	5.0	9,950	12,313	1,635,891
	UK TREASURY	0.625	200	205	27,309
	UK TREASURY	2.0	200	221	29,402
	UK TREASURY	1.5	160	174	23,164
	UK TREASURY	1.25	400	433	57,545
	UK TREASURY	4.25	9,630	12,609	1,675,108
	UK TREASURY	1.625	200	225	29,909
	UK TREASURY	6.0	6,900	10,336	1,373,255
	UK TREASURY	4.75	6,000	8,830	1,173,083
	UK TREASURY	4.25	5,550	8,109	1,077,379
	UK TREASURY	4.5	15,700	24,629	3,271,967
	UK TREASURY	4.25	2,600	4,105	545,436
	UK TREASURY	4.75	100	175	23,336
	UK TREASURY	4.25	600	1,012	134,470
	UK TREASURY	4.25	500	861	114,504
	UK TREASURY	1.25	400	455	60,448
	UK TREASURY	4.5	1,200	2,205	293,053
	UK TREASURY	3.5	18,440	30,879	4,102,382
	UK TREASURY	4.25	6,300	12,030	1,598,188
	UK TREASURY	1.5	9,100	11,285	1,499,321
	UK TREASURY	1.75	16,100	21,221	2,819,225
	UK TREASURY	4.25	5,350	10,756	1,429,048
	UK TREASURY	3.75	6,750	13,267	1,762,614
	UK TREASURY	1.625	1,000	1,357	180,350
	UK TREASURY	1.75	1,100	1,585	210,589
	UK TREASURY	2.5	100	185	24,617
	UK TREASURY	3.5	650	1,529	203,176
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	26,900	42,852	5,692,912
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	6,800	15,180	2,016,768
小 計					38,014,149
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	36,050	38,914	424,942
	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	7,900	8,416	91,908
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	32,250	36,826	402,142
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,988	141,833
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	16,800	18,063	197,252
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	14,300	15,446	168,671
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	10,500	16,620	181,491
小 計					1,608,244
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	3.75	23,600	24,511	255,901
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	13,300	14,141	147,633
	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	38,900	43,412	453,225
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	5,087	53,108
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	5,076	53,003
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	9,600	10,592	110,587

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	
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	千円	
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	7,200	8,159	85,187 2028/4/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	17,000	19,210	200,552 2029/9/6
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,700	2,957	30,881 2030/8/19
小 計					1,390,080	
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	3.0	14,400	15,185	236,139 2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	400	408	6,350 2022/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	18,570	19,951	310,239 2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	32,000	35,972	559,377 2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	15,700	16,819	261,540 2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	21,400	23,019	357,960 2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	38,100	71,794	1,116,403 2039/11/15
小 計					2,848,012	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	—	100	101	11,716 2021/10/8
		BUNDESOBLIGATION	—	700	710	82,430 2022/4/8
		BUNDESOBLIGATION	—	750	764	88,653 2022/10/7
		BUNDESOBLIGATION	—	1,000	1,023	118,763 2023/4/14
		BUNDESOBLIGATION	—	2,000	2,069	240,115 2024/10/18
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	350	365	42,427 2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	400	415	48,198 2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	4,000	4,220	489,580 2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	737	85,535 2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	390	415	48,176 2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	9,200	9,847	1,142,298 2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	2,580	2,819	327,068 2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	23,900	30,127	3,494,748 2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	1,700	1,866	216,507 2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	800	874	101,498 2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	8,100	8,730	1,012,691 2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,700	2,867	332,668 2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	9,100	9,962	1,155,681 2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	20,800	22,325	2,589,778 2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	1,046	121,360 2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	700	746	86,564 2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	21,500	32,774	3,801,828 2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,087	126,190 2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	8,200	12,223	1,417,896 2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,400	1,528	177,337 2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,300	10,557	1,224,684 2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	19,500	32,656	3,788,126 2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	6,200	10,283	1,192,843 2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,600	15,068	1,747,911 2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	8,400	14,618	1,695,717 2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	4,500	8,494	985,400 2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,400	10,990	1,274,884 2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,900	3,384	392,582 2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	5,800	9,612	1,115,028 2044/7/4

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日	
					外貨建金額		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	10,200	17,365	2,014,409	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	10,900	15,100	1,751,623	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	2,300	2,327	269,985	2021/12/10
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	4,000	4,057	470,726	2022/3/11
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	12,200	12,608	1,462,609	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	5,100	5,106	592,369	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	8,330	966,363	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	16,500	17,424	2,021,298	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	5,900	6,050	701,852	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,050	1,047	121,514	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	2,600	2,665	309,200	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	18,900	20,398	2,366,257	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	6,200	6,268	727,096	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	400	405	47,047	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	400	401	46,627	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	8,200	9,099	1,055,546	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	3,100	3,155	366,058	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	31,100	34,716	4,027,163	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	1,900	1,866	216,465	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	100	11,659	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,100	1,219	141,404	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	500	560	65,070	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	18,700	23,878	2,769,851	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	14,700	16,600	1,925,682	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	300	309	35,854	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	5,800	6,422	744,991	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	4,700	4,761	552,287	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,000	1,056	122,554	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,745	2,290,522	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	800	805	93,440	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	3,032	351,821	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	7,000	7,420	860,720	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,106	360,319	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,500	13,483	1,564,115	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.1	2,000	2,065	239,540	2026/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	18,100	24,538	2,846,427	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	17,500	23,451	2,720,403	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	5,800	7,169	831,715	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	29,200	37,945	4,401,666	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	16,000	22,398	2,598,214	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	485	56,260	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	10,900	15,345	1,780,022	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,400	1,463	169,805	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,400	20,713	2,402,708	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	8,000	9,182	1,065,158	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	700	863	100,160	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	500	541	62,854	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	5,000	6,994	811,362	2039/8/1

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	
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	3.1	200	220	25,598
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	11,700	16,367	1,898,587
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	8,800	12,191	1,414,216
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	3,500	3,928	455,694
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,800	3,244	376,345
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	7,000	8,644	1,002,738
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	9,000	8,692	1,008,295
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,700	1,722	199,831
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	800	804	93,273
		FRANCE (GOVT OF)	—	6,000	6,063	703,339
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,600	2,642	306,576
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	1,570	1,682	195,222
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	102	11,837
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	9,600	10,691	1,240,160
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,839	213,382
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	11,000	11,534	1,338,039
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,800	1,892	219,573
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	13,300	13,774	1,597,826
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	1,700	1,849	214,572
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,000	2,148	249,245
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	11,600	12,478	1,447,504
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	9,500	11,911	1,381,701
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	10,500	11,953	1,386,576
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	114	13,262
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	100	124	14,389
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	10,600	14,170	1,643,794
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	501	58,149
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	4,100	4,327	501,978
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	8,500	9,098	1,055,457
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	5,100	5,163	598,917
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	17,600	18,842	2,185,680
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	10,900	13,836	1,604,992
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	27,000	31,553	3,660,211
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	3,000	3,309	383,851
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	26,796	3,108,411
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,466	750,114
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	34,100	41,954	4,866,772
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	4,500	5,510	639,241
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	27,000	40,646	4,714,969
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	13,500	15,676	1,818,511
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	20,100	34,124	3,958,408
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	10,300	17,089	1,982,364
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	300	491	56,996
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	8,100	14,557	1,688,727
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	29,700	47,936	5,560,690
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	4,900	9,803	1,137,262
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	4,700	9,887	1,146,907
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	50	52	6,061

銘 柄			当 期 末			
			利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
					外貨建金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,500	1,517	176,000
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	100	106	12,355
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	200	224	25,999
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	200	244	28,373
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	400	431	50,033
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	102	11,886
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	8,700	9,677	1,122,610
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,500	1,567	181,795
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,260	494,252
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,500	2,721	315,674
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	12,300	17,966	2,084,118
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,096	127,182
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	3,400	3,583	415,697
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	7,500	10,093	1,170,865
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	2,200	3,708	430,184
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	500	551	63,942
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	2,400	4,365	506,395
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	5,500	9,467	1,098,195
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	19,400	20,465	2,374,000
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,100	5,161	598,752
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	10,700	10,741	1,246,019
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	14,550	16,065	1,863,577
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	4,350	4,400	510,503
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	3,000	3,042	352,872
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	15,100	17,369	2,014,804
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	4,200	4,251	493,121
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	5,300	6,114	709,275
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	14,600	17,194	1,994,559
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,900	7,910	917,578
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	450	502	58,303
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	959	111,284
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,100	18,551	2,152,029
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	5,000	5,509	639,078
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	4,000	4,378	507,915
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	22,400	29,962	3,475,671
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	3,100	3,293	382,039
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,000	2,123	246,372
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	5,000	5,293	614,046
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	12,704	1,473,748
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	2,000	2,224	258,014
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	6,400	7,450	864,227
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,500	2,444	283,580
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	5,700	9,185	1,065,533
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,100	15,929	1,847,859
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	3,200	4,150	481,400
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	8,800	11,092	1,286,691
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,700	2,613	303,189
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	16,000	23,177	2,688,615

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	
スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	5.75	31,400	48,962	5,679,594	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	500	729	84,580	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	700	746	86,575	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	800	869	100,890	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	600	669	77,645	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	9,700	10,555	1,224,395	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	2,900	2,970	344,574	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	4,000	4,506	522,742	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	1,000	1,041	120,792	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	3,000	3,179	368,875	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	6,000	7,708	894,211	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	3,300	3,557	412,715	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,140	248,345	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,074	124,685	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	3,000	3,256	377,744	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,500	1,649	191,389	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	5,083	589,721	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	100	113	13,145	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	581	67,412	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	100	124	14,407	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	3,400	5,829	676,242	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	4,400	7,552	876,048	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	5,200	6,347	736,339	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	4,000	5,013	581,615	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,750	203,070	2057/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,000	1,491	173,008	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,500	16,653	1,931,810	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	18,438	2,138,914	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	700	739	85,748	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,200	3,469	402,455	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	100	101	11,781	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	200	220	25,601	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	900	916	106,341	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	150	162	18,827	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	1,300	1,328	154,087	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	700	768	89,136	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,417	164,393	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,076	820,834	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,144	248,784	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	7,600	11,179	1,296,842	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	7,600	8,041	932,820	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	4,800	6,345	736,085	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	400	667	77,425	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	3,200	5,385	624,718	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	7,100	9,215	1,068,950	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,195	254,627	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	450	1,019	118,245	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	800	1,525	176,951	2117/9/20

銘 柄			当 期 末				償還年月日	
			利 率	額面金額	評 価 金額	外貨建金額		
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	—	500	506	58,717	2022/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	100	105	12,222	2022/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	100	106	12,328	2023/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	—	400	408	47,335	2023/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	700	771	89,441	2024/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	3,600	4,441	515,172	2025/7/4	
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	100	107	12,428	2025/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,109	244,654	2026/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,300	4,107	476,514	2028/7/4	
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,400	2,543	295,010	2029/9/15	
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	800	873	101,284	2031/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	200	229	26,585	2034/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	2,000	1,996	231,610	2036/4/15	
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	400	608	70,619	2042/7/4	
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	300	385	44,667	2047/4/15	
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.4	2,430	3,094	358,960	2025/3/13	
		IRISH GOVERNMENT	0.9	4,000	4,275	495,938	2028/5/15	
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	1,200	1,227	142,432	2022/3/15	
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	4,600	4,911	569,701	2026/5/15	
		IRISH TSY 1.10% 2029	1.1	600	652	75,725	2029/5/15	
		IRISH TSY 1.3% 2033	1.3	2,400	2,679	310,765	2033/5/15	
		IRISH TSY 1.35% 2031	1.35	2,000	2,234	259,179	2031/3/18	
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	1,500	1,744	202,322	2050/5/15	
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	700	827	95,947	2037/5/15	
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	3,100	3,989	462,749	2045/2/18	
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	3,700	4,511	523,355	2030/5/15	
		IRISH TSY 2022	—	4,800	4,848	562,443	2022/10/18	
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,100	6,978	809,521	2024/3/18	
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	4,450	4,998	579,771	2023/3/20	
小 計						216,517,762		
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ			
国債証券		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	46,300	47,004	1,198,613	2021/7/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	4,800	5,118	130,530	2024/4/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	28,500	31,673	807,666	2025/7/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	25,000	26,833	684,263	2026/7/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,000	2,150	54,834	2027/7/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	15,000	16,613	423,641	2029/10/25	
小 計						3,299,550		
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	2.25	480	489	37,055	2021/6/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	2,400	2,429	183,859	2021/10/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	2,300	2,358	178,461	2022/4/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	2,400	2,548	192,867	2022/9/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	300	310	23,500	2023/2/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,600	3,853	291,617	2023/7/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	700	738	55,898	2024/2/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	1,900	2,098	158,826	2024/9/1	
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,197	90,603	2025/6/1	

銘 柄	利 率	額面金額	当 期 末				
			評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	761	57,630	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,617	349,413	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	500	571	43,226	2028/5/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	300	352	26,658	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,851	215,750	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	1,200	1,541	116,634	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,100	2,429	183,855	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,050	2,646	200,264	2042/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,000	1,327	100,414	2046/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	1,000	1,163	88,024	2050/3/1
小	計				2,594,561		
マレーシア			千リンギ	千リンギ			
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	1,100	1,132	27,950	2022/3/10
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	426	10,523	2024/9/30
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	2,600	3,017	74,466	2033/11/7
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	400	471	11,630	2037/4/7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	400	409	10,103	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	6,200	6,358	156,931	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.62	500	510	12,607	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,718	116,454	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.795	500	517	12,776	2022/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	13,500	13,943	344,117	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.757	3,500	3,641	89,883	2023/4/20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.8	2,200	2,298	56,736	2023/8/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	6,195	152,912	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	643	15,890	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	9,600	10,527	259,820	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	4,600	4,952	122,218	2027/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	7,000	7,372	181,941	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	2,200	2,344	57,858	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	3,176	78,407	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.885	280	304	7,518	2029/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	5,700	6,443	159,030	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,909	121,170	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	400	442	10,917	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	800	859	21,217	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	900	996	24,597	2035/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.893	2,800	3,359	82,917	2038/6/8
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	9,700	11,672	288,069	2043/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.736	1,100	1,298	32,051	2046/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.921	300	366	9,050	2048/7/6
小	計				2,549,773		
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	5,700	6,016	420,445	2021/5/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	7,500	7,713	539,025	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	3,040	3,403	237,863	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	80	84	5,871	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	5,400	6,234	435,664	2023/4/21

銘 柄	利 率	額面金額	当 期 末		
			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	2.75	7,200	7,887	551,210
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	15,200	17,334	1,211,323
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	15,591	1,089,510
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	12,100	15,509	1,083,828
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	3,200	3,686	257,617
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	17,800	19,847	1,386,908
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	2,100	2,440	170,530
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	12,214	853,526
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	13,300	15,547	1,086,473
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	2,000	2,307	161,257
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	7,700	10,912	762,581
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	2,169	151,619
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	4,000	5,411	378,163
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	700	890	62,255
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,300	1,561	109,139
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	5,300	6,692	467,658
小計				11,422,475	
イスラエル			千新シェケル	千新シェケル	
国債証券	ISRAEL FIXED BOND	5.5	4,500	4,919	149,764
	ISRAEL FIXED BOND	0.75	5,000	5,063	154,147
	ISRAEL FIXED BOND	1.25	5,000	5,133	156,268
	ISRAEL FIXED BOND	4.25	5,000	5,575	169,722
	ISRAEL FIXED BOND	1.5	5,000	5,210	158,593
	ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	5,655	172,166
	ISRAEL FIXED BOND	1.75	5,000	5,325	162,096
	ISRAEL FIXED BOND	6.25	5,000	6,786	206,581
	ISRAEL FIXED BOND	2.0	5,000	5,450	165,913
	ISRAEL FIXED BOND	2.25	5,000	5,594	170,308
	ISRAEL FIXED BOND	1.0	2,000	2,024	61,624
	ISRAEL FIXED BOND	5.5	5,000	8,590	261,484
	ISRAEL FIXED BOND	3.75	5,000	7,071	215,254
小計				2,203,927	
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	95,300	96,711	438,100
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	84,700	87,557	396,636
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	44,400	45,707	207,055
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.75	300	314	1,424
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	53,300	59,344	268,831
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	40,000	47,979	217,345
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	51,300	52,417	237,450
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	112,300	124,897	565,787
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	45,300	53,420	241,994
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	68,500	77,140	349,446
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,306	51,216
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	56,300	75,177	340,556
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	11,800	13,819	62,602
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	66,500	72,305	327,543
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	43,000	48,040	217,625
小計				2,203,927	

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	
メキシコ	%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	87,100	95,449	432,385
小 計					2023/12/7
合 計				4,356,003	
				558,409,476	

\* 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。

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2020年5月11日現在)

区 分	当 期 末	
	数 量	
貸付有価証券＜債券＞券面総額		米ドル 1,154,028,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額		ユーロ 16,600,000
貸付有価証券＜債券＞券面総額		豪ドル 27,100,000

## ○投資信託財産の構成

(2020年5月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 558,409,476	% 76.7
コール・ローン等、その他	169,403,992	23.3
投資信託財産総額	727,813,468	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（564,686,472千円）の投資信託財産総額（727,813,468千円）に対する比率は77.6%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=106.95円、1カナダドル=76.74円、1英ポンド=132.85円、1スウェーデンクローナ=10.92円、1ノルウェークローネ=10.44円、1デンマーククローネ=15.55円、1ユーロ=116.00円、1ズロチ=25.50円、1シンガポールドル=75.67円、1リング=24.68円、1豪ドル=69.88円、1新シェケル=30.44円、1メキシコペソ=4.53円、1ランド=5.83円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月11日現在)

項目	当期末
(A) 資産	
コール・ローン等	729,549,346,520
公社債(評価額)	7,952,791,636
未収入金	558,409,476,994
未収利息	2,587,032,330
前払費用	4,594,710,138
その他未収収益	459,504,024
受入担保代用有価証券	15,452,860
(B) 負債	164,886,261,127
未払金	1,744,348,986
未払解約金	7,600,292,063
未払利息	5,485
受入担保金	155,530,378,538
その他未払費用	11,236,055
(C) 純資産額(A-B)	564,663,085,393
元本	239,006,740,496
次期繰越損益金	325,656,344,897
(D) 受益権総口数	239,006,740,496口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,625円

(注) 期首元本額は268,084,419,000円、期中追加設定元本額は33,092,232,394円、期中一部解約元本額は62,169,910,898円、1口当たり純資産額は2,3625円です。

(注) 2020年5月11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

155,530,378,537円

## ○損益の状況 (2019年5月11日～2020年5月11日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	16,507,705,850
受取利息	16,444,664,276
その他収益金	64,333,611
支払利息	△ 1,292,037
(B) 有価証券売買損益	10,989,677,354
売買益	42,322,261,855
売買損	△ 31,332,584,501
(C) 保管費用等	△ 82,371,970
(D) 当期損益金(A+B+C)	27,415,011,234
(E) 前期繰越損益金	337,743,397,144
(F) 追加信託差損益金	44,217,348,963
(G) 解約差損益金	△ 83,719,412,444
(H) 計(D+E+F+G)	325,656,344,897
次期繰越損益金(H)	325,656,344,897

\*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)	102,686,407,275
野村世界6資産分散投信(分配コース)	23,127,565,619
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	16,118,719,507
のむラップ・ファンド(普通型)	11,330,020,953
マイ・ロード	8,732,790,392
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)	7,313,848,903
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	6,268,102,023
野村DC外国債券インデックスファンド	6,012,148,045
のむラップ・ファンド(保守型)	5,649,317,080
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,530,137,578
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,969,011,331
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,871,221,089
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,527,503,854
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,337,502,044
野村DC運用戦略ファンド	2,944,954,434
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	2,423,390,560
のむラップ・ファンド(積極型)	2,267,517,840

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・外国債券(適格機関投資家専用)	1,988,901,353
マイバランスDC30	1,727,999,247
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)	1,655,570,027
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)外国債券	1,602,137,819
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)	1,521,677,602
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,404,525,492
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)	1,364,895,324
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)	1,215,579,071
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,189,269,436
マイバランスDC50	1,104,260,061
野村インデックスファンド・外国債券	822,665,833
野村6資産均等バランス	780,497,633
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	753,468,107
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)	695,976,449
マイバランスDC70	677,624,248
野村外国債券バッジファンド(確定拠出年金向け)	575,181,053
のむラップ・ファンド(やや保守型)	474,917,230

ファンド名	当期末
	元本額
のむラップ・ファンド（やや積極型）	円 327,819,456
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）	325,036,964
野村外国債券インデックスファンド	302,722,100
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	301,710,390
ネクストコア	199,230,377
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	194,349,584
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）	177,170,939
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）	165,087,446
野村インデックスファンド・海外5資産・バランス	139,895,334
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	134,621,908
野村世界・バランス25VA（適格機関投資家専用）	102,337,977
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	92,201,365
バランスセレクト50	81,769,911
バランスセレクト30	81,630,740
世界6資産分散ファンド	78,161,936
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）	77,383,072
バランスセレクト70	67,707,889
野村資産設計ファンド2040	54,106,972
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	50,849,809
野村資産設計ファンド2025	44,722,632
野村資産設計ファンド2030	42,849,078
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	32,048,381
野村資産設計ファンド2035	29,290,609
野村資産設計ファンド2020	29,279,193
野村資産設計ファンド2015	26,005,469
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	22,257,309
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	16,010,887
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）	15,998,722

ファンド名	当期末
	元本額
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	円 15,478,601
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	13,197,003
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）	9,135,215
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	8,810,074
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）	8,546,080
野村資産設計ファンド2050	8,422,485
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	7,877,418
野村資産設計ファンド2045	6,720,865
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	6,048,480
野村ターゲットデートファンド2016～2026-2028年目標型	5,628,330
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	5,256,339
インデックス・ブレンド（タイプIII）	5,095,015
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	3,445,395
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,357,237
インデックス・ブレンド（タイプV）	3,145,615
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）	2,729,205
野村資産設計ファンド2060	2,366,982
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	2,161,268
野村ターゲットデートファンド2016～2029-2031年目標型	2,048,108
インデックス・ブレンド（タイプI）	2,026,660
野村ターゲットデートファンド2016～2032-2034年目標型	1,471,130
インデックス・ブレンド（タイプIV）	1,352,642
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	1,317,745
インデックス・ブレンド（タイプII）	1,276,241
野村ターゲットデートファンド2016～2035-2037年目標型	1,028,642
野村OFS用・ターゲット・リターン・・バランス・バランス（%コース向け）（適格機関投資家専用）	525,844
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	455,561
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）	255,355

## ○お知らせ

有価証券の貸付に係る事務処理費用を信託財産中から支弁することを明確化するための所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2019年7月31日＞