

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2015年4月20日から2028年5月8日までです。	
運用方針	主として国内外の公社債および株式に分散投資を行い、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。	
主要投資対象	コア資産形成ファンド	MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM外国債券インデックスマザーファンド受益証券、MHAM TOPIXマザーファンド受益証券およびMHAM外国株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。また、MHAM国内短期債券マザーファンド受益証券を通じて国内短期債券に投資する場合や、信託財産の純資産総額の50%を上限に短期金融商品等へ直接投資する場合があります。
	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	F T S E 世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。
	MHAM TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式を主要投資対象とします。
	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	M S C I コクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）の株式を主要投資対象とします。
	MHAM国内短期債券マザーファンド	わが国の短期の国債等を主要投資対象とします。
運用方法	国内債券、外国債券、国内株式および外国株式を主要投資対象とし、各資産のリスク（価格変動性）や、投資環境分析を勘案して配分比率を決定します。各資産およびファンド全体のリスクの状況を管理し、配分比率を調整することにより、基準価額の変動を抑制することを目指します。外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。	
組入制限	コア資産形成ファンド	株式への実質投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
	MHAM外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	MHAM TOPIXマザーファンド	株式の組入比率には、制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	MHAM外国株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	MHAM国内短期債券マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時（原則として毎年5月8日）に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は、委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。	

運用報告書（全体版）

第5期＜決算日2020年5月8日＞

コア資産形成ファンド

愛称：「ヒギナース」ラップ

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、「コア資産形成ファンド」は、2020年5月8日に第5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。

＜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。

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/>

コア資産形成ファンド

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			債券組入比率	株式組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率			
(設定日) 2015年4月20日	円 10,000	円 -	% -	% -	% -	百万円 1
1期(2016年5月9日)	9,889	0	△1.1	98.0	0.0	93
2期(2017年5月8日)	10,052	0	1.6	42.4	26.4	219
3期(2018年5月8日)	10,243	0	1.9	86.3	11.2	276
4期(2019年5月8日)	10,152	0	△0.9	91.0	6.7	382
5期(2020年5月8日)	9,884	0	△2.6	91.1	2.7	433

(注1) 設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。2頁の「設定以来の市況の推移」および「当期中の市況の推移」の各指数は当ファンドが組入れているマザーファンドのベンチマークを記載しています（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）。

■当期中の基準価額等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	株式組入比率
		騰落率		
(期首) 2019年5月8日	円 10,152	% -	% 91.0	% 6.7
5月末	10,153	0.0	90.9	6.5
6月末	10,243	0.9	84.4	12.9
7月末	10,273	1.2	83.2	13.7
8月末	10,302	1.5	88.2	9.2
9月末	10,283	1.3	81.7	15.7
10月末	10,350	2.0	80.7	16.5
11月末	10,375	2.2	79.7	17.3
12月末	10,404	2.5	78.9	18.2
2020年1月末	10,394	2.4	60.7	24.0
2月末	10,204	0.5	66.0	21.8
3月末	9,912	△2.4	95.5	0.7
4月末	9,919	△2.3	91.3	2.8
(期末) 2020年5月8日	9,884	△2.6	91.1	2.7

(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、「債券組入比率」、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

■設定以来の市況の推移

決算期	NOMURA-BPI総合		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		東証株価指数(TOPIX)		MSCIコクサイ・インデックス (円ベース・為替ヘッジなし)	
		騰落率		騰落率		騰落率		騰落率
(設定日) 2015年4月20日	(4月17日) 365.33	—	(4月16日) 463.72	—	ポイント (4月17日) 1,588.69	—	(4月16日) 2,617.97	—
1期(2016年5月9日)	387.68	6.1	428.65	△7.6	1,306.66	△17.8	2,221.98	△15.1
2期(2017年5月8日)	379.64	△2.1	439.54	2.5	1,585.86	21.4	2,785.42	25.4
3期(2018年5月8日)	381.90	0.6	447.08	1.7	1,779.82	12.2	3,046.31	9.4
4期(2019年5月8日)	388.40	1.7	454.86	1.7	1,572.33	△11.7	3,249.57	6.7
5期(2020年5月8日)	388.67	0.1	470.28	3.4	1,458.28	△7.3	3,054.30	△6.0

- (注1) 設定日のNOMURA-BPI総合と東証株価指数(TOPIX)は、前営業日の値を用いております(以下同じ)。
(注2) NOMURA-BPI総合は、小数第3位を四捨五入しております(以下同じ)。
(注3) 設定日のFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)およびMSCIコクサイ・インデックス(円ベース・為替ヘッジなし)は、前々営業日(現地ベース)の値を、設定日以外については、基準価額への反映を考慮して前営業日(現地ベース)の値を用いております(小数第3位四捨五入)(以下同じ)。
(注4) MSCIコクサイ・インデックス(円ベース・為替ヘッジなし)は、税引き前配当再投資ベースになります(以下同じ)。
(注5) 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6) FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産権その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します(以下同じ)。
(注7) 東証株価指数(TOPIX)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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、責任を負いません(以下同じ)。
(注8) MSCIコクサイ・インデックス(円ベース・為替ヘッジなし)は、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に関する著作権、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)。

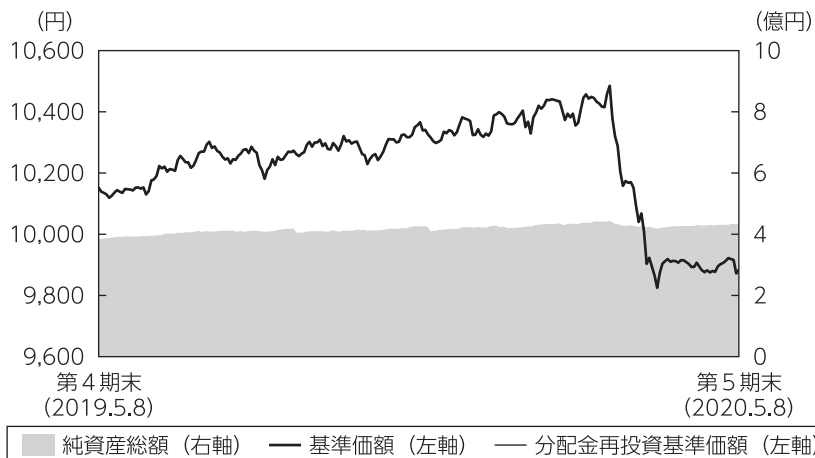
■当期中の市況の推移

年月日	NOMURA-BPI総合		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		東証株価指数(TOPIX)		MSCIコクサイ・インデックス (円ベース・為替ヘッジなし)	
		騰落率		騰落率		騰落率		騰落率
(期首) 2019年5月8日	388.40	—	454.86	—	ポイント 1,572.33	—	3,249.57	—
5月末	390.32	0.5	455.64	0.2	1,512.28	△3.8	3,140.70	△3.4
6月末	392.69	1.1	459.55	1.0	1,551.14	△1.3	3,240.27	△0.3
7月末	393.15	1.2	460.69	1.3	1,565.14	△0.5	3,328.93	2.4
8月末	398.50	2.6	464.28	2.1	1,511.86	△3.8	3,165.56	△2.6
9月末	394.27	1.5	467.48	2.8	1,587.80	1.0	3,275.15	0.8
10月末	392.61	1.1	470.06	3.3	1,667.01	6.0	3,394.32	4.5
11月末	391.33	0.8	470.90	3.5	1,699.36	8.1	3,523.71	8.4
12月末	390.14	0.4	472.81	3.9	1,721.36	9.5	3,631.40	11.8
2020年1月末	391.77	0.9	475.35	4.5	1,684.44	7.1	3,624.06	11.5
2月末	394.74	1.6	484.79	6.6	1,510.87	△3.9	3,369.37	3.7
3月末	388.45	0.0	480.58	5.7	1,403.04	△10.8	2,833.70	△12.8
4月末	389.79	0.4	472.88	4.0	1,464.03	△6.9	3,121.08	△4.0
(期末) 2020年5月8日	388.67	0.1	470.28	3.4	1,458.28	△7.3	3,054.30	△6.0

(注) 騰落率は期首比です。

■当期の運用経過（2019年5月9日から2020年5月8日まで）

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は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式への投資を行うとともに、資産配分比率を機動的に変動させる等対応しました。新型コロナウイルスの世界的感染拡大への懸念などから、国内株式の市況が下落したことなどが寄与し、基準価額は下落しました。

[組入マザーファンドの当作成対象期間における騰落率]

組入マザーファンド	騰落率
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	0.1%
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	3.7%
MHAM TOPIXマザーファンド	△4.8%
MHAM外国株式インデックスマザーファンド	△6.2%

投資環境

●国内株式市況

期初からほぼ横ばいの推移となっておりますが、2019年8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され下落しました。しかし、9月から2020年1月前半までは、欧米中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、反発しました。2月から3月半ばまでは、新型コロナウイルス感染拡大を嫌気し、急落しました。その後、期末にかけては、感染の鈍化や各国における経済対策への期待などを要因とし反発しました。

●国内債券市況

10年国債利回りは上昇しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念などを背景に、利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から2020年1月中旬にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きなどから上昇に転じました。その後新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念などから上昇幅を縮めましたが、3月中旬には、日本の大型経済対策に伴う国債増発懸念などを背景に再び上昇しました。

●外国株式市況

先進国株式市場は米国による対中追加関税に対する不透明感などから上値の重い展開となりましたが、10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から上昇傾向となりました。2020年も米中通商協議の第一段階の合意署名を受け上昇しましたが、2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され大きく下落しました。3月下旬以降は反発しましたが、前期末と比べて下落して期末を迎えました。

●外国債券市況

海外債券市場は上昇しました。期初から8月にかけては米中貿易問題に対する不透明感などから上昇しました。その後は一進一退となりましたが、2月以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて経済への悪影響が懸念され、市場は大幅に上昇しました。3月には米国政府による大規模な景気刺激策や米連邦準備制度理事会（FRB）による緊急利下げなどを受けて一時急激に上下する場面もありましたが、期を通じては上昇しました。

●為替市場

為替市場では、米ドルは米中通商協議を巡る混乱からドル安円高が進行したものの、2019年8月に対中追加関税の一部発動延期等をきっかけとしてドル高円安基調となりました。2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され為替は乱高下し、期末時点では前期末と比べてドル安円高となりました。ユーロも円に対して弱含み前期末比で円高となりました。

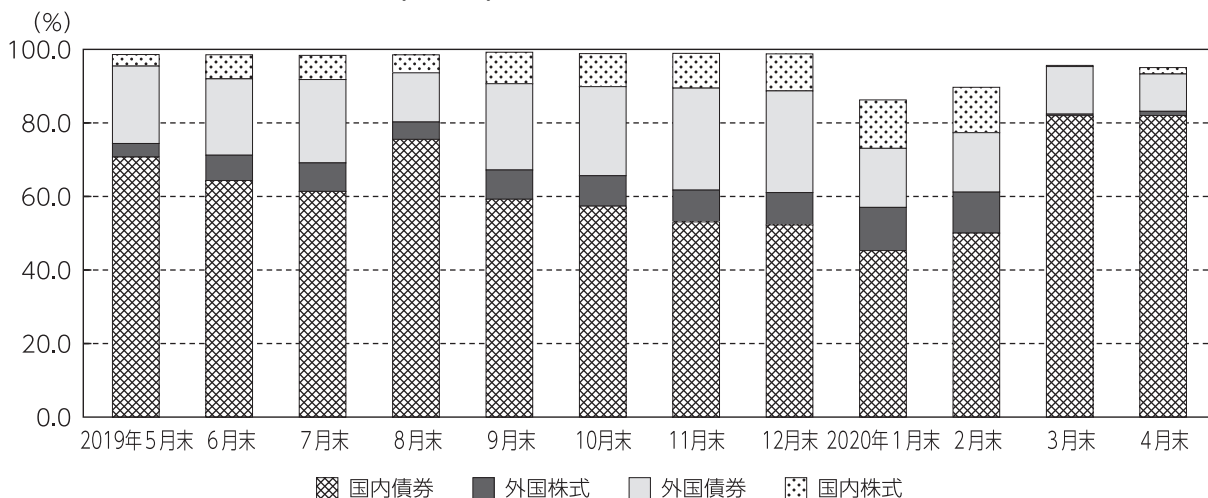
ポートフォリオについて

●当ファンド

当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行うとともに、資産配分比率を機動的に変動させることにより、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行いました。各資産の価格変動リスクや投資環境分析などに基づき、資産配分比率を下図のように推移させました。

なお、当期中はMHAM国内短期債券マザーファンド受益証券への投資は行いませんでした。

<当期中の資産配分比率の推移 (月末値)>



「国内債券」、「外国債券」、「国内株式」、「外国株式」は、各々「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」、「MHAM外国債券インデックスマザーファンド」、「MHAM TOPIXマザーファンド」、「MHAM外国株式インデックスマザーファンド」を表します。

比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

- MHAM TOPIXマザーファンド
ベンチマークであるTOPIX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。
- MHAM日本債券インデックスマザーファンド
ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、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。
- MHAM外国株式インデックスマザーファンド
ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円ベース、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。
- MHAM外国債券インデックスマザーファンド
FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。
なお、格下げによりベンチマーク除外となった南アフリカを全売却し、新規採用となったイスラエルを購入しました。

分配金

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2019年5月9日 ～2020年5月8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	414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

●当ファンド

今後の運用につきましても、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債および株式に投資を行うとともに、資産配分比率を機動的に変動させることにより、安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行います。

●MHAM TOPIX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。

●MHAM日本債券インデックスマザーファンド

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。

●MHAM外国株式インデックスマザーファンド

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概ね一致させることで、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。

●MHAM外国債券インデックスマザーファンド

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。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第5期		項目の概要
	(2019年5月9日 ～2020年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	101円	0.983%	(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10,230円です。
(投信会社)	(59)	(0.579)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(37)	(0.360)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(4)	(0.044)	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
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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)	
(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)	
(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	0.016	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(1)	(0.008)	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)	(0)	(0.004)	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)	(0)	(0.004)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	102	1.001	

(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。

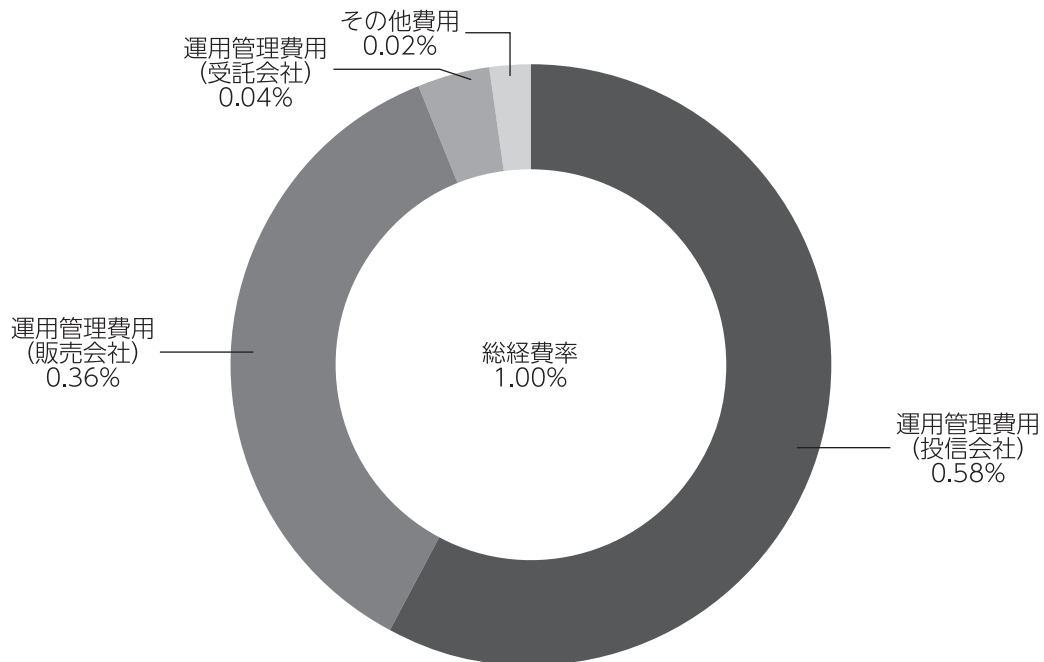
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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1.00%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 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千口 189,798	千円 241,000	千口 123,749	千円 157,000
MHAM外国株式インデックスマザーファンド	24,512	48,500	29,677	53,500
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	63,984	83,000	93,935	123,000
MHAM TOPIXマザーファンド	30,712	59,000	32,816	58,000

■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	MHAM TOPIX マザーファンド	MHAM外国株式 インデックスマザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	34,617,206千円	28,091,549千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	42,911,956千円	31,956,895千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.80	0.87

(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 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

【コア資産形成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)	2千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	0.227千円
(B)/(A)	8.4%

(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。

【MHAM日本債券インデックス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

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 75,219	百万円 5,656	% 7.5	百万円 69,798	百万円 5,356	% 7.7

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。

【MHAM外国債券インデックス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。

【MHAM TOPIX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	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
株 式	百万円 16,745	百万円 5,658	33.8	百万円 17,872	百万円 54	0.3
株式先物取引	15,471	8,833	57.1	15,569	8,356	53.7

平均保有割合 0.1%

(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。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	百万円 160	百万円 162	百万円 290

(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 78

【MHAM外国株式インデックス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、みずほリソース、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	□ 数	評 価 額
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千口 216,545	千口 282,593	千円 354,457	千円 354,457
MHAM外国株式インデックスマザーファンド	7,884	2,719	4,873	4,873
MHAM外国債券インデックスマザーファンド	63,318	33,367	43,720	43,720
MHAM TOPIXマザーファンド	6,344	4,240	7,529	7,529

■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
M H A M日本債券インデックスマザーファンド	千円 354,457	% 81.3
M H A M外国株式インデックスマザーファンド	4,873	1.1
M H A M外国債券インデックスマザーファンド	43,720	10.0
M H A M T O P I X マザーファンド	7,529	1.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	25,206	5.8
投 資 信 託 財 産 総 額	435,786	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MHAM外国株式インデックスマザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、29,574,742千円、99.9%です。

(注3) 期末のMHAM外国債券インデックスマザーファンドの外貨建資産の投資信託財産総額に対する比率は、15,431,634千円、99.7%です。

(注4) 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、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1香港・ドル=13.72円、1シンガポール・ドル=75.36円、1ニュージーランド・ドル=65.01円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シェケル=30.31円、1スイス・フラン=109.42円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1メキシコ・ペソ=4.45円、1マレーシア・リンギット=24.74円、1ポーランド・ズロチ=25.34円、1ユーロ=115.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	435,786,931円
コーラル・ローン等	25,206,102
MHAM日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	354,457,397
MHAM外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,873,380
MHAM外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	43,720,839
MHAM TOPIX マザーファンド(評価額)	7,529,213
(B) 負 債	2,519,619
未払解約金	405,974
未払信託報酬	2,105,140
その他未払費用	8,505
(C) 純資産総額(A-B)	433,267,312
元 本	438,357,789
次期繰越損益金	△5,090,477
(D) 受益権総口数	438,357,789口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,884円

(注) 期首における元本額は377,033,265円、当期中における追加設定元本額は184,043,588円、同解約元本額は122,719,064円です。

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△6,212円
受 取 利 息	600
支 払 利 息	△6,812
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△8,861,241
売 買 益	5,571,242
売 買 損	△14,432,483
(C) 信 託 報 酬 等	△4,124,313
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△12,991,766
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,222,099
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,679,190
(配 当 等 相 当 額)	(12,666,446)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△6,987,256)
(G) 合 計 (D+E+F)	△5,090,477
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△5,090,477
追 加 信 託 差 損 益 金	5,679,190
(配 当 等 相 当 額)	(12,836,807)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△7,157,617)
分 配 準 備 積 立 金	5,343,733
繰 越 損 益 金	△16,113,400

(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	898,544円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	12,836,807
(d) 分 配 準 備 積 立 金	4,445,189
(e) 当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	18,180,540
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	414.74
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額の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。

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年5月8日）

（計算期間 2019年5月9日～2020年5月8日）

MHAM日本債券インデックスマザーファンドの第12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	2008年6月3日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の公社債を主要投資対象として、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。
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	外貨建資産への投資は行いません。

■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	債券先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
8期(2016年5月9日)	12,518	7.0	387.68	7.0	99.6	-	135,853
9期(2017年5月8日)	12,255	△2.1	379.64	△2.1	99.5	-	104,764
10期(2018年5月8日)	12,324	0.6	381.90	0.6	99.3	-	152,614
11期(2019年5月8日)	12,535	1.7	388.40	1.7	99.5	-	153,384
12期(2020年5月8日)	12,543	0.1	388.67	0.1	99.3	-	158,088

(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）。

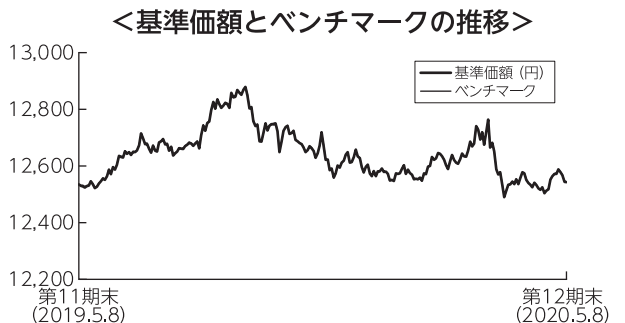
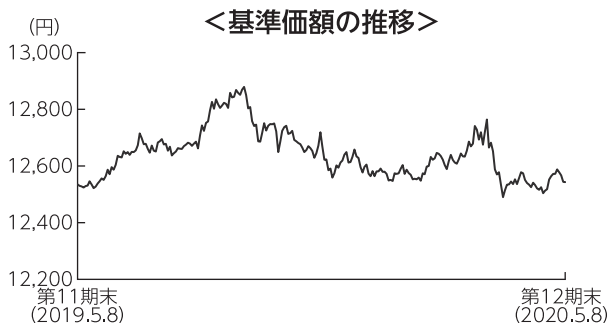
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019年 5 月 8 日	円	%		%	%	%
	12,535	-	388.40	-	99.5	-
5 月 末	12,596	0.5	390.32	0.5	99.5	-
6 月 末	12,672	1.1	392.69	1.1	99.7	-
7 月 末	12,686	1.2	393.15	1.2	99.6	-
8 月 末	12,858	2.6	398.50	2.6	99.5	-
9 月 末	12,722	1.5	394.27	1.5	99.7	-
10 月 末	12,672	1.1	392.61	1.1	99.7	-
11 月 末	12,628	0.7	391.33	0.8	99.7	-
12 月 末	12,590	0.4	390.14	0.4	99.3	-
2020年 1 月 末	12,643	0.9	391.77	0.9	99.6	-
2 月 末	12,741	1.6	394.74	1.6	99.6	-
3 月 末	12,536	0.0	388.45	0.0	101.2	-
4 月 末	12,578	0.3	389.79	0.4	99.3	-
(期 末) 2020年 5 月 8 日	12,543	0.1	388.67	0.1	99.3	-

(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 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)



(注) ベンチマーク (NOMURA-BPI総合) は、期首の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の推移

当ファンドの基準価額は12,543円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内債券への投資を行った結果、市況が概ね横ばいとなったことから、基準価額も概ね横ばいとなりました。

投資環境

10年国債利回りは上昇しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念などを背景に、利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から2020年1月中旬にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きなどから上昇に転じました。その後新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念などから上昇幅を縮めましたが、3月中旬には、日本の大型経済対策に伴う国債増発懸念などを背景に再び上昇しました。

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。

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0.1%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ございません。

■ 売買及び取引の状況 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	74,690,717	67,263,852 (-)
	地方債証券	323,611	910,158 (-)
	特殊債証券	-	522,524 (131,473)
	社債証券	205,282	1,102,390 (-)

(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 (2019年5月9日から2020年5月8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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	75,219	5,656	7.5	69,798	5,356	7.7

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当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	126,395,000	137,044,197	86.7	—	56.6	21.7	8.4
地 方 債 証 券	6,735,330	7,147,889	4.5	3.9	2.8	1.4	0.3
特 殊 債 証 券	7,304,945	7,809,776	4.9	0.1	3.5	1.3	0.2
金 融 債 証 券	300,000	300,099	0.2	—	—	0.1	0.1
普 通 社 債 証 券	4,610,000	4,749,522	3.0	0.1	1.4	1.2	0.4
合 計	145,345,275	157,051,485	99.3	4.1	64.2	25.7	9.5

(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	
1 2 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	680,000	682,114	2021/06/20
3 1 5 回 利付国庫債券 (10年)	1.2000	830,000	842,682	2021/06/20
3 1 6 回 利付国庫債券 (10年)	1.1000	480,000	486,801	2021/06/20
4 0 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	250,000	250,797	2021/07/01
4 0 3 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	400,000	401,372	2021/08/01
1 2 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,160,000	1,164,350	2021/09/20
3 1 7 回 利付国庫債券 (10年)	1.1000	410,000	417,134	2021/09/20
3 1 8 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	850,000	863,625	2021/09/20
4 0 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	500,000	502,090	2021/10/01
4 0 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	700,000	703,003	2021/11/01
4 0 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	500,000	502,225	2021/12/01
1 3 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,050,000	1,054,662	2021/12/20
3 1 9 回 利付国庫債券 (10年)	1.1000	480,000	489,926	2021/12/20
3 2 0 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	1,260,000	1,284,015	2021/12/20
4 0 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	200,000	200,922	2022/01/01
4 0 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	350,000	351,697	2022/02/01
4 1 0 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	700,000	703,549	2022/03/01
1 3 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,050,000	1,055,470	2022/03/20
3 2 1 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	840,000	858,471	2022/03/20
3 2 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.9000	500,000	510,060	2022/03/20
1 3 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,160,000	1,166,867	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.9000	560,000	572,863	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	750,000	765,645	2022/06/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,660,000	1,671,022	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	2,100,000	2,148,804	2022/09/20

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	
134回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,390,000	1,400,202	2022/12/20
326回 利付国庫債券 (10年)	0.7000	520,000	531,934	2022/12/20
327回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,170,000	1,199,916	2022/12/20
59回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	10,000	10,493	2022/12/20
135回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,500,000	1,511,835	2023/03/20
328回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,790,000	1,829,827	2023/03/20
136回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,100,000	1,109,449	2023/06/20
329回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,480,000	1,524,873	2023/06/20
137回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,010,000	1,019,211	2023/09/20
330回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	910,000	939,838	2023/09/20
331回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	500,000	513,015	2023/09/20
64回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	30,000	32,094	2023/09/20
138回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,350,000	1,362,987	2023/12/20
332回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,420,000	1,459,447	2023/12/20
65回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	64,488	2023/12/20
139回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,530,000	1,545,728	2024/03/20
333回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,580,000	1,626,910	2024/03/20
67回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	50,000	53,997	2024/03/20
140回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,350,000	1,364,512	2024/06/20
334回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,460,000	1,505,887	2024/06/20
70回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	50,000	55,283	2024/06/20
71回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	40,000	43,896	2024/06/20
141回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,050,000	1,061,518	2024/09/20
335回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	1,310,000	1,347,374	2024/09/20
72回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	120,839	2024/09/20
142回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,310,000	1,324,580	2024/12/20
336回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	440,000	453,173	2024/12/20
337回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,170,000	1,193,891	2024/12/20
73回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	43,972	2024/12/20
74回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	44,158	2024/12/20
143回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	250,000	252,872	2025/03/20
338回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,200,000	1,231,992	2025/03/20
75回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	44,382	2025/03/20
76回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	76,983	2025/03/20
77回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	44,186	2025/03/20
339回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,320,000	1,356,682	2025/06/20
78回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	66,282	2025/06/20
79回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	55,492	2025/06/20
80回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	100,349	2025/06/20
340回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,660,000	1,708,422	2025/09/20
81回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	160,000	178,448	2025/09/20
82回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	156,898	2025/09/20
341回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,260,000	1,291,348	2025/12/20
83回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	78,845	2025/12/20
84回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	190,519	2025/12/20
342回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,350,000	1,368,724	2026/03/20

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	
85回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	150,000	169,743	2026/03/20
86回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	137,211	2026/03/20
87回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	136,502	2026/03/20
343回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,670,000	1,694,164	2026/06/20
88回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	240,000	275,916	2026/06/20
89回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	11,434	2026/06/20
344回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,360,000	1,380,060	2026/09/20
90回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	170,000	195,345	2026/09/20
91回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	127,105	2026/09/20
345回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,330,000	1,350,388	2026/12/20
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	290,000	333,009	2026/12/20
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,370,000	1,391,317	2027/03/20
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	120,000	137,589	2027/03/20
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	220,000	253,770	2027/03/20
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,270,000	1,290,497	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	200,000	234,706	2027/06/20
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	139,102	2027/06/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,160,000	1,178,942	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	160,000	187,499	2027/09/20
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	186,312	2027/09/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,300,000	1,321,450	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	300,000	350,886	2027/12/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,660,000	1,686,958	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	230,000	271,894	2028/03/20
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	130,000	155,738	2028/03/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,140,000	1,158,160	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	140,000	168,477	2028/06/20
103回 利付国債 (20年)	2.3000	160,000	191,238	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	129,679	2028/06/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,170,000	1,188,216	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	240,000	284,042	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	150,000	178,788	2028/09/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,370,000	1,390,769	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	200,000	237,598	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	290,000	339,491	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,040,000	1,054,809	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	130,000	152,621	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	131,099	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,190,000	1,205,779	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	170,000	204,909	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	190,000	227,278	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,110,000	1,123,542	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	10,000	12,644	2029/09/20
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	479,984	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,100,000	1,112,166	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	270,000	324,961	2029/12/20

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	
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	160,000	194,110	2029/12/20
358回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	200,000	202,070	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	210,000	255,666	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	520,000	627,952	2030/03/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	245,000	294,237	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	270,000	318,807	2030/06/20
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	420,000	487,443	2030/06/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	400,000	477,756	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	370,000	438,098	2030/09/20
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	670,417	2030/12/20
124回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	360,000	435,013	2030/12/20
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	240,000	296,040	2031/03/20
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	302,970	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	220,000	264,235	2031/03/20
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	430,000	517,887	2031/06/20
129回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	320,000	381,868	2031/06/20
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	510,000	610,138	2031/09/20
131回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	290,000	343,667	2031/09/20
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	310,000	368,196	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	520,000	623,610	2031/12/20
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	400,000	480,812	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	190,000	226,153	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	220,000	259,278	2032/03/20
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	250,000	298,215	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	260,000	303,914	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	270,000	318,837	2032/06/20
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	750,000	896,527	2032/09/20
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	470,000	562,951	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	330,000	399,366	2032/12/20
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	520,000	617,448	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	430,000	505,133	2033/03/20
11回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	50,000	60,118	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	640,000	769,516	2033/06/20
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	30,000	37,737	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	600,000	722,766	2033/09/20
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	50,000	62,379	2033/12/20
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	750,000	895,057	2033/12/20
14回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	50,000	65,227	2034/03/20
148回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	600,000	708,996	2034/03/20
15回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	60,000	79,372	2034/06/20
149回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	720,000	852,530	2034/06/20
16回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	90,000	119,482	2034/09/20
150回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	730,000	855,275	2034/09/20
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	70,000	92,188	2034/12/20
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	730,000	835,404	2034/12/20
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	80,000	104,466	2035/03/20

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	
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	680,000	778,674	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	80,000	104,792	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	700,000	812,931	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	130,000	174,691	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	660,000	757,231	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	110,000	144,859	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	740,000	827,112	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	70,000	94,600	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	610,000	624,908	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	150,000	203,367	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	580,000	575,505	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	80,000	108,720	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	660,000	685,396	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	130,000	172,915	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	580,000	611,395	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	220,000	296,751	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	530,000	566,744	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	590,000	620,821	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	274,420	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	520,000	546,644	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	600,000	630,636	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	400,171	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	770,000	795,425	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	570,000	588,564	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	300,000	411,069	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	480,000	512,520	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	630,000	649,914	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	421,782	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	560,000	567,459	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	500,000	497,300	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	260,000	351,036	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	520,000	517,160	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	480,000	476,904	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	420,000	577,966	2040/03/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	650,000	861,211	2040/09/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	480,000	658,372	2041/03/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	560,000	748,860	2041/09/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	620,000	832,784	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	570,000	756,361	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	350,000	458,377	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	310,000	413,614	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	340,000	446,947	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	380,000	491,875	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	360,000	466,495	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	330,000	428,571	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	310,000	403,037	2044/09/20

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	
45回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	390,000	489,407	2044/12/20
46回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	400,000	502,892	2045/03/20
47回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	450,000	577,165	2045/06/20
48回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	480,000	593,251	2045/09/20
49回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	380,000	469,911	2045/12/20
50回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	370,000	403,732	2046/03/20
51回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	380,000	367,969	2046/06/20
52回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	410,000	416,793	2046/09/20
53回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	400,000	416,732	2046/12/20
54回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	400,000	436,684	2047/03/20
55回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	390,000	425,548	2047/06/20
56回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	410,000	447,683	2047/09/20
57回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	390,000	425,610	2047/12/20
1回 利付国債 (40年)	2.4000	110,000	166,182	2048/03/20
58回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	490,000	535,099	2048/03/20
59回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	390,000	415,884	2048/06/20
60回 利付国庫債券 (30年)	0.9000	370,000	413,959	2048/09/20
61回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	360,000	383,785	2048/12/20
2回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	150,000	220,708	2049/03/20
62回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	330,000	334,214	2049/03/20
63回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	400,000	394,344	2049/06/20
64回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	360,000	354,870	2049/09/20
65回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	370,000	364,686	2049/12/20
3回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	210,000	312,068	2050/03/20
66回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	70,000	68,987	2050/03/20
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	340,000	510,200	2051/03/20
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	330,000	480,552	2052/03/20
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	300,000	431,937	2053/03/20
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	360,000	499,550	2054/03/20
8回 利付国庫債券 (40年)	1.4000	390,000	506,980	2055/03/20
9回 利付国庫債券 (40年)	0.4000	570,000	557,750	2056/03/20
10回 利付国庫債券 (40年)	0.9000	520,000	595,857	2057/03/20
11回 利付国庫債券 (40年)	0.8000	440,000	490,604	2058/03/20
12回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	400,000	404,604	2059/03/20
小 計	-	126,395,000	137,044,197	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
100回 共同発行市場公募地方債	1.2100	100,000	101,431	2021/07/23
23年度2回 堺市公募公債	1.0600	100,000	101,641	2021/12/17
23年度1回 新潟市公募公債 10年	1.0600	100,000	101,689	2021/12/22
105回 共同発行市場公募地方債	1.0700	100,000	101,711	2021/12/24
23年度5回 横浜市公募公債	1.0110	100,000	101,713	2022/01/28
115回 共同発行市場公募地方債	0.8000	100,000	101,947	2022/10/25
118回 共同発行市場公募地方債	0.8400	100,000	102,255	2023/01/25
368回 大阪府公募公債 10年	0.8300	100,000	102,211	2023/01/30
719回 東京都公募公債	0.8600	200,000	204,870	2023/03/20
1回 東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	104,771	2023/06/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
25年度6回 千葉県公募公債	0.8000	100,000	102,653	2023/09/25
29回1号 宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	102,296	2023/10/25
127回 共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	102,296	2023/10/25
25年度2回 島根県公募公債	0.6700	106,000	108,452	2023/11/27
25年度8回 埼玉県公募公債	0.7030	100,000	102,479	2023/12/25
25年度2回 新潟県公募公債	0.6700	100,000	102,474	2024/02/28
132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	102,480	2024/03/25
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	102,139	2024/06/20
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	102,455	2024/07/18
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	102,221	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	102,345	2024/09/30
26年度1回 静岡県公募公債	0.5150	100,000	102,250	2024/11/25
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	102,017	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	101,482	2025/01/23
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	101,962	2025/02/25
213回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	102,496	2025/03/19
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	200,000	205,056	2025/05/23
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	111,292	2025/09/19
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	102,332	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	102,353	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,263	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,213	2026/04/24
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,934	2026/06/25
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	99,787	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	99,779	2026/09/18
413回 大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,524	2026/10/28
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	101,081	2027/02/24
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,699	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	109,323	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	104,138	2027/07/07
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	100,403	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	109,304	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	101,072	2028/01/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	110,266	2028/03/16
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	109,933	2028/06/23
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	101,238	2028/09/25
6回 大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	235,954	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	116,192	2028/12/20
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,898	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	100,000	100,555	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	118,568	2029/03/19
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	119,627	2029/12/20
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	120,251	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,516	2030/02/25
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	116,660	2033/05/20
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	116,534	2034/05/26

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
16回 名古屋市公募公債 20年	1.5200	100,000	116,481	2034/06/09
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	111,780	2035/02/16
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	112,458	2035/09/28
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	100,602	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	136,158	2037/03/19
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	136,730	2040/03/19
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	134,197	2042/09/19
小 計	-	6,735,330	7,147,889	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
142回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	100,000	101,361	2021/08/31
29回 地方公共団体金融機構債券	1.0250	100,000	101,499	2021/10/28
147回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	100,000	101,532	2021/10/29
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	100,000	101,851	2022/05/20
38回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8390	100,000	101,860	2022/07/15
170回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8010	100,000	101,886	2022/08/31
40回 地方公共団体金融機構債券	0.8250	100,000	101,989	2022/09/28
177回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8050	100,000	102,102	2022/11/30
101回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.7810	200,000	204,140	2022/12/20
44回 地方公共団体金融機構債券	0.7910	100,000	102,156	2023/01/27
19回 政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	101,948	2023/03/15
18回 国際協力機構債券	0.8680	100,000	102,693	2023/06/20
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	100,000	102,985	2023/07/31
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6990	105,000	107,583	2023/10/31
7回 広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.6940	100,000	102,157	2024/02/28
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	102,533	2024/02/29
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	102,700	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	205,370	2024/06/28
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	102,050	2024/09/20
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	102,209	2025/03/17
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,965	2025/04/25
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	102,281	2025/08/29
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	102,376	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	111,298	2025/12/19
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	103,059	2026/03/13
91回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,329	2026/12/14
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	100,536	2027/01/29
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	216,160	2027/03/19
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	100,000	100,825	2027/04/13
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,896	2027/07/16
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	100,910	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	109,915	2027/12/20
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	101,463	2028/10/16
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	108,659	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	100,000	119,181	2029/06/28
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	119,383	2029/12/28
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	106,199	2030/05/28

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券)	%	千円	千円	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	120,607	2031/01/28
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	119,559	2031/09/19
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	118,731	2031/12/26
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	117,169	2032/07/28
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	114,882	2033/04/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	100,000	133,287	2033/12/20
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	116,557	2034/03/17
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	116,700	2034/04/28
159回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	111,302	2035/05/18
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	113,967	2035/06/20
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	114,414	2035/06/29
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	104,523	2037/04/28
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	103,417	2038/01/29
233回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	103,063	2038/04/20
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	126,671	2040/08/31
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	13,141	13,689	2041/07/10
4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	13,623	14,180	2042/08/10
27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	22,917	24,575	2044/08/10
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	123,879	2045/06/20
38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	31,547	33,341	2045/07/10
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	117,773	2046/01/31
49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	29,589	31,425	2046/06/10
52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	35,499	37,538	2046/09/10
53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	37,087	39,220	2046/10/10
60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	43,829	46,257	2047/05/10
64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	95,090	99,728	2047/09/10
76回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	41,566	43,596	2048/09/10
82回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	49,185	51,224	2049/03/10
84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	49,443	51,535	2049/05/10
86回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	53,606	55,870	2049/07/10
90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	56,395	58,415	2049/11/10
93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	61,493	62,820	2050/02/10
96回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	69,531	71,595	2050/05/10
99回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	71,319	74,016	2050/08/10
117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	85,903	87,119	2052/02/10
118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	86,010	87,288	2052/03/10
119回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	86,072	87,294	2052/04/10
130回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	181,314	183,400	2053/03/10
137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	187,280	190,040	2053/10/10
142回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	95,506	95,825	2054/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	135,234	2055/03/19
小 計	-	7,304,945	7,809,776	-
(金融債券)	%	千円	千円	
326回 利附信中金債(5年)	0.0500	100,000	100,003	2022/01/27
331回 利附信中金債(5年)	0.0800	100,000	100,033	2022/06/27
342回 利附信中金債(5年)	0.1100	100,000	100,063	2023/05/26
小 計	-	300,000	300,099	-

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	
36回 富士通社債	0.5620	100,000	100,427	2021/06/11
37回 東日本高速道路社債	0.0300	200,000	200,032	2021/06/18
31回 ホンダファイナンス社債	0.4180	100,000	100,290	2021/06/18
62回 日本電信電話債券	1.0200	100,000	101,189	2021/09/17
34回 東京瓦斯社債	1.0640	100,000	101,338	2021/09/22
53回 クレディセゾン社債	0.4350	100,000	100,288	2021/10/22
7回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,192	2022/05/10
79回 三菱商事社債	1.0220	100,000	101,497	2022/05/20
50回 野村ホールディングス社債	0.2200	100,000	99,952	2022/08/10
9回 東海旅客鉄道社債	1.7400	110,000	114,222	2022/09/20
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	100,000	105,199	2022/10/27
30回 大阪瓦斯社債	0.7590	100,000	101,631	2022/12/14
344回 東京交通債券	1.6700	100,000	104,266	2023/02/17
5回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	99,462	2023/06/06
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	102,029	2023/06/20
26回 フランス相互信用連合銀行 (BF C M) 円貨社債 (2018)	0.4430	100,000	99,438	2023/10/12
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	102,635	2023/12/20
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	102,623	2024/04/25
2回 B P C E S A円貨社債 (ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,304	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	102,817	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,415	2024/09/03
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	102,412	2024/10/28
321回 北海道電力社債	0.8860	100,000	102,490	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,364	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	102,473	2025/05/21
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	103,122	2025/06/20
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,826	2026/05/26
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 (2016)	0.4000	100,000	99,287	2026/06/10
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,128	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,526	2026/10/23
12回 リゾナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	111,322	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	114,550	2027/04/20
32回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	114,681	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	103,352	2027/09/24
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,274	2027/10/22
54回 電源開発社債	0.3800	100,000	99,389	2027/11/19
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	100,000	100,007	2028/01/18
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	99,154	2028/10/25
21回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	116,917	2029/03/21
14回 プリヂェストン社債	0.3750	100,000	99,664	2029/04/19
65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	117,127	2029/12/21
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	100,783	2036/06/02
527回 中部電力社債	0.8060	100,000	102,282	2037/10/23
26回 豊田通商社債	0.8970	100,000	99,741	2038/03/05
107回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	116,405	2045/01/27
小 計	-	4,610,000	4,749,522	-
合 計	-	145,345,275	157,051,485	-

■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 157,051,485	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,122,759	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	158,174,245	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

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	158,174,245,216円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	837,974,952
公 社 債 (評価額)	157,051,485,604
未 収 利 息	252,464,741
前 払 費 用	32,319,919
(B) 負 債	85,420,000
未 払 解 約 金	85,420,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	158,088,825,216
元 本	126,035,115,497
次 期 繰 越 損 益 金	32,053,709,719
(D) 受 益 権 総 口 数	126,035,115,497口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	12,543円

(注1) 期首元本額 122,368,202,545円
追加設定元本額 53,145,336,589円
一部解約元本額 49,478,423,637円

(注2) 期末における元本の内訳
動的パッケージファンド<DC年金> 320,665,733円
コア資産形成ファンド 282,593,795円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ) 49,527,340,984円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 59,079,266,829円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定] 10,006,058,043円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定] 6,819,190,113円
期末元本合計 126,035,115,497円

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,090,446,870円
受 取 利 息	1,091,066,146
支 払 利 息	△619,276
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△871,192,022
売 買 益	771,928,500
売 買 損	△1,643,120,522
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	219,254,848
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	31,016,391,162
(E) 解 約 差 損 益 金	△13,343,006,602
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,161,070,311
(G) 合 計 (C+D+E+F)	32,053,709,719
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	32,053,709,719

(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。

MHAM外国債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年5月8日）

（計算期間 2019年5月9日～2020年5月8日）

MHAM外国債券インデックスマザーファンドの第12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	2008年6月3日から無期限です。
運用方針	F T S E 世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債に投資を行い、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、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指します。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要投資対象	F T S E 世界国債インデックス（除く日本）に採用されている国・地域の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債券 組入比率	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			
8期(2016年5月9日)	12,050	△7.5	428.65	△7.7	97.5	—	22,909
9期(2017年5月8日)	12,279	1.9	439.54	2.5	98.1	—	11,560
10期(2018年5月8日)	12,444	1.3	447.08	1.7	96.9	—	15,932
11期(2019年5月8日)	12,641	1.6	454.86	1.7	97.7	—	23,076
12期(2020年5月8日)	13,103	3.7	470.28	3.4	97.2	—	15,441

(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、基準価額への反映を考慮して前営業日（現地ベース）の値を用いております。小数点第3位を四捨五入しています（以下同じ）。

(注3) F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した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

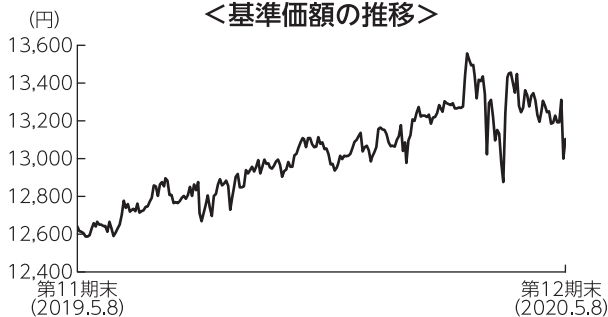
年 月 日	基 準 価 額		F T S E 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) (ベンチマーク)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019年 5 月 8 日	円 12,641	% -	ポイント 454.86	% -	% 97.7	% -
5 月末	12,630	△0.1	455.64	0.2	97.6	-
6 月末	12,793	1.2	459.55	1.0	97.9	-
7 月末	12,832	1.5	460.69	1.3	97.1	-
8 月末	12,920	2.2	464.28	2.1	97.9	-
9 月末	12,985	2.7	467.48	2.8	96.6	-
10 月末	13,113	3.7	470.06	3.3	97.3	-
11 月末	13,119	3.8	470.90	3.5	96.6	-
12 月末	13,178	4.2	472.81	3.9	97.8	-
2020年 1 月末	13,283	5.1	475.35	4.5	97.2	-
2 月末	13,440	6.3	484.79	6.6	100.0	-
3 月末	13,448	6.4	480.58	5.7	96.9	-
4 月末	13,192	4.4	472.88	4.0	96.8	-
(期 末) 2020年 5 月 8 日	13,103	3.7	470.28	3.4	97.2	-

(注1) 騰落率は期首比です。

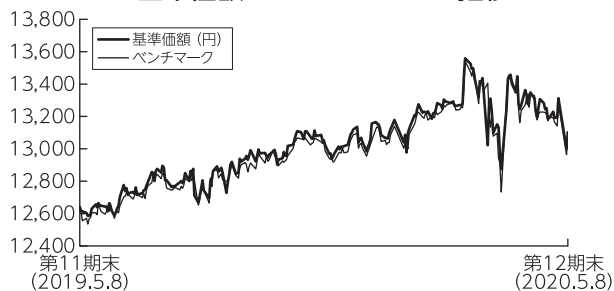
(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

<基準価額の推移>



<基準価額とベンチマークの推移>



(注) ベンチマーク (F T S E世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)) は、期首の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の推移

当ファンドの基準価額は13,103円となり、前期末比で約3.7%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

海外債券市場が上昇したことなどを主因に、基準価額は上昇しました。

投資環境

海外債券市場は上昇しました。期首から8月にかけては米中貿易問題に対する不透明感などから上昇しました。その後は一進一退となりましたが、2月以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて経済への悪影響が懸念され、市場は大幅に上昇しました。3月には米国政府による大規模な景気刺激策や米連邦準備制度理事会 (F R B) による緊急利下げなどを受けて一時急激に上下する場面もありましたが、期を通じては上昇しました。

為替市場 (対円) は大幅な円高になりました。

米ドルは、期首から8月頃にかけては米中貿易問題に対する不透明感などから下落しました。その後は良好な米経済指標や米中協議の進展期待などから値を戻しました。しかし2月以降は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大や主要産油国による減産協議が決裂し原油価格が急落したことなどから、値動きの荒い中、再度下落しました。ユーロもおおむね同様の要因から下落しました。

ポートフォリオについて

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行いました。期を通じて債券の組入比率は高位を維持しました。

なお、格下げによりベンチマーク除外となった南アフリカを全売却し、新規採用となったイスラエルを購入しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドの基準価額騰落率は為替レートの差異を考慮するとベンチマークを約0.1%下回りました。この差異は取引コストなどによるものです。

今後の運用方針

F T S E 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果を目指して運用を行います。債券の組入比率は高位を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) その他費用 (保管費用)	4円	0.029%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(その他)	(3)	(0.019)	
合計	(1)	(0.010)	
合計	4	0.029	
期中の平均基準価額は13,015円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

公社債

			買付額	売付額
外 国	アメリカ	国債証券	千アメリカ・ドル 81,569	千アメリカ・ドル 121,577 (-)
	カナダ	国債証券	千カナダ・ドル 4,634	千カナダ・ドル 6,460 (-)
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリア・ドル 4,336	千オーストラリア・ドル 6,245 (-)
	シンガポール	国債証券	千シンガポール・ドル 585	千シンガポール・ドル 940 (-)
	イギリス	国債証券	千イギリス・ポンド 7,585	千イギリス・ポンド 11,591 (-)
	イスラエル	国債証券	千イスラエル・シケル 1,209	千イスラエル・シケル - (-)
	デンマーク	国債証券	千デンマーク・クローネ 4,810	千デンマーク・クローネ 7,147 (-)
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェー・クローネ 2,305	千ノルウェー・クローネ 2,695 (-)
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデン・クローナ 2,154	千スウェーデン・クローナ 4,780 (-)

			買付額	売付額	
外	メキシコ	国債証券	千メキシコ・ペソ 21,285	千メキシコ・ペソ 32,109 (-)	
	マレーシア	国債証券	千マレーシア・リンギット 1,545	千マレーシア・リンギット 2,602 (-)	
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカ・ランド 11,777	千南アフリカ・ランド 25,817 (-)	
	ポーランド	国債証券	千ポーランド・ズロチ 3,169	千ポーランド・ズロチ 4,473 (-)	
国	口	アイルランド	国債証券	千ユーロ 1,132	千ユーロ 1,470 (-)
		オランダ	国債証券	2,508	4,229 (-)
		ベルギー	国債証券	3,825	5,675 (-)
		フランス	国債証券	15,442	20,607 (-)
		ドイツ	国債証券	8,387	11,250 (-)
		スペイン	国債証券	6,512	10,092 (-)
		イタリア	国債証券	10,943	14,810 (-)
		フィンランド	国債証券	1,299	1,753 (-)
		オーストリア	国債証券	2,513	3,847 (-)

(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。

■利害関係人との取引状況等 (2019年5月9日から2020年5月8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	額面金額	当 期		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	末		
		評 価 額				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 59,065	千アメリカ・ドル 66,557	千円 7,079,047	% 45.8	% -	% 20.7	% 17.5	% 7.7
カ ナ ダ	千カナダ・ドル 3,240	千カナダ・ドル 3,733	千円 284,870	1.8	-	0.9	0.5	0.4
オーストラリア	千オーストラリア・ドル 3,555	千オーストラリア・ドル 4,250	千円 295,060	1.9	-	1.4	0.5	-
シンガポール	千シンガポール・ドル 700	千シンガポール・ドル 810	千円 61,105	0.4	-	0.2	0.2	-
イ ギ リ ス	千イギリス・ポンド 5,314	千イギリス・ポンド 7,611	千円 1,002,693	6.5	-	5.4	1.1	-
イ ス ラ エ ル	千イスラエル・シケル 940	千イスラエル・シケル 1,196	千円 36,269	0.2	-	0.2	-	-
デ ン マ ー ク	千デンマーク・クローネ 3,580	千デンマーク・クローネ 4,647	千円 71,856	0.5	-	0.4	0.1	-
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェー・クローネ 3,030	千ノルウェー・クローネ 3,327	千円 34,640	0.2	-	0.1	0.1	-
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデン・クローナ 2,940	千スウェーデン・クローナ 3,366	千円 36,563	0.2	-	0.2	0.0	-
メ キ シ コ	千メキシコ・ペソ 21,636	千メキシコ・ペソ 23,549	千円 104,793	0.7	-	0.4	0.2	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシア・リンギット 2,570	千マレーシア・リンギット 2,837	千円 70,209	0.5	-	0.4	0.1	-
ポ ー ラ ン ド	千ポーランド・ズロチ 3,010	千ポーランド・ズロチ 3,246	千円 82,255	0.5	-	0.2	0.2	0.1
ユ ー ロ	千ユーロ	千ユーロ	千円					
アイルランド	780	898	103,658	0.7	-	0.5	0.2	-
オ ラ ン ダ	2,120	2,607	300,772	1.9	-	1.2	0.5	0.2
ベルギー	2,680	3,302	380,937	2.5	-	1.9	0.4	0.1
フ ラ ン ス	10,885	13,182	1,520,727	9.8	-	6.6	2.3	1.0
ド イ ツ	7,770	9,557	1,102,507	7.1	-	4.7	1.9	0.6
ス ペ イ ン	6,170	7,352	848,134	5.5	-	3.8	1.5	0.2
イ タ リ ア	10,202	11,363	1,310,868	8.5	-	4.9	2.4	1.2
フィンランド	610	688	79,386	0.5	-	0.4	0.1	-
オーストラリア	1,380	1,725	199,054	1.3	-	0.9	0.3	0.1
合 計	-	-	千円 15,005,413	97.2	-	55.5	30.0	11.6

(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						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		
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円		
US T N/B 1.5 01/31/22	国債証券	1.5000	210	214	22,860	2022/01/31	
US T N/B 2.625 01/31/26	国債証券	2.6250	280	315	33,554	2026/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/25	国債証券	2.5000	220	242	25,826	2025/01/31	
US T N/B 2.25 01/31/24	国債証券	2.2500	160	172	18,296	2024/01/31	
US T N/B 2.5 01/31/24	国債証券	2.5000	360	390	41,511	2024/01/31	
US T N/B 1.875 01/31/22	国債証券	1.8750	370	381	40,530	2022/01/31	
US T N/B 2.5 01/15/22	国債証券	2.5000	560	582	61,932	2022/01/15	
US T N/B 2.375 01/31/23	国債証券	2.3750	340	360	38,329	2023/01/31	
US T N/B 1.375 01/31/25	国債証券	1.3750	590	620	65,943	2025/01/31	
US T N/B 6.0 02/15/26	国債証券	6.0000	60	79	8,432	2026/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/42	国債証券	3.1250	180	246	26,244	2042/02/15	
US T N/B 3.125 02/15/43	国債証券	3.1250	250	342	36,436	2043/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/46	国債証券	2.5000	380	478	50,868	2046/02/15	
US T N/B 3.5 02/15/39	国債証券	3.5000	110	157	16,775	2039/02/15	
US T N/B 5.25 02/15/29	国債証券	5.2500	120	168	17,894	2029/02/15	
US T N/B 5.375 02/15/31	国債証券	5.3750	160	239	25,463	2031/02/15	
US T N/B 4.5 02/15/36	国債証券	4.5000	100	154	16,439	2036/02/15	
US T N/B 4.75 02/15/41	国債証券	4.7500	160	267	28,471	2041/02/15	
US T N/B 3.625 02/15/44	国債証券	3.6250	240	355	37,836	2044/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/49	国債証券	3.0000	330	462	49,206	2049/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/22	国債証券	2.0000	250	258	27,465	2022/02/15	
US T N/B 4.375 02/15/38	国債証券	4.3750	50	78	8,345	2038/02/15	
US T N/B 4.625 02/15/40	国債証券	4.6250	90	147	15,690	2040/02/15	
US T N/B 1.625 02/15/26	国債証券	1.6250	610	652	69,416	2026/02/15	
US T N/B 2.5 02/15/45	国債証券	2.5000	340	425	45,242	2045/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/47	国債証券	3.0000	190	262	27,966	2047/02/15	
US T N/B 3.0 02/15/48	国債証券	3.0000	340	472	50,257	2048/02/15	
US T N/B 2.75 02/15/24	国債証券	2.7500	710	777	82,642	2024/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/25	国債証券	2.0000	740	799	85,064	2025/02/15	
US T N/B 2.625 02/15/29	国債証券	2.6250	620	728	77,452	2029/02/15	
US T N/B 1.75 02/28/22	国債証券	1.7500	200	205	21,890	2022/02/28	
US T N/B 2.75 02/15/28	国債証券	2.7500	300	350	37,312	2028/02/15	
US T N/B 2.0 02/15/23	国債証券	2.0000	690	724	77,092	2023/02/15	
US T N/B 2.25 02/15/27	国債証券	2.2500	560	626	66,615	2027/02/15	
US T N/B 2.125 02/29/24	国債証券	2.1250	150	160	17,090	2024/02/29	
US T N/B 1.5 02/28/23	国債証券	1.5000	240	248	26,475	2023/02/28	
US T N/B 2.5 02/28/26	国債証券	2.5000	170	190	20,265	2026/02/28	
US T N/B 1.875 02/28/22	国債証券	1.8750	320	330	35,101	2022/02/28	
US T N/B 2.5 02/15/22	国債証券	2.5000	840	875	93,073	2022/02/15	
US T N/B 2.625 02/28/23	国債証券	2.6250	250	267	28,411	2023/02/28	
US T N/B 2.0 02/15/50	国債証券	2.0000	70	81	8,687	2050/02/15	
US T N/B 1.5 02/15/30	国債証券	1.5000	160	173	18,418	2030/02/15	

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.125 03/31/24	国債証券	2.1250	760	815	86,725	2024/03/31
US T N/B 1.5 03/31/23	国債証券	1.5000	440	456	48,589	2023/03/31
US T N/B 2.625 03/31/25	国債証券	2.6250	240	267	28,398	2025/03/31
US T N/B 2.25 03/31/26	国債証券	2.2500	280	310	32,982	2026/03/31
US T N/B 2.5 03/31/23	国債証券	2.5000	330	352	37,446	2023/03/31
US T N/B 2.875 04/30/25	国債証券	2.8750	170	191	20,371	2025/04/30
US T N/B 1.75 04/30/22	国債証券	1.7500	180	185	19,755	2022/04/30
US T N/B 2.0 04/30/24	国債証券	2.0000	160	171	18,195	2024/04/30
US T N/B 1.625 04/30/23	国債証券	1.6250	320	333	35,487	2023/04/30
US T N/B 1.875 04/30/22	国債証券	1.8750	200	206	21,996	2022/04/30
US T N/B 2.375 04/30/26	国債証券	2.3750	300	334	35,604	2026/04/30
US T N/B 2.25 04/15/22	国債証券	2.2500	360	374	39,846	2022/04/15
US T N/B 2.75 04/30/23	国債証券	2.7500	230	247	26,318	2023/04/30
US T N/B 2.25 04/30/24	国債証券	2.2500	670	723	76,900	2024/04/30
US T N/B 6.25 05/15/30	国債証券	6.2500	49	75	8,078	2030/05/15
US T N/B 4.375 05/15/40	国債証券	4.3750	100	159	16,984	2040/05/15
US T N/B 4.375 05/15/41	国債証券	4.3750	20	32	3,417	2041/05/15
US T N/B 4.25 05/15/39	国債証券	4.2500	140	219	23,293	2039/05/15
US T N/B 2.875 05/15/43	国債証券	2.8750	260	343	36,513	2043/05/15
US T N/B 3.375 05/15/44	国債証券	3.3750	190	272	28,948	2044/05/15
US T N/B 3.0 05/15/45	国債証券	3.0000	250	340	36,220	2045/05/15
US T N/B 3.0 05/15/47	国債証券	3.0000	330	456	48,600	2047/05/15
US T N/B 2.5 05/15/46	国債証券	2.5000	160	201	21,442	2046/05/15
US T N/B 3.125 05/15/48	国債証券	3.1250	160	227	24,210	2048/05/15
US T N/B 1.75 05/15/22	国債証券	1.7500	250	258	27,451	2022/05/15
US T N/B 2.875 05/15/49	国債証券	2.8750	470	645	68,696	2049/05/15
US T N/B 4.5 05/15/38	国債証券	4.5000	60	95	10,166	2038/05/15
US T N/B 1.75 05/15/23	国債証券	1.7500	390	408	43,424	2023/05/15
US T N/B 2.5 05/15/24	国債証券	2.5000	650	708	75,345	2024/05/15
US T N/B 2.125 05/15/25	国債証券	2.1250	630	686	73,058	2025/05/15
US T N/B 2.875 05/15/28	国債証券	2.8750	530	627	66,693	2028/05/15
US T N/B 2.375 05/15/29	国債証券	2.3750	560	647	68,868	2029/05/15
US T N/B 2.375 05/15/27	国債証券	2.3750	320	361	38,489	2027/05/15
US T N/B 5.0 05/15/37	国債証券	5.0000	55	91	9,682	2037/05/15
US T N/B 1.875 05/31/22	国債証券	1.8750	100	103	11,014	2022/05/31
US T N/B 1.625 05/15/26	国債証券	1.6250	580	621	66,132	2026/05/15
US T N/B 1.625 05/31/23	国債証券	1.6250	230	239	25,525	2023/05/31
US T N/B 2.0 05/31/24	国債証券	2.0000	660	706	75,144	2024/05/31
US T N/B 1.75 05/31/22	国債証券	1.7500	290	299	31,858	2022/05/31
US T N/B 2.125 05/15/22	国債証券	2.1250	410	426	45,343	2022/05/15
US T N/B 2.75 05/31/23	国債証券	2.7500	530	571	60,765	2023/05/31
US T N/B 1.375 06/30/23	国債証券	1.3750	370	383	40,801	2023/06/30
US T N/B 2.0 06/30/24	国債証券	2.0000	90	96	10,258	2024/06/30
US T N/B 2.125 06/30/22	国債証券	2.1250	220	229	24,393	2022/06/30

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.75 06/30/25	国債証券	2.7500	250	280	29,874	2025/06/30
US T N/B 1.875 06/30/26	国債証券	1.8750	30	32	3,470	2026/06/30
US T N/B 2.625 06/30/23	国債証券	2.6250	230	247	26,324	2023/06/30
US T N/B 1.75 06/30/22	国債証券	1.7500	260	268	28,602	2022/06/30
US T N/B 2.25 07/31/21	国債証券	2.2500	300	307	32,733	2021/07/31
US T N/B 2.125 07/31/24	国債証券	2.1250	180	194	20,641	2024/07/31
US T N/B 1.25 07/31/23	国債証券	1.2500	150	155	16,489	2023/07/31
US T N/B 2.0 07/31/22	国債証券	2.0000	250	260	27,684	2022/07/31
US T N/B 2.875 07/31/25	国債証券	2.8750	240	271	28,886	2025/07/31
US T N/B 1.875 07/31/26	国債証券	1.8750	410	446	47,457	2026/07/31
US T N/B 1.125 07/31/21	国債証券	1.1250	140	141	15,069	2021/07/31
US T N/B 1.875 07/31/22	国債証券	1.8750	290	301	32,027	2022/07/31
US T N/B 2.625 07/15/21	国債証券	2.6250	230	236	25,182	2021/07/15
US T N/B 1.75 07/31/21	国債証券	1.7500	450	458	48,811	2021/07/31
US T N/B 3.75 08/15/41	国債証券	3.7500	110	163	17,404	2041/08/15
US T N/B 3.875 08/15/40	国債証券	3.8750	120	180	19,207	2040/08/15
US T N/B 2.75 08/15/42	国債証券	2.7500	250	323	34,411	2042/08/15
US T N/B 3.125 08/15/44	国債証券	3.1250	250	345	36,721	2044/08/15
US T N/B 3.625 08/15/43	国債証券	3.6250	130	191	20,419	2043/08/15
US T N/B 2.875 08/15/45	国債証券	2.8750	170	227	24,177	2045/08/15
US T N/B 2.0 08/15/25	国債証券	2.0000	700	760	80,902	2025/08/15
US T N/B 2.75 08/15/47	国債証券	2.7500	360	477	50,790	2047/08/15
US T N/B 2.25 08/15/49	国債証券	2.2500	380	465	49,463	2049/08/15
US T N/B 2.125 08/15/21	国債証券	2.1250	280	286	30,517	2021/08/15
US T N/B 2.5 08/15/23	国債証券	2.5000	300	322	34,288	2023/08/15
US T N/B 2.375 08/15/24	国債証券	2.3750	140	152	16,225	2024/08/15
US T N/B 2.25 08/15/46	国債証券	2.2500	320	385	41,004	2046/08/15
US T N/B 3.0 08/15/48	国債証券	3.0000	460	641	68,281	2048/08/15
US T N/B 2.25 08/15/27	国債証券	2.2500	690	776	82,607	2027/08/15
US T N/B 1.5 08/15/26	国債証券	1.5000	640	681	72,526	2026/08/15
US T N/B 2.875 08/15/28	国債証券	2.8750	600	712	75,781	2028/08/15
US T N/B 2.0 08/31/21	国債証券	2.0000	210	215	22,879	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/15/22	国債証券	1.6250	150	154	16,476	2022/08/15
US T N/B 2.75 08/31/25	国債証券	2.7500	190	214	22,769	2025/08/31
US T N/B 1.375 08/31/23	国債証券	1.3750	170	176	18,773	2023/08/31
US T N/B 1.625 08/15/29	国債証券	1.6250	380	414	44,136	2029/08/15
US T N/B 1.875 08/31/22	国債証券	1.8750	210	218	23,227	2022/08/31
US T N/B 1.875 08/31/24	国債証券	1.8750	120	128	13,640	2024/08/31
US T N/B 1.125 08/31/21	国債証券	1.1250	380	384	40,939	2021/08/31
US T N/B 1.625 08/31/22	国債証券	1.6250	790	816	86,873	2022/08/31
US T N/B 2.75 08/15/21	国債証券	2.7500	200	206	21,967	2021/08/15
US T N/B 1.5 08/15/22	国債証券	1.5000	420	432	46,040	2022/08/15
US T N/B 1.25 08/31/24	国債証券	1.2500	530	552	58,735	2024/08/31
US T N/B 2.125 09/30/21	国債証券	2.1250	250	256	27,327	2021/09/30

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.125 09/30/24	国債証券	2.1250	180	194	20,694	2024/09/30
US T N/B 1.375 09/30/23	国債証券	1.3750	230	239	25,420	2023/09/30
US T N/B 1.75 09/30/22	国債証券	1.7500	210	217	23,183	2022/09/30
US T N/B 1.125 09/30/21	国債証券	1.1250	40	40	4,312	2021/09/30
US T N/B 1.875 09/30/22	国債証券	1.8750	720	749	79,720	2022/09/30
US T N/B 2.875 09/30/23	国債証券	2.8750	80	87	9,272	2023/09/30
US T N/B 2.75 09/15/21	国債証券	2.7500	910	942	100,201	2021/09/15
US T N/B 1.5 09/30/21	国債証券	1.5000	790	805	85,622	2021/09/30
US T N/B 1.625 09/30/26	国債証券	1.6250	90	96	10,285	2026/09/30
US T N/B 2.25 10/31/24	国債証券	2.2500	250	271	28,920	2024/10/31
US T N/B 2.0 10/31/21	国債証券	2.0000	210	215	22,942	2021/10/31
US T N/B 3.0 10/31/25	国債証券	3.0000	350	399	42,542	2025/10/31
US T N/B 1.25 10/31/21	国債証券	1.2500	300	304	32,431	2021/10/31
US T N/B 2.875 10/15/21	国債証券	2.8750	220	228	24,315	2021/10/15
US T N/B 1.625 10/31/23	国債証券	1.6250	300	314	33,461	2023/10/31
US T N/B 2.0 10/31/22	国債証券	2.0000	320	334	35,577	2022/10/31
US T N/B 1.5 10/31/21	国債証券	1.5000	200	204	21,699	2021/10/31
US T N/B 1.625 10/31/26	国債証券	1.6250	160	171	18,284	2026/10/31
US T N/B 8.0 11/15/21	国債証券	8.0000	35	39	4,169	2021/11/15
US T N/B 3.0 11/15/44	国債証券	3.0000	270	366	38,965	2044/11/15
US T N/B 4.25 11/15/40	国債証券	4.2500	80	126	13,414	2040/11/15
US T N/B 2.75 11/15/42	国債証券	2.7500	256	331	35,247	2042/11/15
US T N/B 3.75 11/15/43	国債証券	3.7500	180	271	28,826	2043/11/15
US T N/B 2.75 11/15/47	国債証券	2.7500	110	146	15,541	2047/11/15
US T N/B 3.0 11/15/45	国債証券	3.0000	210	287	30,554	2045/11/15
US T N/B 2.875 11/15/46	国債証券	2.8750	410	553	58,887	2046/11/15
US T N/B 2.25 11/15/24	国債証券	2.2500	700	761	81,030	2024/11/15
US T N/B 4.375 11/15/39	国債証券	4.3750	140	222	23,696	2039/11/15
US T N/B 3.375 11/15/48	国債証券	3.3750	440	656	69,802	2048/11/15
US T N/B 2.375 11/15/49	国債証券	2.3750	380	477	50,795	2049/11/15
US T N/B 2.0 11/15/21	国債証券	2.0000	360	370	39,381	2021/11/15
US T N/B 2.25 11/15/25	国債証券	2.2500	260	286	30,485	2025/11/15
US T N/B 3.125 11/15/28	国債証券	3.1250	660	800	85,109	2028/11/15
US T N/B 1.625 11/15/22	国債証券	1.6250	730	756	80,478	2022/11/15
US T N/B 2.75 11/15/23	国債証券	2.7500	740	805	85,685	2023/11/15
US T N/B 2.0 11/15/26	国債証券	2.0000	690	758	80,646	2026/11/15
US T N/B 2.0 11/30/22	国債証券	2.0000	530	554	59,004	2022/11/30
US T N/B 2.25 11/15/27	国債証券	2.2500	500	564	60,001	2027/11/15
US T N/B 2.125 11/30/23	国債証券	2.1250	260	277	29,509	2023/11/30
US T N/B 2.125 11/30/24	国債証券	2.1250	180	195	20,746	2024/11/30
US T N/B 2.875 11/30/25	国債証券	2.8750	360	409	43,560	2025/11/30
US T N/B 1.875 11/30/21	国債証券	1.8750	250	256	27,313	2021/11/30
US T N/B 2.875 11/30/23	国債証券	2.8750	600	656	69,823	2023/11/30
US T N/B 1.75 11/30/21	国債証券	1.7500	160	163	17,441	2021/11/30

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	
(アメリカ)		%	千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル	千円	
US T N/B 2.875 11/15/21	国債証券	2.8750	340	354	37,661	2021/11/15
US T N/B 1.75 11/15/29	国債証券	1.7500	510	563	59,934	2029/11/15
US T N/B 1.5 11/30/24	国債証券	1.5000	620	654	69,606	2024/11/30
US T N/B 2.25 12/31/23	国債証券	2.2500	280	300	31,970	2023/12/31
US T N/B 2.625 12/31/23	国債証券	2.6250	470	511	54,351	2023/12/31
US T N/B 2.125 12/31/21	国債証券	2.1250	250	258	27,462	2021/12/31
US T N/B 2.125 12/31/22	国債証券	2.1250	20	21	2,237	2022/12/31
US T N/B 2.0 12/31/21	国債証券	2.0000	190	195	20,824	2021/12/31
US T N/B 2.625 12/15/21	国債証券	2.6250	600	623	66,356	2021/12/15
US T N/B 1.75 12/31/26	国債証券	1.7500	370	401	42,652	2026/12/31
US T N/B 1.75 12/31/24	国債証券	1.7500	290	309	32,928	2024/12/31
小 計	-	-	59,065	66,557	7,079,047	-
(カナダ)		%	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	190	203	15,566	2024/03/01
CANADA 0.5 03/01/22	国債証券	0.5000	110	110	8,433	2022/03/01
CANADA 1.75 03/01/23	国債証券	1.7500	160	166	12,731	2023/03/01
CANADA 1.25 03/01/25	国債証券	1.2500	70	72	5,569	2025/03/01
CANADA 1.5 06/01/26	国債証券	1.5000	140	149	11,401	2026/06/01
CANADA 5.75 06/01/29	国債証券	5.7500	90	132	10,083	2029/06/01
CANADA 5.75 06/01/33	国債証券	5.7500	120	194	14,873	2033/06/01
CANADA 5.0 06/01/37	国債証券	5.0000	40	65	5,023	2037/06/01
CANADA 2.5 06/01/24	国債証券	2.5000	120	130	9,964	2024/06/01
CANADA 4.0 06/01/41	国債証券	4.0000	120	186	14,247	2041/06/01
CANADA 2.75 06/01/22	国債証券	2.7500	110	115	8,827	2022/06/01
CANADA 1.5 06/01/23	国債証券	1.5000	100	103	7,924	2023/06/01
CANADA 2.0 06/01/28	国債証券	2.0000	60	67	5,136	2028/06/01
CANADA 2.25 06/01/25	国債証券	2.2500	110	120	9,190	2025/06/01
CANADA 1.0 06/01/27	国債証券	1.0000	250	259	19,825	2027/06/01
CANADA 2.25 06/01/29	国債証券	2.2500	120	138	10,593	2029/06/01
CANADA 1.25 06/01/30	国債証券	1.2500	50	53	4,080	2030/06/01
CANADA 0.75 09/01/21	国債証券	0.7500	240	241	18,435	2021/09/01
CANADA 1.5 09/01/24	国債証券	1.5000	150	157	12,017	2024/09/01
CANADA 1.0 09/01/22	国債証券	1.0000	150	152	11,644	2022/09/01
CANADA 1.25 11/01/21	国債証券	1.2500	360	365	27,882	2021/11/01
CANADA 3.5 12/01/45	国債証券	3.5000	150	230	17,577	2045/12/01
CANADA 2.75 12/01/48	国債証券	2.7500	90	125	9,591	2048/12/01
CANADA 2.0 12/01/51	国債証券	2.0000	100	123	9,448	2051/12/01
CANADA 2.75 12/01/64	国債証券	2.7500	40	62	4,797	2064/12/01
小 計	-	-	3,240	3,733	284,870	-
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 3.0 03/21/47	国債証券	3.0000	100	127	8,817	2047/03/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/25	国債証券	3.2500	215	244	17,006	2025/04/21
AUSTRALIAN 4.75 04/21/27	国債証券	4.7500	330	422	29,320	2027/04/21

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	
(オーストラリア)		%	千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル	千円	
AUSTRALIAN 2.75 04/21/24	国債証券	2.7500	170	186	12,928	2024/04/21
AUSTRALIAN 4.25 04/21/26	国債証券	4.2500	370	450	31,292	2026/04/21
AUSTRALIAN 5.5 04/21/23	国債証券	5.5000	350	403	28,041	2023/04/21
AUSTRALIAN 3.25 04/21/29	国債証券	3.2500	240	289	20,095	2029/04/21
AUSTRALIAN 4.5 04/21/33	国債証券	4.5000	180	254	17,648	2033/04/21
AUSTRALIAN 3.75 04/21/37	国債証券	3.7500	170	229	15,917	2037/04/21
AUSTRALIAN 2.5 05/21/30	国債証券	2.5000	280	322	22,360	2030/05/21
AUSTRALIAN 2.75 05/21/41	国債証券	2.7500	30	35	2,488	2041/05/21
AUSTRALIAN 3.25 06/21/39	国債証券	3.2500	60	76	5,326	2039/06/21
AUSTRALIAN 1.5 06/21/31	国債証券	1.5000	100	105	7,310	2031/06/21
AUSTRALIAN 5.75 07/15/22	国債証券	5.7500	240	268	18,661	2022/07/15
AUSTRALIAN 2.75 11/21/28	国債証券	2.7500	240	278	19,317	2028/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/27	国債証券	2.7500	290	332	23,113	2027/11/21
AUSTRALIAN 2.75 11/21/29	国債証券	2.7500	190	222	15,413	2029/11/21
小 計	—	—	3,555	4,250	295,060	—
(シンガポール)		%	千シンガポール・ドル	千シンガポール・ドル	千円	
SINGAPORE 2.0 02/01/24	国債証券	2.0000	100	105	7,938	2024/02/01
SINGAPORE 3.5 03/01/27	国債証券	3.5000	80	94	7,123	2027/03/01
SINGAPORE 2.75 03/01/46	国債証券	2.7500	60	78	5,950	2046/03/01
SINGAPORE 2.75 04/01/42	国債証券	2.7500	20	25	1,932	2042/04/01
SINGAPORE 2.625 05/01/28	国債証券	2.6250	60	68	5,150	2028/05/01
SINGAPORE 2.125 06/01/26	国債証券	2.1250	30	32	2,454	2026/06/01
SINGAPORE 2.375 07/01/39	国債証券	2.3750	30	35	2,696	2039/07/01
SINGAPORE 2.75 07/01/23	国債証券	2.7500	100	106	8,056	2023/07/01
SINGAPORE 3.0 09/01/24	国債証券	3.0000	90	99	7,488	2024/09/01
SINGAPORE 2.875 09/01/30	国債証券	2.8750	30	35	2,676	2030/09/01
SINGAPORE 3.375 09/01/33	国債証券	3.3750	100	127	9,637	2033/09/01
小 計	—	—	700	810	61,105	—
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.25 01/22/44	国債証券	3.2500	150	238	31,463	2044/01/22
UK TREASURY 3.5 01/22/45	国債証券	3.5000	180	301	39,688	2045/01/22
UK TREASURY 4.0 01/22/60	国債証券	4.0000	70	160	21,182	2060/01/22
UK TREASURY 1.75 01/22/49	国債証券	1.7500	60	79	10,409	2049/01/22
UK TREASURY 5.0 03/07/25	国債証券	5.0000	165	204	26,893	2025/03/07
UK TREASURY 4.25 03/07/36	国債証券	4.2500	180	284	37,431	2036/03/07
UK TREASURY 1.0 04/22/24	国債証券	1.0000	170	176	23,240	2024/04/22
UK TREASURY 4.25 06/07/32	国債証券	4.2500	50	73	9,620	2032/06/07
UK TREASURY 0.625 06/07/25	国債証券	0.6250	100	102	13,544	2025/06/07
UK TREASURY 1.5 07/22/47	国債証券	1.5000	210	260	34,280	2047/07/22
UK TREASURY 3.75 07/22/52	国債証券	3.7500	110	216	28,461	2052/07/22
UK TREASURY 1.75 07/22/57	国債証券	1.7500	150	215	28,438	2057/07/22
UK TREASURY 2.5 07/22/65	国債証券	2.5000	160	296	39,012	2065/07/22

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	
(イギリス)		%	千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド	千円	
UK TREASURY 3.5 07/22/68	国債証券	3.5000	140	329	43,349	2068/07/22
UK TREASURY 1.5 07/22/26	国債証券	1.5000	170	185	24,415	2026/07/22
UK TREASURY 1.25 07/22/27	国債証券	1.2500	120	129	17,111	2027/07/22
UK TREASURY 0.5 07/22/22	国債証券	0.5000	240	242	31,972	2022/07/22
UK TREASURY 4.25 09/07/39	国債証券	4.2500	140	236	31,095	2039/09/07
UK TREASURY 2.25 09/07/23	国債証券	2.2500	300	322	42,458	2023/09/07
UK TREASURY 2.0 09/07/25	国債証券	2.0000	160	177	23,323	2025/09/07
UK TREASURY 4.5 09/07/34	国債証券	4.5000	110	172	22,726	2034/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/37	国債証券	1.7500	250	301	39,686	2037/09/07
UK TREASURY 1.75 09/07/22	国債証券	1.7500	330	343	45,236	2022/09/07
UK TREASURY 1.625 10/22/71	国債証券	1.6250	90	144	18,983	2071/10/22
UK TREASURY 1.625 10/22/28	国債証券	1.6250	250	281	37,063	2028/10/22
UK TREASURY 0.875 10/22/29	国債証券	0.8750	220	233	30,824	2029/10/22
UK TREASURY 6.0 12/07/28	国債証券	6.0000	120	179	23,673	2028/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/38	国債証券	4.7500	80	140	18,500	2038/12/07
UK TREASURY 4.5 12/07/42	国債証券	4.5000	175	321	42,362	2042/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/46	国債証券	4.2500	90	171	22,625	2046/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/55	国債証券	4.2500	162	361	47,618	2055/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/40	国債証券	4.2500	130	223	29,508	2040/12/07
UK TREASURY 4.75 12/07/30	国債証券	4.7500	115	169	22,288	2030/12/07
UK TREASURY 4.25 12/07/49	国債証券	4.2500	167	335	44,201	2049/12/07
小 計	-	-	5,314	7,611	1,002,693	-
(イスラエル)		%	千イスラエル・シケル	千イスラエル・シケル	千円	
ISRAEL FIXED BOND 5.5 01/31/42	国債証券	5.5000	240	411	12,479	2042/01/31
ISRAEL FIXED BOND 3.75 03/31/47	国債証券	3.7500	90	127	3,860	2047/03/31
ISRAEL FIXED BOND 2.0 03/31/27	国債証券	2.0000	340	370	11,220	2027/03/31
ISRAEL FIXED BOND 1.75 08/31/25	国債証券	1.7500	270	287	8,707	2025/08/31
小 計	-	-	940	1,196	36,269	-
(デンマーク)		%	千デンマーク・クローネ	千デンマーク・クローネ	千円	
DENMARK 4.5 11/15/39	国債証券	4.5000	970	1,829	28,283	2039/11/15
DENMARK 1.75 11/15/25	国債証券	1.7500	620	699	10,807	2025/11/15
DENMARK 1.5 11/15/23	国債証券	1.5000	330	354	5,480	2023/11/15
DENMARK 0.5 11/15/27	国債証券	0.5000	780	835	12,922	2027/11/15
DENMARK 0.5 11/15/29	国債証券	0.5000	510	551	8,521	2029/11/15
DENMARK 0.25 11/15/22	国債証券	0.2500	370	377	5,840	2022/11/15
小 計	-	-	3,580	4,647	71,856	-
(ノルウェー)		%	千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 1.5 02/19/26	国債証券	1.5000	200	215	2,243	2026/02/19
NORWAY 1.75 02/17/27	国債証券	1.7500	300	330	3,442	2027/02/17
NORWAY 3.0 03/14/24	国債証券	3.0000	900	1,002	10,437	2024/03/14
NORWAY 1.75 03/13/25	国債証券	1.7500	290	313	3,263	2025/03/13
NORWAY 2.0 04/26/28	国債証券	2.0000	330	373	3,888	2028/04/26

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	
(ノルウェー)		%	千ルウェー・クローネ	千ルウェー・クローネ	千円	
NORWAY 2.0 05/24/23	国債証券	2.0000	700	742	7,730	2023/05/24
NORWAY 1.75 09/06/29	国債証券	1.7500	310	349	3,635	2029/09/06
小 計	—	—	3,030	3,327	34,640	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ	千円	
SWEDEN 3.5 03/30/39	国債証券	3.5000	300	469	5,099	2039/03/30
SWEDEN 0.75 05/12/28	国債証券	0.7500	400	430	4,672	2028/05/12
SWEDEN 2.5 05/12/25	国債証券	2.5000	850	971	10,551	2025/05/12
SWEDEN 1.5 11/13/23	国債証券	1.5000	600	639	6,943	2023/11/13
SWEDEN 1.0 11/12/26	国債証券	1.0000	420	455	4,943	2026/11/12
SWEDEN 0.75 11/12/29	国債証券	0.7500	370	400	4,351	2029/11/12
小 計	—	—	2,940	3,366	36,563	—
(メキシコ)		%	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	2,289	2,310	10,281	2026/03/05
MEXICAN BONDS 8.5 05/31/29	国債証券	8.5000	2,428	2,813	12,519	2029/05/31
MEXICAN BONDS 7.5 06/03/27	国債証券	7.5000	1,175	1,288	5,732	2027/06/03
MEXICAN BONDS 6.5 06/09/22	国債証券	6.5000	3,434	3,527	15,697	2022/06/09
MEXICAN BONDS 8.0 09/05/24	国債証券	8.0000	2,350	2,608	11,608	2024/09/05
MEXICAN BONDS 7.75 11/13/42	国債証券	7.7500	1,544	1,626	7,240	2042/11/13
MEXICAN BONDS 8.0 11/07/47	国債証券	8.0000	1,257	1,359	6,050	2047/11/07
MEXICAN BONDS 8.5 11/18/38	国債証券	8.5000	900	1,021	4,546	2038/11/18
MEXICAN BONDS 10.0 11/20/36	国債証券	10.0000	911	1,184	5,271	2036/11/20
MEXICAN BONDS 7.75 11/23/34	国債証券	7.7500	915	1,007	4,482	2034/11/23
MEXICAN BONDS 10.0 12/05/24	国債証券	10.0000	1,052	1,248	5,557	2024/12/05
MEXICAN BONDS 8.0 12/07/23	国債証券	8.0000	1,071	1,167	5,195	2023/12/07
MEXICAN BONDS 7.25 12/09/21	国債証券	7.2500	2,310	2,384	10,610	2021/12/09
小 計	—	—	21,636	23,549	104,793	—
(マレーシア)		%	千マレーシア・リンギット	千マレーシア・リンギット	千円	
MALAYSIA 4.736 03/15/46	国債証券	4.7360	310	365	9,054	2046/03/15
MALAYSIA 4.498 04/15/30	国債証券	4.4980	200	226	5,611	2030/04/15
MALAYSIA 3.844 04/15/33	国債証券	3.8440	150	161	3,987	2033/04/15
MALAYSIA 4.762 04/07/37	国債証券	4.7620	300	353	8,744	2037/04/07
MALAYSIA 4.232 06/30/31	国債証券	4.2320	220	245	6,073	2031/06/30
MALAYSIA 4.181 07/15/24	国債証券	4.1810	250	267	6,617	2024/07/15
MALAYSIA 3.955 09/15/25	国債証券	3.9550	400	429	10,633	2025/09/15
MALAYSIA 3.795 09/30/22	国債証券	3.7950	200	206	5,119	2022/09/30
MALAYSIA 3.9 11/30/26	国債証券	3.9000	310	333	8,243	2026/11/30
MALAYSIA 3.899 11/16/27	国債証券	3.8990	230	247	6,122	2027/11/16
小 計	—	—	2,570	2,837	70,209	—
(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 2.5 01/25/23	国債証券	2.5000	480	504	12,777	2023/01/25
POLAND 2.75 04/25/28	国債証券	2.7500	390	427	10,824	2028/04/25
POLAND 2.25 04/25/22	国債証券	2.2500	170	175	4,453	2022/04/25

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	
(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 2.5 04/25/24	国債証券	2.5000	280	298	7,570	2024/04/25
POLAND 2.5 07/25/26	国債証券	2.5000	320	343	8,711	2026/07/25
POLAND 3.25 07/25/25	国債証券	3.2500	300	333	8,444	2025/07/25
POLAND 2.5 07/25/27	国債証券	2.5000	180	193	4,909	2027/07/25
POLAND 5.75 09/23/22	国債証券	5.7500	230	257	6,532	2022/09/23
POLAND 5.75 10/25/21	国債証券	5.7500	200	215	5,455	2021/10/25
POLAND 2.75 10/25/29	国債証券	2.7500	170	188	4,769	2029/10/25
POLAND 2.25 10/25/24	国債証券	2.2500	290	308	7,806	2024/10/25
小 計	—	—	3,010	3,246	82,255	—
(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	80	102	11,865	2045/02/18
IRISH 3.4 03/18/24	国債証券	3.4000	60	68	7,913	2024/03/18
IRISH 5.4 03/13/25	国債証券	5.4000	70	89	10,279	2025/03/13
IRISH 3.9 03/20/23	国債証券	3.9000	90	101	11,652	2023/03/20
IRISH 1.5 05/15/50	国債証券	1.5000	40	46	5,361	2050/05/15
IRISH 2.4 05/15/30	国債証券	2.4000	110	134	15,466	2030/05/15
IRISH 1.1 05/15/29	国債証券	1.1000	120	130	15,050	2029/05/15
IRISH 1.0 05/15/26	国債証券	1.0000	70	74	8,615	2026/05/15
IRISH 1.7 05/15/37	国債証券	1.7000	60	70	8,169	2037/05/15
IRISH 0.4 05/15/35	国債証券	0.4000	20	19	2,267	2035/05/15
IRISH 0.2 05/15/27	国債証券	0.2000	60	60	7,016	2027/05/15
小 計	—	—	780	898	103,658	—
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS 7.5 01/15/23	国債証券	7.5000	70	85	9,871	2023/01/15
NETHERLANDS 3.75 01/15/42	国債証券	3.7500	150	273	31,554	2042/01/15
NETHERLANDS 2.75 01/15/47	国債証券	2.7500	130	224	25,893	2047/01/15
NETHERLANDS 5.5 01/15/28	国債証券	5.5000	100	145	16,813	2028/01/15
NETHERLANDS 4.0 01/15/37	国債証券	4.0000	100	168	19,445	2037/01/15
NETHERLANDS 2.5 01/15/33	国債証券	2.5000	130	175	20,193	2033/01/15
NETHERLANDS 0.5 01/15/40	国債証券	0.5000	40	44	5,097	2040/01/15
NETHERLANDS 01/15/22	国債証券	0.0000	300	303	34,993	2022/01/15
NETHERLANDS 1.75 07/15/23	国債証券	1.7500	80	86	9,946	2023/07/15
NETHERLANDS 0.5 07/15/26	国債証券	0.5000	160	170	19,645	2026/07/15
NETHERLANDS 2.25 07/15/22	国債証券	2.2500	270	287	33,164	2022/07/15
NETHERLANDS 2.0 07/15/24	国債証券	2.0000	210	233	26,939	2024/07/15
NETHERLANDS 0.25 07/15/25	国債証券	0.2500	120	125	14,455	2025/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/28	国債証券	0.7500	140	153	17,692	2028/07/15
NETHERLANDS 0.75 07/15/27	国債証券	0.7500	120	130	15,064	2027/07/15
小 計	—	—	2,120	2,607	300,772	—
(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	160	173	20,057	2022/03/28
BELGIUM 5.5 03/28/28	国債証券	5.5000	80	115	13,358	2028/03/28

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 4.25 03/28/41	国債証券	4.2500	110	188	21,749	2041/03/28
BELGIUM 4.5 03/28/26	国債証券	4.5000	70	89	10,368	2026/03/28
BELGIUM 4.0 03/28/32	国債証券	4.0000	60	87	10,052	2032/03/28
BELGIUM 5.0 03/28/35	国債証券	5.0000	180	301	34,802	2035/03/28
BELGIUM 3.75 06/22/45	国債証券	3.7500	100	171	19,789	2045/06/22
BELGIUM 1.6 06/22/47	国債証券	1.6000	70	85	9,850	2047/06/22
BELGIUM 1.7 06/22/50	国債証券	1.7000	20	25	2,890	2050/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/57	国債証券	2.2500	50	72	8,407	2057/06/22
BELGIUM 2.15 06/22/66	国債証券	2.1500	60	86	10,020	2066/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/26	国債証券	1.0000	420	452	52,194	2026/06/22
BELGIUM 2.6 06/22/24	国債証券	2.6000	150	168	19,486	2024/06/22
BELGIUM 1.0 06/22/31	国債証券	1.0000	80	87	10,144	2031/06/22
BELGIUM 2.25 06/22/23	国債証券	2.2500	110	119	13,797	2023/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/28	国債証券	0.8000	90	94	10,888	2028/06/22
BELGIUM 0.9 06/22/29	国債証券	0.9000	160	173	20,028	2029/06/22
BELGIUM 3.0 06/22/34	国債証券	3.0000	70	96	11,105	2034/06/22
BELGIUM 1.9 06/22/38	国債証券	1.9000	110	136	15,754	2038/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/25	国債証券	0.8000	130	137	15,883	2025/06/22
BELGIUM 0.8 06/22/27	国債証券	0.8000	130	138	16,033	2027/06/22
BELGIUM 1.45 06/22/37	国債証券	1.4500	40	46	5,358	2037/06/22
BELGIUM 4.25 09/28/22	国債証券	4.2500	150	167	19,313	2022/09/28
BELGIUM 0.5 10/22/24	国債証券	0.5000	80	83	9,601	2024/10/22
小 計	—	—	2,680	3,302	380,937	—
(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	610	616	71,083	2022/02/25
FRANCE OAT 03/25/24	国債証券	0.0000	230	234	27,053	2024/03/25
FRANCE OAT 03/25/25	国債証券	0.0000	110	112	12,949	2025/03/25
FRANCE OAT 03/25/23	国債証券	0.0000	340	345	39,853	2023/03/25
FRANCE BTAN 8.5 04/25/23	国債証券	8.5000	120	152	17,565	2023/04/25
FRANCE OAT 3.5 04/25/26	国債証券	3.5000	380	467	53,890	2026/04/25
FRANCE OAT 4.5 04/25/41	国債証券	4.5000	280	502	58,007	2041/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/55	国債証券	4.0000	120	236	27,312	2055/04/25
FRANCE OAT 4.0 04/25/60	国債証券	4.0000	130	273	31,518	2060/04/25
FRANCE OAT 5.5 04/25/29	国債証券	5.5000	340	511	59,032	2029/04/25
FRANCE OAT 3.0 04/25/22	国債証券	3.0000	350	374	43,211	2022/04/25
FRANCE OAT 4.75 04/25/35	国債証券	4.7500	200	331	38,273	2035/04/25
FRANCE OAT 3.25 05/25/45	国債証券	3.2500	190	306	35,342	2045/05/25
FRANCE OAT 2.0 05/25/48	国債証券	2.0000	150	200	23,117	2048/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/50	国債証券	1.5000	230	279	32,207	2050/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/66	国債証券	1.7500	90	122	14,181	2066/05/25
FRANCE OAT 2.25 05/25/24	国債証券	2.2500	480	534	61,610	2024/05/25
FRANCE OAT 2.5 05/25/30	国債証券	2.5000	300	376	43,376	2030/05/25

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	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRANCE OAT 0.75 05/25/28	国債証券	0.7500	380	407	47,062	2028/05/25
FRANCE OAT 1.5 05/25/31	国債証券	1.5000	490	568	65,617	2031/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/25	国債証券	0.5000	350	366	42,279	2025/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/29	国債証券	0.5000	130	136	15,793	2029/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/34	国債証券	1.2500	180	204	23,627	2034/05/25
FRANCE OAT 0.5 05/25/26	国債証券	0.5000	340	357	41,196	2026/05/25
FRANCE OAT 1.0 05/25/27	国債証券	1.0000	300	326	37,619	2027/05/25
FRANCE OAT 1.75 05/25/23	国債証券	1.7500	300	321	37,074	2023/05/25
FRANCE OAT 1.25 05/25/36	国債証券	1.2500	330	376	43,425	2036/05/25
FRANCE OAT 1.75 06/25/39	国債証券	1.7500	230	284	32,787	2039/06/25
FRANCE OAT 4.25 10/25/23	国債証券	4.2500	465	543	62,661	2023/10/25
FRANCE OAT 6.0 10/25/25	国債証券	6.0000	160	216	24,951	2025/10/25
FRANCE OAT 2.75 10/25/27	国債証券	2.7500	120	146	16,938	2027/10/25
FRANCE OAT 4.0 10/25/38	国債証券	4.0000	200	327	37,768	2038/10/25
FRANCE OAT 3.25 10/25/21	国債証券	3.2500	300	316	36,527	2021/10/25
FRANCE OAT 5.75 10/25/32	国債証券	5.7500	350	593	68,523	2032/10/25
FRANCE OAT 2.25 10/25/22	国債証券	2.2500	340	363	41,974	2022/10/25
FRANCE OAT 1.75 11/25/24	国債証券	1.7500	370	407	47,025	2024/11/25
FRANCE OAT 1.0 11/25/25	国債証券	1.0000	40	43	4,967	2025/11/25
FRANCE OAT 0.25 11/25/26	国債証券	0.2500	290	299	34,603	2026/11/25
FRANCE OAT 0.75 11/25/28	国債証券	0.7500	330	354	40,930	2028/11/25
FRANCE OAT 0.0 11/25/29	国債証券	0.0000	240	240	27,783	2029/11/25
小 計	—	—	10,885	13,182	1,520,727	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/24	国債証券	6.2500	70	88	10,164	2024/01/04
DEUTSCHLAND 5.625 01/04/28	国債証券	5.6250	150	223	25,801	2028/01/04
DEUTSCHLAND 6.25 01/04/30	国債証券	6.2500	70	117	13,532	2030/01/04
DEUTSCHLAND 5.5 01/04/31	国債証券	5.5000	210	348	40,208	2031/01/04
DEUTSCHLAND 4.0 01/04/37	国債証券	4.0000	230	401	46,267	2037/01/04
DEUTSCHLAND 2.0 01/04/22	国債証券	2.0000	170	177	20,511	2022/01/04
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/25	国債証券	0.5000	240	254	29,384	2025/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/26	国債証券	0.5000	300	321	37,140	2026/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/29	国債証券	0.2500	220	237	27,362	2029/02/15
DEUTSCHLAND 1.5 02/15/23	国債証券	1.5000	210	223	25,793	2023/02/15
DEUTSCHLAND 0.5 02/15/28	国債証券	0.5000	100	109	12,601	2028/02/15
DEUTSCHLAND 1.75 02/15/24	国債証券	1.7500	130	142	16,459	2024/02/15
DEUTSCHLAND 0.25 02/15/27	国債証券	0.2500	270	287	33,210	2027/02/15
BUNDESobl 04/08/22	国債証券	0.0000	100	101	11,704	2022/04/08
BUNDESobl 04/14/23	国債証券	0.0000	170	173	20,072	2023/04/14
BUNDESobl 04/05/24	国債証券	0.0000	250	257	29,749	2024/04/05
DEUTSCHLAND 1.5 05/15/23	国債証券	1.5000	120	128	14,813	2023/05/15
DEUTSCHLAND 6.5 07/04/27	国債証券	6.5000	70	106	12,312	2027/07/04

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…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/28	国債証券	4.7500	100	144	16,696	2028/07/04
DEUTSCHLAND 4.25 07/04/39	国債証券	4.2500	120	226	26,167	2039/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/42	国債証券	3.2500	200	357	41,205	2042/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 07/04/44	国債証券	2.5000	200	332	38,305	2044/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/40	国債証券	4.7500	140	285	32,922	2040/07/04
DEUTSCHLAND 3.25 07/04/21	国債証券	3.2500	140	146	16,876	2021/07/04
DEUTSCHLAND 1.75 07/04/22	国債証券	1.7500	420	443	51,111	2022/07/04
DEUTSCHLAND 4.75 07/04/34	国債証券	4.7500	230	403	46,526	2034/07/04
DEUTSCHLAND 2.5 08/15/46	国債証券	2.5000	190	324	37,435	2046/08/15
DEUTSCHLAND 1.25 08/15/48	国債証券	1.2500	150	208	24,096	2048/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/25	国債証券	1.0000	420	459	53,024	2025/08/15
DEUTSCHLAND 0.5 08/15/27	国債証券	0.5000	270	293	33,892	2027/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/26	国債証券	0.0000	340	355	41,046	2026/08/15
DEUTSCHLAND 0.25 08/15/28	国債証券	0.2500	400	430	49,614	2028/08/15
DEUTSCHLAND 2.0 08/15/23	国債証券	2.0000	300	327	37,808	2023/08/15
DEUTSCHLAND 1.0 08/15/24	国債証券	1.0000	150	161	18,649	2024/08/15
DEUTSCHLAND 08/15/29	国債証券	0.0000	270	284	32,866	2029/08/15
DEUTSCHLAND 0.0 08/15/50	国債証券	0.0000	50	51	5,935	2050/08/15
DEUTSCHLAND 2.25 09/04/21	国債証券	2.2500	120	124	14,378	2021/09/04
DEUTSCHLAND 1.5 09/04/22	国債証券	1.5000	130	136	15,802	2022/09/04
BUNDESUBL 10/08/21	国債証券	0.0000	210	212	24,463	2021/10/08
BUNDESUBL 10/13/23	国債証券	0.0000	140	143	16,592	2023/10/13
小 計	—	—	7,770	9,557	1,102,507	—
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 6.0 01/31/29	国債証券	6.0000	180	260	30,032	2029/01/31
SPAIN 4.8 01/31/24	国債証券	4.8000	140	164	19,003	2024/01/31
SPAIN 4.2 01/31/37	国債証券	4.2000	210	305	35,202	2037/01/31
SPAIN 5.4 01/31/23	国債証券	5.4000	290	333	38,461	2023/01/31
SPAIN 1.6 04/30/25	国債証券	1.6000	230	245	28,323	2025/04/30
SPAIN 3.8 04/30/24	国債証券	3.8000	230	263	30,426	2024/04/30
SPAIN 1.5 04/30/27	国債証券	1.5000	170	181	20,944	2027/04/30
SPAIN 1.95 04/30/26	国債証券	1.9500	160	174	20,176	2026/04/30
SPAIN 1.4 04/30/28	国債証券	1.4000	200	211	24,452	2028/04/30
SPAIN 1.45 04/30/29	国債証券	1.4500	200	212	24,514	2029/04/30
SPAIN 0.4 04/30/22	国債証券	0.4000	130	131	15,155	2022/04/30
SPAIN 5.9 07/30/26	国債証券	5.9000	80	106	12,329	2026/07/30
SPAIN 4.9 07/30/40	国債証券	4.9000	130	210	24,279	2040/07/30
SPAIN 4.7 07/30/41	国債証券	4.7000	120	192	22,219	2041/07/30
SPAIN 3.45 07/30/66	国債証券	3.4500	90	137	15,866	2066/07/30
SPAIN 4.65 07/30/25	国債証券	4.6500	215	263	30,442	2025/07/30
SPAIN 1.95 07/30/30	国債証券	1.9500	280	310	35,824	2030/07/30
SPAIN 5.75 07/30/32	国債証券	5.7500	245	381	43,961	2032/07/30

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…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPAIN 2.35 07/30/33	国債証券	2.3500	160	185	21,401	2033/07/30
SPAIN 1.4 07/30/28	国債証券	1.4000	180	190	21,952	2028/07/30
SPAIN 1.85 07/30/35	国債証券	1.8500	30	32	3,793	2035/07/30
SPAIN 0.75 07/30/21	国債証券	0.7500	160	161	18,673	2021/07/30
SPAIN 0.25 07/30/24	国債証券	0.2500	250	251	28,993	2024/07/30
SPAIN 2.75 10/31/24	国債証券	2.7500	180	200	23,166	2024/10/31
SPAIN 5.15 10/31/28	国債証券	5.1500	220	299	34,602	2028/10/31
SPAIN 5.15 10/31/44	国債証券	5.1500	130	226	26,153	2044/10/31
SPAIN 2.9 10/31/46	国債証券	2.9000	70	90	10,420	2046/10/31
SPAIN 2.7 10/31/48	国債証券	2.7000	200	250	28,937	2048/10/31
SPAIN 2.15 10/31/25	国債証券	2.1500	230	253	29,194	2025/10/31
SPAIN 1.45 10/31/27	国債証券	1.4500	200	212	24,541	2027/10/31
SPAIN 1.3 10/31/26	国債証券	1.3000	210	221	25,572	2026/10/31
SPAIN 0.6 10/31/29	国債証券	0.6000	180	177	20,451	2029/10/31
SPAIN 4.4 10/31/23	国債証券	4.4000	230	265	30,583	2023/10/31
SPAIN 0.45 10/31/22	国債証券	0.4500	240	243	28,076	2022/10/31
小 計	-	-	6,170	7,352	848,134	-
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 5.75 02/01/33	国債証券	5.7500	150	209	24,166	2033/02/01
ITALY BTPS 4.0 02/01/37	国債証券	4.0000	270	329	38,002	2037/02/01
ITALY BTPS 2.7 03/01/47	国債証券	2.7000	150	151	17,471	2047/03/01
ITALY BTPS 3.45 03/01/48	国債証券	3.4500	130	148	17,158	2048/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/24	国債証券	4.5000	330	370	42,791	2024/03/01
ITALY BTPS 2.8 03/01/67	国債証券	2.8000	90	89	10,295	2067/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/25	国債証券	5.0000	390	456	52,607	2025/03/01
ITALY BTPS 5.0 03/01/22	国債証券	5.0000	155	166	19,258	2022/03/01
ITALY BTPS 4.5 03/01/26	国債証券	4.5000	180	209	24,205	2026/03/01
ITALY BTPS 1.65 03/01/32	国債証券	1.6500	320	308	35,547	2032/03/01
ITALY BTPS 3.5 03/01/30	国債証券	3.5000	230	262	30,226	2030/03/01
ITALY BTPS 0.95 03/15/23	国債証券	0.9500	220	220	25,422	2023/03/15
ITALY BTPS 1.35 04/15/22	国債証券	1.3500	160	161	18,671	2022/04/15
ITALY BTPS 1.2 04/01/22	国債証券	1.2000	160	161	18,614	2022/04/01
ITALY BTPS 1.35 04/01/30	国債証券	1.3500	240	228	26,372	2030/04/01
ITALY BTPS 6.0 05/01/31	国債証券	6.0000	310	429	49,544	2031/05/01
ITALY BTPS 1.85 05/15/24	国債証券	1.8500	240	245	28,342	2024/05/15
ITALY BTPS 1.45 05/15/25	国債証券	1.4500	130	130	15,047	2025/05/15
ITALY BTPS 1.6 06/01/26	国債証券	1.6000	110	110	12,730	2026/06/01
ITALY BTPS 1.5 06/01/25	国債証券	1.5000	190	190	22,033	2025/06/01
ITALY BTPS 2.2 06/01/27	国債証券	2.2000	220	227	26,254	2027/06/01
ITALY BTPS 0.45 06/01/21	国債証券	0.4500	60	60	6,923	2021/06/01
ITALY BTPS 2.1 07/15/26	国債証券	2.1000	210	216	24,992	2026/07/15
ITALY BTPS 1.0 07/15/22	国債証券	1.0000	140	140	16,236	2022/07/15

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	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ITALY BTPS 3.75 08/01/21	国債証券	3.7500	220	228	26,368	2021/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/34	国債証券	5.0000	150	199	23,069	2034/08/01
ITALY BTPS 5.0 08/01/39	国債証券	5.0000	170	234	27,059	2039/08/01
ITALY BTPS 4.75 08/01/23	国債証券	4.7500	190	212	24,517	2023/08/01
ITALY BTPS 2.05 08/01/27	国債証券	2.0500	180	184	21,295	2027/08/01
ITALY BTPS 0.9 08/01/22	国債証券	0.9000	180	180	20,818	2022/08/01
ITALY BTPS 2.95 09/01/38	国債証券	2.9500	160	169	19,581	2038/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/44	国債証券	4.7500	170	231	26,748	2044/09/01
ITALY BTPS 3.25 09/01/46	国債証券	3.2500	170	188	21,688	2046/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/28	国債証券	4.7500	210	258	29,763	2028/09/01
ITALY BTPS 5.0 09/01/40	国債証券	5.0000	200	276	31,873	2040/09/01
ITALY BTPS 2.45 09/01/50	国債証券	2.4500	130	123	14,252	2050/09/01
ITALY BTPS 4.75 09/01/21	国債証券	4.7500	330	348	40,159	2021/09/01
ITALY BTPS 3.75 09/01/24	国債証券	3.7500	160	176	20,353	2024/09/01
ITALY BTPS 3.85 09/01/49	国債証券	3.8500	80	97	11,278	2049/09/01
ITALY BTPS 5.5 09/01/22	国債証券	5.5000	170	188	21,703	2022/09/01
ITALY BTPS 2.25 09/01/36	国債証券	2.2500	170	169	19,534	2036/09/01
ITALY BTPS 1.45 09/15/22	国債証券	1.4500	160	162	18,735	2022/09/15
ITALY BTPS 2.3 10/15/21	国債証券	2.3000	320	327	37,816	2021/10/15
ITALY BTPS 2.45 10/01/23	国債証券	2.4500	340	356	41,078	2023/10/01
ITALY BTPS 9.0 11/01/23	国債証券	9.0000	80	101	11,732	2023/11/01
ITALY BTPS 7.25 11/01/26	国債証券	7.2500	60	80	9,317	2026/11/01
ITALY BTPS 6.5 11/01/27	国債証券	6.5000	300	399	46,132	2027/11/01
ITALY BTPS 5.25 11/01/29	国債証券	5.2500	290	374	43,149	2029/11/01
ITALY BTPS 5.5 11/01/22	国債証券	5.5000	130	144	16,694	2022/11/01
ITALY BTPS 1.45 11/15/24	国債証券	1.4500	110	110	12,786	2024/11/15
ITALY BTPS 0.35 11/01/21	国債証券	0.3500	70	69	8,047	2021/11/01
ITALY BTPS 2.0 12/01/25	国債証券	2.0000	130	133	15,433	2025/12/01
ITALY BTPS 2.5 12/01/24	国債証券	2.5000	107	112	12,992	2024/12/01
ITALY BTPS 2.8 12/01/28	国債証券	2.8000	140	151	17,425	2028/12/01
ITALY BTPS 2.15 12/15/21	国債証券	2.1500	140	143	16,538	2021/12/15
小 計	-	-	10,202	11,363	1,310,868	-
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.75 04/15/31	国債証券	0.7500	50	54	6,294	2031/04/15
FINLAND 1.375 04/15/47	国債証券	1.3750	20	25	2,966	2047/04/15
FINLAND 0.5 04/15/26	国債証券	0.5000	30	31	3,645	2026/04/15
FINLAND 1.125 04/15/34	国債証券	1.1250	60	68	7,935	2034/04/15
FINLAND 4.0 07/04/25	国債証券	4.0000	50	61	7,116	2025/07/04
FINLAND 2.75 07/04/28	国債証券	2.7500	30	37	4,308	2028/07/04
FINLAND 2.625 07/04/42	国債証券	2.6250	50	76	8,800	2042/07/04
FINLAND 0.5 09/15/29	国債証券	0.5000	80	84	9,780	2029/09/15
FINLAND 0.875 09/15/25	国債証券	0.8750	30	32	3,705	2025/09/15

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	
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FINLAND 0.5 09/15/27	国債証券	0.5000	30	31	3,655	2027/09/15
FINLAND 09/15/23	国債証券	0.0000	180	183	21,175	2023/09/15
小 計	—	—	610	688	79,386	—
(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	10	22	2,617	2062/01/26
AUSTRIA 1.5 02/20/47	国債証券	1.5000	20	26	3,003	2047/02/20
AUSTRIA 0.5 02/20/29	国債証券	0.5000	110	116	13,438	2029/02/20
AUSTRIA 0.75 02/20/28	国債証券	0.7500	80	86	9,934	2028/02/20
AUSTRIA 4.15 03/15/37	国債証券	4.1500	100	166	19,250	2037/03/15
AUSTRIA 2.4 05/23/34	国債証券	2.4000	80	105	12,211	2034/05/23
AUSTRIA 3.15 06/20/44	国債証券	3.1500	80	134	15,543	2044/06/20
AUSTRIA 6.25 07/15/27	国債証券	6.2500	85	124	14,406	2027/07/15
AUSTRIA 07/15/23	国債証券	0.0000	90	91	10,565	2023/07/15
AUSTRIA 3.5 09/15/21	国債証券	3.5000	175	184	21,304	2021/09/15
AUSTRIA 2.1 09/20/17	国債証券	2.1000	70	133	15,429	2117/09/20
AUSTRIA 1.65 10/21/24	国債証券	1.6500	100	109	12,653	2024/10/21
AUSTRIA 0.75 10/20/26	国債証券	0.7500	130	139	16,069	2026/10/20
AUSTRIA 1.2 10/20/25	国債証券	1.2000	90	98	11,309	2025/10/20
AUSTRIA 1.75 10/20/23	国債証券	1.7500	90	97	11,225	2023/10/20
AUSTRIA 1.5 11/02/86	国債証券	1.5000	30	43	4,999	2086/11/02
AUSTRIA 3.4 11/22/22	国債証券	3.4000	40	44	5,089	2022/11/22
小 計	—	—	1,380	1,725	199,054	—
合 計	—	—	—	—	15,005,413	—

■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 15,005,413	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	475,459	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	15,480,872	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、15,431,634千円、99.7%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、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1シンガポール・ドル=75.36円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シェケル=30.31円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1メキシコ・ペソ=4.45円、1マレーシア・リングギット=24.74円、1ポーランド・ズロチ=25.34円、1ユーロ=115.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	15,480,872,390円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	323,199,132
公 社 債(評価額)	15,005,413,244
未 収 利 息	89,155,011
前 払 費 用	17,539,340
差 入 委 託 証 拠 金	45,565,663
(B) 負 債	38,939,514
未 払 金	38,609,014
未 払 解 約 金	330,500
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	15,441,932,876
元 本	11,785,412,583
次 期 繰 越 損 益 金	3,656,520,293
(D) 受 益 権 総 口 数	11,785,412,583口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,103円

(注1) 期首元本額 18,254,512,323円
追加設定元本額 12,274,416,063円
一部解約元本額 18,743,515,803円

(注2) 期末における元本の内訳
動的パッケージファンド<DC年金> 39,087,251円
コア資産形成ファンド 33,367,045円
MHAM外国債券インデックスファンド(ファンドラップ) 576,006,932円
MHAM外国債券インデックスファンド<海軍ヘッジあり>(ファンドラップ) 1,007,380,708円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 6,849,775,170円
MHAM外国債券パッシブファンド [適格機関投資家限定] 3,279,795,477円
期末元本合計 11,785,412,583円

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	510,011,572円
受 取 利 息	509,903,840
そ の 他 収 益 金	185,535
支 払 利 息	△77,803
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	421,047,111
売 買 益	1,773,739,886
売 買 損	△1,352,692,775
(C) そ の 他 費 用	△5,421,271
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	925,637,412
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,821,798,286
(F) 解 約 差 損 益 金	△5,778,333,942
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,687,418,537
(H) 合 計(D+E+F+G)	3,656,520,293
次 期 繰 越 損 益 金(H)	3,656,520,293

(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。

MHAM TOPIXマザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2020年3月10日）

（計算期間 2019年3月12日～2020年3月10日）

MHAM TOPIXマザーファンドの第22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	1998年10月22日から無期限です。
運用方針	主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指して運用します。なお、TOPIX先物等を活用する方が有利と認められるときは、現物株への投資に代えてTOPIX先物等を活用することがあります。
主要投資対象	東京証券取引所第一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	株式の組入比率には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証株価指数(TOPIX)		株式組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	中率	(ベンチマーク)	期騰落			
18期 (2016年3月10日)	円	%	ポイント		%	%	百万円
18期 (2016年3月10日)	14,876	△9.6	1,352.17	△11.3	98.1	2.0	50,772
19期 (2017年3月10日)	17,690	18.9	1,574.01	16.4	97.7	2.3	47,445
20期 (2018年3月12日)	19,979	12.9	1,741.30	10.6	98.1	2.4	45,253
21期 (2019年3月11日)	18,549	△7.2	1,581.44	△9.2	97.9	2.1	39,607
22期 (2020年3月10日)	16,917	△8.8	1,406.68	△11.1	99.1	0.8	33,915

(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

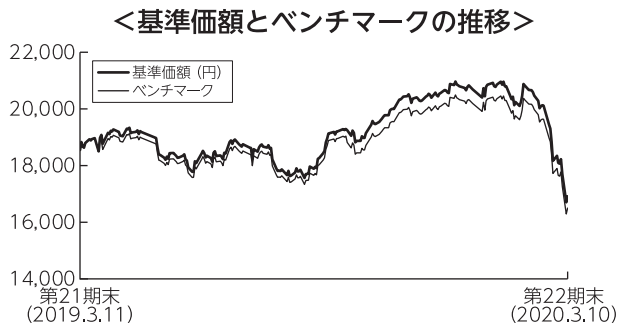
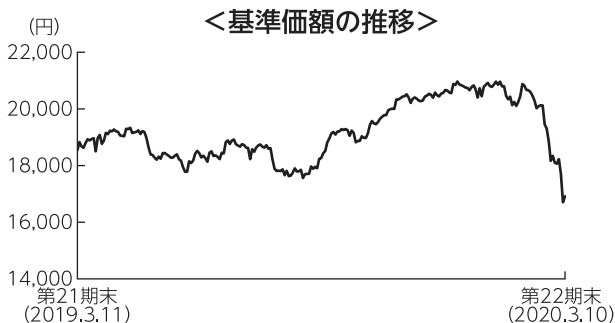
年 月 日	基 準 価 額		東証株価指数(TOPIX)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク) ポイント	騰 落 率		
(期 首) 2019年3月11日	18,549	—	1,581.44	—	97.9	2.1
3 月末	18,873	1.7	1,591.64	0.6	97.0	3.1
4 月末	19,185	3.4	1,617.93	2.3	97.7	2.3
5 月末	17,938	△3.3	1,512.28	△4.4	97.8	2.2
6 月末	18,428	△0.7	1,551.14	△1.9	97.7	2.3
7 月末	18,595	0.2	1,565.14	△1.0	98.1	2.0
8 月末	17,967	△3.1	1,511.86	△4.4	97.9	2.1
9 月末	19,051	2.7	1,587.80	0.4	97.5	2.5
10月末	20,004	7.8	1,667.01	5.4	97.6	2.3
11月末	20,393	9.9	1,699.36	7.5	97.7	2.3
12月末	20,688	11.5	1,721.36	8.8	98.5	1.5
2020年 1 月末	20,246	9.1	1,684.44	6.5	98.2	1.7
2 月末	18,165	△2.1	1,510.87	△4.5	92.0	1.0
(期 末) 2020年 3 月10日	16,917	△8.8	1,406.68	△11.1	99.1	0.8

(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（2019年3月12日から2020年3月10日まで）

基準価額等の推移



(注) ベンチマーク（東証株価指数（TOPIX））は、期首の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の推移

当ファンドの基準価額は16,917円となり、前期末比で8.8%下落しました。

基準価額の主な変動要因

期末にかけて新型コロナウイルスが世界的な拡散をみせたことで、世界景気や企業業績への先行き不安が急速に高まり、基準価額は下落しました。

投資環境

●国内株式市況

期初からほぼ横ばいの推移となっておりましたが、2019年5月には世界景気の後退懸念が広がり下落しました。その後、8月には米中貿易摩擦の激化が嫌気され再び下落しました。しかし、9月から2020年1月前半までは、欧米中央銀行の金融緩和姿勢や米中貿易協議の再開に向けて進展が見られたことなどを好感し、反発しました。ただ、期末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大を嫌気し、急落しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるＴＯＰＩＸ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。

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11.1%下落しました。当ファンドはベンチマークを2.3%上回りました。この差異は、主に保有株式の配当金によるものです。

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		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)	0.001% (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は19,220円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2019年3月12日から2020年3月10日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 8,046.9 (459.492)	千円 15,235,594 (-)	千株 8,319.512	千円 15,872,346

(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 14,986	百万円 15,534	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	31,107,941千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	43,949,010千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.70

(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 (2019年3月12日から2020年3月10日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株 式	15,235	5,658	37.1	15,872	53	0.3
株式先物取引	14,986	8,104	54.1	15,534	8,321	53.6

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株 式	147	144	289

(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 79

(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)	643千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	344千円
(B)/(A)	53.5%

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
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				鹿島建設	44.9	41.6	43,180	ユアテック	3.1	3.1	1,695
極洋	0.8	0.8	2,016	不動テトラ	1.3	1.5	1,927	四電工	0.3	0.3	632
日本水産	23.3	23.2	10,904	大末建設	0.7	0.6	483	中電工	2.4	2.1	4,481
マルハニチロ	3.4	3.3	6,906	鉄建建設	1.2	1.2	2,545	関電工	8.9	7.7	6,583
カネコ種苗	0.5	0.5	534	西松建設	4.1	4.1	8,335	きんでん	12.8	12.7	19,151
サカタのタネ	2.8	2.7	7,327	三井住友建設	13.9	12.8	6,156	東京エネシス	2.1	1.8	1,398
ホクト	1.9	1.7	2,935	大豊建設	1.3	1.2	2,505	トーエネック	0.6	0.5	1,476
ホクリヨウ	0.3	0.4	265	前田建設工業	13.8	13.4	11,095	住友電設	1.4	1.5	3,027
鉱業 (0.2%)				佐田建設	1.3	1.3	403	日本電設工業	3.3	2.9	5,939
住石ホールディングス	5.4	5.4	583	ナカノフード建設	1.5	1.5	547	協和エクシオ	7.5	8.1	18,119
日鉄鉱業	0.5	0.5	1,957	奥村組	3.2	2.9	6,638	新日本空調	1.6	1.4	2,350
三井松島ホールディングス	1	1	925	東鉄工業	2.3	2.3	6,026	九電工	3.8	3.7	10,067
国際石油開発帝石	92.8	91.2	66,831	イチケン	0.4	0.4	604	三機工業	4.4	3.9	4,668
石油資源開発	3.4	3	6,069	富士ピー・エス	0.8	0.8	309	日揮ホールディングス	16.6	16.4	17,433
K&Oエナジーグループ	1.1	1.2	1,893	浅沼組	0.7	0.6	2,481	中外炉工業	0.6	0.6	867
建設業 (2.7%)				戸田建設	22.3	22.1	12,442	ヤマト	1.8	1.8	1,002
ヒノキヤグループ	0.5	0.5	815	熊谷組	2.7	2.5	6,517	太平電業	1.3	1.4	3,140
ショーボンドホールディングス	1.7	3.6	12,780	青木あすなる建設	1	-	-	高砂熟学工業	4.9	4.6	7,350
ミライト・ホールディングス	6.6	6.9	9,211	北野建設	0.4	0.4	948	三見金属工業	0.2	0.2	416
タマホーム	1.2	1.4	1,576	植木組	0.2	0.3	673	朝日工業社	0.4	0.4	1,044
サンヨーホームズ	0.4	0.5	296	矢作建設工業	2.7	2.3	1,711	明星工業	3.6	3.5	2,464
日本アクア	0.7	1.1	621	ピーエス三菱	2.2	1.8	928	大気社	2.6	2.5	7,077
ファーストコーポレーション	0.7	0.8	341	日本ハウスホールディングス	3.8	3.7	1,121	ダイダシ	1.3	1.3	2,926
ベステラ	0.5	0.5	390	大東建託	6.8	6.4	64,032	日比谷総合設備	1.8	1.7	2,893
TATERU	2.9	5.3	699	新日本建設	2.3	2.2	1,639	東芝プラントシステム	4.2	-	-
スペースリユールホールディングス	2.9	2.9	1,183	NIPPPO	5.1	4.5	9,621	OSJBホールディングス	8.6	8.6	1,986
ダイセキ環境ソリューション	0.6	0.5	397	東亜道路工業	0.4	0.4	1,172	レイズネクスト	3.5	2.9	3,398
第一カッター興業	0.3	0.4	667	前田道路	6.1	5.6	14,481	食料品 (3.9%)			
安藤・間	14.9	13.7	9,576	日本道路	0.5	0.5	2,980	日本製粉	5.7	5	7,845
東急建設	6.8	6.7	4,053	東亜建設工業	1.8	1.7	2,446	日清製粉グループ本社	19.3	19.3	32,250
コムシスホールディングス	8.3	8.2	22,189	日本国土開発	-	3.9	1,899	日東富士製粉	0.1	0.1	538
ミサワホーム	2	-	-	若築建設	1	1	1,245	昭和産業	1.5	1.5	4,441
ビアールホールディングス	2	2.5	1,067	東洋建設	7.2	6.1	2,610	鳥越製粉	1.4	1.4	988
高松コンストラクショングループ	1.5	1.5	3,309	五洋建設	23	21.3	10,756	中部飼料	2.1	2	2,618
東建コーポレーション	0.7	0.7	4,690	世紀東急工業	2.8	2.5	1,912	フィード・ワン	11.9	12.3	1,771
ソネック	0.3	0.3	174	福田組	0.6	0.6	2,124	東洋精糖	0.2	0.2	218
ヤマウラ	1	1.1	946	住友林業	13.8	13.5	19,237	日本甜菜製糖	0.9	0.8	1,256
大成建設	19.1	17.7	58,941	日本基礎技術	2.4	2.1	745	三井製糖	1.3	1.5	2,709
大林組	57.5	53.1	51,984	巴コーポレーション	2.6	2.5	770	塩水港精糖	2.2	2	394
清水建設	58.7	54.1	46,255	大和ハウス工業	53	52.5	145,425	日新製糖	0.8	0.7	1,290
飛鳥建設	1.7	1.5	1,585	ライト工業	3.7	3.1	3,754	森永製菓	4.3	4	16,680
長谷工コーポレーション	23.9	20.6	26,512	積水ハウス	58.6	58.2	111,511	中村屋	0.4	0.5	1,742
松井建設	2.1	2	1,194	日特建設	1.7	1.5	1,095	江崎グリコ	5.2	5.1	21,318
銭高組	0.2	0.2	599	北陸電気工事	0.9	0.9	816	名糖産業	0.8	0.8	947

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
井村屋グループ	0.7	0.7	1,098	イトアンド	0.6	0.6	984	マツオカコーポレーション	0.5	0.5	835
不二家	1	1.1	1,991	大冷	0.2	0.2	329	ワールド	1.7	2.4	4,272
山崎製パン	14.1	12.8	21,824	ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.5	1	889	三陽商会	1.1	1	1,298
第一屋製パン	0.5	0.5	419	日清食品ホールディングス	7.3	7.2	58,680	ナイガイ	0.8	1	367
モロゾフ	0.3	0.3	1,410	永谷園ホールディングス	0.9	0.8	1,586	オンワードホールディングス	10.4	10.4	4,867
亀田製菓	1.1	1	4,440	一正蒲鉾	0.7	0.7	522	ルックホールディングス	0.6	0.6	478
寿スピリッツ	1.8	1.6	7,888	フジッコ	1.9	1.8	3,137	ゴールドウイン	1.5	3	19,890
カルビー	7.8	7.8	20,521	ロック・フィールド	1.9	1.9	2,319	デサント	4.1	3.3	3,844
森永乳業	3.5	3.2	11,776	日本たばこ産業	98.8	98	206,143	キング	0.8	0.8	368
六甲バター	1.3	1.2	1,454	ケンコーマヨネーズ	1	1	1,959	ヤマトインターナショナル	1.2	1	344
ヤクルト本社	12.7	11.7	60,723	からやまホールディングス	1.2	1.3	2,064	パルプ・紙 (0.2%)			
明治ホールディングス	12.1	11.3	74,806	なとり	1	1	1,558	特種東海製紙	1	1	3,555
雪印メグミルク	4.1	4.2	8,542	イフジ産業	0.3	0.1	76	王子ホールディングス	75.7	69.5	31,831
プリマハム	2.4	2.6	5,478	ピックルスコーポレーション	0.4	0.4	820	日本製紙	8.1	7.6	11,096
日本ハム	7.4	6.6	25,608	北の達人コーポレーション	6.7	5.9	2,932	三菱製紙	3.3	2.5	855
丸大食品	1.9	1.8	3,031	ユーグレナ	7.3	7.3	5,212	北越コーポレーション	11.3	11	4,224
S Foods	1.5	1.5	3,237	ミヨシ油脂	0.6	0.6	568	中越パルプ工業	0.7	0.7	826
伊藤ハム米久ホールディングス	11.1	11.2	6,328	理研ビタミン	0.8	0.8	2,892	大王製紙	8.2	7.3	10,147
サッポロホールディングス	6.3	5.8	11,924	繊維製品 (0.5%)				阿波製紙	0.5	0.7	322
Aサヒグループホールディングス	35.9	35.6	131,399	片倉工業	2.1	2.4	2,541	レンゴー	17.4	15.7	12,104
キリンホールディングス	77.5	72.1	147,372	グンゼ	1.1	1.3	4,582	トーモク	0.9	1	1,506
宝ホールディングス	12.9	12.7	9,893	東洋紡	7.2	6.6	8,071	ザ・パック	1.2	1.3	4,134
オエノンホールディングス	5.2	4.8	1,718	ユニチカ	5.3	5.6	1,400	化学 (7.4%)			
養命酒製造	0.5	0.5	911	富士紡ホールディングス	0.9	0.8	2,098	クラレ	28.3	26.3	27,667
カ・コ・ホ・フ・グ・パルホールディングス	13.2	12	24,540	倉敷紡績	1.6	1.6	2,875	旭化成	119	109.9	86,897
サントリー食品インターナショナル	11.5	11.4	45,429	シキボウ	0.9	0.9	906	共和レザー	0.9	0.6	385
ダイドールホールディングス	1	1	3,090	日本毛織	5.5	5.5	4,603	昭和電工	11.1	11.8	23,080
伊藤園	5.2	5.2	23,868	トーア紡コーポレーション	0.8	0.7	291	住友化学	131.8	121.9	40,836
キーコーヒー	1.8	1.8	3,801	グアイトーリミテッド	2.9	3.1	589	住友精化	0.8	0.7	1,861
ユニカフェ	0.6	0.6	479	帝国繊維	1.9	1.8	3,025	日産化学	10.3	9.3	39,199
ジャパンフーズ	0.3	0.2	214	帝人	13.7	13.6	22,943	ラサ工業	0.6	0.6	697
日清オイリオグループ	2.2	2.2	7,029	東レ	130.1	120.7	65,129	クレハ	1.6	1.5	6,952
不二製油グループ本社	4.2	4.2	10,096	サカイオーベックス	0.4	0.4	673	多木化学	0.5	0.5	1,712
かどや製油	0.2	0.2	678	住江織物	0.5	0.4	711	テイカ	1.4	1.2	1,670
J-オイルミルズ	0.9	0.9	3,316	日本フェルト	0.7	0.7	277	石原産業	3.4	3.1	1,897
キッコーマン	11.3	12.3	57,933	イチカフ	0.2	0.2	242	片倉コープアグリ	0.5	0.4	395
味の素	37.9	37.7	65,861	日東製網	0.2	0.2	281	日東エフシー	1	-	-
キューピー	9.6	9.6	18,403	アツギ	1.4	1.3	828	日本曹達	2.7	2.5	6,697
ハウス食品グループ本社	6.5	6.4	20,736	ダイニツク	0.7	0.5	314	東ソー	25.8	25.7	33,204
カゴメ	6.9	6.5	14,826	セーレン	4.1	4.1	5,166	トクヤマ	4.9	4.8	11,193
焼津水産化学工業	0.7	0.7	627	ソトー	0.6	0.5	445	セントラル硝子	3.7	3.4	6,259
アリアケジャパン	1.6	1.6	10,400	東海梁工	0.2	0.3	334	東亜合成	10.5	10.4	9,838
ピエトロ	0.2	0.2	311	小松マテーレ	2.8	2.6	1,697	大阪ソーダ	1.8	1.7	4,129
エバラ食品工業	0.4	0.4	806	ワコールホールディングス	4.8	4.4	10,432	関東電化工業	4	4	3,360
やまみ	-	0.2	366	ホギメディカル	2.1	1.8	5,238	デンカ	6.6	6	14,208
ニチレイ	8.9	8.2	22,820	クラウディアホールディングス	0.6	0.5	174	信越化学工業	29.5	28.5	321,337
東洋水産	8.8	8.8	36,696	T S Iホールディングス	6.2	5.7	2,074	日本カーバイド工業	0.6	0.5	505

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
堺化学工業	1.2	1.1	1,923	扶桑化学工業	1.7	1.7	4,736	タカラバイオ	4.5	4.5	8,415
第一稀元素化学工業	1.4	1.8	1,270	トリケミカル研究所	0.4	0.4	3,404	J C U	2.2	2	4,584
エア・ウォーター	13.8	15.6	20,607	A D E K A	8.2	7.6	9,902	新田ゼラチン	1.2	1.1	550
大陽日酸	13.8	16	30,304	日油	6.5	6.2	20,677	○ A T アグリオ	0.2	0.4	423
日本化学工業	0.6	0.5	1,099	新日本理化	3.4	2.9	423	デクセリアルズ	4.4	4.5	3,141
東邦アセチレン	0.2	0.2	237	ハリマ化成グループ	1.3	1.4	1,311	アース製薬	1.3	1.4	7,210
日本パーカライジング	9.1	8.4	7,963	花王	41.5	40.6	328,210	北興化学工業	1.6	1.5	781
高圧ガス工業	2.6	2.4	1,425	第一工業製薬	0.6	0.6	2,043	大成ラミック	0.5	0.5	1,179
チタン工業	0.2	0.3	518	石原ケミカル	0.4	0.5	813	クミアイ化学工業	7.2	7.1	4,877
四国化成工業	2.8	2.5	2,512	日華化学	0.6	0.6	378	日本農薬	4.4	3.3	1,514
戸田工業	0.4	0.5	725	ニイタカ	0.3	0.3	631	アキレス	1.3	1.2	1,699
ステラ ケミファ	1	0.9	2,288	三洋化成工業	1.1	1	4,185	有沢製作所	2.7	2.7	2,135
保土谷化学工業	0.6	0.6	1,938	有機合成薬品工業	2	1.8	442	日東電工	12.9	11.7	59,202
日本触媒	2.8	2.5	13,050	大日本塗料	1.9	1.8	1,440	レック	1.8	1.8	1,731
大日精化工業	1.4	1.4	2,986	日本ペイントホールディングス	13.8	13.7	69,048	三光合成	1.7	2.1	556
カネカ	4.5	4.4	11,382	関西ペイント	18.9	18.7	42,018	きもと	3.7	3.4	438
三菱瓦斯化学	17.2	15.5	21,049	神東塗料	1.6	1.6	236	藤森工業	1.5	1.5	3,798
三井化学	15.2	15	33,915	中国塗料	5.6	4.8	4,128	前澤化成工業	1.1	1.1	1,080
J S R	16.9	15.6	27,674	日本特殊塗料	1.3	1.2	1,106	未来工業	-	0.9	1,519
東京応化工業	2.9	2.8	10,472	藤倉化成	2.3	1.9	784	ウェーブロックホールディングス	0.4	0.6	325
大阪有機化学工業	1.5	1.5	2,160	太陽ホールディングス	1.4	1.3	5,037	J S P	1	1	1,439
三菱ケミカルホールディングス	111.7	110.7	71,899	D I C	7.6	7	16,415	エフピコ	1.4	1.8	11,448
K H ネオケム	2.6	2.9	4,895	サカタインクス	3.8	3.7	3,119	天馬	1.2	1.1	1,688
ダイセル	26.1	22.9	18,663	群インキSCホールディングス	3.5	3.5	6,618	信越ポリマー	3.2	3.1	2,464
住友ベークライト	2.9	2.6	7,397	T & K T O K A	1.3	1.3	908	東リ	4.2	4.3	1,066
積水化学工業	36.6	35.7	50,694	富士フィルムホールディングス	35.5	32.5	162,012	ニフコ	6.9	6.2	13,912
日本ゼオン	15.2	15	13,605	資生堂	33.9	33.7	218,510	バルカー	1.4	1.4	2,571
アイカ工業	5	5	14,990	ライオン	23.8	22	42,614	ユニ・チャーム	36.2	32.7	116,281
宇部興産	8.5	8.4	14,355	高砂香料工業	1.2	1.1	2,065	ジョーエイコーポレーション	-	0.2	149
積水樹脂	2.8	2.9	5,721	マンダム	3.9	3.8	8,249	医薬品 (6.4%)			
タキロンシーアイ	3.7	3.5	1,921	ミルボン	2.1	2.3	11,960	協和キリン	21.4	17.1	41,347
旭有機材	1.2	1	1,311	ファンケル	7.6	6.9	18,319	武田薬品工業	148.6	140.8	529,267
日立化成	7.8	7.7	34,996	コーセー	2.9	3.2	42,048	アステラス製薬	157.4	148.9	244,940
ニチバン	0.9	0.9	1,303	コタ	0.8	0.9	1,181	大日本住友製薬	12.7	12.7	18,453
リケンテクノス	4.8	4.1	1,525	シーボン	0.2	0.3	630	塩野義製薬	22.3	21.7	117,635
大倉工業	0.9	0.7	941	ポーラ・オルビスホールディングス	7.3	7.3	14,811	田辺三菱製薬	17.9	-	-
積水化成成品工業	2.5	2.3	1,219	ノエビアホールディングス	1.1	1.6	7,312	わかもと製薬	2.8	3.2	707
群栄化学工業	0.4	0.4	903	アジパンコスメジャパン	0.6	0.5	464	あすか製薬	2.2	1.9	1,793
タイガースポリマー	0.8	0.9	421	エステー	1.3	1.2	1,610	日本新薬	4.5	4.5	32,850
ミライアル	0.5	0.6	555	アグロ カネシヨウ	0.7	0.5	604	ピオフェルミン製薬	0.3	0.3	671
ダイキアクシス	0.6	0.6	413	コニシ	3	2.7	3,553	中外製薬	17.8	17.7	198,682
ダイキョーニシカワ	3.5	3.5	1,844	長谷川香料	2.1	2.2	4,166	科研製薬	3.1	2.9	14,007
竹本容器	0.6	0.7	432	星光PMC	1.2	1.1	767	エーザイ	20.4	20.3	160,735
森六ホールディングス	0.9	0.7	1,117	小林製薬	4.8	4.7	38,446	ロート製薬	8.8	8.7	24,351
日本化薬	10.8	10.4	11,200	荒川化学工業	1.5	1.5	1,701	小野薬品工業	40.3	39	83,226
カーリットホールディングス	1.9	2	890	メック	1.2	1.2	1,446	久光製薬	5	4.5	19,935
日本精化	1.3	1.3	1,617	日本高純度化学	0.5	0.5	1,129	持田製薬	1.3	2.3	8,337

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
参天製薬	32.4	31.6	52,993	AGC	16.9	16.7	48,162	日本冶金工業	14.4	1.5	2,335
扶桑薬品工業	0.6	0.5	819	日本板硝子	8.4	8.3	3,494	山陽特殊製鋼	2.1	1.3	1,231
日本ケミファ	0.2	0.3	612	石塚硝子	-	0.4	781	愛知製鋼	0.9	0.9	2,475
ツムラ	5.3	5.3	13,610	日本山村硝子	0.8	0.7	646	日立金属	18.3	18.1	23,530
日医工	4.5	4.9	5,184	日本電気硝子	7.4	6.8	10,587	日本金属	0.4	0.4	262
キッセイ薬品工業	3	3	7,329	オハラ	0.7	0.8	736	大平洋金属	1.2	1.2	2,049
生化学工業	3.4	3.3	3,352	住友大阪セメント	3.5	3.2	11,344	新日本電工	10.6	11.6	1,577
栄研化学	3	3	5,400	太平洋セメント	10.8	10.7	23,925	栗本鐵工所	0.9	0.8	1,325
日水製薬	0.7	0.6	711	日本ヒューム	1.8	1.8	995	虹 技	0.2	0.2	200
鳥居薬品	0.9	1.1	3,128	日本コンクリート工業	3.9	3.9	858	日本鑄鉄管	0.3	-	-
J C R ファーマ	1.2	1.2	10,692	三谷セキサン	0.8	0.8	2,884	三菱製鋼	1.3	1.3	985
東和薬品	0.8	2.2	4,516	アジアパイルホールディングス	2.5	2.4	948	日亜鋼業	2.5	2.3	547
富士製薬工業	1.2	1.2	1,218	東海カーボン	15.6	17.7	15,487	日本精線	0.2	0.3	853
沢井製薬	3.5	3.5	19,110	日本カーボン	0.8	0.9	2,898	エンビプロ・ホールディングス	0.5	0.7	375
ゼリア新薬工業	3.4	3.1	5,226	東洋炭素	1	1	1,454	シンニッタ	2.5	2.5	672
第一三共	48.9	48.5	308,217	ノリタケカンパニーリミテド	1	1	3,420	新家工業	0.3	0.4	451
キョーリン製薬ホールディングス	3.8	3.7	7,422	TOTO	13.2	12.2	47,397	非鉄金属 (0.7%)			
大幸薬品	0.8	0.7	2,999	日本碍子	20.9	20.7	30,946	大紀アルミニウム工業所	2.8	2.7	1,493
ダイト	1	1	2,677	日本特殊陶業	14.4	13.2	20,182	日本軽金属ホールディングス	46.2	42.6	6,901
大塚ホールディングス	32.5	32.3	122,094	MARUWA	0.6	0.6	3,996	三井金属鉱業	4.6	4.6	9,857
大正製薬ホールディングス	3.8	3.5	21,490	品川リフラクトリーズ	0.4	0.5	1,177	東邦亜鉛	1	0.9	1,255
ペプチドリーム	8.5	8.6	38,614	黒崎播磨	0.3	0.4	1,908	三菱マテリアル	11.2	11.1	23,310
石油・石炭製品 (0.5%)				ヨータイ	1.5	1.4	831	住友金属鉱山	23.1	21.4	50,536
日本コークス工業	15.5	14.9	864	イソライト工業	0.9	0.9	453	DOWAホールディングス	4	4.3	12,590
昭和シェル石油	15.9	-	-	東京窯業	2.2	2.1	522	古河機械金属	2.9	2.9	3,120
ニチレキ	2.2	1.9	2,302	ニッカトナー	0.8	0.8	396	大塚チタニウムテクノロジーズ	2	1.8	1,708
ユシロ化学工業	0.8	0.9	1,004	フジインコーポレーテッド	1.5	1.5	3,763	東邦チタニウム	3.1	3.1	2,011
ビービー・カストロール	0.6	0.6	694	クニミネ工業	0.6	0.8	764	UACJ	2.6	2.5	3,950
富士石油	4.5	4.7	850	エーアンドエーマテリアル	0.3	0.3	333	CKサンエツ	0.3	0.4	979
MORESCO	0.6	0.6	579	ニチアス	4.7	4.6	9,080	古河電気工業	4.9	5.3	10,425
出光興産	13.2	19.1	46,374	ニチハ	2.4	2.3	4,830	住友電気工業	63	62.6	73,210
JXTGホールディングス	286.6	254.9	94,440	鉄鋼 (0.6%)				フジクラ	20.7	20.8	5,948
コスモエネルギーホールディングス	5	4.9	7,129	日本製鉄	78.2	75.4	77,096	昭和電線ホールディングス	2.3	2	1,872
ゴム製品 (0.7%)				神戸製鋼所	31.2	31.8	10,875	東京特殊電線	0.2	0.3	657
横浜ゴム	10	9.8	15,474	中山製鋼所	2.5	2.2	807	タツタ電線	3.5	3.4	1,570
TOYO TIRE	8.8	9.7	13,182	合同製鐵	0.8	0.9	1,989	カナレ電気	0.2	0.3	455
ブリヂストン	52.3	48.7	159,297	ジェイエーホールディングス	45.5	45.6	36,662	平河ヒューテック	0.7	0.6	520
住友ゴム工業	15.5	15.4	15,569	東京製鐵	9.1	8.2	5,075	リョービ	2.1	2	2,474
藤倉コンポジット	1.6	1.6	569	共英製鋼	1.9	1.8	2,570	アーレスティ	2.1	2.3	867
オカモト	1.2	1.1	3,745	大和工業	3.6	3.5	7,087	アサヒホールディングス	3.2	2.9	6,907
フコク	0.8	0.9	499	東京鐵鋼	0.7	0.6	661	金属製品 (0.6%)			
ニッタ	1.9	1.8	3,774	大阪製鐵	1.1	0.8	1,102	稲葉製作所	1	0.9	988
住友理工	3.5	3.5	2,271	淀川製鋼所	2.2	2.1	3,559	宮地エンジニアリンググループ	0.5	0.5	817
三ツ星ベルト	2.2	2.2	3,071	丸一鋼管	6	5.4	12,717	トーカロ	4.3	4.7	4,234
バンダー化学	3.2	2.8	1,722	モリ工業	0.5	0.5	1,009	アルファ	0.6	0.5	472
ガラス・土石製品 (0.8%)				大同特殊鋼	2.8	2.7	8,923	SUMCO	18.7	20.1	30,833
日東紡績	2.6	2.5	9,512	日本高周波鋼業	0.9	0.7	223	川田テクノロジーズ	0.4	0.4	2,088

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
RS Technologies	0.3	0.5	1,118	F U J I	5.1	7.2	11,685	日工	0.5	2.4	1,478
信和	-	0.7	599	牧野フライス製作所	2	1.9	6,061	巴工業	0.7	0.7	1,215
東洋製鋼グループホールディングス	10.9	10.7	16,264	オーエスジー	8.3	7.7	11,388	井関農機	1.8	1.8	1,866
ホクサンホールディングス	0.8	0.8	1,117	ダイジェット工業	0.2	0.2	194	TOWA	1.6	1.8	1,434
コcona	0.9	0.8	740	旭ダイヤモンド工業	4.7	4.6	2,180	丸山製作所	0.4	0.5	650
横河ブリッジホールディングス	3.2	3.1	5,623	DMG森精機	10.8	10.6	12,041	北川鉄工所	0.7	0.7	1,118
駒井ハルテック	0.3	0.3	426	ソディック	3.7	4	2,588	ローツェ	0.8	0.7	2,180
高田機工	0.1	0.1	239	ディスク	2.3	2.3	49,542	タカキタ	0.6	0.5	204
三和ホールディングス	17.4	16.1	14,312	日東工器	0.9	0.9	1,689	クボタ	91.5	89.8	119,478
文化シャッター	5	4.9	3,645	日進工具	0.5	0.5	1,262	荏原実業	0.5	0.5	969
三協立山	2.4	2.3	2,346	パンチ工業	1.2	1.8	657	三菱化工機	0.6	0.6	937
アルインコ	1.3	1.2	1,092	富士ダイス	0.7	0.6	336	月島機械	3.4	3.1	3,720
東洋シャッター	0.4	0.5	271	豊和工業	1.1	1.1	646	帝国電機製作所	1.2	1.5	1,792
L I X I Lグループ	25.1	24.9	33,664	OKK	0.7	0.9	404	東京機械製作所	-	0.9	190
日本フィルコン	1.3	1.3	566	東洋機械金属	1.3	1.4	592	新東工業	4	3.9	2,714
ノーリツ	3.8	3.6	3,837	津田駒工業	0.4	0.5	382	澁谷工業	1.5	1.5	3,463
長府製作所	1.7	1.6	3,131	島精機製作所	2.3	2.7	4,409	アイチコーポレーション	3	2.9	1,673
リンナイ	3	3.3	22,176	オプトラン	1.6	1.8	4,676	小森コーポレーション	4.7	4.4	3,278
ダイニチ工業	0.8	0.9	516	NCホールディングス	0.7	0.5	245	鶴見製作所	1.3	1.3	2,050
日東精工	2.3	2.2	992	イワキ	-	0.8	731	住友精密工業	0.3	0.3	737
三洋工業	0.2	0.2	335	フリュー	1.4	1.7	1,496	日本ギア工業	-	0.5	133
岡部	3.4	3.4	2,346	ヤマシンフィルタ	3	3.7	2,386	酒井重工業	0.3	0.4	917
ジーテクト	1.9	2	2,270	日阪製作所	2.1	1.9	1,400	荏原製作所	7.6	7	15,512
中国工業	0.7	-	-	やまびこ	3.3	3.2	2,480	石井鐵工所	0.3	0.2	460
東プレ	3.1	3.1	3,968	平田機工	0.8	0.8	3,640	西島製作所	1.8	1.7	1,167
高周波熱錬	3.1	3.1	1,872	ベガサスミシン製造	1.6	1.7	598	北越工業	1.7	1.7	1,745
東京製綱	1.1	1.3	825	マルマエ	0.5	0.7	469	ダイキン工業	23.3	21.6	287,712
サンコール	1	0.9	403	タツモ	0.5	0.8	834	オルガノ	0.6	0.6	3,228
モリテックスチール	1.6	1.6	395	ナブテスコ	9.3	9.9	25,294	トーヨーカネツ	0.7	0.7	1,374
パイオラックス	2.7	2.4	3,446	三井海洋開発	1.8	1.8	2,565	栗田工業	9.3	9.1	23,141
エイチワン	1.7	1.7	914	レオン自動機	1.7	1.6	1,736	椿本チエイン	2.2	2.4	6,230
日本発条	16.9	18	12,618	SMC	5	5.4	215,352	大同工業	0.8	0.8	516
中央発條	0.1	0.1	247	ヤマモーターロブティクスホールディングス	1.8	1.8	1,348	木村化工機	1.6	1.6	700
アドバネクス	0.3	0.3	331	ホンカワミクロン	0.6	0.6	2,646	アネスト岩田	2.6	2.6	2,597
立川ブラインド工業	0.7	0.7	706	ユニオンツール	0.7	0.6	1,431	ダイフク	9.4	8.7	49,851
三益半導体工業	1.6	1.4	2,597	オイレス工業	2.4	2.1	2,677	サムコ	0.5	0.5	779
機械 (4.9%)				日精工・エス・ピー機械	0.5	0.5	1,602	加藤製作所	0.9	1	1,107
日本ドライケミカル	0.5	0.5	693	サトーホールディングス	2.1	2.4	5,277	油研工業	0.3	0.3	412
日本製鋼所	5.2	5.2	6,697	技研製作所	1.2	1.5	4,950	タダノ	8.4	8.3	6,266
三浦工業	7.3	7.3	22,703	日本エアータック	0.6	0.5	367	フジテック	6.2	6.1	7,753
タクマ	6.2	5.6	6,339	カワタ	0.3	0.5	394	C K D	4.8	4.8	7,238
ツガミ	3.9	3.6	2,822	日精樹脂工業	1.4	1.5	1,306	キトー	1.3	1.3	1,493
オークマ	2.2	1.9	7,429	オカダアイオン	0.6	0.5	411	平和	4.8	4.7	9,009
東芝機械	2	1.9	5,023	ワイエイシイホールディングス	0.7	0.8	347	理想科学工業	1.5	1.5	2,199
アマダホールディングス	26	21.3	18,829	小松製作所	77.3	76.6	145,540	SANKYO	4.3	3.7	12,358
アイダエンジニアリング	4.7	4.5	3,190	住友重機械工業	9.8	9.6	20,342	日本金銭機械	2	2	1,226
滝澤鉄工所	0.5	0.5	536	日立建機	6.9	6.8	16,598	マースグループホールディングス	1.1	1.1	1,834

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
フクシマガリレイ	1.1	1.1	3,723	明電舎	3.4	3.1	4,910	エレコム	1.6	1.8	6,444
オーイズミ	0.9	0.8	295	オリジン	0.5	0.5	626	パナソニック	195.2	193.4	171,352
ダイコク電機	0.8	0.8	912	山洋電気	0.8	0.8	3,196	シャープ	17	19.7	22,083
竹内製作所	2.9	2.8	3,886	デンヨー	1.6	1.5	2,653	アンリツ	11.1	11	19,129
アマノ	4.9	4.5	10,917	東芝テック	2.2	2.1	7,854	富士通ゼネラル	5.3	4.6	8,979
JUKI	2.4	2.5	1,435	芝浦メカトロニクス	0.3	0.3	791	ソニー	114.6	107	686,833
蛇の目マシン工業	1.7	1.6	449	マブチモーター	4.7	4.7	16,379	TDK	9	8.2	79,458
マックス	2.6	2.5	3,902	日本電産	20.6	20.4	261,018	帝国通信工業	0.6	0.6	630
グローリー	4.8	4.4	11,290	ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1	-	-	タムラ製作所	6.8	5.8	2,395
新晃工業	1.6	1.6	2,240	トレックス・セミコンダクター	0.6	1	1,075	アルプスアルパイン	17.8	15.1	20,294
大和冷機工業	2.5	2.4	2,155	東光高岳	0.9	1	992	池上通信機	0.6	0.5	410
セガサミーホールディングス	17	16.8	22,680	ダブル・スコープ	2.5	2.7	1,679	日本電波工業	2.3	-	-
日本ピストンリング	0.6	0.5	588	ダイヘン	1.9	1.8	4,590	鈴木	1	0.9	610
リケン	0.8	0.7	1,985	ヤーマン	2.5	2.8	1,327	日本トリム	0.3	0.3	858
TPR	2.3	2.2	2,783	JVCケンウッド	13.4	14.3	2,945	ローランド ディー・ジー	0.9	1	1,412
ツバキ・ナカシマ	2.6	3.5	2,772	ミマキエンジニアリング	1.6	1.6	608	フォスター電機	2.1	1.8	2,194
ホシザキ	5	5	41,750	第一精工	0.8	0.7	1,302	SMK	0.6	0.5	1,084
大豊工業	1.4	1.4	753	日新電機	4	4	4,008	ヨコオ	1.3	1.2	2,888
日本精工	35.1	32	22,528	大崎電気工業	3.5	3.5	1,711	ホシデン	5.1	4.7	3,821
NTN	37.2	40.4	8,362	オムロン	18.2	15.2	81,168	ヒロセ電機	2.5	2.6	27,742
ジェイテクト	16.5	16.4	14,120	日東工業	2.8	2.5	4,417	日本航空電子工業	4	3.9	5,713
不二越	1.6	1.6	4,960	IDEC	2.3	2.4	3,328	TOA	1.9	1.8	1,431
日本トムソン	5.3	5.3	1,833	正興電機製作所	0.3	0.5	529	マクセルホールディングス	3.7	3.7	4,306
THK	10.7	9.9	20,453	不二電機工業	0.3	0.3	295	古野電機	2.2	2.3	1,856
ユーシン精機	1.4	1.4	1,113	ジーエス・ユア コーポレーション	6.2	5.6	9,016	ユニデンホールディングス	0.5	0.5	848
前澤給装工業	0.6	0.5	956	サクサホールディングス	0.4	0.4	601	スミダコーポレーション	1.5	1.4	1,215
イーグル工業	2.1	2.1	1,524	メルコホールディングス	0.7	0.6	1,227	アイコム	1	0.9	2,071
前澤工業	1.3	1.1	334	テクノメディカ	0.4	0.4	740	リオン	0.8	0.7	1,533
日本ピラー工業	1.7	1.7	2,026	日本電気	22.1	20.6	81,782	本多通信工業	1.5	1.6	617
キッツ	7	6.9	3,919	富士通	16.5	16.3	173,676	船井電機	2	1.8	955
マキタ	20.8	22.1	72,377	沖電気工業	7.5	6.9	7,638	横河電機	17.1	15.6	22,401
日立造船	14.4	14.1	4,864	岩崎通信機	1	0.8	588	新電元工業	0.6	0.6	1,688
三菱重工業	28.6	28.4	85,029	電気興業	0.9	0.8	1,986	アズビル	11	10.7	26,931
IHI	13.2	12.3	21,205	サンケン電気	2.1	1.8	4,217	東亜ディーケーケー	0.9	0.9	765
スター精密	3	2.6	2,844	ナカヨ	0.3	0.3	397	日本光電工業	7.6	7	22,260
電気機器 (14.5%)				アイホン	1	0.9	1,269	チノール	0.6	0.5	521
日清紡ホールディングス	9.7	11.5	8,533	ルネサスエレクトロニクス	17.9	81.1	43,712	共和電業	1.8	1.6	584
イビデン	10.6	10.5	23,761	セイコーエプソン	21.2	21	27,216	日本電子材料	0.8	0.8	649
コニカミノルタ	37.5	37.3	19,433	ワコム	12.5	11.6	3,561	堀場製作所	3.4	3.4	17,476
ブラザー工業	22.2	20.7	34,983	アルバック	3.4	3.1	8,624	アドバンテスト	11.7	12.7	60,833
ミネベアミツミ	31.8	31.5	54,243	アクセル	1.2	0.8	490	小野測器	1	0.7	305
日立製作所	76.9	81.3	272,517	EIZO	1.6	1.4	4,529	エスベック	1.5	1.5	2,650
三菱電機	170.7	169.3	212,979	日本信号	4.4	4.4	4,760	キーエンス	8.4	15.4	503,426
富士電機	11.1	10.2	25,867	京三製作所	3.7	4.1	1,750	日置電機	0.9	0.9	2,558
東洋電機製造	0.7	0.6	630	能美防災	2.3	2.2	4,210	シスメックス	13.3	12.1	80,573
安川電機	19.8	18.3	54,442	ホーチキ	1.1	1.3	1,504	日本マイクロニクス	2.8	2.9	2,340
シンフォニア テクノロジー	2.4	2.2	2,156	星和電機	0.8	1	473	メガチップス	1.4	1.6	2,131

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
OBARA GROUP	1	0.9	2,428	象印マホービン	3.2	5	7,660	本田技研工業	144	133.1	338,406
澤藤電機	0.2	0.2	269	MUTOHホールディングス	0.3	0.3	402	スズキ	31.3	33.7	127,857
原田工業	0.6	0.8	596	東京エレクトロン	11.4	11.3	249,108	SUBARU	53	52.6	121,032
コーセル	2.3	2.4	2,359	輸送用機器 (7.7%)				安永	0.8	0.8	721
イリソ電子工業	1.6	1.5	4,987	トヨタ紡織	6	5.1	6,553	ヤマハ発動機	24.1	22.1	32,133
オプテックスグループ	3	2.8	3,052	芦森工業	0.4	0.5	449	ショーワ	4.1	4.1	9,253
千代田インテグレ	0.7	0.8	1,407	ユニプレス	3.3	3.3	3,349	T B K	2.1	2	840
アイ・オー・データ機器	0.6	0.5	382	豊田自動織機	13.8	13.7	70,555	エクセディ	2.3	2.3	4,135
レーザーテック	3.5	7.5	37,462	モリタホールディングス	3	2.9	4,471	豊田合成	5.6	5.5	10,994
スタンレー電気	12.1	11.9	26,798	三櫻工業	2.5	2.3	1,727	愛三工業	2.8	2.8	1,461
岩崎電気	0.7	0.6	762	デンソー	37.6	37.3	135,697	盟和産業	0.2	0.2	183
ウシオ電機	10.4	9.8	12,357	東海理化電機製作所	4.5	4.5	6,232	日本プラスト	1.4	1.4	739
岡谷電機産業	1.7	1.5	400	三井E&Sホールディングス	6.4	6.6	4,752	ヨロズ	1.6	1.7	1,907
ハリオス テクノ ホールディング	1.6	1.7	472	川崎重工業	13.4	13.3	21,838	エフ・シー・シー	3.1	2.8	4,718
エノモト	0.3	0.5	432	名村造船所	5.4	6	1,170	シマノ	6.9	6.3	100,233
日本セラミック	1.8	1.7	3,406	日本車輻製造	0.7	0.6	1,419	テイ・エス テック	4	3.9	9,629
遠藤照明	0.9	0.8	473	三菱ロジスネクスト	2.1	2.3	2,272	ジャムコ	0.9	0.9	826
古河電池	1.3	1.3	712	近畿車輛	0.3	0.4	455	精密機器 (2.6%)			
双信電機	1	1.2	379	日産自動車	201.2	200.1	80,019	テルモ	24.2	48	163,824
山一電機	1.2	1.3	1,964	いすゞ自動車	54	49.1	41,867	クリエートメディック	0.5	0.4	396
図研	1.1	1.2	2,548	トヨタ自動車	190.1	188.7	1,245,420	日機装	5.6	5.2	4,409
日本電子	3.4	3.4	8,377	日野自動車	21.5	21.4	16,135	日本エム・ディ・エム	1	1	1,519
カシオ計算機	15.2	15	24,525	三菱自動車工業	63.4	63.2	20,097	島津製作所	22	20.2	52,116
ファナック	16.2	16.1	258,888	エフテック	1.3	1.3	674	J M S	1.6	1.6	1,086
日本シイエムケイ	4.5	4.1	1,685	レシップホールディングス	0.7	1	438	長野計器	1.4	1.4	1,054
エンプラス	0.8	0.9	2,080	GMB	0.4	0.3	184	ブイ・テクノロジ	0.4	0.8	2,712
大真空	0.8	0.7	1,164	ファルテック	0.5	0.4	282	東京計器	1.2	1.2	847
ローム	8.3	7.6	50,540	武蔵精密工業	4.2	3.9	4,126	愛知時計電機	0.2	0.1	380
浜松ホトニクス	12.3	12.2	48,983	日産車体	3.6	3.5	3,206	インターアクション	0.8	0.9	2,074
三井ハイテック	2.1	1.9	2,306	新明和工業	7.7	4.7	5,564	オーバル	2	1.8	354
新光電気工業	5.9	5.8	6,385	極東開発工業	3.4	3.1	3,403	東京精密	3.1	3.1	9,734
京セラ	26	23.8	156,032	日信工業	3.2	3.5	7,738	マニー	2.1	6.7	14,525
太陽誘電	7.7	7.6	23,066	トピー工業	1.4	1.5	1,963	ニコン	29.8	27.5	27,252
村田製作所	17.9	49.8	271,161	ティラド	0.6	0.6	812	トプコン	9.2	8.6	7,808
ユーシン	2.8	-	-	タチエス	3	2.9	2,699	オリンパス	25.5	93.7	179,107
双葉電子工業	2.8	2.7	2,602	NOK	9.2	9.2	10,414	理研計器	1.4	1.5	3,075
北陸電気工業	0.8	0.8	665	フタバ産業	5	4.9	2,528	タムロン	1.5	1.5	3,000
ニチコン	5.5	5.8	4,118	K Y B	1.8	1.9	4,111	HOYA	34.3	33.9	316,829
日本ケミコン	1.3	1.4	1,885	大同メタル工業	2.9	3.3	1,716	シード	0.8	0.8	588
K O A	2.6	2.6	2,496	プレス工業	8.6	8.5	2,227	ノーリツ鋼機	1.4	1.2	1,252
市光工業	2.7	2.6	1,406	ミクニ	2.3	2.1	522	エー・アンド・ディ	1.6	1.6	1,099
小糸製作所	10.2	10.1	36,259	太平洋工業	3.6	3.5	3,528	朝日インテック	7.2	14.4	39,355
ミツバ	3.4	3.3	1,765	ケーヒン	4	4	10,224	シチズン時計	18.9	20	7,140
SCREENホールディングス	3	2.9	14,877	河西工業	2.1	2.4	1,384	リズム時計工業	0.6	0.5	357
キャノン電子	1.5	1.8	2,901	アイシン精機	14.1	14	43,470	大研医器	1.4	1.4	779
キャノン	91.8	91.1	219,596	マツダ	53.8	50.1	32,565	メニコン	2.3	2.4	10,200
リコー	51.6	43.2	41,904	今仙電機製作所	1.6	1.6	1,102	シンシア	0.3	0.4	144

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
松風	0.8	0.8	1,313	リンテック	4.1	4	8,476	西武ホールディングス	21.8	22.8	30,802
セイコーホールディングス	2.6	2.4	4,279	イトーキ	3.2	3.6	1,126	鴻池運輸	2.7	2.7	3,145
ニプロ	11.9	11.8	12,814	任天堂	10.5	10.4	376,376	西日本鉄道	4.8	4.8	10,536
その他製品 (2.3%)				三菱鉛筆	2.8	2.7	3,515	ハマキョウレックス	1.3	1.4	3,669
中本パックス	0.5	0.5	574	タカラスタンダード	3.5	3.5	4,956	サカイ引越センター	0.9	0.9	4,545
スノーピーク	0.7	1	637	コクヨ	8.2	8.2	11,545	近鉄グループホールディングス	16.2	16.1	69,793
パラマウントベッドホールディングス	2	1.8	7,002	ナカバヤシ	1.6	1.6	792	阪急阪神ホールディングス	21.5	21.4	70,406
トランザクション	1	1.2	927	グローブライド	0.8	0.8	1,348	南海電気鉄道	7.3	7.6	16,355
粧美堂	0.7	0.8	245	オカムラ	6	5.9	4,661	京阪ホールディングス	7.2	7.2	29,556
ニホンフラッシュ	0.7	0.8	1,816	美津濃	1.7	1.5	2,883	神戸電鉄	0.4	0.5	1,762
前田工織	1.9	1.8	3,529	電気・ガス業 (1.6%)				名古屋鉄道	13	13.2	35,666
永大産業	2.1	2.4	614	東京電力ホールディングス	136.5	135.1	49,716	山陽電気鉄道	1.3	1.2	2,134
アートネイチャー	1.8	1.8	1,049	中部電力	52.1	51.7	71,888	日本通運	6.4	5.6	27,272
パンダインコムホールディングス	17.7	17.5	99,890	関西電力	69.5	64.2	70,748	ヤマトホールディングス	28.4	28.3	44,827
アイフイスジャパン	0.4	0.5	294	中国電力	23.8	24.6	33,382	山九	4.5	4.5	18,270
共立印刷	3.2	3.5	504	北陸電力	17.2	15.8	10,728	丸運	0.9	1.2	276
S H O E I	0.8	0.8	3,296	東北電力	40	42.4	38,075	丸全昭和運輸	1.3	1.3	2,796
フランスベッドホールディングス	2.5	2.4	1,968	四国電力	15.4	15.4	12,058	セコグループホールディングス	9	9	6,885
パイロットコーポレーション	3	2.7	8,370	九州電力	35.2	35.4	27,222	トナミホールディングス	0.4	0.4	1,562
萩原工業	0.9	1	1,435	北海道電力	16.4	16	6,880	ニッコンホールディングス	6.1	5.6	11,065
トッパン・フォームズ	3.8	3.7	3,577	沖縄電力	3.1	3.1	5,505	日本石油輸送	0.2	0.2	504
フジールインターナショナル	3.8	3.8	7,079	電源開発	13.6	13.4	28,207	福山通運	2.1	2	6,200
タカラトミー	7.3	7.6	6,019	エフオン	0.8	0.9	416	セイノーホールディングス	12.1	12.1	13,031
廣済堂	-	1.3	864	イーレックス	3	2.5	3,195	エスライン	0.5	0.5	416
エステールホールディングス	0.5	0.5	286	レノバ	2.1	2.8	2,662	神奈川中央交通	0.4	0.4	1,536
アーク	8.2	7.5	540	東京瓦斯	33.5	32.6	74,197	日立物流	3.6	3	7,938
タカノ	0.6	0.6	363	大阪瓦斯	33.1	32.9	55,568	丸和運輸機関	0.9	1.7	3,009
プロネクサス	1.4	1.5	1,396	東邦瓦斯	8.4	8.4	29,736	C&Fロジホールディングス	1.6	1.5	1,624
ホクシン	1.6	1.8	205	北海道瓦斯	0.9	0.8	1,137	九州旅客鉄道	13.6	14.3	43,329
ウッドワン	0.6	0.5	439	広島ガス	3.2	3	975	S Gホールディングス	15.3	16.8	36,674
大建工業	1.3	1.2	1,788	西部瓦斯	1.9	1.8	3,796	海運業 (0.1%)			
凸版印刷	24.2	23.9	40,582	静岡ガス	5.2	4.8	4,003	日本郵船	13.8	13.8	18,892
大日本印刷	24.1	22.2	50,860	メタウォーター	0.8	0.8	2,888	商船三井	9.6	10.1	19,230
図書印刷	1.7	-	-	陸運業 (4.2%)				川崎汽船	5.4	5.4	5,605
共同印刷	0.5	0.5	1,216	S B Sホールディングス	1.7	1.5	2,218	N Sユナイテッド海運	0.9	0.8	1,156
N I S S H A	3.5	3.5	2,499	東武鉄道	18.1	17.9	55,311	飯野海運	7.5	7.5	2,257
光村印刷	0.2	0.2	248	相鉄ホールディングス	5.9	5.4	12,727	共栄タンカー	0.1	0.3	230
TAKARA & COMPANY	0.7	0.8	1,173	東急	46.5	42.9	67,867	乾汽船	1.5	1	1,022
アシックス	17.1	14.1	14,706	京浜急行電鉄	23.5	21.9	34,514	空運業 (0.5%)			
ツツミ	0.6	0.5	892	小田急電鉄	27.5	25.4	49,936	日本航空	29.5	28.9	68,507
小松ウオール工業	0.5	0.5	873	京王電鉄	9.6	8.9	46,013	ANAホールディングス	29.6	29.4	83,202
ヤマハ	10.2	10.1	47,874	京成電鉄	12.8	11.8	38,291	パスコ	0.5	0.4	600
河合楽器製作所	0.5	0.5	1,203	富士急行	2.4	2.3	5,874	倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
グリナップ	1.7	1.7	870	新京成電鉄	0.3	0.4	936	トランコム	0.5	0.5	3,230
ピジョン	10.3	10.3	34,968	東日本旅客鉄道	30.3	29.8	237,595	日新	1.4	1.4	1,897
兼松サステック	0.1	0.1	139	西日本旅客鉄道	15.3	15.1	102,408	三菱倉庫	5.7	5.2	12,147
キングジム	1.5	1.5	1,057	東海旅客鉄道	15.3	14	237,160	三井倉庫ホールディングス	2.1	1.9	2,707

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
住友倉庫	6	5.8	6,786	エムアップ	0.6	0.5	1,105	ショーケース	0.4	0.5	229
澁澤倉庫	0.9	0.8	1,372	エイチーム	1.1	1.2	876	モバイルファクトリー	0.5	0.4	524
東陽倉庫	2.9	2.6	699	エニゴモ	-	1.3	937	テラスカイ	0.1	0.6	1,594
日本トランスシティ	3.4	3.5	1,379	テクノスジャパン	1.4	1.4	509	デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.8	0.7	877
ケイヒン	0.3	0.3	334	コロボラ	4.8	5.5	4,620	P C Iホールディングス	0.3	0.4	731
中央倉庫	0.8	0.8	753	ブロードリーフ	8.4	8.5	3,527	パイプドHD	0.3	0.3	381
川西倉庫	0.3	0.3	249	クロス・マーケティンググループ	0.6	1	299	アイビーシー	0.3	0.4	316
安田倉庫	1.4	1.4	1,164	デジタルハブホールディングス	0.8	1	738	ネオジャパン	0.3	0.4	433
ファイブホールディングス	0.2	0.5	440	システム情報	-	0.9	595	P R T I M E S	0.1	0.2	387
東洋埠頭	0.5	0.4	484	メディアドゥホールディングス	0.5	0.5	1,438	ランドコンピュータ	0.2	0.3	292
宇徳	1.3	1.4	639	じげん	1.9	4.4	1,526	ダブルスタンダード	0.1	0.3	979
上組	10	9.2	17,756	ブイキューブ	1.1	1.2	876	オープンドア	0.8	0.9	828
サンリツ	0.3	0.2	115	エンカレッジ・テクノロジー	-	0.4	248	マイネット	0.5	-	-
キムラユニティー	0.4	0.4	386	サイバーリンクス	0.3	0.4	316	アカツキ	0.6	0.6	2,316
キューソー流通システム	0.4	0.5	805	フィックスターズ	1.6	1.8	1,708	ベネフィットジャパン	0.1	0.2	293
近鉄エクスプレス	3.1	3.5	5,813	CARTA HOLDINGS	0.9	0.9	815	Ubi comホールディングス	0.3	0.5	610
東海運	1.4	1.7	401	オブティム	0.4	0.5	1,810	L I N E	5.1	3.8	20,026
エーアイティー	1	1.3	860	セレス	0.6	0.6	555	カナミックネットワーク	0.3	1.1	619
内外トランスライン	0.5	0.5	474	S H I F T	-	0.5	3,515	ノムラシステムコーポレーション	0.1	0.5	182
日本コンセプト	0.4	0.5	617	ティーガイア	1.7	1.5	2,841	チェンジ	0.2	0.4	1,454
情報・通信業 (9.7%)				セック	0.3	0.3	869	シンクロ・フード	0.7	0.8	212
NECネットエスアイ	1.9	1.6	6,392	豆蔵ホールディングス	1.2	1.2	2,245	オークネット	0.9	1.1	1,028
クロスキャット	0.4	0.5	447	テクマトリックス	1.2	1.2	2,688	セグエグループ	-	0.4	258
システナ	6	5.9	7,616	プロシップ	0.4	0.5	645	エイトレッド	-	0.3	359
デジタルアーツ	0.9	0.8	4,136	ガホー・オパイン・インタータイム	40.5	4	6,472	A O I T Y O H O L D I N G S	1.9	1.8	954
日鉄ソリューションズ	2.5	2.5	6,842	GMOペイメントゲートウェイ	2.8	2.7	19,683	マクロミル	3	3.5	2,488
キューブシステム	0.9	1	570	ザッパラス	1.4	1.4	420	ビーグリー	0.4	0.5	610
エイジア	0.3	0.4	509	システムリサーチ	0.2	0.5	786	オロ	0.2	0.5	1,329
コア	0.8	0.8	868	インターネットインシアティブ	2.8	2.5	7,385	デモナ	-	0.4	242
ソリトンシステムズ	1	0.8	704	さくらインターネット	2	1.8	788	ニーズウェル	-	0.4	224
ソフトクリエイトホールディングス	0.7	0.7	954	ヴァンクス	0.6	0.5	383	サインバースト	-	0.3	433
T I S	5.6	5.5	32,835	GMOクラウド	0.4	0.4	728	ソルクシーズ	0.8	0.8	499
ネオス	0.6	0.7	329	S R Aホールディングス	0.9	0.8	1,797	フェイス	0.7	0.7	462
電算システム	0.7	0.7	1,423	M I N O R I ソリューションズ	0.3	-	-	プロトコーポレーション	-	1.5	1,341
グリーン	11.8	10.5	4,389	システムインテグレータ	0.5	0.6	377	ハイマックス	0.2	0.2	323
ユーエテックホールディングス	3.4	3.4	8,850	朝日ネット	1.4	1.5	1,032	野村総合研究所	10.7	23.6	51,542
三菱総合研究所	0.7	0.7	2,278	e B A S E	0.5	1	1,672	サイバネットシステム	1.4	1.3	768
ボルテージ	0.4	0.6	210	アバント	0.6	1.3	1,069	C Eホールディングス	0.5	1.1	473
電算	0.2	0.2	403	アドソル日進	0.6	0.6	1,244	日本システム技術	0.3	0.3	264
A G S	1	1	600	フリービット	1	0.9	594	インテジホールディングス	2.2	2	1,564
ファインデックス	1.4	1.5	1,011	コムチュア	0.9	1.8	3,549	東邦システムサイエンス	0.5	0.5	379
ブレインパッド	0.3	0.5	2,100	サイバーコム	0.3	0.4	588	ソースネクスト	6.6	8.1	2,365
K L a b	3	3.4	2,182	アステリア	0.9	1.1	423	インフォコム	1.4	1.8	4,584
ポルトヴァイン・ビートルホールディングス	2.3	2	1,516	アイル	-	0.6	814	ラクスル	-	0.9	2,392
イーブクインシアティブジャパン	0.3	0.3	411	マークラインズ	0.6	0.9	1,467	F I G	1.6	2.1	428
ネクソン	42.7	47.4	78,873	メディカル・データ・ビジョン	1.5	1.4	887	システムサポート	-	0.2	471
アイススタイル	4.3	4.8	1,267	g u m i	2.2	2.3	1,391	イーソル	-	0.6	746

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
アルテリア・ネットワークス	-	1.8	3,043	スカパーJ SATホールディングス	13	11	4,708	卸売業 (5.1%)			
ヒートコミュニケーションズホールディングス	0.4	0.5	488	テレビ東京ホールディングス	1.4	1.5	3,072	ハウスイ	0.5	0.5	352
フォーカスシステムズ	1.2	1.1	795	日本BS放送	0.6	0.6	606	高千穂交易	0.7	0.6	580
グレスコ	0.5	1	1,512	ビジョン	0.5	1.6	1,328	伊藤忠食品	0.4	0.5	2,097
フジメディアホールディングス	17.5	16	18,496	スマートバリュー	0.4	0.5	393	エレマテック	0.8	1.5	1,216
オービック	5.8	5.7	80,256	USEN-NEXT HOLDINGS	0.7	0.7	996	JALUX	0.5	0.5	807
ジャストシステム	2.4	2.7	13,500	ワイヤレスゲート	0.9	-	-	あらた	1	1.4	5,572
TDCソフト	1.4	1.5	1,126	コネクシオ	1.2	0.9	1,085	トーマンデバイス	0.3	0.3	931
Zホールディングス	109.8	228.1	85,765	クロップス	0.4	0.4	205	東京エレクトロニクス デバイス	0.7	0.6	1,271
トレンドマイクロ	8.9	7.4	36,963	日本電信電話	114.5	221.6	536,604	フィールズ	1.6	1.5	496
IDホールディングス	0.5	0.6	810	KDDI	147.7	123.8	398,883	双日	93.1	91.9	25,272
日本オラクル	3.4	3.4	27,030	ソフトバンク	133.3	151	219,554	アルフレッサホールディングス	18.7	18.6	35,284
アルファシステムズ	0.5	0.5	1,212	光通信	2	1.7	33,660	横浜冷凍	4.6	4.8	3,868
フューチャー	2.3	2	2,928	NTTドコモ	120.1	122.5	364,743	ラサ商事	0.8	0.6	483
CAC Holdings	1.2	1.2	1,161	エムティーアイ	2	1.7	916	ラクーンホールディングス	0.8	0.8	434
SBテクノロジー	0.8	0.6	1,188	GMOインターネット	6.1	6.6	11,200	アルコニックス	1.8	1.8	1,834
トーセ	0.5	0.5	341	ファイバーゲート	-	0.5	500	神戸物産	2.5	5.7	23,085
オービックビジネスコンサルタント	1.7	1.7	6,222	アドマーケティングコミュニケーション	0.4	0.6	255	あいホールディングス	2.4	2.4	3,225
伊藤忠テクノソリューションズ	7.7	7.6	21,394	KADOKAWA	5	4.6	6,108	ディーブイエックス	0.7	0.7	569
アイティフォー	2.1	2.1	1,274	学研ホールディングス	0.6	0.5	3,215	ダイワボウホールディングス	1.5	1.5	7,380
東計電算	0.2	0.2	766	ゼンリン	3.4	3.4	3,719	マニカ・富士エールホールディングス	4.7	4	5,460
エクスネット	0.3	0.3	258	昭文社	1.1	0.9	268	ラクト・ジャパン	0.4	0.6	1,953
大塚商会	9.1	9	41,175	インプレスホールディングス	1.8	1.7	221	パルケールエスターホールディングス	3.3	3.4	3,403
サイボウズ	2.1	1.9	3,076	アイネット	0.9	0.9	1,109	八洲電機	1.3	1.3	938
ソフトブレイン	1.4	1.1	444	松竹	1.1	1.1	12,584	メディアスホールディングス	1.1	1.3	868
電通国際情報サービス	1.1	1.1	4,763	東宝	11.1	9.8	33,467	レスタールホールディングス	1.1	1.8	2,626
デジタルガレージ	3.3	3	9,795	東映	0.7	0.6	7,470	ジュテックホールディングス	0.4	0.5	464
イーエムシステムズ	1.4	2.4	1,951	エヌ・ティ・ティ・データ	44.9	44.4	54,034	大光	0.6	0.8	392
ウェザーニューズ	0.6	0.5	1,595	ピー・シー・エー	0.2	0.3	875	OCHIホールディングス	0.5	0.5	604
CIJ	1.4	1.3	934	ビジネスブレイン太田昭和	0.3	0.3	677	TOKAIホールディングス	8.9	8.8	7,427
ビジネスエン지니어リング	0.2	0.2	476	DTS	1.9	3.7	6,882	黒谷	0.4	0.5	164
日本エンタープライズ	2.1	2.1	407	スクウェア・エニックスホールディングス	7.8	7.1	31,701	Cominix	0.3	0.3	205
WOWOW	0.8	0.8	1,855	シーイーシー	1.8	1.8	2,680	三洋貿易	0.8	1.7	1,416
スカラ	1.2	1.2	565	カプコン	7.2	7.8	22,900	ビューティガレージ	0.3	0.3	440
インテリジェントウェイブ	-	0.9	484	アイ・エス・ピー	0.4	0.4	663	ウイン・パートナーズ	1.1	1.2	1,192
IMAGICA GROUP	1.6	1.6	603	ジャストテック	1	1	880	ミタチ産業	0.6	0.5	282
ネットワンシステムズ	6	6.4	14,457	S C S K	4.4	3.8	20,102	シッパルスクエアホールディングス	3.5	2.6	11,362
システムソフト	4.5	4.6	312	日本システムウエア	0.6	0.5	885	明治電機工業	0.5	0.5	617
アルゴグラフィックス	0.7	1.5	4,935	アイネス	2.2	1.7	2,315	デリカフーズホールディングス	0.3	0.7	412
マーベラス	2.6	2.5	1,330	T K C	1.4	1.5	6,525	スターティアホールディングス	0.4	0.5	234
エイベックス	3	2.9	2,714	富士ソフト	2.5	2.1	7,035	コマダホールディングス	3.9	3.7	6,419
日本ユニシス	5.3	5.3	16,483	NSD	2.8	5.4	8,467	アセンテック	-	0.2	420
兼松エレクトロニクス	0.9	0.9	2,817	コナミホールディングス	6.9	6	21,150	富士興産	0.9	0.8	392
東京放送ホールディングス	11.1	10.1	16,170	福井コンピュータホールディングス	0.6	0.7	1,687	協栄産業	0.3	0.3	326
日本テレビホールディングス	15.4	13.8	16,725	J B C Cホールディングス	1.3	1.2	1,881	小野建	1.5	1.5	1,662
朝日放送グループホールディングス	1.7	1.6	1,043	ミロク情報サービス	1.7	1.5	3,588	南陽	0.3	0.4	587
テレビ朝日ホールディングス	4.7	4.6	7,470	ソフトバンクグループ	70.1	131.8	578,338	佐島電機	1.4	1.4	1,023

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	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	株数
エコートレーディング	0.9	0.8		千円	カメイ	2.2	2.1		千円	加賀電子	1.7	1.7		千円
伯東	1.2	1.1	1,140		東都水産	0.3	0.3	789		ソーダニッカ	2	1.9	978	
コンドーテック	1.3	1.3	1,140		OUGホールディングス	0.3	0.3	696		立花エレテック	1.2	1.2	1,710	
中山福	1.1	1.1	481		スターゼン	0.7	0.6	2,541		フォーバル	0.7	0.7	583	
ナガイレーベン	2.4	2.4	5,229		山善	6.5	6.6	5,253		P A L T A C	3	2.6	11,973	
三菱食品	1.9	1.8	4,948		椿本興業	0.3	0.3	933		三谷産業	2.2	2.1	646	
松田産業	1.3	1.3	1,671		住友商事	99.1	104.8	142,161		太平洋興発	0.7	0.6	366	
第一興商	2.5	2.5	9,362		内田洋行	0.8	0.7	2,649		株式会社Wismettacホールディングス	0.4	0.4	922	
メディバルホールディングス	18.2	18.1	34,679		三菱商事	117.8	116.8	287,386		ヤマダヘルスケアホールディングス	0.3	0.3	486	
S P K	0.3	0.3	720		第一実業	0.7	0.8	2,552		国際紙パルプ商事	3.4	4.3	941	
萩原電気ホールディングス	0.6	0.6	1,267		キャノンマーケティングジャパン	4.8	4.8	10,401		ヤマタネ	0.8	0.8	918	
アズワン	1.2	1.1	8,745		西華産業	1	1.1	1,182		丸紅建材リース	0.1	0.1	146	
スズデン	0.5	0.6	675		佐藤商事	1.4	1.4	1,069		日鉄物産	1.2	1.2	4,614	
尾家産業	0.7	0.6	660		菱洋エレクトロ	1.7	1.7	2,907		泉州電業	0.5	0.5	1,120	
シモジマ	1	1	1,017		東京産業	1.9	1.7	812		トラスコ中山	3.5	3.5	7,014	
ドウシシャ	1.6	1.6	1,996		ユアサ商事	1.7	1.6	4,404		オートボックスセブン	6.7	6.2	8,010	
小津産業	0.4	0.5	715		神鋼商事	0.4	0.4	788		モリト	1.1	1.2	793	
高速	1	0.9	975		小林産業	1.2	1.2	252		加藤産業	2.7	2.6	7,917	
たけびし	0.5	0.5	589		阪和興業	3	3.1	5,744		北恵	0.4	0.5	325	
リックス	0.3	0.3	425		正栄食品工業	0.9	1.1	3,448		イノテック	1	1	1,001	
丸文	1.6	1.7	824		カナデン	1.5	1.4	1,526		イエローハット	1.6	3.1	4,141	
ハピネット	1.5	1.5	1,650		菱電商事	1.3	1.2	1,602		J Kホールディングス	1.5	1.6	916	
橋本総業ホールディングス	0.3	0.4	571		フルサト工業	0.9	0.9	1,219		日伝	1.3	1.5	2,406	
日本ライフライン	5.3	5	6,600		岩谷産業	3.8	3.7	12,783		北沢産業	1.9	1.5	388	
タカショー	1.3	1.3	523		すてきなイスグループ	0.8	-	-		杉本商事	0.8	0.8	1,280	
エクセル	0.6	-	-		昭光通商	1.3	0.7	359		因幡電機産業	2.3	4.7	10,730	
マルカ	0.5	0.6	1,068		極東貿易	0.5	0.5	710		パイテックホールディングス	0.8	-	-	
I DOM	6	4.7	2,096		イワキ	2.1	2.3	952		東テク	0.5	0.5	928	
進和	1	0.9	1,539		三菱石油	4.6	4.3	3,805		ミスミグループ本社	21.1	20.9	45,457	
エスケイジャパン	0.4	0.5	151		稲畑産業	4.1	3.6	4,122		アルテック	-	1.5	270	
ダイトロン	0.7	0.7	1,074		G S Iクレオス	0.5	0.5	507		タキヒヨー	0.6	0.5	637	
シークス	2.2	2.1	2,364		明和産業	1.7	1.7	782		蔵王産業	0.1	0.2	270	
田中商事	0.5	0.4	235		クワザフ	-	0.8	361		スズケン	7.7	7.1	25,240	
オーハシテクニカ	0.8	0.8	1,014		ワキタ	3.6	3.5	3,059		ジェコス	1.1	1.2	963	
白銅	0.5	0.5	583		東邦ホールディングス	5	5.4	11,361		グローセル	1.8	2	800	
伊藤忠商事	117.4	116.5	265,620		サンゲツ	5.1	4.6	6,913		小売業 (4.6%)				
丸紅	165.6	173.2	104,491		ミツロコグループホールディングス	2.5	2.5	2,300		ローソン	4.3	4.3	23,263	
高島	0.3	0.3	515		シナネンホールディングス	0.8	0.8	1,726		サンエー	1.3	1.5	5,977	
長瀬産業	9.4	9.2	10,782		伊藤忠エネクス	3.8	3.9	3,151		カワチ薬品	1.4	1.4	2,718	
蝶理	1	1.1	1,743		サンリオ	5.3	4.7	6,542		エービーシー・マート	2.6	2.5	13,975	
豊田通商	18.8	18.7	53,388		サンワ テクノス	1.1	1.4	1,107		ハードオフコーポレーション	0.6	0.6	405	
三共生興	2.7	2.4	1,180		リョーサン	1.8	1.8	3,922		アスクル	1.8	1.8	4,845	
兼松	6.7	6.2	6,392		新光商事	1.6	2.6	1,817		ゲオホールディングス	2.6	3.1	3,475	
ツカモトコーポレーション	0.4	0.4	399		トーヨー	0.9	1.1	1,600		アダストリア	2.4	2.3	3,456	
三井物産	138.2	146	236,812		三信電気	1.4	1	1,345		ジーフット	1	1.2	504	
日本紙パルプ商事	1	1	3,375		東陽テクニカ	1.9	1.9	1,616		シー・ヴィ・エス・ペイエリア	-	0.3	122	
日立ハイテク	5.1	5.7	45,486		モスフードサービス	2.3	2.3	5,388		くら寿司	1	0.9	3,910	

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
キャンドウ	0.9	0.9	1,384	すかいらくホールディングス	15.7	18.8	30,456	コーナン商事	2.2	2.3	4,735
パルグループホールディングス	0.9	1.8	2,377	S F Pホールディングス	-	0.7	1,058	エコス	0.6	0.6	874
エディオン	7.2	7.6	6,665	綿半ホールディングス	0.6	0.6	883	ワタミ	-	2.1	1,957
サードコーポレーション	3.5	3.3	1,689	ヨシックス	0.3	0.3	613	マルシエ	0.7	0.6	392
ワッツ	0.7	1	478	コナカ	5	5.2	4,180	心斎橋インテグリティホールディングス	10.1	36.8	67,822
ハローズ	0.6	0.6	1,404	ゴルフダイジェスト・オンライン	0.7	0.8	435	西松屋チェーン	3.8	3.7	2,686
フジオフードシステム	-	1.5	1,971	B E E N O S	0.4	0.6	519	ゼンショーホールディングス	8	8	15,912
あみやき亭	0.4	0.4	1,174	あさひ	1.4	1.3	1,370	幸楽苑ホールディングス	1.1	1.2	1,602
ひらまつ	3.5	3.2	518	日本調剤	0.6	0.5	1,702	ハークスレイ	0.3	0.3	324
大黒天物産	0.4	0.5	1,374	コスモス薬品	0.7	0.7	15,911	サイゼリヤ	2.8	2.7	5,238
ハニーズホールディングス	1.5	1.5	1,624	トーエル	0.8	0.6	345	V Tホールディングス	5.8	6.9	2,235
ファーマライズホールディングス	0.6	0.5	283	オンリー	0.2	-	-	魚力	0.5	0.5	744
アルペン	1.4	1.4	2,093	セブン&アイ・ホールディングス	70.5	65.3	243,046	フジ・コーポレーション	0.3	0.5	825
ハブ	0.6	0.5	348	薬王堂	0.7	-	-	ユナイテッドアローズ	1.9	1.8	3,904
クオールホールディングス	2.5	2.5	2,945	クエントラストホールディングス	4.5	9.6	6,969	ハイデイド高	2.42	2.4	3,544
ジンズホールディングス	1.1	0.9	5,751	ツルハホールディングス	3.7	3.6	44,928	京都きもの友禅	1.3	1.8	410
ビックカメラ	9	9.9	8,890	サンマルクホールディングス	1.3	1.3	2,311	コロナ	5.6	5.6	9,206
DCMホールディングス	9.1	9	8,640	フェリシモ	0.4	0.4	354	ピーシーデポコーポレーション	2.3	2.2	877
ペッパーフードサービス	1.3	-	-	トリドールホールディングス	2.1	2.1	4,857	杏番屋	1.2	1.2	4,932
Monotaro	10.6	11.9	30,202	TOKYO BASE	1.5	1.5	501	P L A N T	0.4	0.7	284
東京一番フーズ	0.5	0.5	253	ウイルプラスホールディングス	0.2	0.2	116	スギホールディングス	3.7	3.3	16,830
DDホールディングス	0.4	0.7	705	J Mホールディングス	0.7	0.9	1,722	薬王堂ホールディングス	-	0.7	1,463
きちりホールディングス	0.5	0.5	274	サツドラホールディングス	0.3	0.5	813	ヴィア・ホールディングス	2.3	-	-
アークランドサースホールディングス	1.2	1.3	1,989	デファクトスタンダード	0.2	-	-	スクロール	2.7	2.5	700
J. フロント リテイリング	21.5	19.8	19,364	アレanzaホールディングス	0.9	0.9	592	ヨンドシーホールディングス	1.8	1.7	3,168
ドトール・日レスホールディングス	3	2.6	4,313	串カツ田中ホールディングス	-	0.3	454	ファミリーマート	18.8	13.4	28,461
マツモトキヨシホールディングス	7	6.9	24,219	パロックジャパンリミテッド	1.4	1.3	917	木曾路	2.1	2.1	4,972
ブロンコビリー	0.9	0.9	1,827	クスリのアオキホールディングス	1.7	1.5	10,035	S R Sホールディングス	2.2	2.1	1,827
ZOZO	18.2	11.6	16,379	力の源ホールディングス	0.5	0.8	539	千趣会	5	3.3	1,184
トレジャー・ファクトリー	0.5	0.6	387	スローグローバルホールディングス	1.9	1.8	12,780	タカキュー	2.1	1.9	245
物語コーポレーション	0.4	0.5	3,265	L I X I L ビバ	1.5	1.7	3,400	ケーヨー	3.4	3.5	1,561
ココカラファイン	1.9	1.8	9,018	メディカルシステムネットワーク	2	1.8	804	上新電機	2	1.9	3,144
三越伊勢丹ホールディングス	31.6	29.4	17,816	はるやまホールディングス	0.7	0.6	437	日本瓦斯	2.7	2.6	9,061
Hamee	0.5	0.6	729	ノジマ	3	2.9	5,046	ロイヤルホールディングス	3	2.9	4,930
ウエルシアホールディングス	4.5	5	33,100	カップ・クリエイイト	2.5	2.4	2,908	東天紅	0.2	0.1	82
クワイエットSDホールディングス	2.5	2.7	6,550	ライトオン	1.5	1.5	696	いなげや	1.9	2.1	2,488
丸善CHIホールディングス	2.3	2.2	688	ジーンズメイト	0.6	0.6	145	島忠	3.8	3.1	7,895
ミサワ	0.5	0.5	290	良品計画	2.4	22.2	28,571	チヨダ	1.8	1.8	1,958
ティーライフ	0.2	0.2	191	三城ホールディングス	2.1	2.1	529	ライフコーポレーション	1.3	1.3	2,909
エー・ピーカンパニー	0.5	-	-	アドヴァン	2.5	2.5	2,527	リンガーハット	2.1	2.1	4,126
チムニー	0.5	0.5	881	アルビス	0.6	0.6	1,064	M r M a x H D	2.3	2.1	697
シュッピン	1.2	1.2	885	コナカ	2.1	1.8	559	テンアライド	2.1	1.8	657
ネクステージ	2.6	2.4	1,701	ハウス オブ ローゼ	0.2	0.2	298	AOKIホールディングス	3.3	3.2	2,636
ジョイフル本田	4.9	4.8	4,944	G-7ホールディングス	0.5	1	1,943	オークワ	2.4	2.6	3,260
鳥貴族	0.6	0.6	1,113	イオン北海道	1.7	1.8	1,063	コメリ	2.6	2.5	4,822
キリン堂ホールディングス	0.7	0.7	1,080	コジマ	2.7	3.1	1,150	青山商事	2.9	3.4	3,668
ホットランド	0.9	1.3	1,276	ヒマラヤ	0.7	0.6	379	しまむら	2	1.9	13,091

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
はせがわ	1	0.8	271	銀行業 (5.2%)				紀陽銀行	6	5.8	7,627
高島屋	13.4	12.3	11,426	島根銀行	0.5	0.9	351	ほくほくフィナンシャルグループ	11.2	11	9,097
松屋	3.5	3.5	1,953	じもとホールディングス	11.4	11.7	1,076	広島銀行	25	24.5	10,143
イチ・ツー・オー リテイリング	8.7	8.1	6,131	めぶきフィナンシャルグループ	87.6	86.8	15,971	山陰合同銀行	9.9	9.6	4,656
近鉄百貨店	0.7	0.6	1,291	東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.3	2.3	2,343	中国銀行	11.2	14.7	11,524
パルコ	1.7	-	-	九州フィナンシャルグループ	27.8	27.7	9,362	鳥取銀行	0.5	0.5	558
丸井グループ	14.3	15.3	30,003	ゆうちょ銀行	47.7	47.6	42,364	伊予銀行	22.6	23.9	10,707
アクシアル リテイリング	1.4	1.4	4,508	富山第一銀行	3.8	3.2	828	百十四銀行	1.7	1.7	2,762
イオン	64.8	64.3	125,802	コンコルディア・フィナンシャルグループ	107.3	98.6	30,467	四国銀行	2.4	2.5	1,832
イズミ	3.4	3.4	9,295	西武フィナンシャルホールディングス	10.8	10.9	6,104	阿波銀行	2.7	2.7	5,219
平和堂	3.4	3.5	5,533	関西みらいフィナンシャルグループ	8.1	10	4,300	大分銀行	1	0.9	1,707
フジ	2.1	2	2,878	三十三フィナンシャルグループ	1.5	1.4	1,822	宮崎銀行	1	1	1,989
ヤオコー	1.9	1.8	10,116	第四北越フィナンシャルグループ	2.9	2.7	5,354	佐賀銀行	0.9	1	1,159
ゼビオホールディングス	2.2	2.1	1,858	新生銀行	12.5	12.5	15,850	十八銀行	1	-	-
ケーズホールディングス	17.5	16.2	17,658	あおぞら銀行	9.4	9.9	22,235	沖縄銀行	1.6	1.6	4,428
Olympicグループ	-	1	444	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,159	1,139.7	501,126	琉球銀行	3.9	3.8	3,442
日産東京販売ホールディングス	2.5	2.4	504	りそなホールディングス	184.8	183.2	62,434	セブン銀行	57.2	56.6	14,489
Genky DrugStores	0.8	0.8	1,340	三井住友トラスト・ホールディングス	33.1	31.6	99,887	みずほフィナンシャルグループ	2,288.8	2,264.8	276,985
ナルミヤ・インターナショナル	-	0.4	312	三井住友フィナンシャルグループ	118.6	115.3	339,846	高知銀行	0.6	0.5	312
総合メディカルホールディングス	1.5	1.5	3,816	千葉銀行	60	58	25,984	山口フィナンシャルグループ	21.1	20.8	10,545
ブックオフグループホールディングス	1	1.2	904	群馬銀行	34	33.1	9,466	長野銀行	0.5	0.5	548
アインホールディングス	2.3	2	11,740	武蔵野銀行	2.5	2.4	3,086	名古屋銀行	1.4	1.4	3,463
元気寿司	0.5	0.5	1,134	千葉興業銀行	4.8	4.6	1,071	北洋銀行	25.5	25.4	4,572
ヤマダ電機	51.5	51	24,276	筑波銀行	7.4	7.6	1,140	愛知銀行	0.6	0.6	1,664
アーグランドサカモト	2.8	2.4	2,364	七十七銀行	5.3	5.6	6,843	中京銀行	0.7	0.7	1,313
ニトリホールディングス	7.3	7.2	103,896	青森銀行	1.3	1.4	2,879	大光銀行	0.5	0.5	628
グルメ杵屋	1.2	1.2	1,135	秋田銀行	1	1	1,486	愛媛銀行	2.3	2.3	2,260
愛眼	1.8	1.5	300	山形銀行	1.9	1.9	1,839	トマト銀行	0.5	0.4	364
ケーユーホールディングス	0.8	0.6	472	岩手銀行	1.2	1.1	2,286	京葉銀行	7.4	7.3	3,328
吉野家ホールディングス	6	5.6	11,704	東邦銀行	15.3	15.2	3,085	栃木銀行	8.8	9.6	1,430
松屋フーズホールディングス	0.8	0.8	2,872	東北銀行	0.8	0.6	497	北日本銀行	0.5	0.5	833
サガミホールディングス	2.3	2.2	2,343	みちのく銀行	1.1	1.2	1,148	東和銀行	2.9	2.8	1,747
関西スーパーマーケット	1.3	1.4	1,146	ふくおかフィナンシャルグループ	13.6	14.1	20,670	福島銀行	2	2.7	415
王将フードサービス	1.2	1.3	7,072	静岡銀行	42.8	41.8	25,581	大東銀行	0.7	0.7	360
プレナス	2	1.8	2,982	十六銀行	2.3	1.9	3,173	トモニホールディングス	13	12.7	3,695
ミニストップ	1.4	1.6	2,075	スルガ銀行	17.7	17.7	6,106	フィデアホールディングス	16.3	15.7	1,554
アークス	3.2	3.5	5,897	八十二銀行	31.1	40.7	13,756	池田泉州ホールディングス	18	19.9	3,004
パローホールディングス	3.7	3.7	5,905	山梨中央銀行	2.1	1.9	1,383	証券・商品先物取引業 (0.8%)			
藤久	0.4	0.4	192	大垣共立銀行	2.7	3.3	5,847	F P G	5.3	5.2	4,040
ベルク	0.8	0.8	3,856	福井銀行	1.4	1.5	1,869	マーキュリアンバスターメント	0.7	0.8	412
大庄	1	1	1,185	北國銀行	1.8	1.8	4,433	S B Iホールディングス	20.1	18.7	34,445
ファーストリテイリング	2.3	2.2	116,050	清水銀行	0.7	0.6	974	ジャフコ	2.8	2.5	8,687
サンドラッグ	6.3	6.3	21,514	富山銀行	0.3	0.3	440	大和証券グループ本社	134.8	134.2	56,578
サックスパー ホールディングス	1.5	1.4	900	滋賀銀行	3.4	3.4	7,112	野村ホールディングス	296.4	293.6	127,040
ヤマザワ	0.4	0.5	643	南都銀行	2	2.7	5,310	岡三証券グループ	14.6	14.7	4,557
やまや	0.3	0.4	806	百五銀行	15.5	15.2	4,164	丸三証券	5.1	5.3	2,109
ベルーナ	4.1	3.4	1,679	京都銀行	6.1	6	19,830	東洋証券	6.4	6.7	810

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
東証東京フィナンシャル・ホールディングス	20.2	19.9	4,815	日本取引所グループ	45.5	48.1	85,569	東京建物	18.5	17.7	23,257
光世証券	0.7	0.6	321	イー・ギャランティ	1.6	1.8	2,359	ダイビル	5	4.5	4,833
水戸証券	5	5.4	1,031	アサククス	0.6	0.9	559	京阪神ビルディング	3	2.8	3,628
いちよし証券	3.6	3.2	1,625	NECキャピタルリソリューション	0.7	0.7	1,355	住友不動産	38	37.8	118,314
松井証券	8.4	9.7	7,333	不動産業 (2.4%)				テオーシー	3.9	3.5	2,201
だいち証券ビジネス	0.9	0.9	402	いちご	21.5	21.4	6,826	東京楽天地	0.3	0.4	1,796
マネックスグループ	16.1	13	2,431	日本駐車場開発	20.5	19.1	2,463	レオパレス21	21.1	-	-
カブドットコム証券	12.7	-	-	スター・マイカ・ホールディングス	-	0.9	1,089	スターツコーポレーション	2.3	2.3	4,641
極東証券	2.3	2.2	1,280	ヒューリック	35.2	35.8	39,129	フジ住宅	2.1	1.9	993
岩井コスモホールディングス	1.7	1.5	1,557	三栄建築設計	0.7	0.7	868	空港施設	2	1.8	817
藍澤証券	3.2	2.9	1,980	スター・マイカ	0.8	-	-	明和地所	0.9	1.1	599
マネーパートナーズグループ	2.1	2	346	野村不動産ホールディングス	11.2	10.2	22,633	ゴールドクレスト	1.4	1.4	2,199
スパークス・グループ	-	6	1,224	三重交通グループホールディングス	3.5	3.6	1,641	エスリード	0.6	0.6	916
保険業 (2.2%)				サムティ	2.3	2.4	3,477	日神グループホールディングス	2.4	2.5	1,025
かんぽ生命保険	6.4	6.2	9,014	ディア・ライフ	2.1	2.2	943	日本エスコ	3	3	1,884
SOMPOホールディングス	29.7	31.4	110,025	コーセーアールイー	0.5	0.5	214	タカラレーベン	8	7.8	3,096
アニコムホールディングス	1.4	1.5	4,620	イー・ディー・ワークス	-	34.6	726	AVANTIA	0.9	1.1	727
MS&ADインフラストラクチャーホールディングス	44	43.7	134,377	日本商業開発	1.1	1.1	1,606	イオンモール	8.5	8.6	12,427
ソニーフィナンシャルホールディングス	13.9	13.8	27,117	プレサンスコーポレーション	2.7	2.7	2,934	毎日コムネット	0.3	0.5	367
第一生命ホールディングス	95.3	94.5	114,486	ユニゾホールディングス	2.6	2.5	14,025	ファースト住建	0.6	0.7	665
東京海上ホールディングス	60.9	59.6	303,304	THEグローバル社	0.9	1.1	365	カチタス	1.9	2	7,090
T&Dホールディングス	52.2	50.1	42,785	ハウスコム	-	0.3	375	トーセイ	2.3	2.3	2,454
アドバンスクリエイト	0.4	0.4	541	日本管理センター	1.1	1.2	1,227	穴吹興産	0.2	0.5	660
その他金融業 (1.2%)				サンセイランディック	0.5	0.6	406	サンフロンティア不動産	2.3	2.3	2,405
全国保証	4.7	4.7	17,813	エストラスト	0.3	0.3	170	エフ・ジェー・ネクスト	1.4	1.5	1,300
ジェイリース	0.4	0.9	225	フージャースホールディングス	3.7	3.5	2,215	インテリックス	0.5	0.6	291
イントラスト	0.5	0.7	387	オープンハウス	2.7	4.9	13,058	日本社宅サービス	-	0.5	410
日本モーゲージサービス	0.2	0.4	753	東急不動産ホールディングス	45.6	46.4	29,417	グランディハウス	1.5	1.4	529
CASA	0.6	0.6	677	飯田グループホールディングス	14	14	20,636	日本空港ビルディング	5.4	5.4	22,761
アルビ	1.5	2.6	3,653	イェーランド	0.3	0.4	268	サービス業 (5.1%)			
プレミアグループ	0.3	1	1,665	ムゲンエステート	1.2	1.4	639	日本工業	1.1	1.1	2,893
クレディセゾン	11.9	11.8	16,579	ビーロット	0.3	0.5	652	LIFULL	6.4	5.7	2,069
芙蓉総合リース	1.9	1.8	9,702	ファーストブラザーズ	0.5	0.5	423	ジェイエイシークルメント	1.3	1.1	1,368
みずほリース	3.2	2.5	5,987	ハウスドゥ	0.9	0.8	727	日本M&Aセンター	12.2	12.3	40,774
東京センチュリー	3.4	3.4	12,546	シーアールイー	0.6	0.5	453	メンバーズ	0.6	0.5	643
日本証券金融	7.5	7.2	3,520	プロパティエージェント	0.2	0.4	318	中広	0.2	0.4	144
アイフル	26	25.8	6,579	ケイアイスター不動産	0.4	0.5	647	アイティメディア	-	0.5	453
リコーリース	1.3	1.4	4,263	アグリ都市デザイン	0.2	0.5	220	タケエイ	1.8	1.6	1,361
イオンフィナンシャルサービス	10.8	10.2	13,586	グッドコムアセット	0.3	0.5	687	E・Jホールディングス	0.2	0.4	508
アコム	34.2	33.7	13,884	ジェイ・エス・ビー	0.1	0.2	842	ビーネックスグループ	0.9	2	1,446
ジャックス	1.8	1.8	3,439	テンポイノベーション	0.1	0.5	352	コシダカホールディングス	4.4	-	-
オリエンコーポレーション	46.3	45.8	5,587	グローバル・リンク・マネジメント	0.1	0.5	302	アルトナー	0.3	0.5	318
日立キャピタル	4	3.9	10,292	パーク24	9.9	9	17,982	パソナグループ	2	1.8	1,792
アプラスフィナンシャル	9.2	9.5	598	パラカ	0.4	0.5	751	CDS	0.4	0.5	567
オリックス	112.1	104.3	161,195	三井不動産	89.5	82.7	179,955	リンクアンドモチベーション	3.1	3.7	1,417
三菱UFJリース	38	42.2	23,463	三菱地所	118.3	117.6	209,092	GCA	1.7	2	1,300
九州リースサービス	0.8	0.6	295	平和不動産	3.2	3.1	9,188	エス・エム・エス	6	5.1	10,618

銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)			銘柄	期首 (前期末)		
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
サニーサイドアップグループ	0.2	0.5	311	アミューズ	1	0.9	1,878	イー・ガーディアン	0.8	0.9	1,436
パーソルホールディングス	16.4	16.3	21,059	ドリームインキュベータ	0.5	0.5	646	リブセンス	1.1	1.6	377
リニカル	0.9	0.9	717	クイック	1	1.1	1,243	ジャパนมテリアル	4.5	5	6,015
クックパッド	5.4	6.2	1,649	TAC	1.2	1.8	304	ベクトル	2	2.1	1,778
エスクリ	0.5	0.6	261	ケネディクス	14.4	15.2	8,040	ウチヤマホールディングス	1	1.3	444
アイ・ケイ・ケイ	0.8	1	519	電通グループ	19.9	16.7	40,313	チャム・ケア・コーポレーション	0.4	1.5	1,183
学情	0.7	0.6	887	テイクアンドギヴ・ニーズ	0.7	0.7	524	ライクキッズ	0.4	0.4	230
スタジオアリス	0.8	0.9	1,287	ぴあ	0.5	0.5	1,167	キャリアリンク	0.7	0.9	382
シミックホールディングス	0.9	1	1,362	イオンファンタジー	0.5	0.7	1,177	I B J	1.1	1.2	919
エパコ	-	0.4	362	シーティーエス	1.9	1.8	957	アサンテ	0.6	0.6	915
N J S	0.3	0.4	606	ネクシーズグループ	0.5	0.6	658	N・フィールド	1.1	1.3	534
総合警備保障	6.5	6.5	31,297	みらかホールディングス	4.6	4.6	11,408	バリューHR	0.4	0.4	1,156
カカココム	12.3	12.2	27,852	アルプス技研	1.4	1.5	2,313	M&Aキャピタルパートナーズ	0.4	1.2	3,606
アイロムグループ	0.6	0.6	643	ダイオーズ	0.4	0.4	451	ライオンエクスプレスホールディングス	0.7	0.7	899
セントケア・ホールディング	1	1.3	509	日本空調サービス	1.7	1.7	1,050	E R Iホールディングス	0.5	0.6	350
サイネックス	0.3	0.4	232	オリエンタルランド	19.3	17.2	226,180	アビスト	0.2	0.3	581
ルネサンス	0.9	1	1,157	ダスキン	4.4	4.3	11,223	シグマクシス	0.8	1.2	1,648
ディップ	2.6	2.3	5,221	明光ネットワークジャパン	2.2	2	1,484	ウィルグループ	1.1	1.2	838
オプトホールディング	1.1	1	1,408	ファルコホールディングス	0.9	0.9	1,382	エスコ・エージェント・ジャパン	2.3	2.4	384
新日本科学	-	1.8	919	田谷	0.9	0.9	504	日本ビューホテル	0.6	-	-
ツクイ	3.9	4.1	1,873	ラウンドワン	5.1	4.6	3,247	リクルートホールディングス	116.9	115.9	402,057
キャリアデザインセンター	0.4	0.5	446	リゾートトラスト	7	7.6	9,355	エラン	1.1	1.1	1,398
ベネフィット・ワン	4.6	4.6	6,610	ビー・エム・エル	2.1	2.1	5,621	土木管理総合試験所	0.7	0.8	242
エムスリー	34.4	35.8	106,505	ワタベウエディング	0.4	0.5	182	ネットマーケティング	-	0.7	434
ツカダ・グローバルホールディング	1.1	1.2	441	りらいほコミュニケーションズ	3.1	3	3,357	日本郵政	133.6	132.3	109,279
プラス	0.2	0.4	211	リソー教育	8.4	7.6	2,226	ベルシステム24ホールディングス	2.8	2.8	3,357
アウトソーシング	8.6	9.3	6,156	早稲田アカデミー	0.2	0.6	512	鎌倉新書	1.2	1.3	1,613
ウェルネット	1.6	1.8	903	ユー・エス・エス	19.9	18.2	28,446	S MN	-	0.4	250
ワールドホールディングス	0.5	0.5	694	東京個別指導学院	0.6	0.7	324	一蔵	0.3	0.2	100
ディアー・エヌ・エー	8.8	8	10,640	サイバーエージェント	10.1	9.3	37,200	L I T A L I C O	0.4	0.6	1,330
博報堂D Yホールディングス	22.7	22.7	25,878	楽天	76.3	75.6	58,816	グローバルキッズCOMPANY	0.2	0.5	254
ぐるなび	2.4	3	1,857	クリック・アンド・リバー社	1	0.9	720	エアトリ	0.5	0.8	819
タカミヤ	1.7	1.8	804	テー・オー・ダブリュー	1.3	1.4	890	アトラエ	0.3	0.5	1,322
ジャパンバスストレスシステム	1.3	1.2	777	山田コンサルティンググループ	-	0.8	852	ストライク	0.4	0.6	2,241
ファンコミュニケーションズ	4.5	4.6	1,922	セントラルスポーツ	0.6	0.6	1,294	ソラスト	4	4.6	4,356
ライク	0.7	0.5	717	フルキャストホールディングス	1.6	1.6	2,649	セラク	0.4	0.5	493
ビジネス・ブレイクスルー	0.8	0.8	280	エン・ジャパン	1.8	2.9	8,053	インソース	0.5	0.8	1,791
エスプール	-	3.2	1,996	リソルホールディングス	0.2	0.2	719	ペイカレント・コンサルティング	0.9	1	6,330
W D Bホールディングス	0.8	0.7	1,479	テクノプロ・ホールディングス	3.3	3.2	18,336	Orchestra Holdings	0.2	0.5	371
ティア	0.9	1.1	525	アトラ	0.4	0.6	132	アイモバイル	0.4	0.8	454
C D G	0.2	0.3	358	インターワークス	0.3	0.5	219	キャリアインデックス	0.6	1	322
バリューコマース	1.1	1	1,921	アイ・アールジャパンホールディングス	0.5	0.6	3,600	M S - J a p a n	0.7	0.6	535
インフォマート	9	17.8	10,751	KeepPer 技研	0.6	0.7	815	船場	0.3	0.3	269
J Pホールディングス	4.9	5.4	1,371	ファーストロジック	0.4	0.5	250	グレイステクノロジー	0.4	0.7	1,778
E P Sホールディングス	2.5	2.5	2,577	三機サービス	0.3	0.4	355	湘南エムベーターサービスホールディングス	1	1.7	3,910
レップス	0.4	0.5	442	Gunosy	1.1	1.1	1,010	フルテック	0.2	0.2	208
プレステージ・インターナショナル	3.1	6.1	4,934	デザインワン・ジャパン	0.4	0.9	183	グリーンズ	0.5	0.5	313

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	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額		株数	株数	株数	評価額
ツナグループ・ホールディングス	0.2	0.4	152		東京テアトル	0.7	0.8	856		船井総研ホールディングス	3.4	3.4	7,225	
GAMEWITH	-	0.6	318		タナベ経営	0.3	0.3	339		進学会ホールディングス	0.7	0.6	283	
ソウルドアウト	-	0.3	580		ナガワ	0.4	0.5	2,865		オオバ	1.3	1.4	730	
MS&Consulting	-	0.4	260		よみうりランド	0.4	0.4	1,344		いであ	0.3	0.4	599	
日総工産	0.4	1.2	754		東京都競馬	1.1	1.1	3,448		学究社	0.5	0.5	567	
キュービネットホールディングス	0.8	0.8	1,468		常磐興産	0.7	0.7	837		ベネッセホールディングス	6	5.5	14,619	
RPAホールディングス	-	1	875		カナモト	2.5	2.6	5,631		イオンディライト	2	2	5,964	
スプリックス	0.5	0.7	520		東京ドーム	6.3	6.7	5,078		ナック	1.2	1.1	888	
マネジメントソリューションズ	-	0.2	579		西尾レントオール	1.7	1.7	3,954		ニチイ学館	2.4	2.5	2,790	
アドバンテッジリスクマネジメント	0.7	0.9	611		トランス・コスモス	1.9	1.6	3,462		ダイセキ	2.7	2.7	6,596	
リログループ	8.9	8.9	21,502		乃村工藝社	3.8	7	6,223		ステップ	0.5	0.5	667	
東祥	1	1.2	1,513		藤田観光	0.7	0.8	1,372		合計	千株	千株	千円	
エイチ・アイ・エス	2.9	2.6	4,550		KNT-CTホールディングス	1	1.3	1,088		株数・金額	19,707.32	19,894.2	33,599,475	
ラックランド	0.3	0.5	780		日本管財	1.7	1.8	3,092		銘柄数<比率>	2,071銘柄	2,095銘柄	<99.1%>	
共立メンテナンス	2.5	2.7	7,919		トーカイ	1.6	1.6	3,739						
イチネンホールディングス	1.7	1.8	1,843		白洋舎	0.2	0.2	490						
建設技術研究所	1.1	1.2	1,800		セコム	17.3	17.2	144,617						
スペース	1	1.1	1,046		セントラル警備保障	0.8	0.8	2,928						
長大	0.7	0.6	484		丹青社	3.1	3.1	2,805						
燦ホールディングス	0.3	0.6	654		メイテック	2.1	2	9,290						
スバル興業	0.1	0.1	680		応用地質	1.8	1.8	2,248						

(注1) 銘柄欄の()内は、期末の国内株式
評価額に対する各業種の比率です。
(注2) 合計欄の< >内は、期末の純資産総
額に対する評価額の比率です。
(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(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
国内	T O P I X	百万円 267	百万円 -

■投資信託財産の構成

2020年3月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 33,599,475	% 98.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	502,570	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	34,102,046	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

(2020年3月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	34,102,046,873円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	358,242,152
株 式(評価額)	33,599,475,960
未 収 配 当 金	86,953,761
差 入 委 託 証 拠 金	57,375,000
(B) 負 債	186,220,590
未 払 金	35,572,590
未 払 解 約 金	150,648,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	33,915,826,283
元 本	20,048,805,260
次 期 繰 越 損 益 金	13,867,021,023
(D) 受 益 権 総 口 数	20,048,805,260口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	16,917円

(注1) 期首元本額 21,352,396,579円
追加設定元本額 8,763,346,083円
一部解約元本額 10,066,937,402円

(注2) 期末における元本の内訳
MHAMスリーウェイオープン 864,954,698円
MHAM TOPIXオープン 4,044,943,213円
MHAM日本株式インデックスファンド(ファンドラップ) 11,932,247,026円
動的パッケージファンド<DC年金> 8,471,995円
コア資産形成ファンド 6,658,225円
MHAM TOPIXファンドVA(適格機関投資家専用) 123,669,533円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定] 1,286,054,747円
MHAM日本株式パッシブファンド[適格機関投資家限定] 1,781,805,823円
期末元本合計 20,048,805,260円

■損益の状況

当期 自2019年3月12日 至2020年3月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,111,498,619円
受 取 配 当 金	1,110,880,562
受 取 利 息	844
そ の 他 収 益 金	1,112,367
支 払 利 息	△495,154
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,553,423,717
売 買 益	2,182,757,314
売 買 損	△6,736,181,031
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△12,594,404
取 引 益	173,602,550
取 引 損	△186,196,954
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,454,519,502
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	18,254,634,306
(F) 解 約 差 損 益 金	△8,999,646,598
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,066,552,817
(H) 合 計(D+E+F+G)	13,867,021,023
次 期 繰 越 損 益 金(H)	13,867,021,023

(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。

MHAM外国株式インデックスマザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年5月8日）

（計算期間 2019年5月9日～2020年5月8日）

MHAM外国株式インデックスマザーファンドの第12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	2008年6月3日から無期限です。
運用方針	MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ※税引き前配当再投資ベースとします（以下同じ）。
主要投資対象	MSCIコクサイ・インデックスを構成している国（地域を含みます。）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		MSCIコクサイ・インデックス （円ベース・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	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
8期(2016年5月9日)	13,334	△14.8	2,221.98	△14.7	95.5	1.6	2.7	40,035
9期(2017年5月8日)	16,560	24.2	2,785.42	25.4	94.6	2.8	2.5	34,010
10期(2018年5月8日)	17,964	8.5	3,046.31	9.4	94.5	3.2	2.3	24,890
11期(2019年5月8日)	19,107	6.4	3,249.57	6.7	92.5	5.0	2.5	28,690
12期(2020年5月8日)	17,917	△6.2	3,054.30	△6.0	93.2	4.2	2.4	29,595

（注1）株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）は、基準価額への反映を考慮して前営業日（現地ベース）の値を用いております（小数第3位四捨五入）（以下同じ）。

（注3）MSCIコクサイ・インデックス（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCI Inc. が開発した指数です。同指数に関する著作権、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）。

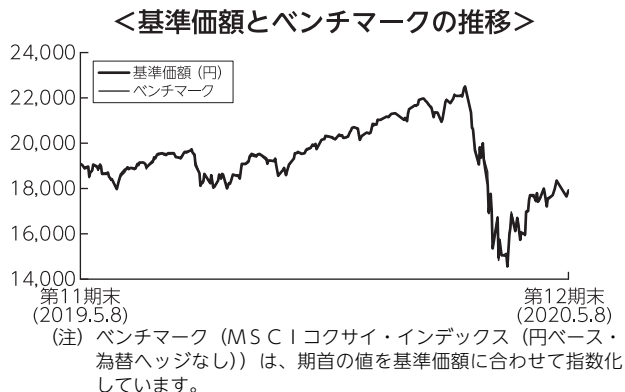
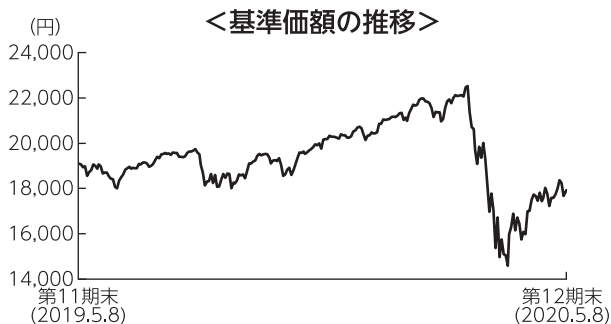
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCIコクサイ・インデックス (円ベース・為替ヘッジなし)		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 受益証券、 投資証券 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2019年 5月 8日	円	%		%	%	%	%
	19,107	—	3,249.57	—	92.5	5.0	2.5
5月末	18,412	△3.6	3,140.70	△3.4	92.7	4.7	2.6
6月末	19,077	△0.2	3,240.27	△0.3	93.9	3.5	2.6
7月末	19,597	2.6	3,328.93	2.4	93.9	3.4	2.6
8月末	18,620	△2.5	3,165.56	△2.6	93.5	3.7	2.8
9月末	19,220	0.6	3,275.15	0.8	93.0	4.4	2.7
10月末	19,983	4.6	3,394.32	4.5	93.2	4.1	2.7
11月末	20,724	8.5	3,523.71	8.4	92.8	4.5	2.6
12月末	21,349	11.7	3,631.40	11.8	94.4	2.9	2.6
2020年 1月末	21,374	11.9	3,624.06	11.5	93.9	3.3	2.7
2月末	19,693	3.1	3,369.37	3.7	93.8	1.7	2.7
3月末	16,726	△12.5	2,833.70	△12.8	90.1	7.4	2.5
4月末	18,364	△3.9	3,121.08	△4.0	93.2	4.3	2.5
(期 末) 2020年 5月 8日	17,917	△6.2	3,054.30	△6.0	93.2	4.2	2.4

(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（2019年5月9日から2020年5月8日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は17,917円となり、前期末比で6.2%下落しました。

基準価額の主な変動要因

株式市場は2020年2月までは堅調に推移しましたが、新型コロナウイルスの影響から多くの市場が下落したことに加え、為替市場ではほとんどの通貨が対円で下落しマイナスの寄与となったことから、当ファンドの基準価額は下落しました。

投資環境

先進国株式市場は米国による対中追加関税に対する不透明感などから上値の重い展開となりましたが、10月中旬以降は米中通商協議の進展期待から上昇傾向となりました。2020年も米中通商協議の第一段階の合意署名を受け上昇しましたが、2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され大きく下落しました。3月下旬以降は反発しましたが、前期末と比べて下落して期末を迎えました。

為替市場では、米ドルは米中通商協議を巡る混乱からドル安円高が進行したものの、2019年8月に対中追加関税の一部発動延期等をきっかけとしてドル高円安基調となりました。2月下旬以降は新型コロナウイルスの感染拡大による経済への影響が懸念され為替は乱高下し、期末時点では前期末と比べてドル安円高となりました。ユーロも円に対して弱含み前期末比で円高となりました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円ベース、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。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末に比べて6.0%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマークを0.2%程度下回りました。この差異は、主に保有株式の配当に対する課税などのマイナス要因によるものです。

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ます。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) (投資信託受益証券) (投資証券)	2円 (1) (0) (0) (0)	0.009% (0.007) (0.002) (0.000) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (投資信託受益証券) (投資証券)	4 (4) (0) (0)	0.022 (0.022) (0.000) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (その他)	18 (12) (6)	0.093 (0.061) (0.032)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	24	0.124	
期中の平均基準価額は19,339円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 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。

■ 売買及び取引の状況 (2019年5月9日から2020年5月8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 12,070.7 (61.59)	千アメリカ・ドル 99,984 (△866)	百株 9,553.92	千アメリカ・ドル 76,048
	カ ナ ダ	百株 1,478.88 (△16.05)	千カナダ・ドル 7,720 (△26)	百株 1,235.66	千カナダ・ドル 5,809
	オーストラリア	百株 3,687.7 (△1.58)	千オーストラリア・ドル 5,451 (△6)	百株 2,672.79	千オーストラリア・ドル 4,013
	香 港	百株 3,109 (73.45)	千香港・ドル 14,486 (-)	百株 2,465.85	千香港・ドル 10,967
	シ ン ガ ポ ー ル	百株 1,010 (-)	千シンガポール・ドル 719 (-)	百株 1,120.29	千シンガポール・ドル 460
国	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	百株 267.5 (-)	千ニューージーランド・ドル 187 (-)	百株 117.11	千ニューージーランド・ドル 79

		買 付		売 付			
		株 数	金 額	株 数	金 額		
外	イ ギ リ ス	百株 12,387.82 (△405.83)	千イギリス・ポンド 7,430 (△18)	百株 17,119.03	千イギリス・ポンド 5,316		
	イ ス ラ エ ル	百株 240.97 (5.73)	千イスラエル・シケル 656 (-)	百株 246.53	千イスラエル・シケル 332		
	ス イ ス	百株 751.96 (-)	千スイス・フラン 5,111 (△16)	百株 627.86	千スイス・フラン 3,934		
	デ ン マ ー ク	百株 133.16 (-)	千デンマーク・クローネ 6,568 (-)	百株 109.54	千デンマーク・クローネ 5,330		
	ノ ル ウ ェ ー	百株 235.77 (-)	千ノルウェー・クローネ 3,027 (-)	百株 149.86	千ノルウェー・クローネ 2,383		
	ス ウ ェ ー デ ン	百株 1,039.86 (19.55)	千スウェーデン・クローナ 14,218 (△7)	百株 838.12	千スウェーデン・クローナ 10,625		
	国	ユ	ア イ ル ラ ン ド	百株 97.08 (0.07)	千ユーロ 203 (-)	百株 34.72	千ユーロ 149
			オ ラ ン ダ	百株 835.01 (-)	千ユーロ 3,514 (-)	百株 717.58	千ユーロ 2,711
			ベ ル ギ ー	百株 111.8 (-)	千ユーロ 754 (-)	百株 95.52	千ユーロ 542
		ロ	ル ク セ ン ブ ル グ	百株 81.24 (-)	千ユーロ 128 (-)	百株 30.61	千ユーロ 75
フ ラ ン ス			百株 1,082.7 (4.02)	千ユーロ 5,028 (△1)	百株 914.63	千ユーロ 3,802	
ド イ ツ			百株 1,068.68 (4.32)	千ユーロ 4,428 (△16)	百株 840.29	千ユーロ 3,309	
ポ ル ト ガ ル			百株 97.98 (-)	千ユーロ 47 (-)	百株 69.29	千ユーロ 25	
ス ペ イ ン			百株 2,106.55 (778.58)	千ユーロ 1,444 (15)	百株 2,335.82	千ユーロ 1,069	
イ タ リ ア			百株 1,668.94 (-)	千ユーロ 857 (-)	百株 837.76	千ユーロ 603	

			買 付		売 付	
			株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ユ ー ロ	フィンランド	百株 396.71 (3.36)	千ユーロ 439 (-)	百株 275.38	千ユーロ 271
		オーストリア	百株 13.35 (-)	千ユーロ 46 (△3)	百株 9.08	千ユーロ 28

(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) 投資信託受益証券、投資証券

銘柄	買付額		売付額	
	□数	金額	□数	金額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.664	100	0.503	72
	(-)	(-)	(-)	(-)
BOSTON PROPERTIES INC	0.713	97	0.671	88
	(-)	(-)	(-)	(-)
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	1.699	71	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	9.679	88	8.319	74
	(-)	(-)	(-)	(-)
PROLOGIS INC	2.614	224	2.076	170
	(0.828)	(-)	(-)	(-)
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.81	171	0.708	145
	(-)	(-)	(-)	(-)
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.223	23	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUINIX INC	0.357	199	0.239	133
	(-)	(-)	(-)	(-)
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.487	26	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
DUKE REALTY TRUST	3.039	99	2.145	67
	(-)	(-)	(-)	(-)
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	1.653	234	1.257	176
	(-)	(-)	(-)	(-)
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.233	74	0.232	64
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY RESIDENTIAL	1.342	112	1.135	88
	(-)	(-)	(-)	(-)
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.589	78	0.352	46
	(-)	(-)	(-)	(-)
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3.176	108	2.026	67
	(-)	(-)	(-)	(-)
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.32	81	0.244	63
	(-)	(-)	(-)	(-)
WELLTOWER INC	1.209	103	0.66	52
	(-)	(-)	(-)	(-)
KIMCO REALTY	0.854	15	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.698	35	0.34	21
	(△1.227)	(-)	(-)	(-)
IRON MOUNTAIN INC	0.703	22	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
THE MACERICH COMPANY	0.756	25	1.379	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1.459	156	0.749	66
	(0.758)	(-)	(-)	(-)
HOST HOTELS & RESORTS INC	1.723	29	2.211	32
	(-)	(-)	(-)	(-)

銘柄	買付額		売付額	
	□数	金額	□数	金額
アメリカ	千□	千アメリカ・ドル	千□	千アメリカ・ドル
MID AMERICA	0.912	114	0.746	93
	(-)	(-)	(-)	(-)
REALTY INCOME CORP	1.436	107	1.126	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
REGENCY CENTERS CORP	0.727	49	0.623	35
	(-)	(-)	(-)	(-)
UDR INC	1.964	87	1.494	65
	(-)	(-)	(-)	(-)
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.816	128	0.503	69
	(-)	(-)	(-)	(-)
PUBLIC STORAGE	0.408	100	0.289	59
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUN COMMUNITIES INC	1.136	158	0.406	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
VENTAS INC	1.419	99	1.036	65
	(-)	(-)	(-)	(-)
VORNADO REALTY TRUST	1.114	73	1.285	74
	(-)	(-)	(-)	(-)
WEYERHAEUSER CO	1.744	48	1.264	36
	(-)	(-)	(-)	(-)
EXTRA SPACE STORAGE INC	1.253	142	0.974	107
	(-)	(-)	(-)	(-)
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.956	127	0.353	42
	(-)	(-)	(-)	(-)
MEDICAL PROPERTIES TRUST	3.874	80	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AGNC INVESTMENT CORP	1.045	18	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
VEREIT INC	3.32	31	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
AMERICAN TOWER CORP	1.857	411	1.412	309
	(-)	(-)	(-)	(-)
WP CAREY INC	1.35	106	0.805	62
	(-)	(-)	(-)	(-)
INVITATION HOMES INC	3.498	91	0.953	21
	(-)	(-)	(-)	(-)
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	-	-	0.945	18
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICI PROPERTIES INC	3.569	87	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
カナダ	千□	千カナダ・ドル	千□	千カナダ・ドル
CANADIAN APT PPTYS REIT	1.327	73	0.956	53
	(-)	(-)	(-)	(-)
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	-	-	-	-
	(1.227)	(26)	(-)	(-)
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
MIRVAC GROUP	26.237	82	25.804	69
	(-)	(-)	(-)	(-)

銘柄	買付額		売付額	
	□数	金額	□数	金額
オーストラリア	千□	千オーストラリア・ドル	千□	千オーストラリア・ドル
GPT GROUP	5.714	35	8.18	47
	(-)	(-)	(-)	(-)
STOCKLAND	10.059	44	14.765	68
	(-)	(-)	(-)	(-)
DEXUS	3.103	38	3.995	48
	(-)	(-)	(-)	(-)
GOODMAN GROUP	3.903	54	2.128	30
	(-)	(-)	(-)	(-)
VICINITY CENTRES	16.882	44	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
SCENTRE GROUP	13.674	55	14.242	49
	(-)	(-)	(-)	(-)
香港	千□	千香港・ドル	千□	千香港・ドル
LINK REIT	6	551	4.8	366
	(-)	(-)	(-)	(-)
HKT TRUST AND HKT LTD	12	150	-	-
	(-)	(-)	(-)	(-)
シンガポール	千□	千シンガポール・ドル	千□	千シンガポール・ドル
CAPITALAND MALL TRUST	14.5	38	15.3	29
	(-)	(-)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INV T	16	50	16.8	51
	(-)	(△0.35753)	(-)	(-)
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	44.2	90	38.5	76
	(-)	(-)	(-)	(-)
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR	-	-	-	-
	(-)	(△0.09104)	(-)	(-)
MAPLE TREE COMMERCIAL TRUST	14.1	34	-	-
	(-)	(△0.00423)	(-)	(-)
ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-RTS	-	-	3.883	0.96406
	(3.883)	(-)	(-)	(-)
イギリス	千□	千イギリス・ポンド	千□	千イギリス・ポンド
HAMMERSON PLC	-	-	4.94	13
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (オランダ)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD	0.6	78	0.589	72
	(-)	(-)	(-)	(-)
ユーロ (フランス)	千□	千ユーロ	千□	千ユーロ
GECINA SA	0.21	29	0.195	31
	(-)	(-)	(-)	(-)

(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。

(3) 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 14,584	百万円 14,648	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	28,091,549千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	31,956,895千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.87

(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 (2019年5月9日から2020年5月8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 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	
AMAZON.COM INC	27.7	31.84	7,538	801,791	インターネット販売・通信販売
ABBOTT LABORATORIES	116.44	133.91	1,258	133,866	ヘルスケア機器・用品
AES CORP	39.02	52.97	64	6,828	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ABIOMED INC	2.99	2.84	53	5,688	ヘルスケア機器・用品
INTL BUSINESS MACHINES CORP	60.71	66.98	811	86,364	情報技術サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	63.14	80.22	416	44,324	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	32.66	36.65	1,344	142,974	ソフトウェア
CHUBB LTD	30.34	34.23	338	36,039	保険
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14.77	16.73	379	40,356	化学
ALLEGHANY CORP	0.88	1.24	63	6,740	保険
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	5.1	63	6,705	バイオテクノロジー
RALPH LAUREN CORP	3.25	2.87	20	2,143	繊維・アパレル・贅沢品
ALLSTATE CORP	23.21	24.53	247	26,311	保険
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	49.15	54.1	718	76,408	コングロマリット
AMGEN INC	43.19	44.93	1,048	111,502	バイオテクノロジー
HESS CORP	19.4	20.05	93	9,894	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN EXPRESS CO	48.65	52.76	457	48,669	消費者金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	32.14	38.52	302	32,202	電力
AFLAC INC	50.32	55.74	199	21,265	保険
AMERICAN INTL GROUP	60.06	60.11	153	16,315	保険
AMERCO	0.51	0.51	14	1,538	陸運・鉄道
ANALOG DEVICES	25.4	28.64	304	32,395	半導体・半導体製造装置
ANADARKO PETROLEUM CORP	34.4	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	15.16	17.01	164	17,534	バイオテクノロジー
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	61.95	57.8	164	17,532	建設関連製品
JONES LANG LASALLE INC	2.82	4.06	41	4,445	不動産管理・開発
VALERO ENERGY CORP	28.73	27.8	170	18,113	石油・ガス・消耗燃料
APACHE CORP	27.87	27.01	32	3,412	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	6.07	6.5	169	18,027	ソフトウェア
APPLE INC	316.09	335.77	10,198	1,084,731	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS INC	65.81	70.5	361	38,429	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	6.39	7.2	43	4,574	化学
ARCHER—DANIELS—MIDLAND CO	38.11	40.96	142	15,143	食品
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	6.56	7.33	52	5,594	電力
AMEREN CORP	16.62	20.5	142	15,186	総合公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	5.12	5.24	32	3,463	電子装置・機器・部品
AUTOLIV INC	5.1	6.15	35	3,791	自動車部品
AUTODESK INC	14.69	16.75	308	32,780	ソフトウェア
AUTOMATIC DATA PROCESSING	29.26	32.81	484	51,566	情報技術サービス
AUTOZONE INC	1.8	1.67	169	17,978	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	5.13	6.58	68	7,300	容器・包装
BALL CORP	22.96	23.67	155	16,588	容器・包装
BERKSHIRE HATHAWAY INC—CL B	85.88	99.3	1,722	183,221	各種金融サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	66.94	63.29	220	23,459	資本市場
BAXTER INTERNATIONAL INC	34.36	37.24	329	35,029	ヘルスケア機器・用品
BECTON DICKINSON & CO	17.88	20.59	527	56,117	ヘルスケア機器・用品
AMETEK INC	16.78	16.06	133	14,230	電気設備
VERIZON COMM INC	273.84	313	1,739	185,029	各種電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	8.53	11.98	61	6,514	保険
BEST BUY CO INC	17.61	16.9	128	13,705	専門小売り
BIO-RAD LABORATORIES-CL A	-	1.59	73	7,786	ライフサイエンス・ツール/サービス
YUM! BRANDS INC	21.75	22.42	189	20,173	ホテル・レストラン・レジャー
FIRSTENERGY CORP	33.06	39.65	159	16,957	電力
H&R BLOCK INC	12.08	-	-	-	各種消費者サービス
BOEING CO	35.77	40.48	520	55,389	航空宇宙・防衛
ROBERT HALF INTL INC	7.21	10.54	47	5,062	専門サービス
BORGWARNER INC	12.26	15.82	44	4,684	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	93.02	106.28	393	41,824	ヘルスケア機器・用品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	10	9.31	66	7,124	航空貨物・物流サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	6.7	7.8	100	10,683	娯楽
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL INC	1.82	1.81	132	14,106	ライフサイエンス・ツール/サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	108.95	177.19	1,081	115,035	医薬品
AFFILIATED MANAGERS GROUP INC	3.16	-	-	-	資本市場
INGREDION INC	4.17	4.18	33	3,597	食品
ONEOK INC	28	33.6	99	10,631	石油・ガス・消耗燃料
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	4.41	6.44	40	4,265	保険
UNITED RENTALS INC	4.88	6.57	74	7,877	商社・流通業
SEMPRA ENERGY	17.96	21.46	265	28,241	総合公益事業
FEDEX CORP	17.07	18.87	220	23,429	航空貨物・物流サービス
VERISIGN INC	7.89	8.26	174	18,605	情報技術サービス
AMPHENOL CORP	20.93	23.28	203	21,601	電子装置・機器・部品
BROWN-FORMAN CORP	15.6	23.22	150	15,966	飲料
SIRIUS XM HOLDINGS INC	92.54	97.08	53	5,699	メディア
CSX CORP	54.71	55.91	357	38,010	陸運・鉄道
CABOT OIL & GAS CORP	25.82	31.92	63	6,783	石油・ガス・消耗燃料
CAMPBELL SOUP CO	10.59	10.72	53	5,728	食品
SEAGATE TECHNOLOGY	16.06	18.96	92	9,824	コンピュータ・周辺機器
CONSTELLATION BRANDS INC	11.23	12.73	209	22,309	飲料
CARDINAL HEALTH INC	21.24	21.59	104	11,141	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARNIVAL CORP COMMON PAIRED	29.02	30.08	40	4,328	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC	39.84	41.88	449	47,790	機械
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	8.82	8.65	92	9,863	ソフトウェア
CELGENE CORP	47.45	-	-	-	バイオテクノロジー
CITRIX SYSTEMS INC	9.61	9.19	138	14,728	ソフトウェア
CENTURYLINK INC	67.6	72.53	69	7,344	各種電気通信サービス
CERNER CORP	20.58	24.48	163	17,442	ヘルスケア・テクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	219.97	236.55	2,157	229,479	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	16.81	18.48	133	14,226	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11.05	12.4	68	7,255	保険
CINTAS CORP	6.5	6.54	139	14,843	商業サービス・用品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
CISCO SYSTEMS INC	298.61	321.53	1,330	141,476	通信機器
CLOROX COMPANY	8.67	9.45	190	20,302	家庭用品
COCA-COLA CO/THE	267.63	307.73	1,372	145,976	飲料
COPART INC	12.31	16.9	137	14,658	商業サービス・用品
COGNEX CORP	10.14	13.31	74	7,885	電子装置・機器・部品
COLGATE-PALMOLIVE CO	55.21	61.93	426	45,317	家庭用品
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	20.23	21.65	186	19,798	ホテル・レストラン・レジャー
COMERICA INC	11.16	11.71	37	4,031	銀行
NRG ENERGY, INC.	17.88	19.89	63	6,794	電力
COMCAST CORP-CL A	304.71	343.99	1,223	130,175	メディア
CONAGRA BRANDS INC	33.99	36.11	119	12,739	食品
CONSOLIDATED EDISON INC	20.61	24.79	183	19,529	総合公益事業
CMS ENERGY CORP	20.29	23.85	130	13,835	総合公益事業
COOPER COS INC	3.52	4.03	122	13,026	ヘルスケア機器・用品
MOLSON COORS BEVERAGE CO	13.82	11.3	42	4,519	飲料
CORNING INC	54.7	53.34	111	11,885	電子装置・機器・部品
SEALED AIR CORP	9.33	15.52	44	4,709	容器・包装
HEICO CORP-CL A	-	5.23	35	3,751	航空宇宙・防衛
CUMMINS INC	10.69	10.57	164	17,506	機械
DR HORTON INC	26.14	25.77	121	12,926	家庭用耐久財
DANAHER CORP	41.89	47.27	772	82,191	ヘルスケア機器・用品
MOODY'S CORP	11.72	12.8	317	33,720	資本市場
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS	39.17	41.65	244	26,030	情報技術サービス
TARGET CORP	33.36	38.51	436	46,431	複合小売り
DEERE & CO	20.57	22.72	308	32,864	機械
MORGAN STANLEY	87.98	91.42	354	37,736	資本市場
REPUBLIC SERVICES INC	15.68	18.32	148	15,823	商業サービス・用品
COSTAR GROUP INC	2.68	2.83	180	19,233	専門サービス
THE WALT DISNEY CO	119.94	136.47	1,440	153,234	娯楽
DOLLAR TREE INC	16.16	18.42	141	15,024	複合小売り
DOVER CORP	10.75	10.27	93	9,947	機械
OMNICOM GROUP	15.47	16.93	90	9,657	メディア
DTE ENERGY CO	12.17	14.1	139	14,804	総合公益事業
DUKE ENERGY CORP	46.75	53.63	430	45,809	電力
FLOWERVE CORP	8.11	13.74	37	4,008	機械
DARDEN RESTAURANTS INC	8.72	8.88	62	6,661	ホテル・レストラン・レジャー
EBAY INC	63.88	57.51	237	25,305	インターネット販売・通信販売
BANK OF AMERICA CORP	618.04	644.26	1,471	156,507	銀行
CITIGROUP INC	161.99	164.03	732	77,879	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO	10.87	10.87	65	6,991	化学
E*TRADE FINANCIAL CORP	19.04	19.29	77	8,200	資本市場
EATON CORP PLC	29.64	30.9	248	26,377	電気設備
EATON VANCE CORP	6.99	6.42	23	2,456	資本市場
CADENCE DESIGN SYS INC	20.03	21.76	177	18,832	ソフトウェア
DISH NETWORK CORP	13.51	17.71	41	4,398	メディア
ECOLAB INC	17.13	19.64	381	40,549	化学
PERKINELMER INC	-	8.52	79	8,405	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ELECTRONIC ARTS INC	20.46	20.66	241	25,665	娯楽
SALESFORCE.COM INC	50.63	62.98	1,070	113,808	ソフトウェア
ERIE INDEMNITY CO	—	1.88	34	3,692	保険
EMERSON ELECTRIC CO	42.62	44.83	247	26,348	電気設備
ATMOS ENERGY CORP	8.18	8.94	86	9,164	ガス
ENTERGY CORP	12.44	14.4	133	14,208	電力
EOG RESOURCES INC	39.04	43.44	209	22,320	石油・ガス・消耗燃料
EQUIFAX INC	7.09	8.88	131	14,007	専門サービス
ESTEE LAUDER COS INC/THE	14.89	15.76	270	28,821	パーソナル用品
EXPEDITORS INTERNATIONAL	12.64	13.28	98	10,505	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	281.32	318.65	1,409	149,936	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	9.85	10.69	100	10,700	化学
NEXTERA ENERGY INC	30.98	36.92	828	88,149	電力
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	2.69	74	7,889	資本市場
ASSURANT INC	3.27	5.11	50	5,358	保険
FASTENAL CO	19.91	44.71	170	18,155	商社・流通業
FIFTH THIRD BANCORP	47.57	54.88	95	10,115	銀行
M&T BANK CORP	9.26	9.22	93	9,965	銀行
FISERV INC	27.43	43.79	469	49,984	情報技術サービス
FLIR SYSTEMS INC	8.5	8.47	40	4,315	電子装置・機器・部品
MACY'S INC	18.06	—	—	—	複合小売り
FORD MOTOR CO	253.23	306.27	149	15,863	自動車
FRANKLIN RESOURCES INC	23.58	23.58	42	4,549	資本市場
FREEMPORT—MCMORAN INC	96.42	121.3	108	11,572	金属・鉱業
FLEX LTD	33.05	38.09	35	3,767	電子装置・機器・部品
ARTHUR J GALLAGHER & CO	12.8	13.48	115	12,241	保険
GAP INC/THE	13.63	26.72	19	2,108	専門小売り
DENTSPLY SIRONA INC	13.05	18.36	75	8,018	ヘルスケア機器・用品
GENERAL DYNAMICS CORP	16.65	18.92	240	25,582	航空宇宙・防衛
GENERAL MILLS INC	40.41	45.45	267	28,409	食品
GENUINE PARTS CO	10.45	9.85	72	7,723	販売
GILEAD SCIENCES INC	86.67	95.83	743	79,103	バイオテクノロジー
GARTNER INC	6.45	7.49	92	9,863	情報技術サービス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	13.9	—	—	—	自動車部品
MCKESSON CORP	13.53	11.18	150	16,002	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NVIDIA CORP	38.72	43.96	1,340	142,544	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	581.37	661.12	403	42,963	コンプロマリット
VWV GRAINGER INC	2.81	3.46	97	10,345	商社・流通業
HALLIBURTON CO	61.96	62.66	62	6,671	エネルギー設備・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	28.1	28.18	174	18,609	飲料
GOLDMAN SACHS GROUP INC	22.3	24.04	438	46,617	資本市場
HARLEY—DAVIDSON INC	9.78	5.42	11	1,178	自動車
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	16.85	307	32,705	航空宇宙・防衛
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7.99	—	—	—	航空宇宙・防衛
HASBRO INC	7.09	10.1	69	7,345	レジャー用品
HENRY SCHEIN INC	9	11.38	61	6,522	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HEICO CORP	—	2.56	21	2,316	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
HELMERICH & PAYNE INC	6.3	-	-	-	エネルギー設備・サービス
HERSHEY FOODS CORP	9.95	11.7	152	16,243	食品
HP INC	107.92	104.29	155	16,582	コンピュータ・周辺機器
F5 NETWORKS INC	3.56	5.01	71	7,604	通信機器
CROWN HOLDINGS INC NPR	7.95	10.53	65	6,995	容器・包装
UNITED THERAPEUTICS CORP	2.55	-	-	-	バイオテクノロジー
JUNIPER NETWORKS INC	26.24	26.24	60	6,452	通信機器
HOLLYFRONTIER CORP	9.84	12.21	34	3,676	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	19.69	21.99	116	12,381	ヘルスケア機器・用品
UNUM GROUP	12.85	17.07	25	2,679	保険
HOME DEPOT INC	75.13	82.52	1,893	201,384	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12.46	13.28	122	12,994	バイオテクノロジー
HORMEL FOODS CORP	17.12	20.97	97	10,391	食品
CENTERPOINT ENERGY INC	35.2	35.93	63	6,806	総合公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	2.13	2.9	55	5,941	建設関連製品
HUMANA INC	9.3	10.03	372	39,622	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	5.13	6.81	68	7,250	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	80.25	86.07	71	7,552	銀行
RED HAT INC	11.75	-	-	-	ソフトウェア
NEKTAR THERAPEUTICS	10.61	-	-	-	医薬品
BIOGEN INC	13.51	13.67	429	45,655	バイオテクノロジー
IDEX CORP	5.81	6.08	93	9,919	機械
ILLINOIS TOOL WORKS	20.39	24.62	386	41,098	機械
INTUIT INC	16.44	19.71	553	58,865	ソフトウェア
IDEXX LABORATORIES INC	6.06	5.95	175	18,622	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	-	8.53	45	4,832	バイオテクノロジー
TRANE TECHNOLOGIES PLC	16.63	16.54	134	14,254	建設関連製品
INTEL CORP	303.22	329.1	1,947	207,113	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5.01	7.31	95	10,129	化学
INTERNATIONAL PAPER CO	27.1	27.61	90	9,573	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	22.56	32.46	52	5,617	メディア
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7.51	9.53	74	7,961	建設・土木
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	4.52	6.11	112	11,945	情報技術サービス
INCYTE CORP	10.63	13.52	130	13,872	バイオテクノロジー
JOHNSON & JOHNSON	178.2	199.04	2,937	312,446	医薬品
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	25.05	28.77	100	10,682	保険
KLA CORPORATION	10.88	11.08	181	19,308	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORP	31.89	23.68	28	3,024	石油・ガス・消耗燃料
KELLOGG CO	18.3	18.29	114	12,195	食品
EAST WEST BANCORP INC	12.1	12.1	39	4,239	銀行
KEYCORP	73.69	69.59	74	7,964	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	23.31	26.17	357	38,049	家庭用品
BLACKROCK INC/NEW YORK	8.05	8.69	432	45,972	資本市場
KOHL'S CORP	9.83	12.91	23	2,457	複合小売り
KROGER CO	53.1	62.39	203	21,685	食品・生活必需品小売り
LAM RESEARCH CORP	10.68	11.09	274	29,208	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	-	2.77	88	9,434	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	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
PACKAGING CORP OF AMERICA	5.55	8.25	77	8,229	容器・包装
AKAMAI TECHNOLOGIES	12.3	13.31	133	14,241	情報技術サービス
LEGGETT & PLATT INC	7.65	9.67	25	2,763	家庭用耐久財
LENNAR CORP	21.15	20.48	104	11,074	家庭用耐久財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	17.74	17.74	23	2,528	各種金融サービス
ELI LILLY & CO	61.89	65.42	1,000	106,437	医薬品
L BRANDS INC	13.87	—	—	—	専門小売り
LINCOLN NATIONAL CORP	16.11	15.71	54	5,809	保険
UNITED PARCEL SERVICE—CL B	46.32	53.09	492	52,417	航空貨物・物流サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	22.06	23.21	182	19,378	ライフサイエンス・ツール/サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	17.09	19.23	724	77,013	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	19.56	18.2	55	5,873	保険
LOWE'S COS INC	54.44	58.21	651	69,292	専門小売り
DOMINION ENERGY INC	49.57	62.77	490	52,141	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	36.2	37.52	56	5,958	ホテル・レストラン・レジャー
MCCORMICK & CO INC	8.33	9.2	147	15,740	食品
MCDONALD'S CORPORATION	51.54	57.06	1,033	109,919	ホテル・レストラン・レジャー
S&P GLOBAL INC	16.91	18.45	545	58,002	資本市場
EVEREST RE GROUP LTD	2.4	3.21	55	5,934	保険
MANPOWERGROUP INC	3.81	3.81	26	2,771	専門サービス
MARKEL CORPORATION	0.98	1.02	85	9,069	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP NPR	13.99	15.89	346	36,850	ヘルスケア機器・用品
MARSH & MCLENNAN COS	32.81	38.36	389	41,472	保険
MASCO CORP	23.49	19.97	82	8,825	建設関連製品
MARTIN MARIETTA MATERIALS INC	3.7	4.5	80	8,600	建設資材
MATTEL INC	21.46	—	—	—	レジャー用品
METLIFE INC	56.99	58.91	202	21,578	保険
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	19.47	18.92	99	10,635	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	89.42	101.38	1,003	106,684	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	48.04	58.29	426	45,319	娯楽
CVS HEALTH CORP	86.22	98.57	605	64,423	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MERCK & CO.INC.	172.04	192.65	1,456	154,906	医薬品
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	25.1	24.18	38	4,109	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	7.24	7.16	114	12,198	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MICROSOFT CORP	484.12	547.52	10,052	1,069,180	ソフトウェア
MICRON TECH INC	76.91	84.31	392	41,778	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	3.28	5.57	32	3,508	機械
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	16.23	17.76	151	16,150	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	36.5	45.76	120	12,868	半導体・半導体製造装置
3M CO	39.04	43.68	636	67,707	コングロマリット
MOHAWK INDUSTRIES INC	3.74	5.27	42	4,504	家庭用耐久財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	11.74	13.25	180	19,195	通信機器
KANSAS CITY SOUTHERN	7.48	7.69	100	10,741	陸運・鉄道
MYLAN NV	35.57	37.91	65	6,983	医薬品
ILLUMINA INC	9.96	11.13	348	37,095	ライフサイエンス・ツール/サービス
XCEL ENERGY INC	34.51	39.49	236	25,184	電力
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	6.96	75	8,064	バイオテクノロジー

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	28.26	29.3	36	3,848	エネルギー設備・サービス
NETAPP INC	18.02	19.8	85	9,057	コンピュータ・周辺機器
NEWELL BRANDS INC	27.82	27.82	33	3,562	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	32.51	59.34	383	40,746	金属・鉱業
NVR INC	0.2	0.27	81	8,615	家庭用耐久財
NIKE INC—CL B	85.42	94.25	834	88,776	繊維・アパレル・贅沢品
NOBLE ENERGY INC	28.25	46.25	40	4,358	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	6.89	6.89	11	1,267	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	18.83	19.74	334	35,604	陸運・鉄道
EVERSOURCE ENERGY	21.63	24.25	188	20,025	電力
NISOURCE INC	21.34	32.8	75	7,988	総合公益事業
TAPESTRY INC	16.94	24.54	35	3,784	繊維・アパレル・贅沢品
NORTHERN TRUST CORP	14.81	16.26	120	12,787	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	10.91	11.9	385	41,025	航空宇宙・防衛
WELLS FARGO & CO	295.91	303.35	765	81,402	銀行
NUCOR CORP	22.42	18.99	77	8,262	金属・鉱業
CHENIERE ENERGY INC	15.09	15.12	65	6,948	石油・ガス・消耗燃料
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32.36	35.14	213	22,731	消費者金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	51.64	68.1	94	10,053	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3.62	7.65	114	12,181	陸運・鉄道
OGE ENERGY CORP	11.69	17.38	50	5,414	電力
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	5.4	5.86	226	24,086	専門小売り
ORACLE CORP	174.69	173.98	915	97,333	ソフトウェア
PACCAR INC	24.37	25.05	171	18,279	機械
PTC INC	6.59	9.26	65	6,978	ソフトウェア
EXELON CORP	63.66	74.72	261	27,847	電力
PARKER HANNIFIN CORP	9.3	9.27	144	15,379	機械
PAYCHEX INC	22.25	23.49	159	17,006	情報技術サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	5.27	5.12	109	11,626	ヘルスケア機器・用品
PPL CORPORATION	47.11	56.16	136	14,508	電力
PEPSICO INC	93.93	105.62	1,389	147,779	飲料
PENTAIR PLC	9.78	10.79	36	3,928	機械
PFIZER INC	382.37	418.63	1,547	164,566	医薬品
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	16	64	6,897	水道
CONOCOPHILLIPS	77.56	81.28	344	36,671	石油・ガス・消耗燃料
PVH CORP	4.54	4.45	19	2,032	繊維・アパレル・贅沢品
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11.59	12.87	111	11,911	石油・ガス・消耗燃料
ALTRIA GROUP INC	125.9	142.02	498	53,019	タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	31.08	32.94	333	35,486	銀行
BROWN & BROWN INC	—	16.07	59	6,346	保険
POLARIS INC	3.48	2.5	17	1,814	レジャー用品
GARMIN LTD	6.65	10.77	84	8,939	家庭用耐久財
FLUOR CORP (NEW)	8.72	—	—	—	建設・土木
PPG INDUSTRIES INC	16.38	16.91	152	16,251	化学
IPG PHOTONICS CORP	2.33	2.33	34	3,652	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORP	29.31	33.49	1,021	108,640	食品・生活必需品小売り
T ROWE PRICE GROUP INC	17.11	17.98	200	21,292	資本市場

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
QUEST DIAGNOSTICS	9.8	9.91	106	11,316	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	164.96	188.44	2,113	224,816	家庭用品
PROGRESSIVE CORP	38.52	44.46	333	35,432	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	33.35	38.95	186	19,810	総合公益事業
PULTE GROUP INC	15.87	20.43	57	6,123	家庭用耐久財
GLOBAL PAYMENTS INC	11.28	22.79	398	42,360	情報技術サービス
QUALCOMM INC	80.7	86.62	682	72,625	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	9.89	8.9	57	6,098	資本市場
EXACT SCIENCES CORP	—	12.17	100	10,724	バイオテクノロジー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2.35	3.43	51	5,459	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	5.36	6.15	344	36,619	バイオテクノロジー
REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC	3.73	5.04	46	4,935	保険
RESMED INC	9.94	10.49	168	17,929	ヘルスケア機器・用品
US BANCORP	102.25	112.79	385	41,027	銀行
SEATTLE GENETICS INC /WA	6.54	8.64	141	15,002	バイオテクノロジー
ARCH CAPITAL GROUP LTD	23.73	31.35	77	8,239	保険
ROSS STORES INC	25.34	26.97	242	25,773	専門小売り
ROLLINS INC	9.06	11.39	47	5,052	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	7.04	7.84	279	29,701	コンプロマリット
ROCKWELL AUTOMATION INC	8.59	8.35	159	16,964	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11.65	12.69	48	5,132	ホテル・レストラン・レジャー
RPM INTERNATIONAL INC	—	9.9	66	7,107	化学
RAYTHEON COMPANY	18.77	—	—	—	航空宇宙・防衛
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2.91	2.96	13	1,432	情報技術サービス
ACCENTURE PLC—CL A	42.47	48	898	95,524	情報技術サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	98.5	109.4	548	58,365	食品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	8.92	9.55	184	19,618	保険
THE TRAVELERS COMPANIES INC	17.93	19.83	189	20,205	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	22.14	46.48	601	63,990	情報技術サービス
BOOKING HOLDINGS INC	3.1	3.18	459	48,836	インターネット販売・通信販売
SCHLUMBERGER LTD	94.11	103.81	173	18,471	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	81.8	87.54	307	32,745	資本市場
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	13.81	15.34	183	19,480	ヘルスケア機器・用品
BUNGE LTD	8.28	10.99	39	4,251	食品
SEI INVESTMENTS CO	7.86	10.55	53	5,669	資本市場
ANTHEM INC	17.28	19.2	510	54,265	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	11.48	11.39	101	10,750	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	20.7	20.2	73	7,796	保険
SHERWIN—WILLIAMS CO/THE	5.72	6.23	329	35,023	化学
CENTENE CORP	27.6	44.47	287	30,559	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	3.14	4.23	77	8,262	銀行
IAC INTERACTIVE CORP	5.42	5.88	139	14,825	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SMITH (A.O.) CORP	8.51	8.24	35	3,795	建設関連製品
ACUITY BRANDS INC	2.37	4.12	34	3,708	電気設備
SNAP—ON INC	3.31	4.56	55	5,927	機械
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	28.38	30.33	172	18,297	保険
ADVANCE AUTO PARTS	4.36	5.09	60	6,475	専門小売り

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
EDISON INTERNATIONAL	22.13	25.1	136	14,557	電力
SOUTHERN CO	65.55	80.23	435	46,275	電力
TRUIST FINANCIAL CORP	52.15	100.96	355	37,841	銀行
SOUTHWEST AIRLINES	8.57	7.59	19	2,054	旅客航空輸送業
AT&T INC	482.31	552.37	1,595	169,728	各種電気通信サービス
CHEVRON CORP	127.28	142.52	1,320	140,427	石油・ガス・消耗燃料
STANLEY BLACK & DECKER INC	10.69	11.69	128	13,674	機械
STATE STREET CORP	25.88	27.65	161	17,127	資本市場
STARBUCKS CORP	82.45	89.57	680	72,402	ホテル・レストラン・レジャー
STEEL DYNAMICS INC	13.85	17.4	41	4,465	金属・鉱業
STRYKER CORP	22.52	25.6	492	52,329	ヘルスケア機器・用品
NETFLIX INC	29.1	33.16	1,447	153,959	娯楽
SUNTRUST BANKS INC	31.83	—	—	—	銀行
NORTONLIFELOCK INC	43.18	41.98	88	9,456	ソフトウェア
KNIGHT SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	8.43	8.43	31	3,344	陸運・鉄道
SYNOPSYS INC	9.04	11.65	185	19,694	ソフトウェア
SYSCO CORP	32.98	33.68	176	18,727	食品・生活必需品小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	7.66	8.77	470	49,991	ヘルスケア機器・用品
TELEFLEX INC	2.69	3.66	125	13,362	ヘルスケア機器・用品
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	65.28	86.32	99	10,604	医薬品
TERADYNE INC	—	13.74	85	9,123	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS INC	64.91	71.25	809	86,125	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	17.75	15.86	40	4,331	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26.88	30.29	1,027	109,239	ライフサイエンス・ツール/サービス
TIFFANY & CO	6.48	7.15	91	9,746	専門小売り
GLOBE LIFE INC	8.45	7.22	54	5,815	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11.6	—	—	—	情報技術サービス
DAVITA INC	7.85	7.85	62	6,692	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TRACTOR SUPPLY CO	7.16	8.05	84	9,004	専門小売り
TRIMBLE INC	14.7	16.73	60	6,485	電子装置・機器・部品
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	2.99	99	10,576	ソフトウェア
TYSON FOODS INC	20.35	22.78	130	13,873	食品
UGI CORP	10.21	18.6	52	5,564	ガス
MARATHON OIL CORP	61.43	59.77	32	3,502	石油・ガス・消耗燃料
UNION PACIFIC CORP	49.12	52.32	817	86,932	陸運・鉄道
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	54.44	113.48	646	68,809	航空宇宙・防衛
UNITEDHEALTH GROUP INC	63.89	71.61	2,040	217,068	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	5.05	5.73	55	5,882	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	6.61	6.46	75	8,034	ヘルスケア機器・用品
VF CORP	22.82	26.37	151	16,065	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOMCBS INC	23.55	39.52	64	6,901	メディア
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	17.21	19.52	527	56,058	バイオテクノロジー
VULCAN MATERIALS CO	9.47	9.51	97	10,335	建設資材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	53.81	58.71	238	25,389	食品・生活必需品小売り
WALMART INC	96.04	107.92	1,315	139,909	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	28.72	32.72	331	35,305	商業サービス・用品
WATERS CORP	5.52	5.29	98	10,464	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
ALLERGAN PLC	22.43	24.88	480	51,069	医薬品
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	5.87	116	12,359	ヘルスケア機器・用品
JM SMUCKER CO/THE—NEW	8.17	8.96	101	10,819	食品
VAIL RESORTS INC	2.37	3.28	56	5,983	ホテル・レストラン・レジャー
WESTERN DIGITAL CORP	17.15	22.14	92	9,854	コンピュータ・周辺機器
WABTEC CORP	8.23	13.19	72	7,752	機械
WHIRLPOOL CORP	3.8	4.91	52	5,582	家庭用耐久財
SKYWORKS SOLUTIONS INC	10.51	12.49	132	14,106	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	5.76	7.79	62	6,595	ホテル・レストラン・レジャー
NASDAQ INC	6.79	9.08	97	10,365	資本市場
CME GROUP INC	23.5	27.12	484	51,485	資本市場
WILLIAMS COS INC	81.67	92.27	177	18,852	石油・ガス・消耗燃料
LKQ CORP	18.7	24.81	62	6,649	販売
ALLIANT ENERGY CORP	17.59	18.2	84	8,950	電力
WEC ENERGY GROUP INC	21	22.92	195	20,752	総合公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	19.54	20.03	73	7,797	資本市場
CARMAX INC	10.39	13.66	99	10,587	専門小売り
XEROX CORP	13.47	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
XILINX INC	17	17.72	149	15,912	半導体・半導体製造装置
CIMAREX ENERGY CO	5.56	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TJX COMPANIES INC	83.54	92.1	446	47,509	専門小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP	—	3.64	85	9,053	電子装置・機器・部品
ZIONS BANCORP NA	15.32	15.32	45	4,818	銀行
DAIRY FARM INTERNATIONAL HLDNGS	20	20	9	1,021	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	68.49	68.49	27	2,950	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	16.28	16.28	72	7,724	コンプロマリット
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LTD	16.61	16.61	36	3,837	コンプロマリット
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	5.33	8.39	118	12,622	バイオテクノロジー
SIGNATURE BANK	3.24	2.7	27	2,877	銀行
CBRE GROUP INC	23.37	24.34	99	10,585	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC	11.82	11.82	25	2,751	メディア
WELLCARE HEALTH PLANS INC	2.94	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
REGIONS FINANCIAL CORP	70.44	66.11	65	6,925	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	2.34	3.03	111	11,832	ホテル・レストラン・レジャー
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2.36	2.36	9	1,042	化学
T—MOBILE US INC	22.74	32.46	309	32,898	無線通信サービス
LAS VEGAS SANDS CORP	26.94	22.8	108	11,487	ホテル・レストラン・レジャー
MOSAIC CO/THE	21.58	31.09	34	3,670	化学
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	2.63	126	13,447	資本市場
CELANESE CORP	9.87	9.86	79	8,426	化学
DEXCOM INC	5.2	6.42	259	27,610	ヘルスケア機器・用品
DISCOVERY INC—A	9.57	9.57	19	2,089	メディア
EXPEDIA GROUP INC	8.61	9.88	65	6,983	インターネット販売・通信販売
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	13.76	13.25	36	3,881	化学
AMERIPRISE FINANCIAL INC	10.09	9.28	112	12,015	資本市場
LIBERTY GLOBAL PLC—SERIES C	37.44	32.28	69	7,367	メディア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	38.01	42.23	393	41,812	資本市場

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC—CLASS A	10.33	10.33	9	1,055	繊維・アパレル・贅沢品
VIACOM INC—CLASS B	20.78	—	—	—	娯楽
LIVE NATION	8.62	8.34	32	3,492	娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1.47	2.04	183	19,473	ホテル・レストラン・レジャー
UNITED AIRLINES HOLIDINGS INC	4.08	6.9	15	1,669	旅客航空輸送業
TRANSDIGM GROUP INC	3.3	3.66	118	12,634	航空宇宙・防衛
MASTERCARD INC	61.23	67.78	1,887	200,751	情報技術サービス
QURATE RETAIL INC	25.34	—	—	—	インターネット販売・通信販売
HANESBRANDS INC	21.21	38.42	35	3,804	繊維・アパレル・贅沢品
WESTERN UNION CO	26.12	34.85	67	7,209	情報技術サービス
OWENS CORNING	6.53	10.82	45	4,798	建設関連製品
LEIDOS HOLDINGS INC	8.37	10.51	105	11,220	情報技術サービス
AERCAP HOLDINGS NV	7.38	10.53	29	3,163	商社・流通業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC	6.27	8.77	16	1,750	航空宇宙・防衛
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT—ADR	21	13.1	20	2,172	ホテル・レストラン・レジャー
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	8.42	8.1	94	10,053	情報技術サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	22.12	36.36	41	4,462	銀行
DELTA AIR LINES INC	10.35	10.63	23	2,451	旅客航空輸送業
INSULET CORP	—	4.97	106	11,373	ヘルスケア機器・用品
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	5.78	5.78	7	836	石油・ガス・消耗燃料
DISCOVER FINANCIAL	23.5	25.63	103	11,034	消費者金融
TE CONNECTIVITY LTD	24.21	24.49	179	19,098	電子装置・機器・部品
CONCHO RESOURCES INC/MIDLAND TX	13.5	14.74	84	8,965	石油・ガス・消耗燃料
WABCO HOLDING INC	3.11	3.24	43	4,652	機械
LULULEMON ATHLETICA INC	6.96	8.66	195	20,815	繊維・アパレル・贅沢品
VMWARE INC	5.34	6.89	91	9,768	ソフトウェア
MERCADOLIBRE INC	2.93	3.11	240	25,536	インターネット販売・通信販売
ULTA BEAUTY INC	3.96	4.09	90	9,664	専門小売り
INVESCO LTD	32.48	32.48	24	2,649	資本市場
MSCI INC	6.4	6.41	214	22,777	資本市場
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	103.68	117.76	825	87,850	タバコ
VISA INC	117.82	129.32	2,362	251,321	情報技術サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12.45	14.44	171	18,288	水道
DISCOVERY INC—C	17.61	26.87	50	5,392	メディア
MARATHON PETROLEUM CORP	46.74	48.73	149	15,953	石油・ガス・消耗燃料
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	8.39	12.5	67	7,156	建設関連製品
KINDER MORGAN INC/DELAWARE	132.57	152.86	228	24,289	石油・ガス・消耗燃料
XYLEM INC	12.96	12.82	81	8,665	機械
ALKERMES PLC	9.65	—	—	—	バイオテクノロジー
LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV	22.17	17.62	94	10,069	化学
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	2.55	2.52	43	4,645	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	10.07	10.52	158	16,854	ソフトウェア
EPAM SYSTEMS INC	—	4.45	101	10,744	情報技術サービス
HCA HEALTHCARE INC	18.54	20.61	211	22,477	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	11.11	11.62	183	19,560	専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3.55	5.02	54	5,843	医薬品
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6.17	5.91	147	15,635	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
FIRST REPUBLIC BANK/SAN FRANCISCO CA	11.43	12.12	123	13,133	銀行
CIT GROUP INC	6.6	—	—	—	銀行
NXP SEMICONDUCTOR NV	22.95	21.83	224	23,835	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP	—	10.35	76	8,129	情報技術サービス
TARGA RESOURCES CORP	13.22	19.73	26	2,816	石油・ガス・消耗燃料
LEAR CORP	4.98	4.98	46	4,911	自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	6.59	8.64	85	9,139	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	15.11	16.26	93	9,909	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	17.88	19.32	335	35,672	複合小売り
FORTINET INC	8.46	11.42	154	16,412	ソフトウェア
AON PLC	15.84	—	—	—	保険
TESLA INC	8.43	10.22	797	84,790	自動車
GENERAL MOTORS CO	85.23	100.9	226	24,081	自動車
WORLDPAY INC	20.31	—	—	—	情報技術サービス
XPO LOGISTICS INC	7.48	7.48	49	5,265	航空貨物・物流サービス
TRIPADVISOR INC	6.25	6.25	11	1,244	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALLY FINANCIAL INC	30.96	25.51	38	4,091	消費者金融
CAPRI HOLDINGS LTD	8.79	16.82	23	2,509	繊維・アパレル・贅沢品
VOYA FINANCIAL INC	9.49	9.78	42	4,551	各種金融サービス
APTIV PLC	18.6	18.59	121	12,897	自動車部品
PHILLIPS 66	29.98	33.31	244	25,972	石油・ガス・消耗燃料
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	6.56	62	6,677	ソフトウェア
FACEBOOK INC	160.78	181.84	3,841	408,587	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IQVIA HOLDINGS INC	11.21	12.5	169	18,017	ライフサイエンス・ツール/サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	10.84	14.88	60	6,389	石油・ガス・消耗燃料
SERVICENOW INC	12.13	14.35	547	58,277	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	6.37	7.39	157	16,752	ソフトウェア
TABLEAU SOFTWARE INC	4.76	—	—	—	ソフトウェア
WORKDAY INC	9.89	12.27	197	20,966	ソフトウェア
ABBVIE INC	100.9	111.78	941	100,128	バイオテクノロジー
ZOETIS INC	32.7	36.03	447	47,610	医薬品
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS LTD	12.94	17.24	20	2,200	ホテル・レストラン・レジャー
COTY INC	30.69	30.69	15	1,609	パーソナル用品
NEWS CORP/NEW-CL A	22.51	39.47	38	4,051	メディア
HD SUPPLY HOLDINGS INC	10.26	14	40	4,337	商社・流通業
CDW CORP	10.8	11.6	123	13,160	電子装置・機器・部品
SPRINT CORP	50.51	—	—	—	無線通信サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	6.95	6.95	6	705	旅客航空輸送業
HOWMET AEROSPACE INC	25.63	28.62	33	3,613	航空宇宙・防衛
TWILIO INC	—	8.72	149	15,849	情報技術サービス
SNAP INC	—	67.16	121	12,964	インタラクティブ・メディアおよびサービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	11.94	16.2	49	5,229	娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	5.21	5.21	16	1,725	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-C	14.6	14.6	45	4,790	メディア
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	12	18.75	16	1,717	繊維・アパレル・贅沢品
OKTA INC	—	7.23	123	13,095	情報技術サービス
BLACK KNIGHT INC	—	11.05	80	8,552	情報技術サービス

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円	
BAKER HUGHES CO	29.5	48.23	67	7,191	エネルギー設備・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	8.62	11.86	65	6,990	食品
ALTICE USA INC-A	23.3	10.9	25	2,666	メディア
TECHNIPFMC LTD	25.24	41.58	31	3,347	エネルギー設備・サービス
BROADCOM INC	27.47	30.07	805	85,633	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	-	5.92	153	16,352	ソフトウェア
MONGODDB INC	-	3.66	64	6,829	情報技術サービス
BURLINGTON STORES INC	3.97	4.74	84	8,990	専門小売り
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	6.74	-	-	-	保険
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	18.99	30.83	61	6,518	医薬品
VEEVA SYSTEMS INC	8.42	9.9	189	20,137	ヘルスケア・テクノロジー
TWITTER INC	45.48	56	161	17,135	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC	9.99	13.09	46	4,963	電気設備
EVERGY INC	18.8	15.54	86	9,234	電力
PLAINS GP HOLDINGS LP	9.43	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
COMMSCOPE HOLDING CO INC	12.19	-	-	-	通信機器
ALLEGION PLC	5.58	7.77	77	8,275	建設関連製品
STERIS PLC	-	6.89	99	10,542	ヘルスケア機器・用品
DOCUSIGN INC	-	7.66	90	9,589	ソフトウェア
WIX.COM LTD	2.56	3.49	52	5,564	情報技術サービス
DROPBOX INC	-	14.55	31	3,387	ソフトウェア
KKR & CO INC	33.03	36.83	99	10,533	資本市場
PERRIGO CO PLC	7.63	10.64	54	5,849	医薬品
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	20.22	19.53	140	14,935	ホテル・レストラン・レジャー
ARAMARK	14.49	17.08	40	4,319	ホテル・レストラン・レジャー
CIGNA CORP	25.03	28.3	521	55,437	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DELL TECHNOLOGIES INC	9.82	14.78	61	6,563	コンピュータ・周辺機器
DOW INC	51.25	56.62	185	19,782	化学
AMCOR PLC	-	120	103	10,989	容器・包装
PINTEREST INC	-	22.85	42	4,544	インタラクティブ・メディアおよびサービス
XEROX HOLDINGS CORP	-	13.47	23	2,482	コンピュータ・周辺機器
FOX CORP-A	23.5	23.5	59	6,311	メディア
FOX CORP-B	9.5	17.55	43	4,668	メディア
CARRIER GLOBAL CORP	-	58.68	96	10,241	建設関連製品
OTIS WORLDWIDE CORP	-	29.34	152	16,167	機械
UBER TECHNOLOGIES INC	-	32.12	99	10,566	陸運・鉄道
CORTEVA INC	-	52.3	138	14,713	化学
BLACKSTONE GROUP INC	-	49.92	263	28,028	資本市場
GRUBHUB INC	5.33	9.32	41	4,449	インターネット販売・通信販売
INGERSOLL RAND INC	-	27.56	76	8,113	機械
PAYCOM SOFTWARE INC	-	4.08	109	11,665	ソフトウェア
SABRE CORP	16.17	27.51	18	1,954	情報技術サービス
AON PLC	-	17.72	327	34,834	保険
PARSLEY ENERGY INC	15.37	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料
ARISTA NETWORKS INC	3.64	3.78	79	8,460	通信機器
IHS MARKIT LTD	27.58	27.99	185	19,743	専門サービス
FNFG GROUP	16.13	21.63	54	5,767	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		
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカ・ドル	千円		
SYNCHRONY FINANCIAL	43.48	36.68	65	7,018	消費者金融	
CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	34.65	33.4	70	7,548	銀行	
CYBERARK SOFTWARE LTD	—	2.99	31	3,368	ソフトウェア	
CDK GLOBAL INC	7.2	10.19	40	4,303	ソフトウェア	
WAYFAIR INC	3.34	4.73	83	8,899	インターネット販売・通信販売	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	13.41	13.05	126	13,462	電子装置・機器・部品	
QORVO INC	7.38	9.35	94	10,026	半導体・半導体製造装置	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	12.41	—	—	—	各種電気通信サービス	
LIBERTY BROADBAND CORP—C W/I	6.29	8.65	109	11,650	メディア	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	12.74	21.97	41	4,449	化学	
GODADDY INC	10.22	13.99	102	10,868	情報技術サービス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	20.9	27.81	38	4,046	専門サービス	
TRANSUNION	13.47	13.8	108	11,563	専門サービス	
SQUARE INC	20.45	26.24	195	20,825	情報技術サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	153.76	51.8	231	24,660	化学	
COCA—COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	12.83	18.91	71	7,656	飲料	
WESTROCK CO	19.04	16.76	42	4,472	容器・包装	
KRAFT HEINZ CO	40.49	51.14	147	15,681	食品	
FORTIVE CORP	20.92	23.44	135	14,442	機械	
MATCH GROUP INC	—	4.57	37	4,016	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
WASTE CONNECTIONS INC	18.16	20.85	191	20,388	商業サービス・用品	
ALPHABET INC—CL A	19.94	22.66	3,102	330,012	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO	100.32	103.45	99	10,540	コンピュータ・周辺機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	75.07	84.31	1,233	131,181	情報技術サービス	
EQUITABLE HOLDINGS INC	14	29.28	51	5,437	各種金融サービス	
FIRST DATA CORP	31.55	—	—	—	情報技術サービス	
DXC TECHNOLOGY CO	19.24	22.01	38	4,056	情報技術サービス	
ZILLOW GROUP INC—C	7.28	7.28	35	3,760	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
ALPHABET INC—CL C	20.94	23.34	3,203	340,730	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
BEIGENE LTD ADR	1.92	3.03	46	4,944	バイオテクノロジー	
L3 TECHNOLOGIES INC	5.48	—	—	—	航空宇宙・防衛	
CHEMOURS CO	10.96	—	—	—	化学	
LINDE PLC	36.63	40.51	748	79,619	化学	
ATHENE HOLDING LTD	9.17	13.98	34	3,696	保険	
ROKU INC	—	7.71	106	11,275	娯楽	
CHARTER COMMUNICATIONS INC	10.99	11.42	587	62,462	メディア	
VISTRA ENERGY CORP	19.87	29.54	53	5,639	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小 計	株 数 ・ 金 額	20,115.05	22,693.42	185,653	19,746,097	
	銘柄数 < 比率 >	597銘柄	608銘柄	—	<66.7%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
AGNICO EAGLE MINES LTD	13.89	18.29	167	12,801	金属・鉱業	
ALIMENTATION COUCHE TARD INC	29.76	61.46	245	18,741	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	126.55	137.93	526	40,154	金属・鉱業	
ATCO LTD	4.68	4.68	17	1,338	総合公益事業	
BANK OF MONTREAL	42.12	48.85	327	25,013	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	82.2	93.98	492	37,579	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	25.58	27.02	147	11,257	銀行
BCE INC	9.44	11.36	64	4,901	各種電気通信サービス
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT	57.73	100.58	466	35,628	資本市場
BAUSCH HEALTH COS INC	18.58	20.58	45	3,483	医薬品
SAPUTO INC	13.86	20.87	71	5,446	食品
BLACKBERRY LTD	31.84	31.84	20	1,562	ソフトウェア
ALGONQUIN POWER & UTILITIES CO	—	41.06	78	5,990	総合公益事業
CGI INC	18.55	19.17	174	13,316	情報技術サービス
CCL INDUSTRIES INC	8.86	15.57	68	5,206	容器・包装
CAE INC	16.03	18.4	39	3,023	航空宇宙・防衛
CAMECO CORP	24.59	24.59	36	2,784	石油・ガス・消耗燃料
ROGERS COMM—CL B	25.59	29.1	164	12,586	無線通信サービス
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	29.42	34.16	279	21,333	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	83.97	90.22	194	14,870	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN TIRE CORP—CL A	3.64	3.48	32	2,461	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD	7.89	16.3	52	3,987	総合公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	49.35	54.27	613	46,788	陸運・鉄道
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12.27	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REITs)
GILDAN ACTIVEWEAR INC	12.35	20.82	38	2,964	繊維・アパレル・贅沢品
OPEN TEXT CORP	20.38	18.63	101	7,773	ソフトウェア
EMPIRE CO LTD	10.76	10.76	32	2,460	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	79.63	107.67	106	8,158	金属・鉱業
FINNING INTERNATIONAL INC	10.76	—	—	—	商社・流通業
FORTIS INC	30.74	36.07	190	14,574	電力
TELUS CORP	6	12	27	2,083	各種電気通信サービス
GREAT WEST LIFECO INC	17.87	25.41	53	4,085	保険
IMPERIAL OIL LTD	16.69	22.28	46	3,538	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	135.64	153.4	684	52,231	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	5.36	5.36	14	1,132	資本市場
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	65.9	—	—	—	金属・鉱業
MANULIFE FINANCIAL CORP	138.12	149.86	245	18,754	保険
LOBLAW CO LTD	11.13	15.98	107	8,220	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	23.5	20.57	109	8,391	自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	42.21	45.36	216	16,542	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2	2.11	73	5,622	保険
METRO INC	18.92	19.98	115	8,811	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	22.14	22.14	8	667	石油・ガス・消耗燃料
EMERA INC	3.65	20.84	113	8,667	電力
METHANEX CORP	4.01	4.01	8	663	化学
ONEX CORP	5.21	5.11	33	2,520	各種金融サービス
POWER CORP OF CANADA	30.05	41.52	84	6,479	保険
POWER FINANCIAL CORP	15.14	—	—	—	保険
QUEBECOR INC—B	—	11.53	34	2,630	メディア
ROYAL BANK OF CANADA	95.41	108.86	916	69,929	銀行
SNC—LAVALIN GROUP INC	10.46	—	—	—	建設・土木
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9.92	10.44	327	25,019	陸運・鉄道

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダ・ドル	千円		
SHAW COMM INC-B	35.85	36.02	81	6,209	メディア	
SUNCOR ENERGY INC	111.37	116.85	270	20,660	石油・ガス・消耗燃料	
LUNDIN MINING CORP	44.52	44.52	28	2,167	金属・鉱業	
ENCANA CORP	105.05	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料	
TECK RESOURCES LTD-CL B	30.6	41.11	50	3,817	金属・鉱業	
THOMSON REUTERS CORP	12.24	15.48	148	11,308	専門サービス	
TORONTO DOMINION BANK (THE) C\$	121.15	137.23	771	58,905	銀行	
TC ENERGY CORP	62.42	70.94	455	34,743	石油・ガス・消耗燃料	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	3.75	3.75	13	1,057	紙製品・林産品	
WESTON (GEORGE) LTD	7.38	4.93	47	3,633	食品・生活必需品小売り	
INTACT FINANCIAL CORP	10.56	10.93	148	11,308	保険	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	26.57	30.61	187	14,295	金属・鉱業	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	1.44	1.4	196	14,982	ソフトウェア	
FRANCO-NEVADA CORP NPR	13.92	14.66	296	22,620	金属・鉱業	
CI FINANCIAL CORP	15.99	15.99	22	1,718	資本市場	
TOURMALINE OIL CORP	16.33	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料	
KEYERA CORP	12.34	24.18	49	3,789	石油・ガス・消耗燃料	
PARKLAND FUEL CORP	-	11.68	37	2,852	石油・ガス・消耗燃料	
ALTAGAS LTD	16.77	16.77	27	2,073	ガス	
PEMBINA PIPELINE CORP	36.44	39.28	122	9,364	石油・ガス・消耗燃料	
DOLLARAMA INC	18.38	19.91	86	6,634	複合小売り	
STARS GROUP INC	10.53	12.14	45	3,473	ホテル・レストラン・レジャー	
CENOVUS ENERGY INC W/I	61.71	80.04	42	3,267	石油・ガス・消耗燃料	
VERMILION ENERGY INC	9.12	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料	
ARC RESOURCES LTD	22.28	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	-	18.99	114	8,761	金属・鉱業	
INTER PIPELINE LTD	23	41.96	44	3,390	石油・ガス・消耗燃料	
NUTRIEN LTD	41.68	44.42	214	16,331	化学	
WSP GLOBAL INC	6.23	6.94	62	4,744	建設・土木	
IA FINANCIAL CORP INC	6.6	7.53	31	2,408	保険	
NEWMONT GOLDCORP CORP	16.96	-	-	-	金属・鉱業	
OVINTIV INC	-	21.01	15	1,189	石油・ガス・消耗燃料	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	13.35	13.35	12	975	石油・ガス・消耗燃料	
SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD	17.05	-	-	-	石油・ガス・消耗燃料	
AIR CANADA	-	8.74	14	1,102	旅客航空輸送業	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	17.7	22.68	160	12,217	ホテル・レストラン・レジャー	
AURORA CANNABIS INC	39.28	39.28	3	287	医薬品	
SHOPIFY INC	6.22	7.84	796	60,802	情報技術サービス	
CANOPY GROWTH CORP	11.91	16.53	35	2,722	医薬品	
HYDRO ONE LTD	19.82	21.86	55	4,243	電力	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,606.85	2,834.02	12,714	970,242	
	銘柄数 < 比率 >	86銘柄	81銘柄	-	<3.3%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	8.21	13.67	84	5,883	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	187.73	221.74	351	24,398	銀行	
WESTPAC BANKING CORPORATION	222.98	278.49	434	30,159	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	24.71	-	-	-	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	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	96.05	114.11	130	9,070	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	245.06	334.91	102	7,114	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	29.95	29.95	17	1,230	銀行
AMP LTD	180.37	382.38	52	3,623	各種金融サービス
ASX LTD	11.88	13.13	106	7,381	資本市場
BHP GROUP LTD	198.54	221.98	688	47,770	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LTD	15.82	15.82	38	2,673	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	36.4	36.4	10	717	複合小売り
COMPUTERSHARE LT	28.29	46.52	53	3,687	情報技術サービス
CSL LIMITED	30.38	34.42	1,059	73,577	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	3.22	3.22	28	1,974	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	178.27	210.39	282	19,600	運送インフラ
COCA-COLA AMATIL LTD	30.91	30.91	25	1,804	飲料
COCHLEAR LTD	4.54	4.54	83	5,814	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	102.93	144.83	80	5,559	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	116	135.2	801	55,618	銀行
BORAL LIMITED	71.24	93.78	25	1,783	建設資材
RIO TINTO LIMITED	26.64	30.34	247	17,167	金属・鉱業
APA GROUP	91.87	91.87	102	7,085	ガス
ARISTOCRAT LEISU	42.72	47.39	118	8,224	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	137.49	159.96	84	5,885	保険
TPG TELECOM LTD	22.43	22.43	16	1,121	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	3.34	3.34	3	230	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	26.87	25.11	53	3,744	建設資材
ORICA LTD	22.09	40.78	68	4,744	化学
CIMIC GROUP LTD	5.69	5.69	13	916	建設・土木
LEND LEASE CORP LTD	34.9	31.95	36	2,506	不動産管理・開発
BLUESCOPE STEEL LTD	33.79	33.79	34	2,362	金属・鉱業
SYDNEY AIRPORT	67.82	53.43	28	2,010	運送インフラ
MACQUARIE GROUP LTD	22.11	25.92	258	17,912	資本市場
WORLEY LTD	18.65	18.65	15	1,096	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD	94.23	102.24	89	6,224	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	177.71	226.03	366	25,450	銀行
NEWCREST MINING LTD	56.97	61.47	171	11,875	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	79.28	144.93	41	2,887	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	98.5	98.5	21	1,504	化学
QANTAS AIRWAYS LIMITED	-	51.76	17	1,243	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	98.26	94.38	70	4,920	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICES	33.59	33.59	15	1,058	各種金融サービス
SANTOS LTD	102.94	136.01	64	4,494	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE	28.65	29.63	76	5,319	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	6.17	6.17	11	764	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS LTD	111.7	219.33	68	4,780	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LTD	79.01	84.26	306	21,291	複合小売り
ALUMINA LIMITED	157.75	187.72	29	2,058	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM LTD	63.54	71.11	153	10,687	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	90.17	95.18	332	23,066	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリア・ドル	千円		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	7.78	41	2,864	資本市場	
SEEK LTD	19.33	20.25	34	2,379	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD	3.66	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
AUSNET SERVICES	112.62	112.62	21	1,524	電力	
AGL ENERGY LTD	48.62	43.74	71	4,976	総合公益事業	
BRAMBLES LTD	113.77	129.04	137	9,540	商業サービス・用品	
CROWN RESORTS LTD	22.84	22.84	20	1,452	ホテル・レストラン・レジャー	
AURIZON HOLDINGS LTD	164.72	151.06	69	4,802	陸運・鉄道	
TREASURY WINE ESTATES LTD	42.1	60.65	60	4,172	飲料	
AMCOR PLC—CDI	84.58	—	—	—	容器・包装	
MEDIBANK PVT LTD	159.8	223.04	63	4,412	保険	
SOUTH32 LTD(AUD)	370.94	407.69	76	5,278	金属・鉱業	
COLES GROUP LTD	66.48	90.9	138	9,610	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	—	12.19	24	1,697	ソフトウェア	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,867.82	5,881.15	8,135	564,795	
	銘柄数 < 比率 >	62銘柄	62銘柄	—	<1.9%>	
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
ASM PACIFIC TECH	18	18	145	1,997	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	120	110	177	2,432	不動産管理・開発	
BANK OF EAST ASIA	76.57	66.57	105	1,448	銀行	
CLP HOLDINGS LTD	112.96	122.96	983	13,487	電力	
PCCW LTD	250	250	118	1,629	各種電気通信サービス	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	38.14	38.14	172	2,370	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	78.51	92.51	2,279	31,274	資本市場	
MTR CORP	89.41	124.41	533	7,314	陸運・鉄道	
HANG LUNG GROUP LTD	50	—	—	—	不動産管理・開発	
HANG SENG BANK LTD	46.96	56.96	763	10,471	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	104.75	115.22	348	4,781	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	83.2	98.2	491	6,749	電力	
(THE) WHARF HOLDINGS LTD	73.85	—	—	—	不動産管理・開発	
HONG KONG & CHINA GAS	629.84	762.82	1,046	14,359	ガス	
HYSAN DEVELOPMENT CO	40	—	—	—	不動産管理・開発	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LTD	169.04	149.04	761	10,449	ホテル・レストラン・レジャー	
KERRY PROPERTIES LTD	35	35	74	1,020	不動産管理・開発	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	259.95	274.95	658	9,034	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	90	90	69	949	コングロマリット	
YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS	45	45	57	782	繊維・アパレル・贅沢品	
NEW WORLD DEVELOPMENT	480	520	470	6,449	不動産管理・開発	
SHANGRI—LA ASIA LTD	80	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
SINO LAND CO	198	298	318	4,374	不動産管理・開発	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	110.65	115.65	1,185	16,263	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC LTD A	35.2	35.2	171	2,349	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	81.56	111.56	713	9,788	機械	
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	—	40	115	1,586	食品	
WHEELOCK & CO LTD	51.44	81.44	463	6,363	不動産管理・開発	
MINTH GROUP LTD	40	—	—	—	自動車部品	
SJM HOLDINGS LTD	120	120	92	1,266	ホテル・レストラン・レジャー	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港・ドル	千円		
WYNN MACAU LTD	95.53	95.53	128	1,766	ホテル・レストラン・レジャー	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	58	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
AIA GROUP LTD	808.89	918.89	6,358	87,241	保険	
HKT TRUST / HKT LTD	—	341.36	428	5,882	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	182	202	620	8,508	ホテル・レストラン・レジャー	
SWIRE PROPERTIES LTD	68	102	216	2,966	不動産管理・開発	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD	73.85	93.85	309	4,249	不動産管理・開発	
HK ELECTRIC INVESTMENTS & HK ELECTRIC INVESTMENTS LTD	165	165	132	1,811	電力	
BUDWEISER BREWING CO APAC LTD	—	107	226	3,112	飲料	
WH GROUP LTD	515	780	558	7,662	食品	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	186.13	211.13	1,181	16,207	コングロマリット	
CK ASSET HOLDINGS LTD	183.63	213.63	1,028	14,112	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,944.06	7,002.02	23,507	322,516	
	銘柄数 < 比率 >	39銘柄	36銘柄	—	<1.1%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポール・ドル	千円		
SINGAPORE TECH ENG	92	110	36	2,735	航空宇宙・防衛	
SEMBCORP INDUSTRIES	62.34	62.34	9	742	コングロマリット	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	101	101	16	1,217	メディア	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	410.29	—	—	—	食品	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	117.1	135.1	266	20,097	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	25	50	39	2,965	不動産管理・開発	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	6.04	6.04	12	916	販売	
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL SERVICES LTD	42	42	12	946	運送インフラ	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	79	79	77	5,810	資本市場	
CAPITALAND LTD	152.75	209.75	60	4,583	不動産管理・開発	
GENTING SINGAPORE LTD	369.93	369.93	28	2,132	ホテル・レストラン・レジャー	
KEPPEL CORP LTD	86	85	51	3,843	コングロマリット	
COMFORTDELGRO CORP LTD	133.18	133.18	21	1,595	陸運・鉄道	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	207.45	247.45	219	16,559	銀行	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	556.08	662.08	182	13,720	各種電気通信サービス	
SINGAPORE AIRLINES LTD	35	71	31	2,354	旅客航空輸送業	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	88.66	102.66	204	15,380	銀行	
UOL GROUP LIMITED	31	31	20	1,581	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	17	17	26	2,019	電子装置・機器・部品	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	118	105	36	2,753	食品	
YANGZUJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	144	144	14	1,058	機械	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,873.82	2,763.53	1,366	103,014	
	銘柄数 < 比率 >	21銘柄	20銘柄	—	<0.3%>	
(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	55.5	95.73	54	3,547	運送インフラ	
RYMAN HEALTHCARE LTD	23.19	23.19	28	1,836	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
A2 MILK CO LTD	45.03	48.05	94	6,166	食品	
FISHER & PAYKEL	33.35	52.97	155	10,120	ヘルスケア機器・用品	
FLETCHER BUILDING LTD	53.5	53.5	18	1,217	建設資材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	108.16	112.28	50	3,277	各種電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER LTD	—	83.4	38	2,515	電力	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(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		
MERIDIAN ENERGY LTD	79.95	79.95	36	2,390	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小 計	株 数 ・ 金 額	398.68	549.07	477	31,071	
	銘柄数 < 比率 >	7銘柄	8銘柄	-	<0.1%>	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
ANTOFAGASTA PLC	25.87	48.64	39	5,163	金属・鉱業	
ASHTED GROUP	36.3	31.83	70	9,292	商社・流通業	
SEVERN TRENT PLC	13.92	14.5	35	4,617	水道	
BHP GROUP PLC	145.09	156.5	215	28,381	金属・鉱業	
BARCLAYS PLC	1,136.28	1,322.8	139	18,367	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	59.21	68.97	36	4,822	家庭用耐久財	
BT GROUP PLC	563.31	636.47	66	8,795	各種電気通信サービス	
BUNZL PLC	24.72	26.23	45	5,979	商社・流通業	
EASYJET PLC	10.34	10.34	5	723	旅客航空輸送業	
AVIVA PLC	271.52	299.05	73	9,742	保険	
CRODA INTERNATIONAL	7.53	10.95	54	7,163	化学	
DIAGEO PLC	164.01	178.02	494	65,150	飲料	
SCHRODERS PLC	7.43	7.22	20	2,654	資本市場	
DCC PLC	7.77	7.77	45	5,965	コンプロマリット	
NATIONAL GRID PLC	224.7	267.11	246	32,416	総合公益事業	
KINGFISHER PLC	124.65	218.91	34	4,501	専門小売り	
BAE SYSTEMS PLC	218.96	247.96	127	16,731	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	153.49	174.05	518	68,260	タバコ	
HALMA PLC	-	31.4	70	9,237	電子装置・機器・部品	
NEXT PLC	8.2	10.93	53	7,029	複合小売り	
IMPERIAL BRANDS PLC	63.91	70.23	114	15,053	タバコ	
JOHNSON MATTHEY PLC	11.37	16.74	32	4,311	化学	
ANGLO AMERICAN PLC	72.66	74.11	108	14,322	金属・鉱業	
COMPASS GROUP PLC	105.78	118.87	152	20,154	ホテル・レストラン・レジャー	
HSBC HOLDINGS PLC	1,313.12	1,537.42	634	83,588	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	412.61	431.78	88	11,660	保険	
CENTRICA PLC	331.97	465.58	18	2,447	総合公益事業	
UNILEVER PLC	75.3	84.33	344	45,360	パーソナル用品	
MEGGITT PLC	47.75	78.73	20	2,672	航空宇宙・防衛	
MORRISON <W.M.> SUPERMARKETS	130.82	239.87	44	5,912	食品・生活必需品小売り	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	40.05	44.1	39	5,226	水道	
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	59.75	51.28	20	2,659	保険	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	20.88	28.42	50	6,611	食品	
PEARSON PLC	45.89	60.87	27	3,605	メディア	
PERSIMMON PLC	23.95	23.95	54	7,200	家庭用耐久財	
PRUDENTIAL PLC	174.06	197.55	221	29,226	保険	
RIO TINTO PLC	79.27	84.9	316	41,668	金属・鉱業	
VODAFONE GROUP PLC	1,800.97	2,034.07	229	30,253	無線通信サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	43.97	53.76	357	47,083	家庭用品	
RELX PLC	132.72	147.11	273	36,027	専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	-	128.92	62	8,187	商業サービス・用品	
ROLLS ROYCE HOLDINGS PLC	114.13	124.66	35	4,714	航空宇宙・防衛	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	283.33	351.49	40	5,283	銀行	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円	
ST JAMES'S PLACE PLC	32.22	33.04	28	3,696	資本市場
SSE PLC	71.32	68.19	84	11,098	電力
BP PLC	1,328.74	1,533.11	484	63,802	石油・ガス・消耗燃料
SAGE GROUP PLC(THE)	63.44	87.22	55	7,376	ソフトウェア
SMITHS GROUP PLC	23.2	31.58	39	5,200	コンピュータリット
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	-	4.72	44	5,826	機械
STANDARD CHARTERED PLC	191.94	213.93	88	11,650	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,650.19	5,369.3	167	22,069	銀行
TAYLOR WIMPLEY PLC	267.59	267.59	40	5,354	家庭用耐久財
TESCO PLC	662.57	758.3	179	23,705	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	71.69	69.03	52	6,956	資本市場
SMITH & NEPHEW PLC	61.86	67.29	111	14,693	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	330.34	378.06	633	83,404	医薬品
WEIR GROUP	14.81	27.94	26	3,543	機械
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	21.65	23.91	187	24,657	資本市場
BABCOCK INT'L GROUP	15.85	-	-	-	商業サービス・用品
WPP PLC	88.34	96.75	58	7,711	メディア
ASTRAZENECA PLC	84.3	99.19	848	111,842	医薬品
WHITBREAD PLC	10.78	11.85	33	4,461	ホテル・レストラン・レジャー
CARNIVAL PLC	10.17	15.94	14	1,967	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER GROUP PLC	94.6	175.65	16	2,200	複合小売り
JOHN WOOD GROUP PLC	41.58	-	-	-	エネルギー設備・サービス
INTERTEK GROUP PLC	12.34	13.01	61	8,093	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	24.34	23.4	32	4,269	繊維・アパレル・贅沢品
INVESTEC PLC	42.12	-	-	-	資本市場
INTERCONTINENTAL HOTELS	10.75	14.2	51	6,723	ホテル・レストラン・レジャー
ITV PLC	212.41	120.27	8	1,161	メディア
SAINSBURY (J) PLC	102.78	93.03	17	2,361	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	97.12	97.12	9	1,239	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	12.38	12.38	29	3,938	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	7.29	8.68	37	4,880	家庭用耐久財
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	303.89	322.26	425	56,065	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	250.1	276.12	348	45,964	石油・ガス・消耗燃料
TUI AG-DI	25.76	47.89	12	1,671	ホテル・レストラン・レジャー
AVEVA GROUP PLC	-	5.23	20	2,693	ソフトウェア
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	137.15	201.29	44	5,820	資本市場
EXPERIAN PLC	63.91	68.47	178	23,461	専門サービス
MONDI PLC	28.4	38.53	52	6,908	紙製品・林産品
HARGREAVES LANSDOWN PLC	16.83	28.35	42	5,620	資本市場
FRESNILLO PLC NPR	13.63	-	-	-	金属・鉱業
OCADO GROUP PLC	-	33.03	61	8,110	インターネット販売・通信販売
INFORMA PLC	93.13	82.67	37	4,947	メディア
GLENCORE PLC	781.01	791.11	117	15,435	金属・鉱業
GVC HOLDINGS PLC	33.83	60.15	47	6,282	ホテル・レストラン・レジャー
EVRAZ PLC	-	30.46	8	1,083	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	6.5	-	-	-	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	79.12	71.57	20	2,645	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		
(イギリス)	百株	百株	千イギリス・ポンド	千円		
COCA-COLA HBC AG	11.89	19.57	37	4,889	飲料	
CONVATEC GROUP PLC	86.41	-	-	-	ヘルスケア機器・用品	
ROYAL MAIL PLC	56.04	-	-	-	航空貨物・物流サービス	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	45.01	-	-	-	ホテル・レストラン・レジャー	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C	8,103.23	-	-	-	航空宇宙・防衛	
FERGUSON PLC	16.86	14.92	85	11,203	商社・流通業	
M&G PLC	-	234.53	30	4,066	各種金融サービス	
JD SPORTS FASHION PLC	-	33.38	18	2,437	専門小売り	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	25.61	21.24	10	1,334	ソフトウェア	
AUTO TRADER GROUP PLC	55.59	48.41	23	3,059	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	358.12	339	32	4,287	電気設備	
小 計	株 数 ・ 金 額	27,838.29	22,701.25	10,779	1,420,113	
	銘柄数 < 比率 >	93銘柄	92銘柄	-	<4.8%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエル・シェケル	千円		
BANK HAPOALIM BM	61.88	73.28	165	5,010	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL BM	87.82	117.26	223	6,788	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	133	-	-	-	各種電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	1.45	1.45	69	2,100	航空宇宙・防衛	
ISRAEL DISCOUNT BANK LTD	-	92.36	106	3,224	銀行	
ISRAEL CHEMICALS LTD	42.09	42.09	53	1,615	化学	
NICE LTD	3.58	5.32	323	9,807	ソフトウェア	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	7.94	6.17	43	1,324	銀行	
AZRIELI GROUP	2.58	2.58	51	1,546	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	340.34	340.51	1,036	31,419	
	銘柄数 < 比率 >	8銘柄	8銘柄	-	<0.1%>	
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
CREDIT SUISSE GROUP AG	178.13	191.36	156	17,136	資本市場	
NESTLE SA-REGISTERED	202.95	225.28	2,337	255,819	食品	
CIE FINANC RICHEMONT	36.21	39.24	214	23,477	繊維・アパレル・贅沢品	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	46.58	53.12	1,816	198,783	医薬品	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3.32	3.32	69	7,628	機械	
SIKA INHABER	9.31	9.78	160	17,576	化学	
SGS SA-REG	0.39	0.49	104	11,479	専門サービス	
NOVARTIS AG-REG SHS	143.71	162.45	1,351	147,854	医薬品	
BALOISE HOLDING AG -R	2.85	3.22	44	4,879	保険	
BARRY CALLEBAUT AG	0.13	0.19	35	3,856	食品	
CLARIANT AG-REG	11.79	8.24	14	1,578	化学	
SWISSCOM AG-REG	1.87	1.76	85	9,401	各種電気通信サービス	
ABB LTD	126.78	140.58	246	26,918	電気設備	
ADECCO GROUP AG-REG	13.27	9.91	40	4,443	専門サービス	
GEBERIT AG	2.61	2.96	125	13,697	建設関連製品	
LONZA GROUP AG-REG	5.17	5.71	251	27,509	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDT & SPRUENGLI PART	0.06	0.07	53	5,905	食品	
LINDT & SPRUENGLI NAMEN	0.01	0.01	81	8,884	食品	
GIVAUDAN-REG	0.62	0.71	233	25,543	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	9.8	11.26	327	35,853	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		
(スイス)	百株	百株	千スイス・フラン	千円		
LAFARGEHOLCIM LTD	33.92	37.78	147	16,184	建設資材	
TEMENOS GROUP	3.56	5.11	66	7,285	ソフトウェア	
SONOVA HOLDING AG	3.27	3.91	73	8,049	ヘルスケア機器・用品	
KUEHNE & NAGEL INTL AG	3.16	3.65	49	5,377	海運業	
STRAUMANN HOLDING AG	0.61	0.86	63	6,950	ヘルスケア機器・用品	
THE SWATCH GROUP AG-B	2.38	2.38	43	4,798	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	3.44	4.34	15	1,691	繊維・アパレル・贅沢品	
SCHINDLER NAMEN	1.15	1.67	34	3,771	機械	
SWISS LIFE HOLDING AG	2.41	2.38	79	8,718	保険	
VIFOR PHARMA AG	2.81	3	45	5,025	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING	0.48	0.64	39	4,369	化学	
SWISS PRIME SITE AG	4.49	6.64	59	6,560	不動産管理・開発	
PARGESA HOLDING PORTEUR	2.29	2.29	15	1,718	各種金融サービス	
DUFREY GROUP	2.05	4.82	12	1,328	専門小売り	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1.31	1.38	109	11,998	資本市場	
JULIUS BAER GROUP LTD	17.73	17.73	66	7,327	資本市場	
SWISS RE LTD	19.91	22.59	150	16,481	保険	
ALCON INC	28.74	31.41	164	17,981	ヘルスケア機器・用品	
UBS GROUP AG	261.69	292.82	281	30,810	資本市場	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,190.96	1,315.06	9,273	1,014,659	
	銘柄数 < 比率 >	39銘柄	39銘柄	-	<3.4%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーク・クローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	6.72	9.43	782	12,097	飲料	
A P MOLLER A/S	0.39	0.39	247	3,822	海運業	
AP MOLLER MAERSK A	0.36	0.36	212	3,289	海運業	
DANSKE BANK A/S	51.74	51.74	399	6,180	銀行	
GENMAB A/S	3.62	5.35	973	15,053	バイオテクノロジー	
NOVOZYMES-B SHS	13.9	17.42	608	9,409	化学	
NOVO NORDISK A/S-B	122.21	134.6	5,814	89,895	医薬品	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13.6	14.09	836	12,930	電気設備	
COLOPLAST-B	8.88	8.51	895	13,840	ヘルスケア機器・用品	
DSV PANALPINA A S	13.83	16.36	1,132	17,512	航空貨物・物流サービス	
DEMANT A/S	6.28	6.28	107	1,667	ヘルスケア機器・用品	
H LUNDBECK A/S	4.34	4.34	105	1,627	医薬品	
TRYG A/S	7.37	5.96	108	1,681	保険	
PANDORA A/S	6.47	6.47	175	2,720	繊維・アパレル・贅沢品	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	5.83	8.61	526	8,133	化学	
ISS A/S	9.8	9.8	99	1,535	商業サービス・用品	
ORSTED A/S	13.6	12.85	894	13,826	電力	
小 計	株 数 ・ 金 額	288.94	312.56	13,921	215,225	
	銘柄数 < 比率 >	17銘柄	17銘柄	-	<0.7%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェー・クローネ	千円		
MOWI ASA	31.65	26.53	464	4,831	食品	
DNB ASA	66.93	76.17	883	9,201	銀行	
NORSK HYDRO ASA	81.67	147.69	354	3,691	金属・鉱業	
TELENOR ASA	51.74	56.01	823	8,568	各種電気通信サービス	

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		
(ノルウェー)	百株	百株	千/ルウェー・クロネ	千円		
ORKLA ASA	47.43	65.57	553	5,756	食品	
EQUINOR ASA	78.4	68.57	950	9,889	石油・ガス・消耗燃料	
YARA INTERNATIONAL ASA	10.41	13.6	472	4,914	化学	
AKER BP ASA	6.68	6.68	113	1,179	石油・ガス・消耗燃料	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	12.53	12.53	220	2,295	保険	
SCHIBSTED ASA	6.13	6.13	135	1,410	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	393.57 10銘柄	479.48 10銘柄	4,970 -	51,739 <0.2%>	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデン・クロナ	千円		
ATLAS COPCO AB-A SHS	49.18	47.27	1,598	17,356	機械	
ATLAS COPCO AB-B SHS	22.94	32.93	1,006	10,936	機械	
ERICSSON LM-B SHS	205.31	229.89	1,891	20,542	通信機器	
LUNDBERGS B	4.77	4.77	193	2,104	各種金融サービス	
SKF AB-B SHS	22.15	29.63	450	4,891	機械	
SANDVIK AB	79.77	92.09	1,348	14,641	機械	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	111.7	119.16	889	9,658	銀行	
SKANSKA AB-B SHS	20.8	23.18	415	4,516	建設・土木	
SWEDBANK AB	60.48	66.51	713	7,745	銀行	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	104.46	120.17	1,052	11,434	銀行	
VOLVO AB-B SHS	107.28	114.24	1,396	15,166	機械	
SWEDISH MATCH AB	10.33	13.59	841	9,135	タバコ	
TELE2 AB-B SHS	29.44	44.57	554	6,026	無線通信サービス	
INDUSTRIVARDEN C	10.07	10.07	201	2,185	各種金融サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	14.06	16.88	229	2,491	家庭用耐久財	
SECURITAS AB-B SHS	18.11	21.26	255	2,778	商業サービス・用品	
INVESTOR AB-B SHS	31.32	35.01	1,663	18,067	各種金融サービス	
HENNES&MAURITZ AB-B SHS	51.51	59.46	778	8,449	専門小売り	
ASSA ABLOY AB-B	68.22	78.46	1,426	15,490	建設関連製品	
TELIA CO AB	200.7	210.3	679	7,376	各種電気通信サービス	
LUNDIN ENERGY AB	11.58	19.11	435	4,727	石油・ガス・消耗燃料	
BOLIDEN AB	16.63	21.55	409	4,447	金属・鉱業	
ALFA LAVAL AB	17.93	27.83	513	5,580	機械	
KINNEVIK AB-B	14.15	19.48	423	4,597	各種金融サービス	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA	3.9	6.57	151	1,643	無線通信サービス	
ICA GRUPPEN AB	4.74	4.23	177	1,930	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	26.11	26.11	151	1,645	家庭用耐久財	
HEXAGON AB	15.17	18.95	879	9,548	電子装置・機器・部品	
EPIROC AB-A	39.01	59.88	588	6,396	機械	
EPIROC AB-B	22.62	22.62	221	2,401	機械	
ESSITY AB-B	42.34	44.75	1,370	14,885	家庭用品	
NORDEA BANK ABP	201.16	218.71	1,300	14,120	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	1,637.94 32銘柄	1,859.23 32銘柄	24,209 -	262,920 <0.9%>	
(ユーロ・・・アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
CRH PLC	58.81	62.15	167	19,271	建設資材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	4.86	4.78	52	6,112	ホテル・レストラン・レジャー	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ・・・アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KERRY GROUP PLC-A	11.23	11.58	116	13,425	食品	
KINGSPAN GROUP PLC	9.1	9.49	46	5,329	建設関連製品	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13.35	18.25	52	6,046	容器・包装	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	57.7	111.23	18	2,100	銀行	
AIB GROUP PLC	51.83	51.83	5	593	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	206.88	269.31	458	52,879	
	銘柄数 < 比率 >	7銘柄	7銘柄	-	<0.2%>	
(ユーロ・・・オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AIRBUS SE	38.97	44.75	249	28,780	航空宇宙・防衛	
KONINKLIJKE DSM NV	13.61	13.77	158	18,267	化学	
ING GROEP NV-CVA	266.83	291.51	142	16,454	銀行	
RANDSTAD NV	6.95	7.26	26	3,030	専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	83.38	81.55	186	21,571	食品・生活必需品小売り	
HEINEKEN NV	17.61	19.4	143	16,565	飲料	
AKZO NOBEL	15.26	15.98	111	12,900	化学	
ASML HOLDING NV	27.58	32.27	892	102,968	半導体・半導体製造装置	
AEGON NV	136.47	125.73	27	3,228	保険	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	65.95	68.27	270	31,242	ヘルスケア機器・用品	
WOLTERS KLUWER-CVA	20.83	21.51	143	16,585	専門サービス	
STMICROELECTRONICS NV	40.15	50.38	116	13,442	半導体・半導体製造装置	
QIAGEN N.V.	18.11	18.11	70	8,124	ライフサイエンス・ツール/サービス	
VOPAK (KON.)	4.32	4.32	21	2,509	石油・ガス・消耗燃料	
KONINKLIJKE KPN NV	259.1	238.68	50	5,798	各種電気通信サービス	
HEINEKEN HOLDING NV-A	8.61	9.37	64	7,458	飲料	
UNILEVER NV	102.58	112.22	501	57,867	パーソナル用品	
FERRARI NV	8.72	9.87	143	16,583	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV	74.74	51.1	25	2,929	機械	
PROSUS NV	-	37.1	262	30,327	インターネット販売・通信販売	
NN GROUP NV	17.83	20.94	54	6,239	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	74.17	68.65	52	6,018	自動車	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	-	9.05	88	10,229	インターネット販売・通信販売	
ABN AMRO BANK NV	24.81	35.03	23	2,711	銀行	
EXOR NV	6.36	9.46	45	5,205	各種金融サービス	
ALTICE EUROPE NV	-	53.78	19	2,272	メディア	
ADYEN NV	0.51	0.82	78	9,020	情報技術サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,333.45	1,450.88	3,973	458,336	
	銘柄数 < 比率 >	24銘柄	27銘柄	-	<1.5%>	
(ユーロ・・・ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
UMICORE	12.33	12.24	44	5,166	化学	
KBC GROUPE	17.17	20.39	99	11,502	銀行	
SOLVAY SA	4.62	6.81	49	5,695	化学	
AGEAS	10.66	10.81	36	4,223	保険	
UCB SA	7.4	9.19	76	8,867	医薬品	
COLRUYT NV	3.57	3.57	20	2,384	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4.74	8.01	57	6,636	各種金融サービス	
PROXIMUS	9.01	9.01	16	1,870	各種電気通信サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ・・・ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
GALAPAGOS NV	—	3.65	76	8,829	バイオテクノロジー	
TELENET GROUP HOLDING NV	3.4	3.4	11	1,348	メディア	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	51.78	53.88	212	24,545	飲料	
小 計	株 数 ・ 金 額	124.68	140.96	702	81,070	
	銘柄数 < 比率 >	10銘柄	11銘柄	—	<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)	48.85	59.16	60	6,968	金属・鉱業	
EUROFINS SCIENTIFIC	0.67	0.73	38	4,491	ライフサイエンス・ツール/サービス	
TENARIS SA	28.7	28.7	17	2,045	エネルギー設備・サービス	
SES FDR	21.39	37.21	21	2,432	メディア	
RTL GROUP SA	1.89	—	—	—	メディア	
AROUNDTOWN SA	45.74	72.07	36	4,233	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	147.24	197.87	174	20,171	
	銘柄数 < 比率 >	6銘柄	5銘柄	—	<0.1%>	
(ユーロ・・・フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AIR LIQUIDE	28.66	36.27	435	50,188	化学	
AXA	125.98	150.03	244	28,200	保険	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	39.36	38.06	72	8,401	総合公益事業	
DASSAULT AVIATION SA	0.15	0.17	11	1,373	航空宇宙・防衛	
DANONE	42.28	46.84	294	34,020	食品	
SAFRAN SA	22.19	25.13	203	23,505	航空宇宙・防衛	
ACCOR SA	15.39	9.22	21	2,451	ホテル・レストラン・レジャー	
BOUYGUES	12.87	20.29	55	6,415	建設・土木	
BNP PARIBAS	75.38	87.4	249	28,729	銀行	
THALES SA	6.23	8.71	60	7,033	航空宇宙・防衛	
CAPGEMINI SA	11.3	10.3	92	10,646	情報技術サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3.36	3.36	11	1,352	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	3.67	3.67	43	5,029	電子装置・機器・部品	
NATIXIS	55.8	42.79	9	1,050	資本市場	
EIFFAGE	4.65	4.98	36	4,209	建設・土木	
PUBLICIS GROUPE	15.27	14.41	36	4,225	メディア	
FAURECIA	4.75	4.75	14	1,726	自動車部品	
IMERYS SA	2.23	—	—	—	建設資材	
L'OREAL	16.71	19.04	474	54,691	パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	18.61	21.09	728	84,070	繊維・アパレル・贅沢品	
BOLLORE	54.61	54.61	13	1,544	娯楽	
MICHELIN(CGDE)-B	12.18	13.88	121	13,988	自動車部品	
PERNOD-RICARD	14.54	16.19	218	25,185	飲料	
PEUGEOT SA	40.95	39.89	51	5,954	自動車	
RENAULT SA	13.91	18.3	31	3,608	自動車	
REMY COINTREAU	1.39	1.39	13	1,581	飲料	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	35.57	35.87	87	10,063	建設関連製品	
SEB SA	1.43	1.43	15	1,801	家庭用耐久財	
SOCIETE GENERALE-A	52.07	53.47	69	8,059	銀行	
VINCI S.A.	34.28	39.81	294	33,947	建設・土木	
SODEXO	5.3	6.98	44	5,129	ホテル・レストラン・レジャー	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額		
(ユーロ・・・フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37.5	42.36	335	38,760	電気設備	
VIVENDI SA	71.09	61.04	119	13,731	娯楽	
TOTAL SA	159.45	180.85	589	67,950	石油・ガス・消耗燃料	
VALEO	14.13	23.76	47	5,498	自動車部品	
ORANGE	136.47	147.13	157	18,144	各種電気通信サービス	
HERMES INTL	2.19	2.33	156	18,067	繊維・アパレル・贅沢品	
SOCIETE BIC SA	1.57	—	—	—	商業サービス・用品	
DASSAULT SYSTEMES SA	9.07	9.21	128	14,810	ソフトウェア	
KERING	5.17	5.78	255	29,515	繊維・アパレル・贅沢品	
CNP ASSURANCES	9.82	22.68	20	2,391	保険	
CARREFOUR SA	34.75	47.24	62	7,256	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	5.64	7.57	48	5,627	情報技術サービス	
SANOFI	75.17	85.65	777	89,666	医薬品	
UBISOFT ENTERTAINMENT	4.83	6.66	48	5,579	娯楽	
TELEPERFORMANCE	3.39	4.21	94	10,864	専門サービス	
EURAZEO	2.89	3.03	12	1,490	各種金融サービス	
JC DECAUX SA	4.67	4.67	8	1,010	メディア	
ESSILORLUXOTTICA	19.6	21.5	238	27,456	繊維・アパレル・贅沢品	
CREDIT AGRICOLE SA	81.32	95.36	68	7,896	銀行	
WENDEL	1.73	1.34	9	1,143	各種金融サービス	
ILIAD SA	1.66	1.66	23	2,762	各種電気通信サービス	
BIOMERIEUX	2.58	2.58	30	3,520	ヘルスケア機器・用品	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1.61	1.97	43	5,040	ライフサイエンス・ツール/サービス	
ENGIE	123.21	127.09	123	14,206	総合公益事業	
ALSTOM	9.06	14.92	52	6,063	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	10.87	10.87	10	1,181	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	35.48	47.62	33	3,915	電力	
IPSEN SA	2.2	2.27	15	1,740	医薬品	
ARKEMA SA	6	6	44	5,170	化学	
LEGRAND SA	19.86	22.35	128	14,866	電気設備	
ADP	1.73	2.51	20	2,322	運送インフラ	
SCOR SE	9.53	14.38	34	4,034	保険	
REXEL SA	18.8	—	—	—	商社・流通業	
BUREAU VERITAS SA	24.1	24.1	44	5,123	専門サービス	
GETLINK	27.2	33.77	37	4,300	運送インフラ	
SUEZ SA	21.86	15.14	15	1,772	総合公益事業	
EDENRED	14.04	17.64	66	7,694	情報技術サービス	
WORLDLINE SA	2.25	10.08	66	7,616	情報技術サービス	
AMUNDI SA	3.68	3.68	22	2,540	資本市場	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,787.24	1,959.33	8,052	928,921	
	銘柄数 < 比率 >	70銘柄	67銘柄	—	<3.1%>	
(ユーロ・・・ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ADIDAS AG	12.57	13.79	288	33,263	繊維・アパレル・贅沢品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	22.68	24.77	122	14,105	自動車	
COMMERZBANK AG	59.18	65.66	21	2,459	銀行	
FRESENIUS SE & CO KGAA	28.31	32.7	128	14,877	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 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ・・・ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
UNITED INTERNET	7.32	4.42	14	1,616	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE PREF	4.09	4.09	14	1,656	化学
HANNOVER RUECK SE	3.54	4.93	69	8,024	保険
GEA GROUP AG	9.98	9.98	21	2,529	機械
CONTINENTAL AG	7.66	7.44	55	6,433	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	66.51	74.33	196	22,654	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	2.84	-	-	-	メディア
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	8.99	13.14	60	6,971	自動車
MERCK KGAA	9.19	9.73	102	11,819	医薬品
RWE AG	30.57	39.8	106	12,272	総合公益事業
SAP SE	65.36	74.36	798	92,078	ソフトウェア
E.ON SE	148.95	173.87	157	18,168	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	6.07	7.95	55	6,424	家庭用品
SIEMENS AG-REG	50.99	58.28	491	56,683	コンプロマリット
PUMA AG	0.48	6.21	36	4,245	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG	62.79	74.53	431	49,798	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	12.59	13.96	108	12,561	家庭用品
DAIMLER AG	61.36	67.38	202	23,392	自動車
BASF SE	62.01	68.83	313	36,191	化学
BEIERSDORF AG	5.91	8.05	74	8,565	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	1.25	1.69	11	1,343	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	11.3	9.02	37	4,359	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO	15.3	16	113	13,104	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE	28.41	31.53	495	57,105	保険
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	13.78	-	-	-	メディア
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	14.22	14.22	11	1,289	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	10.01	11.14	217	25,046	保険
VOLKSWAGEN AG	1.86	2.79	37	4,354	自動車
VOLKSWAGEN AG PFD	12.62	13.61	173	19,961	自動車
THYSSENKRUPP AG	25.81	45.08	24	2,782	金属・鉱業
1&1 DRILLISCH AG	2.86	-	-	-	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG	137.3	144.97	95	10,962	資本市場
BMW VORZUG	3.14	5.59	23	2,676	自動車
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	223.11	256.19	340	39,262	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG	2.07	2.81	78	9,076	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	79.72	96.58	175	20,277	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG	-	3.01	28	3,333	ヘルスケア機器・用品
DEUTSCHE BOERSE AG	13	14.55	215	24,908	資本市場
FRAPORT AG	2.44	2.44	8	1,006	運送インフラ
WIRECARD AG	8.05	8.82	74	8,568	情報技術サービス
LANXESS AG	5.14	6.61	30	3,493	化学
MTU AERO ENGINES HOLDING AG	3.06	3.82	49	5,656	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN	25.11	29.28	111	12,852	不動産管理・開発
SYMRISE AG	9.14	8.6	80	9,286	化学
BRENNTAG AG	9.08	12.1	52	6,046	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	9.62	20.43	44	5,180	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	44.47	70.89	18	2,126	各種電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ・・・ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HUGO BOSS AG-ORD	3.72	-	-	-	繊維・アパレル・贅沢品
OSRAM LICHT AG	5.77	-	-	-	電気設備
KION GROUP AG	4.18	4.18	18	2,170	機械
VONOVIA SE	33.46	40.11	195	22,496	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	-	3.84	31	3,594	機械
SIEMENS HEALTHINEERS AG	8.81	8.01	32	3,786	ヘルスケア機器・用品
METRO AG	9.85	9.85	7	857	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE	8.18	-	-	-	総合公益事業
ZALANDO SE	6.52	11.38	60	7,023	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	11.34	15.33	46	5,420	化学
UNIPER SE	11.84	10.89	26	3,082	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
DELIVERY HERO SE	5.16	9.79	83	9,680	インターネット販売・通信販売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	1,570.64 61銘柄	1,803.35 57銘柄	6,925 -	798,969 <2.7%>
(ユーロ・・・ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	15.09	15.09	23	2,699	食品・生活必需品小売り
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	200.43	214.87	83	9,642	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	29.14	43.39	45	5,195	石油・ガス・消耗燃料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	244.66 3銘柄	273.35 3銘柄	152 -	17,537 <0.1%>
(ユーロ・・・スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円	
IBERDROLA SA	415.87	467.05	412	47,618	電力
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	14.6	14.6	19	2,267	電気設備
REPSOL SA	93.98	88.94	78	9,002	石油・ガス・消耗燃料
TELEFONICA S.A	318.13	362.72	155	17,925	各種電気通信サービス
ENDESA S.A.	18.57	26.11	52	6,045	電力
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19.23	15.74	36	4,252	建設・土木
BANKINTER S.A.	39.11	59.4	20	2,359	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	452.23	486.81	131	15,123	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	20.57	16.49	26	3,085	ガス
BANCO SANTANDER SA	1,086.21	1,262.68	247	28,535	銀行
RED ELECTRICA DE CORPORACION SA	32.83	27.74	42	4,937	電力
BANCO SABADELL	329.93	465.17	15	1,803	銀行
INDITEX	72.8	82.95	193	22,372	専門小売り
MAPFRE SA	67.36	67.36	11	1,272	保険
ENAGAS	13.12	24.22	49	5,710	ガス
GRIFOLS SA	17.49	25.29	73	8,489	バイオテクノロジー
FERROVIAL SA	36.15	34.19	75	8,740	建設・土木
CAIXABANK	254.06	298.33	48	5,647	銀行
AMADEUS IT GROUP SA	30	33.08	132	15,241	情報技術サービス
BANKIA SA	78.06	78.06	7	819	銀行
AENA SME SA	3.95	5.28	57	6,633	運送インフラ
CELLNEX TELECOM SAU	-	21.35	104	12,063	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	3,414.25 21銘柄	3,963.56 22銘柄	1,993 -	229,948 <0.8%>

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	79.5	80.02	102	11,834	保険
INTESA SANPAOLO	998.25	1,156	162	18,723	銀行
UNICREDIT SPA	135.36	143.54	93	10,756	銀行
ENI SPA	171.9	189.56	162	18,709	石油・ガス・消耗燃料
MEDIOBANCA SPA	35.94	32.2	16	1,909	銀行
ENEL SPA	540.9	616.95	381	44,040	電力
LEONARDO SPA	24.96	24.96	14	1,724	航空宇宙・防衛
SNAM SPA	166.86	166.86	66	7,705	ガス
TELECOM ITALIA SPA	679.63	1,147.57	39	4,527	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	343.57	343.57	11	1,367	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA	28.99	38.99	51	5,986	運送インフラ
TERNA SPA	84.28	132.78	75	8,654	電力
RECORDATI SPA	6.56	6.56	26	3,095	医薬品
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	35.8	44.8	31	3,633	飲料
PRYSMIAN SPA	14.86	25.14	43	5,050	電気設備
MONCLER SPA	11.03	11.64	38	4,470	繊維・アパレル・贅沢品
FINECOBANK SPA	-	29.18	27	3,176	銀行
POSTE ITALIANE SPA	32.15	31.4	22	2,618	保険
PIRELLI & C SPA	25.42	25.42	9	1,085	自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	株 数 ・ 金 額	1,378	159,069	
	銘柄数 < 比率 >	銘柄数 < 比率 >	-	<0.5%>	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	25.98	40.56	27	3,125	機械
NOKIAN RENKAAT OYJ	7.37	7.37	13	1,589	自動車部品
UPM-KYMMENE OYJ	39.32	39.23	98	11,386	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R SHS	32.24	58.56	60	7,029	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	29.39	33.53	101	11,758	保険
FORTUM OYJ	26.1	36.67	55	6,383	電力
NOKIA OYJ	377.99	434.21	143	16,554	通信機器
ELISA OYJ	8.37	9.76	52	6,037	各種電気通信サービス
METSO OYJ	6.47	6.47	16	1,856	機械
NESTE OYJ	22.53	31.75	98	11,346	石油・ガス・消耗燃料
KONE OYJ	23.32	25.66	143	16,606	機械
ORION OYJ	6.46	6.46	29	3,375	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	株 数 ・ 金 額	841	97,050	
	銘柄数 < 比率 >	銘柄数 < 比率 >	-	<0.3%>	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	8.6	12.98	40	4,671	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG	4.04	4.04	17	1,977	電力
VOEST-ALPINE AG	7.18	7.18	13	1,562	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	22.22	22.11	42	4,881	銀行
ANDRITZ AG	4.42	4.42	13	1,562	機械
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	9.15	9.15	14	1,662	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	株 数 ・ 金 額	141	16,318	
	銘柄数 < 比率 >	銘柄数 < 比率 >	-	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	株 数 ・ 金 額	-	27,594,088	
	銘柄数 < 比率 >	銘柄数 < 比率 >	-	<93.2%>	

(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) 外国投資信託受益証券、投資証券

銘柄	期首(前期末)		当期		期末	
	□数	金額	□数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額
(アメリカ)	千□	千円	千□	千円	千アメリカ・ドル	千円
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.762	0.923	0.923	139	14,871	14,871
BOSTON PROPERTIES INC	1.06	1.102	1.102	94	10,062	10,062
OMEGA HEALTHCARE INVS INC	-	1.699	1.699	44	4,774	4,774
SL GREEN	0.701	0.701	0.701	32	3,484	3,484
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	9.229	10.589	10.589	64	6,858	6,858
PROLOGIS INC	4.214	5.58	5.58	491	52,268	52,268
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.92	1.022	1.022	163	17,439	17,439
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.546	0.769	0.769	67	7,137	7,137
EQUINIX INC	0.53	0.648	0.648	437	46,545	46,545
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	0.923	1.41	1.41	43	4,675	4,675
DUKE REALTY TRUST	2.102	2.996	2.996	99	10,588	10,588
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	2.76	3.156	3.156	488	51,925	51,925
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.451	0.452	0.452	112	11,973	11,973
EQUITY RESIDENTIAL	2.494	2.701	2.701	170	18,112	18,112
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.433	0.67	0.67	50	5,343	5,343
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2.768	3.918	3.918	91	9,772	9,772
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.783	0.859	0.859	245	26,141	26,141
WELLTOWER INC	2.472	3.021	3.021	126	13,495	13,495
KIMCO REALTY	2.48	3.334	3.334	33	3,563	3,563
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.869	-	-	-	-	-
IRON MOUNTAIN INC	1.603	2.306	2.306	56	6,021	6,021
THE MACERICH COMPANY	0.623	-	-	-	-	-
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	-	1.468	1.468	89	9,480	9,480
HOST HOTELS & RESORTS INC	5.314	4.826	4.826	53	5,671	5,671
MID AMERICA	0.83	0.996	0.996	113	12,050	12,050
REALTY INCOME CORP	1.984	2.294	2.294	124	13,275	13,275
REGENCY CENTERS CORP	0.897	1.001	1.001	39	4,164	4,164
UDR INC	1.994	2.464	2.464	93	9,916	9,916
SIMON PROPERTY GROUP INC	2.003	2.316	2.316	132	14,040	14,040
PUBLIC STORAGE	1.014	1.133	1.133	207	22,114	22,114
SUN COMMUNITIES INC	-	0.73	0.73	95	10,168	10,168
VENTAS INC	2.365	2.748	2.748	74	7,914	7,914
VORNADO REALTY TRUST	1.271	1.1	1.1	41	4,409	4,409
WEYERHAEUSER CO	5.271	5.751	5.751	107	11,395	11,395
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.745	1.024	1.024	90	9,602	9,602
DIGITAL REALTY TRUST INC	1.4	2.003	2.003	298	31,749	31,749
MEDICAL PROPERTIES TRUST	-	3.874	3.874	65	6,992	6,992
AGNC INVESTMENT CORP	3.021	4.066	4.066	51	5,436	5,436
VEREIT INC	5.694	9.014	9.014	47	5,052	5,052
AMERICAN TOWER CORP	2.909	3.354	3.354	789	83,921	83,921
WP CAREY INC	0.947	1.492	1.492	90	9,668	9,668
INVITATION HOMES INC	1.839	4.384	4.384	107	11,475	11,475
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	0.945	-	-	-	-	-
VICI PROPERTIES INC	-	3.569	3.569	59	6,289	6,289
小計	□数	金額	□数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額
	銘柄数 < 比率 >		銘柄数 < 比率 >			
		79.166	107.463	5,827	619,848	-
(カナダ)	千□	千円	千□	千円	千カナダ・ドル	千円
SMARTCENTRES REIT	0.439	0.439	0.439	8	661	661
CANADIAN APT PPTYS REIT	-	0.371	0.371	17	1,363	1,363
H & R REAL ESTATE INVESTMENT	0.89	0.89	0.89	8	617	617
FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVEST	-	1.227	1.227	15	1,218	1,218
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TRUST	0.957	0.957	0.957	14	1,074	1,074
小計	□数	金額	□数	金額	外貨建金額	邦貨換算金額
	銘柄数 < 比率 >		銘柄数 < 比率 >			
		2.286	3.884	64	4,935	-
(オーストラリア)	千□	千円	千□	千円	千オーストラリア・ドル	千円
MIRVAC GROUP	21.484	21.917	21.917	47	3,316	3,316
GPT GROUP	14.397	11,931	11,931	46	3,205	3,205
STOCKLAND	20.553	15,847	15,847	43	3,014	3,014

銘柄	期首(前期末)		当期		末
	□数	□数	□数	外貨建金額	邦貨換算金額
(オーストラリア)		千□	千□	千オーストラリア・ドル	千円
DEXUS		7.954	7.062	61	4,265
GOODMAN GROUP		11.687	13.462	189	13,186
VICINITY CENTRES		19.022	35.904	48	3,389
SCENTRE GROUP		37.083	36.515	77	5,373
小計	□数・金額	132.18	142.638	515	35,751
	銘柄数<比率>	7銘柄<0.2%>	7銘柄<0.1%>	-	-
(香港)		千□	千□	千香港・ドル	千円
LINK REIT		13.716	14.916	1,020	13,997
HKT TRUST AND HKT LTD		22.136	-	-	-
小計	□数・金額	35.852	14.916	1,020	13,997
	銘柄数<比率>	2銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	-	-
(シンガポール)		千□	千□	千シンガポール・ドル	千円
CAPITALAND MALL TRUST		14.7	13.9	25	1,927
ASCENDAS REAL ESTATE INV		25.072	24.272	71	5,414
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		15.981	21.681	34	2,581
SUNTEC REAL ESTATE INVEST TR		13.1	13.1	17	1,352
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		-	14.1	27	2,040
小計	□数・金額	68.853	87.053	176	13,315
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.0%>	5銘柄<0.0%>	-	-
(イギリス)		千□	千□	千イギリス・ポンド	千円
BRITISH LAND CO PLC		8.045	8.045	31	4,122
HAMMERSON PLC		4.94	-	-	-
LAND SECURITIES GROUP PLC		6.057	6.057	38	5,137
SEGRO PLC		8.155	8.155	67	8,835
小計	□数・金額	27.197	22.257	137	18,095
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.1%>	3銘柄<0.1%>	-	-
(ユーロ…オランダ)		千□	千□	千ユーロ	千円
UNIBAIL-RODAMCO WESTFIELD		0.985	0.996	49	5,751
小計	□数・金額	0.985	0.996	49	5,751
	銘柄数<比率>	1銘柄<0.1%>	1銘柄<0.0%>	-	-
(ユーロ…フランス)		千□	千□	千ユーロ	千円
GECINA SA		0.267	0.282	32	3,711
ICADE		0.206	0.206	13	1,589
KLEPIERRE		1.688	1.688	28	3,302
COVIVIO		0.403	0.403	21	2,457
小計	□数・金額	2.564	2,579	95	11,061
	銘柄数<比率>	4銘柄<0.1%>	4銘柄<0.0%>	-	-
合計	□数・金額	349.083	381.786	-	722,757
	銘柄数<比率>	64銘柄<2.5%>	67銘柄<2.4%>	-	-

(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) 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。

(3) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
外 国		百万円	百万円
	S&P500 EMINI FUT	888	-
	S&P/TSE 60 IX FUT	54	-
	SPI 200 FUTURES	27	-
	FTSE 100 INDEX FUTURE	78	-
	DJ EURO STOXX 50	198	-

(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

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	27,594,088	93.2
投 資 信 託 受 益 証 券、 投 資 証 券	722,757	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等、 そ の 他	1,294,003	4.4
投 資 信 託 財 産 総 額	29,610,849	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、29,574,742千円、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、2020年5月8日における邦貨換算レートは、1アメリカ・ドル=106.36円、1カナダ・ドル=76.31円、1オーストラリア・ドル=69.42円、1香港・ドル=13.72円、1シンガポール・ドル=75.36円、1ニュージーランド・ドル=65.01円、1イギリス・ポンド=131.74円、1イスラエル・シケル=30.31円、1スイス・フラン=109.42円、1デンマーク・クローネ=15.46円、1ノルウェー・クローネ=10.41円、1スウェーデン・クローナ=10.86円、1ユーロ=115.36円です。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	29,609,447,809円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	568,831,961
株 式(評価額)	27,594,088,808
投資信託受益証券(評価額)	49,067,276
投 資 証 券(評価額)	673,690,177
未 収 入 金	68,091,874
未 収 配 当 金	34,165,965
差 入 委 託 証 拠 金	621,511,748
(B) 負 債	13,942,000
未 払 解 約 金	13,942,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	29,595,505,809
元 本	16,518,425,621
次 期 繰 越 損 益 金	13,077,080,188
(D) 受 益 権 総 口 数	16,518,425,621口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,917円

(注1) 期首元本額 15,015,808,427円
 追加設定元本額 10,856,834,110円
 一部解約元本額 9,354,216,916円

(注2) 期末における元本の内訳
 動的パッケージファンド<DC年金> 3,047,212円
 コア資産形成ファンド 2,719,976円
 MHAM外国株式インデックスファンド(ファンドラップ) 12,236,937,691円
 MHAM外国株式インデックスファンド 303,995,231円
 MHAM外国株式インデックスファンド<為替ヘッジあり>(ファンドラップ) 21,213,198円
 MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定] 557,620,659円
 MHAM外国株式パッシブファンド[適格機関投資家限定] 3,392,891,654円
 期末元本合計 16,518,425,621円

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	675,681,047円
受 取 配 当 金	671,357,017
受 取 利 息	1,604,501
そ の 他 収 益 金	2,784,846
支 払 利 息	△65,317
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△3,101,557,799
売 買 益 損	3,135,175,559
売 買 損	△6,236,733,358
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△57,069,407
取 引 益 損	408,092,332
取 引 損	△465,161,739
(D) そ の 他 費 用	△25,541,240
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△2,508,487,399
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	13,675,182,281
(G) 解 約 差 損 益 金	△8,215,779,084
(H) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,126,164,390
(I) 合 計(E+F+G+H)	13,077,080,188
次 期 繰 越 損 益 金(I)	13,077,080,188

(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。