

# 運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2021年2月25日>

## DIAM DC バランスインデックスファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/内外/資産複合 (インデックス型)
信託期間	2006年12月27日から無期限です。
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の長期的な成長を図ることを目標として安定的な運用を行います。
主要投資対象	<p>ベビーファンド* 以下の各マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。</p> <p>国内株式パッシブ・ファンド (最適化法)・マザーファンド 東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。</p> <p>国内債券パッシブ・ファンド・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。</p> <p>外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド 海外の株式を主要投資対象とします。</p> <p>外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 海外の公社債を主要投資対象とします。</p>
運用方法	<p>マザーファンドへの投資を通じて国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います。</p> <p>基本アロケーションのもと、委託会社が独自に指数化する合成インデックスに概ね連動する投資成果をめざして運用します。</p> <p>各資産につき、基本アロケーションにおける各資産毎の比率から一定の範囲内で配分比率の変動を抑えます。実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。</p>
組入制限	<p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額のDIAM DC バランス30インデックスファンド：40%以下、DIAM DC バランス50インデックスファンド：60%以下、DIAM DC バランス70インデックスファンド：80%以下、とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額のDIAM DC バランス30インデックスファンド：35%以下、DIAM DC バランス50インデックスファンド：45%以下、DIAM DC バランス70インデックスファンド：50%以下、とします。</p>
分配方針	<p>決算日 (原則として2月25日。休業日の場合は翌営業日。) に、経費控除後の利子、配当収入および売買益 (評価益を含みます。) 等から基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。</p>

\*ベビーファンドとは、DIAM DC バランス30インデックスファンド、DIAM DC バランス50インデックスファンド、DIAM DC バランス70インデックスファンドです。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

DIAM DC バランス30インデックスファンド

DIAM DC バランス50インデックスファンド

DIAM DC バランス70インデックスファンド

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM DC バランスインデックスファンド」は、2021年2月25日に第14期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

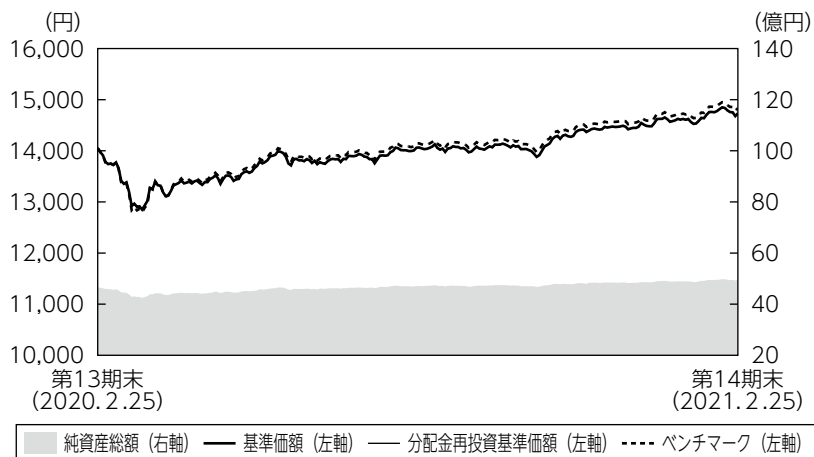
アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

## ■当期の運用経過（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

### DIAMDC バランス30インデックスファンド 基準価額等の推移



第14期首： 14,053円  
 第14期末： 14,732円  
 （既払分配金0円）  
 騰落率： 4.8%  
 （分配金再投資ベース）

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

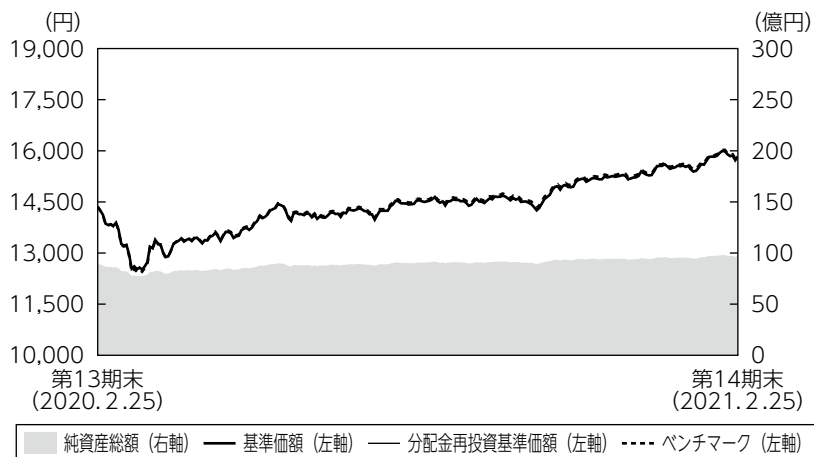
### 基準価額の主な変動要因

期初は新型コロナウイルスの影響長期化やそれに伴う景気減速などが懸念されましたが、その後の世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、期末にかけてのワクチン開発や接種の進展等から景気回復への期待を好感した内外の株式市場は上昇しました。また、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	22.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.2%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.8%

## DIAMDC バランス50インデックスファンド 基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

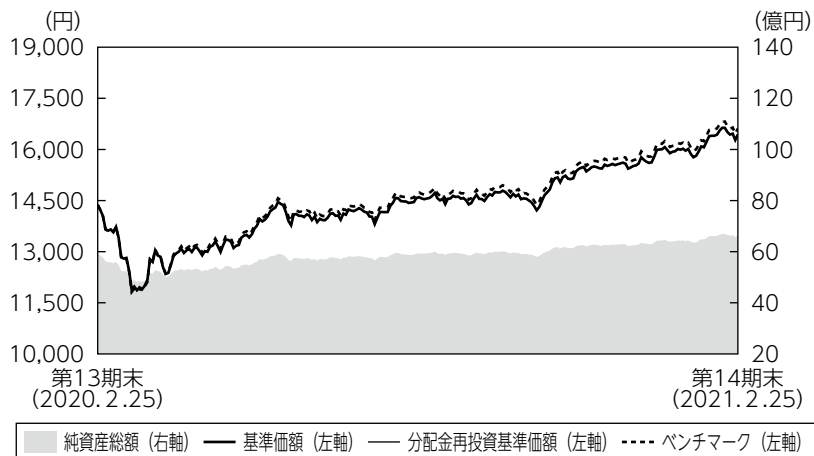
### 基準価額の主な変動要因

期初は新型コロナウイルスの影響長期化やそれに伴う景気減速などが懸念されましたが、その後の世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、期末にかけてのワクチン開発や接種の進展等から景気回復への期待を好感した内外の株式市場は上昇しました。また、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	22.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.2%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.8%

## DIAMDC バランス70インデックスファンド 基準価額等の推移



第14期首： 14,374円  
 第14期末： 16,441円  
 (既払分配金0円)  
 騰落率： 14.4%  
 (分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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はありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク（委託会社が独自に指数化した合成インデックス）は、期首の基準価額に合わせて指数化していません。

### 基準価額の主な変動要因

期初は新型コロナウイルスの影響長期化やそれに伴う景気減速などが懸念されましたが、その後の世界的な大規模金融緩和や財政出動の動き、期末にかけてのワクチン開発や接種の進展等から景気回復への期待を好感した内外の株式市場は上昇しました。また、欧米での金融緩和長期化観測等を受けた海外債券市場が上昇したことなどがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

### ◆組入ファンドの当作成期間の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	22.0%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	△2.5%
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	17.2%
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1.8%

## 投資環境

国内株式市場は、期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続やワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

国内債券市場は下落しました。期初は新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり、利回りは低下（価格は上昇）したものの、2020年3月にリスク性資産の価格が反発したことを受けて利回りは上昇（価格は下落）しました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月から期末にかけては国内株式市場が堅調に推移したことや米長期金利が上昇したことを受けて利回りは上昇しました。

外国株式市場は上昇しました。米国株式市場は期初から新型コロナウイルスの世界的な感染拡大により急落しましたが、2020年3月下旬以降は米景気対策法案への期待などから反発しました。その後も欧米における感染拡大から調整する場面もありましたが、ワクチン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感などを受け堅調に推移しました。欧州株式市場は急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

外国債券市場では、米国債の利回りは低下しました。一方、ドイツ債の利回りは上昇しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R B（米連邦準備理事会）による緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチンへの期待を受けて利回りが上昇傾向となりました。ドイツ債についてはワクチンへの期待を受けて利回りは上昇しました。

為替市場では、主要通貨に対してまちまちな動きとなりました。米ドル／円相場は、期初は新型コロナウイルスの感染拡大を受けたリスク回避の動きや世界的なドル需要の高まりが交錯し相場が振れた後、米中対立への警戒や金融緩和の長期化観測、先々の景気不透明感等から円高米ドル安の動きとなりました。ユーロ／円相場については欧州復興基金設立への期待等により2020年5月以降は円安ユーロ高の動きとなりました。英ポンドやその他主要通貨に対しては前期末比で円安となりました。

## ポートフォリオについて

各ファンドでは、以下の基本アロケーションによる合成インデックスに概ね連動した投資成果をめざし、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行いました。

### <基本アロケーション>

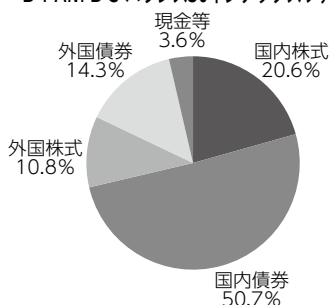
DIAM DC バランス30インデックスファンド：国内株式20%、国内債券52%、外国株式10%、外国債券15%、短期金融資産3%

DIAM DC バランス50インデックスファンド：国内株式35%、国内債券30%、外国株式15%、外国債券17%、短期金融資産3%

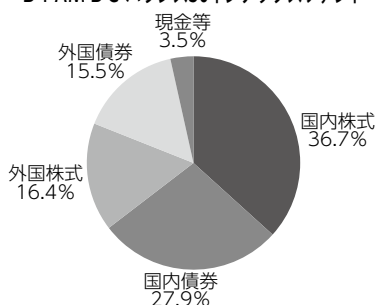
DIAM DC バランス70インデックスファンド：国内株式50%、国内債券7%、外国株式20%、外国債券20%、短期金融資産3%

## 決算日（2021年2月25日）現在の組入比率

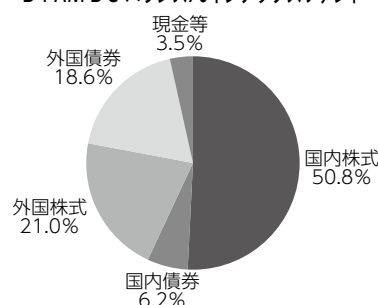
DIAM DC バランス30インデックスファンド



DIAM DC バランス50インデックスファンド



DIAM DC バランス70インデックスファンド



(注1) 各資産の組入比率は、先物を含んだ実質組入比率です。

(注2) 株式には、不動産投信（リート）および新株予約権証券を含む場合があります。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）（配当込み）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMUR A-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

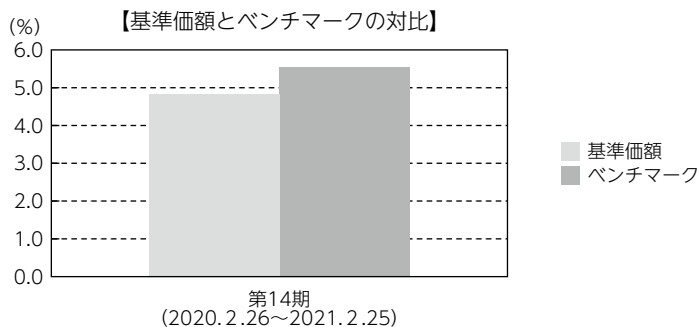
### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

## DIAMDC バランス30インデックスファンド ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で5.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.7%と、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年2月26日 ～2021年2月25日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	5,153円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

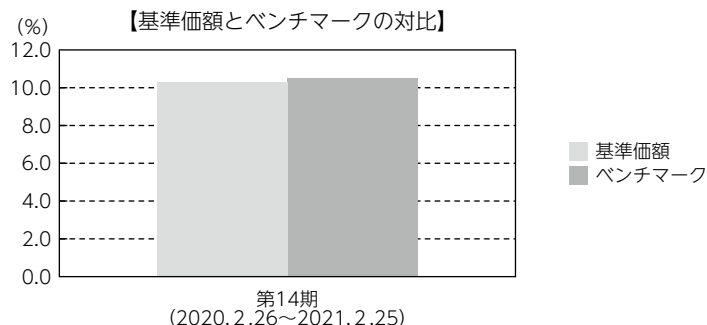
(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## DIAMDC バランス50インデックスファンド ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で10.5%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%と、ベンチマークに概ね連動したパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ■分配原資の内訳(1万口当たり)

項目	当期
	2020年2月26日 ～2021年2月25日
当期分配金(税引前)	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	6,861円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金(税引前)」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

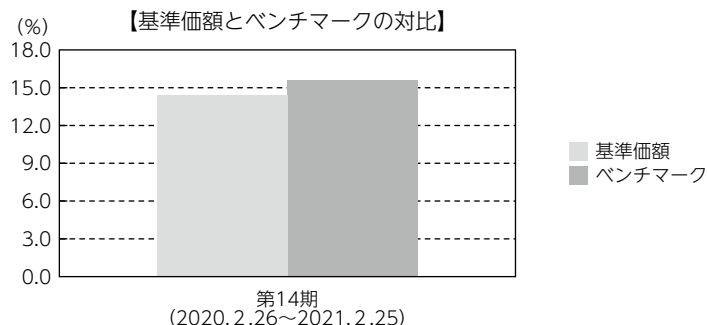
(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益(含、評価益)」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。



## DIAMDC バランス70インデックスファンド ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で15.6%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△1.2%のパフォーマンスとなりました。なお、差異の要因としては、組入れているマザーファンドと当該資産のベンチマークの為替の採用基準が異なることや、信託報酬、時価変動により各マザーファンドへの投資比率と基本アロケーションの間に乖離が生じることなどが挙げられます。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

## 分配金

当期の収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ■分配原資の内訳(1万口当たり)

項目	当期
	2020年2月26日 ~2021年2月25日
当期分配金(税引前)	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	8,159円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金(税引前)」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金(税引前)」の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益(含、評価益)」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

## 今後の運用方針

各ファンドでは、合成インデックスに概ね連動した投資成果が得られるよう、各マザーファンドへの投資比率が基本アロケーションから大きく乖離しないよう運用を行います。

### ●国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

### ●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

### ●外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークに連動したファンドパフォーマンスをめざします。

### ●外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

引き続き、ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

## ■分配金のお知らせ

各ファンドの収益分配金につきましては基準価額水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

\* 合成インデックスについて

- (注1) 合成インデックスとは、国内株式については東証株価指数（TOPIX）（配当込み）、国内債券についてはNOMURA-BPI総合、外国株式についてはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）、外国債券についてはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）、短期金融資産についてはコール・ローンのオーバーナイト物レートを、各ファンドにおける基本アロケーションに基づいて委託会社が独自に合成したものです。基本アロケーションについては、前掲の「ポートフォリオについて」をご参照ください。
- (注2) 運用環境見直し等の大きな変更が信託財産の中長期的な成長に影響をおよぼす可能性が高いと判断した場合には、基本アロケーションの若干の見直しを行う場合があります。
- (注3) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈱東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行また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。
- (注4) NOMURA-BPI総合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ます。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- (注5) MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- (注6) FTSE世界国債インデックスは、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。

# DIAMDC バランス30インデックスファンド

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
	(分配)落	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率						
10期(2017年2月27日)	円 12,846	円 0	% 5.3	ポイント 13,486.34	% 5.9	% 30.8	% 0.6	% 65.0	% -	% -	百万円 4,191
11期(2018年2月26日)	13,537	0	5.4	14,251.52	5.7	28.8	0.6	66.8	-	-	4,448
12期(2019年2月25日)	13,547	0	0.1	14,326.21	0.5	29.1	0.7	66.2	-	-	4,498
13期(2020年2月25日)	14,053	0	3.7	14,913.60	4.1	28.1	0.7	67.0	-	-	4,666
14期(2021年2月25日)	14,732	0	4.8	15,739.37	5.5	30.7	0.5	65.0	-	-	4,946

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首) 2020年2月25日	円 14,053	% -	ポイント 14,913.60	% -	% 28.1	% 0.7	% 67.0	% -	% -
2月末	13,780	△1.9	14,611.47	△2.0	27.1	0.5	69.1	-	-
3月末	13,317	△5.2	14,152.03	△5.1	27.0	0.8	70.0	-	-
4月末	13,520	△3.8	14,400.77	△3.4	27.9	0.9	67.1	-	-
5月末	13,753	△2.1	14,657.94	△1.7	28.2	0.8	65.9	-	-
6月末	13,777	△2.0	14,696.88	△1.5	29.2	0.7	66.5	-	-
7月末	13,755	△2.1	14,668.30	△1.6	28.5	0.6	67.3	-	-
8月末	14,039	△0.1	14,983.93	0.5	29.1	1.3	66.4	-	-
9月末	14,046	△0.0	15,001.16	0.6	29.0	0.9	66.3	-	-
10月末	13,881	△1.2	14,829.84	△0.6	28.4	0.7	67.0	-	-
11月末	14,368	2.2	15,352.61	2.9	30.0	1.0	65.8	-	-
12月末	14,513	3.3	15,509.63	4.0	29.9	0.8	65.5	-	-
2021年1月末	14,527	3.4	15,533.83	4.2	29.7	0.7	65.8	-	-
(期末) 2021年2月25日	14,732	4.8	15,739.37	5.5	30.7	0.5	65.0	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2020年2月26日 ～2021年2月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	37円	0.264%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は13,985円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(14)	(0.099)	
(販売会社)	(18)	(0.132)	
(受託会社)	( 5)	(0.033)	
(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(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)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.008	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 0)	(0.002)	
(監査費用)	( 1)	(0.004)	
(その他)	( 0)	(0.003)	
合計	38	0.274	

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

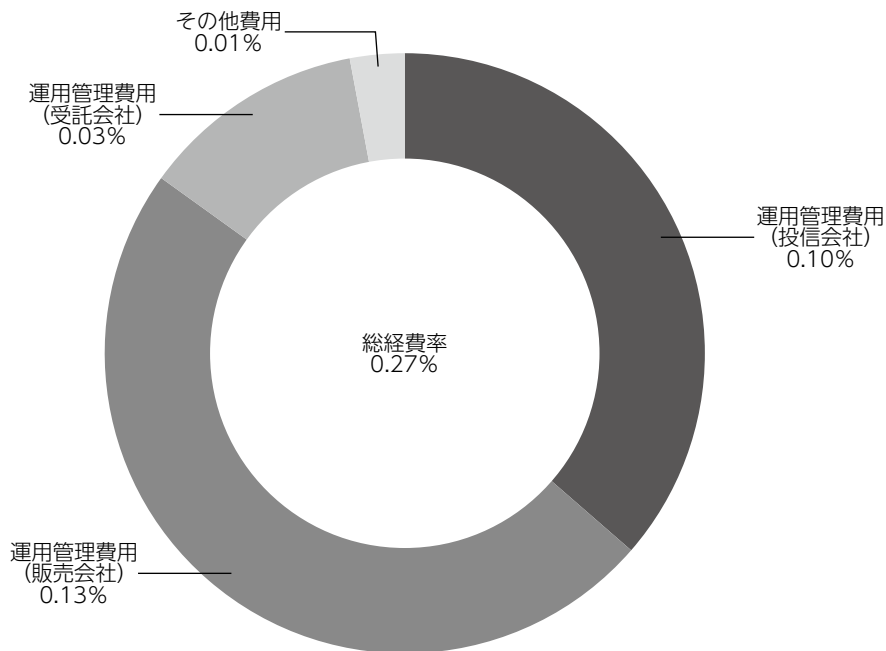
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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0.27%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	27,526	64,709	48,717	136,640
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	168,442	220,161	61,118	80,581
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	12,934	44,098	16,461	67,721
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	5,430	10,769	11,941	22,976

## ■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	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	241,194,773千円	160,220,787千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	237,278,032千円	346,644,284千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.01	0.46

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

### 【D I A M D C バランス30インデックスファンドにおける利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 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)	32千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.787千円
(B)／(A)	2.4%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

## 【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 128,643	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,551	百万円 7,508	% 6.7

平均保有割合 0.4%

(注) 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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,047	百万円 867	百万円 2,640

### (3) 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	当 期	
	買 付 額	期 額
株 式		百万円 250

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 200,722	百万円 4,470	% 2.2	百万円 143,863	百万円 12,195	% 8.5

平均保有割合 1.0%

(注) 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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

## 【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。



## ■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	348,768	327,576	1,023,610
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,841,604	1,948,928	2,523,667
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	115,910	112,383	532,282
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	367,533	361,021	717,963

## ■投資信託財産の構成

2021年2月25日現在

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	1,023,610	20.6
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,523,667	50.9
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	532,282	10.7
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	717,963	14.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	164,019	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	4,961,544	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年2月25日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは479,786,969千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは136,700,219千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.06円、1カナダ・ドル=84.73円、1オーストラリア・ドル=84.47円、1香港・ドル=13.68円、1シンガポール・ドル=80.42円、1ニュージーランド・ドル=78.80円、1イギリス・ポンド=150.05円、1イスラエル・シケル=32.50円、1スイス・フラン=116.93円、1デンマーク・クローネ=17.34円、1ノルウェー・クローネ=12.65円、1スウェーデン・クローナ=12.80円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1ポーランド・ズロチ=28.61円、1ユーロ=128.95円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,961,544,301円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	163,962,683
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	1,023,610,953
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,523,667,389
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	532,282,312
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	717,963,964
未 収 入 金	57,000
(B) 負 債	15,483,170
未 払 解 約 金	9,013,021
未 払 信 託 報 酬	6,375,415
そ の 他 未 払 費 用	94,734
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,946,061,131
元 本	3,357,314,515
次 期 繰 越 損 益 金	1,588,746,616
(D) 受 益 権 総 口 数	3,357,314,515口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	14,732円

(注) 期首における元本額は3,320,362,231円、当期中における追加設定元本額は453,091,880円、同解約元本額は416,139,596円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年2月26日 至2021年2月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△54,858円
受 取 利 息	4,198
支 払 利 息	△59,056
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	241,154,535
売 買 益	311,065,030
売 買 損	△69,910,495
(C) 信 託 報 酬 等	△12,514,923
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	228,584,754
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	835,648,445
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	524,513,417
(配 当 等 相 当 額)	(665,669,432)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△141,156,015)
(G) 合 計(D+E+F)	1,588,746,616
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,588,746,616
追 加 信 託 差 損 益 金	524,513,417
(配 当 等 相 当 額)	(665,995,398)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△141,481,981)
分 配 準 備 積 立 金	1,064,233,199

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	59,336,291円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	169,248,463
(c) 収 益 調 整 金	665,995,398
(d) 分 配 準 備 積 立 金	835,648,445
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,730,228,597
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	5,153.61
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

# DIAMDC バランス50インデックスファンド

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率						
10期(2017年2月27日)	円 12,776	円 0	% 9.4	ポイント 13,622.52	% 10.1	% 50.9	% 1.0	% 44.4	% -	% -	百万円 7,834
11期(2018年2月26日)	13,878	0	8.6	14,847.06	9.0	49.0	1.1	46.2	-	-	8,547
12期(2019年2月25日)	13,729	0	△1.1	14,771.42	△0.5	47.7	1.2	47.1	-	-	8,531
13期(2020年2月25日)	14,358	0	4.6	15,516.30	5.0	47.4	1.3	47.2	-	-	8,938
14期(2021年2月25日)	15,834	0	10.3	17,149.41	10.5	52.0	0.7	43.4	-	-	9,692

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率						
(期首) 2020年2月25日	円 14,358	% -	ポイント 15,516.30	% -	% 47.4	% 1.3	% 47.2	% -	% -
2月末	13,866	△3.4	14,969.46	△3.5	46.2	0.8	49.2	-	-
3月末	13,251	△7.7	14,321.63	△7.7	48.1	1.5	48.4	-	-
4月末	13,596	△5.3	14,721.56	△5.1	48.4	1.5	45.9	-	-
5月末	14,023	△2.3	15,185.41	△2.1	47.8	1.3	44.9	-	-
6月末	14,074	△2.0	15,257.73	△1.7	49.5	1.2	45.6	-	-
7月末	13,979	△2.6	15,150.38	△2.4	48.9	1.0	46.4	-	-
8月末	14,516	1.1	15,736.90	1.4	49.6	2.1	45.0	-	-
9月末	14,510	1.1	15,746.85	1.5	49.4	1.6	45.2	-	-
10月末	14,254	△0.7	15,479.83	△0.2	48.8	1.2	46.0	-	-
11月末	15,092	5.1	16,371.54	5.5	51.0	1.6	44.3	-	-
12月末	15,342	6.9	16,637.85	7.2	51.1	1.4	43.8	-	-
2021年1月末	15,389	7.2	16,697.46	7.6	51.1	1.2	43.9	-	-
(期末) 2021年2月25日	15,834	10.3	17,149.41	10.5	52.0	0.7	43.4	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2020年2月26日 ～2021年2月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	43円	0.297%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,417円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(17)	(0.115)	
(販売会社)	(21)	(0.148)	
(受託会社)	( 5)	(0.033)	
(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(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)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.010	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 0)	(0.002)	
(監査費用)	( 1)	(0.004)	
(その他)	( 1)	(0.004)	
合計	45	0.310	

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

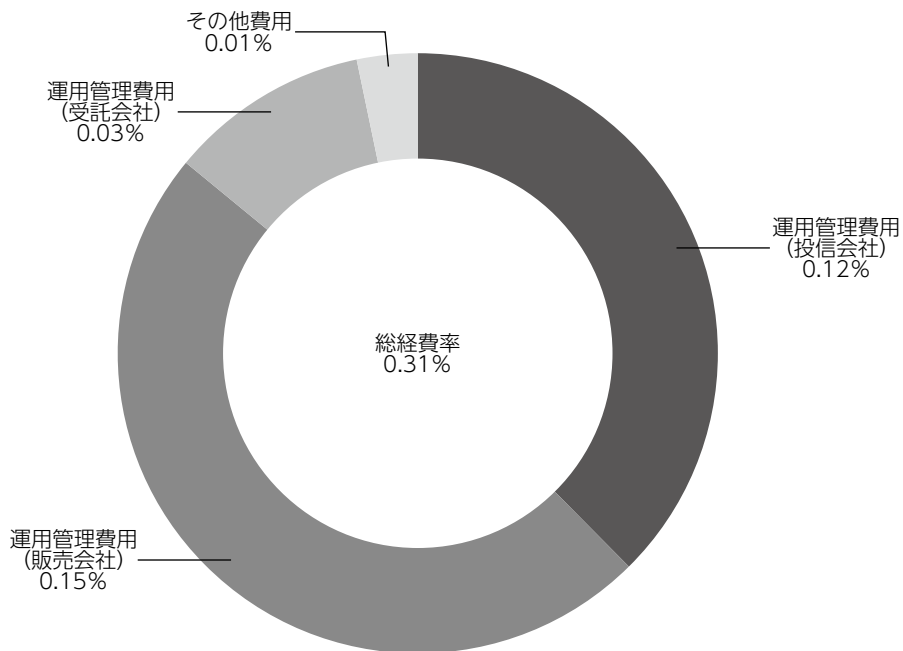
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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0.31%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	88,161	183,888	128,335	361,558
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	211,411	276,249	157,444	207,730
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	29,230	91,208	30,487	128,254
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	—	—	30,226	57,761

## ■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	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	241,194,773千円	160,220,787千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	237,278,032千円	346,644,284千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.01	0.46

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

### 【D I A M D C バランス50インデックスファンドにおける利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 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)	103千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2千円
(B)／(A)	2.6%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

## 【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 128,643	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,551	百万円 7,508	% 6.7

平均保有割合 1.3%

(注) 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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,047	百万円 867	百万円 2,640

### (3) 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	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 250

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 200,722	百万円 4,470	% 2.2	百万円 143,863	百万円 12,195	% 8.5

平均保有割合 1.1%

(注) 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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

## 【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	1,181,694	1,141,519	3,567,021
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,047,028	2,100,996	2,720,580
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	337,771	336,515	1,593,837
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	797,283	767,057	1,525,447

## ■投資信託財産の構成

2021年2月25日現在

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド	3,567,021	36.7
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	2,720,580	28.0
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,593,837	16.4
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	1,525,447	15.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	321,278	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	9,728,165	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年2月25日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは479,786,969千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは136,700,219千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.06円、1カナダ・ドル=84.73円、1オーストラリア・ドル=84.47円、1香港・ドル=13.68円、1シンガポール・ドル=80.42円、1ニュージーランド・ドル=78.80円、1イギリス・ポンド=150.05円、1イスラエル・シケル=32.50円、1スイス・フラン=116.93円、1デンマーク・クローネ=17.34円、1ノルウェー・クローネ=12.65円、1スウェーデン・クローナ=12.80円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1ポーランド・ズロチ=28.61円、1ユーロ=128.95円です。



## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	9,728,165,617円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	314,241,762
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	3,567,021,174
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	2,720,580,041
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,593,837,893
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,525,447,747
未 収 入 金	7,037,000
(B) 負 債	35,688,162
未 払 解 約 金	21,589,685
未 払 信 託 報 酬	13,914,614
そ の 他 未 払 費 用	183,863
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	9,692,477,455
元 本	6,121,173,640
次 期 繰 越 損 益 金	3,571,303,815
(D) 受 益 権 総 口 数	6,121,173,640口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	15,834円

(注) 期首における元本額は6,225,383,146円、当期中における追加設定元本額は460,563,926円、同解約元本額は564,773,432円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年2月26日 至2021年2月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△103,491円
受 取 利 息	6,319
支 払 利 息	△109,810
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	927,782,290
売 買 益	1,024,240,746
売 買 損	△96,458,456
(C) 信 託 報 酬 等	△26,936,294
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	900,742,505
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,141,364,166
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	529,197,144
(配 当 等 相 当 額)	(1,157,352,732)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△628,155,588)
(G) 合 計(D+E+F)	3,571,303,815
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,571,303,815
追 加 信 託 差 損 益 金	529,197,144
(配 当 等 相 当 額)	(1,157,894,134)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△628,696,990)
分 配 準 備 積 立 金	3,042,106,671

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	141,471,400円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	759,271,105
(c) 収 益 調 整 金	1,157,894,134
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,141,364,166
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	4,200,000,805
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	6,861.43
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

# DIAMDC バランス70インデックスファンド

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	純資産額
	(分配)円	税込み分配金円	期中騰落率%	(ベンチマーク)ポイント	期中騰落率%						
10期(2017年2月27日)	12,455	0	13.4	13,439.74	14.2	69.6	1.3	25.3	-	-	百万円 4,943
11期(2018年2月26日)	13,935	0	11.9	15,102.12	12.4	68.0	1.4	26.7	-	-	5,654
12期(2019年2月25日)	13,629	0	△2.2	14,854.34	△1.6	67.4	1.7	26.8	-	-	5,626
13期(2020年2月25日)	14,374	0	5.5	15,740.56	6.0	66.6	1.8	27.5	-	-	5,913
14期(2021年2月25日)	16,441	0	14.4	18,192.19	15.6	70.3	1.0	24.7	-	-	6,631

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		合成インデックス		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率
	騰落率	(ベンチマーク)騰落率	騰落率	騰落率					
(期首) 2020年2月25日	円 14,374	% -	ポイント 15,740.56	% -	% 66.6	% 1.8	% 27.5	% -	% -
2月末	13,665	△4.9	14,950.20	△5.0	65.7	1.2	28.7	-	-
3月末	12,851	△10.6	14,119.98	△10.3	66.1	2.1	29.8	-	-
4月末	13,299	△7.5	14,654.99	△6.9	66.2	2.1	27.5	-	-
5月末	13,888	△3.4	15,320.22	△2.7	65.0	1.8	26.4	-	-
6月末	13,967	△2.8	15,426.38	△2.0	67.6	1.6	26.9	-	-
7月末	13,807	△3.9	15,238.88	△3.2	67.3	1.3	27.5	-	-
8月末	14,560	1.3	16,095.14	2.3	67.4	2.8	26.5	-	-
9月末	14,549	1.2	16,096.34	2.3	67.6	2.1	26.3	-	-
10月末	14,214	△1.1	15,731.75	△0.1	67.2	1.7	27.0	-	-
11月末	15,355	6.8	16,997.19	8.0	69.0	2.2	25.6	-	-
12月末	15,696	9.2	17,377.77	10.4	69.1	1.9	25.3	-	-
2021年1月末	15,771	9.7	17,475.02	11.0	69.1	1.6	25.5	-	-
(期末) 2021年2月25日	円 16,441	% 14.4	ポイント 18,192.19	% 15.6	% 70.3	% 1.0	% 24.7	% -	% -

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注4) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注5) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2020年2月26日 ～2021年2月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	48円	0.330%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,434円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(投信会社)	(19)	(0.132)	
(販売会社)	(24)	(0.165)	
(受託会社)	( 5)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	( 0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(先物・オプション)	( 0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(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)	
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)	
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)	
(投資証券)	( 0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.011	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(保管費用)	( 0)	(0.002)	
(監査費用)	( 1)	(0.004)	
(その他)	( 1)	(0.005)	
合計	50	0.345	

(注1) 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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

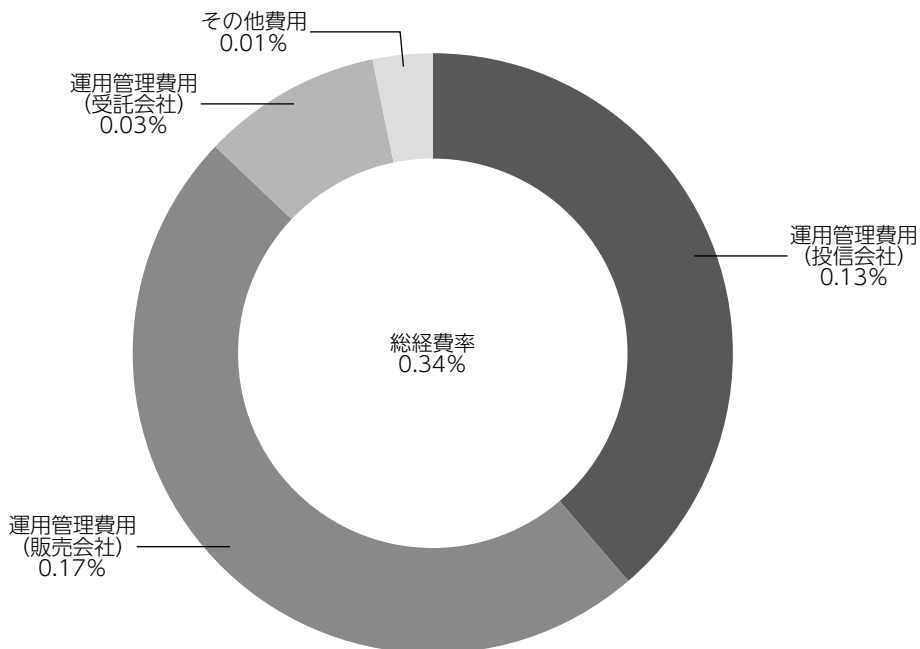
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## (参考情報)

### ◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額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0.34%です。



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

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

## ■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	30,293	73,427	70,633	197,371
国内債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	8,764	11,436	8,429	11,070
外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド	24,345	87,849	27,993	112,608
外国債券パッシブ・ファンド・ マザーファンド	47,542	94,326	50,798	97,879

## ■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	国内株式パッシブ・ファンド （最適化法）・マザーファンド	外国株式パッシブ・ファンド・ マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	241,194,773千円	160,220,787千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	237,278,032千円	346,644,284千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	1.01	0.46

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2020年2月26日から2021年2月25日まで）

### 【D I A M D C バランス70インデックスファンドにおける利害関係人との取引状況等】

#### (1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引はありません。

#### (2) 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)	91千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2千円
(B)／(A)	2.7%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうちこのファンドに対応するものを含みます。

## 【国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 128,643	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,551	百万円 7,508	% 6.7

平均保有割合 1.2%

(注) 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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,047	百万円 867	百万円 2,640

### (3) 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	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 250

## 【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

### 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 200,722	百万円 4,470	% 2.2	百万円 143,863	百万円 12,195	% 8.5

平均保有割合 0.2%

(注) 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ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

## 【外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

## 【外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

## ■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	1,120,913	1,080,573	3,376,577
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	317,181	317,515	411,151
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	298,101	294,453	1,394,620
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	632,041	628,786	1,250,467

## ■投資信託財産の構成

2021年2月25日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式パッシブ・ファンド (最適化法) ・マザーファンド	3,376,577	50.6
国内債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	411,151	6.2
外国株式パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,394,620	20.9
外国債券パッシブ・ファンド ・マザーファンド	1,250,467	18.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	235,202	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	6,668,018	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、2021年2月25日現在、外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドは479,786,969千円、99.8%、外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドは136,700,219千円、99.5%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月25日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.06円、1カナダ・ドル=84.73円、1オーストラリア・ドル=84.47円、1香港・ドル=13.68円、1シンガポール・ドル=80.42円、1ニュージーランド・ドル=78.80円、1イギリス・ポンド=150.05円、1イスラエル・シケル=32.50円、1スイス・フラン=116.93円、1デンマーク・クローネ=17.34円、1ノルウェー・クローネ=12.65円、1スウェーデン・クローナ=12.80円、1メキシコ・ペソ=5.20円、1マレーシア・リンギット=26.24円、1ポーランド・ズロチ=28.61円、1ユーロ=128.95円です。

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月25日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	6,668,018,912円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	231,024,682
国内株式パッシブ・ファンド(最適化法)・マザーファンド(評価額)	3,376,577,088
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	411,151,331
外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,394,620,723
外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	1,250,467,088
未 収 入 金	4,178,000
(B) 負 債	36,031,796
未 払 解 約 金	25,658,306
未 払 信 託 報 酬	10,251,605
そ の 他 未 払 費 用	121,885
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	6,631,987,116
元 本	4,033,813,214
次 期 繰 越 損 益 金	2,598,173,902
(D) 受 益 権 総 口 数	4,033,813,214口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	16,441円

(注) 期首における元本額は4,114,256,126円、当期中における追加設定元本額は445,535,191円、同解約元本額は525,978,103円です。

## ■損益の状況

当期 自2020年2月26日 至2021年2月25日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△68,360円
受 取 利 息	5,000
支 払 利 息	△73,360
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	851,837,685
売 買 益	891,233,241
売 買 損	△39,395,556
(C) 信 託 報 酬 等	△19,558,870
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	832,210,455
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,402,590,908
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	363,372,539
(配 当 等 相 当 額)	(1,055,881,494)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△692,508,955)
(G) 合 計(D+E+F)	2,598,173,902
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,598,173,902
追 加 信 託 差 損 益 金	363,372,539
(配 当 等 相 当 額)	(1,056,590,144)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△693,217,605)
分 配 準 備 積 立 金	2,234,801,363

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	109,896,041円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	699,905,118
(c) 収 益 調 整 金	1,056,590,144
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,425,000,204
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	3,291,391,507
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	8,159.50
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0



# 国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンド 運用報告書

第19期（決算日 2021年2月8日）

（計算期間 2020年2月8日～2021年2月8日）

国内株式パッシブ・ファンド（最適化法）・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年10月30日から無期限です。
運用方針	主として東京証券取引所第1部に上場されている株式に投資し、わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、東証株価指数（TOPIX）（配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第1部に上場されている株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率	株式先物率	純資産額
	期騰	期中落率	(配当込み) ベンチマーク	期中落率			
15期 (2017年2月7日)	円	%	ポイント	%	%	%	百万円
15期 (2017年2月7日)	22,429	12.3	2,161.36	12.3	97.6	2.3	284,249
16期 (2018年2月7日)	26,432	17.8	2,547.46	17.9	98.1	0.8	289,238
17期 (2019年2月7日)	24,228	△8.3	2,334.81	△8.3	98.5	1.5	279,184
18期 (2020年2月7日)	27,423	13.2	2,642.55	13.2	97.6	2.4	269,760
19期 (2021年2月8日)	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3	318,586

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 東証株価指数（TOPIX）は、株式会社東京証券取引所（㈩東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は、㈩東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、㈩東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、㈩東京証券取引所は、ファンドの発行また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（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

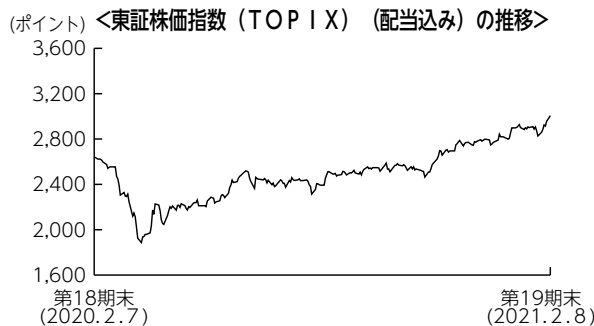
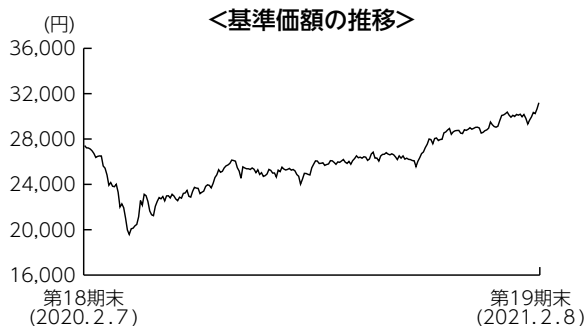
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入率 比	株式先物率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み) (ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2020年 2月7日	円 27,423	% -	ポイント 2,642.55	% -	% 97.6	% 2.4
2 月 末	23,926	△12.8	2,305.76	△12.7	97.8	1.9
3 月 末	22,498	△18.0	2,167.60	△18.0	100.1	3.3
4 月 末	23,470	△14.4	2,261.88	△14.4	97.1	3.0
5 月 末	25,068	△8.6	2,416.04	△8.6	92.2	2.2
6 月 末	25,027	△8.7	2,411.45	△8.7	97.4	2.6
7 月 末	24,020	△12.4	2,314.39	△12.4	98.2	1.8
8 月 末	25,983	△5.3	2,503.59	△5.3	97.8	2.4
9 月 末	26,316	△4.0	2,536.14	△4.0	96.6	3.4
10 月 末	25,569	△6.8	2,464.21	△6.7	96.8	2.8
11 月 末	28,422	3.6	2,738.72	3.6	97.0	3.2
12 月 末	29,264	6.7	2,819.93	6.7	97.1	2.7
2021年 1 月 末	29,330	7.0	2,826.50	7.0	97.6	2.4
(期 末) 2021年 2月8日	31,202	13.8	3,006.47	13.8	97.7	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年2月8日から2021年2月8日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は31,202円となり、前期末比で13.8%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大による景気への影響が嫌気されて急落する場面もありましたが、世界各国での経済対策や金融政策、新型コロナウイルスのワクチン開発による感染収束への期待の高まりなどを要因として、基準価額は上昇しました。

### 投資環境

期初から2020年3月半ばにかけては新型コロナウイルスの感染拡大により景気への影響が深刻になるとの見方が広がり、急落しました。ただ、4月から6月までは、感染拡大に鈍化の兆しが見られたことや世界各国での経済対策などを要因として値を戻す展開となりました。その後、7月から10月までは、ほぼ横ばいの推移となりました。期末にかけては、世界的な低金利の継続や新型コロナウイルスのワクチン開発期待、米国での追加経済対策などを要因として上昇しました。

### ポートフォリオについて

ベンチマークである東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

【運用状況】 (注1) 組入比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は東証33業種分類によるものです。

### ○組入上位10業種

#### 期首 (前期末)

No.	業種	比率
1	電気機器	14.2%
2	情報・通信業	8.7
3	輸送用機器	7.4
4	化学	6.9
5	医薬品	6.1
6	銀行業	5.5
7	サービス業	5.1
8	機械	5.0
9	卸売業	4.9
10	小売業	4.4



#### 期末

No.	業種	比率
1	電気機器	17.6%
2	情報・通信業	9.2
3	化学	7.3
4	輸送用機器	6.9
5	医薬品	5.6
6	機械	5.6
7	サービス業	5.5
8	銀行業	4.6
9	小売業	4.6
10	卸売業	4.4

### ○組入上位10銘柄

#### 期首 (前期末)

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.5%
2	ソニー	日本・円	2.0
3	ソフトバンクグループ	日本・円	1.6
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.6
5	武田薬品工業	日本・円	1.5
6	日本電信電話	日本・円	1.5
7	キーエンス	日本・円	1.4
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.2
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本・円	1.1
10	KDDI	日本・円	1.0
組入銘柄数		2,151銘柄	



#### 期末

No.	銘柄名	通貨	比率
1	トヨタ自動車	日本・円	3.0%
2	ソニー	日本・円	2.8
3	ソフトバンクグループ	日本・円	2.7
4	キーエンス	日本・円	2.1
5	任天堂	日本・円	1.3
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本・円	1.3
7	日本電産	日本・円	1.3
8	リクルートホールディングス	日本・円	1.3
9	信越化学工業	日本・円	1.2
10	日本電信電話	日本・円	1.2
組入銘柄数		2,183銘柄	

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で13.8%上昇しました。

当ファンドはベンチマークと同等のリターンとなりました。ポートフォリオのリスク特性をベンチマークにほぼ一致させたため、ベンチマークに沿ったパフォーマンスとなりました。

### 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果を目標としたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)
合 計	0	0.001

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(25,909円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については12ページ(1万口当たりの費用明細)をご参照ください。

## ■ 売買及び取引の状況 (2020年2月8日から2021年2月8日まで)

### (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
		千株	千円	千株	千円
国 内 上 場		63,510.4 (△11,652.101)	127,938,692 (-)	55,403.199	112,472,446

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( )内は、株式分割、増資割当および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。

### (2) 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 71,359	百万円 71,662	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

## ■ 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	240,411,139千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	237,278,032千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)÷(b)	1.01

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

## ■利害関係人との取引状況等（2020年2月8日から2021年2月8日まで）

### (1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 127,938	百万円 6,656	% 5.2	百万円 112,472	百万円 7,504	% 6.7

### (2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		期
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 1,047	百万円 867	百万円 2,537

### (3) 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	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 250

### (4) 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)	3,691千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	207千円
(B) / (A)	5.6%

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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、千葉興業銀行、みずほフィナンシャルグループ、みずほリース、オリエントコーポレーションです。

# ■組入資産の明細

## (1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>		千株	千円		千株	千円			千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円	
極洋	5.1	5.4	16,956				ビーエス三菱	11.1	12.2	8,405				森永製菓	25.4	27.8	118,984			
日本水産	146.5	148.6	76,083				日本ハウスホールディングス	23.2	25.6	9,088				中村屋	2.8	2.5	9,925			
マルハニチロ	21.2	25.2	64,688				大東建託	40.5	40.5	486,000				江崎グリコ	32.1	32.7	156,469			
雪国まいたけ	—	9.9	17,998				新日本建設	14.4	15.9	14,182				名糖産業	5.2	5.6	8,428			
カネコ種苗	4.5	4.6	7,369				N I P P O	27.9	30.8	87,348				井村屋グループ	4.6	6.8	17,999			
サカタのタネ	17.4	19.2	75,552				東亜道路工業	2.1	2.4	9,372				不二家	6	7.6	18,088			
ホクト	11.2	13.6	29,648				前田道路	35.8	22.9	45,777				山崎製パン	81.2	89	172,126			
ホクリヨウ	2.3	2.3	1,628				日本道路	3.3	3.6	27,108				第一屋製パン	1.8	2.9	2,821			
<b>鉱業 (0.2%)</b>							東亜建設工業	10.5	9.9	20,304				モロゾフ	1.8	1.7	9,707			
住石ホールディングス	30.1	27.8	3,141				日本国土開発	19.8	36.3	20,763				亀田製菓	6.2	6.9	34,051			
日鉄鉱業	3.4	3.7	20,831				若築建設	6.1	6.7	8,736				寿スピリッツ	10.4	11.4	75,924			
三井鉱山ホールディングス	5.7	6.7	6,117				東洋建設	37.9	41.6	22,713				カルビー	49.4	54.1	166,898			
国際石油開発帝石	587.5	590.1	411,889				五洋建設	134	157.5	140,175				森永乳業	20	21.9	111,690			
石油資源開発	19.2	21	49,224				世紀東急工業	16.2	17.9	15,501				六甲バター	7.1	8	14,848			
K&Oエナジーグループ	7.1	7.7	11,118				福田組	3.9	4.3	22,489				ヤクルト本社	74.5	81.6	438,192			
<b>建設業 (2.3%)</b>							住友林業	85.7	87.2	199,164				明治ホールディングス	71.6	78.5	580,115			
ヒノキヤグループ	3.7	4	8,560				日本基礎技術	11.4	11.7	5,814				雪印メグミルク	26.1	28.6	68,153			
シーボンドホールディングス	22.7	22.9	107,859				巴コーポレーション	15.2	16.8	6,820				プリマハム	16.9	16.8	55,860			
ミライト・ホールディングス	43.6	55.7	96,361				大和ハウス工業	334.5	342.4	1,101,500				日本ハム	41.4	45.4	212,472			
タマホーム	6.9	9.7	18,100				ライト工業	19.4	21.3	38,254				林業産業	3.7	3.6	2,199			
サンヨーホームズ	1.2	2.2	1,850				積水ハウス	369.9	402.2	850,451				丸大食品	11.6	11.8	20,886			
日本アーク	5.8	6.4	3,916				日特建設	8.9	9.9	7,959				S Foods	8.7	10.7	37,610			
ファーストコーポレーション	4.5	4.9	3,528				北陸電気工事	5.8	6.6	8,144				柿安本店	3.8	4.1	11,512			
ベストテラ	2.5	3	4,932				ユアテック	19.4	21.3	18,147				伊藤ハム米久ホールディングス	69.8	76.7	57,525			
T A T E R U	30.3	29.9	5,621				日本リーテック	—	7.7	18,995				サッポロホールディングス	36.9	40.5	88,492			
キャンディル	—	2.8	1,598				四電工	1.7	1.7	4,845				アサヒグループホールディングス	226.6	259.3	1,151,032			
スペースリョーホールディングス	17.8	19.6	13,818				中電工	13.7	17.1	38,970				キリンホールディングス	459	503.3	1,138,716			
ダイセキ環境ソリューション	2.9	3.1	2,476				関電工	48.1	60.4	55,749				宝ホールディングス	81	87.9	124,378			
第一カッター興業	1.8	4	5,532				きんでん	80.4	80.2	146,365				オノンホールディングス	28.7	34.2	13,885			
安藤・間	87.2	102.9	81,805				東京エネクス	11.2	12.3	11,771				養命酒製造	3.4	4	7,812			
東急建設	42.9	47	26,696				トーエネック	3.4	3.8	14,934				コトコト 株式会社ホールディングス	76	90.8	159,989			
コムスホールディングス	51.9	56.9	194,598				住友電設	9.6	10.5	27,111				サントリー食品インターナショナル	72.4	79.5	302,497			
ビーアールホールディングス	16	19	13,756				日本電設工業	18.6	20.4	41,616				ダイドグループホールディングス	5.6	6.7	36,180			
福松コンストラクショングループ	9.1	10.1	21,573				協和エクシオ	51.3	56.2	163,429				伊藤園	32.8	36.1	241,870			
東建コーポレーション	4.5	4.9	43,414				新日本空調	9	9.8	21,903				キーコーヒー	10.7	11.8	25,735			
ソネック	1.5	1.7	1,390				9電工	23.8	26.1	92,916				ユニカフェ	2.9	3.9	3,966			
ヤマウラ	6.4	7.2	6,789				三機工業	24.4	26.3	34,374				ジャパンフーズ	1.5	1.5	1,866			
大成建設	112.8	115.4	437,366				日揮ホールディングス	104.1	123.6	166,365				日清オイリオグループ	14	15.3	48,118			
大林組	338.1	370.8	350,406				中外炉工業	3.7	4.1	7,121				不二製油グループ本社	26.4	29	95,410			
清水建設	343.2	347.3	277,492				ヤマト	10.8	11.9	8,472				かどや製油	1.1	1	4,060			
飛鳥建設	9.7	10.5	12,316				太平電業	8.2	8.2	21,287				J-オイルミルズ	5.6	5.6	21,336			
長谷工コーポレーション	130.9	121.3	163,633				高砂熱学工業	29.4	33.5	55,442				キッコマン	77.9	85.4	628,544			
松井建設	13.4	14.7	10,936				三晃金属工業	1.4	1.6	4,753				味の素	239	282.3	648,301			
銭高組	1.4	1.2	5,412				朝日工業社	2.2	2.1	6,224				キューピー	60.3	66	160,512			
鹿島建設	265.5	271.6	413,646				明星工業	21.8	24.1	19,810				ハウス食品グループ本社	40.5	44.4	175,824			
不動テトラ	8.9	9.1	16,489				大気社	16.4	18	53,946				カゴメ	41.1	48.5	169,507			
大末建設	4	4.9	4,356				ダイダン	8.1	8.2	23,780				焼津水産化学工業	5.3	4.8	4,939			
鉄建建設	7.3	7.5	14,970				日比谷総合設備	10.9	12.2	23,131				アリアゲジャパン	9.9	10.9	78,153			
西松建設	26	26.5	68,688				フィル・カンパニー	1.4	2.1	4,166				ビエトロ	1.4	1.2	2,109			
三井住友建設	81.7	89.4	42,912				OS JBホールディングス	53.1	54.1	14,985				エバラ食品工業	2.5	2.4	6,684			
大豊建設	7.6	8.1	30,942				東洋エン지니어リング	14.2	15.4	7,499				やまみ	0.5	1.1	2,332			
前田建設工業	84.7	92.9	89,834				レイズネクスト	18.2	20	23,800				ニチレイ	51.5	56.5	167,070			
佐田建設	7.4	6.7	2,974				<b>食料品 (3.4%)</b>							東洋水産	55.7	61	291,580			
ナカノフード建設	9.3	9.7	3,899				ニップ	31.6	35	57,435				イトフードホールディングス	3.8	4.2	7,988			
奥村組	18.4	20.4	56,630				日清製粉グループ本社	122.3	134.1	246,207				大冷	1.4	1.5	2,919			
東鉄工業	14.5	16	44,624				日清製粉	0.7	0.6	4,032				ヨムラ・フード・ホールディングス	5.9	6.7	6,110			
イチケン	2.4	2.7	5,367				昭和产业	10	10.1	32,168				日清食品ホールディングス	46	46.5	400,830			
浅沼組	3.8	4.4	20,064				鳥越製粉	9.7	10.8	9,698				永谷園ホールディングス	5.3	6	14,418			
戸田建設	140.3	154.1	122,201				中部飼料	13.3	14.6	21,681				一正精鮮	4	4	4,872			
熊谷組	15.7	17.1	48,273				フィード・ワン	72.9	16.2	14,596				フジッコ	11.7	13	26,806			
北野建設	2	1.9	4,677				東洋精糖	1.7	1.7	2,087				ロック・フィールド	11.7	12.8	20,569			
植木組	1.5	1.6	4,606				日本甜菜製糖	5.7	6.4	10,873				日本たばこ産業	624.9	636.5	1,369,111			
矢作建設工業	14.9	16.7	14,545				三井製糖	9.5	9.5	18,800				ケンコーマヨネーズ	6.1	7.3	14,235			
							塩水港精糖	11.3	14.4	3,283				わらべや日洋ホールディングス	7.1	7.8	13,392			
							日新製糖	5.1	4.5	8,536				なとり	6.1	6.9	13,869			

銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末					
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額			
		千株	千円		千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
イフジ産業	1.9	2.3	2,081		3.8	3.8	9,146		8.8	8.7	8,404		258.1	283.1	2,128,062		8.7	8.7	8,404		8.7	8.7	8,404
ピッルスコーポレーション	2.3	2.8	9,996		9.1	9.9	70,587		258.1	283.1	2,128,062		4	4	3.9		4	3.9		4	3.9	15,015	
北の達人コーポレーション	37.7	41.4	25,957		3.1	4.5	27,945		4	3.9	15,015		3	3	6,240		3	3		3	3	6,240	
ユーグレナ	46.2	51.2	47,104		7.8	8.4	12,793		3	3	6,240		3.7	4.3	3,857		3.7	4.3		3.7	4.3	3,857	
ミヨシ油脂	4.4	4.4	5,302		19	20.6	17,036		3	3	6,240		1.6	2.4	6,835		1.6	2.4		1.6	2.4	6,835	
理研ビタミン	5.1	11.2	15,792		3	2.4	3,033		6.3	6.9	37,191		8	8.7	9,952		8	8.7		8	8.7	9,952	
繊維製品 (0.5%)					15.6	16.2	54,270		15.6	16.2	54,270		15.6	16.2	54,270		15.6	16.2		15.6	16.2	54,270	
片倉工業	15.4	15.6	21,715		163.3	178.9	334,364		8.5	9.2	2,815		12	13.2	13,002		8.5	9.2		8.5	9.2	2,815	
グンゼ	7.8	8.5	32,895		30.5	34.3	91,615		12	13.2	13,002		87.2	95.5	926,350		12	13.2		12	13.2	13,002	
東洋紡	41.7	45.8	63,707		21.6	22	49,038		87.2	95.5	926,350		118.7	130.1	404,611		87.2	95.5		87.2	95.5	926,350	
ユニチカ	31.2	33.8	15,345		66.4	70.7	84,274		118.7	130.1	404,611		8.8	9.3	1,953		118.7	130.1		118.7	130.1	404,611	
富士紡ホールディングス	5.1	5.6	24,948		10.8	11.9	32,713		8.8	9.3	1,953		30.1	27.9	25,891		8.8	9.3		8.8	9.3	1,953	
倉敷紡績	10.9	10.7	20,811		25.1	27.3	23,778		30.1	27.9	25,891		8	8.7	9,952		30.1	27.9		30.1	27.9	25,891	
シキボウ	5.6	6.6	6,890		38.6	42.2	175,763		8	8.7	9,952		14.5	16	8,256		8	8.7		8	8.7	9,952	
日本毛織	34.8	38.1	38,100		181.3	214.1	3,869,857		14.5	16	8,256		7.8	8.5	52,105		14.5	16		14.5	16	8,256	
ダイトウボウ	17.8	19.3	2,161		3.7	4.2	5,712		7.8	8.5	52,105		44.7	48.9	134,866		7.8	8.5		7.8	8.5	52,105	
トー紡コーポレーション	4.1	4.1	1,927		6.8	8.1	17,293		44.7	48.9	134,866		23.2	25.3	28,513		44.7	48.9		44.7	48.9	134,866	
ダイドーリミテッド	14.1	16.6	3,170		11.5	11.7	11,594		23.2	25.3	28,513		22.4	24.5	47,309		23.2	25.3		23.2	25.3	28,513	
帝国繊維	11.8	13	30,407		90.2	118.1	208,800		22.4	24.5	47,309		8.4	9.4	7,802		90.2	118.1		90.2	118.1	208,800	
帝人	86.2	109	211,351		101.5	95.3	196,413		8.4	9.4	7,802		206.7	207.8	1,281,918		101.5	95.3		101.5	95.3	196,413	
東レ	764.7	838.4	618,655		3.3	3.2	9,712		206.7	207.8	1,281,918		214.3	235	1,830,180		3.3	3.2		3.3	3.2	9,712	
サカイオーベックス	2.9	3.1	6,767		1.5	1.9	2,758		214.3	235	1,830,180		140.2	153.7	363,961		1.5	1.9		1.5	1.9	2,758	
住江織物	2.3	2.1	4,332		53.3	58.4	64,824		140.2	153.7	363,961		6.8	7.4	19,336		53.3	58.4		53.3	58.4	64,824	
日本フェルト	5.7	5.5	2,480		16.9	18.5	13,912		6.8	7.4	19,336		24.3	24.7	43,076		16.9	18.5		16.9	18.5	13,912	
イチカフ	1.5	1.3	1,683		1.3	1.5	3,553		24.3	24.7	43,076		14.4	15.8	111,232		1.3	1.5		1.3	1.5	3,553	
日東製網	1.2	1.3	1,970		16.3	15.5	19,313		14.4	15.8	111,232		43.7	43	168,560		16.3	15.5		16.3	15.5	19,313	
アヅキ	8.8	9.3	4,770		2.4	2.4	5,347		43.7	43	168,560		20.3	22.2	385,614		2.4	2.4		2.4	2.4	5,347	
ダイニチ	3.9	3.6	2,851		5.8	6.3	22,522		20.3	22.2	385,614		5.7	7	10,703		5.8	6.3		5.8	6.3	22,522	
セーレン	26	28.5	52,012		4	3.4	17,238		5.7	7	10,703		1.2	1.3	2,581		4	3.4		4	3.4	17,238	
ソトー	3.8	4	3,272		16.4	21	126,000		1.2	1.3	2,581		46	50.5	109,585		16.4	21		16.4	21	126,000	
東海染工	1.4	1.3	1,458		9.4	9.6	22,790		46	50.5	109,585		10.3	10	50,500		9.4	9.6		9.4	9.6	22,790	
小松マテール	17.3	19.1	20,093		30	30	119,850		10.3	10	50,500		2.3	3	3,267		30	30		30	30	119,850	
ワコールホールディングス	27.5	28.9	68,695		27.7	116	291,972		2.3	3	3,267		6.9	7.4	6,506		27.7	116		27.7	116	291,972	
ホギメディカル	12	15.6	50,934		96	100	335,500		6.9	7.4	6,506		3.4	4.5	6,961		96	100		96	100	335,500	
レナウン	28.2	-	-		98.4	116.2	362,544		3.4	4.5	6,961		17.7	19.5	32,311		98.4	116.2		98.4	116.2	362,544	
クラウディアホールディングス	2.9	2.4	691		18.2	19.9	142,882		17.7	19.5	32,311		14.4	20.5	43,009		18.2	19.9		18.2	19.9	142,882	
T S Iホールディングス	35.5	34.7	10,028		9.8	10.7	39,162		14.4	20.5	43,009		3.7	3.7	7,788		9.8	10.7		9.8	10.7	39,162	
マツオカコーポレーション	3.1	3.7	7,788		706.2	774.1	577,943		3.7	3.7	7,788		6.3	6.9	5,361		706.2	774.1		706.2	774.1	577,943	
ワールド	1.5	15.1	21,789		18.6	19.1	48,380		6.3	6.9	5,361		30.2	33.1	364,100		18.6	19.1		18.6	19.1	48,380	
三陽商会	5.5	6	4,512		144.5	155.5	130,309		30.2	33.1	364,100		9.7	9.9	12,780		144.5	155.5		144.5	155.5	130,309	
ナイガイ	4	3.8	1,250		16.6	18.2	74,074		9.7	9.9	12,780		7.4	8.1	17,293		16.6	18.2		16.6	18.2	74,074	
オンワードホールディングス	63.5	69.3	20,166		227.1	244.9	502,289		7.4	8.1	17,293		3.1	3.3	9,147		227.1	244.9		227.1	244.9	502,289	
ルックホールディングス	3.6	4	3,752		95.3	104.5	172,425		3.1	3.3	9,147		28.2	31	96,556		95.3	104.5		95.3	104.5	172,425	
キムラタン	57.9	68.3	1,707		31.7	32.2	122,360		28.2	31	96,556		13.1	13.3	49,010		31.7	32.2		31.7	32.2	122,360	
ゴールドウイン	19.2	19.1	139,812		53.3	58.4	123,048		13.1	13.3	49,010		6.7	7.7	5,197		53.3	58.4		53.3	58.4	123,048	
デサント	20.6	19.8	35,224		19	19.1	41,408		6.7	7.7	5,197		1.8	2.3	3,061		19	19.1		19	19.1	41,408	
キング	5	4.6	2,737		22.8	25.2	17,589		1.8	2.3	3,061		27.8	33	46,860		22.8	25.2		22.8	25.2	17,589	
ヤマトインターナショナル	6.3	10.6	3,710		6	6.6	10,553		27.8	33	46,860		8.2	8.9	55,269		6	6.6		6	6.6	10,553	
パルプ・紙 (0.2%)					48.9	-	-		8.2	8.9	55,269		11.1	10.9	12,415		48.9	-		48.9	-	-	
特種東海製紙	6.7	7.2	34,452		5.6	6.2	11,315		11.1	10.9	12,415		3.3	3.7	11,081		5.6	6.2		5.6	6.2	11,315	
王子ホールディングス	441.3	521.3	347,185		26.7	28.2	14,128		3.3	3.7	11,081		44.7	48.8	44,359		26.7	28.2		26.7	28.2	14,128	
日本製紙	46.7	51.1	75,219		5	5.5	10,923		44.7	48.8	44,359		19.4	21.2	10,833		5	5.5		5	5.5	10,923	
三菱製紙	12	17.1	5,950		14.2	15.6	8,923		19.4	21.2	10,833		7.4	8.2	12,464		14.2	15.6		14.2	15.6	8,923	
北越コーポレーション	70	82.9	38,797		2.4	2.2	5,526		7.4	8.2	12,464		17	16.5	16,665		2.4	2.2		2.4	2.2	5,526	
中越パルプ工業	4.5	4.7	5,705		5.6	6.7	2,914		17	16.5	16,665		74.5	75.7	734,290		5.6	6.7		5.6	6.7	2,914	
巴川製紙所	3.2	3.7	3,048		3.8	3.7	4,421		74.5	75.7	734,290		11.5	14	18,802		3.8						



銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末					
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株	株	数	千株
バルカー			8.8			9.7	日本山村硝子			4.5			5.3	古河機械金属			19			19.3			25,765
ユニ・チャーム			207.9			250.8	日本電気硝子			43.3			43.8	エス・サイエンス			47.6			54.7			2,461
ジョーエコーポレーション			1.2			2.6	オハラ			4.3			4.7	大塚チタニウムテクノロジーズ			11.1			12			9,972
<b>医薬品 (5.7%)</b>							住友大阪セメント			20.4			21.3	東邦チタニウム			19.1			20.9			19,395
協和キリン			108.4			119	太平洋セメント			68.1			70	UACJ			16.2			17.7			40,656
武田薬品工業			897.1			983.7	日本ヒューム			10.8			11	C Kサンエツ			1.9			2.1			8,158
アステラス製薬			948.4			1,025.1	日本コンクリート工業			23.4			25.4	古河電気工業			33.1			36.4			106,142
大日本住友製薬			79.9			87.6	三谷セキサン			5			5.5	住友電気工業			398.6			407.9			652,232
塩野義製薬			137.9			148.7	アジアパイルホールディングス			15.3			18.5	フジクラ			128.7			141.1			77,605
わかもと製薬			13			14.3	東海カーボン			112.9			115.5	昭和電線ホールディングス			12.3			11.3			21,470
あすか製薬			12.3			13.4	日本カーボン			5.5			6.5	東京特殊電線			1.6			1.5			3,870
日本新薬			28.3			33.5	東洋炭素			6.3			7	タツタ電線			21.1			20.6			14,440
ピオフェルミン製薬			1.7			2.2	ノリタケカンパニーリミテド			5.9			6.6	カナレ電気			1.7			2.2			3,916
中外製薬			112.4			369.8	TOTO			77			84.5	平河ヒューテック			4			6.5			7,956
科研製薬			18.5			20.2	日本硝子			131.6			130	リョービ			13.2			14.2			18,616
エーザイ			129			130.6	日本特殊陶業			83.9			90	アーレスティ			14			14.6			5,956
ロート製薬			55.3			56.3	ダントーホールディングス			8			8.6	アサヒホールディングス			18.7			21.9			93,294
小野薬品工業			247.6			271.5	MARUWA			4.2			4.1	<b>金属製品 (0.6%)</b>			6			6.7			9,601
久光製薬			28.5			34.4	品川リフラクトリーズ			2.9			2.8	稲葉製作所			3.3			3.8			8,759
持田製薬			15			16.4	黒崎播磨			2.1			2	豊地エンジニアリンググループ			3.3			3.8			3,870
参天製薬			200.8			205.7	ユータイ			8.6			8.6	トーカロ			29.6			30.2			43,004
扶桑薬品工業			3.8			3.8	インソライト工業			5.5			5.3	アルファ			3.8			4.5			4,761
日本ケミファ			1.4			1.2	東京窯業			13.8			15.7	SUMCO			127.7			149.6			338,694
ソムラ			33.5			39.5	ニッカトー			4.9			5.4	川田テクノロジー			2.1			2.4			10,896
日医工			30.6			33.4	フジミンコ-ポレテッド			9.6			9.5	RS Technologies			3.1			3.8			24,472
キッセイ薬品工業			19.1			20.9	クニミネ工業			4.4			3.8	ジェイテックホールディングス			-			1			3,855
生化学工業			20.8			20.9	エーアンドエーマテリアル			1.8			2.4	信和			4.6			6.4			4,588
栄研化学			19			20.8	ニチアス			29.5			29.9	野鐵グループホールディングス			67.9			74.5			100,426
日本製薬			4.6			4.6	ニチハ			15			16.5	ホッカンホールディングス			5.9			6			8,946
鳥居薬品			6.7			7.4	<b>鉄鋼 (0.7%)</b>							コロナ			5.9			6.8			6,473
JCRファーマ			7.6			33.3	日本製鉄			477.3			558.1	横河アリジックホールディングス			19.9			20.1			40,099
東和薬品			13.8			17.1	神戸製鋼所			195.1			213.7	駒井ハルテック			1.9			2.4			5,296
富士製鋼工業			7.3			8.1	中山製鋼所			14.9			17.1	高田機工			0.9			0.8			2,056
沢井製薬			22.1			25.9	合同製鐵			5.7			6.3	三和ホールディングス			102.3			110.2			146,566
ゼリア新薬工業			19.6			21.5	ジェイエフイーホールディングス			287.9			338.2	文化シャッター			31.5			34.6			33,873
第一三共			308.5			1,015	東京製鐵			52			45.6	三協立山			14.8			15			13,065
キョーリン製薬ホールディングス			23.8			26.1	共英製鋼			12			13.1	アルインコ			7.8			7.8			7,612
大幸薬品			4.4			14.5	大和工業			22.6			24.9	東洋シャッター			2.5			2.4			1,682
ダイト			6.3			7.5	東京製鋼			4.4			4.5	LIXIL			157.4			161			464,485
大塚ホールディングス			205.4			245.8	大阪製鐵			5.7			6.3	日本フイルコン			8.3			8.5			4,309
大正製薬ホールディングス			22.7			28.1	淀川製鋼所			14.4			15.9	ノーリツ			22.1			24.3			39,438
ペプチドリーム			54.6			60.1	丸一鋼管			34.6			37.9	長府製作所			10.8			12			25,860
<b>石油・石化製品 (0.4%)</b>							モリ工業			3.2			3.5	リンナイ			20.7			22.7			252,197
日本コークス工業			92.1			100.5	大同特殊鋼			17.4			19.1	ダイニチ工業			5.7			5.7			5,033
ニチレキ			12.7			14	日本高周波鋼業			4.2			4	日東精工			14.7			15.1			7,368
ユシロ化学工業			6			6.8	山陽特殊製鋼			8.9			9.1	三洋工業			1.4			1.3			2,455
ピーピー・カストロール			3.9			4.3	愛知製鋼			6			6.6	岡部			21.6			24.1			19,207
富士石油			29			28.8	日立金属			114.8			110.3	ジーテクト			13.3			14.6			23,038
MORESCO			4			4.5	日本金属			2.4			2.9	199.22			19.9			21.9			35,565
出光興産			121.3			131.2	大太平洋金属			7.2			7.8	高周波熱錬			20.5			22.3			12,532
ENEOSホールディングス			1,621.8			1,778.3	新日本電工			69.2			75.3	東京製鋼			7.6			8.2			11,873
コスモエネルギーホールディングス			31.2			37.3	栗本鐵工所			5.3			5.4	サンコール			6.1			10.3			4,923
<b>ゴム製品 (0.6%)</b>							缸 技			1.6			1.3	モリテックスチール			8.4			9			3,807
横浜ゴム			62.4			68.4	日本鑄鉄管			1.1			1.4	パイオラックス			15.7			17.3			28,493
TOYO TIRE			61.9			62.2	三菱製鋼			8			8.8	エイチワン			10.5			11.6			9,767
ブリヂストン			331.4			314.4	日亜鋼業			15.7			17.8	日本発条			114.3			116.4			99,522
住友ゴム工業			96.9			106	日本精線			1.7			1.7	中央発條			1.2			1			2,803
藤倉コンポジット			9.5			10.8	エンビロ-ホールディングス			4.1			5.1	アドパネクス			1.3			1.6			2,606
オカモト			6.5			7.3	シン・ンタツ			16.6			14.5	立川プラインド工業			4.7			5.3			7,080
フコク			4.7			4.4	新家工業			2.4			3.1	三益半導体工業			8.4			9.1			24,151
ニッタ			12.1			12.2	<b>新鉄金属 (0.8%)</b>							<b>機械 (5.7%)</b>									
住友理工			20.9			22.8	大紀アルミニウム工業所			17.5			17.7	日本ドライケミカル			2.7			3			4,746
三ツ星ベルト			14.2			14.4	日本製鋼所			270			31.9	日本製鋼所			32.3			35.5			113,422
バンドー化学			19			20.9	日本軽金属ホールディングス			28.8			31.6	三浦工業			46.1			50.6			300,514
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>							三井金属鉱業			28.8			31.6	タクマ			36.1			39.6			90,960
日東紡績			16			17.5	東邦亜鉛			5.5			6.5	ツガミ			22			24.2			41,019
AGC			106.6			108.6	三菱マテリアル			70.5			77.2	オークマ			12.4			13.6			85,680
日本板硝子			51.5			59.8	住友金属鉱山			136.3			149.4	芝浦機械			12			12.2			34,147
石塚硝子			1.9			2.1	DOWAホールディングス			27													



銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末			銘柄	期首(前期末)			当期末				
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		
日本電波工業		千株	千円		千株	千円	太陽誘電		千株	千円		千株	千円	T B K		千株	千円		千株	千円		
鈴木	9.8	11.5	8,372		5.8	6,333	村田製作所	47.9	52.5	308,175		316.7	3,288,236	エフセディ	12.9	11.8	5,298		14.7	16	26,592	
日本トリム	1.4	2.5	11,500		1.4	11,500	双葉電子工業	17	20.3	20,320		17	20,320	豊田合成	34.8	38.2	114,600		16.9	18.5	11,322	
ローランド ディー. ジー.	5.9	7	12,838		5.9	12,838	北陸電気工業	4.3	4.6	4,443		4.3	4,443	愛三工業	16.9	18.5	11,322		16.9	18.5	11,322	
フォスター電機	11.3	12.4	18,910		11.3	18,910	ニチコン	36.6	37.1	52,756		36.6	37.1	盟和産業	1.6	1.6	1,465		1.6	1.6	1,465	
S M K	2.8	3.1	9,501		2.8	9,501	日本ケミコン	8.2	11.9	20,658		8.2	11.9	日本プラス	8.4	10.3	5,963		8.4	10.3	5,963	
ヨコオ	6.9	8.7	28,710		6.9	28,710	K O A	16.2	16.3	27,106		16.2	16.3	ヨロズ	10.1	10.2	14,280		10.1	10.2	14,280	
ティアック	8	7.3	985		8	985	市光工業	16.1	17.6	13,710		16.1	17.6	エフ・シー・シー	17.6	19.3	32,539		17.6	19.3	32,539	
ホンデン	29.5	32.2	36,225		29.5	36,225	小糸製作所	64.6	70.8	544,452		64.6	70.8	シマノ	40.4	44.3	1,087,786		40.4	44.3	1,087,786	
ヒロセ電機	16.7	18.2	297,024		16.7	297,024	ミツバ	19.9	21.7	11,001		19.9	21.7	テイ・エス テック	25	27.4	86,858		25	27.4	86,858	
日本航空電子工業	24.7	27	45,873		24.7	45,873	SCREENホールディングス	18.7	20.5	171,995		18.7	20.5	ジャムコ	5.4	7	5,306		5.4	7	5,306	
T O A	11.5	14	12,670		11.5	12,670	キャノン電子	11.3	10.9	19,227		11.3	10.9	精密機器 (2.6%)								
マクセルホールディングス	23.3	23.4	34,351		23.3	34,351	キャノン	580.4	587.5	1,395,312		580.4	587.5	テルモ	305.1	362.5	1,653,000		305.1	362.5	1,653,000	
古野電気	13.9	15.1	17,938		13.9	17,938	リコー	274.3	300.7	282,658		274.3	300.7	クリエートメディック	3.6	4.2	4,124		3.6	4.2	4,124	
ユニデンホールディングス	3	3	7,113		3	7,113	象印マホービン	31.6	31.9	59,621		31.6	31.9	日機装	32.3	38.2	42,058		32.3	38.2	42,058	
スマグコーポレーション	8.3	10	10,410		8.3	10,410	MUTOHホールディングス	1.4	1.2	1,868		1.4	1.2	日本エム・ディ・エム	6.2	6.8	14,708		6.2	6.8	14,708	
アイコム	6	4.9	13,940		6	13,940	東京エレクトロン	71.9	69.3	2,851,695		71.9	69.3	島津製作所	128.8	152.2	637,718		128.8	152.2	637,718	
リオン	4.5	5	15,975		4.5	15,975	輸送用機器 (7.0%)						J M S	9.2	10	11,540		9.2	10	11,540		
本多通信工業	9.4	9.4	4,690		9.4	4,690	トヨタ紡織	31.4	34.5	64,618		31.4	34.5	クボテック	2.8	3.1	1,159		2.8	3.1	1,159	
船井電機	10.9	13.4	6,324		10.9	6,324	芦森工業	2.2	2.4	2,460		2.2	2.4	長野計器	7.8	8.5	8,185		7.8	8.5	8,185	
横河電機	98.9	118.3	282,855		98.9	282,855	ユニプレス	20.9	19.3	21,654		20.9	19.3	ブイ・テクノロジ	5	5.5	35,200		5	5.5	35,200	
新電元工業	3.8	4.5	13,360		3.8	13,360	豊田自動織機	87.3	95.7	912,021		87.3	95.7	東京計器	6.9	7.5	7,177		6.9	7.5	7,177	
アズビル	68	80	404,800		68	404,800	モリタホールディングス	18.9	19	34,827		18.9	19	愛知時計電機	1.3	1.2	5,334		1.3	1.2	5,334	
東亜ディーケーケー	5.3	6.1	5,264		5.3	5,264	三機工業	13.7	16.3	15,273		13.7	16.3	インターアクション	5.8	5.9	15,045		5.8	5.9	15,045	
日本光電工業	44.6	48.9	154,035		44.6	154,035	デンソー	237.4	260.4	1,749,627		237.4	260.4	オーバル	9.8	10.7	3,520		9.8	10.7	3,520	
チノ	3.7	3.8	5,506		3.7	5,506	東海理化電機製作所	28.4	31.2	60,091		28.4	31.2	東京精密	19.5	19.9	90,744		19.5	19.9	90,744	
共和電業	11.3	13	5,187		11.3	5,187	三井E&Sホールディングス	39	45.7	20,245		39	45.7	マニ	42.9	47	134,843		42.9	47	134,843	
日本電子材料	4.3	4.3	8,376		4.3	8,376	川崎重工	83.9	91.9	221,019		83.9	91.9	ニコン	174.4	180.4	162,179		174.4	180.4	162,179	
堀場製作所	21.3	23.4	165,438		21.3	165,438	名村造船所	34.7	35.7	6,961		34.7	35.7	トプコン	54.3	59.5	81,158		54.3	59.5	81,158	
アドバンテスト	80.2	87.9	777,036		80.2	777,036	サナハスホールディングス	13.2	15.5	2,464		13.2	15.5	オリンパス	596.7	654.2	1,336,857		596.7	654.2	1,336,857	
小野測器	4.2	4.3	2,390		4.2	2,390	日本車輛製造	4	4.3	11,145		4	4.3	理研計器	9.5	10.5	32,182		9.5	10.5	32,182	
エスベック	9.5	10.5	21,231		9.5	21,231	三菱ロジスネクスト	14.3	15.7	18,698		14.3	15.7	ダムロン	8.7	9.5	20,510		8.7	9.5	20,510	
キーエンス	97.7	116	6,583,000		97.7	6,583,000	近畿車輛	1.6	1.6	2,035		1.6	1.6	H O Y A	215.3	234.6	3,065,049		215.3	234.6	3,065,049	
日置電機	5.6	5.7	23,740		5.6	23,740	日産自動車	1,271.6	1,394.4	877,914		1,271.6	1,394.4	シード	4.6	5.2	3,354		4.6	5.2	3,354	
シスメックス	77	92.2	1,095,797		77	1,095,797	いすゞ自動車	312.4	342.6	393,304		312.4	342.6	ノーリツ鋼機	7.2	10.6	23,415		7.2	10.6	23,415	
日本マイクロニクス	18.8	20.6	32,774		18.8	32,774	トヨタ自動車	1,203.1	1,197.8	9,626,718		1,203.1	1,197.8	イー・アンド・ディ	9.8	9.9	13,087		9.8	9.9	13,087	
メガチップス	10	11.9	35,200		10	35,200	日野自動車	134.6	147.7	146,518		134.6	147.7	朝日インテック	91.6	124.4	414,252		91.6	124.4	414,252	
O B A R A G R O U P	5.6	7	29,050		5.6	29,050	三菱自動車工業	399	437.1	135,938		399	437.1	シチズン時計	126.3	149.2	54,010		126.3	149.2	54,010	
薄藤電機	1.3	1.3	2,701		1.3	2,701	エフテック	7.5	8.4	5,955		7.5	8.4	リズム	3.4	3.1	2,263		3.4	3.1	2,263	
原田工業	5.1	5	4,550		5.1	4,550	レシップホールディングス	4.4	4.6	2,829		4.4	4.6	大研医器	7.5	9.5	5,443		7.5	9.5	5,443	
コーセル	13.2	14.4	17,121		13.2	17,121	G M B	2	2.2	2,305		2	2.2	メニコン	14.8	18.1	120,908		14.8	18.1	120,908	
イリソ電子工業	9.1	9.9	50,985		9.1	50,985	ファルテック	1.9	2.3	1,731		1.9	2.3	シンシア	1.1	1.2	824		1.1	1.2	824	
オプテックグループ	17.6	19.4	37,830		17.6	37,830	武蔵精密工業	24	26.4	43,612		24	26.4	松風	4.9	5.5	10,274		4.9	5.5	10,274	
千代田インテグレイ	5	5.1	9,327		5	9,327	日産車体	21.1	17.3	15,760		21.1	17.3	セイコーホールディングス	15.2	16.6	26,609		15.2	16.6	26,609	
アイ・オー・データ機器	4	4.4	4,549		4	4,549	新明和工業	29.1	33.3	32,267		29.1	33.3	ニプロ	74.7	88.1	117,525		74.7	88.1	117,525	
レーザータック	47.3	51.9	703,764		47.3	703,764	極東開発工業	20	20.4	32,762		20	20.4	その他製品 (2.5%)								
スタンレー電気	75.8	82.9	291,808		75.8	291,808	日信工業	21.9	-	-		21.9	-	中本パックス	2.8	3.1	5,418		2.8	3.1	5,418	
岩崎電気	4.2	4.3	6,811		4.2	6,811	トビー工業	8.9	9.8	14,131		8.9	9.8	スノーピーク	5.1	7	14,378		5.1	7	14,378	
ウシオ電機	62.6	60.6	84,840		62.6	84,840	ティラド	3.9	3.7	5,901		3.9	3.7	パワマウントバッドホールディングス	11.4	11.4	54,663		11.4	11.4	54,663	
岡谷電機産業	8.5	8.9	3,408		8.5	3,408	曙ブレーキ工業	59.3	64.1	10,961		59.3	64.1	トランザクション	6.9	6.4	7,180		6.9	6.4	7,180	
ハリス テクノ ホールディング	9.9	11.2	3,998		9.9	3,998	タチエス	17.6	18.1	21,683		17.6	18.1	糖美堂	3.2	3	1,218		3.2	3	1,218	
エノモト	3.3	3.3	5,824		3.3	5,824	N O K	57.9	57.2	81,224		57.9	57.2	ニホンフラッシュ	5	10.1	12,796		5	10.1	12,796	
日本セラミック	10.9	12	36,360		10.9	36,360	フタバ産業	30.1	29.6	16,605		30.1	29.6	前田工織	11.8	13	37,388		11.8	13	37,388	
遠藤照明	5.4	6.7	3,912		5.4	3,912	K Y B	12	13.2	34,848		12	13.2	永大産業	14.3	16.8	5,292		14.3	16.8	5,292	
古河電池	7.6	8.4	14,086		7.6	14,086	大同メタル工業	20.7	24.6	13,677		20.7	24.6	アートネイチャー	11.5	11.6	7,992		11.5	11.6	7,992	
双信電機	5.4	5.8	2,615		5.4	2,615	プレス工業	53.5	58.5	20,884		53.5	58.5	パダイナムホールディングス	111.5	97.8	903,574		111.5	97.8	903,574	
山一電機	7.9	7.6	11,947		7.9	11,947	ミクニ	13.7	16.1	4,620		13.7										

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			
	株	数	価 値	株	数	評 価 額		株	数	株	数	評 価 額	株		数	株	数	評 価 額	株	数	評 価 額
プロネクサス		千株	千円		千株	千円	鴻池運輸		千株	千円		千株	千円	クロスキャット		千株	千円		千株	千円	
ホクシン	9.3	10.3	12,030		17.1	19	西日本鉄道	17.1	19	20,805		2.8	3	3,690		2.8	3	3,690		2.8	3
ウッドワン	7.2	8.5	994		29.9	32.8	ハマコックス	29.9	32.8	97,088		37.7	41.4	83,172		37.7	41.4	83,172		37.7	41.4
大建工業	3.5	3.4	3,733		8.3	9.1	サイカイ越センター	8.3	9.1	30,667		5.2	6.8	70,400		5.2	6.8	70,400		5.2	6.8
凸版印刷	7.2	8	14,808		5.7	5.5	近鉄グループホールディングス	5.7	5.5	29,095		15.9	17.3	60,896		15.9	17.3	60,896		15.9	17.3
大日本印刷	152.2	179.6	290,952		102.1	111.9	阪急阪神ホールディングス	102.1	111.9	536,001		5.6	6.2	7,303		5.6	6.2	7,303		5.6	6.2
共同印刷	141.1	142.8	286,456		136.2	149.3	南海電気鉄道	136.2	149.3	555,396		1.9	1.8	3,319		1.9	1.8	3,319		1.9	1.8
N I S S H A	3.4	3.7	13,597		48.4	53.1	京阪ホールディングス	48.4	53.1	144,697		4.5	4.9	7,599		4.5	4.9	7,599		4.5	4.9
光村印刷	22.1	24.3	35,235		45.5	49.9	神戸電鉄	45.5	49.9	257,983		5.1	8.2	16,334		5.1	8.2	16,334		5.1	8.2
TAKARA & COMPANY	0.9	0.8	1,436		2.4	2.8	名古屋鉄道	2.4	2.8	10,500		4.6	5.8	10,242		4.6	5.8	10,242		4.6	5.8
アシックス	5.2	5.8	10,440		83.9	92.1	山陽電気鉄道	83.9	92.1	261,379		4.6	4.5	12,123		4.6	4.5	12,123		4.6	4.5
ツツミ	89	104.6	204,702		7.3	8.1	ヤマトホールディングス	7.3	8.1	17,074		35.3	116	283,272		35.3	116	283,272		35.3	116
ローランド	3.4	3	5,739		36.1	38.8	丸 連	36.1	38.8	299,536		4.3	5.5	3,151		4.3	5.5	3,151		4.3	5.5
小松ウオール工業	-	6.9	27,117		179	157	JNSホールディングス	179	157	449,962		4.1	4.3	13,029		4.1	4.3	13,029		4.1	4.3
ヤマハ	3.4	3.7	6,645		28.4	28.7	電算システム	28.4	28.7	128,289		64.9	71.1	43,726		64.9	71.1	43,726		64.9	71.1
河合楽器製作所	64.2	70.3	447,108		5.9	7.6	グリー	5.9	7.6	1,968		-	0.8	4,624		-	0.8	4,624		-	0.8
クリナップ	3.4	3.3	10,065		8.3	9.1	GMOベバポ	8.3	9.1	32,396		21.6	23.7	149,073		21.6	23.7	149,073		21.6	23.7
ビジョン	10.1	11.4	5,814		56.3	61.9	コーエーテックホールディングス	56.3	61.9	62,828		4.6	5	20,975		4.6	5	20,975		4.6	5
オリバー	65.2	75.9	340,411		2.4	2.3	三菱総合研究所	2.4	2.3	13,501		1.9	2.8	1,512		1.9	2.8	1,512		1.9	2.8
兼松サステック	2.2	2.4	6,345		36.5	37.6	ボルテージ	36.5	37.6	85,540		1.2	1	2,539		1.2	1	2,539		1.2	1
キングジム	0.7	0.6	1,057		1.1	0.9	電算	1.1	0.9	2,394		5.9	6.1	5,105		5.9	6.1	5,105		5.9	6.1
リンテック	25.6	25.4	61,366		13.1	14.4	AGS	13.1	14.4	65,232		9	9.7	10,864		9	9.7	10,864		9	9.7
イトーキ	22.9	23.3	8,108		76.5	83.9	ファインデックス	76.5	83.9	128,702		2.1	2.9	12,397		2.1	2.9	12,397		2.1	2.9
任天堂	66.1	67.7	4,295,565		3.1	3	ブレインパッド	3.1	3	2,709		20.4	21.2	20,966		20.4	21.2	20,966		20.4	21.2
三菱鉛筆	17.7	19.5	27,865		2.5	2.5	K L a b	2.5	2.5	9,825		12.7	15.4	18,587		12.7	15.4	18,587		12.7	15.4
タカラスタンダード	22.2	24.5	40,400		18.8	24.7	チートウエイ・ビートルホールディングス	18.8	24.7	84,721		1.5	1.9	4,727		1.5	1.9	4,727		1.5	1.9
ココヨ	51.7	56.6	82,239		10.8	23.6	イープラックインシアティブジャパン	10.8	23.6	50,409		301.2	293.1	1,017,057		301.2	293.1	1,017,057		301.2	293.1
ナカバヤシ	10.7	12.1	7,562		10.3	11.4	ネクソン	10.3	11.4	23,210		27.3	35.3	16,696		27.3	35.3	16,696		27.3	35.3
グローブライド	4.8	5.7	24,367		91.1	86.4	アイスタイル	91.1	86.4	220,665		3.1	3	7,266		3.1	3	7,266		3.1	3
オカムラ	37.6	45.4	49,440		107.2	211.7	エムアールホールディングス	107.2	211.7	544,492		7.2	8	9,792		7.2	8	9,792		7.2	8
美津濃	9.8	11.7	27,144		85.4	93.6	Eニゴモ	85.4	93.6	276,120		7.5	10.9	14,137		7.5	10.9	14,137		7.5	10.9
電気・ガス業 (1.3%)					64.6	66.4	テクノスジャパン	64.6	66.4	204,844		8.3	8.9	6,363		8.3	8.9	6,363		8.3	8.9
東京電力ホールディングス	860.8	1,002.3	407,936		31.4	34.5	e n i s h	31.4	34.5	67,930		4.7	5.9	2,979		4.7	5.9	2,979		4.7	5.9
中部電力	330	361.8	488,249		5.6	5.4	コロプラ	5.6	5.4	8,456		34.7	38	35,986		34.7	38	35,986		34.7	38
関西電力	408.6	448	479,360		10.2	12.3	オルトプラス	10.2	12.3	5,043		7.9	6.8	2,944		7.9	6.8	2,944		7.9	6.8
中国電力	149.1	170.7	223,787		48.1	52.4	ブロードリーフ	48.1	52.4	22,741		52.5	57.4	37,424		52.5	57.4	37,424		52.5	57.4
北陸電力	98.6	108.1	75,886		1.8	2.2	クロス・マーケティンググループ	1.8	2.2	2,085		4.9	5.4	2,143		4.9	5.4	2,143		4.9	5.4
東北電力	269.6	276.8	259,361		5.9	5.9	デジタルハーツホールディングス	5.9	5.9	5,846		5.6	5.3	6,990		5.6	5.3	6,990		5.6	5.3
四国電力	97.2	98.2	74,533		183.8	272.7	システム情報	183.8	272.7	606,212		5.4	8.5	10,081		5.4	8.5	10,081		5.4	8.5
九州電力	222.3	261	246,123		186.6	302.1	メディアアドゥ	186.6	302.1	721,565		3.4	4.4	27,236		3.4	4.4	27,236		3.4	4.4
北海道電力	101	110.3	51,841		1.9	2.2	じげん	1.9	2.2	3,416		26.2	28.2	11,928		26.2	28.2	11,928		26.2	28.2
沖縄電力	20	23	33,281		2.9	3.4	ブイキューブ	2.9	3.4	29,648		6.5	6.3	19,246		6.5	6.3	19,246		6.5	6.3
電源開発	85.9	94	164,970		8.8	9	エンカレッジ・テクノロジ	8.8	9	12,591		1.7	2.2	1,471		1.7	2.2	1,471		1.7	2.2
エフオン	5.1	7.2	8,071		32.4	38.7	サイバーリンクス	32.4	38.7	125,001		1.6	3.8	8,208		1.6	3.8	8,208		1.6	3.8
イーレックス	15.3	17.3	30,396		11.6	11.9	ディー・エル・イー	11.6	11.9	27,036		7.9	9.2	2,999		7.9	9.2	2,999		7.9	9.2
レノバ	17.8	19.9	74,426		37.5	40.3	フィックスターズ	37.5	40.3	56,460		11.2	12.2	12,322		11.2	12.2	12,322		11.2	12.2
東京瓦斯	207.5	227.3	527,676		5.6	6.3	CARTA HOLDINGS	5.6	6.3	14,565		5.1	4.7	6,283		5.1	4.7	6,283		5.1	4.7
大阪瓦斯	209.3	214.1	432,053		18.5	16.8	オプティム	18.5	16.8	5,796		2.8	8.1	26,365		2.8	8.1	26,365		2.8	8.1
東邦瓦斯	53	58.1	381,136		22.5	25.1	セレス	22.5	25.1	14,809		3.5	3.8	10,260		3.5	3.8	10,260		3.5	3.8
北海道瓦斯	5.8	6.6	10,791		1.7	1.7	S H I F T	1.7	1.7	2,327		2.8	5.2	67,288		2.8	5.2	67,288		2.8	5.2
広島ガス	22.4	25.4	9,804		2.8	2.5	ティーガイア	2.8	2.5	14,809		9.4	12.3	23,628		9.4	12.3	23,628		9.4	12.3
西岡瓦斯	12.1	13.3	39,806		1.1	1.7	セック	1.1	1.7	2,327		1.5	1.7	4,836		1.5	1.7	4,836		1.5	1.7
静岡ガス	30.6	33.5	33,165		6.2	6.4	日本アジアグループ	6.2	6.4	7,628		11.1	11.2	14,425		11.1	11.2	14,425		11.1	11.2
メタウォーター	5.2	13.4	30,860		1.8	2.1	豆蔵ホールディングス	1.8	2.1	2,480		7.2	-	-		7.2	-	-		7.2	-
陸運業 (3.6%)					8.4	9.6	テックマトリックス	8.4	9.6	9,177		7.4	17.9	34,708		7.4	17.9	34,708		7.4	17.9
SBSホールディングス	9.3	8.7	22,011		2.2	2.2	プロシッパ	2.2	2.2	2,296		3.1	3.4	4,848		3.1	3.4	4,848		3.1	3.4
東武鉄道	113.7	123.2	394,240		3.1	3	ポネ・オンライン・エンターテイメント	3.1	3	4,266		25.5	27.9	73,181		25.5	27.9	73,181		25.5	27.9
相鉄ホールディングス	34.5	40.5	106,393		8.7	8.5	GMOペイメントゲートウェイ	8.7	8.5	3,995		17.4	24.6	378,594		17.4	24.6	378,594		17.4	24.6
東急	271.9	298.1	432,245		58.5	62.4	ザッパラス	58.5	62.4	123,614		5.6	4.6	2,093		5.6	4.6	2,093		5.6	4

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株
ODKソリューションズ	—	—	—	—	—	—	ベース	—	—	—	—	—	ゼンリン	—	—	—	—	—	—	
フリービット	6.3	6.9	1,550	6.3	6.9	1,550	フォーカスシステムズ	6.5	7.7	5,420	6.5	7.7	5,420	21.1	21.1	29,505	21.1	21.1	29,505	
コムチュア	11.8	10.7	33,116	11.8	10.7	33,116	フレスコ	6.5	7.9	11,194	6.5	7.9	11,194	5.4	4.4	2,050	5.4	4.4	2,050	
サイバーコム	1.8	2.1	3,654	1.8	2.1	3,654	フジ・メディア・ホールディングス	101.9	120.1	159,372	101.9	120.1	159,372	8.8	10.0	1,950	8.8	10.0	1,950	
アステリア	6.4	8.3	8,715	6.4	8.3	8,715	オービック	36.7	36.6	718,824	36.7	36.6	718,824	5.4	6.6	9,168	5.4	6.6	9,168	
アール	3.8	6.5	10,276	3.8	6.5	10,276	ジャストシステム	17.2	16.5	129,300	17.2	16.5	129,300	7.6	7.6	116,888	7.6	7.6	116,888	
マクラインズ	5.3	4.8	12,086	5.3	4.8	12,086	TDCソフト	9.3	10.2	9,904	9.3	10.2	9,904	63.2	68.5	289,412	63.2	68.5	289,412	
メディカル・データ・ビジョン	8.1	13.2	33,950	8.1	13.2	33,950	Zホールディングス	1,452.9	1,593.8	1,063,064	1,452.9	1,593.8	1,063,064	4.9	3.8	76,646	4.9	3.8	76,646	
gumi	13.6	16	14,672	13.6	16	14,672	トレンドマイクロ	47	61.9	372,019	47	61.9	372,019	281.7	309	518,193	281.7	309	518,193	
ショーケース	2.4	2.4	2,409	2.4	2.4	2,409	IDホールディングス	4.1	4.5	5,728	4.1	4.5	5,728	1.3	1.7	7,633	1.3	1.7	7,633	
モバイルファクトリー	2.3	2.4	2,680	2.3	2.4	2,680	日本オラクル	21.4	23.5	301,035	21.4	23.5	301,035	1.8	4	7,236	1.8	4	7,236	
テラスカイ	3.8	3.7	14,152	3.8	3.7	14,152	アルファシステムズ	3.3	3.1	11,966	3.3	3.1	11,966	23.7	24	58,080	23.7	24	58,080	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	4.7	5.1	8,221	4.7	5.1	8,221	フューチャー	12.7	14	27,356	12.7	14	27,356	45.1	49.5	346,995	45.1	49.5	346,995	
PCIホールディングス	2.1	4.4	6,116	2.1	4.4	6,116	CAC Holdings	6.8	7.5	10,725	6.8	7.5	10,725	11.3	12.2	17,677	11.3	12.2	17,677	
パイプHD	1.3	2.4	3,796	1.3	2.4	3,796	S Bテクノロジ	3.8	4.2	12,999	3.8	4.2	12,999	49.9	49.7	339,948	49.9	49.7	339,948	
アイビジー	1.9	1.9	2,101	1.9	1.9	2,101	トーセ	2.9	3.3	2,653	2.9	3.3	2,653	2	5.3	7,234	2	5.3	7,234	
ネオジャパン	1.9	2.2	4,052	1.9	2.2	4,052	オービックビジネスコンサルタント	10.8	11.9	80,920	10.8	11.9	80,920	6.7	7.3	9,117	6.7	7.3	9,117	
P R T I M E S	0.9	2.4	8,964	0.9	2.4	8,964	伊藤忠テクノソリューションズ	48.2	52.9	195,730	48.2	52.9	195,730	24.4	26.8	179,024	24.4	26.8	179,024	
ランドコンピュータ	1.6	1.5	1,707	1.6	1.5	1,707	アイティフォー	12.9	15.1	13,741	12.9	15.1	13,741	3.5	3.8	7,923	3.5	3.8	7,923	
ダブルスタンダード	1.3	1.5	6,615	1.3	1.5	6,615	東計電算	1.5	1.8	7,542	1.5	1.8	7,542	10.4	11.3	15,740	10.4	11.3	15,740	
オープンドア	5.2	6.9	14,276	5.2	6.9	14,276	エックスネット	1.6	2.2	2,206	1.6	2.2	2,206	9	9.8	71,050	9	9.8	71,050	
マイネット	3.5	3.8	3,587	3.5	3.8	3,587	大塚商会	57.2	62.8	331,584	57.2	62.8	331,584	13.6	12.3	70,479	13.6	12.3	70,479	
アカツキ	3.8	4.6	19,964	3.8	4.6	19,964	サイボウズ	12.3	13.5	37,732	12.3	13.5	37,732	34.8	37.3	75,980	34.8	37.3	75,980	
ベネフィットジャパン	0.8	0.9	1,746	0.8	0.9	1,746	ソフトブレーン	6.2	—	—	6.2	—	—	38.5	42.1	309,435	38.5	42.1	309,435	
Ubicomホールディングス	2.3	3	9,720	2.3	3	9,720	電通国際情報サービス	6.5	14.4	58,032	6.5	14.4	58,032	4.2	5.3	20,908	4.2	5.3	20,908	
LINE	24.2	—	—	24.2	—	—	ACC E S S	—	10.8	8,424	—	10.8	8,424	7.1	7.8	11,832	7.1	7.8	11,832	
カナミックネットワーク	6.4	10.6	7,706	6.4	10.6	7,706	デジタルガレージ	19.1	19.1	77,164	19.1	19.1	77,164	9.3	11.5	25,656	9.3	11.5	25,656	
ノムラシステムコーポレーション	2.3	5.1	1,907	2.3	5.1	1,907	イーエムシステムズ	14.9	19.2	18,316	14.9	19.2	18,316	839.5	920.5	8,730,942	839.5	920.5	8,730,942	
チェンジ	2.1	16.2	58,887	2.1	16.2	58,887	ウェザーニューズ	3.6	3.4	17,612	3.6	3.4	17,612	0.9	0.6	604	0.9	0.6	604	
シンクロ・フード	4.6	6.9	2,566	4.6	6.9	2,566	C I J	7.9	7.9	7,149	7.9	7.9	7,149	4.1	4.7	5,729	4.1	4.7	5,729	
オークネット	6.5	6.1	8,021	6.5	6.1	8,021	ビジネスエンジニアリング	1.2	1.2	4,080	1.2	1.2	4,080	—	1.6	2,544	—	1.6	2,544	
キャピタル・アセット・プランニング	—	—	—	—	—	—	日本エンタープライズ	10.8	11.6	2,865	10.8	11.6	2,865	2.4	2.4	12,768	2.4	2.4	12,768	
セググループ	1.7	2.9	3,775	1.7	2.9	3,775	WOWOW	5.1	5.7	16,404	5.1	5.7	16,404	9.9	9.4	10,020	9.9	9.4	10,020	
エイトレッド	1.3	2.2	5,717	1.3	2.2	5,717	スカラ	7.5	10.3	8,549	7.5	10.3	8,549	3.1	3.3	5,240	3.1	3.3	5,240	
AOI TYO HOLDINGS	10.7	12	5,580	10.7	12	5,580	インテリジェント ウェブ	4	6.9	4,974	4	6.9	4,974	8.5	9.3	45,570	8.5	9.3	45,570	
マクромリ	18.9	23.6	20,437	18.9	23.6	20,437	IMAGICA GROUP	9	10	4,030	9	10	4,030	1.6	1.6	6,400	1.6	1.6	6,400	
ビョーグリー	2	2.3	4,054	2	2.3	4,054	ネットワンシステムズ	40.3	47.3	172,172	40.3	47.3	172,172	3.9	3.8	13,813	3.9	3.8	13,813	
オロ	2.8	3.6	13,860	2.8	3.6	13,860	システムソフト	26.3	25.5	3,162	26.3	25.5	3,162	8.2	10.2	5,783	8.2	10.2	5,783	
ユーザローカル	—	1.8	7,560	—	1.8	7,560	アルゴグラフィックス	9	9	28,305	9	9	28,305	586.6	641.6	168,740	586.6	641.6	168,740	
テモナ	1.3	2.5	2,527	1.3	2.5	2,527	メーベラス	16.1	18.2	16,398	16.1	18.2	16,398	118	120.7	267,471	118	120.7	267,471	
ニーズウェル	1.2	2.2	1,515	1.2	2.2	1,515	エイベックス	18.2	19.9	28,536	18.2	19.9	28,536	29.9	30.8	27,812	29.9	30.8	27,812	
サンポスト	1.6	2.6	2,631	1.6	2.6	2,631	日本ユニシス	33	40.3	143,266	33	40.3	143,266	1.5	1.6	2,657	1.5	1.6	2,657	
ソルクシーズ	4.5	4.4	4,386	4.5	4.4	4,386	兼松エレクトロニクス	5.7	6.4	24,576	5.7	6.4	24,576	5.6	6.5	6,051	5.6	6.5	6,051	
フェイス	3.8	3.6	3,002	3.8	3.6	3,002	都築電気	—	4.3	6,712	—	4.3	6,712	11.2	12.3	20,750	11.2	12.3	20,750	
プロトコーポレーション	9.5	10.4	12,823	9.5	10.4	12,823	TBSホールディングス	64.4	76.9	170,641	64.4	76.9	170,641	36.6	80.4	244,014	36.6	80.4	244,014	
ハイマックス	1.2	2.9	4,355	1.2	2.9	4,355	日本テレビホールディングス	88.3	96.6	137,751	88.3	96.6	137,751	—	2	1,088	—	2	1,088	
野村総合研究所	149.9	211.8	751,890	149.9	211.8	751,890	朝日放送グループホールディングス	10.5	12.1	8,796	10.5	12.1	8,796	15.2	16.7	35,003	15.2	16.7	35,003	
サイバネットシステム	7.5	8.2	8,077	7.5	8.2	8,077	テレビ朝日ホールディングス	29.1	35.8	77,614	29.1	35.8	77,614	3.8	4	4,268	3.8	4	4,268	
CEホールディングス	6.1	6.2	3,844	6.1	6.2	3,844	スカパーJ SATホールディングス	69.6	76.3	37,844	69.6	76.3	37,844	9.1	10.6	90,312	9.1	10.6	90,312	
日本システム技術	1.7	2.1	3,303	1.7	2.1	3,303	テレビ東京ホールディングス	8.7	8.5	21,173	8.7	8.5	21,173	25.3	27.7	61,909	25.3	27.7	61,909	
インテジホールディングス	13.3	14.4	17,323	13.3	14.4	17,323	日本BS放送	3.6	4.1	4,825	3.6	4.1	4,825	4	5.1	13,882	4	5.1	13,882	
東邦システムサイエンス	2.9	3	2,817	2.9	3	2,817	ビジョン	9.9	14.2	14,185	9.9	14.2	14,185	—	2.5	4,362	—	2.5	4,362	
ソースネクスト	50.2	54.7	17,230	50.2	54.7	17,230	スマートバリュー	3.1	3.1	2,938	3.1	3.1	2,938	20	20.6	17,180	20	20.6	17,180	
インフォコム	11.5	10.6	32,489	11.5	10.6	32,489	USEN-NEXT HOLDINGS	4	4.4	7,810	4	4.4	7,810	8.3	9.2	8,914	8.3	9.2	8,914	
HEROZ	0.5	3.2	9,888	0.5	3.2	9,888	ワイヤレスゲート	5	4.8	3,124	5	4.8	3,124	6	6.8	6,038	6	6.8	6,038	
ラクスル	5.6	9.4	38,493	5.6	9.4	38,493	コネクシオ	6	6.7	9,393	6	6.7	9,393	11.1	12.2	26,242	11.1	12.2	26,242	
I P S	—	2.1	5,592	—	2.1	5,592	日本通信	81.8	102	20,910	81.8	102	20,910	2.3	2.3	2,449	2.3	2.3	2,449	
F I G	11.6	12.6	3,376	11.6	12.6	3,376	クロップス	1.9	2.3	1,826	1.9	2.3	1,826	4.6	4.9	3,278	4.6	4.9	3,278	
システムサポート	0.9	3.4	5,215	0.9	3.4	5,215	日本電信電話	1,414.3	1,357.1	3,781,559	1,414.3	1,357.1	3,781,559							

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末				
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株	株	数
スターティアホールディングス			千円			千円	佐藤商事			千円			スズケン			千円			千株			千円
コマダホールディングス	23.2	23.2	2.4	25.4	50,342	2,454	菱洋エレクトロ	10.8	10.8	9,850	10	10	ジェコス	7.3	7.3	45	49.3	45	49.3	212,236	8.2	7,986
ピーバンドットコム	—	—	1.5	1,426	—	1,426	東京産業	9.6	9.6	25,678	11	11	グローセル	9.4	12.9	9.4	12.9	9.4	12.9	6,566		
アセンテック	0.8	0.8	2.9	5,417	—	5,417	ユアサ商事	10.1	10.1	7,370	12	12	<b>小売業 (4.7%)</b>									
富士興産	3.3	3.3	3.5	4,665	—	4,665	神鋼商事	2.7	2.7	39,480	2.7	2.7	ローン	26.8	29.5	2.7	29.5	26.8	29.5	158,710		
協栄産業	1.2	1.2	1.5	2,095	—	2,095	トルク	6.3	6.3	5,402	5.8	5.8	サンエー	8.9	8.8	8.9	8.8	8.9	8.8	37,708		
小野建	9.6	10.7	13,407	—	13,407	13,407	阪和興業	19.9	19.9	2,700	23.2	23.2	カワチ薬品	8.3	8.1	8.3	8.1	8.3	8.1	24,624		
南陽	2.1	2.1	3,540	—	3,540	3,540	正栄食品工業	6.8	6.8	1,548	7.5	7.5	イーピーシー・マート	16.6	18.1	16.6	18.1	16.6	18.1	117,107		
佐島電機	7.9	7.4	5,638	—	5,638	5,638	カナデン	8.6	8.6	68,092	9.6	9.6	ハードオフコーポレーション	4.2	5.4	4.2	5.4	4.2	5.4	4,266		
エコトレーディング	2.3	2.6	1,799	—	1,799	1,799	菱電商事	7.6	7.6	12,220	8.4	8.4	アスフル	11.1	10.1	11.1	10.1	11.1	10.1	39,137		
伯東	6.5	7.1	9,201	—	9,201	9,201	フルサト工業	5.9	5.9	8,366	6.3	6.3	ゲオホールディングス	19.1	15.6	19.1	15.6	19.1	15.6	19,874		
コンドーテック	8.3	9.2	9,926	—	9,926	9,926	岩谷産業	23.6	23.6	180,234	27.9	27.9	アダグストリア	14.7	16.1	14.7	16.1	14.7	16.1	34,212		
中山福	6.2	7.1	3,819	—	3,819	3,819	ナイス	4.6	4.6	7,764	4.7	4.7	ジープット	6.4	7.6	6.4	7.6	6.4	7.6	3,268		
ナガイレーベン	15.4	15.5	48,205	—	48,205	48,205	昭光通商	3.5	3.5	2,291	3.4	3.4	シー・ヴィー・エス・バイエリア	1.5	2	1.5	2	1.5	2	840		
三菱食品	11.6	12.9	37,474	—	37,474	37,474	ニチモウ	1.7	1.7	3,086	1.6	1.6	くら寿司	5.5	6.9	5.5	6.9	5.5	6.9	46,713		
松田産業	7.8	8.5	16,192	—	16,192	16,192	極東貿易	3.1	3	4,215	3	3	キャンドウ	5.1	5.6	5.1	5.6	5.1	5.6	10,651		
第一興商	15.8	17.3	69,373	—	69,373	69,373	イワキ	14	14	9,910	15.2	15.2	アイケイ	—	2.5	—	2.5	—	2.5	2,247		
メディアルホールディングス	114.6	116.7	261,174	—	261,174	261,174	三菱石油	26.1	26.1	32,344	28.7	28.7	バルブルーホールディングス	5.4	10.2	5.4	10.2	5.4	10.2	16,932		
S P K	2.2	5.2	6,812	—	6,812	6,812	稲畑産業	23.4	23.4	45,393	27.9	27.9	エディオン	48.8	49.3	48.8	49.3	48.8	49.3	53,441		
萩原電気ホールディングス	4	4.4	12,315	—	12,315	12,315	G S I クレオス	2.5	2.5	6,104	2.8	2.8	サラーコーポレーション	21.6	23.9	21.6	23.9	21.6	23.9	14,005		
アズワン	6.9	8.3	127,820	—	127,820	127,820	明和産業	9.8	9.8	5,076	10.8	10.8	ワッツ	4.8	5.2	4.8	5.2	4.8	5.2	4,664		
スズデン	3.7	3.5	4,389	—	4,389	4,389	クワザホールディングス	3.8	3.8	2,961	4.4	4.4	ハローズ	4	4.4	4	4.4	4	4.4	13,860		
尾家産業	3.1	3	3,978	—	3,978	3,978	ヤマエ久野	—	—	9,613	8.5	8.5	フジフードグループ本社	9	9.8	9	9.8	9	9.8	12,828		
シモンヤ	6.5	6.5	9,145	—	9,145	9,145	ワキタ	22.6	22.9	23,541	22.9	22.9	あみやき亭	2.2	2.5	2.2	2.5	2.2	2.5	7,377		
ドウシヤ	10.1	11	20,680	—	20,680	20,680	東邦ホールディングス	34.1	37.3	77,994	37.3	37.3	ひらまつ	19.6	21.9	19.6	21.9	19.6	21.9	3,810		
小津産業	2.3	2.3	4,397	—	4,397	4,397	サンゲツ	29.2	31.5	52,542	31.5	31.5	大黒天物産	2.5	2.7	2.5	2.7	2.5	2.7	16,200		
高速	3.3	6.3	10,111	—	10,111	10,111	ミックログループホールディングス	15.7	17.1	21,665	17.1	17.1	ハニースホールディングス	9.4	9.1	9.4	9.1	9.4	9.1	9,236		
たけびし	6.5	3.5	5,565	—	5,565	5,565	シナネンホールディングス	4.4	4.3	14,061	4.3	4.3	ファーマライズホールディングス	2.5	3.3	2.5	3.3	2.5	3.3	2,577		
リックス	2.3	2.2	3,773	—	3,773	3,773	伊藤忠エネクス	23.5	26	26,910	26	26	アルペン	8.2	8.9	8.2	8.9	8.2	8.9	20,105		
丸文	9.4	10.6	5,989	—	5,989	5,989	サンリョウ	29.8	32.6	55,452	32.6	32.6	ハブ	3.1	3.6	3.1	3.6	3.1	3.6	2,538		
ハピネット	8.9	9.7	16,266	—	16,266	16,266	サンワ テクノス	7.5	7.6	8,436	7.6	7.6	クオールホールディングス	15.6	15.7	15.6	15.7	15.6	15.7	22,011		
橋本総業ホールディングス	2.1	2	5,008	—	5,008	5,008	リョーサン	11.7	12.8	30,438	12.8	12.8	ジンスホールディングス	5.6	6.2	5.6	6.2	5.6	6.2	45,198		
日本ライフライン	31.4	37.6	55,384	—	55,384	55,384	新光商事	16.7	15.9	12,497	15.9	15.9	ビックカメラ	62.9	69	62.9	69	62.9	69	84,594		
タカショー	5.4	7.4	5,653	—	5,653	5,653	トーホー	4.8	5.4	10,303	5.4	5.4	DCMホールディングス	57.3	71.9	57.3	71.9	57.3	71.9	78,083		
エクセル	3.1	—	—	—	—	—	三信電気	5.7	6.4	13,344	6.4	6.4	ペッパーフードサービス	8.5	13.2	8.5	13.2	8.5	13.2	3,722		
マルカ	3.8	3.8	7,527	—	7,527	7,527	東陽テクニカ	12.2	12.2	14,554	12.2	12.2	MonotaRO	75.5	82.8	75.5	82.8	75.5	82.8	475,272		
I DOM	28.7	39.3	26,095	—	26,095	26,095	モスフードサービス	14	16.5	51,315	16.5	16.5	東京一番フーズ	2.7	2.6	2.7	2.6	2.7	2.6	1,534		
進和	6.3	7	15,638	—	15,638	15,638	加賀電子	10.6	10.5	26,901	10.5	10.5	DDホールディングス	4.2	5.2	4.2	5.2	4.2	5.2	3,556		
エスケイジャパン	2.2	2.7	1,236	—	1,236	1,236	ソーダニッカ	10.8	11.3	6,102	11.3	11.3	きちりホールディングス	2.9	3.4	2.9	3.4	2.9	3.4	2,080		
ダイトロン	4.5	5	8,300	—	8,300	8,300	立花エレテック	7.9	8.7	14,215	8.7	8.7	アークランドサービスホールディングス	7.8	9.7	7.8	9.7	7.8	9.7	21,262		
シークス	13.5	14.8	24,375	—	24,375	24,375	フォーバル	4.7	4.3	3,650	4.3	4.3	J. フロント リテイリング	126.8	139	126.8	139	126.8	139	139,139		
田中商事	3.4	3.1	2,176	—	2,176	2,176	P A L T A C	17	18.7	108,273	18.7	18.7	ドトール・イレズホールディングス	16.9	18.4	16.9	18.4	16.9	18.4	30,875		
オーハシテクニカ	5.9	6.2	8,500	—	8,500	8,500	三谷産業	14.2	15.6	7,098	15.6	15.6	マツモトキヨシホールディングス	43.9	48.1	43.9	48.1	43.9	48.1	222,222		
白銅	3.9	3.6	5,320	—	5,320	5,320	太平洋興発	4.1	5.1	3,274	5.1	5.1	ブロンコビリー	5.5	6.1	5.5	6.1	5.5	6.1	14,139		
ダイコー通産	—	1.1	1,741	—	1,741	1,741	smiellacホールディングス	1.9	2.6	7,254	2.6	2.6	ZOZO	73	68.7	73	68.7	73	68.7	246,976		
伊藤忠商事	742.8	814.6	2,526,074	—	2,526,074	2,526,074	ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.8	1.1	1,706	1.1	1.1	トレジャー・ファクトリー	3.2	3.4	3.2	3.4	3.2	3.4	2,760		
丸紅	1,105.3	1,148.1	853,956	—	853,956	853,956	コア商事ホールディングス	—	3.3	4,524	3.3	3.3	物語コーポレーション	2.7	3.1	2.7	3.1	2.7	3.1	37,541		
高島	1.6	1.6	2,710	—	2,710	2,710	国際紙パルプ商事	25.2	25.5	6,273	25.5	25.5	ココカラファイン	11.1	10.4	11.1	10.4	11.1	10.4	79,560		
長瀬産業	59.8	65.5	114,297	—	114,297	114,297	ヤマタネ	5.3	5.3	7,568	5.3	5.3	三協伊勢丹ホールディングス	185.6	203.4	185.6	203.4	185.6	203.4	150,516		
蝶理	6.8	7.5	12,412	—	12,412	12,412	丸紅建材リース	1	0.9	1,655	0.9	0.9	Hamee	3.3	2.9	3.3	2.9	3.3	2.9	5,121		
豊田通商	118.5	116.9	550,599	—	550,599	550,599	日鉄物産	7.5	8.3	32,079	8.3	8.3	ウエルシアホールディングス	31.6	61.5	31.6	61.5	31.6	61.5	222,630		
三共生興	16	18	9,396	—	9,396	9,396	泉州電業	3.3	3.3	11,022	3.3	3.3	クワイエSDホールディングス	17.8	17.1	17.8	17.1	17.8	17.1	60,277		
兼松	39.6	46.5	67,378	—	67,378	67,378	トラスコ中山	22.1	26.7	76,655	26.7	26.7	丸善CHホールディングス	12.4	15.4	12.4	15.4	12.4	15.4	5,790		
ツカモトコーポレーション	1.8	1.7	2,585	—	2,585	2,585	オートバックスセブン	39.4	43.2	61,646	43.2	43.2	ミザウ	2.1	2.4	2.1	2.4	2.1	2.4	1,608		
三井物産	933.4	945.5	1,900,455	—	1,900,455	1,900,455	モリト	7.8	9													

銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末			銘柄	期首(前期末)			当期 末								
	株	数	価 値	株	数	評 価		株	数	価 値	株	数	評 価		株	数	価 値	株	数	評 価	株	数	評 価			
		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		千株	千円		
ゴルフダイジェスト・オンライン	4.9	6	5,916				SRSホールディングス	12.5	14.6	12,585			ヤマザワ	2	2.6	4,555										
B E E N O S	4	5.4	12,792				千趣会	19.2	20.9	7,064			やまや	2.1	2.5	5,577										
あさひ	8	8.6	13,975				タカキュー	8.6	9.9	1,485			ペルーナ	22.7	25	26,350										
日本調剤	3.3	7.1	11,786				リテールパートナーズ	-	14.1	19,711			<b>銀行業 (4.7%)</b>													
コスモス薬品	4.7	11.8	197,296				ケーヨー	21.8	21.6	16,372			島根銀行	2.1	4.3	2,906										
トーエル	5.2	5.7	4,776				上新電機	12.5	13.7	42,744			じもとホールディングス	72.2	8	6,648										
オンライン	1.8	2.6	1,209				日本瓦斯	16.8	19.2	100,800			めがきフィナンシャルグループ	552.6	604.6	130,593										
セブ&アイ・ホールディングス	415.4	455.6	1,935,388				ロイヤルホールディングス	18.6	20.3	38,955			東京さほしフィナンシャルグループ	14.4	14.6	17,052										
クワイート・レストラン・ホールディングス	28.6	62.5	55,437				東天紅	0.8	0.6	554			九州フィナンシャルグループ	174.5	238	105,196										
ツルハホールディングス	23.1	25.4	372,110				いなげや	13.2	13	22,750			ゆうちょ銀行	301.3	330.8	318,560										
サンマルクホールディングス	8.4	9.1	14,696				島忠	20	-	-			富士第一銀行	25.4	28.6	8,608										
フェリシモ	2.3	2.6	3,458				チヨダ	11.1	12.2	12,285			コンコディア・フィナンシャルグループ	625.3	709.7	291,686										
トリドールホールディングス	13.2	28.8	47,001				ライフコーポレーション	8.1	8.8	29,656			西日本フィナンシャルホールディングス	72.5	77.6	53,388										
TOKYO BASE	9.6	10.4	6,905				リンガーハット	13.1	14.4	35,913			関西みらいフィナンシャルグループ	62.4	54.8	31,181										
ウィルバスホールディングス	1.6	1.9	1,575				M r M a x H D	14.6	15.9	12,465			三十三フィナンシャルグループ	9.9	10.2	13,637										
JMホールディングス	5.4	8.8	18,647				テンアライド	9.8	11.7	4,223			新設越フィナンシャルグループ	18.5	19	44,270										
サツドラホールディングス	1.5	1.5	3,097				AOKIホールディングス	21.2	23.1	14,691			ひろさんホールディングス	-	172.2	110,380										
アレナホールディングス	5.3	6.7	9,339				オークワ	16.6	18.2	23,314			新生銀行	78	95.1	131,428										
軌道トヨホホールディングス	1.6	3	5,172				コメリ	16.4	18	51,948			あおぞら銀行	63.3	69.4	148,169										
パロックスジャパンリミテッド	7.3	8.1	6,625				青山商事	21.9	25.7	18,735			三井住友フィナンシャル・グループ	7,320.8	7,977.2	4,144,953										
グスノアホールディングス	9.5	11.6	102,544				しまむら	12.3	13.5	157,545			りそなホールディングス	1,167	1,267.6	513,758										
かの源ホールディングス	4.8	5.4	3,520				はせがわ	5.3	5.2	1,549			三井住友トラスト・ホールディングス	201	220.5	771,529										
スシローホールディングス	11.6	63.9	269,658				高島屋	77.4	84.7	93,000			三井住友フィナンシャルグループ	735.5	807.1	2,881,347										
L I X I L ビバ	10.5	-	-				松屋	21.4	25.4	24,384			千葉銀行	365.7	388.8	250,776										
メディカルシステムネットワーク	10.3	10.2	7,701				エイチ・ツー・オー リテイリング	50.3	55	45,815			群馬銀行	209	239.8	81,532										
はるやまホールディングス	4.5	6.1	4,385				近鉄百貨店	4	4.5	15,277			武蔵野銀行	15.8	17.3	28,233										
ノジマ	18.9	20.7	57,525				丸コ	10.2	-	-			千葉興業銀行	29.2	29.8	7,688										
カッパ・クリエイト	14.9	16.4	25,420				丸井グループ	97.3	98.5	207,539			筑波銀行	44.4	48.4	9,002										
ライトオン	8	8.8	5,737				アグシアル リテイリング	8.8	9.7	48,694			七十七銀行	35.9	36.6	51,715										
ジーンズメイト	3.4	3.6	1,130				井筒屋	5.8	6.3	1,417			青森銀行	8.3	9	22,077										
良品計画	141	154.5	391,348				イオン	408.7	448.1	1,543,704			秋田銀行	6.8	7.1	10,089										
三城ホールディングス	11.5	14.9	4,410				イズミ	21.6	23.6	95,580			山形銀行	11.9	13	13,884										
アドヴァン	16.2	12	13,560				平和堂	21.5	21.5	47,558			岩手銀行	6.9	7.6	15,481										
アルビス	4	3.7	9,375				フジ	12.9	14.1	28,482			東邦銀行	95.1	104.1	22,069										
コナカ	12.5	14.1	4,808				ヤオコー	12	13.2	92,004			東北銀行	5.1	5.9	6,578										
ハウス オブ ローゼ	1.3	1.2	2,034				ゼビオホールディングス	12.9	14	13,440			みちのく銀行	6.8	7.5	7,792										
G-7ホールディングス	6.2	6.9	16,870				ケーズホールディングス	102.5	103.7	153,683			みくおフィナンシャルグループ	89.5	105.1	216,716										
イオン北海道	10.7	15.6	16,426				Olympicグループ	5.5	6	5,526			静岡銀行	263.3	283.9	230,526										
ゴジマ	18.3	19.9	13,273				日産東京販売ホールディングス	15.9	14.3	3,875			十六銀行	13.4	14.6	29,127										
ヒマラヤ	3.5	4.3	4,067				シルバライフ	-	1.6	3,393			スルガ銀行	108.8	101.6	34,645										
コーナン商事	15.1	16.6	49,401				一家ダニングプロジェクト	-	1.1	687			八十二銀行	256.7	262.3	97,051										
エコス	3.9	4.3	8,380				Genky DrugStores	5.2	5.1	20,145			山梨中央銀行	12.3	13.6	11,655										
ワタミ	12.5	15.3	15,682				ナルミヤ・インターナショナル	1.8	2.3	2,263			大垣共立銀行	21	23	47,817										
マルシェ	2.9	3	1,524				聯合メディカルホールディングス	9.3	-	-			福井銀行	9.1	10	19,210										
パルティフィ・インターナショナルホールディングス	233.4	232.8	572,688				フクオクグループホールディングス	6.2	6.8	5,997			北國銀行	10.9	10.9	28,797										
西松屋チェーン	23.3	25.5	38,683				ギフト	-	1.1	2,302			清水銀行	4.4	4.9	8,374										
ゼンショーホールディングス	50.9	62.5	181,312				アインホールディングス	13.1	16.9	122,525			富士銀行	2	1.9	5,449										
幸楽苑ホールディングス	6.7	7.3	12,942				元氣寿司	2.7	3.2	8,102			滋賀銀行	21.3	23.3	46,157										
ハウスレイ	2	2	1,852				ヤマダホールディングス	323.6	390.2	214,610			南都銀行	17.6	17	30,685										
サイゼリヤ	17.5	17.2	37,083				アークランドサカモト	16.6	18.2	28,301			百五銀行	95.7	105.2	32,401										
V Tホールディングス	44.1	43.9	19,140				ニトリホールディングス	46	46.3	954,011			京都銀行	38	41.7	254,787										
魚力	3	3.5	6,443				グルメ軒屋	7.5	8.4	8,509			紀陽銀行	37.6	41.3	58,728										
ポプラ	2.8	3.3	1,135				愛眼	8.3	7.6	1,770			ほくほくフィナンシャルグループ	70.7	77.5	75,950										
フジ・コーポレーション	2.9	3.1	6,993				ケーユーホールディングス	5.5	6	5,088			広島銀行	157.1	-	-										
ユナイテッドアローズ	11.1	13.2	26,637				吉野家ホールディングス	34.9	38.2	84,956			山陰合同銀行	63	73.6	36,652										
ハイデイド高	15.3	16.8	31,197				松屋フーズホールディングス	5.1	5.6	20,524			中国銀行	91.5	100.4	86,344										
京都さきもの友禅	7	6.4	1,561				サガミホールディングス	14.2	15.7	19,106			鳥取銀行	3.7	4	4,480										
コウイド	35.3	38.6	76,775				関西スーパーマーケット	8.9	8.8	10,419			伊予銀行	151.7	154.6	99,717										
ピーシーゴコポレーション	14.1	13.6	8,214				王将フードサービス	7.8	7.7	46,354			百十四銀行	11.3	12.2	19,202										
壺番屋	7.4	8.2	42,640				プレナス	11.9	13.2	26,386			四国銀行	16.1												

銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末			銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株		株	数	千株	株	数	千株
山口フィナンシャルグループ	132.8		145.4	92,474		千円	アコム	213.7		234.5	110,684	日興グループホールディングス	15.7		17.6	7,990				
長野銀行	3.5		3.9	4,992			ジャックス	11.7		12.8	27,377	日本エスコ	19.2		21.1	16,521				
名古屋銀行	8.6		9.4	26,263			オリエントコーポレーション	287.8		315.1	45,059	タカラレーベン	48.7		48.6	16,961				
北洋銀行	160.2		176	40,832			日立キャピタル	25.1		27.5	79,227	AVANTIA	6		6.6	6,072				
愛知銀行	3.9		3.9	11,352			アプラスフィナンシャル	51.2		-	-	イオンモール	53.3		58.4	108,215				
中京銀行	4.4		4.3	7,817			オリックス	665.2		723.4	1,331,779	毎日コムネット	2.2		3.5	2,418				
大光銀行	3.7		3.5	4,501			三菱UFJリソース	269.9		262.4	149,830	ファースト住建	4.6		5	5,535				
愛媛銀行	14.9		16.5	16,153			九州リースサービス	5		6.5	4,257	ランド	589.5		624.6	6,246				
トマト銀行	4.1		4.5	4,810			日本取引所グループ	305.3		315	800,257	カチタス	13.2		28.9	90,746				
京葉銀行	45.3		49.7	21,718			イー・ギャランティ	11.4		13.3	32,731	トーセイ	14.7		16.1	17,339				
栃木銀行	51.4		56.1	10,210			アサックス	5.5		6.5	4,888	穴吹興産	2.2		2.7	4,514				
北日本銀行	3.4		3.7	7,078			NECキャピタルソリューション	4.3		4.8	9,777	サンフロンティア不動産	14.7		14.1	13,352				
東和銀行	18.7		20.5	14,022			<b>不動産業 (2.0%)</b>					エフ・ジェー・ネクスト	9.3		11.6	13,282				
福島銀行	10.4		13.2	3,009			いちご	135.3		129.6	41,990	インテリックス	3.1		2.7	1,490				
大東銀行	5.6		5.9	3,829			日本駐車場開発	117.2		115.5	16,747	ランドビジネス	4.3		4.4	1,491				
トモニホールディングス	82.3		90.1	29,012			スター・マイカ・ホールディングス	5.5		6.1	7,118	サンネクスタグループ	2.8		3.8	3,701				
フィデアホールディングス	103.6		114	13,224			SREホールディングス	-		1.3	6,175	グランディハウス	8.3		8.1	3,636				
池田泉州ホールディングス	122.8		133.5	21,360			ADワックスグループ	-		22.5	3,555	日本空港ビルデング	34		37.2	212,040				
<b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b>							ヒューリック	227.1		247.2	303,314	<b>サービス業 (5.6%)</b>								
F P G	32.8		35.8	21,515			三栄建築設計	4.3		4.7	8,492	明豊ファシリティワークス	-		5.3	3,614				
ジャフインベストメントアドバイザー	-		5.9	7,634			野村不動産ホールディングス	64.5		70.7	171,094	日本工営	6.9		7.1	19,716				
マセリアインベストメント	4.7		4.8	3,624			三菱建研ホールディングス	21.5		23.7	11,968	LIFULL	36		39.4	17,690				
SBIホールディングス	118.8		143	413,270			サムティ	15.1		16.5	28,578	ミクシィ	-		21.6	54,367				
日本アジア投資	9.3		10.1	2,454			ディア・ライフ	13.7		16.4	7,412	ジェイエイ・リクルーメント	6.9		7.5	14,617				
ジャパコ グループ	16.3		17.9	107,937			コーセーアールイー	3.2		3.5	2,149	日本M&Aセンター	77.8		92.6	561,156				
大和証券グループ本社	853.2		873.3	452,107			イー・ディー・ワークス	201.8		-	-	メンバーズ	3.1		3.3	8,556				
野村ホールディングス	1,871.3		1,780.3	1,072,986			日本商業開発	6.7		7.3	12,629	中広	1.1		1.2	422				
岡三証券グループ	90.6		99.2	39,580			フルサンスコーポレーション	17.4		19.1	28,650	UTグループ	12.1		16.3	58,680				
丸三証券	31.5		34.6	20,414			ユニホルディングス	16		-	-	アイティメディア	3.1		3.7	8,295				
東洋証券	38.2		38.2	5,882			THEグローバル社	5.5		7.3	2,014	タケエイ	9.9		12.5	16,412				
親野フィナンシャルホールディングス	122		123.8	43,082			ハウスコム	1.4		1.2	1,588	E・Jホールディングス	1.2		4.4	4,422				
光世証券	2.5		3	1,962			日本管理センター	7		6.2	7,582	ビーネックスグループ	11.3		14.1	17,568				
水戸証券	30.8		31.2	8,455			サンセイランディング	3.2		3.5	2,618	コジカホールディングス	24.8		26.8	13,480				
いちよし証券	19.8		23.2	13,270			エストラスト	1.4		1.3	929	アルトナー	2.5		2.8	2,514				
松井証券	60.7		57.1	49,962			フージャースホールディングス	21.2		19	13,110	パソナグループ	11.1		12.2	25,010				
だいこう証券ビジネス	5.2		-	-			オープンハウス	30.9		36.7	164,049	CDS	2.5		2.4	3,492				
マネックスグループ	80.3		104.4	73,497			東急不動産ホールディングス	289.3		316.7	206,805	リソバンドモチベーション	22.7		20.7	13,579				
極東証券	14.3		15.7	12,607			飯田グループホールディングス	88.7		97.2	242,319	GCA	12.4		14.6	11,008				
岩井コスモホールディングス	10		11.9	17,980			イープランド	1.7		2.3	1,927	エス・エム・エス	32		38.4	145,344				
監理證券	19.1		21.7	17,913			ムゲンエステート	7.3		7.3	3,577	エーサイドアップグループ	2.3		4	2,720				
マネポートナズグループ	11.5		12.8	2,777			ビーロット	2.4		5.4	3,531	パルニホールディングス	103		113	246,905				
スパークス・グループ	36.8		53.8	16,893			ファーストブラザーズ	2.4		2.2	2,206	リニカル	5		6.5	4,972				
小林洋行	3.2		3	822			ハウスドゥ	5.9		5.6	6,949	クックパッド	36.1		35.6	11,605				
<b>保険業 (1.9%)</b>							シーアールイー	2.7		3	3,777	エスクリ	3.3		3.6	1,299				
かんぽ生命保険	37.6		144.5	324,836			プロ/ティエーエージェント	1.6		1.9	2,603	アイ・ケイ・ケイ	5.1		5.6	3,500				
SOMPOホールディングス	200		205.6	897,855			ケイアイスター不動産	3.4		3.6	9,540	学情	3.7		3.9	5,541				
アコム ホールディングス	8.8		32.8	36,932			アグレ都市デザイン	1.5		2.1	1,644	スタジオアリス	5.2		5.7	12,135				
MS&ADインフラストラクチャーホールディングス	278		283.3	906,560			グッドコムアセット	2.4		5.5	7,293	シミツホールディングス	5.7		5.6	9,088				
ソニーフィナンシャルホールディングス	87.4		-	-			ジェイ・エス・ビー	1.1		2.2	7,821	エプコ	1.6		2.8	2,741				
第一生命ホールディングス	601.8		616	1,114,960			テンポイノベーション	2.4		3.3	3,111	NJS	2.2		2.8	5,656				
東京海上ホールディングス	380.3		386.6	2,135,965			グローバル・リク・マセジント	1.7		2	1,500	総合整備保障	41		45	237,150				
T&Dホールディングス	317.8		348.4	496,818			パーク24	57.1		62.5	142,937	カカコム	77.1		83.5	288,075				
アドバンスクワイエット	2.4		2.4	4,596			バラカ	2.8		3.1	5,118	アイロムグループ	3.7		4	7,684				
<b>その他金融業 (1.1%)</b>							三井不動産	524.5		531.4	1,279,079	セントケア・ホールディング	6.7		8.3	8,466				
全国保証	30		30.3	150,591			三菱地所	745.2		766	1,401,780	サイネックス	1.7		2.2	1,617				
ジェイリース	3		3.8	2,922			平和不動産	19.5		20	76,400	ルネサンス	5.7		7	7,938				
イントラスト	3.8		3.3	2,508			東京建物	116.3		114.9	183,495	ディップ	14.5		17.6	52,553				
日本モーゲージサービス	2.1		5.9	7,056			ダイヤビル	27.4		30.1	38,528	デジタルホールディングス	5.6		7.8	15,748				
CASA	3.7		3.2	3,257			京阪神ビルディング	17.2		20.1	31,778	新日本科学	11.2		13.7	9,439				
アルヒ	16.9		17.1	29,736			住友不動産	239.1		262.1	943,822	ツクイホールディングス	24.3		26.7	18,289				
プレミアアグループ	5.8		5.4	13,300			テオーシー	20.9		22.9	17,518	キャリアデザインセンター	2.7		2.5	2,412				
クレディセゾン	74.5		68	91,868			東京楽天地	1.4		2	9,060	ペムフィット・フン	28.2		41.2	130,810				
芙蓉総合リース	11.1		12.2	93,330			レオパレス21	139.4		96.5	15,729	エムスリー	227.1		199.3	1,717,168				
みずほリース	16.4		18	61,290			スターツコーポレーション	14.5		13.8	39,633	ツカダ・グローバルホールディング	6.7		9.5	2,964				
東京センチュリー	21.4		27.1	237,125			フジ住宅	12.4		13.6	9,125	プラス	0.8		1.5	732				
日本証券金融	46.8		49.4	30,825			空港施設	10.8		12.1	6,497	アウトソーシング	59		64.7	96,532				
アイフル	162.3		195.2	55,436			明和地所	5.9		5.5	3,542	ウエルネット	9.8		11.5	5,681				
リコーリース	8.4		9.2	30,360			ゴールドクレスト	8.4		10.5	18,952	ワールドホールディングス	3.5		3.9	7,889				
イオンフィナンシャルサービス	65.1		71.3	99,748			エスリード	4.2		4.6	7,130	ディー・エヌ・エー	50.5		47.8	100,858				





## (2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期		末
		買 建 額	売 建 額	額
国内	T O P I X	百万円 7,442		百万円 -

## ■投資信託財産の構成

2021年2月8日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
株 式	千円 311,274,068		% 97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,511,950		2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	318,786,019		100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	318,786,019,057円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,651,925,208
株 式(評価額)	311,274,068,500
未 収 入 金	391,827,620
未 収 配 当 金	389,312,729
差 入 委 託 証 拠 金	78,885,000
(B) 負 債	199,379,000
未 払 解 約 金	199,379,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	318,586,640,057
元 次 期 繰 越 損 益 金	102,105,610,506
(D) 受 益 権 総 口 数	216,481,029,551
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	102,105,610,506円
	31,202円

(注1) 期首元本額 98,370,254,055円  
 追加設定元本額 67,069,989,134円  
 一部解約元本額 63,334,632,683円

(注2) 期末における元本の内訳

One DC 国内株式インデックスファンド	15,975,939,497円
DIAM国内株式バッシブ・ファンド	3,179,107,702円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	2,626,890円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	5,088,758円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	8,151,762円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	24,072,359円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	14,018,113円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	12,980,814円
たわらノーロード TOPIX	784,765,731円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	612,281,321円
たわらノーロード バランス(堅実型)	23,454,696円
たわらノーロード バランス(標準型)	140,720,417円
たわらノーロード バランス(積極型)	207,209,167円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(保守型)	1,707,448円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定型)	108,252,549円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(安定成長型)	245,952,107円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(成長型)	166,536,220円
たわらノーロード スマートグローバルバランス(積極型)	228,275,842円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	431,973円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	1,205,302円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	4,833,419円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	2,885,817円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	6,004,044円
DIAM国内株式インデックスファンド<DC年金>	34,764,926,964円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	1,023,160,847円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	3,393,344,349円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	3,451,908,533円
DIAM DC バランス30インデックスファンド	332,009,300円
DIAM DC バランス50インデックスファンド	1,152,607,788円
DIAM DC バランス70インデックスファンド	1,085,041,257円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	35,744,954円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	1,112,139,190円
マネックス資産設計ファンド エゴリレーション	21,186,872円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	313,080,893円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	264,026,418円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	439,000,020円
投資のソムリエ	15,620,354,669円
クルーズコントロール	637,176,611円
投資のソムリエ<DC年金>	960,546,202円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	294,854,779円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	367,544,221円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	6,918,316円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	16,838,854円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	264,587,992円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	2,928,248,506円

投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	19,134,149円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	9,070,573円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	2,599,277円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	42,338,447円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	98,734,309円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,803,475,886円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	265,437,692円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	9,278,066円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	5,239,774円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	5,173,103円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,626,870円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12(適格機関投資家限定)	52,904,100円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	64,217,224円
マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	71,448,850円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	32,545,912円
DIAMワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	41,658,362円
日本資産分散戦略ファンド(インカム重視)(為替ヘッジあり)(適格機関投資家限定)	562,668,029円
インカム重視マルチアセット運用ファンド	85,977,917円
DIAMグローバル・バランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	72,359,909円
DIAMグローバル・バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	128,443,286円
DIAM国際分散バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	7,951,637円
DIAM国際分散バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	35,906,053円
DIAM国内重視バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	8,484,030円
DIAM国内重視バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	3,658,825円
DIAM世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	21,889,554円
DIAM世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	46,792,943円
DIAMバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	689,878,804円
DIAMバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	729,307,036円
DIAMバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	2,064,787,625円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA(適格機関投資家限定)	150,408,971円
DIAMグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	37,142,128円
DIAM アスク グローバル バランスファンド30VA(適格機関投資家限定)	373,020,041円
DIAM世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家限定)	102,439,732円
DIAM世界アセットバランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	1,576,268円
DIAM世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	468,054,341円
DIAM世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	24,008,365円
DIAM世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	99,685,187円
DIAM世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	238,004,405円
DIAM世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	323,286,503円
DIAM世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	45,168,755円
DIAM国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	20,550,710円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1212)(適格機関投資家限定)	362,800,005円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1303)(適格機関投資家限定)	1,106,076,367円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1306)(適格機関投資家限定)	1,467,666,407円
DIAM世界アセットバランスファンド7VA(1309)(適格機関投資家限定)	58,984,178円
期末元本合計	102,105,610,506円

(注3) 担保資産  
 代用として担保を提供している資産はありません。

## ■損益の状況

当期 自2020年2月8日 至2021年2月8日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	5,192,079,491円	
	受取配当金	5,191,315,557	
	受取利息	7,434	
	その他の収益	3,319,941	
	支払利息	△2,563,441	
(B)	有価証券売買損益	32,654,345,029	
	売却益	50,944,545,133	
	売却損	△18,290,200,104	
(C)	先物取引等取引損益	1,230,944,200	
	取引益	2,753,684,220	
	取引損	△1,522,740,020	
(D)	当期損益金(A+B+C)	39,077,368,720	
(E)	前期繰越損益金	171,390,003,476	
(F)	解約差損益金	△99,083,661,761	
(G)	追加信託差損益金	105,097,319,116	
(H)	合計(D+E+F+G)	216,481,029,551	
	次期繰越損益金(H)	216,481,029,551	

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

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (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。

# 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第18期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月15日～2021年2月15日）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入 比率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率	ポイント	期中 騰落率				
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	—	—	百万円 379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346

(注1) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合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ます。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

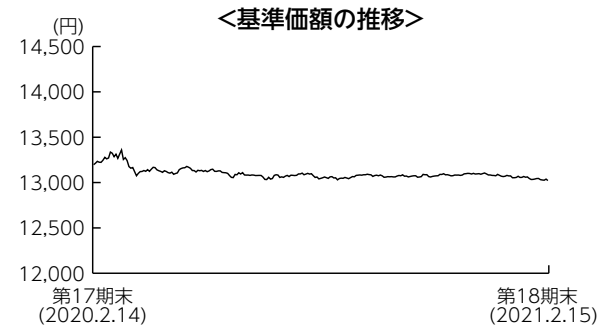
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 率	債券先物 率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期 首) 2020年 2月14日	円 13,197	% -	ポイント 390.72	% -	% 99.4	% -	% -
2 月 末	13,336	1.1	394.74	1.0	101.0	-	-
3 月 末	13,124	△0.6	388.45	△0.6	101.4	-	-
4 月 末	13,169	△0.2	389.79	△0.2	99.4	-	-
5 月 末	13,112	△0.6	388.13	△0.7	99.4	-	-
6 月 末	13,060	△1.0	386.56	△1.1	99.7	-	-
7 月 末	13,104	△0.7	387.91	△0.7	99.5	-	-
8 月 末	13,044	△1.2	386.09	△1.2	100.0	-	-
9 月 末	13,081	△0.9	387.22	△0.9	99.7	-	-
10 月 末	13,059	△1.0	386.63	△1.0	99.5	-	-
11 月 末	13,076	△0.9	387.12	△0.9	99.9	-	-
12 月 末	13,078	△0.9	387.20	△0.9	99.3	-	-
2021年 1 月 末	13,045	△1.2	386.25	△1.1	99.2	-	-
(期 末) 2021年 2月15日	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年2月15日から2021年2月15日まで）

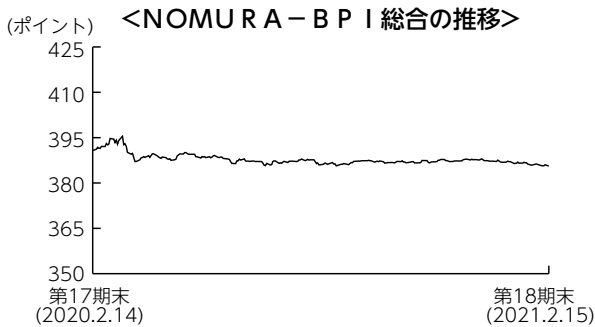


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は13,022円となり、前期末比で1.3%下落しました。

### 基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり基準価額は上昇して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和政策などを受けて基準価額は下落に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に基準価額は下落しました。



### 投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり利回りは低下（価格は上昇）して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和

政策などを受けて利回りは上昇に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。

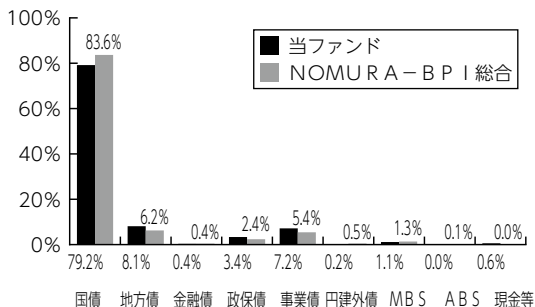
### ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

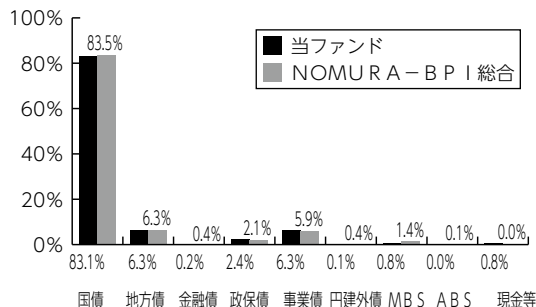
**【運用状況】** (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○**セクター別構成比**

期首 (前期末)

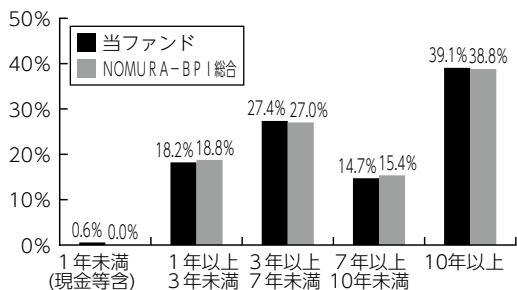


期末

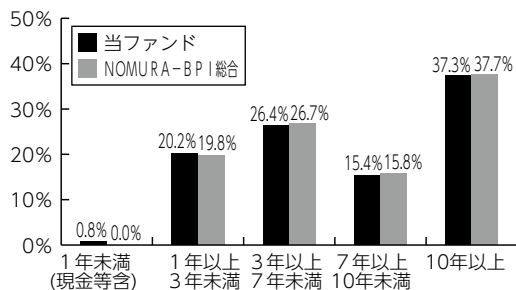


○**残存年限別構成比**

期首 (前期末)



期末



**ベンチマークとの差異について**

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

**今後の運用方針**

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。



## ■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

## ■ 売買及び取引の状況 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	191,780,597	136,499,291 (-)
	地方債証券	2,830,950	3,489,753 (-)
	特殊債証券	2,021,381	1,817,635 (203,888)
	社債証券	1,451,683	1,318,867 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## ■ 利害関係人との取引状況等 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 198,084	百万円 4,470	% 2.3	百万円 143,125	百万円 11,792	% 8.2

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、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

## ■組入資産の明細

### 公社債

#### (A) 債券種類別開示

##### 国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	212,920,000	227,135,859	83.1	—	55.9	18.5	8.7
地 方 債 証 券	16,600,000	17,224,060	6.3	5.1	2.3	2.8	1.1
特 殊 債 券	14,894,979	15,838,836	5.8	—	3.8	1.5	0.5
金 融 債 券	500,000	500,321	0.2	—	—	0.2	—
普 通 社 債 券	10,281,000	10,583,824	3.9	0.1	1.2	2.0	0.7
合 計	255,195,979	271,282,901	99.2	5.2	63.1	25.1	11.0

(注 1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第 2 位を四捨五入しています。

(注 2) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

#### (B) 個別銘柄開示

##### 国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,300,000	1,315,925	2022/03/20
4 1 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	900,000	902,367	2022/04/01
4 1 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,500,000	1,504,245	2022/05/01
4 1 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	400,000	401,184	2022/06/01
1 3 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,500,000	2,507,700	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	3,200,000	3,244,000	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,050,000	1,063,030	2022/06/20
4 1 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,003,220	2022/07/01
4 1 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	200,000	200,684	2022/08/01
4 1 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,270,000	1,274,597	2022/09/01
1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,980,000	1,987,246	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,400,000	1,420,650	2022/09/20
4 1 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,300,000	1,305,330	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	600,000	602,526	2022/12/01
1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,697,165	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.7000	500,000	507,610	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,200,000	1,220,472	2022/12/20
4 2 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,600,000	1,607,056	2023/01/01
1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,840,000	1,848,648	2023/03/20
3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,790,000	1,817,154	2023/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,250,000	1,256,587	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,770,000	1,808,196	2023/06/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,400,000	1,408,190	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,250,000	1,279,887	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	650,000	662,161	2023/09/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,567,085	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,360,000	2,408,781	2023/12/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,720,000	1,732,263	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,250,000	2,300,557	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,702,742	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,380,000	2,437,453	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,660,000	1,673,163	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	2,940,000	3,005,209	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	350,000	377,958	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,920,000	1,935,916	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	760,000	777,882	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,340,000	1,361,185	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	340,000	367,672	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,500,000	1,513,245	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,030,000	2,072,508	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	152,703	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,750,000	2,775,162	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,107,579	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	190,000	206,606	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,000,000	2,019,380	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,350,000	2,405,295	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	240,000	263,308	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,100,000	1,110,967	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	2,210,000	2,253,537	2025/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	2,580,000	2,605,696	2026/03/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
85回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	489,249	2026/03/20
343回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,280,000	2,303,233	2026/06/20
88回 利付国庫債券(20年)	2.3000	350,000	394,775	2026/06/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,280,000	2,303,689	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	300,000	338,418	2026/09/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,010,000	3,041,785	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	870,000	981,012	2026/12/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,470,000	2,496,429	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	250,000	281,637	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	450,000	509,697	2027/03/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,010,000	2,031,748	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	350,000	402,692	2027/06/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,980,000	2,001,621	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	574,780	2027/09/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,060,000	2,082,639	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	450,000	516,591	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,700,000	2,727,837	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	695,772	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,960,000	1,979,462	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	360,000	424,504	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,220,000	2,241,090	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	400,000	464,652	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	350,000	409,230	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,840,000	1,856,596	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	400,000	466,412	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	400,000	460,132	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,870,000	1,885,876	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	220,000	253,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	330,000	386,202	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,920,000	1,935,187	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	290,000	343,064	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	646,052	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,180,000	2,195,892	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	100,000	123,791	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	770,000	907,753	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,160,000	2,173,327	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	650,386	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	200,000	238,268	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	121,243	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,100,000	2,111,403	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	320,000	382,585	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	650,000	771,238	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,160,000	2,169,028	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	310,000	366,193	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	300,000	348,804	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	400,000	457,636	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,090,000	2,096,959	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	634,451	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	350,000	407,883	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	254,984	2030/11/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	800,000	801,952	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	898,800	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	390,000	463,565	2030/12/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	800,012	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	340,000	405,324	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	420,000	496,490	2031/03/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	620,000	734,582	2031/06/20
129回 利付国庫債券(20年)	1.8000	590,000	692,996	2031/06/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	680,000	800,734	2031/09/20
131回 利付国庫債券(20年)	1.7000	300,000	350,124	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	248,698	2031/11/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	420,000	491,278	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	672,839	2031/12/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	630,000	745,397	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	350,000	410,284	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	440,000	510,972	2032/03/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	350,000	411,176	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	380,000	437,931	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	450,000	523,629	2032/06/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,090,000	1,283,224	2032/09/20
8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	200,000	238,010	2032/11/22
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	750,000	884,730	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	400,000	476,508	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	700,000	889,245	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	430,000	498,030	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	200,000	236,840	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,410,000	1,669,722	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	200,000	247,280	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,050,000	1,245,741	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	100,000	122,688	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,180,000	1,387,691	2033/12/20
148回 利付国庫債券(30年)	2.4000	290,000	371,606	2034/03/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,090,000	1,269,904	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	259,598	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,130,000	1,318,291	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	150,000	195,262	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,230,000	1,420,600	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	258,562	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,410,000	1,592,383	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	320,000	410,387	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,270,000	1,435,150	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	257,114	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	1,170,000	1,339,135	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	263,350	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,030,000	1,165,290	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	258,300	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	1,230,000	1,356,185	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	220,000	291,332	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	940,000	953,564	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	265,498	2036/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	1,150,000	1,130,645	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	190,000	252,825	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	980,000	1,006,195	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	260,686	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,050,000	1,093,501	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	400,000	528,508	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,080,000	1,140,166	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,150,000	1,194,424	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	420,000	564,253	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	920,000	954,564	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,070,000	1,109,012	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	480,000	647,956	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,160,000	1,182,330	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	890,000	905,895	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	560,000	749,616	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,150,000	1,207,684	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	950,000	963,404	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	570,000	755,215	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	850,000	845,716	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	850,000	829,098	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	460,000	603,280	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	820,000	798,212	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,060,000	1,029,694	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	610,000	814,807	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	760,000	751,336	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,020,000	1,006,444	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	930,000	1,194,910	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,100,000	1,084,237	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	400,000	401,812	2040/12/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	920,000	1,221,097	2041/03/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,100,000	1,422,652	2041/09/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	950,000	1,232,416	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	990,000	1,267,506	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	690,000	871,884	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	610,000	783,972	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	500,000	633,225	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	500,000	623,635	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	810,000	1,011,179	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	520,000	649,740	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	590,000	737,848	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	580,000	700,564	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	750,000	906,360	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	710,000	874,720	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	710,000	842,549	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	800,000	949,648	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	610,000	639,389	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	620,000	576,550	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	680,000	663,442	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	750,000	748,320	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	731,577	2047/03/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	731,010	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	620,000	646,951	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	690,000	719,407	2047/12/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	870,000	906,313	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	680,000	691,097	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	760,000	809,179	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	660,000	668,566	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	280,000	390,972	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	500,000	480,470	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	570,000	532,072	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	640,000	596,384	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	610,000	567,446	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	290,000	406,925	2050/03/20
66回 利付国庫債券(30年)	0.4000	520,000	483,464	2050/03/20
67回 利付国庫債券(30年)	0.6000	690,000	676,496	2050/06/20
68回 利付国庫債券(30年)	0.6000	710,000	696,005	2050/09/20
69回 利付国庫債券(30年)	0.7000	400,000	402,480	2050/12/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	550,000	776,259	2051/03/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	500,000	683,400	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	570,000	768,348	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	530,000	688,099	2054/03/20
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	620,000	753,963	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	1,020,000	928,567	2056/03/20
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	900,000	960,156	2057/03/20
11回 利付国庫債券(40年)	0.8000	750,000	776,655	2058/03/20
12回 利付国庫債券(40年)	0.5000	750,000	701,722	2059/03/20
13回 利付国庫債券(40年)	0.5000	560,000	523,213	2060/03/20
小 計	-	212,920,000	227,135,859	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
23年度20回 愛知県公募公債	1.0820	500,000	505,950	2022/03/29
109回 共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	506,155	2022/04/25
708回 東京都公募公債	0.8900	500,000	505,870	2022/06/20
111回 共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	708,288	2022/06/24
364回 大阪府公募公債	0.7900	300,000	303,675	2022/09/27
194回 神奈川県公募公債	0.7910	300,000	304,290	2022/12/20
24年度7回 千葉県公募公債	0.7400	300,000	304,020	2022/12/22
119回 共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	507,945	2023/02/24
121回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	506,070	2023/04/25
25年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	305,760	2023/05/30
720回 東京都公募公債	0.8700	300,000	306,006	2023/06/20
25年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	203,676	2023/06/20
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	408,404	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	306,657	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	204,162	2023/08/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	305,367	2023/11/24
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	408,140	2023/12/20
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	204,114	2024/02/26
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	305,370	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	310,767	2024/06/26
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	408,188	2024/07/29

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(地方債証券)</b>	%	千円	千円	
488回 名古屋市公債券 10年	0.5980	450,000	459,342	2024/09/20
26年度11回 京都府公債券	0.4760	350,000	356,125	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	506,395	2025/01/24
26年度17回 兵庫県公債券	0.4600	200,000	203,420	2025/02/26
5回 東京都公債券 20年	2.1100	100,000	108,538	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	407,380	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	409,088	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	511,810	2025/07/25
1回 静岡県公債券 20年	2.1800	100,000	109,907	2025/09/19
9回 東京都公債券 20年	2.4400	200,000	225,162	2026/06/19
10回 東京都公債券 20年	2.3300	300,000	337,659	2026/09/18
4回 京都市公債券 20年	2.5100	100,000	113,555	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	503,105	2027/01/25
29年度4回 大阪市公債券	0.1500	200,000	200,720	2027/09/21
29年度6回 広島市公債券	0.2300	300,000	302,616	2028/02/25
5回 兵庫県公債券 15年	1.3100	300,000	325,755	2028/05/26
30年度7回 神戸市公債券 30年	0.2540	300,000	302,910	2028/09/20
第91回 川崎市公債券	0.1850	200,000	200,902	2028/09/20
7回 静岡県公債券 20年	2.3200	300,000	349,713	2028/09/21
30年度14回 北海道公債券	0.1950	300,000	301,023	2028/12/28
30年度19回 愛知県公債券	0.1150	200,000	199,584	2029/03/28
802回 東京都公債券	0.1300	400,000	398,920	2030/03/19
8回 静岡県公債券 15年	0.8280	200,000	212,062	2030/06/07
36回2号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	249,280	2030/10/28
19回 神奈川県公債券 20年	1.8180	100,000	117,027	2032/01/30
24年度2回 福岡県公債券(20年)	1.6350	300,000	346,629	2032/08/16
10回 大阪府公債券 20年	1.7200	200,000	233,022	2032/09/24
14回 千葉県公債券 20年	1.1370	100,000	110,202	2033/04/15
14回 埼玉県公債券 20年	1.5460	300,000	347,556	2034/05/08
17回 北九州市公債券 20年	1.5290	100,000	115,540	2034/06/20
2回 横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	129,352	2035/03/20
18回 千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	110,769	2035/04/13
14回 大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	101,754	2036/09/29
30年度7回 福岡市公債券	0.7010	200,000	207,200	2038/10/19
27年度8回 愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	180,630	2045/06/20
27年度2回 広島県公債券 30年	0.7110	100,000	100,534	2046/03/22
小計	-	16,600,000	17,224,060	-
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
36回 政地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	303,435	2022/05/20
96回 高速道路機構債	0.7960	700,000	708,715	2022/09/20
44回 政地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	406,508	2023/01/20
55回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	508,535	2023/03/20
189回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	505,830	2023/04/28
193回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	510,330	2023/06/30
50回 政地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	510,845	2023/07/14
195回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	337,296	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	101,807	2023/09/20
56回 政地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	553,696	2024/01/19
64回 政地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	305,619	2024/09/13
241回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	508,850	2025/03/31

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(特殊債券)</b>	%	千円	千円	
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,988	2025/10/21
83回 地方公共団体金融機構債券	0.0900	400,000	400,100	2026/04/28
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	201,450	2027/04/13
309回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	804,584	2027/04/30
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,936	2027/06/18
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,809	2027/11/19
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	302,601	2028/02/18
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	216,500	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	229,678	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	200,000	234,800	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	353,061	2029/08/28
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	233,760	2029/09/20
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	213,174	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	232,584	2030/10/29
121回 政日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	580,090	2030/10/31
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	415,009	2031/06/13
9回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	233,608	2031/12/26
13回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	9,602	9,625	2032/05/10
14回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	48,380	48,479	2032/05/10
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	116,203	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	231,992	2032/09/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	524,544	2033/12/20
239回 政日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	334,509	2035/02/28
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	224,840	2035/06/28
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	195,472	2036/06/20
6回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	33,729	34,375	2037/05/10
8回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	23,700	24,300	2037/05/10
9回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	35,535	36,439	2037/05/10
319回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	206,776	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	269,850	2037/09/18
2回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	2.2700	37,851	39,092	2037/11/10
43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	12,520	12,966	2041/06/10
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,532	49,903	2041/07/10
51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	36,441	37,518	2042/02/10
1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	59,815	61,473	2042/05/10
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	126,650	135,786	2044/10/10
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	201,216	212,960	2045/05/10
260回 政日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	232,750	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	109,874	2045/12/20
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	219,892	2047/03/20
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	97,973	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	100,000	98,305	2050/06/20
114回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	243,543	244,073	2051/11/10
126回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	256,239	258,150	2052/11/10
128回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	256,635	258,377	2053/01/10
131回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,603	262,976	2053/04/10
132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,339	262,708	2053/05/10
137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	269,649	272,447	2053/10/10
小計	-	14,894,979	15,838,836	-

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,245	2024/05/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	400,076	2025/08/27
小計	-	500,000	500,321	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
13回 パナソニック社債	0.5680	100,000	100,504	2022/03/18
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	204,970	2022/03/25
45回 住友商事社債	1.1170	100,000	101,167	2022/04/20
23回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,933	2022/05/23
1回 BPCE SA円債社債(ノンチャルボンド)	0.2140	200,000	200,026	2022/06/30
21回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	103,163	2022/09/20
94回 丸紅社債	1.1700	100,000	101,679	2022/10/12
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	207,266	2022/10/27
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	100,632	2022/12/02
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	306,135	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	102,634	2022/12/20
518回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,522	2023/01/25
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	203,664	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	101,449	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	203,150	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	102,272	2023/03/24
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	306,687	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	101,833	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	204,340	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	102,389	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	410,484	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	315,429	2023/09/20
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,394	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,811	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	206,326	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	211,196	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	307,551	2023/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	412,360	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	411,680	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	203,324	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	106,595	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	107,569	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	203,108	2024/10/28
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー・円債社債	0.8650	200,000	204,512	2024/11/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,607	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	325,155	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	216,228	2025/06/20
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	218,268	2025/09/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	134,320	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	104,642	2026/06/25
33回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,778	2026/12/14
34回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	202,562	2027/02/16
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	303,708	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	304,260	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,200	2027/05/07
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	200,000	202,036	2028/01/18
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	202,072	2028/06/06
14回 プリズトン社債	0.3750	200,000	200,284	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	107,232	2029/04/27
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	200,000	201,788	2030/09/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	235,190	2030/12/20
350回 北海道電力社債	0.7540	200,000	202,868	2038/03/25
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	99,910	2038/07/12
71回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	98,726	2059/12/24
47回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	97,235	2060/09/17
小計	-	10,281,000	10,583,824	-
合計	-	255,195,979	271,282,901	-

## ■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 271,282,901	% 99.2
コール・ローン等、その他	2,188,062	0.8
投資信託財産総額	273,470,964	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	273,470,964,587円
コ ー ル ・ 公 社 未 前 負 未 払 純 資 産	1,577,987,460
元 次 期 繰 越 損 益	271,282,901,629
(B) 負 債	528,367,341
受 取 利 用 債 金	81,708,157
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	124,841,000
	124,841,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	273,346,123,587
元 次 期 繰 越 損 益	209,919,027,595
(D) 受 取 利 用 債 金 総 額	63,427,095,992
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	209,919,027,595円
	13,022円

(注1) 期首元本額	168,870,516,479円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D/C)	25,891,763円
追加設定元本額	167,666,444,476円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	37,090,342円
一部解約元本額	126,617,933,360円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	588,184,487円
(注2) 期末における元本の内訳		リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,654,944,013円
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	20,138,397,472円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,553,714,682円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	75,739,659円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	8,354,710円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	64,284,684円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	4,154,214円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	13,922,204円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	4,151,302円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	698,579,753円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	10,186,401円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	175,024,830円	D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,170,668円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	1,324,203円
たわらノーロード 国内債券	13,371,410,550円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	18,427,003円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	1,375,425,101円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	1,519,942,923円
たわらノーロード バランス (堅実型)	479,364,723円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	9,097,902円
たわらノーロード バランス (標準型)	771,140,997円	D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	7,795,147,063円
たわらノーロード バランス (積極型)	94,268,225円	Oneコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,101,630,563円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	35,956,909円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	308,141,870円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	841,677,984円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	5,804,574,674円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	857,299,721円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII (適格機関投資家限定)	5,780,092,239円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	267,544,001円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV (適格機関投資家限定)	5,759,938,173円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	94,593,242円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV (適格機関投資家限定)	5,767,537,679円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	11,595,925円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	2,207,986円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	7,216,822円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	194,833,349円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	15,550,209円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	115,400,455円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	3,935,187円	D I A M国際分散バランスファンド30VA	41,774,211円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	2,527,471円	D I A M国際分散バランスファンド50VA	118,714,473円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,617,188,939円	D I A M国内重視バランスファンド30VA	47,275,935円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	7,945,845,516円	D I A M国内重視バランスファンド50VA	10,741,315円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	10,564,168,081円	D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	63,831,542円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,214,698,647円	D I A M世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	147,396,923円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,934,636,468円	D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	4,113,378,518円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,100,996,248円	D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,455,390,819円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	317,515,894円	D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,620,892,716円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	69,643,768円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	512,197,093円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,183,121,770円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	209,605,289円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	9,343,546円	D I A M アグサ グローバル バランスファンド30VA	2,518,908,521円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	3,834,269,246円	D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	229,606,580円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,215,297,756円	D I A M世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,843,033円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	244,940,249円	D I A M世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	2,800,949,726円
投資のソムリエ	19,968,780,596円	D I A M世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	54,001,054円
クルーズコントロール	1,710,359,908円	D I A M世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	448,922,701円
投資のソムリエ<DC年金>	1,200,230,759円	D I A M世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	713,955,739円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,601,786,821円	D I A M世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	1,210,800,648円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	458,001,465円	D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	338,532,229円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	6,432,489円	D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	106,770,675円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	14,490,817円	Oneコアポートフォリオ・アリス戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	928,960,030円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,572,825,479円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	382,409,178円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	28,534,806,570円	期末元本合計	209,919,027,595円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	15,124,286円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	7,164,986円		

## ■損益の状況

当期 自2020年2月15日 至2021年2月15日

項	目	当	期					
(A) 配	当	等	収	益	1,854,548,870円			
受	取		利	息	1,855,446,015			
支	払		利	息	△897,145			
(B) 有	証	券	売	買	損	益	△5,046,081,656	
売		買			益	損	53,162,300	
売					損	益	△5,099,243,956	
(C) 当	期	損	益	金(A + B)	△3,191,532,786			
(D) 前	期	繰	越	損	益	金	53,988,844,136	
(E) 解	約	差	損	益	金	△39,191,042,382		
(F) 追	加	信	託	差	損	益	金	51,820,827,024
(G) 合				計(C + D + E + F)	63,427,095,992			
次	期	繰	越	損	益	金(G)	63,427,095,992	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。



# 外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日 2021年2月15日）

（計算期間 2020年2月18日～2021年2月15日）

外国株式パッシブ・ファンド・マザーファンドの第19期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年9月2日から無期限です。
運用方針	主に海外の株式に投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		MSCIコクサイ・インデックス		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	（円換算ベース、配当込み、 為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
15期(2017年2月15日)	30,270	26.6	ポイント 971,437.64	% 27.0	% 95.6	% 1.7	百万円 278,963
16期(2018年2月15日)	33,302	10.0	1,070,930.74	10.2	95.7	2.2	284,448
17期(2019年2月15日)	34,418	3.4	1,111,144.35	3.8	95.3	2.0	349,689
18期(2020年2月17日)	41,812	21.5	1,354,548.25	21.9	94.7	2.7	370,420
19期(2021年2月15日)	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5	477,565

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) ベンチマークはMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

(注4) MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています（以下同じ）。

(注5) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

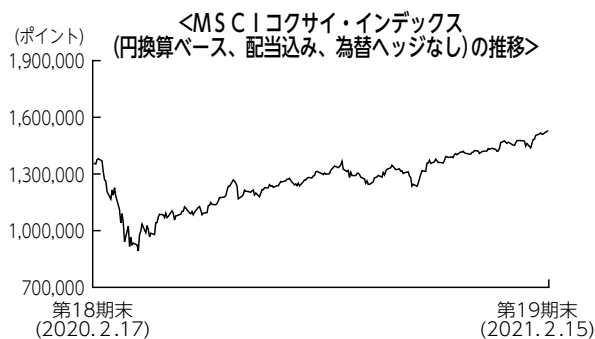
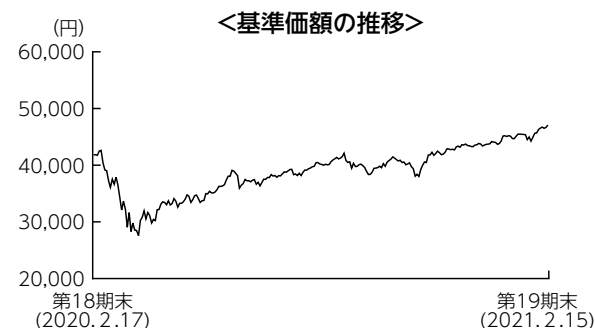
年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
	円	騰 落 率	ポ イ ン ト	騰 落 率		
(期 首) 2020年 2月 17日	41,812	% -	1,354,548.25	% -	% 94.7	% 2.7
2 月 末	37,252	△10.9	1,206,797.36	△10.9	95.7	1.4
3 月 末	31,648	△24.3	1,027,164.79	△24.2	96.5	2.6
4 月 末	34,754	△16.9	1,126,486.20	△16.8	94.3	3.0
5 月 末	36,243	△13.3	1,175,146.51	△13.2	94.1	3.4
6 月 末	36,940	△11.7	1,198,230.56	△11.5	96.0	1.5
7 月 末	38,177	△8.7	1,236,614.10	△8.7	95.4	2.2
8 月 末	41,110	△1.7	1,333,631.14	△1.5	90.7	7.9
9 月 末	39,487	△5.6	1,281,404.41	△5.4	95.4	2.1
10 月 末	38,389	△8.2	1,245,785.85	△8.0	95.9	1.6
11 月 末	42,818	2.4	1,390,283.49	2.6	95.9	2.9
12 月 末	44,055	5.4	1,430,471.52	5.6	96.0	2.3
2021年 1 月 末	44,967	7.5	1,461,431.17	7.9	96.1	1.7
(期 末) 2021年 2月 15日	47,083	12.6	1,529,401.79	12.9	95.5	2.5

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注3) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年2月18日から2021年2月15日まで）



### 基準価額の推移

当期末の基準価額は47,083円となり、前期末比で12.6%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

株式市場では米国市場が新型コロナウイルスの感染拡大への懸念による急落から反発し、前期末の水準を大きく上回る上昇となり、基準価額を押し上げました。為替市場では米ドルなど一部の通貨が円高となりマイナスに寄与したものの、ユーロなどの欧州通貨が円安となりプラスの寄与となりました。こうした要因から当期の基準価額は上昇しました。

### 投資環境

先進国株式市場は上昇しました。米国市場は2020年2月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大から急落しましたが、3月下旬以降は米景気対策法案への期待などから反発しました。その後も欧米における新型コロナウイルスの感染拡大から調整する場面もありましたが、ワク

チン開発や接種の進展、経済活動正常化への期待感などを受けて堅調に推移しました。欧州市場は急落後の反発力に欠ける市場もあり、前期末比では各国市場まちまちの値動きとなりました。

為替市場はまちまちの値動きとなりました。新型コロナウイルスの感染拡大から大きく変動した2020年2月、3月を除いて、米ドルに対してはほぼ一貫して円高となりました。これは米国が金融緩和を積極的に進めたことが主な要因です。一方でユーロなど他の多くの通貨に対しては円安となりました。経済活動再開への期待などによりリスク回避姿勢が後退したことから、安全資産と見られた円が売られ、その他の通貨が買われたためです。

### ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）のリスク特性に概ね一致したポートフォリオを構築しました。

## 【運用状況】

### ○組入株式上位10業種

#### 期首（前期末）

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	10.3%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.9
3	銀行	7.3
4	資本財	6.7
5	メディア・娯楽	6.1
6	ヘルスケア機器・サービス	4.9
7	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.9
8	小売	4.8
9	食品・飲料・タバコ	4.6
10	エネルギー	4.5

#### 期末

No.	業種	比率
1	ソフトウェア・サービス	12.1%
2	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.6
3	メディア・娯楽	7.1
4	資本財	6.2
5	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.1
6	小売	5.8
7	銀行	5.6
8	ヘルスケア機器・サービス	5.1
9	半導体・半導体製造装置	4.6
10	各種金融	4.4



(注1) 比率は純資産総額に対する割合です。

(注2) 業種は各決算日時点でのGICS（世界産業分類基準）によるものです。

### ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で12.9%上昇しました。

当ファンドはベンチマーク比で△0.3%と、配当課税等の要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

### 今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

### ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%
(株 式)	( 1)	(0.002)
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)
(先物・オプション)	( 1)	(0.002)
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)
(投 資 証 券)	( 0)	(0.000)
(b) 有価証券取引税	5	0.013
(株 式)	( 5)	(0.012)
(新株予約権証券)	( 0)	(0.000)
(投資信託受益証券)	( 0)	(0.000)
(投 資 証 券)	( 0)	(0.000)
(c) その他費用	9	0.024
(保 管 費 用)	( 0)	(0.000)
(そ の 他)	( 9)	(0.024)
合 計	16	0.040

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額(39,034円)で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については12ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

# ■売買及び取引の状況 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)

## (1) 株 式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 76,463.16 (14,562.26)	千アメリカ・ドル 701,987 (△3,608)	百株 45,411.7	千アメリカ・ドル 353,039
	カ ナ ダ	百株 12,093.39 (△21.96)	千カナダ・ドル 51,424 (△0.21676)	百株 7,238.68	千カナダ・ドル 24,349
	オーストラリア	百株 21,852.12 (453.07)	千オーストラリア・ドル 36,147 (-)	百株 14,694.93	千オーストラリア・ドル 16,462
	香 港	百株 19,390 (△2,849.15)	千香港・ドル 83,001 (-)	百株 12,540.48	千香港・ドル 48,260
	シンガポール	百株 8,246.5 (2,113.75)	千シンガポール・ドル 3,326 (-)	百株 12,498.19	千シンガポール・ドル 2,401
	ニュージーランド	百株 872.37 (-)	千ニュージーランド・ドル 822 (-)	百株 719.94	千ニュージーランド・ドル 502
	イ ギ リ ス	百株 78,899.1 (5,792.39)	千イギリス・ポンド 42,047 (△8)	百株 50,946.95	千イギリス・ポンド 18,921
	イスラエル	百株 496.65 (39.42)	千イスラエル・シケル 1,841 (-)	百株 39.42	千イスラエル・シケル 32
	ス イ ス	百株 4,418.96 (0.31)	千スイス・フラン 31,583 (△340)	百株 2,215.29	千スイス・フラン 15,848
	デンマーク	百株 1,158.98 (-)	千デンマーク・クローネ 58,612 (-)	百株 555.11	千デンマーク・クローネ 28,435
	ノルウェー	百株 1,469.2 (-)	千ノルウェー・クローネ 19,876 (-)	百株 582.96	千ノルウェー・クローネ 8,645
	スウェーデン	百株 6,788.69 (375.01)	千スウェーデン・クローナ 111,556 (-)	百株 3,516.25	千スウェーデン・クローナ 42,207
国	イ ギ リ ス	百株 269.98 (-)	千ユーロ 1,265 (-)	百株 1,401.32	千ユーロ 6,758
	アイルランド	百株 458.5 (1.04)	千ユーロ 2,589 (-)	百株 1,443.88	千ユーロ 982
	オランダ	百株 4,881.21 (839.88)	千ユーロ 15,275 (△4)	百株 3,280.09	千ユーロ 7,736
	ベルギー	百株 432.31 (-)	千ユーロ 2,499 (-)	百株 232.58	千ユーロ 900
	ルクセンブルグ	百株 569.96 (101.97)	千ユーロ 530 (-)	百株 306.11	千ユーロ 153
	フランス	百株 6,144.78 (△285.63)	千ユーロ 29,258 (△125)	百株 3,419.66	千ユーロ 14,451
	ドイツ	百株 6,260.14 (378.62)	千ユーロ 29,572 (△322)	百株 3,026.64	千ユーロ 12,394

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユ ー ロ ム	ポ ル ト ガ ル	百株 370.56 (2,016.06)	千ユーロ 154 (-)	百株 2,016.06	千ユーロ 18
		ス ペ イ ン	百株 11,323.51 (36,219.26)	千ユーロ 6,785 (△1)	百株 47,689.27	千ユーロ 4,268
		イ タ リ ア	百株 8,841.37 (-)	千ユーロ 6,080 (-)	百株 3,017.58	千ユーロ 2,303
		フ ィ ン ラ ン ド	百株 2,365.02 (-)	千ユーロ 3,003 (-)	百株 1,056.68	千ユーロ 1,660
		オ ー ス ト リ ア	百株 213.07 (-)	千ユーロ 503 (-)	百株 140.25	千ユーロ 378

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ( ) 内は、株式分割、増資割当および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。

## (2) 新株予約権証券

			買 付		売 付	
			証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	証券	千アメリカ・ドル	証券	千アメリカ・ドル	
		9,583	153	9,583 (-)	29 (-)	
国	ス イ ス	証券	千スイス・フラン	証券	千スイス・フラン	
		87,844	17	(-)	(-)	

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## (3) 投資信託受益証券、投資証券

			買 付		売 付	
			口 数	金 額	口 数	金 額
<b>アメリカ</b>			千口	千アメリカ・ドル	千口	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT			4.85 (-)	777 (-)	1.49 (-)	258 (-)
BOSTON PROPERTIES INC			4.047 (-)	379 (-)	3.127 (-)	267 (-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC			4.922 (-)	183 (-)	- (-)	- (-)
SL GREEN			2.636 (-)	121 (-)	9.733 (-)	487 (-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT			42.275 (-)	276 (-)	22.963 (-)	139 (-)
PROLOGIS INC			18.354 (-)	1,753 (-)	8.083 (-)	798 (-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC			2.743 (-)	435 (-)	0.905 (-)	145 (-)
CAMDEN PROPERTY TRUST			6.861 (-)	594 (-)	5.28 (-)	501 (-)
EQUINIX INC			2.314 (-)	1,707 (-)	0.844 (-)	633 (-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC			- (-)	- (-)	13.649 (-)	514 (-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
DUKE REALTY TRUST	9.24	334	4.589	173
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	11.24	1,808	3.992	639
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1.316	285	0.887	186
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	14.226	867	6.987	404
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	-	6	523
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	11.492	269	6.111	200
	(-)	(-)	(-)	(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	1.835	527	0.775	231
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	15.617	849	9.305	519
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	-	-	32.98	366
	(-)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	5.143	127	4.529	143
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2.461	151	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	8.836	125	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
MID AMERICA	4.745	576	2.725	311
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	9.434	560	3.459	207
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	3.096	123	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	10.298	374	5.586	190
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	7.149	492	2.372	151
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	3.283	697	1.637	311
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	2.252	330	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	8.055	304	2.539	132
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	3.954	132	3.712	139
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	15.289	354	8.814	254
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	3.124	339	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	9.706	1,350	1.819	276
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	21.376	429	7.418	132
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	9.532	111	8.245	149
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	20.066	138	-	-
	(△82.136)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	10.881	2,582	5.358	1,305
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	7.024	454	4.534	323
	(-)	(-)	(-)	(-)

	買 付 額		売 付 額	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
<b>アメリカ</b>	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
INVITATION HOMES INC	8.091	231	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICI PROPERTIES INC	30.263	635	17.38	344
	(—)	(—)	(—)	(—)
<b>カナダ</b>	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
SMARTCENTRES REIT	—	—	3.067	73
	(—)	(—)	(—)	(—)
CANADIAN APT PPTYS REIT	3.947	157	3.812	220
	(—)	(—)	(—)	(—)
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	10.748	104
	(—)	(—)	(—)	(—)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.935	174	30.611	555
	(—)	(—)	(—)	(—)
<b>オーストラリア</b>	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
DEXUS	24.397	218	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
GOODMAN GROUP	30.602	436	14.296	213
	(—)	(—)	(—)	(—)
VICINITY CENTRES	101.268	160	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
<b>香港</b>	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	66.3	4,266	24	1,464
	(—)	(—)	(—)	(—)
<b>シンガポール</b>	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	136.1	294	—	—
	(148.536)	(375)	(—)	(—)
ASCENDAS REAL ESTATE INVT	161.8	490	70	236
	(—)	(△7)	(—)	(—)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(△206.3)	(△429)	(—)	(—)
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	563.1	1,151	293	609
	(—)	(△2)	(—)	(—)
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△1)	(—)	(—)
<b>イギリス</b>	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
SEGRO PLC	13.709	129	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)
<b>ユーロ (フランス)</b>	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
ICADE	—	—	2.234	138
	(—)	(—)	(—)	(—)
KLEPIERRE	4.769	104	4.712	125
	(—)	(△14)	(—)	(—)
COVIVIO	1.942	112	1.544	148
	(—)	(—)	(—)	(—)
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	2.022	119	—	—
	(—)	(—)	(—)	(—)

(注1) 金額は受渡代金です。

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



#### (4) 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 147,648	百万円 147,076	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

#### ■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	160,063,426千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	346,644,284千円
(c) 売 買 高 比 率 (a)/(b)	0.46

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

#### ■利害関係人との取引状況等 (2020年2月18日から2021年2月15日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

### (1) 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当期		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	千円			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円			
AMAZON.COM INC	325.49	380.64	124,762	13,115,060			インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	1,365.53	1,585.92	20,336	2,137,746			ヘルスケア機器・用品
AES CORP	475.98	567.35	1,618	170,152			独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	35.74	39.87	1,309	137,620			ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	684.81	798.02	9,640	1,013,365			情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	790.23	1,053.11	9,875	1,038,061			半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	375.4	429.77	21,438	2,253,630			ソフトウェア
CHUBB LTD	352.14	406.4	6,671	701,304			保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	173.59	198.54	5,172	543,781			化学
ALLEGHANY CORP	10.94	12.63	769	80,865			保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	60.52	60.52	551	57,937			バイオテクノロジー
RALPH LAUREN CORP	34.22	-	-	-			繊維・アパレル・贅沢品
ALLSTATE CORP	258.32	283.81	2,963	311,557			保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	556.87	627.86	12,781	1,343,575			コングロマリット
AMGEN INC	464.84	524.53	12,442	1,307,942			バイオテクノロジー
HESS CORP	213.67	247.76	1,486	156,267			石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	544.74	616.15	7,986	839,544			消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	392.77	450.17	3,538	371,997			電力
AFLAC INC	570.28	582.83	2,734	287,465			保険
AMERICAN INTL GROUP	680.37	754.5	3,123	328,355			保険
AMERCO	5.85	9.29	464	48,851			陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	291.05	335.79	5,398	567,525			半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	181.92	192.19	3,044	319,995			バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	604.52	653.14	3,499	367,869			建設関連製品
JONES LANG LASALLE INC	40.87	-	-	-			不動産管理・開発
VALERO ENERGY CORP	314.33	374	2,421	254,524			石油・ガス・消耗燃料
APACHE CORP	314.7	-	-	-			石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	67.7	79.7	3,216	338,138			ソフトウェア
APPLE INC	3,499.77	15,286.24	206,929	21,752,463			コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	711.21	818.51	9,552	1,004,107			半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	76.34	95.36	1,570	165,039			化学
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	421.46	517.45	2,883	303,085			食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	78.13	92.78	706	74,308			電力
AMEREN CORP	194.87	222.73	1,632	171,573			総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	57.95	66.51	698	73,467			電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	59.13	75.7	713	75,016			自動車部品
AUTODESK INC	172.35	198.42	6,054	636,458			ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	334.93	386.31	6,452	678,290			情報技術サービス
AUTOZONE INC	19.17	21.6	2,476	260,357			専門小売り
AVERY DENNISON CORP	65.49	76.27	1,351	142,094			容器・包装
BALL CORP	252.62	288.47	2,586	271,945			容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,020.32	1,250.78	30,326	3,187,912			各種金融サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	666.37	702.98	2,947	309,851			資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	370.97	443.26	3,489	366,846			ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	207.72	260.87	6,686	702,897			ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	178.21	200.08	2,435	256,069			電気設備
VERIZON COMM INC	3,203.11	3,685.67	19,976	2,099,911			各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	122.01	125.11	849	89,272			保険
BEST BUY CO INC	187.2	215.6	2,598	273,122			専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	15.24	18.59	1,231	129,435			ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	231.1	273.93	2,889	303,706			ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	435.84	478	1,493	156,972			電力
BOEING CO	413.69	481.42	10,156	1,067,703			航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	83.24	111.11	819	86,174			専門サービス

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BORGLWARNER INC	172.1	219.38	921	96,834	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,066.58	1,290.98	4,956	520,982	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	99.88	117.19	1,069	112,472	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	87.66	106.87	2,135	224,526	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	19.29	22.08	2,695	283,321	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,814.88	2,018.55	12,109	1,272,927	医薬品
INGREDION INC	53.05	—	—	—	食品
ONEOK INC	324.27	392.84	1,772	186,283	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	59	80.93	874	91,913	保険
UNITED RENTALS INC	61.81	61.81	1,769	185,970	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	215.99	261.13	3,251	341,752	総合公益事業
FEDEX CORP	193.68	224.18	5,895	619,780	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	80.48	87.62	1,773	186,413	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	227.63	262.07	3,561	374,388	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	243.81	260.85	2,004	210,726	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,252.54	971.36	591	62,184	メディア
CSX CORP	595.4	686.59	6,188	650,579	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	314.16	314.16	572	60,203	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	140.5	166.23	777	81,691	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	200.52	196.41	1,418	149,089	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	128.2	146.75	3,540	372,191	飲料
CARDINAL HEALTH INC	229.5	247.18	1,281	134,750	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	319.62	471.45	971	102,091	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	432.58	486.12	9,624	1,011,747	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	98.65	98.65	1,190	125,187	ソフトウェア
CITRIX SYSTEMS INC	94.64	99.33	1,367	143,759	ソフトウェア
LUMEN TECHNOLOGIES INC	804.24	804.24	947	99,590	各種電気通信サービス
CERNER CORP	251.43	272.58	2,042	214,758	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	2,476.52	2,725.45	38,496	4,046,802	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	198.96	212.87	1,765	185,593	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	112.22	128.72	1,189	125,053	保険
CINTAS CORP	66.04	80.99	2,773	291,542	商業サービス・用品
CISCO SYSTEMS INC	3,309.4	3,769.58	17,826	1,873,905	通信機器
CLOROX COMPANY	98.76	117.85	2,191	230,386	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	3,147.58	3,644.71	18,475	1,942,095	飲料
COPART INC	167.49	186.28	2,224	233,855	商業サービス・用品
COGNEX CORP	122.84	146.77	1,379	145,012	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	627.79	712.97	5,591	587,812	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	221.45	256.86	3,325	349,610	ホテル・レストラン・レジャー
MOLINA HEALTHCARE INC	—	52.03	1,125	118,292	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
COMERICA INC	119.85	—	—	—	銀行
NRG ENERGY, INC.	210.39	210.39	905	95,188	電力
COMCAST CORP-CL A	3,511.08	4,081.73	21,727	2,283,947	メディア
CONAGRA BRANDS INC	358.02	461.45	1,594	167,593	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	252.2	298.44	2,120	222,929	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	229.37	259.36	1,462	153,713	総合公益事業
COOPER COS INC	39.36	50.31	1,938	203,822	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	132.2	165.13	726	76,394	飲料
CORNING INC	583.76	710.11	2,618	275,297	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	138.7	138.7	611	64,283	容器・包装
HEICO CORP-CL A	52.92	62.36	724	76,126	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	119.63	137.18	3,346	351,813	機械
DR HORTON INC	283.55	322.07	2,646	278,228	家庭用耐久財
DANAHER CORP	482.99	572.81	14,085	1,480,657	ヘルスケア機器・用品
MOODY'S CORP	129.22	151.99	4,235	445,236	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	423.7	470.43	3,620	380,579	情報技術サービス
TARGET CORP	394.21	449.86	8,611	905,258	複合小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
DEERE & CO	238.24	267.97	8,387	881,689	機械
MORGAN STANLEY	951.98	1,216.65	9,077	954,218	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	180.81	191.36	1,746	183,576	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	27.85	34.38	3,230	339,631	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,394.4	1,619.66	30,396	3,195,244	娯楽
DOLLAR TREE INC	186.97	219.16	2,375	249,675	複合小売り
DOVER CORP	111.13	126.52	1,552	163,228	機械
OMNICOM GROUP	173.65	196.63	1,302	136,937	メディア
DTE ENERGY CO	148.17	177.93	2,151	226,206	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	568.01	642.05	5,766	606,215	電力
FLOWERVE CORP	98.82	-	-	-	機械
DARDEN RESTAURANTS INC	97	109.02	1,400	147,206	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	637.71	614.91	3,874	407,292	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	6,844.79	6,976.37	23,280	2,447,209	銀行
CITIGROUP INC	1,746.72	1,867.17	11,880	1,248,909	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	94.23	122.29	1,335	140,416	化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	171.04	-	-	-	資本市場
EATON CORP PLC	318.18	364.97	4,524	475,657	電気設備
EATON VANCE CORP	91.84	-	-	-	資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	226.28	246.39	3,589	377,318	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	177.49	214.2	671	70,612	メディア
ECOLAB INC	204.79	230.5	5,068	532,772	化学
PERKINELMER INC	83.38	97.55	1,468	154,401	ライフサイエンス・ツール/サービス
ELECTRONIC ARTS INC	224.91	251.42	3,714	390,466	娯楽
SALESFORCE.COM INC	644.04	815.12	19,593	2,059,620	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	22.43	22.43	583	61,367	保険
EMERSON ELECTRIC CO	467.05	522.99	4,462	469,116	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	86.5	115.03	1,047	110,097	ガス
ENERGY CORP	150.31	171.95	1,631	171,517	電力
EOG RESOURCES INC	446.03	540.41	3,297	346,641	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	91.61	103.22	1,828	192,259	専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	173.46	202.15	5,867	616,781	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	125.15	139.42	1,346	141,546	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	3,276.09	3,789.44	19,144	2,012,443	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	102.09	114.16	1,229	129,221	化学
NEXTERA ENERGY INC	374.04	1,752.42	14,567	1,531,374	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	28.75	32.46	1,025	107,825	資本市場
FAIR ISAAC CORP	-	24.82	1,175	123,612	ソフトウェア
ASSURANT INC	45.94	55.23	707	74,389	保険
FASTENAL CO	458.91	504.82	2,392	251,482	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	581.44	636.46	2,069	217,507	銀行
M&T BANK CORP	99.99	114.32	1,625	170,922	銀行
FISERV INC	443.49	514.04	5,653	594,340	情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	116.23	-	-	-	電子装置・機器・部品
FORD MOTOR CO	3,108.36	3,423.19	3,919	412,023	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	237.13	237.13	654	68,848	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	1,149.93	1,269.73	3,965	416,839	金属・鉱業
FLEX LTD	351.27	-	-	-	電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	142.7	179.22	2,091	219,820	保険
GAP INC/THE	182.95	-	-	-	専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	183.86	183.86	1,017	106,976	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	188.21	215.99	3,560	374,244	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	461.41	538.66	3,076	323,435	食品
GENUINE PARTS CO	116.05	133.93	1,330	139,829	販売
GILEAD SCIENCES INC	978.31	1,130.1	7,559	794,627	バイオテクノロジー
GARTNER INC	73.84	75.22	1,375	144,645	情報技術サービス
MCKESSON CORP	145.58	142.89	2,604	273,735	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	千円	
NVIDIA CORP	447.12	552.38	33,057	3,474,970	3,474,970	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	6,747.57	7,857.77	9,217	968,908	968,908	コングロマリット
WW GRAINGER INC	37.62	42.34	1,575	165,604	165,604	商社・流通業
HALLIBURTON CO	668.43	774.83	1,562	164,284	164,284	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	327.28	345.68	3,170	333,327	333,327	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	249	293.78	8,999	945,982	945,982	資本市場
HARLEY-DAVIDSON INC	129.01	-	-	-	-	自動車
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	175.86	189.69	3,526	370,728	370,728	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	94.73	113.83	1,041	109,463	109,463	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	115.16	115.16	799	84,085	84,085	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	22.78	36.23	465	48,954	48,954	航空宇宙・防衛
HERSHEY FOODS CORP	112.92	136.22	2,062	216,767	216,767	食品
HP INC	1,174.82	1,251.84	3,441	361,750	361,750	コンピュータ・周辺機器
F5 NETWORKS INC	48.74	55.29	1,164	122,414	122,414	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	104.72	120.24	1,189	125,081	125,081	容器・包装
JUNIPER NETWORKS INC	279.39	279.39	705	74,157	74,157	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	118.55	-	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	196.88	240.09	1,992	209,427	209,427	ヘルスケア機器・用品
UNUM GROUP	151.85	-	-	-	-	保険
HOME DEPOT INC	846.67	963.81	26,746	2,811,612	2,811,612	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	131.85	162.88	1,417	149,029	149,029	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	241.61	262.54	1,266	133,133	133,133	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	376.78	490.65	1,049	110,271	110,271	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	29.13	29.13	853	89,677	89,677	建設関連製品
HUMANA INC	103.84	119.37	4,543	477,633	477,633	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
JB HUNT TRANSPORT SERVICES INC	60	75.44	1,118	117,621	117,621	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	795.17	938.57	1,356	142,567	142,567	銀行
BIOGEN INC	141.19	144.18	4,008	421,387	421,387	バイオテクノロジー
IDEX CORP	61.54	72.94	1,457	153,249	153,249	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	247.55	275.8	5,543	582,683	582,683	機械
INTUIT INC	200.54	233.97	9,686	1,018,205	1,018,205	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	67.91	77.82	4,234	445,081	445,081	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	109.6	109.6	625	65,739	65,739	バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	182.44	218.91	3,304	347,317	347,317	建設関連製品
INTEL CORP	3,428.07	3,802.57	23,503	2,470,707	2,470,707	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	79.65	199.06	2,668	280,523	280,523	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	294.11	319.83	1,572	165,345	165,345	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	288.62	353.17	869	91,439	91,439	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	101.08	110.33	1,267	133,259	133,259	建設・土木
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	60.19	68.74	1,001	105,238	105,238	情報技術サービス
INCYTE CORP	137.98	159.42	1,344	141,313	141,313	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	2,043.38	2,351.55	39,172	4,117,773	4,117,773	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	287.53	334.76	1,660	174,577	174,577	保険
KLA CORPORATION	127.24	141.3	4,688	492,852	492,852	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	333.12	560.14	1,119	117,646	117,646	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	191.81	219.54	1,259	132,421	132,421	食品
EAST WEST BANCORP INC	115.6	-	-	-	-	銀行
KEYCORP	794.97	875.97	1,670	175,600	175,600	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	261.25	308.61	4,077	428,644	428,644	家庭用品
BLACKROCK INC./NEW YORK	89.29	136.68	9,881	1,038,763	1,038,763	資本市場
KOHL'S CORP	119.1	-	-	-	-	複合小売り
KROGER CO	639.44	712.62	2,419	254,321	254,321	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	111.39	130.86	7,670	806,321	806,321	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	27.16	33.02	1,280	134,645	134,645	航空宇宙・防衛
PACKAGING CORP OF AMERICA	71.43	84.38	1,123	118,131	118,131	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	132.54	141.53	1,437	151,141	151,141	情報技術サービス
LEGGETT & PLATT INC	109.28	-	-	-	-	家庭用耐久財

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		千円	千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル				
LENINAR CORP	227.53	258.81	2,396		251,874		家庭用耐久財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	207.95	-	-		-		各種金融サービス
ELI LILLY & CO	672.42	771.11	15,984	1,680,273			医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	153.44	180.9	947	99,549			保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	539.13	633.18	10,345	1,087,521			航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	236.62	284.52	3,641	382,772			ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	196.76	225.05	7,600	798,976			航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	217.59	217.59	1,057	111,208			保険
LOWE'S COS INC	599.41	679.92	12,045	1,266,219			専門小売り
DOMINION ENERGY INC	637.96	733.73	5,273	554,331			総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	385.73	458.5	1,647	173,173			ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	99.35	215.14	1,928	202,748			食品
MCDONALD'S CORPORATION	587.12	664.19	14,207	1,493,442			ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	190.18	215.72	7,322	769,753			資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	31.14	34.16	831	87,452			保険
MANPOWERGROUP INC	45.55	-	-	-			専門サービス
MARKET CORPORATION	10.65	12.01	1,329	139,752			保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	165.61	561.91	4,925	517,730			ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	388.72	442.08	4,986	524,197			保険
MASCO CORP	212.16	231.51	1,272	133,728			建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	47.86	52.58	1,739	182,856			建設資材
METLIFE INC	612.6	679.99	3,785	397,932			保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	213.86	235.91	2,269	238,614			半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,037.71	1,200.14	14,370	1,510,624			ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	602.43	696.43	7,229	759,979			娯楽
CVS HEALTH CORP	1,004.51	1,175.45	8,723	916,963			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	1,983.19	2,257.06	16,927	1,779,466			医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	326.86	366.51	1,512	159,003			半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	80.49	85.88	2,046	215,094			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	5,617.88	6,425.29	157,413	16,547,273			ソフトウェア
MICRON TECH INC	847.94	999.6	8,797	924,791			半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	41.88	-	-	-			機械
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	184.73	218.94	3,493	367,203			半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	487.15	612.87	3,298	346,734			半導体・半導体製造装置
3M CO	442.96	515.39	9,210	968,157			コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	49.76	49.76	842	88,546			家庭用耐久財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	125.93	150.06	2,717	285,625			通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	76.14	83.46	1,746	183,634			陸運・鉄道
MYLAN NV	435.74	-	-	-			医薬品
ILLUMINA INC	116.19	131.34	6,629	696,894			ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	389.63	465.91	2,867	301,401			電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	65.45	80.58	919	96,649			バイオテクノロジー
NOV INC	271.94	-	-	-			エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	179.63	198.04	1,383	145,434			コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	333.17	333.17	805	84,720			家庭用耐久財
NEWMONT CORP	638.69	726.65	4,282	450,215			金属・鉱業
NVR INC	2.63	3.05	1,433	150,690			家庭用耐久財
NIKE INC-CL B	967	1,116.09	15,861	1,667,399			繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	394.36	-	-	-			石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	94.87	-	-	-			複合小売り
NORDSON CORP	-	46.44	874	91,909			機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	202.6	229.57	5,850	614,990			陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	247.68	305.69	2,603	273,686			電力
NISOURCE INC	315.48	314.27	708	74,430			総合公益事業
TAPESTRY INC	217.9	-	-	-			繊維・アパレル・贅沢品
NORTHERN TRUST CORP	159.59	173.65	1,704	179,145			資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	121.94	136.98	4,073	428,178			航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当期			業種等
	株数	株数	評価額		千円	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル			
WELLS FARGO & CO	3,239.87	3,503.46	11,747		1,234,855	銀行
NUCOR CORP	240.42	288.6	1,625		170,922	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	191.75	191.9	1,297		136,406	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	359.69	417.51	4,916		516,788	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	695.5	852.06	2,163		227,414	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	52.09	87.12	1,848		194,343	陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	160.28	160.28	505		53,140	電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	58.22	65.76	2,847		299,354	専門小売り
ORACLE CORP	1,806.97	1,782.61	11,244		1,182,043	ソフトウェア
PACCAR INC	273.94	304.46	2,983		313,647	機械
PTC INC	77.66	94.33	1,346		141,520	ソフトウェア
EXELON CORP	737.21	853.23	3,601		378,587	電力
PARKER HANNIFIN CORP	100.92	119	3,287		345,556	機械
PAYCHEX INC	253.29	298.42	2,667		280,446	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	61.63	65.29	3,979		418,372	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	537.24	713.2	1,997		209,995	電力
PEPSICO INC	1,082.92	1,235.16	16,535		1,738,168	飲料
PENTAIR PLC	125.11	155.64	834		87,743	機械
PFIZER INC	4,280.75	4,971.81	17,262		1,814,594	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	155.16	229.37	1,070		112,503	水道
CONOCOPHILLIPS	858.96	1,233.91	5,819		611,705	石油・ガス・消耗燃料
PVH CORP	52.05	-	-		-	繊維・アパレル・贅沢品
PG&E CORP	-	1,239.99	1,463		153,810	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	129.08	181.44	2,400		252,316	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	1,442.97	1,673.74	7,264		763,595	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	344.94	382.89	6,213		653,126	銀行
BROWN & BROWN INC	172.94	203.08	909		95,638	保険
POLARIS INC	40.95	-	-		-	レジャー用品
GARMIN LTD	107.74	123.65	1,616		169,885	家庭用耐久財
PPG INDUSTRIES INC	190.31	206.85	2,865		301,264	化学
IPG PHOTONICS CORP	26.08	33.53	847		89,135	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	339.84	394.44	13,913		1,462,626	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	184.83	200.07	3,264		343,210	資本市場
QUEST DIAGNOSTICS	108.83	119.26	1,502		157,986	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	1,939.08	2,223.79	28,380		2,983,306	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	461.27	528.87	4,562		479,616	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	390.39	445.03	2,593		272,596	総合公益事業
PULTE GROUP INC	212.09	243.05	1,178		123,863	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	236.92	271.25	5,348		562,235	情報技術サービス
QUALCOMM INC	939.82	1,010	14,945		1,571,121	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	103.88	107.44	1,226		128,899	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	113.06	139.11	2,156		226,674	バイオテクノロジー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	31.61	40.52	645		67,819	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	61.16	95.04	4,615		485,163	バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	50.42	60.97	688		72,423	保険
RESMED INC	111.16	132.86	2,664		280,093	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	1,156.14	1,226.62	5,843		614,281	銀行
SEAGEN INC	91.5	102.96	1,707		179,491	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	315	343.83	1,208		127,044	保険
ROSS STORES INC	288.14	311.97	3,715		390,547	専門小売り
ROLLINS INC	123.78	185.67	697		73,366	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	79.49	91.27	3,614		379,953	コングロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	92.51	107.18	2,670		280,745	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	140.75	158.79	1,073		112,888	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	111.41	110.04	955		100,405	化学
RAYTHEON COMPANY	219.72	-	-		-	航空宇宙・防衛
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	38.48	-	-		-	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)		当期			業種等
	株数	株数	評価額		金額	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ACCENTURE PLC-CL A	493.57	568.7	14,642	1,539,200		情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,113.85	1,278.63	7,056	741,806		食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	101.9	117.94	2,682	281,951		保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	195.63	221.48	3,232	339,823		保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	474.12	557.29	7,556	794,376		情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	32.83	36.87	7,929	833,516		インターネット販売・通信販売
SCHLUMBERGER LTD	1,065.93	1,309.4	3,505	368,473		エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	898.67	1,376.29	8,008	841,867		資本市場
POOL CORP	-	35.32	1,193	125,434		販売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	155.9	181.87	2,935	308,529		ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	106.22	133.04	1,037	109,084		食品
SEI INVESTMENTS CO	106.53	106.53	611	64,323		資本市場
ANTHEM INC	197.28	226.07	6,571	690,785		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	127.49	138.36	1,455	152,978		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	221.75	250.38	1,355	142,469		保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	63.67	73.88	5,327	559,986		化学
CENTENE CORP	461.24	509.9	3,018	317,316		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	40.44	45.32	2,295	241,298		銀行
IAC INTERACTIVE CORP	62.52	-	-	-		インタラクティブ・メディアおよびサービス
SMITH (A.O.) CORP	113.51	113.51	685	72,034		建設関連製品
ACUITY BRANDS INC	30.87	-	-	-		電気設備
SNAP-ON INC	39.81	48.25	916	96,343		機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	313.88	372.26	3,010	316,421		保険
ADVANCE AUTO PARTS	52.97	62.26	951	100,010		専門小売り
EDISON INTERNATIONAL	266.52	350.41	2,029	213,312		電力
SOUTHERN CO	800.67	923.98	5,553	583,743		電力
TRUIST FINANCIAL CORP	1,036.81	1,215.55	6,565	690,132		銀行
SOUTHWEST AIRLINES	113.52	117.91	605	63,634		旅客航空輸送業
AT&T INC	5,656.86	6,363.97	18,328	1,926,663		各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,471.08	1,721.63	15,933	1,674,949		石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	117.76	140.26	2,462	258,862		機械
STATE STREET CORP	295.9	324.04	2,381	250,363		資本市場
STARBUCKS CORP	923.12	1,049.03	11,046	1,161,185		ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	175.47	175.47	690	72,545		金属・鉱業
STRYKER CORP	258.5	304.36	7,552	793,939		ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	338.6	394.98	21,981	2,310,687		娯楽
NORTONLIFELOCK INC	489.55	489.55	1,051	110,487		ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	97.93	97.93	424	44,615		陸運・鉄道
SYNOPSIS INC	118.55	133.81	3,908	410,856		ソフトウェア
SYSCO CORP	382.29	421.71	3,215	337,973		食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	88.5	105.44	8,517	895,364		ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	34.55	40.02	1,625	170,880		ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	883.22	883.22	982	103,242		医薬品
TERADYNE INC	121.62	142.84	2,034	213,833		半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	720.56	818.5	14,703	1,545,635		半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	163.04	194.86	991	104,241		航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	309.95	354.62	18,008	1,893,071		ライフサイエンス・ツール/サービス
TIFFANY & CO	87.33	-	-	-		専門小売り
GLOBE LIFE INC	72.82	105.78	994	104,546		保険
DAVITA INC	81.59	64.97	682	71,704		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	95.73	104.62	1,673	175,885		専門小売り
TRIMBLE INC	200.73	224.42	1,660	174,502		電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	28.51	34.73	1,648	173,337		ソフトウェア
TYSON FOODS INC	227.36	249.8	1,637	172,153		食品
UGI CORP	147.97	200.72	780	82,035		ガス
MARATHON OIL CORP	584.18	-	-	-		石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	544.82	605.64	12,909	1,357,080		陸運・鉄道



銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	634.51	1,372.1	9,962	1,047,291	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	733.07	849.87	27,896	2,932,441	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	61.53	61.53	795	83,618	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	72.26	81.39	1,433	150,683	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	267.5	287.12	2,282	239,977	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	453.61	493.63	2,878	302,572	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	198.29	239.38	5,122	538,451	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	97.94	121.7	2,001	210,446	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	602.5	668.71	3,368	354,145	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	1,104.64	1,264.14	18,263	1,919,809	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	323	383.57	4,343	456,633	商業サービス・用品
WATERS CORP	54.68	52.11	1,479	155,542	ライフサイエンス・ツール/サービス
ALLERGAN PLC	252.62	—	—	—	医薬品
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	52.4	70.09	2,060	216,622	ヘルスケア機器・用品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	91.76	103.06	1,186	124,695	食品
VAIL RESORTS INC	31.09	35.9	1,031	108,447	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	225.67	258.67	1,696	178,293	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	149.64	162.57	1,309	137,620	機械
WHIRLPOOL CORP	46.14	56.56	1,130	118,870	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	139.02	153.31	2,905	305,397	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	79.7	86.39	1,018	107,023	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	90.2	100.97	1,433	150,707	資本市場
CME GROUP INC	276.73	321.8	5,933	623,679	資本市場
WILLIAMS COS INC	907.18	1,125.35	2,570	270,189	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	221.96	236.91	874	91,945	販売
ALLIANT ENERGY CORP	172.21	228.29	1,102	115,885	電力
WEC ENERGY GROUP INC	238.39	290.02	2,408	253,193	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	218.2	—	—	—	資本市場
CARMAX INC	120.81	142.09	1,777	186,855	専門小売り
XILINX INC	189.97	214	3,119	327,874	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	930.1	1,081.5	7,354	773,073	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	41.28	45.61	2,178	229,053	電子装置・機器・部品
ZIONS BANCORP NA	131.42	—	—	—	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	274	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	764	1,087	498	52,447	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	157	206	1,116	117,368	コンゴロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	171	171	432	45,460	コンゴロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	81.78	102.39	1,616	169,973	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	41.71	—	—	—	銀行
CBRE GROUP INC	236.13	296.17	2,112	222,074	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	127.32	127.32	319	33,566	各種電気通信サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	764.8	855.82	1,673	175,969	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32.56	36.41	1,402	147,420	ホテル・レストラン・レジャー
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	37.37	1,442	151,602	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CHEMICAL CORP	30	—	—	—	化学
T-MOBILE US INC	256.75	499.8	6,181	649,802	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	277.59	302.77	1,696	178,295	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	282.49	325.92	953	100,281	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	28.92	32.09	1,773	186,391	資本市場
CELANESE CORP	103.26	115.88	1,538	161,682	化学
DEXCOM INC	72.16	87.06	3,591	377,564	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC-A	104.23	153.62	734	77,189	メディア
EXPEDIA GROUP INC	115.27	115.08	1,686	177,236	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	184.75	184.75	819	86,151	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	103.12	106.14	2,314	243,321	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	340.23	340.23	843	88,625	各種電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	442.48	487.85	5,418	569,597	資本市場

銘柄	期首(前期末)	当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額	評価額	評価額	
			千アメリカ・ドル	千円	千円	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	146.96	—	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
LIVE NATION	113.39	138.04	1,161	122,137	—	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	20.4	23.26	3,553	373,536	—	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	45.08	—	—	—	—	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	36.81	47.45	2,735	287,549	—	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	699.14	798.24	27,219	2,861,364	—	情報技術サービス
HANESBRANDS INC	276.19	—	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	352.22	353.67	848	89,189	—	情報技術サービス
OWENS CORNING	77.56	99.65	854	89,824	—	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	111.13	128.66	1,386	145,796	—	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	88.07	—	—	—	—	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	70.67	—	—	—	—	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT-ADR	173.5	173.5	308	32,464	—	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	91.76	99.59	1,474	155,013	—	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	295.45	—	—	—	—	銀行
DELTA AIR LINES INC	111.58	147.23	637	66,999	—	旅客航空輸送業
INSULET CORP	47.81	55.66	1,612	169,543	—	ヘルスケア機器・用品
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	60.38	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	239.78	269.75	2,528	265,753	—	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	256.41	289.3	3,754	394,646	—	電子装置・機器・部品
MASIMO CORP	—	45.05	1,242	130,571	—	ヘルスケア機器・用品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	159.7	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	40.76	—	—	—	—	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	82.55	108.17	3,708	389,860	—	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	65.32	74.64	1,083	113,871	—	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	35	40.41	7,851	825,366	—	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	45.77	45.38	1,451	152,593	—	専門小売り
INVESCO LTD	334.43	334.43	758	79,697	—	資本市場
MSCI INC	67.14	76.17	3,311	348,119	—	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,203.48	1,392.7	11,993	1,260,802	—	タバコ
VISA INC	1,337.71	1,505.8	31,615	3,323,450	—	情報技術サービス
KEURIG DR PEPPER INC	—	484.8	1,540	161,906	—	飲料
AMERICAN WATER WORKS CO INC	145.36	169.15	2,734	287,501	—	水道
DISCOVERY INC-C	304.21	304.21	1,239	130,312	—	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	514.74	595.87	3,006	316,070	—	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	116.24	117.44	1,055	110,910	—	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	1,600.64	1,859.92	2,760	290,143	—	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	132.37	172.22	1,707	179,444	—	機械
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	208.76	246.36	2,368	248,977	—	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	34.79	34.84	613	64,505	—	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	111.94	146.41	2,537	266,765	—	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	40.23	53.33	2,134	224,393	—	情報技術サービス
ZILLOW GROUP INC	—	53.66	1,088	114,473	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	148.14	762	80,135	—	資本市場
HCA HEALTHCARE INC	206.49	236.31	4,100	431,014	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	123.2	136.44	2,585	271,791	—	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	42.73	52.57	880	92,574	—	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	68.85	78.06	2,063	216,875	—	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	124.53	149.86	2,328	244,790	—	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	213.18	243.75	4,738	498,085	—	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	98.33	116.67	963	101,291	—	情報技術サービス
TARGA RESOURCES CORP	190.38	—	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	46.81	46.81	747	78,568	—	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	86.22	104.72	936	98,401	—	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	172.68	202.43	1,336	140,486	—	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	202.52	218.25	4,334	455,636	—	複合小売り
FORTINET INC	111.5	121.46	2,000	210,325	—	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
AON PLC	181.89	—	—	—	保険
HORIZON PHARMA PLC	—	189.86	1,718	180,680	医薬品
TESLA INC	105.48	667.04	54,438	5,722,571	自動車
GENERAC HOLDINGS INC	—	54.02	1,765	185,598	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	—	101.63	2,098	220,621	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,006.95	1,164.31	6,240	656,022	自動車
XPO LOGISTICS INC	76.14	76.14	923	97,094	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	92.63	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	318.71	338.57	1,422	149,515	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	121.38	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	102.73	135.03	742	78,040	各種金融サービス
APTIV PLC	189.2	326.97	3,703	389,322	自動車部品
PHILLIPS 66	342.35	399.51	3,085	324,338	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	58.85	71.72	922	97,022	ソフトウェア
FACEBOOK INC	1,861.56	2,150.14	58,161	6,113,914	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	134.53	168.96	3,255	342,184	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	114.24	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SERVENOW INC	144.06	172.89	10,222	1,074,622	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	72.72	84.6	3,342	351,386	ソフトウェア
WORKDAY INC	122.24	155.26	4,368	459,205	ソフトウェア
ABBVIE INC	1,144.34	1,581.52	16,517	1,736,308	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	368.25	426.6	7,111	747,597	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	168.99	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	238.13	—	—	—	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	302.63	302.63	717	75,459	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	140.75	—	—	—	商社・流通業
CDW CORP	114.06	127.68	1,984	208,573	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	638.82	—	—	—	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	101.99	—	—	—	旅客航空輸送業
HOWMET AEROSPACE INC	307.49	381.27	1,078	113,343	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	91.9	119	5,179	544,516	情報技術サービス
COUPA SOFTWARE INC	—	62.46	2,289	240,642	ソフトウェア
SNAP INC	571.3	822.23	5,095	535,624	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRADE DESK INC A	—	36.48	3,151	331,324	ソフトウェア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	143.04	195.46	888	93,426	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	50.06	83.24	362	38,124	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	142.05	142.05	610	64,149	メディア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	154.1	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
OKTA INC	88.16	106.51	3,107	326,686	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	127	130.42	1,139	119,823	情報技術サービス
BAKER HUGHES CO	510.05	572.74	1,300	136,668	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	106.69	131.81	1,017	106,911	食品
ALTICE USA INC-A	138.87	215.06	744	78,220	メディア
TECHNIPFMC LTD	312.57	—	—	—	エネルギー設備・サービス
BROADCOM INC	307.62	360.27	17,520	1,841,770	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	57.25	67.99	3,013	316,824	ソフトウェア
MONGODB INC	34.23	41.88	1,770	186,156	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	50.95	56.02	1,471	154,675	専門小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	295.78	358.24	1,065	112,033	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	97.33	118.32	3,762	395,559	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	575.62	690.05	4,961	521,548	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	132.14	132.14	771	81,120	電気設備
EVERGY INC	183.88	210.39	1,145	120,378	電力
ALLEGION PLC	74.69	90.22	1,066	112,156	建設関連製品
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	114.54	1,119	117,647	ソフトウェア
STERIS PLC	66.58	73.9	1,352	142,161	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	72.2	152.47	4,014	422,007	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
WIX.COM LTD	40	49.18	1,440	151,376	情報技術サービス
DROPBOX INC	175.73	281.7	690	72,579	ソフトウェア
KKR & CO INC	373.07	472.67	2,278	239,541	資本市場
PERRIGO CO PLC	105.53	105.53	474	49,897	医薬品
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC	-	155.78	6,746	709,243	ソフトウェア
MODERNA INC	-	240.31	4,415	464,152	バイオテクノロジー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	206.55	258.78	2,901	305,053	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	181.44	186.32	670	70,509	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA CORP	290.83	331.16	6,852	720,355	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	129.6	205.86	1,647	173,228	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	564.34	647.07	3,762	395,536	化学
AMCOR PLC	1,300	1,461.49	1,680	176,676	容器・包装
PINTEREST INC	131.83	420.97	3,537	371,896	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PELOTON INTERACTIVE INC	-	178.7	2,763	290,546	レジャー用品
XEROX HOLDINGS CORP	174.55	-	-	-	コンピュータ・周辺機器
FOX CORP-A	262.57	317.51	1,034	108,774	メディア
FOX CORP-B	130.09	130.09	409	43,008	メディア
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	-	130.78	3,166	332,829	ソフトウェア
CHEVY INC	-	65.86	781	82,171	インターネット販売・通信販売
AVANTOR INC	-	445.09	1,365	143,498	ライフサイエンス・ツール/サービス
DYNATRACE INC	-	159.49	853	89,746	ソフトウェア
CLOUDFLARE INC	-	132.18	1,136	119,425	ソフトウェア
TRADEWEB MARKETS INC	-	70.65	482	50,717	資本市場
CARRIER GLOBAL CORP	-	750.77	2,798	294,217	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	-	375.35	2,399	252,247	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	133.12	838.27	5,082	534,265	陸運・鉄道
CORTEVA INC	593.22	686.39	3,045	320,144	化学
MATCH GROUP INC	-	215.66	3,656	384,327	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SLACK TECHNOLOGIES INC	-	325.12	1,420	149,317	ソフトウェア
BLACKSTONE GROUP INC	508.89	585.87	4,113	432,399	資本市場
CARLYLE GROUP INC	-	125.09	464	48,863	資本市場
10X GENOMICS INC	-	53.12	1,045	109,926	ライフサイエンス・ツール/サービス
DATADOG INC	-	130.21	1,469	154,479	ソフトウェア
GRUBHUB INC	81.58	-	-	-	インターネット販売・通信販売
INGERSOLL RAND INC	-	312.82	1,373	144,424	機械
PAYCOM SOFTWARE INC	39.23	43.3	1,788	187,975	ソフトウェア
PPD INC	-	108.28	411	43,253	ライフサイエンス・ツール/サービス
SABRE CORP	198.09	-	-	-	情報技術サービス
AON PLC	-	208.07	4,744	498,776	保険
IAC/INTERACTIVECORP	-	70.64	1,853	194,812	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZENDESK INC	-	100.21	1,575	165,595	ソフトウェア
ROYALTY PHARMA PLC	-	103.61	497	52,257	医薬品
VIATRIS INC	-	1,128.66	2,058	216,408	医薬品
DRAFTKINGS INC	-	146.71	895	94,183	ホテル・レストラン・レジャー
SNOWFLAKE INC	-	28.05	840	88,302	情報技術サービス
ARISTA NETWORKS INC	44.41	50.42	1,630	171,359	通信機器
IHS MARKIT LTD	297.96	344.11	3,220	338,541	専門サービス
FNF GROUP	213.72	245.67	973	102,343	保険
CATALENT INC	-	146.73	1,838	193,219	医薬品
SYNCHRONY FINANCIAL	439.86	454.91	1,689	177,651	消費者金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	358.2	415.03	1,681	176,780	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD	34.57	34.57	562	59,154	ソフトウェア
CDK GLOBAL INC	99.69	-	-	-	ソフトウェア
WAYFAIR INC	50.91	55.43	1,623	170,707	インターネット販売・通信販売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	139.54	174.07	2,671	280,841	電子装置・機器・部品
HUBSPOT INC	-	37.41	1,879	197,570	ソフトウェア
QORVO INC	88.71	101.68	1,789	188,119	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)		当期末		業種等	
	株数	株数	評価額	金額		
	株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	168.88	—	—	—	各種電気通信サービス	
LIBERTY BROADBAND CORP W/I	—	29.47	432	45,436	メディア	
LIBERTY BROADBAND CORP-C W/I	83.07	131.89	1,973	207,423	メディア	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	170.18	170.18	463	48,730	化学	
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	—	42.57	1,408	148,071	半導体・半導体製造装置	
GODADDY INC	123.28	145.4	1,246	131,064	情報技術サービス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	262.04	—	—	—	専門サービス	
ETSY INC	—	102.37	2,394	251,659	インターネット販売・通信販売	
TRANSUNION	150	167.6	1,593	167,477	専門サービス	
SQUARE INC	264.87	335.06	9,138	960,666	情報技術サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	587.57	477.57	3,413	358,794	化学	
CARVANA CO	—	53.47	1,582	166,402	専門小売り	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	193.21	182.96	940	98,894	飲料	
TELADOC HEALTH INC	—	104.54	3,069	322,710	ヘルスケア・テクノロジー	
WESTROCK CO	182.84	227.78	1,007	105,929	容器・包装	
KRAFT HEINZ CO	511.63	568.79	2,012	211,601	食品	
NOVOCURE LTD	—	74.08	1,404	147,685	ヘルスケア機器・用品	
FORTIVE CORP	225	259.81	1,858	195,329	機械	
MATCH GROUP INC	45.99	—	—	—	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
WASTE CONNECTIONS INC	204.17	247.78	2,461	258,799	商業サービス・用品	
ALPHABET INC-CL A	231.32	269	56,356	5,924,174	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	1,040.4	1,162.57	1,671	175,737	コンピュータ・周辺機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	864.04	1,000.53	29,852	3,138,127	情報技術サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	354.71	352.77	964	101,422	各種金融サービス	
SUNRUN INC	—	100	836	87,964	電気設備	
DXC TECHNOLOGY CO	208.48	—	—	—	情報技術サービス	
ZILLOW GROUP INC-C	81.66	133.76	2,645	278,137	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
ALPHABET INC-CL C	242.52	267.96	56,381	5,926,847	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
BEIGENE LTD ADR	31.59	—	—	—	バイオテクノロジー	
ZSCALER INC	—	61.93	1,402	147,440	ソフトウェア	
CABLE ONE INC	—	3.92	806	84,754	メディア	
LINDE PLC	417.98	470.49	11,888	1,249,702	化学	
ATHENE HOLDING LTD	118.47	118.47	535	56,252	保険	
ROKU INC	66.74	95.87	4,493	472,318	娯楽	
AVALARA INC	—	71.02	1,234	129,737	ソフトウェア	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	119.86	129.32	7,933	833,931	メディア	
VISTRA CORP	300	380.32	811	85,275	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	232,877.56 608銘柄	278,491.28 592銘柄	3,119,137 —	327,883,766 <68.7%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES LTD	163.02	205.78	1,742	144,386	金属・鉱業	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	684.96	784.79	3,125	258,877	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	1,409.53	1,559.61	4,385	363,305	金属・鉱業	
ATCO LTD	71.93	71.93	277	22,988	総合公益事業	
BANK OF MONTREAL	502.86	584.93	5,708	472,926	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	945.61	1,094.36	7,771	643,753	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	255.48	291.32	2,117	175,374	銀行	
BCE INC	116.73	149.59	830	68,763	各種電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	687.51	1,159.24	6,316	523,275	資本市場	
BAUSCH HEALTH COS INC	204.15	281.92	1,118	92,669	医薬品	
BOMBARDIER INC 'B'	1,516.15	—	—	—	航空宇宙・防衛	
SAPUTO INC	186.01	253.95	958	79,415	食品	
BLACKBERRY LTD	396.52	466.71	768	63,638	ソフトウェア	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	363.21	561.93	1,263	104,645	総合公益事業	
CGI INC	186.86	198.59	1,997	165,449	情報技術サービス	
CCL INDUSTRIES INC	113.4	153.58	1,017	84,248	容器・包装	
CAE INC	230	250.06	802	66,495	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
CAMECO CORP	326.27	326.27	653	54,110	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM-CL B	276.96	315.43	1,813	150,248	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	341.11	409.56	4,645	384,844	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	914.93	1,007.58	3,440	285,042	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP-CL A	48.62	48.62	846	70,138	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	91.19	91.19	294	24,415	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	554.93	634.82	8,918	738,815	陸運・鉄道
YAMANA GOLD INC	-	843.17	513	42,537	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	159.11	159.11	568	47,081	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	217.95	252.61	1,539	127,503	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	150.93	150.93	573	47,486	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	997.41	1,278.09	1,195	98,994	金属・鉱業
RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC	-	99.63	734	60,851	商業サービス・用品
FORTIS INC	323.12	452.28	2,329	192,954	電力
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	552.96	496.94	1,252	103,739	金属・鉱業
TELUS CORP	159.45	318.9	850	70,482	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	207.22	252.5	785	65,052	保険
IMPERIAL OIL LTD	215.42	215.42	554	45,934	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,565.99	1,830.5	8,056	667,361	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	29.53	60.69	211	17,521	資本市場
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,470.54	1,716.81	4,271	353,844	保険
LOBLAW CO LTD	153.54	151.36	947	78,466	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	239.09	270.24	2,672	221,359	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	442.41	518.08	3,212	266,090	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	20.72	23.98	1,229	101,883	保険
METRO INC	199.49	207.6	1,136	94,173	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	287.49	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
EMERA INC	191.38	224.33	1,166	96,634	電力
METHANEX CORP	52.81	-	-	-	化学
ONEX CORP	66.46	66.46	481	39,898	各種金融サービス
PAN AMERICAN SILVER CORP	-	187.66	794	65,851	金属・鉱業
POWER CORP OF CANADA	237.92	465.51	1,431	118,580	保険
POWER FINANCIAL CORP	216.76	-	-	-	保険
QUEBECOR INC-B	113.31	160.42	521	43,203	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	1,113.11	1,270.82	13,496	1,118,017	銀行
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	107.47	122.36	5,673	470,010	陸運・鉄道
SHAW COMM INC-B	354.31	434.84	982	81,410	メディア
SUNCOR ENERGY INC	1,191.41	1,308.06	2,994	248,035	石油・ガス・消耗燃料
LUNDIN MINING CORP	434.8	643.1	855	70,854	金属・鉱業
TECK RESOURCES LTD-CL B	410.16	410.16	1,026	85,046	金属・鉱業
THOMSON REUTERS CORP	163.94	150.49	1,582	131,111	専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	-	74.17	689	57,110	商社・流通業
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	1,409.24	1,612.38	12,160	1,007,381	銀行
TC ENERGY CORP	717.04	824.24	4,664	386,396	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER CO LTD	56.96	72	678	56,209	紙製品・林産品
WESTON (GEORGE) LTD	61.84	61.84	599	49,640	食品・生活必需品小売り
INTACT FINANCIAL CORP	109.89	125.15	1,867	154,723	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	349.63	409.93	2,091	173,290	金属・鉱業
CONSTELLATION SOFTWARE INC	15.65	18.64	3,008	249,222	ソフトウェア
FRANCO-NEVADA CORP NPR	149.22	176.52	2,714	224,856	金属・鉱業
B2GOLD CORP	-	1,016.75	649	53,821	金属・鉱業
CI FINANCIAL CORP	206.95	202.85	388	32,196	資本市場
KEYERA CORP	166.68	166.68	434	35,983	石油・ガス・消耗燃料
PARKLAND CORP	105.83	144.97	545	45,227	石油・ガス・消耗燃料
ALTAGAS LTD	239.44	239.44	476	39,432	ガス
PEMBINA PIPELINE CORP	426.84	504.1	1,775	147,077	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	235.36	269.06	1,311	108,636	複合小売り

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	
<b>(カナダ)</b>	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
STARS GROUP INC	185.29	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
CENOVUS ENERGY INC W/I	807.21	1,197.09	1,025	84,986	石油・ガス・消耗燃料
NORTHLAND POWER INC	—	175.68	864	71,631	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
TMX GROUP LTD	—	50.58	650	53,917	資本市場
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	152.5	218.4	1,061	87,910	金属・鉱業
INTER PIPELINE LTD	279.46	418.63	729	60,446	石油・ガス・消耗燃料
NUTRIEN LTD	444.53	506.3	3,599	298,206	化学
CRONOS GROUP INC	160	—	—	—	医薬品
SSR MINING INC	—	180	378	31,313	金属・鉱業
WSP GLOBAL INC	84	101.94	1,176	97,451	建設・土木
IA FINANCIAL CORP INC	81.04	122.78	794	65,786	保険
GFL ENVIRONMENTAL INC	—	164.85	604	50,063	商業サービス・用品
OVINTIV INC	192.78	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BROOKFIELD RENEWABLE CORP	—	108.45	695	57,632	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	149.61	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
AIR CANADA	107.22	107.22	239	19,833	旅客航空輸送業
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	196.85	251.76	1,888	156,481	ホテル・レストラン・レジャー
AURORA CANNABIS INC	665.62	—	—	—	医薬品
SHOPIFY INC	76.05	97.39	17,989	1,490,281	情報技術サービス
FIRSTSERVICE CORP	—	35.03	664	55,008	不動産管理・開発
CANOPIY GROWTH CORP	186.34	186.34	952	78,941	医薬品
HYDRO ONE LTD	273.4	273.4	787	65,272	電力
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,926.62 85銘柄	35,759.37 87銘柄	192,614 15,956,174	<3.3%>
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	124.32	168.54	1,087	88,733	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	2,181.8	2,577.13	6,396	521,949	銀行
WESTPAC BANKING CORPORATION	2,654.07	3,180.22	7,041	574,546	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,156.62	1,535.17	3,658	298,518	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	2,969.65	3,644.09	1,184	96,641	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	390.14	—	—	—	銀行
AMP LTD	3,024.14	3,024.14	399	32,573	各種金融サービス
ASX LTD	155.73	191.62	1,349	110,110	資本市場
BHP GROUP LTD	2,281.36	2,637.49	11,794	962,460	金属・鉱業
AMPOL LTD	209.46	209.46	560	45,720	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	148.67	—	—	—	複合小売り
COMPUTERSHARE LT	380.4	380.4	539	44,046	情報技術サービス
CSL LIMITED	351.66	407.66	11,282	920,643	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	41.19	57.45	902	73,675	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,064.75	2,508.16	3,273	267,088	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	486.01	526.93	691	56,455	飲料
COCHLEAR LTD	43.81	55.33	1,142	93,192	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,328.6	1,328.6	579	47,268	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,370.26	1,589.4	13,807	1,126,660	銀行
BORAL LIMITED	861.01	—	—	—	建設資材
RIO TINTO LIMITED	280.81	338.59	3,973	324,225	金属・鉱業
APA GROUP	941.06	1,182.05	1,120	91,439	ガス
ARISTOCRAT LEISU	453.23	517.17	1,710	139,558	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	1,805.73	2,251.8	1,202	98,120	保険
TPG TELECOM LTD	287.19	287.19	212	17,365	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32.75	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	339.26	398.39	1,621	132,310	建設資材
ORICA LTD	278.65	413.11	632	51,575	化学
CIMIC GROUP LTD	87.09	87.09	178	14,603	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	429.74	621.16	741	60,519	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	369.41	496.93	844	68,934	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	851.3	1,160.56	648	52,938	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	額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(オーストラリア)</b>	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
MACQUARIE GROUP LTD	247.65	298.21	4,302	351,090	資本市場
WORLEY LTD	277.72	-	-	-	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	1,047.83	1,174.54	1,235	100,826	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	2,264.21	2,998.19	7,474	609,918	銀行
NEWCREST MINING LTD	620.8	732.02	1,900	155,066	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,054.7	1,978.95	801	65,400	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,364.26	-	-	-	化学
QANTAS AIRWAYS LIMITED	622.82	622.82	283	23,124	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	1,078.2	1,448.68	1,254	102,371	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	-	934.04	1,126	91,918	金属・鉱業
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	457.07	-	-	-	各種金融サービス
SANTOS LTD	1,328.62	1,596.18	1,086	88,699	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	346.84	401.48	1,376	112,336	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H SOUL PATTINSON & CO LTD	44.66	84.06	243	19,830	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	1,485.35	2,056.49	913	74,507	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	860.51	1,015.75	5,586	455,868	複合小売り
ALUMINA LIMITED	1,846.13	-	-	-	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	759.44	861.96	2,153	175,699	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	956.47	1,117.03	4,590	374,625	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	99.95	99.95	484	39,515	資本市場
SEEK LTD	258.99	358.36	1,119	91,381	インターネット・メディアおよびサービス
AUSNET SERVICES	1,650.66	1,650.66	282	23,032	電力
AGL ENERGY LTD	496.44	490.76	542	44,250	総合公益事業
BRAMBLES LTD	1,266.93	1,271.66	1,323	108,021	商業サービス・用品
CROWN RESORTS LTD	328.61	328.61	324	26,519	ホテル・レストラン・レジャー
EVOLUTION MINING LTD	-	1,409.64	651	53,142	金属・鉱業
AURIZON HOLDINGS LTD	1,501.5	1,501.5	578	47,171	陸連・鉄道
TREASURY WINE ESTATES LTD	576.67	576.67	585	47,762	飲料
XERO LTD	-	104.98	1,367	111,585	ソフトウェア
AFTERPAY LTD	-	183.22	2,780	226,862	情報技術サービス
MEDIBANK PVT LTD	2,069.1	2,831.54	812	66,312	保険
SOUTH32 LTD(AUD)	3,575.25	4,123.45	1,067	87,146	金属・鉱業
COLES GROUP LTD	816.08	1,210.32	2,196	179,253	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	80	136.04	446	36,466	ソフトウェア
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	57,763.33 62銘柄	65,373.59 58銘柄	127,470 -	10,401,584 <2.2%>
<b>(香港)</b>	百株	百株	千香港・ドル	千円	
ASM PACIFIC TECH	191	329	3,964	53,757	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,640	1,640	3,476	47,145	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,038.6	1,038.6	1,842	24,983	銀行
CLP HOLDINGS LTD	1,210	1,345	9,710	131,679	電力
PCCW LTD	3,310	3,310	1,515	20,556	各種電気通信サービス
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	495	495	2,096	28,426	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	944.4	1,090.4	58,336	791,041	資本市場
MTR CORP	1,260	1,260	5,657	76,714	陸連・鉄道
HANG SENG BANK LTD	577	657	9,605	130,248	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	1,154.5	1,154.5	3,607	48,921	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,015	1,345	5,561	75,414	電力
HONG KONG & CHINA GAS	7,767.55	9,132.92	10,027	135,978	ガス
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	1,570	1,970	13,583	184,187	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES LTD	735	-	-	-	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,750	3,175	7,508	101,820	銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,350	-	-	-	コンプロマリット
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	505	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,842.66	1,630.66	5,788	78,496	不動産管理・開発
SINO LAND CO	2,554	2,554	2,911	39,480	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,250	1,085	11,804	160,073	不動産管理・開発



銘柄	期首(前期末)		当期		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	
SWIRE PACIFIC LTD A	305	495	2,440	33,091	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,135	1,285	15,921	215,890	機械
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	700	—	—	—	食品
WHEELOCK & CO LTD	640	—	—	—	不動産管理・開発
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	1,660	3,701	50,196	建設関連製品
SJM HOLDINGS LTD	1,560	1,560	1,539	20,878	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,244	1,244	1,749	23,717	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	9,356.27	10,872.27	112,527	1,525,879	保険
HKT TRUST / HKT LTD	2,890	2,890	3,040	41,226	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	1,992	1,988	6,739	91,385	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,042	1,042	2,349	31,862	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	957.5	1,497.5	6,581	89,245	不動産管理・開発
ESR CAYMAN LTD	—	1,474	4,171	56,564	不動産管理・開発
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	2,300	2,300	1,745	23,671	電力
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	1,019	1,506	3,945	53,503	飲料
WH GROUP LTD	7,425	8,970	5,767	78,210	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,088.32	2,553.32	13,660	185,233	コングロマリット
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,983.32	2,248.32	8,982	121,796	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	351,864 —	4,771,281 —	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE TECH ENG	1,250	1,250	465	36,902	航空宇宙・防衛
SEMBCORP INDUSTRIES	814	—	—	—	総合公益事業
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	1,237	—	—	—	メディア
DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,419	1,557	4,059	322,130	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	364	364	261	20,740	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	59.44	—	—	—	販売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	478	—	—	—	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	689	689	685	54,405	資本市場
CAPITALAND LTD	2,045.15	3,088.15	960	76,218	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	4,164	4,268	367	29,128	ホテル・レストラン・レジャー
KEPPEL CORP LTD	1,011	1,349	690	54,812	コングロマリット
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,779	—	—	—	陸運・鉄道
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,515.53	2,716.53	2,865	227,440	銀行
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,071.22	6,768.22	1,610	127,835	各種電気通信サービス
SINGAPORE AIRLINES LTD	475	1,608.5	702	55,783	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK LTD	952	1,024	2,451	194,547	銀行
UOL GROUP LIMITED	405	405	301	23,944	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	210	210	418	33,214	電子装置・機器・部品
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,423	1,814	972	77,162	食品
YANGZJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	1,888	—	—	—	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	16,812 —	1,334,268 —	
(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	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	852.45	1,102.26	760	57,726	運送インフラ
RYMAN HEALTHCARE LTD	298.94	298.94	437	33,240	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD	550.91	550.91	587	44,573	食品
FISHER & PAYKEL	431.84	490.44	1,581	120,048	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	641.04	—	—	—	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,596.23	1,596.23	749	56,881	各種電気通信サービス
MIGHTY RIVER POWER LTD	617.34	617.34	419	31,862	電力
MERIDIAN ENERGY LTD	756.56	1,241.62	721	54,752	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	5,258 —	399,085 —	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	317.98	317.98	487	71,096	金属・鉱業
ASHTREAD GROUP	366.89	389.16	1,524	222,381	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
SEVERN TRENT PLC	182.17	219.33	514	75,110	水道
BHP GROUP PLC	1,612.84	1,844.54	3,905	569,662	金属・鉱業
BARCLAYS PLC	13,428.31	16,088.89	2,347	342,363	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	822.83	822.83	559	81,606	家庭用耐久財
BT GROUP PLC	6,307.77	7,955.07	986	143,870	各種電気通信サービス
BUNZL PLC	278.38	288.34	675	98,533	商社・流通業
EASYJET PLC	136.28	-	-	-	旅客航空輸送業
AVIVA PLC	3,146.91	3,634.64	1,267	184,797	保険
CRODA INTERNATIONAL	103.91	125.68	829	120,980	化学
DIAGEO PLC	1,828.12	2,096.47	6,308	920,062	飲料
SCHRODERS PLC	109.32	113.54	400	58,439	資本市場
DCC PLC	78.98	78.98	464	67,756	コンゴロマリット
NATIONAL GRID PLC	2,646.42	3,068.81	2,628	383,312	総合公益事業
KINGFISHER PLC	1,656.8	1,971.59	534	77,899	専門小売り
BAE SYSTEMS PLC	2,486.72	2,737.49	1,313	191,646	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,772.72	2,065.85	5,607	817,890	タバコ
HALMA PLC	279.01	319.01	816	119,064	電子装置・機器・部品
NEXT PLC	100.18	114.67	880	128,411	複合小売り
IMPERIAL BRANDS PLC	716.56	877.08	1,309	191,051	タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	150.17	191.07	573	83,686	化学
ANGLO AMERICAN PLC	789.81	1,075.54	2,864	417,738	金属・鉱業
COMPASS GROUP PLC	1,195.6	1,564.43	2,205	321,608	ホテル・レストラン・レジャー
HSBC HOLDINGS PLC	15,612.12	18,255.85	7,335	1,069,838	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	4,527.58	5,146.92	1,337	195,101	保険
CENTRICA PLC	4,713.4	-	-	-	総合公益事業
UNILEVER PLC	855.86	2,351.36	9,313	1,358,408	パーソナル用品
MEGGITT PLC	621.81	-	-	-	航空宇宙・防衛
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	1,686.76	2,302.12	393	57,415	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	544.87	677.14	639	93,230	水道
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	808.64	954.87	646	94,284	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	255.47	311.66	694	101,229	食品
PEARSON PLC	650.09	650.09	496	72,382	メディア
PERSIMMON PLC	260.85	281.26	765	111,661	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,049.4	2,268.96	3,013	439,472	保険
RIO TINTO PLC	874.36	1,010.08	5,993	874,197	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC	20,437.18	24,232.37	3,244	473,241	無線通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	544.64	645.58	4,071	593,759	家庭用品
RELX PLC	1,475.23	1,741.63	3,250	474,122	専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,406.17	1,697.66	891	130,041	商業サービス・用品
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	1,392.68	6,709.69	622	90,814	航空宇宙・防衛
NATWEST GROUP PLC	3,974.34	4,230.54	724	105,696	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	376.85	497.89	609	88,956	資本市場
SSE PLC	746.84	886.46	1,260	183,850	電力
BP PLC	15,740.09	18,382.94	4,812	701,925	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	871.11	1,084.48	640	93,352	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	317.2	403.17	603	88,027	コンゴロマリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55.18	65.74	773	112,804	機械
STANDARD CHARTERED PLC	2,183.29	2,400.93	1,111	162,096	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	53,939.91	64,953.56	2,409	351,465	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	2,522.87	3,467.94	558	81,484	家庭用耐久財
TESCO PLC	7,573.16	8,605.34	2,070	301,974	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	766.43	886.51	1,016	148,304	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	680.27	769.28	1,209	176,433	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	3,862.19	4,499.85	5,750	838,755	医薬品
WEIR GROUP	191.61	-	-	-	機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	246.6	275.89	2,703	394,337	資本市場
WPP PLC	951.48	1,115.98	920	134,314	メディア

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	1,015.56	1,175.51	8,782	1,280,889	医薬品
WHITBREAD PLC	98.14	185.94	596	86,971	ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	133.5	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	1,767.3	—	—	—	複合小売り
INTERTEK GROUP PLC	120.83	138.42	808	117,860	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	316.86	389.5	696	101,573	繊維・アパレル・贅沢品
INTERCONTINENTAL HOTELS	124.6	166.52	815	118,884	ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	2,543.08	—	—	—	メディア
SAINSBURY (J) PLC	1,372.15	1,902.05	435	63,555	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	1,222.5	—	—	—	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	158.93	158.93	476	69,470	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	82.33	115.81	498	72,681	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,336.87	3,777.76	5,130	748,349	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	2,863.67	3,238.58	4,212	614,334	石油・ガス・消耗燃料
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	182	429	62,645	医薬品
TUI AG-DI	298.24	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
AVEVA GROUP PLC	57.04	104.08	397	57,911	ソフトウェア
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,011.44	2,063.13	659	96,230	資本市場
EXPERIAN PLC	698.42	803.76	2,120	309,248	専門サービス
MONDI PLC	397.67	471.7	867	126,587	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	209.27	280.11	461	67,245	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	—	173.85	177	25,875	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	310.11	427.89	1,121	163,508	インターネット販売・通信販売
INFORMA PLC	1,024.75	1,493.58	758	110,662	メディア
GLENCORE PLC	8,664.21	8,804.08	2,366	345,159	金属・鉱業
ENTAIN PLC	496.18	496.18	671	97,913	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	487.65	487.65	250	36,500	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	81.49	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC	1,126.94	1,126.94	345	50,344	保険
COCA-COLA HBC AG	152.08	152.08	361	52,679	飲料
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	517.21	366	53,483	保険
FERGUSON PLC	171.28	205.31	1,831	267,104	商社・流通業
M&G PLC	2,049.4	2,049.4	384	56,104	各種金融サービス
JD SPORTS FASHION PLC	320.86	320.86	258	37,634	専門小売り
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	261	—	—	—	ソフトウェア
AUTO TRADER GROUP PLC	763.48	980.62	580	84,727	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,647.35	4,246.75	725	105,791	コンピュータソフト
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	232,616.39 93銘柄	266,360.93 85銘柄	146,478 —	21,363,882 <4.5%>
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円	
BANK HAPOALIM BM	797.54	1,023.59	2,359	76,231	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	1,063.99	1,307.03	2,594	83,826	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD	17.6	17.6	820	26,499	航空宇宙・防衛
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	1,021.34	1,021.34	1,278	41,315	銀行
ICL GROUP LTD	494.11	494.11	944	30,508	化学
NICE LTD	49.02	55.35	4,964	160,415	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	104.44	104.44	803	25,946	銀行
AZRIELI GROUP	22.91	44.14	898	29,022	不動産管理・開発
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,570.95 8銘柄	4,067.6 8銘柄	14,663 —	473,765 <0.1%>
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円	
CREDIT SUISSE GROUP AG	1,914.83	2,257.7	2,782	327,931	資本市場
LOGITECH INTL-REG	—	144.29	1,512	178,207	コンピュータ・周辺機器
NESTLE SA-REGISTERED	2,303.64	2,570.32	25,888	3,050,931	食品
CIE FINANCIER RICHEMONT	409.15	474.14	4,162	490,491	繊維・アパレル・贅沢品
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	544.32	628.85	19,695	2,321,124	医薬品
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	28.96	34.67	870	102,555	機械

銘柄	期首(前期末)		当期			業種等
	株数	株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
SIKA INHABER	102.09	123.63	3,147	370,946	化学	
SGS SA-REG	4.24	5.4	1,473	173,670	専門サービス	
NOVARTIS AG-REG SHS	1,662.22	1,981.27	16,246	1,914,639	医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	32.52	42.59	660	77,798	保険	
BARRY CALLEBAUT AG	2.65	2.65	535	63,147	食品	
CLARIANT AG-REG	122.82	199.79	371	43,794	化学	
SWISSCOM AG-REG	19.6	24.89	1,156	136,339	各種電気通信サービス	
ABB LTD	1,408.52	1,657.76	4,343	511,861	電気設備	
ADECCO GROUP AG-REG	129.44	129.44	738	87,011	専門サービス	
GEBERIT AG	29.01	31.81	1,773	208,958	建設関連製品	
LONZA GROUP AG-REG	57.93	68.69	4,190	493,802	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDT & SPRUENGLI PART	0.79	0.95	779	91,861	食品	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.09	0.09	774	91,215	食品	
GIVAUDAN-REG	7.42	8.12	2,967	349,762	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	115.58	135.85	5,063	596,689	保険	
LAFARGEHOLCIM LTD	379.97	478.95	2,392	281,939	建設資材	
TEMENOS GROUP	47.3	57.23	600	70,784	ソフトウェア	
SONOVA HOLDING AG	45.84	46.98	1,122	132,269	ヘルスケア機器・用品	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	40.18	45.18	942	111,015	海運業	
STRAUMANN HOLDING AG	7.94	9.19	1,015	119,730	ヘルスケア機器・用品	
THE SWATCH GROUP AG-B	21.34	24.41	646	76,233	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	45.92	45.92	235	27,734	繊維・アパレル・贅沢品	
SCHINDLER NAMEN	16.63	16.63	416	49,035	機械	
SWISS LIFE HOLDING AG	24.58	27.61	1,204	141,964	保険	
BANQUE CANTONALE VAUD	-	25	248	29,285	銀行	
VIFOR PHARMA AG	34.65	46.45	548	64,594	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING	6.33	8.27	740	87,228	化学	
SWISS PRIME SITE AG	59.9	83.37	731	86,166	不動産管理・開発	
PARGESA HOLDING PORTEUR	30	-	-	-	各種金融サービス	
DUFREY GROUP	31.38	-	-	-	専門小売り	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	15.05	16.58	1,852	218,354	資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	178.49	201.18	1,098	129,451	資本市場	
SWISS RE LTD	225.97	248.71	2,086	245,914	保険	
ALCON INC	320.32	429.61	2,856	336,686	ヘルスケア機器・用品	
UBS GROUP AG	3,016.86	3,314.28	4,540	535,105	資本市場	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	13,444.47 39銘柄	15,648.45 39銘柄	122,411	14,426,235	<3.0%>
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	84.41	99.74	9,585	164,191	飲料	
A P MOLLER A/S	4.91	5.68	7,196	123,277	海運業	
AP MOLLER MAERSK A	2.73	2.55	2,996	51,325	海運業	
DANSKE BANK A/S	510.34	593.05	6,505	111,443	銀行	
GENMAB A/S	50.14	61.9	15,524	265,935	バイオテクノロジー	
NOVOZYMES-B SHS	155.33	177.4	7,195	123,256	化学	
ROCKWOOL INTERNATIONAL AS	-	8.13	1,843	31,585	建設関連製品	
NOVO NORDISK A/S-B	1,369.25	1,540.44	70,860	1,213,835	医薬品	
GN STORE NORD A/S	-	128.95	7,110	121,799	ヘルスケア機器・用品	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	139.63	181.27	23,583	403,980	電気設備	
COLOPLAST-B	97.29	107.34	11,056	189,389	ヘルスケア機器・用品	
DSV PANALPINA A S	176.26	190.49	21,353	365,792	航空貨物・物流サービス	
DEMANT A/S	72.44	107.39	2,849	48,804	ヘルスケア機器・用品	
H LUNDBECK A/S	48.4	48.4	1,235	21,158	医薬品	
TRYG A/S	111.07	111.07	2,228	38,166	保険	
PANDORA A/S	82.51	82.51	5,052	86,556	繊維・アパレル・贅沢品	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	75.39	93.36	5,355	91,733	化学	
AMBU A/S B	-	141.56	4,675	80,095	ヘルスケア機器・用品	

銘柄	期首(前期末)		当期		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	千円	
ISS A/S	111.07	—	—	—	商業サービス・用品
ORSTED A/S	150.9	164.71	17,162	293,998	電力
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	223,369	3,826,326	
	17銘柄	19銘柄	—	<0.8%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千円	千円	
MOWI ASA	351.83	435.37	8,374	104,176	食品
DNB ASA	713.52	807.09	13,280	165,211	銀行
NORSK HYDRO ASA	931.39	1,290.36	5,293	65,845	金属・鉱業
TELENOR ASA	547.66	630.38	8,945	111,276	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	—	75.37	2,713	33,753	メディア
ORKLA ASA	649.38	652.83	5,291	65,830	食品
EQUINOR ASA	810.22	831.49	12,555	156,190	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	121.71	151.93	6,285	78,189	化学
AKER BP ASA	85.52	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	166.83	166.83	3,403	42,337	保険
ADEVINTA ASA	—	222.65	2,996	37,281	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SCHIBSTED ASA	74.45	74.45	2,251	28,007	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	株数・金額 銘柄数<比率>	71,390	888,100	
	10銘柄	11銘柄	—	<0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
ATLAS COPCO AB-A SHS	522.84	564.89	27,803	351,997	機械
ATLAS COPCO AB-B SHS	287.68	360.51	15,314	193,881	機械
ERICSSON LM-B SHS	2,361.6	2,649.68	30,100	381,070	通信機器
LUNDBERGS B	73.82	73.82	3,239	41,008	各種金融サービス
SKF AB-B SHS	288.12	348.49	7,757	98,208	機械
SANDVIK AB	877.84	1,034	22,344	282,884	機械
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	1,308.27	1,449.9	13,692	173,351	銀行
SKANSKA AB-B SHS	244	316.53	6,580	83,311	建設・土木
SWEDBANK AB	719.58	798.25	11,940	151,163	銀行
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	—	529.45	8,023	101,581	紙製品・林産品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	1,121.06	1,392.3	11,831	149,790	銀行
VOLVO AB-B SHS	1,192.27	1,305.9	27,450	347,517	機械
SWEDISH MATCH AB	129.41	138.45	8,525	107,936	タバコ
TELE2 AB-B SHS	346.18	470.55	5,187	65,677	無線通信サービス
INDUSTRIVARDEN A	—	119.55	3,498	44,285	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN C	114.03	114.03	3,183	40,305	各種金融サービス
ELECTROLUX AB-SER B	191.91	191.91	4,055	51,337	家庭用耐久財
SECURITAS AB-B SHS	240.98	240.98	3,012	38,135	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	351.8	395.67	25,750	325,997	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	602.83	688.14	12,376	156,682	専門小売り
ASSA ABLOY AB-B	810.88	870.21	19,614	248,319	建設関連製品
TELIA CO AB	2,318.55	2,104.77	7,436	94,141	各種電気通信サービス
LUNDIN ENERGY AB	121.46	147.39	3,746	47,432	石油・ガス・消耗燃料
BOLIDEN AB	218.55	283.76	8,816	111,615	金属・鉱業
ALFA LAVAL AB	233.43	283.92	7,072	89,537	機械
KINNEVIK AB-B	183.1	217.22	9,554	120,958	各種金融サービス
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	78.44	—	—	—	無線通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER	—	89.67	3,753	47,520	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	59.2	90.09	3,714	47,024	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	336.92	336.92	3,463	43,848	家庭用耐久財
NIBE INDUSTRIER AB	—	288.34	8,367	105,934	建設関連製品
HEXAGON AB	211.45	265.34	19,481	246,632	電子装置・機器・部品
EPIROC AB-A	489.55	607.5	10,409	131,784	機械
EPIROC AB-B	308.99	308.99	4,795	60,711	機械
ESSITY AB-B	466.4	521.43	13,739	173,944	家庭用品
EQT AB	—	209.34	5,442	68,906	資本市場
EVOLUTION GAMING GROUP AB	—	136.41	14,152	179,171	ホテル・レストラン・レジャー

銘柄	期首(前期末)		当期		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	千円		
NORDEA BANK ABP	2,592.68	2,957.52	21,193	268,310	銀行	
INVESTMENT AB LATOUR	—	149.45	3,036	38,446	コンプロマリット	
小計	株数・金 銘柄 額 <比率>	19,403.82	23,051.27	419,459	5,310,363	
(ユーロ…イギリス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UNILEVER PLC	1,131.34	—	—	—	パーソナル用品	
小計	株数・金 銘柄 額 <比率>	1,131.34	—	—	—	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
CRH PLC	619.9	716.53	2,635	335,855	建設資材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	62.46	141.28	2,263	288,435	ホテル・レストラン・レジャー	
KERRY GROUP PLC-A	122.58	147.3	1,596	203,487	食品	
KINGSPAN GROUP PLC	117.68	134.52	716	91,287	建設関連製品	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	173.97	208.7	874	111,387	容器・包装	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	822.56	—	—	—	銀行	
AIB GROUP PLC	413.52	—	—	—	銀行	
小計	株数・金 銘柄 額 <比率>	2,332.67	1,348.33	8,085	1,030,453	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AIRBUS SE	451.22	531.76	4,903	624,884	航空宇宙・防衛	
KONINKLIJKE DSM NV	137.16	152.1	2,210	281,740	化学	
ING GROEP NV-CVA	3,045.08	3,448.92	2,879	366,963	銀行	
RANDSTAD NV	90.74	126.01	681	86,845	専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	890.26	992.8	2,334	297,454	食品・生活必需品小売り	
HEINEKEN NV	195.82	226.83	1,951	248,717	飲料	
AKZO NOBEL	174.91	179.59	1,530	195,042	化学	
ASML HOLDING NV	330.53	380.98	18,848	2,402,114	半導体・半導体製造装置	
AEGON NV	1,503.49	1,503.49	561	71,602	保険	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	719.25	829.19	3,976	506,802	ヘルスケア機器・用品	
WOLTERS KLUWER-CVA	206.87	257.15	1,811	230,905	専門サービス	
STMICROELECTRONICS NV	556.11	541.76	1,912	243,717	半導体・半導体製造装置	
QIAGEN N.V.	179.74	207.63	936	119,309	ライフサイエンス・ツール/サービス	
VOPAK (KON.)	53.64	53.64	234	29,879	石油・ガス・消耗燃料	
KONINKLIJKE KPN NV	2,910.29	3,478.24	1,018	129,788	各種電気通信サービス	
HEINEKEN HOLDING NV-A	97.91	100.04	743	94,789	飲料	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	397.52	553.04	540	68,928	飲料	
FERRARI NV	89.34	115.42	1,947	248,216	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV	779.51	893.78	1,083	138,050	機械	
PROSUS NV	368.71	442.19	4,656	593,393	インターネット販売・通信販売	
JDE PEET'S BV	—	73.08	235	30,044	食品	
NN GROUP NV	217.2	252.74	900	114,793	保険	
ARGENX SE	—	38.79	1,201	153,146	バイオテクノロジー	
STELLANTIS NV	790.84	1,769.58	2,347	299,168	自動車	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	90	108.36	982	125,223	インターネット販売・通信販売	
ABN AMRO BANK NV	342.51	342.51	300	38,280	銀行	
EXOR NV	79.71	99.66	672	85,729	各種金融サービス	
ALTICE EUROPE NV	567.63	—	—	—	各種電気通信サービス	
ADYEN NV	8.18	15.89	3,479	443,479	情報技術サービス	
小計	株数・金 銘柄 額 <比率>	15,274.17	17,715.17	64,885	8,269,017	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UMICORE	141.15	176.54	839	107,046	化学	
KBC GROUPE	185.77	210.38	1,245	158,773	銀行	
SOFINA	—	13.82	406	51,867	各種金融サービス	
SOLVAY SA	55.63	71.83	687	87,622	化学	
AGEAS	143.65	143.65	652	83,167	保険	
UCB SA	90.95	105.71	927	118,173	医薬品	

銘柄	期首(前期末)		当期		業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
COLRUYT NV	46.73	46.73	236	30,169	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	66.89	99.04	841	107,208	各種金融サービス
PROXIMUS	142.83	137.39	233	29,730	各種電気通信サービス
GALAPAGOS NV	34.26	34.26	242	30,859	バイオテクノロジー
ELIA GROUP	-	28.62	281	35,816	電力
TELENET GROUP HOLDING NV	36.34	-	-	-	メディア
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	587.31	663.27	3,488	444,612	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,531.51 11銘柄	1,731.24 12銘柄	10,083 -	1,285,048 <0.3%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ARCELOR MITTAL (NL)	467.14	615.94	1,150	146,676	金属・鉱業
EUROFINS SCIENTIFIC	8.99	113.3	922	117,605	ライフサイエンス・ツール/サービス
TENARIS SA	369.59	369.59	262	33,488	エネルギー設備・サービス
SES FDR	288.47	288.47	199	25,476	メディア
AROUNDTOWN SA	717.83	830.54	483	61,558	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,852.02 5銘柄	2,217.84 5銘柄	3,019 -	384,805 <0.1%>
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIR LIQUIDE	363.17	412	5,557	708,296	化学
AXA SA	1,481.6	1,694.93	3,240	412,909	保険
VEOLIA ENVIRONNEMENT	444.49	507.07	1,140	145,332	総合公益事業
DASSAULT AVIATION SA	1.63	2.95	270	34,512	航空宇宙・防衛
DANONE	488.33	543.15	2,928	373,229	食品
SAFRAN SA	258.98	280.36	3,053	389,089	航空宇宙・防衛
ACCOR SA	122.77	173.8	519	66,247	ホテル・レストラン・レジャー
BOUYGUES	175.72	214.17	718	91,570	建設・土木
BNP PARIBAS	864.34	1,019.91	4,731	602,949	銀行
THALES SA	85.49	105.13	818	104,368	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	125.15	149.12	2,017	257,122	情報技術サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	42.64	-	-	-	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	43.34	-	-	-	電子装置・機器・部品
NATIXIS	701.66	701.66	280	35,767	資本市場
EIFFAGE	64.61	84.65	690	87,942	建設・土木
PUBLICIS GROUPE	151.98	185.95	873	111,378	メディア
FAURECIA	61.17	61.17	268	34,269	自動車部品
L'OREAL	195.54	224.47	7,144	910,543	パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	214.86	248.73	13,165	1,677,783	繊維・アパレル・贅沢品
BOLLORE	713.47	713.47	258	32,951	娯楽
MICHELIN(CGDE)-B	124.22	148.02	1,727	220,139	自動車部品
PERNOD-RICARD	167.19	190.38	3,032	386,494	飲料
PEUGEOT SA	439.05	-	-	-	自動車
RENAULT SA	149.17	190.19	748	95,351	自動車
REMY COINTREAU	18.6	18.6	296	37,760	飲料
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	394.36	445.6	1,879	239,585	建設関連製品
SEB SA	15.51	22.18	371	47,374	家庭用耐久財
SOCIETE GENERALE-A	611.81	695.95	1,236	157,623	銀行
VINCI S.A.	392.37	472.57	4,048	515,881	建設・土木
SODEXO	70.75	91.78	684	87,208	ホテル・レストラン・レジャー
SCHNEIDER ELECTRIC SE	436.56	483.76	6,240	795,289	電気設備
VIVENDI SA	679.89	709.95	1,852	236,142	娯楽
TOTAL SE	1,860.2	2,258.11	7,897	1,006,487	石油・ガス・消耗燃料
VALEO	196.53	196.53	635	81,048	自動車部品
ORANGE	1,512.46	1,840.93	1,794	228,649	各種電気通信サービス
HERMES INTL	24.83	28.8	2,662	339,279	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	99.53	121.83	2,317	295,382	ソフトウェア
KERING	58.3	68.27	3,740	476,691	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	139.87	139.87	187	23,921	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)	百株	百株	千ユーロ	千円		
CARREFOUR SA	510.94	499.26	721	91,907	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	73.04	89.72	592	75,463	情報技術サービス	
SANOFI	871.69	1,014.54	7,929	1,010,553	医薬品	
UBISOFT ENTERTAINMENT	59.35	76.86	580	73,932	娯楽	
TELEPERFORMANCE	43.83	53.12	1,567	199,703	専門サービス	
EURAZEO	27.48	52.29	324	41,315	各種金融サービス	
JC DECAUX SA	60.58	—	—	—	メディア	
ESSILORLUXOTTICA	217.61	249.84	3,420	435,884	繊維・アパレル・贅沢品	
CREDIT AGRICOLE SA	862.05	986.85	1,073	136,768	銀行	
ORPEA	—	49.32	574	73,192	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WENDEL	22.2	22.2	216	27,570	各種金融サービス	
ILIAD SA	21.02	10.46	160	20,401	各種電気通信サービス	
BIOMERIEUX	32.48	32.48	407	51,988	ヘルスケア機器・用品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	18.84	23.87	969	123,504	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ENGIE	1,392.72	1,660.61	2,167	276,280	総合公益事業	
ALSTOM	157.12	217.79	915	116,682	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	125.42	—	—	—	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	538	547.78	581	74,102	電力	
IPSEN SA	36.46	36.46	271	34,569	医薬品	
ARKEMA SA	50.33	63.93	571	72,820	化学	
LEGRAND SA	206.73	238.06	1,798	229,176	電気設備	
ADP	23.13	23.13	231	29,462	運送インフラ	
SCOR SE	101.16	156.67	436	55,625	保険	
BUREAU VERITAS SA	231.79	298.1	668	85,135	専門サービス	
GETLINK	376.46	376.46	499	63,616	運送インフラ	
SUEZ SA	266.2	266.2	454	57,875	総合公益事業	
EDENRED	191.88	214.88	1,023	130,376	情報技術サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	80.92	312	39,764	ホテル・レストラン・レジャー	
WORLDLINE SA	77.58	223.86	1,762	224,578	情報技術サービス	
AMUNDI SA	41.19	59.24	392	50,015	資本市場	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	20,629.42	23,068.91	119,655	15,248,842	<3.2%>
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADIDAS AG	139	172.02	5,021	639,909	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	252.51	312.17	2,192	279,475	自動車	
COMMERZBANK AG	831.18	831.18	425	54,233	銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	314.63	390.3	1,410	179,809	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
UNITED INTERNET	98.82	98.82	374	47,717	各種電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE PREF	55.46	55.46	267	34,137	化学	
HANNOVER RUECK SE	48.68	48.68	691	88,093	保険	
GEA GROUP AG	118.38	118.38	362	46,239	機械	
CONTINENTAL AG	83.12	103.36	1,267	161,557	自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	760.32	869.75	3,742	476,948	航空貨物・物流サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	126.49	126.49	762	97,170	自動車	
MERCK KGAA	98.5	118.74	1,697	216,390	医薬品	
RWE AG	464.89	592.73	2,013	256,600	総合公益事業	
SAP SE	760.71	934.54	10,145	1,292,925	ソフトウェア	
E.ON SE	1,813.17	2,098.42	1,835	233,941	総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	75.85	86.02	665	84,848	家庭用品	
SIEMENS AG-REG	591.13	686.52	9,200	1,172,542	コングロメリット	
PUMA AG	73.51	92.39	789	100,622	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYER AG	720.11	887.08	4,785	609,901	医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	137.59	162.41	1,419	180,896	家庭用品	
DAIMLER AG	694.81	780.56	5,047	643,202	自動車	
BASF SE	705.54	832.15	5,560	708,620	化学	
BEIERSDORF AG	83.71	83.71	770	98,209	パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	17.07	17.07	130	16,587	建設・土木	



銘柄	期首(前期末)		当期		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)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEIDELBERGCEMENT AG	120.31	145.71	932	118,880	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	162.14	201.91	1,239	157,939	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	329.44	375.04	7,333	934,585	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	160.96	279.9	298	38,042	旅客航空輸送業	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	110.91	123.01	2,873	366,200	保険	
VOLKSWAGEN AG	26.45	27.58	499	63,617	自動車	
VOLKSWAGEN AG PFD	144.01	163.61	2,637	336,109	自動車	
NEMETSCHKE SE	-	50.95	295	37,659	ソフトウェア	
THYSSENKRUPP AG	271.1	-	-	-	金属・鉱業	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,493.84	1,659.49	1,490	189,913	資本市場	
BMW VORZUG	41.16	41.16	225	28,771	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	2,635.92	2,993.58	4,443	566,339	各種電気通信サービス	
SARTORIUS AG	27.12	30.44	1,464	186,593	ヘルスケア機器・用品	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	990.68	1,188.79	4,227	538,731	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	-	4.79	397	50,696	機械	
CARL ZEISS MEDITEC AG	37.71	37.71	504	64,301	ヘルスケア機器・用品	
BECHTLE AG	-	25.11	425	54,272	情報技術サービス	
DEUTSCHE BOERSE AG	145.25	167.52	2,288	291,623	資本市場	
FRAPORT AG	31.49	-	-	-	運送インフラ	
WIRECARD AG	89.63	-	-	-	情報技術サービス	
LANXESS AG	68.56	68.56	416	53,105	化学	
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	41.68	48.73	947	120,756	航空宇宙・防衛	
DEUTSCHE WOHNEN	269.47	290.97	1,200	153,034	不動産管理・開発	
SYMRISE AG	99.88	113.08	1,179	150,377	化学	
BRENNTAG SE	123.53	140.44	921	117,408	商社・流通業	
EVONIK INDUSTRIES AG	171.16	171.16	474	60,464	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	615.41	983.85	225	28,712	各種電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN AG	-	59.34	700	89,265	不動産管理・開発	
KION GROUP AG	45.67	59.03	438	55,879	機械	
VONOVIA SE	386.17	454.51	2,508	319,733	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	44.92	68.6	736	93,875	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	114.68	238.05	1,162	148,136	ヘルスケア機器・用品	
METRO AG	107.74	-	-	-	食品・生活必需品小売り	
TEAMVIEWER AG	-	136.68	624	79,567	ソフトウェア	
SIEMENS ENERGY AG	-	358.31	1,121	142,970	電気設備	
ZALANDO SE	99.64	147.56	1,473	187,787	インターネット販売・通信販売	
SCOUT24 AG	-	96.7	645	82,320	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	127.08	163.37	957	121,962	化学	
HELLOFRESH SE	-	128.38	984	125,486	インターネット販売・通信販売	
UNIPER SE	142.52	182.03	550	70,150	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
DELIVERY HERO SE	80.81	109.74	1,445	184,185	インターネット販売・通信販売	
小計	株数 銘柄数	金額 比率	18,422.22 57銘柄	22,034.34 61銘柄	110,876 -	14,130,044 <3.0%>
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円		
JERONIMO MARTINS	195.17	195.17	246	31,463	食品・生活必需品小売り	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,016.06	2,386.62	1,179	150,280	電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	400.88	400.88	361	46,050	石油・ガス・消耗燃料	
小計	株数 銘柄数	金額 比率	2,612.11 3銘柄	2,982.67 3銘柄	1,787 -	227,795 <0.0%>
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
IBERDROLA SA	4,772.67	5,508.72	5,952	758,544	電力	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	158.85	212.06	714	91,046	電気設備	
REPSOL SA	1,149.98	1,359.9	1,206	153,791	石油・ガス・消耗燃料	
TELEFONICA S.A	3,677.55	4,558.87	1,715	218,623	各種電気通信サービス	
ENDESA S.A.	234.17	277.36	608	77,515	電力	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	201.37	213.95	547	69,800	建設・土木	
BANKINTER S.A.	579.6	-	-	-	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)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	5,235.94	5,782.51	2,544	324,246	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	236.12	236.12	495	63,161	ガス	
BANCO SANTANDER SA	12,640.63	15,869.57	4,435	565,265	銀行	
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	345.96	345.96	517	65,979	電力	
BANCO SABADELL	4,136.31	—	—	—	銀行	
INDITEX	838.83	1,004.23	2,581	329,034	専門小売り	
MAPFRE SA	844.74	—	—	—	保険	
ENAGAS	180.95	234.77	416	53,136	ガス	
GRIFOLS SA	235.18	235.18	534	68,154	バイオテクノロジー	
FERROVIAL SA	386.66	405.93	834	106,308	建設・土木	
CAIXABANK	2,972.24	3,073.31	692	88,241	銀行	
AMADEUS IT GROUP SA	338.91	411.18	2,226	283,802	情報技術サービス	
BANKIA SA	1,006.75	—	—	—	銀行	
ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA-RTS	—	213.57	8	1,129	建設・土木	
AENA SME SA	53.38	62.56	822	104,840	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SAU	197.8	272.34	1,248	159,062	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,424.59 22銘柄	40,278.09 19銘柄	28,104 <0.7%>	3,581,685	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ASSICURAZIONI GENERALI	870.3	975.69	1,528	194,781	保険	
INTESA SANPAOLO	11,576.31	15,123.69	3,169	403,975	銀行	
UNICREDIT SPA	1,557.18	1,939.1	1,628	207,481	銀行	
ENI SPA	1,978.38	2,193.31	1,947	248,181	石油・ガス・消耗燃料	
MEDIOBANCA SPA	416.39	574.42	510	65,049	銀行	
ENEL SPA	6,323.33	7,299.44	6,181	787,727	電力	
LEONARDO SPA	283.16	—	—	—	航空宇宙・防衛	
SNAM SPA	1,691.63	1,712.94	766	97,622	ガス	
TELECOM ITALIA SPA	7,626.75	7,626.75	289	36,934	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	4,975.96	4,975.96	213	27,204	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	373.65	452.99	713	90,923	運送インフラ	
TERNA SPA	1,136.54	1,136.54	701	89,366	電力	
RECORDATI SPA	68.59	103.03	459	58,599	医薬品	
AMPLIFON SPA	—	113.72	426	54,332	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PRYSMIAN SPA	214.52	223.28	634	80,811	電気設備	
DIASORIN SPA	—	22.23	412	52,580	ヘルスケア機器・用品	
MONCLER SPA	143.53	175.67	900	114,712	繊維・アパレル・贅沢品	
NEXI SPA	—	430.97	698	89,029	情報技術サービス	
FINECOBANK SPA	450.48	538.18	810	103,324	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	400.15	400.15	387	49,353	保険	
INFRASTRUCTURE WIRELESS ITALIANE SPA	—	233.44	216	27,607	各種電気通信サービス	
PIRELLI & C SPA	340.86	—	—	—	自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	40,427.71 18銘柄	46,251.5 20銘柄	22,595 <0.6%>	2,879,599	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KESKO OYJ-B	—	240.85	518	66,053	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ	349.35	349.35	298	38,021	機械	
NOKIAN RENKAAT OYJ	93.99	—	—	—	自動車部品	
UPM-KYMMENE OYJ	399.09	448.29	1,441	183,673	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R SHS	419.15	532.5	878	111,904	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A SHS	361.41	448.22	1,653	210,777	保険	
FORTUM OYJ	374.52	394.09	857	109,284	電力	
NOKIA OYJ	4,308	5,185.32	1,802	229,700	通信機器	
ELISA OYJ	107.87	136.42	676	86,214	各種電気通信サービス	
NELES OYJ	85.85	—	—	—	機械	
NESTE OYJ	329.31	367.96	2,105	268,320	石油・ガス・消耗燃料	
KONE OYJ	265.02	298.9	2,070	263,900	機械	

銘	柄	期首(前期末)		当		期		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)		百株	百株			千ユーロ	千円			
ORION OYJ		80.51	80.51			288	36,741			医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >	7,174.07	8,482.41			12,590	1,604,590			
(ユーロ…オーストリア)		百株	百株			千ユーロ	千円			
OMV AG		128.17	128.17			451	57,528			石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		49.08	69.24			482	61,458			電力
VOEST-ALPINE AG		98.75	98.75			306	39,113			金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		209.43	242.04			642	81,864			銀行
ANDRITZ AG		62.65	—			—	—			機械
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		96.41	179.11			299	38,119			銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >	644.49	717.31			2,182	278,083			
合 計	株 数 ・ 金 額 柄 数 < 比 率 >	858,545.81	974,571.62			—	455,954,801			
		1,254銘柄	1,224銘柄			—	<0.3%>			

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各通貨別（ユーロは国別）株式評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (2) 外国新株予約権証券

銘	柄	期首(前期末)		当		期		業	種	等
		証	券 数	証	券 数	評 価 額				
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			
(スイス)			証 券		証 券	千スイス・フラン	千円			
CIE FINANCIERE RICHEMO 11/22/23			—		87,844	28	3,416			
合 計	証 券 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		—		87,844	—	3,416			
			—銘柄		1銘柄	—	<0.0%>			

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

(注2) < >内は、期末の純資産総額に対する各国別評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (3) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘 柄	期 首(前期末)		当 期 末			
	□ 数	□ 数	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	比 率	
<b>不動産ファンド (アメリカ)</b>	千□	千□	千アメリカ・ドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	8.646	12.006	2,077	218,413		0.0
BOSTON PROPERTIES INC	12.027	12.947	1,218	128,069		0.0
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	17.771	22.693	849	89,336		0.0
SL GREEN	7.097	—	—	—		—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	108.247	127.559	1,081	113,708		0.0
PROLOGIS INC	56.079	66.35	7,143	750,967		0.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	10.491	12.329	2,213	232,649		0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8.062	9.643	1,027	107,996		0.0
EQUINIX INC	6.522	7.992	5,672	596,324		0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	13.649	—	—	—		—
DUKE REALTY TRUST	27.278	31.929	1,327	139,558		0.0
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	31.583	38.831	6,386	671,311		0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5.075	5.504	1,482	155,840		0.0
EQUITY RESIDENTIAL	27.869	35.108	2,369	249,038		0.1
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6	—	—	—		—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	40.162	45.543	1,409	148,124		0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	8.778	9.838	2,596	272,958		0.1
WELLTOWER INC	32.099	38.411	2,593	272,589		0.1
KIMCO REALTY	32.98	—	—	—		—
IRON MOUNTAIN INC	23.977	24.591	815	85,744		0.0
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13.626	16.087	1,009	106,165		0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	55.116	63.952	952	100,167		0.0
MID AMERICA	8.834	10.854	1,499	157,613		0.0
REALTY INCOME CORP	23.491	29.466	1,840	193,467		0.0
REGENCY CENTERS CORP	11.403	14.499	762	80,199		0.0
UDR INC	22.345	27.057	1,155	121,477		0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	23.306	28.083	3,068	322,544		0.1
PUBLIC STORAGE	12.188	13.834	3,207	337,177		0.1
SUN COMMUNITIES INC	7.418	9.67	1,438	151,246		0.0
VENTAS INC	29.505	35.021	1,776	186,720		0.0
VORNADO REALTY TRUST	12.472	12.714	488	51,308		0.0
WEYERHAEUSER CO	57.621	64.096	2,245	236,091		0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	9.261	12.385	1,447	152,167		0.0
DIGITAL REALTY TRUST INC	15.605	23.492	3,290	345,875		0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST	39.953	53.911	1,212	127,510		0.0
AGNC INVESTMENT CORP	44.741	46.028	752	79,108		0.0
VEREIT INC	82.604	20.534	776	81,592		0.0
AMERICAN TOWER CORP	34.213	39.736	9,027	948,983		0.2
WP CAREY INC	13.039	15.529	1,093	114,905		0.0
INVITATION HOMES INC	42.384	50.475	1,564	164,483		0.0
VICI PROPERTIES INC	34.2	47.083	1,283	134,919		0.0
小 計	□ 数 銘 柄	□ 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	1,077.717	1,135.78	80,159	8,426,360	—	—
	41銘柄<2.2%>	37銘柄<1.8%>	—	—	—	1.8
<b>(カナダ)</b>	千□	千□	千カナダ・ドル	千円		%
SMARTCENTRES REIT	3.067	—	—	—		—
CANADIAN APT PPTYS REIT	7.819	7.954	409	33,900		0.0
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	10.748	—	—	—		—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	17.676	—	—	—		—
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	13.467	13.467	242	20,069		0.0
小 計	□ 数 銘 柄	□ 数 銘 柄	金 額 数<比 率>	金 額 数<比 率>		
	52.777	21.421	651	53,970	—	—
	5銘柄<0.0%>	2銘柄<0.0%>	—	—	—	0.0

銘柄	期首(前期末)		当期			期末	
	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額	比率	比率	
<b>(オーストラリア)</b>	千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円		%	
MIRVAC GROUP	329.418	329.418	764	62,362		0.0	
GPT GROUP	158.232	158.232	653	53,325		0.0	
STOCKLAND	194.018	194.018	909	74,251		0.0	
DEXUS	84.575	108.972	950	77,539		0.0	
GOODMAN GROUP	132.051	148.357	2,664	217,422		0.0	
VICINITY CENTRES	270.443	371.711	570	46,559		0.0	
SCENTRE GROUP	420.268	420.268	1,130	92,250		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	7,643 7銘柄<0.2%>	623,711 -	-	0.1	
<b>(香港)</b>	千□	千□	千香港・ドル	千円		%	
LINK REIT	157.9	200.2	13,473	182,700		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	13,473 1銘柄<0.0%>	182,700 -	-	0.0	
<b>(シンガポール)</b>	千□	千□	千シンガポール・ドル	千円		%	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL	199	483.636	1,034	82,136		0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INVNT	200.806	292.606	898	71,289		0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	206.3	-	-	-		-	
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	192.1	192.1	286	22,715		0.0	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	-	270.1	521	41,369		0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	192.3	192.3	399	31,742		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	3,140 5銘柄<0.1%>	249,252 -	-	0.1	
<b>(イギリス)</b>	千□	千□	千イギリス・ポンド	千円		%	
BRITISH LAND CO PLC	69.819	69.819	321	46,842		0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	55.843	55.843	338	49,438		0.0	
SEGRO PLC	87.247	100.956	977	142,532		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	1,637 3銘柄<0.1%>	238,813 -	-	0.1	
<b>(フランス)</b>	千□	千□	千ユーロ	千円		%	
GECINA SA	3.67	3.67	433	55,189		0.0	
ICADE	2.234	-	-	-		-	
KLEPIERRE	17.042	17.099	323	41,272		0.0	
COVIVIO	4.265	4.663	305	38,982		0.0	
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	10.898	12.92	752	95,926		0.0	
小計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	1,815 5銘柄<0.1%>	231,370 -	-	0.0	
合計	□数 銘柄数<比率>	□数 銘柄数<比率>	4,118.923 67銘柄<2.7%>	4,784.089 -	10,006,178	2.1	

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

(注2) 比率は、期末の純資産総額に対する投資信託受益証券、投資証券評価額の比率です。

(注3) 金額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。なお、合計は、四捨五入の関係で合わない場合があります。

## (4) 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	S & P 5 0 0	E M I N I		百万円 8,863		百万円 -
	S & P / T S E	6 0		416		-
	S P I	2 0 0	F U T U R E S	275		-
国	FTSE	1 0 0		562		-
	D J	E U R O	S T O X X	1,936		-

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を期末の仲値により、邦貨換算したものです。

## ■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項	目	当 期		末	
		評 価	額	比	率
株	式		千円 455,954,801		% 95.5
新 株	予 約 権 証 券		3,416		0.0
投 資 信 託	受 益 証 券、投 資 証 券		10,006,178		2.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、その他			11,688,217		2.4
投 資 信 託 財 産 総 額			477,652,614		100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、477,230,001千円、99.9%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月15日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.12円、1カナダ・ドル=82.84円、1オーストラリア・ドル=81.60円、1香港・ドル=13.56円、1シンガポール・ドル=79.36円、1ニュージーランド・ドル=75.90円、1イギリス・ポンド=145.85円、1イスラエル・シケル=32.31円、1スイス・フラン=117.85円、1デンマーク・クローネ=17.13円、1ノルウェー・クローネ=12.44円、1スウェーデン・クローナ=12.66円、1ユーロ=127.44円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月15日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	478,371,556,028円		
一 般 株 券 (評 価 額)	7,543,114,076		
株 券 (評 価 額)	455,954,801,985		
株 券 (評 価 額)	3,416,297		
株 券 (評 価 額)	872,963,897		
株 券 (評 価 額)	9,133,215,008		
株 券 (評 価 額)	997,758,204		
株 券 (評 価 額)	327,168,116		
株 券 (評 価 額)	3,539,118,445		
(B) 負 債	805,612,996		
未 払 金	725,661,696		
未 払 金	79,951,300		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	477,565,943,032		
元 本	101,430,005,374		
次 期 繰 越 損 益	376,135,937,658		
(D) 受 取 金 数	101,430,005,374円		
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	47,083円		
(注1) 期首元本額	88,590,932,378円	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	109,409,614円
追加設定元本額	45,119,031,395円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	1,213,146,637円
一部解約元本額	32,279,958,399円	ワールドアセットバランス (基本コース)	336,245,295円
(注2) 期末における元本の内訳		ワールドアセットバランス (リスク抑制コース)	982,171,507円
D I A M 外国株式パッシブ・ファンド	3,590,651,003円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	12,186,690円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	2,310,337円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	5,775,603円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	6,547,566円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	1,075,918円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	6,756,671円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	20,712,777円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	21,177,539円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	33,065,020円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	17,784,106円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	740,973,150円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	10,755,334円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	175,140,431円
たわらノーロード 先進国株式	19,446,068,276円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	6,120,622円
たわらノーロード 先進国株式<ラップ向け>	221,026,311円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	3,347,358円
たわらノーロード 先進国株式<為替ヘッジあり>	2,352,778,639円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	3,322,497円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	410,571,761円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,214,984円
たわらノーロード バランス (堅実型)	46,019,112円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	117,075,833円
たわらノーロード バランス (標準型)	354,659,393円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	142,051,776円
たわらノーロード バランス (積極型)	417,152,173円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	6,645,402円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	1,077,196円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	72,091,910円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	132,195,005円	M S C I コアサイ・インデックスファンド<為替ヘッジあり> (適格機関投資家限定)	257,923,303円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	345,649,707円	D I A M 外国株式インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	63,007,304円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	228,974,611円	D I A M 外国株式パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	1,445,094,587円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	343,116,453円	D I A M 先進国株式パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,156,121,882円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	1,447円	外国株式パッシブ・ファンド2 (適格機関投資家限定)	862,725,175円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	628,040円	D I A M ワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	11,658,494円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	2,639,134円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	190,209,441円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,984,548円	D I A M グローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	47,142,712円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	4,398,037円	D I A M グローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	83,869,902円
たわらノーロード 全世界株式	85,362,898円	D I A M 国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	5,197,402円
D I A M 外国株式インデックスファンド<DC年金>	46,681,552,310円	D I A M 国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	34,446,092円
One D C 先進国株式インデックスファンド	578,488,633円	D I A M 国内重複バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,743,840円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>1安定型	183,355,556円	D I A M 国内重複バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,557,070円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	935,988,345円	D I A M 世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	12,351,541円
D I A M バランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,108,633,939円	D I A M 世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	42,816,355円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	112,383,572円	D I A M バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	298,196,031円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	336,515,401円	D I A M バランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	415,545,865円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	294,455,629円	D I A M バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,340,967,617円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	26,718,430円	D I A M グローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	497,122,927円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	815,556,610円	D I A M グローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	73,316,094円
マネックス資産設計ファンド エポリユーション	168,120,959円	D I A M アップ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	487,021,391円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	207,380,963円	D I A M 世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	21,947,333円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	175,357,524円	D I A M 世界アセットバランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	4,736,583円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	291,398,144円	D I A M 世界アセットバランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	203,141,179円
投資のソムリエ	4,677,116,550円	D I A M 世界アセットバランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	15,672,025円
グルーズコントロール	247,166,541円	D I A M 世界アセットバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	65,152,864円
投資のソムリエ<DC年金>	287,425,394円	D I A M 世界アセットバランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	103,614,222円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	195,280,389円	D I A M 世界アセットバランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	210,904,861円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	114,819,293円	期末元本合計	101,430,005,374円
D I A M コア資産設計ファンド (堅実型)	1,868,239円		
D I A M コア資産設計ファンド (積極型)	4,162,455円		

## ■損益の状況

当期 自2020年2月18日 至2021年2月15日

項	目	当	期
(A)	配当 受取 受取 支の 支の 払他 取	等配 利 益 利 益	収当 当 息 金 息 △
(B)	有価 売 売	証券 買 買	損益 益 損
(C)	先物 取 取	取引 等 引	損益 益 損
(D)	そ の	他 費	用 △
(E)	当期 損	益	金(A+B+C+D)
(F)	前期 繰	越	損益
(G)	解約 約	差	損益
(H)	追加 信託	差	損益
(I)	合 次	計(E+F+G+H)	損益
			金(I)
			6,240,305,046円
			6,234,830,400
			332,462
			5,507,444
			△365,260
			50,582,940,100
			87,299,316,083
			△36,716,375,983
			1,388,470,803
			4,988,951,090
			△3,600,480,287
			△87,341,531
			58,124,374,418
			281,829,514,820
			△91,806,425,185
			127,988,473,605
			376,135,937,658
			376,135,937,658

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

(注2) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (H)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。



# 外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンド 運用報告書

第18期（決算日 2021年2月22日）

（計算期間 2020年2月22日～2021年2月22日）

外国債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月10日から無期限です。
運用方針	主に日本を除く世界主要国の公社債に投資し、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）」に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要投資対象	海外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資には、制限を設けません。

## ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		FTSE世界国債インデックス		債券組入率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率	（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし） （ベンチマーク）	騰落率			
14期（2017年2月21日）	17,364	△2.9	ポイント 108,792.68	% △2.7	% 97.9	% -	百万円 248,485
15期（2018年2月21日）	17,876	2.9	111,885.82	2.8	97.7	-	217,863
16期（2019年2月21日）	18,170	1.6	113,733.36	1.7	98.1	-	197,670
17期（2020年2月21日）	19,586	7.8	122,662.63	7.9	97.8	-	130,803
18期（2021年2月22日）	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-	137,037

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）ベンチマークはFTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）であり、算出にあたっては米ドルベース指数をもとに委託会社が独自に円換算しています（以下同じ）。

（注3）FTSE世界国債インデックスは、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（以下同じ）。

（注4）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

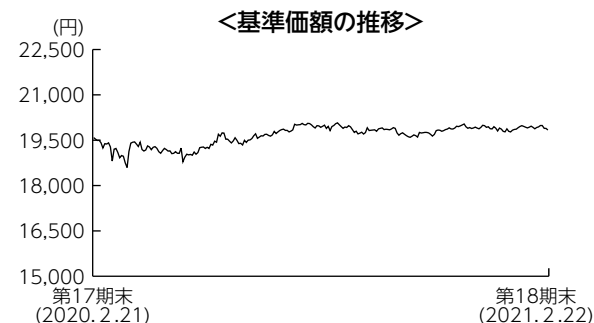
## ■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		F T S E世界国債インデックス ( 除く日本、 円 ベース、 為替ヘッジなし) (ベンチマーク)		債券組入 比	債券先物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 21 日	円 19,586	% -	ポイント 122,662.63	% -	% 97.8	% -
2 月 末	19,413	△0.9	121,401.29	△1.0	97.3	-
3 月 末	19,435	△0.8	121,796.59	△0.7	97.4	-
4 月 末	19,066	△2.7	119,329.72	△2.7	96.1	-
5 月 末	19,338	△1.3	120,973.12	△1.4	97.3	-
6 月 末	19,646	0.3	123,063.01	0.3	98.4	-
7 月 末	19,841	1.3	123,870.50	1.0	99.0	-
8 月 末	19,819	1.2	124,064.52	1.1	99.4	-
9 月 末	19,912	1.7	124,690.18	1.7	97.8	-
10 月 末	19,615	0.1	122,727.67	0.1	98.2	-
11 月 末	19,817	1.2	124,001.42	1.1	99.1	-
12 月 末	19,982	2.0	125,045.38	1.9	98.6	-
2021 年 1 月 末	19,954	1.9	125,100.34	2.0	98.6	-
(期 末) 2021 年 2 月 22 日	19,836	1.3	124,229.95	1.3	98.4	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ■当期の運用経過（2020年2月22日から2021年2月22日まで）

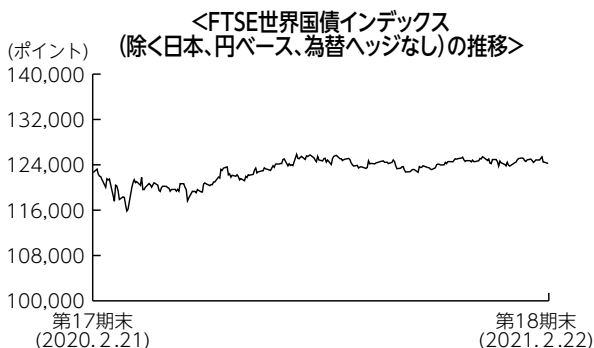


### 基準価額の推移

当期末の基準価額は19,836円となり、前期末比で1.3%上昇しました。

### 基準価額の主な変動要因

米国債の利回りは低下（価格は上昇）しました。新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R B（米連邦準備理事会）が緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。これらを主因に基準価額は上昇しました。



### 投資環境

外国債券市場では、米国債の利回りは低下しました。一方、ドイツ債の利回りは上昇（価格は低下）しました。米国債利回りは新型コロナウイルスに伴う景気減速対策としてF R Bが緊急利下げを行ったことや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続を示唆したことにより利回りが大幅に低下しました。期末には新型コロナウイルスのワクチン期待を受けて利回りが上昇し始め、ドイツ債についても期待を受けて利回りは上昇しました。

為替市場ではドル／円は円高ドル安に、ユーロ／円は円安ユーロ高となりました。ドル／円は、F R Bによる緊急利下げや2023年末までのゼロ金利と量的緩和の継続示唆、追加緩和期待から円高ドル安が進みました。ユーロ／円は、E C B（欧州中央銀行）の追加金融緩和策が域内景気を下支えるとの見方やユーロ圏経済指標の改善などから円安ユーロ高となりました。

## ポートフォリオについて

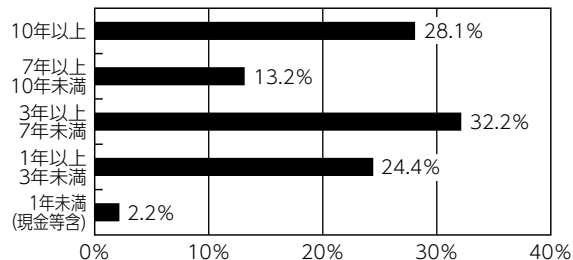
ベンチマークであるF T S E世界国債インデックス（除く日本、円ベース、為替ヘッジなし）とリスク特性を極力一致させたポートフォリオを構築しました。

### 【運用状況】

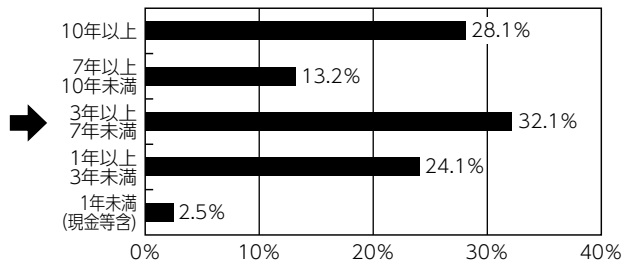
※組入比率は純資産総額に対する割合です。

### ○残存別構成比

#### 期首（前期末）



#### 期末



### ○国別構成比

#### 期首（前期末）

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	48.3%	48.8%	△0.5%
カナダ	1.8%	1.9%	△0.1%
計	50.1%	50.7%	△0.6%
中南米			
メキシコ	0.7%	0.9%	△0.1%
計	0.7%	0.9%	△0.1%
欧州			
オーストリア	1.4%	1.4%	0.0%
ベルギー	2.3%	2.4%	△0.1%
フィンランド	0.5%	0.6%	△0.1%
フランス	9.5%	9.8%	△0.3%
ドイツ	5.7%	6.2%	△0.5%
アイルランド	0.7%	0.7%	0.0%
イタリア	8.9%	8.8%	0.1%
オランダ	1.8%	1.8%	0.0%
スペイン	5.3%	5.5%	△0.2%
ユーロ計	36.1%	37.2%	△1.1%
デンマーク	0.4%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.2%	0.3%	△0.1%
英国	6.2%	6.4%	△0.1%
ポーランド	0.5%	0.6%	△0.1%
ノルウェー	0.2%	0.2%	△0.1%
計	43.7%	45.4%	△1.8%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	1.8%	1.9%	0.0%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.6%	0.5%	0.1%
計	2.8%	2.8%	0.0%
アフリカ			
南アフリカ	0.5%	0.5%	0.0%
計	0.5%	0.5%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

#### 期末

国	当ファンド	世界国債インデックス	差
北米			
米国	42.4%	43.3%	△0.9%
カナダ	2.0%	2.0%	0.0%
計	44.3%	45.2%	△0.9%
中南米			
メキシコ	0.8%	0.8%	0.0%
計	0.8%	0.8%	0.0%
欧州			
オーストリア	1.5%	1.6%	△0.1%
ベルギー	2.5%	2.6%	△0.1%
フィンランド	0.6%	0.7%	0.0%
フランス	10.6%	10.7%	△0.2%
ドイツ	7.5%	7.7%	△0.2%
アイルランド	0.8%	0.9%	0.0%
イタリア	9.5%	9.8%	△0.3%
オランダ	1.8%	1.9%	△0.1%
スペイン	6.1%	6.1%	0.0%
ユーロ計	40.9%	41.9%	△1.0%
デンマーク	0.5%	0.5%	0.0%
スウェーデン	0.3%	0.3%	0.0%
英国	6.6%	6.6%	0.0%
ポーランド	0.6%	0.7%	0.0%
ノルウェー	0.2%	0.3%	0.0%
計	49.2%	50.3%	△1.1%
アジア・オセアニア			
オーストラリア	2.8%	2.3%	0.5%
シンガポール	0.4%	0.4%	0.0%
マレーシア	0.5%	0.5%	0.0%
計	3.6%	3.2%	0.4%
中近東			
イスラエル	0.4%	0.4%	0.0%
計	0.4%	0.4%	0.0%
現金など	1.6%	-	-
合計	100.0%	100.0%	-

(注) 世界国債インデックスとはF T S E世界国債インデックス（除く日本）です。

## ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で1.3%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークにほぼ連動したパフォーマンスとなりました。なお、若干の乖離の要因としては、ファンドとベンチマークの為替の採用基準が異なることが挙げられます。

## 今後の運用方針

ベンチマークとポートフォリオのリスク特性を極力一致させることで、ベンチマークに連動することをめざしたパッシブ運用を行います。

## ■ 1万口当たりの費用明細

項 目	当 期	
	金 額	比 率
(a) その他費用	2円	0.012%
（保管費用）	(2)	(0.011)
（その他）	(0)	(0.001)
合 計	2	0.012

(注) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額（19,648円）で除して100を乗じたものです。なお、費用項目の概要及び注記については12ページ（1万口当たりの費用明細）をご参照ください。

## ■売買及び取引の状況 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

### 公社債

			買 付 額	売 付 額						
外	ア	メ	リ	カ	国 債 証 券	千アメリカ・ドル 204,013	千アメリカ・ドル 220,431			
	カ	ナ	ダ		国 債 証 券	千カナダ・ドル 12,919	千カナダ・ドル 8,752			
	オ	ス	ト	ラ	リ	ア	国 債 証 券	千オーストラリア・ドル 19,582	千オーストラリア・ドル 4,973	
	シ	ン	ガ	ポ	ー	ル	国 債 証 券	千シンガポール・ドル 1,694	千シンガポール・ドル 844	
	イ	ギ	リ	ス		国 債 証 券	千イギリス・ポンド 22,124	千イギリス・ポンド 14,602		
	イ	ス	ラ	エ	ル	国 債 証 券	千イスラエル・シケル 19,040	千イスラエル・シケル 567		
	デ	ン	マ	ー	ク	国 債 証 券	千デンマーク・クローネ 9,664	千デンマーク・クローネ 5,334		
	ノ	ル	ウ	ェ	ー	国 債 証 券	千ノルウェー・クローネ 6,951	千ノルウェー・クローネ 3,221		
	ス	ウ	ェ	ー	デ	ン	国 債 証 券	千スウェーデン・クローナ 15,553	千スウェーデン・クローナ 3,970	
	メ	キ	シ	コ		国 債 証 券	千メキシコ・ペソ 64,559	千メキシコ・ペソ 27,641		
	マ	レ	ー	シ	ア	国 債 証 券	千マレーシア・リンギット 5,060	千マレーシア・リンギット 10,671		
	南	ア	フ	リ	カ	国 債 証 券	千南アフリカ・ランド -	千南アフリカ・ランド 85,263		
	ポ	ー	ラ	ン	ド	国 債 証 券	千ポーランド・ズロチ 10,959	千ポーランド・ズロチ 5,220		
国	ユ ー ロ 圏	ア	イ	ル	ラ	ン	ド	国 債 証 券	千ユーロ 3,473	千ユーロ 1,628
		オ	ラ	ン	ダ		国 債 証 券	6,076	5,390	
		ベ	ル	ギ	ー		国 債 証 券	8,408	6,178	
		フ	ラ	ン	ス		国 債 証 券	36,111	22,676	
		ド	イ	ツ			国 債 証 券	43,157	22,151	
		ス	ペ	イ	ン		国 債 証 券	22,043	12,904	
		イ	タ	リ	ア		国 債 証 券	32,711	28,279	
		フ	ィ	ン	ラ	ン	ド	国 債 証 券	1,694	439
オ	ー	ス	ト	リ	ア	国 債 証 券	5,421	3,790		

(注) 金額は受渡代金です (経過利子分は含まれておりません)。

## ■利害関係人との取引状況等 (2020年2月22日から2021年2月22日まで)

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

## ■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

外国（外貨建）公社債

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千アメリカ・ドル 519,140	千アメリカ・ドル 550,714	千円 58,100,386	% 42.4	% -	% 18.2	% 17.4	% 6.7
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 29,460	千カナダ・ドル 31,957	千円 2,675,453	2.0	-	0.9	0.7	0.3
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 41,700	千オーストラリア・ドル 45,344	千円 3,772,248	2.8	-	1.9	0.7	0.2
シンガポール	千シンガポール・ドル 6,200	千シンガポール・ドル 6,929	千円 552,643	0.4	-	0.3	0.1	0.0
イギリス	千イギリス・ポンド 49,770	千イギリス・ポンド 61,565	千円 9,110,469	6.6	-	5.0	1.1	0.5
イスラエル	千イスラエル・シケル 15,670	千イスラエル・シケル 17,913	千円 577,359	0.4	-	0.2	0.2	0.0
デンマーク	千デンマーク・クローネ 30,780	千デンマーク・クローネ 38,545	千円 662,988	0.5	-	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェー・クローネ 23,270	千ノルウェー・クローネ 24,312	千円 303,668	0.2	-	0.1	0.1	-
スウェーデン	千スウェーデン・クローナ 30,610	千スウェーデン・クローナ 33,818	千円 431,523	0.3	-	0.1	0.1	0.0
メキシコ	千メキシコ・ペソ 180,572	千メキシコ・ペソ 203,320	千円 1,047,101	0.8	-	0.5	0.3	0.0
マレーシア	千マレーシア・リンギット 21,930	千マレーシア・リンギット 23,693	千円 618,878	0.5	-	0.3	0.1	0.1
ポーランド	千ポーランド・ズロチ 28,350	千ポーランド・ズロチ 30,882	千円 881,086	0.6	-	0.3	0.2	0.2
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	7,940	9,015	1,153,117	0.8	-	0.6	0.2	0.1
オランダ	16,600	19,801	2,532,858	1.8	-	1.2	0.5	0.1
ベルギー	21,530	26,470	3,385,814	2.5	-	1.9	0.4	0.2
フランス	95,020	113,104	14,467,133	10.6	-	7.1	2.7	0.7
ドイツ	68,530	80,607	10,310,448	7.5	-	4.5	2.4	0.6
スペイン	54,310	64,919	8,303,795	6.1	-	4.0	1.4	0.6
イタリア	85,840	102,183	13,070,282	9.5	-	6.1	2.6	0.8
フィンランド	5,900	6,530	835,308	0.6	-	0.4	0.2	0.0
オーストリア	13,180	15,826	2,024,348	1.5	-	1.0	0.4	0.1
合 計	-	-	千円 134,816,915	98.4	-	54.9	32.0	11.4

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

(注2) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(B) 個別銘柄開示  
外国（外貨建）公社債銘柄別

銘柄	当	期				末		
		種	利	額	評		額	
					類			率
金額	外貨建金額	邦貨換算金額	千円	償還年月日				
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	2,180	2,396	252,827	2026/01/31		
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	350	371	39,146	2024/01/31		
US T N/B 1.75 01/31/23	国債証券	1.7500	4,980	5,138	542,095	2023/01/31		
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	3,890	4,151	438,000	2024/01/31		
US T N/B 0.125 01/15/24	国債証券	0.1250	7,000	6,983	736,769	2024/01/15		
US T N/B 1.5 01/31/27	国債証券	1.5000	2,490	2,592	273,551	2027/01/31		
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	3,280	3,407	359,530	2025/01/31		
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	840	1,063	112,235	2026/02/15		
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	680	818	86,326	2042/02/15		
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	1,440	1,731	182,671	2043/02/15		
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	1,970	2,127	224,478	2046/02/15		
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	900	1,135	119,785	2039/02/15		
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	490	646	68,201	2029/02/15		
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	700	970	102,339	2031/02/15		
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	730	1,009	106,521	2036/02/15		
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	1,200	1,775	187,338	2041/02/15		
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	1,630	2,113	222,976	2044/02/15		
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	3,070	3,655	385,650	2049/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	8,470	8,630	910,479	2022/02/15		
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	550	763	80,586	2038/02/15		
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	750	1,086	114,619	2040/02/15		
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	4,180	4,394	463,590	2026/02/15		
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	2,080	2,249	237,286	2045/02/15		
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	1,640	1,942	204,893	2047/02/15		
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	2,540	3,013	317,963	2048/02/15		
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	5,320	5,721	603,661	2024/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	5,300	5,642	595,232	2025/02/15		
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	4,110	4,586	483,909	2029/02/15		
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	4,370	4,900	517,043	2028/02/15		
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	4,370	4,532	478,215	2023/02/15		
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	3,550	3,857	406,915	2027/02/15		
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	1,300	1,374	145,014	2024/02/29		
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	1,000	1,027	108,434	2023/02/28		
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	2,550	2,789	294,267	2026/02/28		
US T N/B 2.75 02/28/25	国債証券	2.7500	1,660	1,816	191,616	2025/02/28		
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	1,680	1,710	180,494	2022/02/28		
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	1,800	1,890	199,484	2023/02/28		
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	3,270	3,176	335,147	2050/02/15		
US T N/B 1.375 02/15/23	国債証券	1.3750	4,000	4,099	432,533	2023/02/15		
US T N/B 1.125 02/28/27	国債証券	1.1250	1,100	1,120	118,248	2027/02/28		
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	3,970	4,059	428,226	2030/02/15		
US T N/B 1.125 02/28/25	国債証券	1.1250	1,000	1,029	108,566	2025/02/28		
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	4,080	4,318	455,627	2024/03/31		
US T N/B 1.75 03/31/22	国債証券	1.7500	6,990	7,118	751,041	2022/03/31		
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	2,000	2,057	217,099	2023/03/31		
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	2,150	2,343	247,221	2025/03/31		
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	3,090	3,342	352,660	2026/03/31		
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	3,020	3,171	334,565	2023/03/31		
US T N/B 0.625 03/31/27	国債証券	0.6250	1,800	1,779	187,711	2027/03/31		



銘柄	柄	当				期		末
		種類	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		
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.375 03/31/22	国債証券	0.3750	1,500	1,504	158,756	2022/03/31		
US T N/B 0.5 03/31/25	国債証券	0.5000	800	802	84,693	2025/03/31		
US T N/B 0.5 03/15/23	国債証券	0.5000	2,000	2,015	212,648	2023/03/15		
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	3,000	3,097	326,786	2023/04/30		
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	1,760	1,917	202,260	2026/04/30		
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	2,490	2,632	277,697	2023/04/30		
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	3,300	3,510	370,317	2024/04/30		
US T N/B 0.125 04/30/22	国債証券	0.1250	1,000	1,000	105,555	2022/04/30		
US T N/B 0.25 04/15/23	国債証券	0.2500	2,000	2,005	211,560	2023/04/15		
US T N/B 0.5 04/30/27	国債証券	0.5000	2,000	1,959	206,730	2027/04/30		
US T N/B 0.375 04/30/25	国債証券	0.3750	2,000	1,995	210,480	2025/04/30		
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	710	1,024	108,108	2030/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	1,200	1,690	178,367	2040/05/15		
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	1,040	1,474	155,562	2041/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/42	国債証券	3.0000	980	1,155	121,870	2042/05/15		
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	810	1,118	117,974	2039/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	2,200	2,544	268,492	2043/05/15		
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	2,030	2,537	267,656	2044/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	1,630	1,921	202,703	2045/05/15		
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	1,290	1,528	161,261	2047/05/15		
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	1,810	1,954	206,164	2046/05/15		
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	2,660	3,227	340,548	2048/05/15		
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	5,400	5,510	581,361	2022/05/15		
US T N/B 1.125 05/15/40	国債証券	1.1250	2,100	1,818	191,900	2040/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	3,090	3,597	379,554	2049/05/15		
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	540	761	80,300	2038/05/15		
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	2,620	2,714	286,343	2023/05/15		
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	4,240	4,548	479,820	2024/05/15		
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	5,150	5,516	582,036	2025/05/15		
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	4,430	5,011	528,743	2028/05/15		
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	2,810	3,081	325,127	2029/05/15		
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	3,100	3,392	357,915	2027/05/15		
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	500	735	77,554	2037/05/15		
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	3,090	3,246	342,523	2026/05/15		
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	2,900	2,997	316,228	2023/05/31		
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	4,770	5,040	531,777	2024/05/31		
US T N/B 1.25 05/15/50	国債証券	1.2500	4,180	3,361	354,635	2050/05/15		
US T N/B 2.125 05/31/26	国債証券	2.1250	2,050	2,206	232,782	2026/05/31		
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,463	365,414	2023/05/31		
US T N/B 2.875 05/31/25	国債証券	2.8750	2,530	2,789	294,315	2025/05/31		
US T N/B 0.5 05/31/27	国債証券	0.5000	1,500	1,467	154,837	2027/05/31		
US T N/B 0.125 05/15/23	国債証券	0.1250	3,000	2,999	316,450	2023/05/15		
US T N/B 0.625 05/15/30	国債証券	0.6250	4,000	3,772	397,998	2030/05/15		
US T N/B 0.25 05/31/25	国債証券	0.2500	4,470	4,431	467,532	2025/05/31		
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	3,460	3,560	375,610	2023/06/30		
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	4,530	4,654	491,057	2022/06/30		
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	790	867	91,568	2025/06/30		
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	4,670	4,965	523,862	2026/06/30		
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	1,820	1,926	203,230	2023/06/30		
US T N/B 1.75 06/30/24	国債証券	1.7500	1,340	1,406	148,350	2024/06/30		
US T N/B 1.75 06/15/22	国債証券	1.7500	830	847	89,463	2022/06/15		
US T N/B 0.5 06/30/27	国債証券	0.5000	1,700	1,661	175,272	2027/06/30		

銘柄	柄	当				期		末
		種類	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		
(アメリカ)			%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 0.25 06/15/23	国債証券	0.2500	2,800	2,807	296,150	2023/06/15		
US T N/B 0.25 06/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,972	313,557	2025/06/30		
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	1,860	2,056	216,926	2025/07/31		
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	2,370	2,520	265,877	2026/07/31		
US T N/B 1.75 07/31/24	国債証券	1.7500	3,690	3,875	408,881	2024/07/31		
US T N/B 2.75 07/31/23	国債証券	2.7500	3,270	3,477	366,869	2023/07/31		
US T N/B 0.125 07/15/23	国債証券	0.1250	1,600	1,599	168,727	2023/07/15		
US T N/B 0.375 07/31/27	国債証券	0.3750	2,000	1,936	204,257	2027/07/31		
US T N/B 0.25 07/31/25	国債証券	0.2500	1,000	989	104,403	2025/07/31		
US T N/B 6.25 08/15/23	国債証券	6.2500	1,000	1,151	121,518	2023/08/15		
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	710	930	98,172	2041/08/15		
US T N/B 5.5 08/15/28	国債証券	5.5000	650	860	90,749	2028/08/15		
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	1,110	1,473	155,401	2040/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	1,430	1,621	171,019	2042/08/15		
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	1,750	2,104	222,011	2044/08/15		
US T N/B 4.5 08/15/39	国債証券	4.5000	790	1,124	118,603	2039/08/15		
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	1,670	2,163	228,297	2043/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	1,890	2,183	230,394	2045/08/15		
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	5,180	5,532	583,676	2025/08/15		
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	1,880	2,130	224,744	2047/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	2,400	2,464	259,984	2049/08/15		
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	4,330	4,581	483,367	2023/08/15		
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	3,920	4,203	443,510	2024/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	2,370	2,440	257,496	2046/08/15		
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	3,210	3,812	402,258	2048/08/15		
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	2,690	2,923	308,449	2027/08/15		
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	3,090	3,225	340,282	2026/08/15		
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	3,680	4,168	439,803	2028/08/15		
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	3,980	4,069	429,353	2022/08/15		
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	1,640	1,804	190,403	2025/08/31		
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	2,380	2,466	260,250	2029/08/15		
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	3,680	3,779	398,704	2022/08/31		
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	3,120	3,293	347,418	2024/08/31		
US T N/B 2.75 08/31/23	国債証券	2.7500	2,170	2,311	243,869	2023/08/31		
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	1,210	1,235	130,312	2022/08/15		
US T N/B 1.125 08/15/40	国債証券	1.1250	4,100	3,536	373,108	2040/08/15		
US T N/B 1.375 08/15/50	国債証券	1.3750	4,540	3,772	397,956	2050/08/15		
US T N/B 0.125 08/31/22	国債証券	0.1250	4,000	4,001	422,148	2022/08/31		
US T N/B 0.625 08/15/30	国債証券	0.6250	6,210	5,833	615,385	2030/08/15		
US T N/B 1.375 08/31/26	国債証券	1.3750	1,100	1,139	120,247	2026/08/31		
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	2,440	2,521	266,027	2024/08/31		
US T N/B 0.25 08/31/25	国債証券	0.2500	1,000	988	104,296	2025/08/31		
US T N/B 0.125 08/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,998	210,859	2023/08/15		
US T N/B 3.0 09/30/25	国債証券	3.0000	1,410	1,569	165,571	2025/09/30		
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	2,930	3,121	329,279	2024/09/30		
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	1,500	1,547	163,269	2023/09/30		
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	5,250	5,388	568,500	2022/09/30		
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	840	899	94,878	2023/09/30		
US T N/B 1.5 09/15/22	国債証券	1.5000	750	766	80,852	2022/09/15		
US T N/B 0.125 09/15/23	国債証券	0.1250	2,000	1,998	210,810	2023/09/15		
US T N/B 0.375 09/30/27	国債証券	0.3750	1,700	1,640	173,086	2027/09/30		
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	1,900	1,994	210,378	2026/09/30		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(アメリカ)</b>		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 0.25 09/30/25	国債証券	0.2500	3,000	2,963	312,617	2025/09/30
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	1,920	2,138	225,648	2025/10/31
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	4,000	4,156	438,484	2023/10/31
US T N/B 2.875 10/31/23	国債証券	2.8750	3,690	3,957	417,549	2023/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	2,350	2,467	260,301	2026/10/31
US T N/B 1.5 10/31/24	国債証券	1.5000	2,200	2,294	242,054	2024/10/31
US T N/B 0.5 10/31/27	国債証券	0.5000	3,000	2,915	307,548	2027/10/31
US T N/B 0.25 10/31/25	国債証券	0.2500	2,000	1,973	208,164	2025/10/31
US T N/B 5.25 11/15/28	国債証券	5.2500	850	1,115	117,656	2028/11/15
US T N/B 6.125 11/15/27	国債証券	6.1250	900	1,208	127,522	2027/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	1,790	2,109	222,586	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	510	709	74,894	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	1,220	1,382	145,894	2042/11/15
US T N/B 3.125 11/15/41	国債証券	3.1250	760	913	96,410	2041/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	1,360	1,794	189,270	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	2,140	2,424	255,755	2047/11/15
US T N/B 1.625 11/15/50	国債証券	1.6250	2,900	2,569	271,052	2050/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	1,240	1,464	154,500	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	2,020	2,336	246,475	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	4,690	5,023	529,933	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	910	1,277	134,819	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	2,660	3,377	356,378	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	2,770	2,922	308,330	2049/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	5,190	5,609	591,776	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	4,840	5,575	588,210	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	5,620	5,766	608,404	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	5,520	5,907	623,261	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	2,640	2,826	298,190	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	6,590	6,810	718,492	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	3,270	3,555	375,063	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	2,000	2,107	222,390	2023/11/30
US T N/B 1.375 11/15/40	国債証券	1.3750	2,300	2,073	218,764	2040/11/15
US T N/B 1.625 11/30/26	国債証券	1.6250	1,020	1,070	112,898	2026/11/30
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	1,940	2,029	214,088	2029/11/15
US T N/B 0.875 11/15/30	国債証券	0.8750	6,400	6,137	647,506	2030/11/15
US T N/B 0.25 11/15/23	国債証券	0.2500	6,000	6,011	634,211	2023/11/15
US T N/B 0.125 11/30/22	国債証券	0.1250	5,340	5,341	563,524	2022/11/30
US T N/B 0.625 11/30/27	国債証券	0.6250	2,000	1,957	206,532	2027/11/30
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	2,000	2,086	220,099	2024/11/30
US T N/B 0.375 11/30/25	国債証券	0.3750	2,590	2,567	270,875	2025/11/30
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	3,060	3,272	345,226	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/25	国債証券	2.6250	2,290	2,515	265,433	2025/12/31
US T N/B 2.25 12/31/24	国債証券	2.2500	3,000	3,216	339,322	2024/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	5,520	5,726	604,107	2022/12/31
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	740	781	82,498	2026/12/31
US T N/B 0.125 12/15/23	国債証券	0.1250	1,000	998	105,314	2023/12/15
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	1,600	1,684	177,754	2024/12/31
US T N/B 0.375 12/31/25	国債証券	0.3750	1,000	990	104,502	2025/12/31
US T N/B 0.625 12/31/27	国債証券	0.6250	1,000	977	103,142	2027/12/31
小 計	-	-	519,140	550,714	58,100,386	-
<b>(カナダ)</b>		%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円	
CANADA 2.25 03/01/24	国債証券	2.2500	530	560	46,922	2024/03/01

銘	柄	当期					末	
		種類	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		
<b>(カナダ)</b>			%	千カナダ・ドル	千カナダ・ドル	千円		
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	300	301	25,209	2022/03/01		
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	3,160	3,257	272,751	2023/03/01		
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	700	720	60,283	2025/03/01		
CANADA 0.25 03/01/26	国債証券	0.2500	800	781	65,418	2026/03/01		
CANADA 1.5 05/01/22	国債証券	1.5000	920	934	78,257	2022/05/01		
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	800	831	69,616	2026/06/01		
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	1,000	1,375	115,123	2029/06/01		
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	720	1,077	90,199	2033/06/01		
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	390	586	49,096	2037/06/01		
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	1,600	1,709	143,158	2024/06/01		
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	680	956	80,070	2041/06/01		
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	2,240	2,313	193,723	2022/06/01		
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	1,210	1,244	104,185	2023/06/01		
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	720	776	65,008	2028/06/01		
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	1,300	1,391	116,489	2025/06/01		
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	700	708	59,340	2027/06/01		
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	610	670	56,143	2029/06/01		
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	1,810	1,832	153,378	2030/06/01		
CANADA 2.0 09/01/23	国債証券	2.0000	920	959	80,358	2023/09/01		
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	1,500	1,518	127,152	2022/09/01		
CANADA 0.5 09/01/25	国債証券	0.5000	2,350	2,336	195,571	2025/09/01		
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	920	1,246	104,373	2045/12/01		
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	850	1,034	86,592	2048/12/01		
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	1,280	1,347	112,782	2051/12/01		
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	350	452	37,894	2064/12/01		
CANADA 0.5 12/01/30	国債証券	0.5000	1,100	1,031	86,351	2030/12/01		
小計	—	—	29,460	31,957	2,675,453	—		
<b>(オーストラリア)</b>			%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円		
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	870	988	82,219	2047/03/21		
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	2,720	3,045	253,353	2025/04/21		
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	1,670	2,071	172,356	2027/04/21		
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	1,980	2,143	178,346	2024/04/21		
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	2,010	2,388	198,670	2026/04/21		
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	2,510	2,800	232,976	2023/04/21		
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	2,440	2,842	236,444	2029/04/21		
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	980	1,300	108,149	2033/04/21		
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	760	957	79,630	2037/04/21		
AUSTRALIAN 2.25 05/21/28	国債証券	2.2500	1,740	1,888	157,097	2028/05/21		
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	2,050	2,263	188,323	2030/05/21		
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	740	812	67,595	2041/05/21		
AUSTRALIAN 1.25 05/21/32	国債証券	1.2500	1,390	1,350	112,351	2032/05/21		
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	620	733	61,060	2039/06/21		
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	1,640	1,650	137,336	2031/06/21		
AUSTRALIAN 2.75 06/21/35	国債証券	2.7500	530	595	49,562	2035/06/21		
AUSTRALIAN 1.75 06/21/51	国債証券	1.7500	1,000	850	70,744	2051/06/21		
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	680	733	61,040	2022/07/15		
AUSTRALIAN 0.5 09/21/26	国債証券	0.5000	1,680	1,664	138,499	2026/09/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	1,780	2,001	166,541	2028/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	1,630	1,827	151,993	2027/11/21		
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	1,860	2,085	173,533	2029/11/21		
AUSTRALIAN 2.25 11/21/22	国債証券	2.2500	2,190	2,271	189,002	2022/11/21		
AUSTRALIAN 1.0 11/21/31	国債証券	1.0000	1,600	1,523	126,716	2031/11/21		

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(オーストラリア)</b>						
AUSTRALIAN 0.25 11/21/25	国債証券	0.2500	千オーストラリア・ドル 1,450	千オーストラリア・ドル 1,434	千円 119,342	2025/11/21
AUSTRALIAN 0.25 11/21/24	国債証券	0.2500	1,440	1,439	119,773	2024/11/21
AUSTRALIAN 1.0 12/21/30	国債証券	1.0000	1,740	1,677	139,582	2030/12/21
小計	—	—	41,700	45,344	3,772,248	—
<b>(シンガポール)</b>						
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	千シンガポール・ドル 730	千シンガポール・ドル 843	千円 67,253	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	420	513	40,914	2046/03/01
SINGAPORE 1.875 03/01/50	国債証券	1.8750	210	220	17,613	2050/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	380	454	36,250	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	130	144	11,552	2028/05/01
SINGAPORE 2.375 06/01/25	国債証券	2.3750	340	366	29,194	2025/06/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	310	332	26,509	2026/06/01
SINGAPORE 2.875 07/01/29	国債証券	2.8750	200	228	18,215	2029/07/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	100	112	8,978	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	700	739	58,960	2023/07/01
SINGAPORE 2.25 08/01/36	国債証券	2.2500	480	528	42,154	2036/08/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	550	598	47,716	2024/09/01
SINGAPORE 3.125 09/01/22	国債証券	3.1250	800	834	66,544	2022/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	370	426	33,998	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	480	586	46,786	2033/09/01
小計	—	—	6,200	6,929	552,643	—
<b>(イギリス)</b>						
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	千イギリス・ポンド 1,310	千イギリス・ポンド 1,842	千円 272,723	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	1,280	1,882	278,641	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	870	1,631	241,423	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	890	997	147,593	2049/01/22
UK TREASURY 0.875 01/31/46	国債証券	0.8750	250	229	33,909	2046/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/24	国債証券	0.1250	500	500	73,991	2024/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/28	国債証券	0.1250	1,000	976	144,542	2028/01/31
UK TREASURY 0.125 01/31/23	国債証券	0.1250	1,500	1,502	222,361	2023/01/31
UK TREASURY 0.125 01/30/26	国債証券	0.1250	1,200	1,191	176,244	2026/01/30
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	1,410	1,684	249,239	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	1,330	1,931	285,773	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	1,120	1,152	170,511	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	1,210	1,659	245,552	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	1,250	1,273	188,463	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	910	963	142,551	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	940	1,556	230,311	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	910	1,055	156,180	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	980	1,430	211,723	2065/07/22
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	960	1,781	263,612	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	900	959	141,928	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	1,260	1,328	196,608	2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	1,920	1,934	286,259	2022/07/22
UK TREASURY 0.75 07/22/23	国債証券	0.7500	1,560	1,587	234,847	2023/07/22
UK TREASURY 0.25 07/31/31	国債証券	0.2500	750	710	105,086	2031/07/31
UK TREASURY 0.625 07/31/35	国債証券	0.6250	800	755	111,850	2035/07/31
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	920	1,403	207,743	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	1,180	1,246	184,385	2023/09/07
UK TREASURY 2.75 09/07/24	国債証券	2.7500	480	524	77,655	2024/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	790	854	126,416	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	760	1,105	163,582	2034/09/07

銘柄	種 類	利 率	額 面 金 額	期 間		償 還 年 月 日
				評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
<b>(イギリス)</b>		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	1,440	1,582	234,125	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	1,530	1,571	232,601	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/54	国債証券	1.6250	520	575	85,205	2054/10/22
UK TREASURY 0.5 10/22/61	国債証券	0.5000	470	367	54,449	2061/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	580	701	103,738	2071/10/22
UK TREASURY 1.25 10/22/41	国債証券	1.2500	880	888	131,413	2041/10/22
UK TREASURY 0.625 10/22/50	国債証券	0.6250	1,050	887	131,403	2050/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	930	1,008	149,300	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	910	929	137,602	2029/10/22
UK TREASURY 0.375 10/22/30	国債証券	0.3750	1,450	1,405	207,984	2030/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	760	1,076	159,354	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	880	1,403	207,676	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	1,280	2,094	309,883	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	1,060	1,765	261,246	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	1,020	1,895	280,491	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/27	国債証券	4.2500	780	980	145,163	2027/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	960	1,486	220,009	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	1,140	1,578	233,628	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	990	1,712	253,474	2049/12/07
小計	—	—	49,770	61,565	9,110,469	—
<b>(イスラエル)</b>		%	千イスラエル・シユケル	千イスラエル・シユケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	1,500	2,457	79,193	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	1,260	1,669	53,806	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	2,610	2,830	91,218	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/24	国債証券	3.7500	2,600	2,881	92,859	2024/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.0 03/31/30	国債証券	1.0000	950	947	30,529	2030/03/31
ISRAEL FIXED BOND 4.25 03/31/23	国債証券	4.2500	2,920	3,169	102,152	2023/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.5 05/31/37	国債証券	1.5000	500	484	15,608	2037/05/31
ISRAEL FIXED BOND 0.75 07/31/22	国債証券	0.7500	300	302	9,750	2022/07/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	2,030	2,153	69,393	2025/08/31
ISRAEL FIXED BOND 1.25 11/30/22	国債証券	1.2500	1,000	1,019	32,846	2022/11/30
小計	—	—	15,670	17,913	577,359	—
<b>(デンマーク)</b>		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 0.25 11/15/52	国債証券	0.2500	1,650	1,599	27,514	2052/11/15
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	8,050	14,548	250,227	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	5,320	5,884	101,211	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	2,300	2,430	41,804	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	7,130	7,536	129,636	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	2,670	2,835	48,774	2029/11/15
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	3,660	3,710	63,820	2022/11/15
小計	—	—	30,780	38,545	662,988	—
<b>(ノルウェー)</b>		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	3,770	3,891	48,598	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	1,000	1,044	13,042	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	6,200	6,658	83,169	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	3,800	3,955	49,405	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	2,070	2,198	27,457	2028/04/26
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	1,000	1,034	12,923	2023/05/24
NORWAY 1.375 08/19/30	国債証券	1.3750	3,730	3,757	46,934	2030/08/19
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	1,700	1,772	22,137	2029/09/06
小計	—	—	23,270	24,312	303,668	—

銘	柄	当期					償還年月日
		種類	利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(スウェーデン)</b>			%	千スウェーデン・クナ	千スウェーデン・クナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	3,270	4,838	61,740	2039/03/30	
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	1,540	1,613	20,589	2028/05/12	
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	6,180	6,890	87,926	2025/05/12	
SWEDEN 0.125 05/12/31	国債証券	0.1250	2,200	2,155	27,505	2031/05/12	
SWEDEN 3.5 06/01/22	国債証券	3.5000	3,000	3,146	40,153	2022/06/01	
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	8,200	8,604	109,789	2023/11/13	
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	4,250	4,506	57,505	2026/11/12	
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	1,970	2,062	26,313	2029/11/12	
小計	—	—	30,610	33,818	431,523	—	
<b>(メキシコ)</b>			%	千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ	千円	
MEXICAN BONDS 5.75 03/05/26	国債証券	5.7500	14,859	15,407	79,350	2026/03/05	
MEXICAN BONDS 03/09/23	国債証券	6.7500	20,000	21,027	108,292	2023/03/09	
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	17,109	20,314	104,618	2029/05/31	
MEXICAN BONDS 7.75 05/29/31	国債証券	7.7500	10,000	11,329	58,346	2031/05/29	
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	18,071	20,262	104,352	2027/06/03	
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	7,830	8,066	41,542	2022/06/09	
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	10,000	11,134	57,343	2024/09/05	
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	13,643	14,895	76,713	2042/11/13	
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	9,254	10,313	53,112	2047/11/07	
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	8,125	9,596	49,422	2038/11/18	
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	8,085	10,834	55,799	2036/11/20	
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	7,000	7,917	40,776	2034/11/23	
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	22,596	26,847	138,264	2024/12/05	
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	14,000	15,372	79,167	2023/12/07	
小計	—	—	180,572	203,320	1,047,101	—	
<b>(マレーシア)</b>			%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 3.892 03/15/27	国債証券	3.8920	800	858	22,423	2027/03/15	
MALAYSIA 3.48 03/15/23	国債証券	3.4800	1,220	1,258	32,867	2023/03/15	
MALAYSIA 4.392 04/15/26	国債証券	4.3920	3,070	3,362	87,826	2026/04/15	
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	1,800	2,008	52,448	2030/04/15	
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	1,210	1,234	32,232	2033/04/15	
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	1,200	1,349	35,236	2037/04/07	
MALAYSIA 3.733 06/15/28	国債証券	3.7330	2,000	2,133	55,725	2028/06/15	
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	2,430	2,595	67,806	2024/07/15	
MALAYSIA 4.921 07/06/48	国債証券	4.9210	2,600	2,934	76,659	2048/07/06	
MALAYSIA 3.828 07/05/34	国債証券	3.8280	600	605	15,815	2034/07/05	
MALAYSIA 3.418 08/15/22	国債証券	3.4180	3,000	3,067	80,122	2022/08/15	
MALAYSIA 4.935 09/30/43	国債証券	4.9350	2,000	2,286	59,713	2043/09/30	
小計	—	—	21,930	23,693	618,878	—	
<b>(ポーランド)</b>			%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	2,850	2,981	85,062	2023/01/25	
POLAND 5.75 04/25/29	国債証券	5.7500	1,440	1,968	56,166	2029/04/25	
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	3,010	3,373	96,231	2028/04/25	
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	1,500	1,539	43,927	2022/04/25	
POLAND 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	2,290	2,447	69,821	2024/04/25	
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	2,080	2,277	64,976	2026/07/25	
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	2,380	2,662	75,948	2025/07/25	
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	2,280	2,511	71,645	2027/07/25	
POLAND 07/25/22	国債証券	—	1,200	1,199	34,226	2022/07/25	
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	1,720	1,876	53,528	2022/09/23	
POLAND 4.0 10/25/23	国債証券	4.0000	3,940	4,340	123,836	2023/10/25	
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	210	236	6,758	2029/10/25	

銘柄	種別	利率	額面金額	期		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)		%	千ポーランド・ズロチ	千ポーランド・ズロチ	千円	
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	600	639	18,255	2024/10/25
POLAND 1.25 10/25/30	国債証券	1.2500	2,850	2,828	80,701	2030/10/25
小計	—	—	28,350	30,882	881,086	—
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
IRISH 2.0 02/18/45	国債証券	2.0000	560	746	95,441	2045/02/18
IRISH 1.35 03/18/31	国債証券	1.3500	210	239	30,637	2031/03/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	510	572	73,204	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	800	993	127,088	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	570	623	79,736	2023/03/20
IRISH 0.8 03/15/22	国債証券	0.8000	370	375	48,008	2022/03/15
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	400	487	62,335	2050/05/15
IRISH 1.3 05/15/33	国債証券	1.3000	340	389	49,840	2033/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	630	776	99,305	2030/05/15
IRISH 0.9 05/15/28	国債証券	0.9000	430	466	59,681	2028/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	380	419	53,719	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	980	1,053	134,768	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	400	488	62,484	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	240	246	31,485	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	280	289	37,051	2027/05/15
IRISH 0.0 10/18/31	国債証券	0.0000	360	358	45,872	2031/10/18
IRISH 10/18/22	国債証券	0.0000	220	222	28,416	2022/10/18
IRISH 0.2 10/18/30	国債証券	0.2000	260	266	34,040	2030/10/18
小計	—	—	7,940	9,015	1,153,117	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	1,060	1,856	237,460	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	960	1,580	202,134	2047/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/52	国債証券	0.0000	570	521	66,732	2052/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/23	国債証券	3.7500	390	422	54,100	2023/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	850	1,204	154,070	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	950	1,556	199,028	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	780	1,027	131,440	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	590	634	81,131	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/24	国債証券	0.0000	830	846	108,247	2024/01/15
NETHERLANDS 0.0 01/15/27	国債証券	0.0000	460	473	60,539	2027/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	2,110	2,233	285,722	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	940	992	127,004	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	980	1,019	130,462	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	820	894	114,426	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	1,020	1,058	135,379	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	850	923	118,071	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	700	755	96,602	2027/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/29	国債証券	0.2500	790	828	105,927	2029/07/15
NETHERLANDS 0.0 07/15/30	国債証券	0.0000	950	972	124,375	2030/07/15
小計	—	—	16,600	19,801	2,532,858	—
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 4.0 03/28/22	国債証券	4.0000	420	441	56,473	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	1,240	1,760	225,203	2028/03/28
BELGIUM 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	1,060	1,827	233,799	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	820	1,031	131,896	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	530	766	98,035	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	1,090	1,826	233,596	2035/03/28
BELGIUM 1.25 04/22/33	国債証券	1.2500	710	811	103,806	2033/04/22



銘柄	当			期		末
	種類	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…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	650	1,112	142,359	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	640	783	100,199	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	490	617	78,957	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	420	609	77,973	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	420	615	78,676	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	1,020	1,100	140,806	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	1,050	1,163	148,792	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	810	897	114,848	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	830	886	113,400	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	880	951	121,745	2028/06/22
BELGIUM 0.4 06/22/40	国債証券	0.4000	320	316	40,517	2040/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	1,010	1,103	141,206	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	670	922	118,055	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	550	692	88,625	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	1,140	1,207	154,391	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	850	913	116,837	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	230	271	34,712	2037/06/22
BELGIUM 0.1 06/22/30	国債証券	0.1000	800	815	104,354	2030/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	1,190	1,284	164,250	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	530	551	70,513	2024/10/22
BELGIUM 0.2 10/22/23	国債証券	0.2000	660	674	86,307	2023/10/22
BELGIUM 0.0 10/22/27	国債証券	0.0000	500	511	65,471	2027/10/22
小計	—	—	21,530	26,470	3,385,814	—
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 02/25/22	国債証券	0.0000	690	694	88,821	2022/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/23	国債証券	0.0000	1,100	1,113	142,487	2023/02/25
FRANCE OAT 0.0 02/25/26	国債証券	0.0000	1,500	1,535	196,426	2026/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	2,720	2,770	354,339	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	2,470	2,524	322,898	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	2,700	2,735	349,943	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	1,030	1,236	158,103	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	2,820	3,408	435,949	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	2,180	3,907	499,797	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	1,060	2,102	268,932	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	1,090	2,266	289,912	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	2,540	3,749	479,635	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	2,350	2,450	313,451	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	1,650	2,716	347,506	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	1,800	2,911	372,455	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	1,690	2,269	290,233	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	1,870	2,277	291,284	2050/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/52	国債証券	0.7500	1,380	1,387	177,469	2052/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	940	1,257	160,785	2066/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/72	国債証券	0.5000	300	250	32,008	2072/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	1,980	2,165	276,933	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	2,940	3,661	468,371	2030/05/25
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	2,750	2,961	378,755	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	3,590	4,161	532,264	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	2,620	2,736	350,084	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	2,140	2,265	289,789	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	2,340	2,678	342,620	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	2,070	2,176	278,364	2026/05/25

銘	柄	当 期					末	
		種 類	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		
<b>(ユーロ…フランス)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	1,650	1,794	229,560	2027/05/25		
FRANCE OAT 0.5 05/25/40	国債証券	0.5000	700	708	90,570	2040/05/25		
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	3,130	3,299	422,007	2023/05/25		
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	2,190	2,515	321,805	2036/05/25		
FRANCE OAT 05/25/22	国債証券	0.0000	2,190	2,207	282,375	2022/05/25		
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	1,990	2,477	316,939	2039/06/25		
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	2,730	3,090	395,284	2023/10/25		
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	1,800	2,358	301,617	2025/10/25		
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	2,780	3,365	430,494	2027/10/25		
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	1,520	2,486	318,067	2038/10/25		
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	2,260	3,779	483,444	2032/10/25		
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	2,030	2,128	272,281	2022/10/25		
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	2,680	2,915	372,985	2024/11/25		
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	2,220	2,380	304,526	2025/11/25		
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	3,850	4,000	511,672	2026/11/25		
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	2,340	2,524	322,868	2028/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/30	国債証券	0.0000	2,200	2,215	283,329	2030/11/25		
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	2,450	2,483	317,675	2029/11/25		
小 計	-	-	95,020	113,104	14,467,133	-		
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>			%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	840	1,009	129,077	2024/01/04		
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	1,160	1,663	212,761	2028/01/04		
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	710	1,141	145,960	2030/01/04		
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	1,240	1,974	252,550	2031/01/04		
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	1,790	2,971	380,038	2037/01/04		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	1,860	1,948	249,230	2025/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	1,810	1,913	244,799	2026/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	1,900	2,009	257,043	2029/02/15		
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	1,420	1,482	189,649	2023/02/15		
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	1,430	1,534	196,261	2028/02/15		
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	1,500	1,611	206,122	2024/02/15		
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	1,960	2,059	263,449	2027/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/31	国債証券	0.0000	800	825	105,600	2031/02/15		
DEUTSCHLAND 0.0 02/15/30	国債証券	0.0000	1,690	1,749	223,796	2030/02/15		
BUNDESUBL 04/14/23	国債証券	0.0000	1,030	1,045	133,747	2023/04/14		
BUNDESUBL 04/05/24	国債証券	0.0000	1,540	1,574	201,335	2024/04/05		
BUNDESUBL 0.0 04/11/25	国債証券	0.0000	1,250	1,284	164,339	2025/04/11		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/24	国債証券	1.5000	1,410	1,511	193,332	2024/05/15		
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	1,650	1,731	221,527	2023/05/15		
DEUTSCHLAND 0.0 05/15/35	国債証券	0.0000	1,600	1,623	207,699	2035/05/15		
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	710	1,036	132,551	2027/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	600	837	107,173	2028/07/04		
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	1,140	2,046	261,708	2039/07/04		
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	1,100	1,859	237,901	2042/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	1,760	2,755	352,481	2044/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	1,180	2,277	291,365	2040/07/04		
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	1,540	1,591	203,522	2022/07/04		
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	1,420	2,378	304,297	2034/07/04		
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	1,750	2,801	358,330	2046/08/15		
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	1,620	2,091	267,533	2048/08/15		
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	1,770	1,903	243,435	2025/08/15		
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	2,300	2,461	314,801	2027/08/15		

銘柄	当			期		末
	種類	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	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	1,680	1,737	222,237	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	1,440	1,521	194,610	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	4,550	4,858	621,485	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	1,340	1,420	181,684	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	1,910	1,979	253,198	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	1,070	1,008	129,048	2050/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	2,000	2,067	264,453	2030/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/30	国債証券	0.0000	500	518	66,381	2030/08/15
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	1,650	1,705	218,190	2022/09/04
BUNDESUBL 10/18/24	国債証券	0.0000	1,130	1,158	148,192	2024/10/18
BUNDESUBL 10/07/22	国債証券	0.0000	1,400	1,415	181,074	2022/10/07
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	1,280	1,304	166,811	2023/10/13
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	1,300	1,339	171,294	2025/10/10
BUNDESUBL 0.0 10/10/25	国債証券	0.0000	300	309	39,592	2025/10/10
DEUTSCHLAND 0.0 11/15/27	国債証券	0.0000	1,500	1,553	198,764	2027/11/15
小計	—	—	68,530	80,607	10,310,448	—
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 5.85 01/31/22	国債証券	5.8500	1,810	1,918	245,400	2022/01/31
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	1,580	2,319	296,634	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	1,130	1,305	167,019	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	1,380	2,112	270,198	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	1,460	1,627	208,161	2023/01/31
SPAIN 0.0 01/31/25	国債証券	0.0000	1,400	1,417	181,312	2025/01/31
SPAIN 0.0 01/31/26	国債証券	0.0000	500	505	64,681	2026/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	1,450	1,566	200,434	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	1,270	1,442	184,462	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	1,210	1,331	170,255	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	1,270	1,413	180,831	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	1,240	1,363	174,414	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	1,170	1,297	165,900	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	1,570	1,587	203,015	2022/04/30
SPAIN 0.5 04/30/30	国債証券	0.5000	1,150	1,178	150,752	2030/04/30
SPAIN 0.1 04/30/31	国債証券	0.1000	600	584	74,788	2031/04/30
SPAIN 0.0 04/30/23	国債証券	0.0000	990	1,000	127,947	2023/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	1,170	1,559	199,413	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	1,170	2,018	258,214	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	1,270	2,167	277,244	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	960	1,568	200,686	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	1,370	1,672	213,954	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	1,460	1,692	216,473	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	1,520	2,428	310,616	2032/07/30
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	1,240	1,515	193,803	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	1,210	1,333	170,511	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	1,290	1,503	192,345	2035/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	940	960	122,873	2024/07/30
SPAIN 0.35 07/30/23	国債証券	0.3500	1,420	1,448	185,248	2023/07/30
SPAIN 0.8 07/30/27	国債証券	0.8000	1,200	1,266	161,987	2027/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	1,540	1,717	219,729	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	1,180	1,640	209,797	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	830	1,552	198,523	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	1,180	1,659	212,220	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	860	1,178	150,763	2048/10/31

銘柄	当			期		末
	種類	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	
<b>(ユーロ…スペイン)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 1.0 10/31/50	国債証券	1.0000	870	827	105,834	2050/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	1,380	1,537	196,709	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	1,480	1,627	208,133	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	1,550	1,680	214,917	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	1,480	1,535	196,390	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	480	543	69,499	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	1,340	1,361	174,183	2022/10/31
SPAIN 1.2 10/31/40	国債証券	1.2000	970	1,018	130,298	2040/10/31
SPAIN 1.25 10/31/30	国債証券	1.2500	1,770	1,932	247,206	2030/10/31
小計	—	—	54,310	64,919	8,303,795	—
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 0.85 01/15/27	国債証券	0.8500	1,400	1,456	186,335	2027/01/15
ITALY BTPS 0.0 01/15/24	国債証券	0.0000	1,000	1,006	128,741	2024/01/15
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	1,280	2,008	256,884	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	1,660	2,373	303,632	2037/02/01
ITALY BTPS 2.0 02/01/28	国債証券	2.0000	1,390	1,554	198,774	2028/02/01
ITALY BTPS 0.35 02/01/25	国債証券	0.3500	1,080	1,099	140,671	2025/02/01
ITALY BTPS 0.5 02/01/26	国債証券	0.5000	300	306	39,255	2026/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	1,020	1,298	166,138	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	1,020	1,472	188,339	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	1,090	1,245	159,300	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	590	766	98,031	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	1,790	2,157	275,965	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	1,700	1,793	229,406	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	1,630	1,994	255,091	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	2,490	2,742	350,735	2032/03/01
ITALY BTPS 3.1 03/01/40	国債証券	3.1000	810	1,067	136,523	2040/03/01
ITALY BTPS 3.35 03/01/35	国債証券	3.3500	1,090	1,435	183,565	2035/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	1,540	1,947	249,140	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	1,070	1,098	140,476	2023/03/15
ITALY BTPS 0.95 03/01/23	国債証券	0.9500	920	943	120,718	2023/03/01
ITALY BTPS 1.45 03/01/36	国債証券	1.4500	1,020	1,084	138,752	2036/03/01
ITALY BTPS 1.8 03/01/41	国債証券	1.8000	600	655	83,791	2041/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/01/37	国債証券	0.9500	600	591	75,633	2037/03/01
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	980	999	127,816	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	770	783	100,209	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	1,510	1,623	207,690	2030/04/01
ITALY BTPS 0.9 04/01/31	国債証券	0.9000	1,000	1,027	131,490	2031/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	970	1,484	189,831	2031/05/01
ITALY BTPS 4.5 05/01/23	国債証券	4.5000	1,400	1,548	198,031	2023/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	810	863	110,393	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	1,340	1,425	182,335	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	1,100	1,188	152,055	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	1,690	1,802	230,610	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	920	1,034	132,351	2027/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	1,630	1,806	231,125	2026/07/15
ITALY BTPS 1.75 07/01/24	国債証券	1.7500	1,200	1,277	163,407	2024/07/01
ITALY BTPS 1.85 07/01/25	国債証券	1.8500	900	974	124,616	2025/07/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	1,610	2,448	313,227	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	1,330	2,175	278,248	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	1,900	2,136	273,237	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	940	1,049	134,278	2027/08/01

銘柄	種類	利率	額面金額	期		償還年月日
				評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(ユーロ…イタリア)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.0 08/01/29	国債証券	3.0000	1,330	1,611	206,138	2029/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	980	997	127,633	2022/08/01
ITALY BTPS 0.95 08/01/30	国債証券	0.9500	1,170	1,214	155,341	2030/08/01
ITALY BTPS 0.3 08/15/23	国債証券	0.3000	1,000	1,014	129,739	2023/08/15
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	940	1,206	154,346	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	970	1,629	208,416	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	990	1,376	176,028	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	1,390	1,842	235,636	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	1,150	1,897	242,768	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	870	1,062	135,841	2050/09/01
ITALY BTPS 1.7 09/01/51	国債証券	1.7000	700	726	92,956	2051/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/33	国債証券	2.4500	1,600	1,908	244,090	2033/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	1,010	1,148	146,940	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	840	1,299	166,197	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	1,150	1,252	160,192	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	1,020	1,201	153,665	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	900	925	118,388	2022/09/15
ITALY BTPS 0.95 09/15/27	国債証券	0.9500	600	627	80,222	2027/09/15
ITALY BTPS 0.65 10/15/23	国債証券	0.6500	980	1,004	128,441	2023/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	930	996	127,430	2023/11/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	1,190	1,487	190,250	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	1,080	1,517	194,063	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	1,790	2,528	323,473	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	1,750	2,464	315,192	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	1,960	2,153	275,399	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	1,040	1,101	140,904	2024/11/15
ITALY BTPS 2.5 11/15/25	国債証券	2.5000	1,250	1,398	178,894	2025/11/15
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	970	1,063	135,971	2025/12/01
ITALY BTPS 1.25 12/01/26	国債証券	1.2500	1,350	1,437	183,865	2026/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	1,170	1,285	164,476	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	1,200	1,422	181,987	2028/12/01
ITALY BTPS 1.65 12/01/30	国債証券	1.6500	1,480	1,630	208,521	2030/12/01
小計	-	-	85,840	102,183	13,070,282	-
<b>(ユーロ…フィンランド)</b>		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 2.0 04/15/24	国債証券	2.0000	280	303	38,830	2024/04/15
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	380	414	52,981	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	130	163	20,898	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	430	452	57,907	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	290	330	42,293	2034/04/15
FINLAND 1.5 04/15/23	国債証券	1.5000	340	355	45,518	2023/04/15
FINLAND 04/15/22	国債証券	0.0000	120	120	15,463	2022/04/15
FINLAND 0.125 04/15/36	国債証券	0.1250	210	209	26,765	2036/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	430	517	66,188	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	380	468	59,870	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	350	521	66,657	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	570	606	77,525	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	300	319	40,918	2025/09/15
FINLAND 0.5 09/15/28	国債証券	0.5000	240	254	32,613	2028/09/15
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	300	318	40,704	2027/09/15
FINLAND 1.625 09/15/22	国債証券	1.6250	400	414	53,013	2022/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	230	233	29,925	2023/09/15
FINLAND 0.25 09/15/40	国債証券	0.2500	170	169	21,636	2040/09/15

銘柄	柄	当期				期末	
		種類	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…フィンランド)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.0 09/15/30		国債証券	0.0000	170	172	22,059	2030/09/15
FINLAND 0.0 09/15/24		国債証券	0.0000	180	184	23,536	2024/09/15
小計		—	—	5,900	6,530	835,308	—
(ユーロ…オーストリア)			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
AUSTRIA 3.8 01/26/62		国債証券	3.8000	210	457	58,552	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47		国債証券	1.5000	520	659	84,407	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29		国債証券	0.5000	340	361	46,200	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28		国債証券	0.7500	820	884	113,179	2028/02/20
AUSTRIA 0.0 02/20/30		国債証券	0.0000	840	853	109,145	2030/02/20
AUSTRIA 4.85 03/15/26		国債証券	4.8500	590	753	96,360	2026/03/15
AUSTRIA 4.15 03/15/37		国債証券	4.1500	890	1,456	186,298	2037/03/15
AUSTRIA 0.75 03/20/51		国債証券	0.7500	180	193	24,758	2051/03/20
AUSTRIA 3.65 04/20/22		国債証券	3.6500	280	293	37,587	2022/04/20
AUSTRIA 0.5 04/20/27		国債証券	0.5000	520	550	70,465	2027/04/20
AUSTRIA 0.0 04/20/23		国債証券	0.0000	200	202	25,932	2023/04/20
AUSTRIA 2.4 05/23/34		国債証券	2.4000	480	629	80,544	2034/05/23
AUSTRIA 0.85 06/30/20		国債証券	0.8500	170	171	21,910	2120/06/30
AUSTRIA 3.15 06/20/44		国債証券	3.1500	470	770	98,504	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27		国債証券	6.2500	670	959	122,698	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23		国債証券	0.0000	650	659	84,363	2023/07/15
AUSTRIA 07/15/24		国債証券	0.0000	800	816	104,386	2024/07/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17		国債証券	2.1000	380	684	87,492	2117/09/20
AUSTRIA 09/20/22		国債証券	0.0000	470	474	60,729	2022/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24		国債証券	1.6500	540	584	74,825	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26		国債証券	0.7500	680	727	93,079	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25		国債証券	1.2000	640	692	88,612	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23		国債証券	1.7500	750	797	102,015	2023/10/20
AUSTRIA 0.0 10/20/40		国債証券	0.0000	200	188	24,080	2040/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86		国債証券	1.5000	150	209	26,841	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22		国債証券	3.4000	740	792	101,373	2022/11/22
小計		—	—	13,180	15,826	2,024,348	—
合計		—	—	—	—	134,816,915	—

## ■投資信託財産の構成

2021年2月22日現在

項目	目	当期		期末
		評価額	比率	率
		千円		%
公社債		134,816,915		97.7
コール・ローン等、その他		3,110,505		2.3
投資信託財産総額		137,927,421		100.0

(注1) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 当期末の外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、136,245,185千円、98.8%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2021年2月22日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=105.50円、1カナダ・ドル=83.72円、1オーストラリア・ドル=83.19円、1シンガポール・ドル=79.75円、1イギリス・ポンド=147.98円、1イスラエル・シケル=32.23円、1デンマーク・クローネ=17.20円、1ノルウェー・クローネ=12.49円、1スウェーデン・クローナ=12.76円、1メキシコ・ペソ=5.15円、1マレーシア・リンギット=26.12円、1ポーランド・ズロチ=28.53円、1ユーロ=127.91円です。

# ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月22日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	139,026,864,416円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,966,445,647
公 社 債(評価額)	134,816,915,952
未 収 入 金	1,420,260,588
未 収 利 息	784,425,849
前 払 費 用	38,816,380
(B) 負 債	1,989,330,062
未 払 金	1,924,681,062
未 払 解 約 金	64,649,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	137,037,534,354
元 本	69,085,269,493
次 期 繰 越 損 益 金	67,952,264,861
(D) 受 益 権 総 口 数	69,085,269,493口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	19,836円

(注1) 期首元本額	66,784,593,799円	グループコントロール	2,047,605,074円
追加設定元本額	22,324,176,727円	D I AM 8資産バランスファンドN<DC年金>	112,880,979円
一部解約元本額	20,023,501,033円	4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	216,614,702円
(注2) 期末における元本の内訳		D I AMコア資産設計ファンド (堅実型)	7,184,218円
D I AM外国債券パッシブ・ファンド	7,285,630,090円	D I AMコア資産設計ファンド (積極型)	13,602,076円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	6,005,013円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	109,987,588円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	17,901,375円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	157,862,427円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	16,109,682円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,708,262円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	58,667,541円	D I AMパッシブ資産分散ファンド	1,153,273,300円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	49,579,939円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定)	288,411,930円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	22,987,271円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	353,533,881円
たわらノーロード 先進国債券	9,989,838,812円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08 (適格機関投資家限定)	161,736,477円
たわらノーロード 先進国債券<ラップ向け>	186,647,242円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	179,290,591円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	971,663,519円	D I AM海替フルハッジ型外国債券パッシブ私募ファンド (適格機関投資家向け)	6,015,406,638円
たわらノーロード バランス (堅実型)	26,728,812円	D I AM外国債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	3,819,894,345円
たわらノーロード バランス (標準型)	121,338,758円	外国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	2,325,976,349円
たわらノーロード バランス (積極型)	25,135,439円	先進国債券パッシブファンド (適格機関投資家限定)	5,699,054,337円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	4,073,309円	D I AMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	61,358,370円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	220,889,452円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定)	471,072,165円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	214,665,752円	D I AMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	503,573,522円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	46,211,416円	D I AMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	298,873,925円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	2,643,196円	D I AM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,070,483円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	275,405円	D I AM国際分散/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	51,781,571円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	1,559,857円	D I AM国内重視/バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	12,259,425円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	3,960,740円	D I AM国内重視/バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	1,487,646円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,185,878円	D I AM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	41,773,382円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	1,140,370円	D I AM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	62,816,454円
D I AM外国債券インデックスファンド<DC年金>	5,996,521,601円	D I AMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,343,965,366円
One D C 先進国債券インデックスファンド	286,853,098円	D I AMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	1,733,964,005円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	632,089,833円	D I AMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	3,001,729,443円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	1,830,048,277円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	553,039,600円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,993,683,959円	D I AMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	192,002,729円
D I AM DCバランス30インデックスファンド	361,021,755円	D I AMアクサグローバルバランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,181,197,557円
D I AM DCバランス50インデックスファンド	767,057,750円	D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家向け)	541,945,752円
D I AM DCバランス70インデックスファンド	628,680,822円	D I AM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	3,548,316円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	16,652,719円	D I AM世界アセット/バランスファンド2VA (適格機関投資家限定)	456,033,204円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	516,637,062円	D I AM世界アセット/バランスファンド3VA (適格機関投資家限定)	467,152,429円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	28,446,399円	D I AM世界アセット/バランスファンド4VA (適格機関投資家限定)	632,499,155円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国10)	125,346,778円	D I AM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	66,775,811円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国20)	95,961,436円	期末元本合計	69,085,269,493円
D I AM DC 8資産バランスファンド (新興国30)	160,485,652円		

## ■損益の状況

当期 自2020年2月22日 至2021年2月22日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,666,161,128	円
	受取利息	2,666,403,831	
	支払利息	△242,703	
(B)	有価証券売買損益	△1,147,059,846	
	売却益	6,089,848,393	
	売却損	△7,236,908,239	
(C)	その他の費用	△15,375,562	
(D)	当期損益金(A+B+C)	1,503,725,720	
(E)	前期繰越損益金	64,019,323,522	
(F)	解約差損益金	△19,145,002,454	
(G)	追加信託差損益金	21,574,218,073	
(H)	計(D+E+F+G)	67,952,264,861	
	次期繰越損益金(H)	67,952,264,861	

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) (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。