

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／株式
信 託 期 間	2019年 7 月31日から無期限
運 用 方 針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が運用する「世界株式ファンド（適格機関投資家専用）」を主要投資対象とします。
組 入 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブの直接利用は行いません。
分 配 方 針	年 1 回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。 ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

グローバル株式ファンド

愛称：The GDP

運 用 報 告 書（全 体 版）

第 2 期（決算日 2021年 4 月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
さて、「グローバル株式ファンド」は2021年 4 月15日に第 2 期の決算を行いました。
ここに期間中の運用状況について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。

スカイオーシャン・アセットマネジメント

〒220-8611 神奈川県横浜市西区みなとみらい3-1-1

＜照会先＞ ホームページ：https://www.soam.co.jp/
サポートデスク：045-225-1651
（受付時間 営業日の午前 9 時～午後 5 時）

【運用報告書の表記について】

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

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 期 騰	中 率 落		
(設定日)	円	円		%	%	百万円
2019年7月31日	10,000	—	—	—	—	137
1期(2020年4月15日)	8,709	0	△12.9	96.4	564	
2期(2021年4月15日)	13,060	0	50.0	97.9	5,268	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

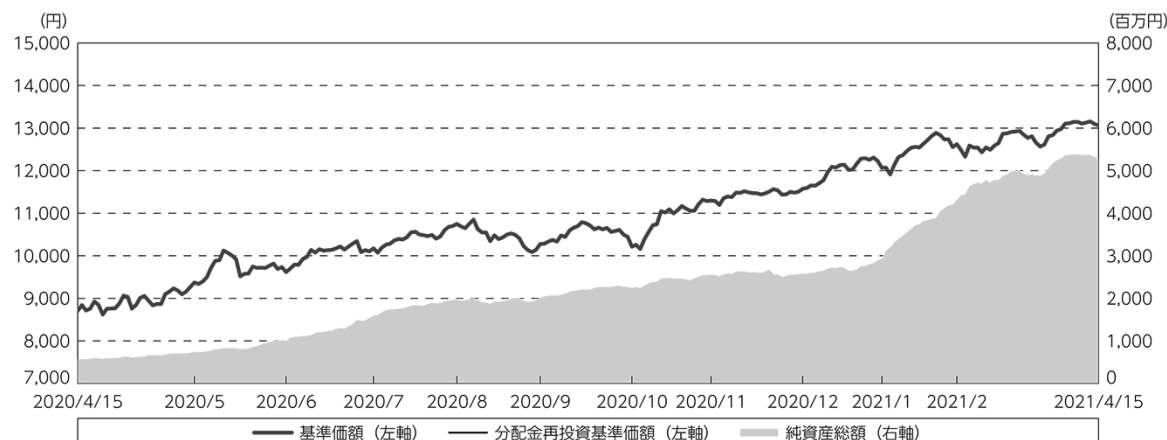
年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首)	円		%	%
2020年4月15日	8,709	—	96.4	
4月末	8,880	2.0	96.6	
5月末	9,371	7.6	97.3	
6月末	9,618	10.4	98.2	
7月末	10,174	16.8	98.1	
8月末	10,748	23.4	98.3	
9月末	10,277	18.0	97.9	
10月末	10,214	17.3	97.4	
11月末	11,296	29.7	98.1	
12月末	11,575	32.9	98.3	
2021年1月末	12,065	38.5	96.6	
2月末	12,621	44.9	98.4	
3月末	12,834	47.4	97.5	
(期 末)				
2021年4月15日	13,060	50.0	97.9	

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2020年4月16日～2021年4月15日)

期中の基準価額等の推移



期 首：8,709円

期 末：13,060円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：50.0% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2020年4月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」の基準価額が上昇したことから、当ファンドの基準価額も上昇しました。

組入ファンド	投資資産	当期末 組入比率	騰落率
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	わが国、先進国、新興国の株式	97.9%	52.7%
国内株式インデックス マザーファンド	日本株式	5.7%	39.0%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	55.4%	54.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	38.1%	54.5%
その他	コールローン等	0.8%	—
FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	わが国の公社債	0.0%	-0.2%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。騰落率は期首からのものです。

(注) 「世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」の組入資産の比率は、「世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」に対する評価額の割合です。

投資環境

■国内株式市場

国内株式市場は大幅に上昇しました。国内の新型コロナウイルスの新規感染者数は一進一退の不安定な状況が続いていますが、国内外各国の金融政策や経済対策により市場のリスク許容度が大きく改善したことが上昇要因となりました。なお、期中に安倍首相が辞任し菅新政権が誕生しましたが、国内株式市場への影響は限定的となりました。

■先進国株式市場

先進国株式市場は大幅に上昇しました。新型コロナウイルスへの警戒が続きましたが、各国の金融政策や経済対策による下支えに加え、新型コロナウイルスのワクチンの接種開始により経済正常化への進展が見られたことが好材料となりました。特に、米国でバイデン新政権が誕生し、民主党が上下両院で過半数を確保したことで大型経済対策実現への期待が高まりました。

■新興国株式市場

新興国株式市場は大幅に上昇しました。一部の国で新型コロナウイルス変異株の感染拡大が懸念されていますが、市場のリスク許容度の回復や、先進国同様に各国の金融政策や経済対策による下支えが続いたことが上昇要因となりました。ただし、2021年2月以降は米国国債利回りの上昇を警戒して、やや上値の重い展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

「世界株式ファンド（適格機関投資家専用）」への投資を高位に保つ運用を行いました。

・世界株式ファンド（適格機関投資家専用）

「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、主として日本、先進国及び新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）に投資しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

基準価額水準、市場動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、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

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 2 期
	2020年4月16日～ 2021年4月15日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	— %
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,060

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

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

○今後の運用方針

○当ファンド

「世界株式ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、主として日本、先進国及び新興国の株式(DR(預託証券))を含みます。)に投資します。

・世界株式ファンド(適格機関投資家専用)

「国内株式インデックス マザーファンド」、「外国株式インデックス マザーファンド」及び「新興国株式インデックス マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、主として日本、先進国及び新興国の株式(DR(預託証券))を含みます。)に投資し、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

・F0Fs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)

主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年4月16日～2021年4月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 51	% 0.473	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(21)	(0.198)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(27)	(0.247)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.006	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	52	0.479	
期中の平均基準価額は、10,806円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

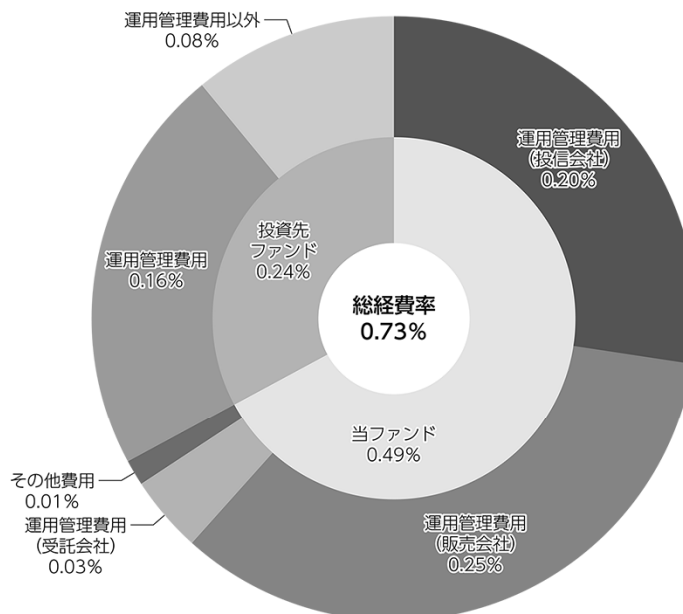
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.73%です。



(単位: %)

総経費率(①+②+③)	0.73
①当ファンドの費用の比率	0.49
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.16
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.08

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

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

○売買及び取引の状況

(2020年4月16日～2021年4月15日)

投資信託証券

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	口	千円	口	千円
		3,521,617,704	4,121,500	318,464,713	378,000

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月16日～2021年4月15日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2020年4月16日～2021年4月15日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年4月16日～2021年4月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021年4月15日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
	F0Fs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）	101,021	101,021	99	0.0
	世界株式ファンド（適格機関投資家専用）	615,218,806	3,818,371,797	5,160,147	97.9
	合 計	615,319,827	3,818,472,818	5,160,247	97.9

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2021年4月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,160,247	94.1
コール・ローン等、その他	325,269	5.9
投資信託財産総額	5,485,516	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年4月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,485,516,052
コール・ローン等	285,268,709
投資信託受益証券(評価額)	5,160,247,343
未収入金	40,000,000
(B) 負債	217,052,167
未払解約金	209,100,128
未払信託報酬	7,859,923
未払利息	781
その他未払費用	91,335
(C) 純資産総額(A－B)	5,268,463,885
元本	4,034,088,870
次期繰越損益金	1,234,375,015
(D) 受益権総口数	4,034,088,870口
1万円当たり基準価額(C／D)	13,060円

(注) 当ファンドの期首元本額は648,245,345円、期中追加設定元本額は5,125,121,986円、期中一部解約元本額は1,739,278,461円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.3060円です。

○損益の状況 (2020年4月16日～2021年4月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 60,127
支払利息	△ 60,127
(B) 有価証券売買損益	639,115,367
売買益	864,913,544
売買損	△ 225,798,177
(C) 信託報酬等	△ 11,103,189
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	627,952,051
(E) 前期繰越損益金	△ 38,124,280
(F) 追加信託差損益金	644,547,244
(配当等相当額)	(△ 208,646)
(売買損益相当額)	(644,755,890)
(G) 計(D＋E＋F)	1,234,375,015
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	1,234,375,015
追加信託差損益金	644,547,244
(配当等相当額)	(△ 208,646)
(売買損益相当額)	(644,755,890)
分配準備積立金	589,887,898
繰越損益金	△ 60,127

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

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

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

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(589,887,898円)、および信託約款に規定する収益調整金(644,695,763円)より分配対象収益は1,234,583,661円(1万円当たり3,060円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○お知らせ

該当事項はございません。

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／株式	
信託期間	信託期間は2019年7月23日から無期限です。	
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式インデックス マザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックス マザーファンド	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックス マザーファンド	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	世界株式ファンド (適格機関投資家専用)	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。
	国内株式インデックス 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は、行いません。
	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。
	新興国株式インデックス マザーファンド	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)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。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

世界株式ファンド (適格機関投資家専用)

運用報告書(全体版)

第1期(決算日 2020年6月10日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
■当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比	投 信 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分 配	込 金	期 騰 落 中 率				
設 定 日 (2019年7月23日)	円 10,000	円 —	—	% —	% —	% —	百万円 0.5	
第1期(2020年6月10日)	10,229	0	2.3	94.9	2.5	1.5	801	

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

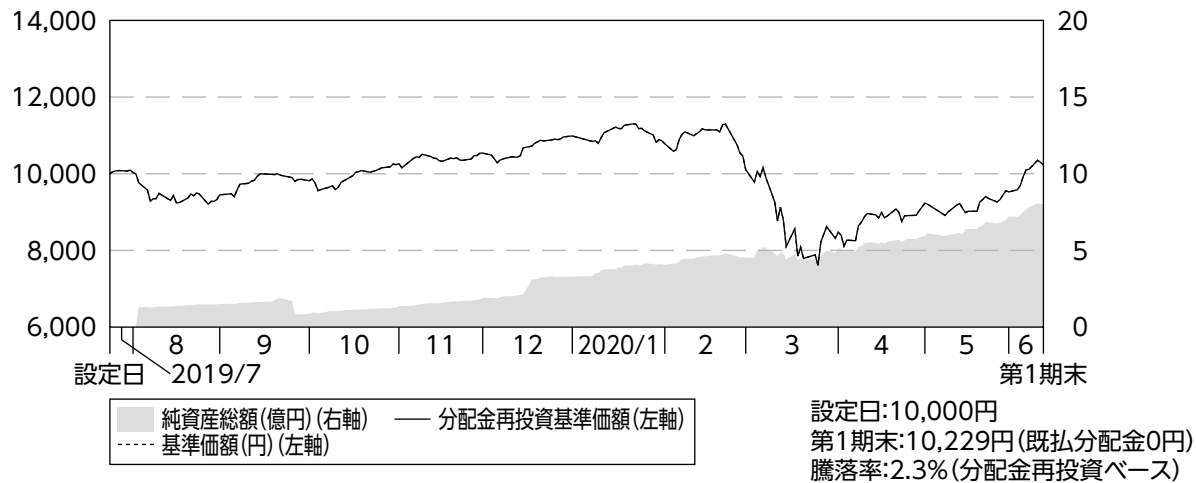
年 月 日	基 準	価 額	株 組 入 比 率	式 率	株 式 先 物 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率				
(設 定 日) 2019年 7月23日	円 10,000	% —		% —	% —	% —
7月末	10,032	0.3		93.3	3.2	1.6
8月末	9,450	△5.5		93.8	3.3	1.8
9月末	9,818	△1.8		94.5	3.9	1.8
10月末	10,262	2.6		94.1	3.3	1.7
11月末	10,539	5.4		94.9	2.3	1.7
12月末	10,986	9.9		96.1	5.0	1.7
2020年 1月末	10,782	7.8		93.8	3.5	1.7
2月末	10,104	1.0		94.2	3.0	1.7
3月末	8,474	△15.3		91.7	5.5	1.5
4月末	9,232	△7.7		94.3	3.1	1.5
5月末	9,525	△4.8		93.2	4.0	1.5
(当 期 末) 2020年 6月10日	10,229	2.3		94.9	2.5	1.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定していません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様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、2019年7月23日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

設定日から2020年1月にかけては、米中対立激化への懸念が高まり下落する場面もありましたが、各国中央銀行の金融緩和期待や米中通商協議の進展期待などを背景に底堅く推移しました。2月下旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まったことやOPEC(石油輸出国機構)と非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことを受けて大幅に下落する展開となりましたが、期末にかけては各国が打ち出した大規模な経済政策や経済活動再開への期待などを背景に反発しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	6.1%	5.7%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	54.3%	4.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	38.7%	△3.1%

投資環境

国内株式市場

設定日から2020年1月にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景に底堅く推移しました。1月下旬以降は、新型コロナウイルス感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まり大幅に下落する展開となりましたが、期末にかけては、欧米の経済活動再開への期待や国内での新規感染者数の減少、緊急事態宣言の全面的な解除などを背景に反発しました。

先進国株式市場

設定日から2020年2月中旬にかけては、米中通商協議の進展期待などを背景に底堅く推移しました。3月中旬にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まったことやOPEC（石油輸出国機構）と非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことを受けて大幅に下落する展開となりましたが、期末にかけては、各国が打ち出した大規模な経済政策や経済活動再開への期待などを背景に反発しました。

新興国株式市場

設定日から2020年1月にかけては、米中通商協議進展への期待が高まったことや中国の金融緩和策への期待感などを背景に上昇基調で推移しました。2020年1月下旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界経済減速への懸念が高まったことやOPECと非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことを受けて大幅に下落する展開となりましたが、期末にかけては、各国が打ち出した大規模な経済政策などを受けて反発しました。

○当ファンド

国内、先進国および新興国の株式へ分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。各資産への配分は、概ね基本組入比率を維持する運用を行いました。

・国内株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目標として、現物株式については、東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外した上で、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、設定や解約による資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む国内株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

・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)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む外国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

・新興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エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成して運用を行い、また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む新興国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

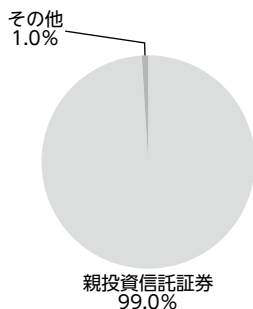
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

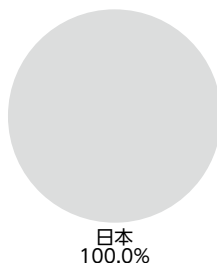
	当期末
	2020年6月10日
外国株式インデックス マザーファンド	54.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	38.7%
国内株式インデックス マザーファンド	6.1%
その他	1.0%
組入ファンド数	3

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

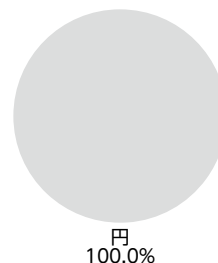
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目		第1期
		2019年7月23日～2020年6月10日
当期分配金	(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	(円)	301

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)―印は該当がないことを示します。

○当ファンド

下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本、先進国及び新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資します。

各マザーファンド受益証券の基本組入比率は、日本、先進国(日本を除きます。)及び新興国のGDP(Gross Domestic Product(国内総生産))総額の比率に基づき決定します。

・国内株式インデックス マザーファンド

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)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。

・外国株式インデックス マザーファンド

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)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。

・新興国株式インデックス マザーファンド

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年7月23日～2020年6月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.146%	(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9,927円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(12)	(0.117)	
(販売会社)	(1)	(0.010)	
(受託会社)	(2)	(0.019)	
(b) 売買委託手数料	2	0.018	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(1)	(0.013)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(1)	(0.006)	
(c) 有価証券取引税	1	0.013	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.013)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	7	0.074	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(7)	(0.068)	
(監査費用)	(0)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	24	0.251	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各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。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
新興国株式インデックス マザーファンド	132,110	358,085	18,028	48,186
国内株式インデックス マザーファンド	36,861	54,450	5,176	7,703
外国株式インデックス マザーファンド	184,319	483,662	26,127	67,921

株式売買比率

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<新興国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,503,142千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	58,047,808千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.35

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	127,792,476千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	299,990,763千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.42

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	65,697,738千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	355,212,231千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.18

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■ 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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 1	百万円 1	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	802	132	16.5	794	130	16.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国株式インデックス マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 32	百万円 32	% 100.0	百万円 32	百万円 32	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	26,147	3,534	13.5	26,148	3,534	13.5

<平均保有割合 0.2%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 916	百万円 916	% 100.0	百万円 916	百万円 916	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	793,364	139,097	17.5	783,799	136,818	17.5

<平均保有割合 0.0%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式インデックス マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 84,375	百万円 67	% 0.1	百万円 44,690	百万円 12	% 0.0
金 銭 信 託	188	188	100.0	188	188	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	183,230	27,585	15.1	182,693	27,454	15.0

<平均保有割合 0.1%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

＜国内株式インデックス マザーファンド＞

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	225百万円	140百万円	873百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当 期 首 残 高 (元)	当 期 設 定 本	当 期 解 約 本	当 期 末 残 高 (元)	取 引 の 理 由
千円 －	千円 500	千円 500	千円 －	当初設定時における取得およびその解約

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	当 期 末	
	口 数	評 価 額
	千口	千円
新興国株式インデックス マザーファンド	114,081	310,494
国内株式インデックス マザーファンド	31,685	48,598
外国株式インデックス マザーファンド	158,192	435,171

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

新興国株式インデックス マザーファンド 25,324,856千円

国内株式インデックス マザーファンド 216,012,632千円

外国株式インデックス マザーファンド	153,028,332千口
--------------------	---------------

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
新興国株式インデックス マザーファンド	310,494	38.7
国内株式インデックス マザーファンド	48,598	6.1
外国株式インデックス マザーファンド	435,171	54.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,068	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	802,331	100.0

(注1)新興国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(68,927,972千円)の投資信託財産総額(68,951,633千円)に対する比率は100.0%です。

(注2)外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(422,064,201千円)の投資信託財産総額(423,221,792千円)に対する比率は99.7%です。

(注3)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル＝107.79円	1カナダドル＝80.37円	1メキシコペソ＝4.93円
1ブラジルレアル＝21.99円	1チリペソ＝0.14円	1コロンビアペソ＝0.0295円
1ユーロ＝122.26円	1イギリスポンド＝137.16円	1スイスフラン＝113.33円
1スウェーデンクローナ＝11.71円	1ノルウェークローネ＝11.62円	1デンマーククローネ＝16.40円
1トルコリラ＝15.86円	1チェココルナ＝4.60円	1ハンガリーフォリント＝0.355円
1ポーランドズロチ＝27.51円	1オーストラリアドル＝74.81円	1ニュージーランドドル＝70.07円
1香港ドル＝13.91円	1シンガポールドル＝77.59円	1マレーシアリンギット＝25.23円
1タイバーツ＝3.45円	1フィリピンペソ＝2.16円	1インドネシアルピア＝0.0078円
1韓国ウォン＝0.09円	1新台湾ドル＝3.62円	1インドルピー＝1.44円
1イスラエルシェケル＝31.25円	1パキスタンルピー＝0.66円	1カタールリアル＝29.40円
1南アフリカランド＝6.49円	1アラブ首長国連邦ディルハム＝29.39円	1サウジアラビアリアル＝28.78円
1香港・オフショア人民元＝15.23円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年6月10日現在
(A)資 産	802,331,388円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,065,791
新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	310,494,736
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	48,598,885
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	435,171,976
(B)負 債	350,396
未 払 信 託 報 酬	339,112
未 払 利 息	11
そ の 他 未 払 費 用	11,273
(C)純 資 産 総 額(A-B)	801,980,992
元 本	784,023,262
次 期 繰 越 損 益 金	17,957,730
(D)受 益 権 総 口 数	784,023,262口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,229円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年7月23日 至 2020年6月10日
(A)配 当 等 収 益	△1,518円
受 取 利 息	11
支 払 利 息	△1,529
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	23,155,180
売 買 益	25,570,915
売 買 損	△2,415,735
(C)信 託 報 酬 等	△502,553
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	22,651,109
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	△4,693,379
(配 当 等 相 当 額)	(△3,569)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△4,689,810)
(F) 計 (D+E)	17,957,730
(G)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	17,957,730
追 加 信 託 差 損 益 金	△4,693,379
(配 当 等 相 当 額)	(991,427)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△5,684,806)
分 配 準 備 積 立 金	22,651,109

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は500,000円、期中追加設定元本額は909,062,765円、期中一部解約元本額は125,539,503円です。

※分配金の計算過程

項	目	当	期
(A)	配当等収益額(費用控除後)		6,315,314円
(B)	有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)		16,335,795円
(C)	収益調整金額		991,427円
(D)	分配準備積立金額		－円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		23,642,536円
(F)	期末残存口数		784,023,262口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		301円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2020年3月14日)

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	1.9	151,002
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	1.8	162,440
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	1.8	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	2.2	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7	313,448

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(当 期 首) 2019年 5月29日	円 14,134	% －	1,536.41	% －	% 97.8	% 2.2
5月末	13,912	△1.6	1,512.28	△1.6	98.0	2.1
6月末	14,292	1.1	1,551.14	1.0	98.7	1.5
7月末	14,422	2.0	1,565.14	1.9	99.0	1.0
8月末	13,935	△1.4	1,511.86	△1.6	98.9	1.1
9月末	14,775	4.5	1,587.80	3.3	98.2	1.9
10月末	15,514	9.8	1,667.01	8.5	97.9	1.9
11月末	15,816	11.9	1,699.36	10.6	98.2	1.8
12月末	16,044	13.5	1,721.36	12.0	98.9	1.1
2020年 1月末	15,701	11.1	1,684.44	9.6	98.7	1.3
2月末	14,087	△0.3	1,510.87	△1.7	98.5	1.5
3月末	13,248	△6.3	1,403.04	△8.7	97.3	2.6
4月末	13,822	△2.2	1,464.03	△4.7	97.9	2.1
(当 期 末) 2020年 5月29日	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7

(注1) 騰落率は期首比です。

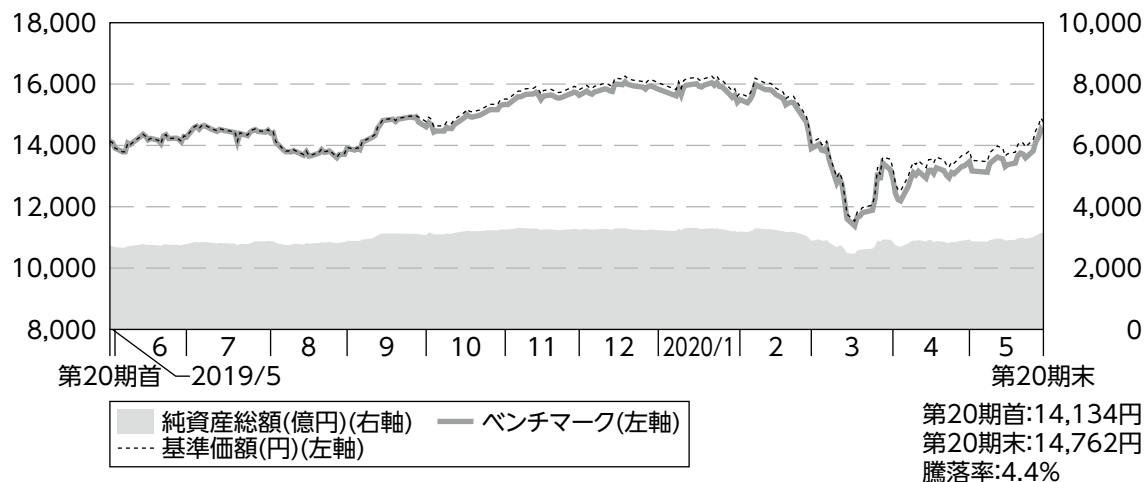
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、期首と比べて上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

期初から年末までは、米中通商協議の進展や企業業績の改善期待などから、国内株式市場は上昇しました。年明け以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、経済活動の停滞による企業業績への影響が懸念されたこと、原油価格が急落したことなどから3月中旬にかけて大きく下落しました。4月は各国の金融緩和政策や大規模な経済対策が打ち出されたこと、欧米での経済活動再開の動きなどを背景に反発し、期末にかけては国内で緊急事態宣言が全面解除になったことなどから、上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

- (1) 株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。
- (2) 東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX(東証株価指数)の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

当ファンドの組入資産の内容

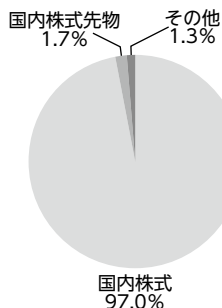
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.3%
2	ソニー	日本	1.9%
3	キーエンス	日本	1.8%
4	東証株価指数先物 2006	日本	1.7%
5	ソフトバンクグループ	日本	1.7%
6	武田薬品工業	日本	1.5%

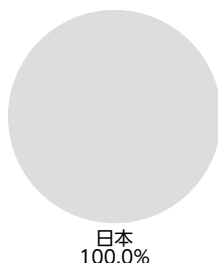
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本電信電話	日本	1.4%
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.3%
9	第一三共	日本	1.3%
10	任天堂	日本	1.2%
組入銘柄数			2,104

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

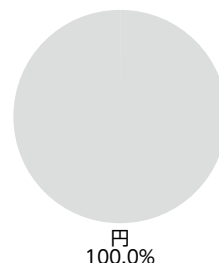
○資産別配分



○国別配分



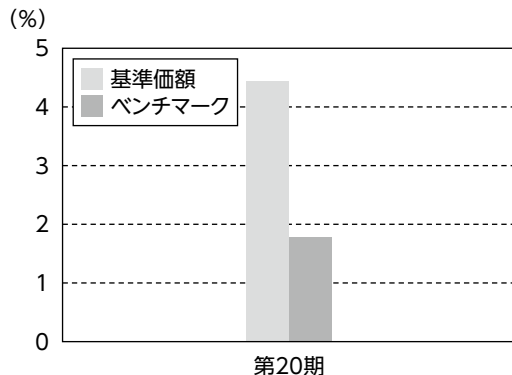
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.7%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)です。

今後の運用方針

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日～2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (0) (－) (－) (－) (－) (0)	0.001% (0.000) (0.000) (－) (－) (－) (－) (0.000)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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) (監査費用) (その他)	0 (－) (－) (0)	0.000 (－) (－) (0.000)	(c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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。

(注2) 各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(14,630円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株 式＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 44,017 (2,402)	千円 77,573,825 (－)	千株 24,490	千円 48,238,316

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜新株予約権証券＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	内	証券 － (225,900)	千円 － (－)	証券 187,800	千円 562

(注1) 金額は受渡代金です。

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		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 48,977	百万円 49,910	百万円 －	百万円 －

(注) 金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	125, 812, 141千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	295, 160, 588千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0. 42

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 998	百万円 998	% 100. 0	百万円 276	百万円 276	% 100. 0
コ ー ル ・ ロ ー ン	867, 507	151, 128	17. 4	868, 693	152, 069	17. 5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■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	221百万円	144百万円	818百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注2) 当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	5.3	6.6	17,787
日本水産	164	188	93,812
マルハニチロ	23.7	27.2	63,403
カネコ種苗	5	5.7	8,128
サカタのタネ	20	22.4	82,880
ホクト	13.8	14.3	28,700
ホクリヨウ	2.2	2.9	1,899
鉱業(0.2%)			
住石ホールディングス	35.2	38	4,332
日鉄鉱業	3.8	4.3	19,694
三井松島ホールディングス	6.9	7.3	6,336
国際石油開発帝石	658	754.3	566,403
石油資源開発	23.6	24.6	49,790
K&Oエナジーグループ	8	9.1	14,177
建設業(2.6%)			
ヒノキヤグループ	4.6	4.7	7,755
ショーボンドホールディングス	11.7	29.3	146,060
ミライト・ホールディングス	46.1	55.9	86,030
タマホーム	7.9	10.1	13,170
サンヨーホームズ	2.4	1.6	1,016
日本アクア	5.2	7.5	4,567
ファーストコーポレーション	5	5.7	3,060
ベステラ	3.1	3.2	3,260
T A T E R U	14.2	38.8	6,440
キャンディル	—	3.1	1,692
スペースバリューホールディングス	19.9	22.9	8,106
ダイセキ環境ソリューション	3.1	3.6	3,589
第一カッター興業	2	2.3	4,261
明豊ファシリティワークス	—	6	3,426
安藤・間	105.9	112	78,064
東急建設	48.6	55.1	32,398
コムシスホールディングス	58.2	66.7	200,100
ミサワホーム	13.6	—	—
ビーアールホールディングス	17.8	20.5	11,890
高松コンストラクショングループ	10.4	11.7	29,987
東建コーポレーション	5.1	5.8	42,862
ソネック	1.7	1.9	1,548
ヤマウラ	7	8.2	6,674
大成建設	134.8	144.8	541,552
大林組	406.3	434.2	432,897
清水建設	414.5	440.7	401,918
飛島建設	12	12.5	13,937

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
長谷工コーポレーション	169.7	168.1	220,715
松井建設	15.7	17.1	10,602
銭高組	1.7	1.9	6,916
鹿島建設	317.5	340.9	416,579
不動テトラ	9.7	11.3	16,012
大末建設	5.4	5	3,900
鉄建建設	8.4	9.4	20,896
西松建設	29.4	33.5	70,618
三井住友建設	95.8	104.9	47,519
大豊建設	9.4	9.7	24,298
前田建設工業	97.1	108.8	91,936
佐田建設	10.2	9.3	3,822
ナカノフドー建設	11.5	11.9	4,605
奥村組	22.4	23.6	61,360
東鉄工業	16.2	18.6	53,512
イチケン	2.8	3.1	4,665
富士ビー・エス	5.6	6.4	3,628
浅沼組	5	4.9	20,727
戸田建設	158.2	180.3	119,719
熊谷組	19.5	20.1	52,923
青木あすなろ建設	7.3	—	—
北野建設	3	2.6	6,845
植木組	1.9	1.9	4,683
矢作建設工業	18.3	19.2	14,803
ビーエス三菱	15	14.3	7,907
日本ハウスホールディングス	25.7	29.6	9,324
大東建託	48.2	47.4	539,649
新日本建設	16.7	18.5	13,949
N I P P O	35.8	35.9	96,032
東亜道路工業	2.5	2.7	8,788
前田道路	42.4	38.3	76,944
日本道路	3.7	4.2	29,820
東亜建設工業	9.7	13.5	22,207
日本国土開発	22	42.2	23,252
若築建設	6.8	7.8	9,016
東洋建設	49.3	48.7	20,892
五洋建設	160.9	172.1	96,720
世紀東急工業	19.6	20.8	16,681
福田組	4.5	5	24,425
住友林業	96.3	110	150,810
日本基礎技術	13.8	14.6	6,161
巴コーポレーション	18.5	19.3	7,102
大和ハウス工業	374.9	429.6	1,148,965

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ライト工業	26	24.8	36,257	
積水ハウス	414.7	470.9	966,522	
日特建設	11.5	11.3	8,203	
北陸電気工事	6.5	7.5	7,020	
ユアテック	21.6	24.8	15,648	
日本リーテック	—	9.1	18,891	
四電工	2.1	2.4	5,616	
中電工	17.4	17.5	40,512	
関電工	61.6	61.8	60,811	
きんでん	90	103.2	186,069	
東京エネシス	14	14.4	10,742	
トーエネック	3.8	4.4	17,160	
住友電設	9.4	12.3	30,786	
日本電設工業	23.1	23.8	56,715	
協和エクシオ	53	65.8	162,789	
新日本空調	11.7	11.5	29,175	
九電工	26.7	30.5	91,286	
三機工業	31	31.3	42,974	
日揮ホールディングス	117	133.7	154,958	
中外炉工業	4.1	4.7	7,477	
ヤマト	13.3	13.9	9,201	
太平電業	9.2	10.5	24,874	
高砂熱学工業	33.2	37.7	68,991	
三晃金属工業	1.9	1.9	3,912	
朝日工業社	3	2.9	8,990	
明星工業	24.4	28.1	21,243	
大気社	18.6	21.1	71,001	
ダイダン	9.3	10.4	30,108	
日比谷総合設備	12.2	14	27,468	
東芝プラントシステム	29.6	—	—	
フィル・カンパニー	—	2.5	7,762	
OSJBホールディングス	59.7	68.5	16,988	
東洋エンジニアリング	10.1	18.2	7,352	
レイズネクスト	24.3	23.3	29,870	
食料品(4.0%)				
日本製粉	38.4	40.7	66,422	
日清製粉グループ本社	136.9	157	263,603	
日東富士製粉	0.9	1	6,130	
昭和産業	11.1	12.8	42,176	
鳥越製粉	10.7	12.3	11,033	
中部飼料	14.8	17	28,339	
フィード・ワン	81	93.3	17,353	
東洋精糖	1.8	2.3	2,877	
日本甜菜製糖	6.9	7.2	12,175	
三井製糖	9.6	12.2	25,412	
塩水港精糖	13.1	15	3,150	
日新製糖	5.7	6.6	12,889	
森永製菓	30.5	32.6	150,775	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
中村屋	3.1	3.6	14,634	
江崎グリコ	36.4	41.2	214,652	
名糖産業	5.8	6.7	8,723	
井村屋グループ	5.2	7.9	16,163	
不二家	6.8	7.8	16,941	
山崎製パン	99.1	104.2	201,210	
第一屋製パン	2.1	2.4	2,287	
モロゾフ	2.1	2.4	14,304	
亀田製菓	7.5	7.9	42,818	
寿スビリッツ	12.8	13.4	70,350	
カルビー	55.2	63.3	197,179	
森永乳業	24.3	25.7	116,421	
六甲バター	8.8	9.2	14,646	
ヤクルト本社	89.8	95.6	630,960	
明治ホールディングス	85.9	91.9	745,309	
雪印メグミルク	29.2	33.5	88,607	
ブリマハム	17	21.7	57,266	
日本ハム	50.2	53.1	211,338	
林兼産業	4	4.6	2,658	
丸大食品	12.9	14.8	28,786	
S F o o d s	10.9	11.1	28,338	
柿安本店	—	4.8	12,566	
伊藤ハム米久ホールディングス	78	89.5	59,965	
サッポロホールディングス	44.3	47.4	102,147	
アサヒグループホールディングス	253.8	291	1,180,878	
キリンホールディングス	548.3	589.4	1,301,100	
宝ホールディングス	90.8	103	89,507	
オエノンホールディングス	34.3	36.7	14,496	
養命酒製造	3.7	4.3	8,105	
コカ・コーラ ボトラーズ	92.8	97.5	208,650	
ジャパンホールディングス	81.1	93	409,200	
サントリー食品インターナショナル	6.8	7.1	37,488	
ダイドーグループホールディングス	36.8	42.2	260,796	
伊藤園	11.9	13.7	32,208	
キーコーヒー	3.3	3.6	3,470	
ユニカフェ	1.7	2	2,376	
ジャパンフーズ	15.6	17.9	61,576	
日清オイリオグループ	29.6	33.9	98,004	
不二製油グループ本社	1.3	1.5	5,572	
かどや製油	6.3	7.2	31,140	
Jーオイルミルズ	80	100	542,000	
キッコーマン	267.7	306.9	563,775	
味の素	67.5	77.4	163,236	
キュービー	45.3	52	189,540	
ハウス食品グループ本社	48.6	52.7	159,944	
カゴメ	5.9	6.7	6,204	
焼津水産化学工業	11.1	12.7	94,996	
アリアケジャパン	1.6	1.8	2,901	
ビエトロ				

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エバラ食品工業	2.9	3.4	7,490	
やまみ	—	1.2	2,766	
ニチレイ	63	66.2	200,917	
東洋水産	62.4	71.5	402,545	
イトアイト	4.2	4.8	8,587	
大冷	1.4	1.8	3,520	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3.3	7.7	8,993	
日清食品ホールディングス	51.5	59.1	531,900	
永谷園ホールディングス	6.5	6.8	14,980	
一正蒲鉾	4.7	5.4	5,340	
フジッコ	13.1	15	29,865	
ロック・フィールド	13.1	15	20,910	
日本たばこ産業	699.9	802.4	1,715,130	
ケンコーマヨネーズ	6.8	7.8	16,723	
わらべや日洋ホールディングス	7.9	9.1	15,970	
なとり	6.8	7.8	13,657	
イフジ産業	2.1	2.4	1,924	
ビックルスコーポレーション	2.9	3	6,897	
北の達人コーポレーション	47.6	48.5	25,268	
ユウグレナ	51.7	59.9	44,565	
ミヨシ油脂	4.6	5.3	6,163	
理研ビタミン	5.7	13.1	29,606	
繊維製品(0.5%)				
片倉工業	14.6	20.1	24,321	
グンゼ	8	10.1	38,733	
東洋紡	50.2	53.9	81,335	
ユニチカ	34.7	41	14,514	
富士紡ホールディングス	6.2	6.7	21,607	
倉敷紡績	11.3	13.7	33,236	
シキボウ	6.2	7.1	7,518	
日本毛織	39	45.1	45,370	
トーア紡コーポレーション	5	5.4	2,770	
ダイドーリミテッド	14.4	—	—	
帝国繊維	13.3	15.5	35,495	
帝人	96.5	110.9	195,627	
東レ	917.7	982.7	514,836	
サカイオーベックス	3	3.8	8,230	
住江織物	3.5	3	5,790	
日本フェルト	6.9	8.6	4,110	
イチカワ	1.8	2.3	3,153	
日東製網	1.4	1.6	2,289	
アツギ	9.9	11.3	6,983	
ダイニック	4.8	5.1	3,937	
セーレン	29.2	33.7	45,023	
ソトー	4.8	5.5	5,274	
東海染工	1.7	2	2,234	
小松マテレー	19.6	22.4	16,598	
ワコールホールディングス	34.5	35.4	78,977	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ホギメディカル	14.7	15.5	54,715	
レナウン	34	—	—	
クラウドシアホールディングス	3.1	3.6	1,551	
T S I ホールディングス	43.8	45.7	21,113	
マツオカコーポレーション	3.8	3.9	9,426	
ワールド	15.5	19.3	30,243	
三陽商会	7.2	7.2	6,523	
ナイガイ	4.5	5.2	1,872	
オンワードホールディングス	71.3	81.7	30,229	
ルックホールディングス	4.4	4.7	4,037	
ゴールドウイン	10.7	24.6	169,494	
デサント	28.9	26.5	42,479	
キング	6.4	6.6	3,399	
ヤマトインターナショナル	7.8	12.2	4,318	
パルプ・紙(0.2%)				
特種東海製紙	7.5	8.6	37,238	
王子ホールディングス	532.5	566.9	306,692	
日本製紙	56.7	60	95,460	
三菱製紙	19.2	15.4	5,852	
北越コーポレーション	78.5	80.8	32,804	
中越パルプ工業	5	5.7	8,396	
巴川製紙所	3.9	4	3,528	
大王製紙	57.6	59.8	87,128	
阿波製紙	3	3.5	1,928	
レンゴー	122	128.2	109,226	
トーモク	7.3	8.3	14,292	
ザ・バック	9	10.3	32,136	
化学(7.2%)				
クラレ	199.6	213.6	241,795	
旭化成	841.5	898.8	763,980	
共和レザー	7.4	7.4	4,995	
昭和電工	78.6	96.5	248,487	
住友化学	931.1	996.3	332,764	
住友精化	5.8	6	18,240	
日産化学	72.6	75.3	358,051	
ラサ工業	4.2	4.8	7,123	
クレハ	10.9	11.6	55,042	
多木化学	3.5	5.3	38,160	
テイカ	9.6	9.9	15,592	
石原産業	22.7	24.3	18,516	
片倉コープアグリ	3.4	3.5	4,189	
日東エフシー	7.4	—	—	
日本曹達	18.7	20.1	60,119	
東ソー	182.8	209.6	313,980	
トクヤマ	34.1	39.1	100,721	
セントラル硝子	25.8	27.7	54,402	
東亜合成	74.2	85.1	87,738	
大阪ソーダ	12.7	13.8	36,156	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
関東電化工業	27.9	32.2	29,913	
デンカ	46.5	49.5	130,630	
信越化学工業	208.4	232.8	2,937,936	
日本カーバイド工業	4	4.6	6,536	
堺化学工業	7.9	8.8	17,512	
第一稀元素化学工業	12.8	14.7	11,598	
エア・ウォーター	96.9	126.1	197,346	
大陽日酸	97.4	130.3	236,103	
日本化学工業	4	4.2	9,979	
東邦アセチレン	1.8	2	2,564	
日本パーカライジング	64.6	68.4	78,523	
高圧ガス工業	18.7	21.5	16,598	
チタン工業	1.5	1.7	3,197	
四国化成工業	19.9	20.9	23,951	
戸田工業	2.5	3.1	5,270	
ステラ ケミファ	6.9	7.4	19,617	
保土谷化学工業	4.1	5.1	21,394	
日本触媒	19.9	21	126,630	
大日精化工業	9.8	12	29,940	
カネカ	30.6	35.1	100,842	
三菱瓦斯化学	121.6	126.2	202,424	
三井化学	107.4	123.1	275,744	
J S R	118.7	126.4	266,956	
東京応化工業	20.3	23.3	116,267	
大阪有機化学工業	11	12.5	23,437	
三菱ケミカルホールディングス	790.8	906.5	574,992	
KHネオケム	18	23.9	50,668	
ダイセル	174.2	176.6	161,059	
住友ベークライト	20.5	21.3	64,539	
積水化学工業	258.5	291.6	438,858	
日本ゼオン	106.7	122.3	126,825	
アイカ工業	35.5	40.7	130,647	
宇部興産	59.7	68.5	131,862	
積水樹脂	19.5	24.4	57,803	
タキロンシーアイ	25.5	29.3	21,564	
旭有機材	8.2	7.7	11,719	
日立化成	54.7	—	—	
ニチバン	6.2	7.1	10,848	
リケンテクノス	32.1	34.1	14,799	
大倉工業	6.1	6.4	10,534	
積水化成成品工業	17.5	18.2	11,011	
群栄化学工業	3	3.1	8,487	
タイガースポリマー	6.3	7.1	3,315	
ミライアル	3.5	4.8	6,196	
ダイキアクシス	4.3	4.8	3,796	
ダイキョーニシカワ	25	28.6	17,388	
竹本容器	4.3	4.8	3,561	
森六ホールディングス	6.4	7.3	11,680	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本化薬	75.3	83.9	90,779	
カーリットホールディングス	12.7	14.5	8,018	
日本精化	9.5	10.9	16,088	
扶桑化学工業	12	13.7	55,005	
トリケミカル研究所	2.6	3	32,070	
A D E K A	58.3	62.4	93,537	
日油	44.6	51.1	195,713	
新日本理化	—	22.4	4,032	
ハリマ化成グループ	9.8	11.2	11,144	
花王	293.2	331.5	2,866,480	
第一工業製薬	4.4	5.1	24,046	
石原ケミカル	3	3.7	7,211	
日華化学	4.1	4.6	4,324	
ニイタカ	1.9	2.8	10,262	
三洋化成工業	8	8.1	40,014	
有機合成薬品工業	9.3	10.4	3,983	
大日本塗料	13.4	15.3	15,055	
日本ペイントホールディングス	97.6	111.9	840,369	
関西ペイント	132.9	152.4	340,156	
神東塗料	9.6	10.7	1,926	
中国塗料	38.8	38.6	31,574	
日本特殊塗料	8.9	10.1	9,120	
藤倉化成	15.9	18.3	9,150	
太陽ホールディングス	9.7	10	50,600	
D I C	53.5	57.3	161,070	
サカタインクス	25.8	29.6	31,760	
東洋インキSCホールディングス	25	28.7	59,724	
T & K T O K A	9.2	10.5	8,379	
富士フイルムホールディングス	250.9	265.5	1,322,455	
資生堂	240	275.1	1,807,407	
ライオン	168.3	180	443,700	
高砂香料工業	8.3	8.7	21,523	
マンダム	27.2	31.1	67,704	
ミルボン	14.9	18.5	98,235	
ファンケル	53.8	56	171,360	
コーセー	20.5	26	350,740	
コタ	6.4	8	9,632	
シーボン	1.5	1.8	3,855	
ボーラ・オルビスホールディングス	51.6	59.1	123,873	
ノエビアホールディングス	11.5	11.7	56,394	
アジュパンコスメジャパン	2.8	3.1	2,945	
エステー	8.7	8.9	14,747	
アグロ カネショウ	4.9	5.8	8,497	
コニシ	21.4	22.7	34,662	
長谷川香料	16	23.9	56,977	
星光PMC	8.1	7.9	5,688	
小林製薬	33.8	38.8	372,480	
荒川化学工業	10.8	12.4	16,132	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
メック	8.3	9.5	19,826	
日本高純度化学	3.3	3.8	10,199	
タカラバイオ	31.6	36.2	104,038	
J C U	15.7	16.8	54,600	
新田ゼラチン	7.6	8.7	6,298	
O A T アグリオ	1.7	2.4	2,733	
デクセリアルズ	31.2	35.8	30,716	
アース製薬	9.1	10.4	74,048	
北興化学工業	12.3	14.2	8,676	
大成ラミック	4	4.5	12,078	
クミアイ化学工業	49.9	57.3	49,851	
日本農薬	21.4	24.7	12,177	
アキレス	8.8	9.5	16,102	
有沢製作所	18.9	21.9	17,760	
日東電工	83.3	95.5	556,765	
レック	12.9	14.8	23,650	
三光合成	13.9	15.8	5,024	
きもと	20.9	23.5	3,689	
藤森工業	10.9	12.4	43,586	
前澤化成工業	8.3	8.8	9,160	
未来工業	6.5	7.4	14,481	
ウェーブブロックホールディングス	3.4	4.8	3,758	
J S P	7.1	8.1	11,979	
エフピコ	13.3	15.2	120,232	
天馬	8.4	9.2	16,790	
信越ポリマー	21.6	24.9	23,655	
東リ	30.2	34.5	9,004	
ニフコ	48.4	50.8	119,786	
バルカー	9.8	11.2	23,307	
ユニ・チャーム	256.1	266.9	1,070,269	
ショーエイコーポレーション	1	2.1	1,852	
医薬品(7.2%)				
協和キリン	141.7	139.3	407,034	
武田薬品工業	1,054.4	1,152	4,828,032	
アステラス製薬	1,113.5	1,200.5	2,298,357	
大日本住友製薬	89.5	102.6	156,259	
塩野義製薬	154.4	174.1	1,107,450	
田辺三菱製薬	126.3	—	—	
わかもと製薬	14.3	16.5	4,158	
あすか製薬	14.9	15.8	18,644	
日本新薬	31.6	36.2	335,936	
バイオフェルミン製薬	2.1	2.4	5,481	
中外製薬	125.9	144.4	2,294,516	
科研製薬	21.8	23.7	140,304	
エーザイ	144.6	165.7	1,398,176	
ロート製薬	61.9	71.1	235,341	
小野薬品工業	285.2	318	978,486	
久光製薬	35.7	36.6	198,738	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
持田製薬	18.3	19.2	80,160	
参天製薬	224.8	257.9	513,221	
扶桑薬品工業	4.3	4.9	12,524	
日本ケミファ	1.6	1.8	4,939	
ツムラ	37.4	42.9	128,528	
日医工	31.8	39.2	51,352	
キッセイ薬品工業	21.4	24.5	66,885	
生化学工業	23.4	26.9	30,854	
栄研化学	21.2	24.3	44,833	
日水製薬	5.1	5.8	7,302	
鳥居薬品	6.5	8.7	28,231	
J C R ファーマ	8.5	9.8	121,226	
東和薬品	17.4	17.7	40,125	
富士製薬工業	8.2	9.4	11,674	
沢井製薬	24.8	28.4	168,696	
ゼリア新薬工業	23.9	25.1	53,337	
第一三共	345.6	396.2	3,995,677	
キョーリン製薬ホールディングス	26.6	30.6	71,328	
大幸薬品	5.4	16.9	37,974	
ダイト	7	8.4	36,624	
大塚ホールディングス	230.1	263.8	1,283,123	
大正製薬ホールディングス	27	29.3	200,412	
ペプチドリーム	60.5	70.4	340,384	
石油・石炭製品(0.5%)				
日本コークス工業	101.5	117	7,371	
ニチレキ	15.4	16.3	27,139	
ユシロ化学工業	6.3	7.8	9,633	
ビービー・カストロール	4.3	4.9	6,384	
富士石油	29.2	37	6,845	
MORESCO	4.4	5	5,270	
出光興産	139.4	153.7	367,343	
J X T Gホールディングス	2,031.3	2,082.9	862,945	
コスモエネルギーホールディングス	35	40.1	68,370	
ゴム製品(0.6%)				
横浜ゴム	69.9	80.2	130,485	
TOYO TIRE	62	79.5	121,555	
ブリヂストン	371.2	398.8	1,426,507	
住友ゴム工業	108.5	124.4	136,342	
藤倉コンポジット	10.5	12.1	4,634	
オカモト	8.4	8.4	32,130	
フコク	5.3	6.1	4,202	
ニッタ	13.6	15.6	34,850	
住友理工	23.3	26.8	16,991	
三ツ星ベルト	15.9	18.2	29,793	
バンダー化学	23	24.4	15,298	
ガラス・土石製品(0.8%)				
日東紡績	18	20.6	121,540	
A G C	119.4	136.9	417,545	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本板硝子	53	66.2	27,075	
石塚硝子	2	2.5	5,387	
日本山村硝子	5	5.8	4,912	
日本電気硝子	52.3	55.6	94,964	
オハラ	4.8	5.5	5,340	
住友大阪セメント	24.4	26.2	99,298	
太平洋セメント	76.3	87.5	222,862	
日本ヒューム	12.1	13.9	10,355	
日本コンクリート工業	26	29.9	8,162	
三谷セキサン	5.6	6.5	33,540	
アジアパイルホールディングス	17.1	19.7	9,101	
東海カーボン	109.7	145.1	142,052	
日本カーボン	5.8	7.1	24,282	
東洋炭素	7.1	8.1	13,170	
ノリタケカンパニーリミテド	7.2	7.7	28,259	
TOTO	92.9	98.9	422,303	
日本碍子	147.4	166.2	262,429	
日本特殊陶業	101.9	105.3	182,906	
MARUWA	4.2	5.3	43,566	
品川リフラクトリーズ	3.2	3.7	9,120	
黒崎播磨	2.4	2.8	11,046	
ヨータイ	10.6	11	7,667	
イソライト工業	6.2	7.2	3,722	
東京窯業	15.4	17.7	5,451	
ニッカトー	5.5	6.3	4,271	
フジミインコーポレーテッド	10.8	12.3	38,191	
クニミネ工業	5.4	5.6	5,588	
エーアンドエーマテリアル	2.3	2.3	2,785	
ニチアス	33.1	37.9	94,181	
ニチハ	16.8	19.3	45,046	
鉄鋼(0.6%)				
日本製鉄	554.9	612.8	608,265	
神戸製鋼所	218.6	250.8	100,570	
中山製鋼所	16.5	19.2	6,796	
合同製鐵	5.8	7.4	15,769	
ジェイ エフ イー ホールディングス	322.6	369.9	292,960	
東京製鐵	64	66.8	46,626	
共英製鋼	13.5	15.5	22,072	
大和工業	25.4	29.1	64,747	
東京鐵鋼	4.9	5.7	7,780	
大阪製鐵	7.9	7.3	9,475	
淀川製鋼所	16.1	18.5	31,820	
丸一鋼管	42.3	44.5	122,775	
モリ工業	3.6	4.1	9,840	
大同特殊鋼	19.6	22.4	82,768	
日本高周波鋼業	4.4	5.2	2,033	
日本冶金工業	98.9	11.4	19,619	
山陽特殊製鋼	15.1	9.4	9,240	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
愛知製鋼	6.7	7.7	23,331	
日立金属	128.7	147.6	183,319	
日本金属	2.8	3.2	2,256	
大平洋金属	8.1	9.3	15,717	
新日本電工	71.3	88.6	13,821	
栗本鐵工所	6	6.8	12,709	
虹技	1.8	2.1	2,522	
三菱製鋼	8.9	10.2	7,282	
日亜鋼業	17.5	20.3	5,582	
日本精練	1.7	2.3	7,498	
エンビプロ・ホールディングス	4.5	5.9	3,953	
シンニッタン	18.5	21.5	6,106	
新家工業	2.7	3.2	3,660	
非鉄金属(0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	19.8	22.7	13,847	
日本軽金属ホールディングス	326	347.1	64,213	
三井金属鉱業	32.3	37	85,914	
東邦亜鉛	6.7	7.1	10,635	
三菱マテリアル	78.9	90.5	221,996	
住友金属鉱山	163.6	175.1	525,475	
DOWAホールディングス	27.9	34.7	120,062	
古河機械金属	19.8	24.4	27,230	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13.9	14.3	14,800	
東邦チタニウム	21.5	24.7	16,598	
UACJ	18.2	20.8	41,392	
CKサンエツ	2.3	2.9	9,352	
古河電気工業	34.5	42.6	112,123	
住友電気工業	446.6	512	642,304	
フジクラ	144.6	165.7	52,526	
昭和電線ホールディングス	13.8	15.9	18,412	
東京特殊電線	1.6	2.1	4,886	
タツタ電線	23.9	27.3	17,144	
カナレ電気	2.1	2.3	4,034	
平河ヒューテック	5.1	6.9	7,824	
リョービ	14.8	16.9	23,676	
アーレスティ	14.9	18.2	6,715	
アサヒホールディングス	22.5	24	66,480	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	6.7	7.7	10,710	
宮地エンジニアリンググループ	3.6	4.2	7,035	
トーカロ	30.7	38	40,128	
アルファC o	4.2	4.8	4,560	
SUMCO	132	162.7	268,617	
川田テクノロジーズ	2.7	2.8	14,280	
RS Technologies	2.4	3.9	13,435	
信和	6.3	7.9	5,545	
東洋製罐グループホールディングス	76.1	87.2	99,931	
ホッカンホールディングス	6.1	7.5	12,870	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
コロナ	6.6	7.6	7,113	
横河ブリッジホールディングス	22.2	25.5	55,590	
駒井ハルテック	2.3	2.6	3,915	
高田機工	1.1	1.3	3,010	
三和ホールディングス	123.4	129.1	119,288	
文化シャッター	35.2	40.3	32,481	
三協立山	16.6	17.6	16,931	
アルインコ	9.5	9.9	9,444	
東洋シャッター	2.9	3.3	2,286	
L I X I Lグループ	176.2	202	303,808	
日本フィルコン	9.1	10.5	5,691	
ノーリツ	26.7	28.4	35,812	
長府製作所	12.2	13.9	32,331	
リンナイ	21.3	26.6	241,262	
ダイニチ工業	6.4	7.4	5,172	
日東精工	16.5	18.9	9,317	
三洋工業	1.6	1.8	3,261	
岡部	24.2	27.7	22,658	
ジーテクト	13.2	17	19,278	
東プレ	22.3	25.5	33,022	
高周波熱錬	23	26.4	14,731	
東京製綱	7.3	9.8	5,684	
サンコール	6.7	10.2	4,202	
モリテック スチール	9.3	10.7	3,349	
パイオラックス	19.1	20.2	34,622	
エイチワン	11.7	13.4	7,343	
日本発條	119	146.9	108,852	
中央発條	1.4	1.6	4,555	
アドバネクス	1.6	2	2,686	
立川ブラインド工業	5.3	6	7,104	
三益半導体工業	10.7	10.7	23,946	
機械 (5.1%)				
日本ドライケミカル	3.3	3.4	5,440	
日本製鋼所	36.3	41.6	66,144	
三浦工業	51.7	59.3	272,780	
タクマ	43.7	46.5	65,332	
ツガミ	27	28.5	28,585	
オークマ	15.2	16	71,840	
芝浦機械	13.6	15.5	36,781	
アマダ	179.6	170	163,370	
アイダエンジニアリング	32.5	36	26,460	
滝澤鉄工所	3.8	4.3	4,497	
F U J I	47.8	58.9	117,034	
牧野フライス製作所	14.1	16.1	53,693	
オーエスジー	58.9	63.4	96,811	
ダイジェット工業	1.5	1.6	2,153	
旭ダイヤモンド工業	31.5	36.2	18,498	
DMG森精機	75.7	86.7	113,490	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ソディック	26.2	32.3	26,744	
ディスコ	16.2	18.6	447,516	
日東工器	6.6	7.5	14,842	
日進工具	3.6	5.4	15,233	
パンチ工業	8.4	12.5	5,600	
富士ダイス	5.4	6.2	3,918	
豊和工業	6.8	7.7	6,491	
OKK	5.1	5.9	2,596	
東洋機械金属	8.7	10	4,250	
津田駒工業	2.7	2.8	2,399	
エンシュウ	—	3.4	3,270	
島精機製作所	16.5	21.6	35,251	
オプトラン	11.7	15.3	43,268	
NCホールディングス	4	4.3	2,420	
イワキポンプ	5.2	8.8	8,976	
フリーュー	9.6	13.5	12,406	
ヤマシンフィルタ	20.8	29.8	29,680	
日阪製作所	14.8	17	12,852	
やまびこ	23.3	26.6	26,094	
平田機工	5.7	6.5	40,235	
ベガサスミシン製造	11.3	14.1	4,723	
マルマエ	5	5.1	4,493	
タツモ	5.1	6.4	9,913	
ナプテスコ	65.8	80.7	269,941	
三井海洋開発	12.7	14.6	23,710	
レオン自動機	11.8	13.5	17,631	
SMC	35.4	43.4	2,359,658	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	5.9	—	—	
ホソカワミクロン	4.2	4.8	29,232	
ユニオンツール	5.2	5.1	14,331	
オイレス工業	16.8	17.8	25,276	
日精エー・エス・ビー機械	4.1	4	13,740	
サトーホールディングス	14.4	19.5	48,457	
技研製作所	10.5	12.1	59,290	
日本エアータック	3.9	4.8	5,155	
カワタ	3.3	4.1	3,161	
日精樹脂工業	10.2	11.6	10,498	
オカダアイヨン	4.2	4.4	4,272	
ワイエイシイホールディングス	4.7	5.9	2,849	
小松製作所	546.9	627.2	1,367,296	
住友重機械工業	69.2	79.3	195,078	
日立建機	48.5	55.5	157,065	
日工	3.4	19.1	12,567	
巴工業	5.2	5.9	10,667	
井関農機	12.2	13.9	17,124	
TOWA	10.4	14.1	15,777	
丸山製作所	2.8	2.9	3,654	
北川鉄工所	5.5	6.3	10,867	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ローツェ	5.3	6.1	29,737	
タカキタ	4.4	5	2,915	
クボタ	647.1	734.7	1,064,947	
荏原実業	3.6	3.5	9,170	
三菱化工機	4.3	4.8	8,587	
月島機械	24.1	25.6	32,947	
帝国電機製作所	8.5	11.5	15,065	
新東工業	28.8	33	26,037	
澁谷工業	10.6	12.1	37,268	
アイチ コーポレーション	21	24.1	18,050	
小森コーポレーション	32.9	35.3	27,534	
鶴見製作所	9.5	10.7	20,993	
住友精密工業	2	2.1	4,932	
日本ギア工業	—	5.8	1,716	
酒井重工業	2.3	2.7	6,048	
荏原製作所	53.6	57.3	148,808	
石井鐵工所	1.9	1.8	4,681	
西島製作所	12.5	14.1	11,801	
北越工業	12.5	14.3	14,657	
ダイキン工業	164.9	176.4	2,795,940	
オルガノ	4.4	5	30,300	
トーヨーカネツ	4.6	6.1	12,980	
栗田工業	65.4	75	224,025	
椿本チエイン	15.8	19.8	55,143	
大同工業	5.9	6.8	4,420	
木村化工機	10.6	11.8	5,723	
アネスト岩田	18.9	21.6	18,640	
ダイフク	66.5	70.8	593,304	
サムコ	3.4	3.5	6,730	
加藤製作所	6.3	7.7	9,432	
油研工業	2.1	2.4	3,602	
タダノ	58.4	67	57,352	
フジテック	44	50.4	81,244	
CKD	33.7	38	70,604	
キトー	9.2	10.5	12,421	
平和	33.7	38.7	70,782	
理想科学工業	10.7	12.3	16,236	
SANKYO	30.3	30.8	85,470	
日本金銭機械	13.4	15.4	8,747	
マースグループホールディングス	7.7	8.8	14,379	
フクシマガリレイ	7.5	8.6	28,509	
オーイズミ	5.3	6	2,640	
ダイコク電機	5.6	6.4	8,076	
竹内製作所	20.3	23.2	41,272	
アマノ	34.5	36.3	84,542	
JUKI	16.8	19.3	12,043	
蛇の目シン工業	11.1	12.8	5,900	
マックス	18.5	21.2	35,149	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
グローリー	33.5	35.6	91,064	
新晃工業	11.3	12.9	19,775	
大和冷機工業	17.5	20.1	19,677	
セガサミーホールディングス	119.9	137.4	192,909	
日本ビストンリング	4.5	5.1	6,278	
リケン	5.6	6.4	18,099	
T P R	16.3	18.7	27,470	
ツバキ・ナカシマ	18.4	28.3	26,885	
ホシザキ	35.3	40.5	352,350	
大豊工業	10	11.4	6,053	
日本精工	248.1	260.8	205,510	
N T N	259.9	320.8	72,500	
ジェイテクト	115.9	132.9	115,490	
不二越	11.2	12.9	44,827	
日本トムソン	35.9	41.3	16,809	
T H K	75.3	80.6	225,680	
ユーシン精機	9.4	10.8	7,527	
前澤給装工業	4.8	5.1	10,342	
イーグル工業	15	17.2	13,037	
前澤工業	8.3	9.4	3,318	
日本ビラー工業	12.3	14.1	20,233	
キッツ	49.1	56.2	40,351	
マキタ	147	180.6	659,190	
日立造船	96.2	110.1	45,141	
三菱重工業	202.4	232.1	646,978	
I H I	92.9	99.8	154,590	
スター精密	20.7	21.4	27,563	
電気機器 (14.5%)				
日清紡ホールディングス	67.2	92.4	74,012	
イビデン	74.1	84.9	242,134	
コニカミノルタ	264.2	303.7	121,176	
ブラザー工業	157.5	169.3	343,509	
ミネベアミツミ	224.4	257.3	486,554	
日立製作所	543.7	665.3	2,298,611	
三菱電機	1,207.7	1,384.6	1,964,055	
富士電機	78.4	83.5	240,396	
東洋電機製造	4.9	5.1	6,456	
安川電機	140	149.1	577,017	
シンフォニアテクノロジー	16.9	18	19,638	
明電舎	24	25.5	46,461	
オリジン	3.4	3.8	5,700	
山洋電気	5.9	6.8	33,320	
デンヨー	11.2	11.9	22,848	
東芝テック	15.2	17.4	65,163	
芝浦メカトロニクス	2.2	2.6	7,077	
マブチモーター	33.5	38.5	137,060	
日本電産	145.3	333.3	2,207,112	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6.8	—	—	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
トレックス・セミコンダクター	5.7	8.4	9,811	
東光高岳	6.4	8.2	8,634	
ダブル・スコープ	17.8	—	—	
ダイヘン	13.3	15.2	54,948	
ヤーマン	17.8	23.3	17,195	
JVCケンウッド	93.2	115.7	20,363	
ミマキエンジニアリング	11.3	13.6	5,548	
第一精工	5.3	5.8	14,964	
日新電機	28.4	32.6	36,577	
大崎電気工業	24.1	27.8	14,400	
オムロン	128.4	124.1	886,074	
日東工業	19.4	20.4	38,984	
I D E C	16.3	20.1	35,798	
正興電機製作所	2.6	3.7	4,354	
不二電機工業	1.6	2.7	3,466	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	43.6	46.5	88,629	
サクサホールディングス	3.1	3.3	5,765	
メルコホールディングス	5.1	5	13,485	
テクノメディカ	1.8	3.4	6,160	
日本電気	156.3	168	812,280	
富士通	116.4	133.5	1,481,850	
沖電気工業	52.4	56.4	60,122	
岩崎通信機	5.6	6.1	5,203	
電気興業	6.4	6.7	17,728	
サンケン電気	14.2	15.2	37,878	
ナカヨ	2.5	2.8	3,928	
アイホン	6.9	7.9	12,521	
ルネサスエレクトロニクス	125.7	663.2	370,728	
セイコーエプソン	149.9	171.9	208,686	
ワコム	88.3	94.1	45,732	
アルバック	24.1	25.5	82,492	
アクセル	5.6	6.4	5,408	
E I Z O	11.1	10.8	43,416	
日本信号	30.9	35.4	42,940	
京三製作所	26.2	32.7	17,363	
能美防災	16.1	18.6	37,460	
ホーチキ	7.9	10.4	14,206	
星和電機	7.1	7.6	5,479	
エレコム	11.5	15.4	78,694	
パナソニック	1,379.8	1,582.1	1,523,562	
シャープ	119.9	160.3	187,070	
アンリツ	77.8	89.2	189,371	
富士通ゼネラル	37	37.6	79,148	
ソニー	810.3	867.4	5,962,507	
T D K	63.2	66.9	674,352	
帝国通信工業	5.6	6.5	7,741	
タムラ製作所	46.8	46.5	21,111	
アルプスアルパイン	125.9	122.9	160,015	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
池上通信機	3.8	4.4	3,951	
鈴木	7	7.4	5,875	
日本トリム	2.3	2	6,470	
ローランド ディー・ジー	6.3	8	10,056	
フォスター電機	13.7	14.6	17,885	
SMK	3.4	3.6	9,216	
ヨコオ	8.8	9.1	25,789	
ホシデン	35.8	38.4	36,096	
ヒロセ電機	17.3	21.5	276,705	
日本航空電子工業	27.8	31.8	47,477	
T O A	13.1	15	11,430	
マクセルホールディングス	26.2	30.3	32,633	
古野電気	15.9	18.4	16,596	
ユニデンホールディングス	3.6	3.9	7,768	
スミダコーポレーション	10.5	11.3	8,316	
アイコム	6.7	7.7	22,915	
リオン	5.7	6	14,478	
本多通信工業	10.9	13	5,681	
横河電機	120.9	127.1	197,259	
新電元工業	4.3	4.9	13,024	
アズビル	78	87.4	240,262	
東亜ディーケーケー	6.4	7.4	6,726	
日本光電工業	53.3	57.4	206,353	
チノー	4.3	4.9	7,080	
共和電業	12.9	14.8	6,038	
日本電子材料	5	5.6	5,756	
堀場製作所	24	27.4	155,358	
アドバンテスト	82.4	103	547,960	
小野測器	6.1	6.7	3,638	
エスベック	10.8	12.6	22,201	
キーエンス	59.3	125.5	5,565,925	
日置電機	6.4	7.4	25,604	
シスメックス	94.1	99	852,390	
日本マイクロニクス	21.3	24.7	25,515	
メガチップス	9.7	13.1	25,112	
O B A R A G R O U P	6.2	8.2	26,240	
澤藤電機	1.7	1.9	3,009	
原田工業	5.3	7.1	5,878	
コーセル	15.6	19	17,746	
イリソ電子工業	11.1	11.8	40,533	
オプテックスグループ	21.4	23.1	33,610	
千代田インテグレ	5.2	6.7	11,838	
アイ・オー・データ機器	4.7	5	4,855	
レーザーテック	24.8	60.9	538,965	
スタンレー電気	85.5	97.5	255,352	
岩崎電気	4.9	5.7	10,368	
ウシオ電機	70.4	76.8	98,380	
岡谷電機産業	9.5	12.3	3,997	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ヘリオス テクノ ホールディング	11.6	14.2	5,140	
エノモト	3.7	4.6	5,027	
日本セラミック	12.4	14.3	29,543	
遠藤照明	6.5	7.8	4,414	
古河電池	9.1	10.7	6,430	
双信電機	6.7	8	3,176	
山一電機	9.1	10.3	16,902	
図研	8.1	9.2	23,938	
日本電子	23.9	27.5	88,550	
カシオ計算機	106.9	122.5	232,382	
ファナック	114.8	131.6	2,528,694	
日本シイエムケイ	27	33.8	13,790	
エンプラス	5.6	7.3	16,797	
大真空	4.7	5.3	10,573	
ローム	57.8	61.5	445,875	
浜松ホトニクス	86.7	99.4	485,072	
三井ハイテック	13.6	15.6	21,824	
新光電気工業	40.9	46.8	64,022	
京セラ	184.1	194.9	1,136,461	
太陽誘電	53.9	61.7	185,100	
村田製作所	380.2	406.8	2,446,902	
双葉電子工業	19.9	22.4	22,310	
北陸電気工業	4.8	6.1	5,776	
ニチコン	38.4	47.6	36,985	
日本ケミコン	8.6	10.5	16,285	
KOA	18.5	21.4	21,164	
市光工業	18.5	21.6	11,685	
小糸製作所	72.4	83.1	379,351	
ミツバ	22.6	26.6	11,650	
SCREENホールディングス	21	24	115,800	
キャノン電子	11.2	14.8	25,456	
キャノン	650.2	745.4	1,654,042	
リコー	363.2	352.4	280,510	
象印マホービン	30.2	40.9	69,325	
MUTOHホールディングス	1.8	2.1	3,328	
東京エレクトロン	80.5	87.9	1,889,850	
輸送用機器 (7.3%)				
トヨタ紡織	42.3	40.4	61,327	
芦森工業	2.6	2.9	2,650	
ユニプレス	23.4	26.9	28,083	
豊田自動織機	97.8	112.1	617,671	
モリタホールディングス	21.2	24.2	43,874	
三櫻工業	15.4	17.6	14,326	
デンソー	265.9	304.9	1,259,541	
東海理化電機製作所	31.8	36.5	57,560	
三井E&Sホールディングス	41.9	50	28,250	
川崎重工業	94	107.7	183,736	
名村造船所	36.1	44.6	7,760	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
日本車輛製造	4.4	5	13,945	
三菱ロジスネクスト	14.4	18.3	19,196	
近畿車輛	1.1	2.1	2,652	
日産自動車	1,424.3	1,633	654,669	
いすゞ自動車	381.7	401.2	405,011	
トヨタ自動車	1,345.8	1,544.9	10,435,799	
日野自動車	150.8	172.9	126,044	
三菱自動車工業	447	512.5	155,800	
エフテック	8.5	9.8	5,145	
レンップホールディングス	4.3	5.4	3,202	
GMB	2.4	2.6	1,781	
ファルテック	2.2	2.5	1,825	
武蔵精密工業	29.4	30.9	30,003	
日産車体	23.6	27	27,378	
新明和工業	50.6	37.3	39,799	
極東開発工業	24	25.7	35,388	
日信工業	22.1	28.2	62,322	
トビー工業	10	11.4	15,162	
ティラド	4.4	5.1	7,206	
曙ブレーキ工業	65.1	76	14,516	
タチエス	19.9	22.8	20,383	
NOK	65	74.5	102,735	
フタバ産業	33.6	38.6	20,187	
KYB	12.1	15.5	33,092	
大同メタル工業	19.6	26.7	15,219	
プレス工業	60	68.9	18,327	
ミクニ	15.5	17.8	5,251	
太平洋工業	25.3	29.1	28,721	
ケーヒン	27.8	31.8	80,899	
河西工業	14.8	18.8	9,719	
アイシン精機	99.5	114	387,030	
マツダ	379	407.4	280,698	
今仙電機製作所	11.3	12.9	9,636	
本田技研工業	1,018.8	1,090.2	3,035,116	
スズキ	220.9	274.4	1,027,902	
SUBARU	374.9	429.8	1,022,279	
安永	5.9	6.7	6,827	
ヤマハ発動機	170.6	180.6	280,833	
ショーワ	28.6	32.7	73,542	
TBK	14.5	16.6	7,719	
エクセディ	16.4	18.8	32,580	
豊田合成	39	44.7	102,944	
愛三工業	18.9	21.8	12,644	
盟和産業	1.9	2.2	2,127	
日本プラス	9.5	11	5,159	
ヨロズ	11.3	13	15,080	
エフ・シー・シー	21.7	22.7	41,541	
シマノ	48.7	51.8	1,026,158	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
テイ・エス テック	28.1	32.2	97,566	
ジャムコ	6.1	7	5,544	
精密機器 (2.6%)				
テルモ	341.7	391.8	1,657,314	
クリエートメディック	4	4.6	4,517	
日機装	39	41.6	41,516	
日本エム・ディ・エム	—	8	13,832	
島津製作所	155.4	165.5	482,432	
JMS	11.1	11.7	9,851	
長野計器	9.5	10.1	10,584	
ブイ・テクノロジー	5.6	6.5	26,617	
東京計器	7.7	8.8	8,509	
愛知時計電機	1.6	1.8	7,875	
インターアクション	6.1	7.4	16,346	
オーバル	11.8	12.5	2,862	
東京精密	21.8	25.1	87,473	
マニー	16	55.2	156,768	
ニコン	210.5	211.5	209,385	
トプコン	64.9	69.8	65,961	
オリンパス	719.6	766.1	1,433,756	
理研計器	10.7	12.2	29,597	
タムロン	10.7	11.2	22,747	
HOYA	243.1	276.5	2,795,415	
シード	5.2	5.9	4,690	
ノーリツ鋼機	9.5	9.4	13,583	
エー・アンド・ディ	11	12.7	9,575	
朝日インテック	51.2	156.8	517,440	
シチズン時計	132.2	162.3	62,485	
リズム時計工業	4.1	4.4	2,675	
大研医器	9.6	9.6	6,096	
メニコン	16.6	19.6	107,408	
シンシア	1.8	1.6	721	
松風	5.9	6.3	10,313	
セイコーホールディングス	18.6	19.6	35,750	
ニプロ	83.6	95.8	120,708	
その他製品 (2.4%)				
中本バックス	3.4	3.5	5,582	
スノーピーク	4.6	7.4	7,407	
パライマウントベッドホールディングス	13.9	14.6	61,101	
トランザクション	7.6	7.6	7,820	
粧美堂	3.5	4	1,444	
ニホンフラッシュ	5.2	12.9	18,098	
前田工繊	13.3	15.3	35,725	
永大産業	15.7	18.1	5,448	
アートネイチャー	12.8	14.8	9,442	
バンダイナムコホールディングス	124.9	143.1	858,027	
アイフィスジャパン	2.7	3.5	2,387	
共立印刷	20	23.1	3,303	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
SHOEI	5.8	12.1	29,850	
フランスベッドホールディングス	17.1	19.6	16,503	
パイロットコーポレーション	21.1	22.6	83,281	
萩原工業	6.7	7.7	10,795	
トッパン・フォームズ	25.9	29.7	33,293	
フジシールインターナショナル	27.1	31	68,944	
タカラトミー	50.5	62.1	57,194	
廣済堂	11.2	9.6	8,131	
エステールホールディングス	3.2	3.7	2,223	
アーク	45.9	52.8	5,966	
タカノ	4.7	5.4	3,817	
プロネクス	10.4	11.9	13,030	
ホクシン	7.4	8.5	1,062	
ウッドワン	4.1	4.7	5,292	
大建工業	9.1	9.3	16,070	
凸版印刷	170.5	195.4	360,122	
大日本印刷	170.2	181.2	443,758	
図書印刷	11.3	—	—	
共同印刷	3.7	4.3	12,882	
NISSHA	24.8	28.4	27,065	
光村印刷	1	1.2	1,814	
TAKARA & COMPANY	5.8	6.7	12,642	
アシックス	113.9	114.3	130,873	
ツツミ	3.8	4.3	7,417	
小松ウオール工業	3.7	4.2	8,127	
ヤマハ	71.8	82.3	431,252	
河合楽器製作所	3.7	4.3	12,603	
クリナップ	11.2	12.9	6,708	
ビジョン	73	83.7	351,540	
オリバー	—	2.9	7,612	
兼松サステック	0.8	0.9	1,295	
キングジム	10	11.5	10,856	
リンテック	28.7	32.9	84,388	
イトーキ	22.1	29.4	12,024	
任天堂	69.1	84.9	3,696,546	
三菱鉛筆	19.9	22.8	33,607	
タカラスタンダード	25	28.6	45,016	
コクヨ	57.9	66.4	93,092	
ナカバヤシ	11.8	13.6	8,731	
グローブライド	5.8	6.2	14,390	
オカムラ	42.1	48.3	42,600	
美津濃	12	12.6	25,741	
電気・ガス業 (1.6%)				
東京電力ホールディングス	964.1	1,105.3	401,223	
中部電力	369.5	423.6	614,643	
関西電力	492.8	524.6	563,158	
中国電力	167	199.7	295,556	
北陸電力	118.3	126.6	89,379	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
東北電力	282.8	345.9	386,024	
四国電力	108.7	124.7	100,757	
九州電力	248.9	285.4	255,718	
北海道電力	113	129.6	56,376	
沖縄電力	22.4	26.89	54,264	
電源開発	96.1	110.2	224,036	
エフオン	5.6	7.4	4,610	
イーレックス	21	19.7	28,998	
レノバ	19.8	23.1	21,760	
東京瓦斯	236.9	266.3	684,524	
大阪瓦斯	234.4	268.7	578,511	
東邦瓦斯	59.8	68.1	361,611	
北海道瓦斯	6.5	7.4	11,566	
広島ガス	24.7	28.5	10,260	
西部瓦斯	13.6	15.6	40,981	
静岡ガス	37.1	39.3	38,907	
メタウォーター	5.8	6.7	32,193	
陸運業(4.3%)				
SBSホールディングス	11.9	12	28,836	
東武鉄道	127.4	144.3	551,226	
相鉄ホールディングス	41.4	44.3	137,108	
東急	328	349.2	596,433	
京浜急行電鉄	165.4	177.8	320,217	
小田急電鉄	193.4	205.9	553,665	
京王電鉄	67.5	71.8	459,520	
京成電鉄	90.5	96.4	340,774	
富士急行	16.5	18.9	66,055	
新京成電鉄	3.1	3.6	7,704	
東日本旅客鉄道	214.7	243.7	2,059,265	
西日本旅客鉄道	108.3	123.4	857,753	
東海旅客鉄道	108.1	115.1	2,121,868	
西武ホールディングス	149.6	185.8	261,606	
鴻池運輸	19.2	22	27,280	
西日本鉄道	33.5	38.4	111,590	
ハマキョウレックス	9.3	10.6	34,450	
サカイ引越センター	6.3	7.3	44,603	
近鉄グループホールディングス	114.4	131.1	693,519	
阪急阪神ホールディングス	152.5	174.9	696,102	
南海電気鉄道	51	62.2	162,404	
京阪ホールディングス	50.9	58.4	299,008	
神戸電鉄	2.9	3.1	11,687	
名古屋鉄道	93.8	107.8	350,350	
山陽電気鉄道	8.8	9.4	21,056	
日本通運	44.1	45.4	251,516	
ヤマトホールディングス	200.5	229.9	548,081	
山九	31.8	36.4	159,978	
丸運	6.5	7.5	1,792	
丸全昭和運輸	9.3	10.6	30,464	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
センコーグループホールディングス	63	72.3	62,178	
トナミホールディングス	2.7	3.1	18,724	
ニッコンホールディングス	43.5	46.9	102,335	
日本石油輸送	1.4	1.4	4,445	
福山通運	14.6	16.8	59,472	
セイノーホールディングス	85.7	98.2	144,746	
エスライン	3.4	3.9	3,919	
神奈川中央交通	2.8	3.2	13,216	
日立物流	25.1	24	71,112	
丸和運輸機関	6	13.8	40,751	
C&Fロジホールディングス	11.6	13.3	20,282	
九州旅客鉄道	96	115	351,325	
S Gホールディングス	108.1	137.6	483,664	
海運業(0.1%)				
日本郵船	96.1	110.3	171,295	
商船三井	68.2	83.4	159,210	
川崎汽船	34.7	40.4	44,884	
N Sユナイテッド海運	6.6	7.9	11,218	
飯野海運	56.3	64.8	22,161	
共栄タンカー	1.5	3.4	3,012	
乾汽船	10.2	7.6	8,838	
空運業(0.4%)				
日本航空	209.4	231.9	490,932	
A N Aホールディングス	209.1	239.7	622,980	
パスコ	2.2	2.5	3,632	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	3.2	3.7	24,901	
日新	9.9	11.3	18,023	
三菱倉庫	39.6	41.6	115,148	
三井倉庫ホールディングス	14	15	24,045	
住友倉庫	42.1	47.2	63,248	
澁澤倉庫	6.3	7.2	15,292	
東陽倉庫	20.5	23.7	8,058	
日本トランスシティ	25.1	28.9	14,970	
ケイヒン	2.2	2.5	3,275	
中央倉庫	7	8	8,144	
川西倉庫	2.3	2.4	2,438	
安田倉庫	9.4	10.8	9,622	
ファイズホールディングス	2	2.8	3,094	
東洋埠頭	3.5	4	5,396	
宇徳	9.7	11.2	5,140	
上組	70.5	73.2	154,086	
サンリツ	2.7	3.1	1,863	
キムラユニティ	3.1	3.5	3,636	
キューソー流通システム	2.9	3.3	5,778	
近鉄エクスプレス	21.6	27.9	48,462	
東海運	6.5	7.5	1,995	
エーアイティー	7.4	9.3	7,337	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
内外トランスライン	3.6	4.6	4,765	
日本コンセプト	4.2	4.2	6,304	
情報・通信業(9.5%)				
NECネットエスアイ	13.1	38.7	78,367	
クロスキャット	3.3	3.8	3,936	
システナ	42.4	48.6	74,844	
デジタルアーツ	6.4	6.7	57,553	
日鉄ソリューションズ	17.8	20.5	60,516	
キューブシステム	6.5	7.6	5,867	
エイジア	2.5	2.7	3,677	
コア	5.1	6	7,398	
ラクーンホールディングス	—	6.4	4,992	
ソリトンシステムズ	6.9	6.2	8,332	
ソフトクリエイトホールディングス	5.3	6.1	13,542	
T I S	39.5	136	312,392	
ネオス	2.6	5.4	3,866	
電算システム	4.6	5.3	18,603	
グリー	82.1	84	37,128	
コーエーテクモホールディングス	24.3	27.9	86,769	
三菱総合研究所	5.1	5.9	24,455	
電算	1.4	1.6	3,476	
A G S	6.9	8	6,808	
ファインデックス	10.2	11.7	11,384	
ブレインパッド	2.3	3.5	17,307	
K L a b	21.2	26.3	20,487	
ボールトゥウィン・ビット クルーホールディングス	15.9	16.7	16,032	
イーブクイニシアティブジャパン	2	2.1	5,260	
ネクソン	302.4	379.1	851,458	
アイスタイル	30.6	38.9	11,981	
エムアップホールディングス	4.2	4	10,556	
エイチーム	8.3	9.7	7,449	
エニグモ	—	13.1	13,231	
テクノスジャパン	10.2	11	6,644	
コロブラ	39.1	44.8	48,249	
ブロードリーフ	59.1	67.8	37,900	
クロス・マーケティンググループ	4.9	6.9	2,297	
デジタルハーツホールディングス	5.6	7.5	6,577	
システム情報	6.2	10.4	11,980	
メディアドゥホールディングス	3.7	4.3	18,511	
じげん	16.9	34.4	13,037	
エンカレッジ・テクノロジー	1.8	3.3	2,808	
サイバーリンクス	2	2.3	4,130	
フィックスターズ	12.7	14.7	19,359	
CARTA HOLDINGS	5.8	6.8	7,296	
オブティム	5.3	7.2	19,980	
セレス	4	4.7	5,860	
S H I F T	—	5.5	55,990	
ティーガイア	12	12.2	27,938	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
セック	2	2.1	7,570	
日本アジアグループ	12.4	14.3	4,533	
豆蔵ホールディングス	8.2	—	—	
テクマトリックス	8.4	9.7	31,767	
プロシップ	3.6	4.2	5,472	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	286.1	32.9	57,673	
GMOペイメントゲートウェイ	19.5	28.8	349,344	
ザッパラス	6.6	6.6	2,534	
システムリサーチ	1.6	3.8	7,193	
インターネットイニシアティブ	19.4	20.2	76,861	
さくらインターネット	14.4	15	9,735	
ヴィンクス	4.1	4.1	4,460	
GMOクラウド	2.7	2.6	14,482	
SRAホールディングス	6.4	7.3	18,155	
Minor iソリューションズ	2.4	—	—	
システムインテグレータ	—	4.6	4,140	
朝日ネット	9.9	9.9	10,662	
e B A S E	7.2	16.5	21,450	
アバント	4.3	13.2	14,876	
アドソル日進	4.3	4.9	12,705	
フリービット	7.2	7.4	6,482	
コムチュア	6.7	15.3	45,395	
サイバーコム	2.2	2.6	4,924	
アステリア	8.1	8.8	4,488	
アイル	—	7.7	13,675	
マークラインズ	5.5	6.9	14,013	
メディカル・データ・ビジョン	10.6	10.6	11,363	
ショーケース	2.9	3.6	2,282	
モバイルファクトリー	3.4	3.3	3,927	
テラスカイ	2	5	14,205	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	5.3	5.5	8,217	
P C I ホールディングス	2.5	5.4	5,205	
パイブドHD	2	1.9	3,013	
アイビーシー	2.3	2.5	2,557	
ネオジャパン	2.4	2.8	3,841	
P R T I M E S	1.1	1.3	3,139	
ランドコンピュータ	2	2.3	2,573	
ダブルスタンダード	1.1	1.8	8,793	
オープンドア	5.9	6.9	8,666	
マイネット	4	4.4	5,341	
アカツキ	4.2	4.9	19,967	
ベネフィットジャパン	1.1	1.2	1,874	
U b i c o mホールディングス	2.3	3.2	5,273	
L I N E	36.2	31.2	168,168	
カナミックネットワーク	2.5	12.7	11,379	
ノムラシステムコーポレーション	1.5	3.5	1,799	
チェンジ	2.2	4.8	25,344	
シンクロ・フード	5.3	6.5	2,379	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
オークネット	6.4	8.6	9,718	
セグエグループ	—	3.3	2,986	
エイトレッド	1.4	2.4	4,754	
AOI TYO Holdings	13.1	14.3	7,221	
マクロミル	21.1	28.1	20,541	
ビーグリー	3.2	2.8	4,379	
オロ	3.2	3.7	10,881	
ユーザーローカル	—	1.4	4,508	
テモナ	—	3.3	2,554	
ニーズウェル	—	3	2,115	
サインポスト	—	3	5,133	
ソルクシーズ	5.2	6.2	4,451	
フェイス	4.9	5.2	3,452	
プロトコルボレーション	5.4	12.4	14,309	
ハイマックス	1.5	1.7	3,371	
野村総合研究所	75.4	192.7	548,809	
サイバネットシステム	10	10.1	6,827	
CEホールディングス	3.6	7.7	3,826	
日本システム技術	2	2.4	3,187	
インテージホールディングス	15.3	17.3	15,051	
東邦システムサイエンス	3.7	3.9	3,494	
ソースネクスト	46.4	65.3	21,418	
インフォコム	13	15	42,105	
HEROZ	—	2	7,890	
ラクスル	—	11	31,966	
F I G	11	15.7	4,286	
システムサポート	—	3.2	6,304	
イーソル	—	6.7	9,849	
アルテリア・ネットワークス	13.3	15.2	30,141	
東海ソフト	—	1.2	1,632	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.8	2.6	2,875	
トピラシステムズ	—	1.8	3,214	
フォーカスシステムズ	8.1	8.7	8,021	
クレスコ	3.7	8.4	13,112	
フジ・メディア・ホールディングス	123.1	131.1	141,850	
オービック	41.1	47.1	879,828	
ジャストシステム	16.9	22.1	163,540	
TDCソフト	10.5	12.2	11,565	
Zホールディングス	773.3	1,866.4	821,216	
トレンドマイクロ	63.2	60.5	358,160	
IDホールディングス	4.7	5.4	8,218	
日本オラクル	24	27.6	347,208	
アルファシステムズ	3.8	4.3	17,028	
フューチャー	16.2	16.6	29,697	
CAC Holdings	8.6	9.1	11,811	
SBテクノロジ	5.1	5	13,965	
トーセ	3.4	4	3,444	
オービックビジネスコンサルタント	12.1	13.9	77,840	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
伊藤忠テクノソリューションズ	54.1	62	225,680	
アイティフォー	14.6	16.8	12,180	
東計電算	1.8	2.1	8,505	
エックスネット	2.4	2.4	2,284	
大塚商会	64.2	73.6	382,720	
サイボウズ	14	16	44,384	
ソフトブレーン	9.7	8.5	4,496	
電通国際情報サービス	7.4	8.5	42,755	
ACCESS	—	13	12,454	
デジタルガレージ	23.1	24.5	93,712	
EMシステムズ	9.7	19.4	16,296	
ウェザーニューズ	4.1	4.7	17,742	
C I J	9.4	9.6	9,081	
ビジネスエンジニアリング	1.3	1.7	4,576	
日本エンタープライズ	13.3	14.8	4,114	
WOWOW	5.8	6.6	16,896	
スカラ	8.4	9.4	6,645	
インテリジェント ウェイブ	4.7	8.3	6,415	
IMAGICA GROUP	10.3	12.3	5,190	
ネットワンシステムズ	42	51.8	168,868	
システムソフト	29.8	32.7	2,746	
アルゴグラフィックス	10.1	11.6	43,094	
マーベラス	18.3	21.1	16,458	
エイベックス	20.5	23.6	22,490	
日本ユニシス	37.1	42.5	141,525	
兼松エレクトロニクス	6.5	7.5	29,775	
東京放送ホールディングス	78.7	82.8	140,180	
日本テレビホールディングス	108.9	113.6	141,318	
朝日放送グループホールディングス	12	13.9	10,216	
テレビ朝日ホールディングス	32.7	37.5	63,450	
スカパーJ SATホールディングス	90.9	90	39,510	
テレビ東京ホールディングス	9.8	11.3	27,707	
日本BS放送	4.2	4.8	5,414	
ビジョン	3.7	13	11,063	
スマートバリュー	3.7	3.8	4,503	
ワイヤレスゲート	5.6	6.9	3,891	
コネクシオ	8.5	7.9	11,707	
クロップス	2.4	2.9	2,061	
日本電信電話	810.6	1,816.3	4,439,037	
KDDI	1,044.4	1,012.6	3,175,513	
ソフトバンク	1,256.6	1,234.9	1,686,873	
光通信	14	14	330,540	
NTTドコモ	750.4	971.6	2,867,677	
エムティーアイ	11.7	13.6	8,173	
GMOインターネット	43.3	53.7	146,493	
ファイバーゲート	—	4.6	6,375	
アイドマーケティングコミュニケーション	2.9	4.6	2,249	
KADOKAWA	34.7	36.7	65,032	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
学研ホールディングス	4	18.4	30,562	
ゼンリン	23.7	27.3	37,237	
昭文社ホールディングス	5.9	7	2,828	
インプレスホールディングス	9.8	11.2	1,702	
アイネット	6.9	7.2	11,066	
松竹	7.9	9	126,900	
東宝	78	80.2	317,592	
東映	5	5.1	74,919	
エヌ・ティ・ティ・データ	315.7	362	450,690	
ビー・シー・エー	1.6	2.4	10,080	
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	2.4	6,376	
D T S	13.3	30.5	69,997	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	55.2	58	303,340	
シーイーシー	12.8	14.7	27,489	
カプコン	50.9	64.1	243,900	
アイ・エス・ピー	2.4	2.8	5,966	
ジャステック	7.1	8.9	10,101	
S C S K	31.3	31.4	165,478	
日本システムウエア	4	4.6	10,842	
アイネス	15.2	13.6	19,067	
T K C	10.1	11.5	64,860	
富士ソフト	17.7	17.4	78,996	
NSD	19.5	43.8	73,759	
コナミホールディングス	48.5	49.4	186,979	
福井コンピュータホールディングス	4	5.4	16,956	
J B C Cホールディングス	9.5	9.3	15,205	
ミロク情報サービス	11.8	12.1	30,322	
ソフトバンクグループ	495.2	1,078.1	5,209,379	
卸売業(4.7%)				
ハウスイ	1	1.1	1,013	
高千穂交易	4.6	5.3	5,199	
カワニシホールディングス	—	1.6	2,142	
伊藤忠食品	2.9	3.4	15,946	
エレマテック	11.2	12.8	11,392	
J A L U X	3.4	3.9	7,070	
あらた	8.8	10.9	49,649	
トーメンデバイス	1.8	2.1	7,434	
東京エレクトロン デバイス	4.3	4.9	13,837	
フィールズ	10.4	10.4	3,993	
双日	656.9	753.2	189,053	
アルフレッサ ホールディングス	132.2	151.6	329,426	
横浜冷凍	33.4	35.7	32,772	
神栄	1.6	—	—	
ラサ商事	6.3	7.2	6,501	
ラクーンホールディングス	5.7	—	—	
アルコニックス	12.6	14.5	18,429	
神戸物産	18	47.1	262,818	
ハイパー	—	2.1	1,220	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
あい ホールディングス	17	19.5	28,158	
ディーブイエックス	4.7	4.9	4,581	
ダイワボウホールディングス	10.8	11.6	83,868	
マクニカ・富士エレホールディングス	33	32.5	56,322	
ラクト・ジャパン	5	5.1	19,584	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	22.4	25.7	27,396	
八洲電機	9.2	10.6	9,550	
メディアスホールディングス	6.7	7.8	7,651	
レスターホールディングス	13	14.2	29,507	
ジュテックホールディングス	2.7	3.1	3,038	
大光	5	5.8	3,967	
O C H I ホールディングス	3.5	4	5,804	
T O K A I ホールディングス	62.9	72.1	72,532	
黒谷	2.7	3.8	1,869	
C o m i n i x	2.1	2.4	1,804	
三洋貿易	6	13.7	13,152	
ビューティガレージ	1.9	2.2	3,832	
ウイン・パートナーズ	7.7	9.9	10,107	
ミタチ産業	3.6	4.1	2,492	
シップヘルスケアホールディングス	24.8	21.9	102,054	
明治電機工業	3.7	4.3	5,912	
デリカフーズホールディングス	2.1	4.8	3,120	
スターティアホールディングス	2.3	3.1	2,263	
コメダホールディングス	27.5	29.7	55,390	
ビーバードットコム	—	1.4	1,400	
アセンテック	—	1.5	4,680	
富士興産	4.6	4.2	2,150	
協栄産業	1.4	1.5	1,852	
小野建	10.7	12.2	15,786	
南陽	2.4	3	4,440	
佐島電機	8.8	9.3	7,812	
エコートレーディング	2.7	3.2	1,667	
伯東	8.2	8.3	8,183	
コンドーテック	9.2	10.6	11,267	
中山福	6.8	7.9	3,531	
ナガイレーベン	17.2	18.1	48,327	
三菱食品	13.1	15	40,875	
松田産業	8.7	10	14,450	
第一興商	17.7	20.3	76,937	
メディバルホールディングス	128.4	147.2	314,566	
S P K	2.6	5.9	8,324	
萩原電気ホールディングス	4.4	5.1	11,332	
アズワン	8.5	8.9	105,821	
スズデン	4.1	4.7	5,649	
尾家産業	3.8	4	5,960	
シモジマ	7.3	8.4	10,575	
ドウシシャ	11.2	12.9	20,201	
小津産業	2.6	3	5,412	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
高速	7.1	8.1	11,939	
たけびし	4.2	4.8	7,041	
リックス	2.7	3.1	4,727	
丸文	10.5	12.1	5,844	
ハビネット	9.9	11.4	12,209	
橋本総業ホールディングス	2.4	2.8	5,213	
日本ライフライン	37.3	40.4	58,660	
タカショー	5.8	8.9	4,191	
エクセル	2.9	—	—	
マルカ	3.9	4.8	8,856	
I DOM	40	36.8	19,062	
日本エム・ディ・エム	7	—	—	
進和	7	8.1	15,624	
エスケイジャパン	2.9	3	939	
ダイトロン	5.5	5.8	9,831	
シークス	15.1	17.4	18,444	
田中商事	4	4.2	2,910	
オーハシテクニカ	6.7	7.7	12,520	
白銅	3.8	4.9	6,928	
伊藤忠商事	832	953.8	2,203,278	
丸紅	1,172.9	1,419.5	742,824	
高島	1.9	2.2	3,707	
長瀬産業	66.9	76.7	102,624	
蝶理	7.6	8.7	15,842	
豊田通商	132.8	152.2	415,506	
三共生興	20.2	20.7	9,294	
兼松	47.5	50.9	68,053	
ツカモトコーポレーション	2.1	2.4	2,673	
三井物産	979.9	1,180.8	1,931,198	
日本紙パルプ商事	6.8	7.8	30,381	
日立ハイテク	36.2	—	—	
カメイ	15.5	17.8	19,152	
東都水産	1.7	1.7	5,499	
OUGホールディングス	1.9	2.2	5,904	
スターゼン	4.4	5	23,150	
山善	46.5	53.3	49,888	
椿本興業	2.7	2.5	8,162	
住友商事	703.5	860.4	1,116,799	
内田洋行	5.1	5.4	30,456	
三菱商事	834.7	957	2,406,855	
第一実業	5.4	6.7	25,292	
キャノンマーケティングジャパン	34	33.8	74,224	
西華産業	6.7	7.7	9,301	
佐藤商事	10.6	11.3	10,203	
菱洋エレクトロ	12.1	13.8	36,873	
東京産業	11.8	12.4	6,931	
ユアサ商事	12.2	12.9	40,699	
神鋼商事	2.7	3.4	6,630	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
トルク	7.1	8.2	2,476	
阪和興業	20.6	25.5	50,643	
正栄食品工業	8.3	8.8	38,720	
カナデン	10.7	11.1	14,152	
菱電商事	9.4	9.8	13,847	
フルサト工業	6.6	7.5	10,837	
岩谷産業	26.4	30.3	115,140	
ナイス	5	5.8	4,825	
昭光通商	4.2	4.4	2,688	
ニチモウ	1.9	2.1	3,815	
極東貿易	3.7	3.9	5,772	
イワキ	14.2	17.9	8,771	
三愛石油	32	33.6	37,094	
稲畑産業	28.6	30	39,570	
G S I クレオス	3.2	3.4	3,937	
明和産業	11	12.6	6,186	
クワザワ	4.2	4.9	2,572	
ヤマエ久野	—	9.9	12,513	
ワキタ	25.4	29.1	30,031	
東邦ホールディングス	35.2	43.8	94,213	
サンゲツ	35.4	37.2	59,334	
ミツウロコグループホールディングス	15.7	20.1	24,200	
シナネンホールディングス	4.9	5.6	15,288	
伊藤忠エネクス	26.3	30.2	26,032	
サンリオ	36.7	38.3	69,169	
サンワテクノス	7.2	9.7	8,633	
リョーサン	13.1	15.1	36,844	
新光商事	11.2	21.4	19,388	
トーホー	5.4	6.2	11,742	
三信電気	8.2	7.3	12,074	
東陽テクニカ	13.7	14.6	15,271	
モスフードサービス	15.6	17.9	53,700	
加賀電子	11.8	13.6	31,756	
ソーダニッカ	12.2	14.1	7,402	
立花エレテック	8.8	10.1	17,856	
フォーバル	5.2	6	7,002	
PAL TAC	21.4	21.9	115,632	
三谷産業	13.9	18	7,038	
西本Wismettacホールディングス	2.7	2.5	4,797	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1	1.2	2,326	
国際紙パルプ商事	27.7	32.4	9,201	
ヤマタネ	6	6.8	8,384	
丸紅建材リース	1.2	1.3	2,024	
日鉄物産	8.5	9.7	36,181	
泉州電業	4	4.2	11,310	
トラスコ中山	24.8	28.4	70,545	
オートバックスセブン	47.3	50.6	66,893	
モリト	8.6	10	6,810	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
加藤産業	18.6	19.7	74,269	
北恵	2.3	3.5	3,192	
イノテック	7.1	7.1	7,902	
イエローハット	22.5	25.8	39,628	
J Kホールディングス	10.7	12.3	10,553	
日伝	9.9	12.3	28,154	
北沢産業	9	10.3	2,853	
杉本商事	6.4	7.4	13,712	
因幡電機産業	16.9	38.8	95,409	
東テク	3.9	4.5	10,053	
ミスミグループ本社	149	170.9	489,115	
アルテック	8.8	10.9	2,572	
タキヒヨー	3.6	4.1	7,027	
蔵王産業	2	2.6	3,775	
スズケン	54.3	57.8	226,287	
ジェコス	8.2	9.4	9,353	
グローセル	10.9	13.7	5,959	
小売業(4.9%)				
ローソン	30.1	34.5	205,620	
サンエー	9	11.4	48,963	
カワチ薬品	9.3	10.6	27,899	
エービーシー・マート	18.6	21.3	139,515	
ハードオフコーポレーション	4.9	5.7	4,172	
アスクル	12.5	14.3	46,475	
ゲオホールディングス	18.2	24.7	33,295	
アダストリア	16.5	19	33,326	
ジーフット	7.3	8.2	3,927	
くら寿司	7	7.2	35,424	
キャンドウ	5.7	6.6	12,421	
パルグループホールディングス	6.1	14.1	19,542	
エディオン	50.5	62.8	62,800	
サウラコーポレーション	24.4	28	16,016	
ワッツ	5.4	6.3	4,788	
ハローズ	4.5	5.2	16,120	
フジオフードシステム	5	11.6	19,360	
あみやき亭	2.6	3	9,510	
ひらまつ	23.9	25.1	5,095	
大黒天物産	2.9	3.3	13,299	
ハニーズホールディングス	10.6	12.2	15,103	
ファーマライズホールディングス	3	3.6	2,386	
アルベン	9.2	10.6	18,687	
ハブ	3.9	4.2	3,095	
クオールホールディングス	17.6	20.2	26,037	
ジンズホールディングス	6.3	7.2	49,176	
ビックカメラ	70.7	81.1	92,048	
DCMホールディングス	64.3	75.7	84,784	
ペッパーフードサービス	9.5	—	—	
MonotaRO	75.2	97	379,755	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
東京一番フーズ	3.2	3.9	2,024	
DDホールディングス	2.6	5.4	5,589	
きちりホールディングス	3.3	3.9	2,613	
アークランドサービスホールディングス	8.8	10.1	19,321	
J. フロント リテイリング	152.3	163.1	149,236	
ドール・日レスホールディングス	20.9	19.7	36,208	
マツモトキヨシホールディングス	49.2	56.4	227,574	
ブロンコビリー	6.3	7.2	17,496	
Z O Z O	128.6	93.9	186,297	
トレジャー・ファクトリー	3.6	4.3	3,160	
物語コーポレーション	2.9	3.7	29,045	
ココカラファイン	13.4	14.3	77,792	
三越伊勢丹ホールディングス	222.7	238.7	172,102	
H a m e e	3.8	5	6,420	
ウエルシアホールディングス	31.5	40.6	367,430	
クリエイトSDホールディングス	17.6	23	78,430	
丸善CH Iホールディングス	13.8	15.9	6,105	
ティーライフ	1.7	2.2	2,552	
エー・ビーカンパニー	2.5	—	—	
チムニー	3.7	4.3	7,761	
シュッピン	8.2	9.5	7,818	
オイシックス・ラ・大地	—	13.5	31,104	
ネクステージ	18.6	19.8	17,701	
ジョイフル本田	34.9	40.1	53,934	
鳥貴族	4	4.1	7,683	
キリン堂ホールディングス	4.8	5.5	12,078	
ホットランド	6.3	9.3	11,559	
すかいらくホールディングス	110.9	152.9	267,116	
S F Pホールディングス	5.1	7.9	13,335	
綿半ホールディングス	4.5	5.2	9,770	
ヨシックス	2	2.3	5,694	
ユナイテッド・スーパーマー ケット・ホールディングス	34.7	39.8	44,894	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5	6.6	3,907	
BEENOS	4.2	6.5	7,013	
あさひ	9.9	10.3	15,965	
日本調剤	4.2	8.4	14,523	
コスモス薬品	5.3	12.1	187,187	
トーエル	5.9	6.9	4,954	
オンリー	2.2	2.7	1,630	
セブン&アイ・ホールディングス	498.6	533.5	1,967,014	
薬王堂	5.2	—	—	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	32.1	73.5	61,152	
ツルハホールディングス	25.9	29.7	472,824	
サンマルクホールディングス	9.4	10.9	20,383	
フェリシモ	2.8	3.2	3,376	
トリドールホールディングス	14.7	33.9	41,391	
T O K Y O B A S E	10.8	12.9	4,579	
ウイルプラスホールディングス	2	2	1,494	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
J Mホールディングス	6.1	10.4	28,558	
サツドラホールディングス	1.8	2.1	4,244	
デファクトスタンダード	0.9	—	—	
アレナザホールディングス	6.6	7.1	6,184	
串カツ田中ホールディングス	—	2.9	5,109	
パロックジャパンリミテッド	9.8	9.8	6,370	
クスリのアオキホールディングス	11.8	12.2	108,580	
力の源ホールディングス	4.6	6.5	5,044	
スシローグローバルホールディングス	13.1	74.9	170,772	
L I X I L ビバ	10.2	13.5	32,575	
メディカルシステムネットワーク	12.8	13.6	6,405	
はるやまホールディングス	5.7	6.7	4,991	
ノジマ	21.2	24.3	60,968	
カッパ・クリエイト	16.7	19.1	28,917	
ライトオン	9	10.2	5,610	
良品計画	16.9	181.2	295,174	
三城ホールディングス	15	15.2	4,620	
アドヴァン	18.3	21	25,410	
アルビス	4.6	5.3	11,267	
コナカ	14.2	16.7	5,494	
ハウス オブ ローゼ	1.5	1.8	2,896	
G-7ホールディングス	3.5	8.1	19,083	
イオン北海道	12.1	18.2	14,232	
コジマ	20.6	23.9	11,878	
ヒマラヤ	4.3	5	4,105	
コーナン商事	15.7	19.5	61,327	
エコス	4.5	5.1	9,715	
ワタミ	15.7	16.3	17,147	
マルシェ	3.3	3.9	2,519	
バン・バシフィック・インター ナショナルホールディングス	71.2	299.8	650,865	
西松屋チェーン	26.2	30.1	27,812	
ゼンショーホールディングス	56.2	65.4	150,093	
幸楽苑ホールディングス	7.6	8.8	15,716	
ハークスレイ	2.6	3	3,000	
サイゼリヤ	19.7	20.3	46,568	
V Tホールディングス	54	57.1	21,812	
魚力	3.4	3.9	6,165	
フジ・コーポレーション	3.2	3.7	7,429	
ユナイテッドアローズ	13.6	14.4	26,654	
ハイデイ日高	17.2	19.8	37,818	
京都きもの友禅	7.9	9.5	2,251	
コロワイド	39.6	45.3	73,023	
ビーンデポコーポレーション	16	18.4	11,592	
老番屋	8.4	9.6	53,568	
P L A N T	3.2	3.8	2,276	
スギホールディングス	26.1	27.3	190,008	
薬王堂ホールディングス	—	6	16,152	
スクロール	18.6	21.5	8,019	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ヨンドシーホールディングス	13.3	14	27,510	
ファミリーマート	133.1	109	220,071	
木曽路	14.6	17.9	45,466	
S R Sホールディングス	14.1	16.3	15,028	
タカキュー	9.8	12	1,692	
リテールパートナーズ	—	18.2	28,901	
ケーヨー	22.2	28.3	18,310	
上新電機	14.1	16.1	35,919	
日本瓦斯	19.4	21.6	92,340	
ロイヤルホールディングス	20.8	23.9	47,226	
いなげや	13.4	17	28,696	
島忠	25.2	25.7	75,223	
チヨダ	12.6	14.5	15,283	
ライフコーポレーション	9.1	10.4	35,100	
リンガーハット	14.7	16.9	41,252	
M r M a x H D	16.5	19.2	8,467	
テンアライド	10.9	12.6	4,901	
A O K Iホールディングス	23.9	27.6	18,988	
オークワ	17.1	21.5	32,766	
コメリ	18.4	21.1	56,083	
青山商事	20.8	28.4	23,316	
しまむら	13.9	15.9	120,522	
はせがわ	6.6	7.7	2,664	
高島屋	93.4	99.5	102,982	
松屋	24.1	27.7	18,946	
エイチ・ツー・オー リテイリング	61.2	64.8	54,691	
近鉄百貨店	4.6	5.3	17,092	
パルコ	11.5	—	—	
丸井グループ	100.7	125.1	243,069	
アクシアル リテイリング	9.9	11.4	47,025	
イオン	457.8	524.8	1,250,860	
イズミ	24.2	27.8	94,103	
平和堂	24.2	27.8	53,820	
フジ	14.4	16.5	31,069	
ヤオコー	13.5	15.5	109,275	
ゼビオホールディングス	14.5	16.7	15,581	
ケーズホールディングス	123.7	131.7	181,746	
O l y m p i c グループ	7.2	7.3	5,015	
日産東京販売ホールディングス	17.9	21	4,893	
シルバーライフ	—	1.9	4,516	
一家ダイニングプロジェクト	—	1.4	931	
Genky DrugStores	5.9	6.1	17,330	
ナルミヤ・インターナショナル	—	3.3	2,590	
総合メディカルホールディングス	10.4	—	—	
ブックオフグループホールディングス	6.2	7.9	6,888	
アインホールディングス	16	16.8	116,928	
元気寿司	3.4	3.5	8,459	
ヤマダ電機	362.6	415.9	217,931	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アークランドサカモト	20.3	21.5	25,585	
ニトリホールディングス	51.5	59	1,152,565	
グルメ杵屋	8.6	9.9	10,226	
愛眼	9.4	10.9	2,376	
ケーユーホールディングス	6.3	7.4	6,208	
吉野家ホールディングス	41.6	44.9	110,947	
松屋フーズホールディングス	5.8	6.6	26,103	
サガミホールディングス	16	18.4	23,809	
関西スーパーマーケット	9.1	11.5	12,949	
王将フードサービス	8.7	10	62,800	
ブレナス	13.4	15.4	28,875	
ミニストップ	8.9	10.2	15,453	
アークス	22.4	28	61,040	
パローホールディングス	25.7	30.3	64,084	
ベルク	5.9	6.8	45,152	
大庄	6.4	7.4	10,434	
ファーストリテイリング	15.9	18.2	1,101,646	
サンドラッグ	44.8	51.4	186,582	
サックスパー ホールディングス	10.2	11.9	6,592	
ヤマザワ	2.5	3.3	5,662	
やまや	2.1	2.9	6,498	
ペルーナ	29.2	29.7	16,067	
銀行業(5.1%)				
島根銀行	3.8	3.6	1,868	
じもとホールディングス	80.1	92.3	8,860	
めぶきフィナンシャルグループ	622	709.6	173,142	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	16.6	18.4	19,908	
九州フィナンシャルグループ	197.4	298.8	136,850	
ゆうちょ銀行	338.2	386.9	344,341	
富山第一銀行	30.8	32.6	8,704	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	749.2	780	274,560	
西日本フィナンシャルホールディングス	76	90.9	67,447	
関西みらいフィナンシャルグループ	57.1	80.1	31,239	
三十三フィナンシャルグループ	10.9	12.7	19,583	
第四北越フィナンシャルグループ	21	23.7	53,609	
新生銀行	87.4	100.2	137,775	
あおぞら銀行	66.5	81.4	162,962	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,199.5	9,341.8	4,149,627	
りそなホールディングス	1,307.1	1,498.6	581,157	
三井住友トラスト・ホールディングス	234.1	258.1	818,435	
三井住友フィナンシャルグループ	839.5	944.5	2,945,895	
千葉銀行	411.3	455.7	233,318	
群馬銀行	240.4	262.3	88,395	
武蔵野銀行	18.1	20.3	30,795	
千葉興業銀行	36.4	37.4	9,387	
筑波銀行	49.3	56.8	10,508	
七十七銀行	37.9	46.1	70,855	
青森銀行	9.5	10.6	23,139	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
秋田銀行	8	8.8	13,666	
山形銀行	13.9	15.3	20,578	
岩手銀行	8.6	8.9	22,107	
東邦銀行	106.5	122.1	28,815	
東北銀行	6.1	6.5	6,136	
みちのく銀行	7.6	8.8	10,630	
ふくおかフィナンシャルグループ	105.3	115	201,595	
静岡銀行	300.8	338.2	232,005	
十六銀行	16.4	17.1	35,892	
スルガ銀行	—	139.7	54,622	
八十二銀行	289.3	329.6	131,180	
山梨中央銀行	15	15.9	14,771	
大垣共立銀行	25.4	27	61,398	
福井銀行	10.7	11.7	19,351	
北國銀行	12.5	13.6	37,576	
清水銀行	5.4	5.6	10,371	
富山銀行	2.6	2.6	5,917	
滋賀銀行	24.2	27.4	68,691	
南都銀行	19	22.7	51,097	
百五銀行	109.7	122.9	39,205	
京都銀行	42.9	48.9	189,243	
紀陽銀行	42.7	48.4	80,924	
ほくほくフィナンシャルグループ	80	90.9	82,537	
広島銀行	177.3	201.6	101,808	
山陰合同銀行	71.8	81	43,011	
中国銀行	103.3	117.5	113,740	
鳥取銀行	4.7	4.7	5,851	
伊予銀行	159.3	194.9	118,694	
百十四銀行	13	14.5	28,492	
四国銀行	17.8	20.7	17,139	
阿波銀行	18.5	22.3	55,170	
大分銀行	7.6	7.9	19,947	
宮崎銀行	8.3	9.1	21,284	
佐賀銀行	7.7	8.3	9,254	
沖縄銀行	11.1	12.5	41,375	
琉球銀行	28.2	31.5	30,555	
セブン銀行	405.3	456.2	140,053	
みずほフィナンシャルグループ	16,185.5	18,556.6	2,495,862	
高知銀行	4.3	5	3,635	
山ロフィナンシャルグループ	149.7	170.5	109,802	
長野銀行	4.5	4.5	5,197	
名古屋銀行	9.9	10.2	24,072	
北洋銀行	182.9	205.9	41,797	
愛知銀行	4.5	4.9	14,798	
中京銀行	5.3	5.6	11,978	
大光銀行	4.6	4.7	7,214	
愛媛銀行	17.4	19.1	22,767	
トマト銀行	5.5	5.3	5,543	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
京葉銀行	54	58.2	30,147	
栃木銀行	66.3	66	10,956	
北日本銀行	4.2	4.3	8,496	
東和銀行	20.8	24	16,992	
福島銀行	7.3	12.9	2,347	
大東銀行	5.7	7.1	4,842	
トモニホールディングス	94.4	105.6	36,643	
フィデアホールディングス	115.1	132.6	14,188	
池田泉州ホールディングス	130.4	157	26,533	
証券・商品先物取引業(0.8%)				
F P G	37.5	42.4	25,779	
マーキュリアインベストメント	4.7	6.4	3,596	
S B I ホールディングス	142	152.6	352,353	
ジャフコ	19.6	21	76,020	
大和証券グループ本社	956	1,096.2	489,672	
野村ホールディングス	2,096.2	2,403.3	1,112,487	
岡三証券グループ	101.8	116.9	40,915	
丸三証券	35.6	41	18,655	
東洋証券	43.3	50.2	6,726	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	142.4	157.5	39,690	
光世証券	3	3.6	1,879	
水戸証券	34.9	40.4	8,322	
いちよし証券	25	25.9	11,888	
松井証券	58.4	78.2	66,235	
だいこう証券ビジネス	5.1	6.8	6,242	
マネックスグループ	110.2	101	24,240	
カブドットコム証券	86.9	—	—	
極東証券	16.1	18.7	9,854	
岩井コスモホールディングス	12.3	13.1	12,903	
藍澤證券	21.6	24.8	17,211	
マネーパートナーズグループ	14.3	15.4	3,280	
スパークス・グループ	47.4	63.9	14,185	
保険業(2.1%)				
かんぽ生命保険	45	48.4	66,211	
SOMPOホールディングス	210	256.8	984,057	
アニコム ホールディングス	9.8	11.3	60,116	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	311.4	357.1	1,130,221	
ソニーフィナンシャルホールディングス	97.9	112.2	291,271	
第一生命ホールディングス	673.9	772.8	1,084,238	
東京海上ホールディングス	425.9	482.8	2,253,710	
T & Dホールディングス	368.4	408.2	397,178	
アドバンスクリエイト	2.8	2.8	6,412	
その他金融業(1.1%)				
全国保証	33.6	38.5	159,582	
ジェイリース	3.3	3.8	1,554	
イントラスト	3.3	4.8	3,571	
日本モーゲージサービス	2.1	2.8	5,602	
C a s a	5.4	4.8	6,000	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アルヒ	10.8	21.7	32,419	
プレミアグループ	6.8	7.4	14,467	
クレディセゾン	83.4	95.7	122,783	
芙蓉総合リース	13.6	14.3	88,374	
みずほリース	22.4	21.1	50,133	
東京センチュリー	24	27.5	128,837	
日本証券金融	52.5	60.2	30,401	
アイフル	181.7	208.3	55,616	
リコーリース	9.4	10.7	33,544	
イオンフィナンシャルサービス	76.1	83.6	101,406	
アコム	239.4	274.5	120,505	
ジャックス	13.2	15.1	28,508	
オリエントコーポレーション	322.2	369.4	47,283	
日立キャピタル	28.1	32.2	73,222	
アプラスフィナンシャル	56.9	65.5	4,519	
オリックス	794.7	854.1	1,220,508	
三菱UFJリース	268.7	346.6	182,311	
九州リースサービス	5.8	6.7	3,283	
日本取引所グループ	321.8	392	908,264	
イー・ギャランティ	11.2	14.6	31,886	
アサックス	4.9	7.1	4,529	
NECキャピタルソリューション	4.8	5.6	11,379	
不動産業(2.1%)				
いちご	155.2	180.3	55,352	
日本駐車場開発	138	149.1	21,023	
スター・マイカ・ホールディングス	—	8.3	12,433	
ADワークスグループ	—	25.3	4,705	
ヒューリック	250	293.5	319,915	
三栄建築設計	5.6	7.1	8,548	
スター・マイカ	6.4	—	—	
野村不動産ホールディングス	79.9	83.9	167,296	
三重交通グループホールディングス	26.2	31.7	15,120	
サムティ	17.4	20.8	30,534	
ディア・ライフ	18.3	23.6	11,210	
コーセーアールイー	5.2	—	—	
エー・ディー・ワークス	115	—	—	
日本商業開発	8.3	10	15,280	
プレサンスコーポレーション	19.8	—	—	
ユニゾホールディングス	18.7	—	—	
ハウスコム	—	3.8	5,099	
日本管理センター	9	10.7	12,936	
サンセイラニディック	4.9	6.4	5,574	
エストラスト	1.2	—	—	
フージャースホールディングス	21.2	27.2	16,755	
オープンハウス	17.5	40.4	120,311	
東急不動産ホールディングス	322.4	375	204,750	
飯田グループホールディングス	100.1	115.2	184,320	
イーグランド	3.6	5.1	3,386	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ムゲンエステート	10.5	13.2	7,048	
ファーストブラザーズ	4.4	—	—	
ハウストゥ	6.6	6.7	6,880	
シーアールイー	4.2	4.9	5,782	
ケイアイスター不動産	4.1	—	—	
グッドコムアセット	3.6	4.5	7,429	
ジェイ・エス・ビー	0.9	3.7	8,757	
テンポイノベーション	2.2	5.6	4,060	
パーク24	70.2	74.3	155,361	
バラカ	3.7	4.7	8,460	
三井不動産	632.4	674.5	1,398,575	
三菱地所	835.1	958	1,641,054	
平和不動産	23.1	25.7	75,686	
東京建物	131.2	145.3	201,821	
ダイビル	36.4	37.1	38,955	
京阪神ビルディング	22.4	23.3	34,833	
住友不動産	268.1	307.7	918,330	
テオーシー	29.2	29.7	20,790	
東京楽天地	2	2.7	12,258	
スターツコーポレーション	16.7	19.5	42,724	
フジ住宅	16.8	19.5	10,276	
空港施設	16.4	18.1	7,927	
明和地所	8.9	11.9	5,081	
ゴールドクレスト	10.1	12	18,936	
エスリード	5.5	6.7	10,150	
日神グループホールディングス	20.4	25	10,275	
日本エスコ	23.4	24.7	19,932	
タカラレーベン	57.8	62.4	23,400	
AVANTIA	8.1	10.3	8,075	
イオンモール	60.5	69.8	105,747	
毎日コムネット	4.2	5.8	4,843	
ファースト住建	5.5	7.9	7,260	
カチタス	13.6	34.7	83,453	
トーセイ	17.8	20.7	22,169	
穴吹興産	1.7	4.2	7,303	
サンフロンティア不動産	17.7	21.1	19,876	
エフ・ジェー・ネクスト	11.7	14.2	12,538	
インテリックス	5.1	3.8	1,987	
ランドビジネス	5	4.6	1,614	
日本社宅サービス	—	6	6,636	
グランディハウス	13.2	15.6	6,162	
日本空港ビルデング	38.3	44	208,560	
サービス業(5.4%)				
日本工営	7.8	8.9	29,325	
LIFULL	40.5	46.5	19,762	
ジェイエシールクルートメント	9.3	9	12,429	
日本M&Aセンター	86.1	100	433,000	
メンバーズ	3.9	4	7,320	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
中広	1.5	2.1	1,117	
UTグループ	—	20.9	42,218	
アイティメディア	2.6	5.4	5,740	
タケエイ	12.1	12.8	12,377	
E・Jホールディングス	1.6	2.4	3,748	
ビーネックスグループ	6.4	16.7	13,677	
コンダカホールディングス	27.9	32.1	17,237	
アルトナー	3	3.4	2,611	
パソナグループ	14.2	14.4	18,432	
CDS	3	3.4	4,508	
リンクアンドモチベーション	21.4	29.5	13,393	
GCA	11.8	16.2	10,627	
エス・エム・エス	42.5	41.2	110,292	
サニーサイドアップグループ	1.3	4.7	3,896	
パソルホールディングス	115.4	132.4	188,670	
リニカル	6.6	6.5	6,175	
クックパッド	36.5	46.6	14,632	
エスクリ	3.3	4.4	1,971	
アイ・ケイ・ケイ	5.8	6.7	4,073	
学情	4.8	4.8	6,393	
スタジオアリス	5.9	6.7	10,974	
シミックホールディングス	6.5	6.6	10,071	
エプコ	—	2.9	3,352	
NJS	2.6	3	5,364	
総合警備保障	45.9	52.7	279,310	
カカコム	86.5	97.8	254,866	
アイロムグループ	4.4	4.7	10,753	
セントケア・ホールディング	8.7	8.9	3,835	
サイネックス	2.2	2.4	1,596	
ルネサンス	6.5	7.5	8,820	
ディップ	18.7	18.7	47,591	
オプトホールディング	7.2	7.3	11,161	
ツクイ	27.5	31.4	15,794	
キャリアデザインセンター	3	3.2	3,145	
ベネフィット・ワン	32	48.2	113,462	
エムスリー	243	291.8	1,266,412	
ツカダ・グローバルホールディング	7.6	8.7	3,654	
プラス	1.5	1.9	1,069	
アウトソーシング	61	75.9	48,044	
ウェルネット	11.1	13.5	9,639	
ワールドホールディングス	3.3	4.6	8,303	
ディー・エヌ・エー	62.3	64.9	96,052	
博報堂DYホールディングス	160.5	184.1	246,509	
ぐるなび	16.6	23.2	15,288	
タカミヤ	12.1	14.3	7,150	
ジャパンベストレスキューシステム	7.8	10.4	9,120	
ファンコミュニケーションズ	31.9	36.7	17,469	
ライク	4.7	4.4	7,066	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ビジネス・ブレイクスルー	5.2	5.9	2,236	
エスブルー	—	34.1	25,745	
WDBホールディングス	5.3	6.1	16,463	
時間いらず	—	0.9	4,279	
ティア	6.9	8	4,296	
CDG	1.2	1.5	2,320	
バリューコマース	7.8	7.5	20,205	
インフォマート	63.3	145.1	131,170	
J Pホールディングス	33.3	42	11,886	
エコナックホールディングス	21.9	25.2	2,520	
E P Sホールディングス	17.4	18	19,944	
レッグス	3	3.4	3,532	
プレステージ・インターナショナル	21.7	49.7	47,314	
アミューズ	7	7.3	17,541	
ドリームインキュベータ	3.6	4.1	6,338	
クイック	7.2	8.3	10,391	
T A C	7	8.7	1,609	
ケネディクス	101.6	123.5	72,371	
電通グループ	140.6	136.4	393,514	
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.5	5.2	3,536	
びあ	3.3	3.8	14,421	
イオンファンタジー	3.8	5.2	9,906	
シーティーエス	13.2	15.1	10,690	
ネクシィーズグループ	4.1	4.2	4,548	
みらかホールディングス	32.3	37.1	92,972	
アルプス技研	10.2	11.8	22,939	
ダイオーズ	2.8	2.7	3,061	
日本空調サービス	13.2	14	10,164	
オリエンタルランド	136.4	140.7	2,197,030	
ダスキン	29.7	32.9	97,055	
明光ネットワークジャパン	13.7	16.9	14,534	
ファルコホールディングス	6.4	7.4	12,321	
ラウンドワン	35.9	37.1	34,020	
リゾートトラスト	48.9	60.7	82,066	
ビー・エム・エル	14.9	17.1	51,898	
ワタベウェディング	2.1	2.5	1,070	
りらいあコミュニケーションズ	21	24	29,400	
リソー教育	58.9	60.9	18,574	
早稲田アカデミー	3.5	5.9	5,782	
ユー・エス・エス	141	148.2	278,319	
東京個別指導学院	4.2	4.9	2,979	
サイバーエージェント	66.4	81.5	442,545	
楽天	538	616.8	601,996	
クリーク・アンド・リバー社	6.9	7	7,420	
テー・オー・ダブリュー	10.2	21.4	7,597	
山田コンサルティンググループ	5.7	8.7	11,449	
セントラルスポーツ	4.3	5	13,000	
フルキャストホールディングス	11.6	13.3	21,027	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エン・ジャパン	16.8	23.6	68,581	
リソルホールディングス	1.3	1.5	5,385	
テクノプロ・ホールディングス	23.2	26.4	170,280	
アトラ	2.8	3.5	941	
インターワークス	2.4	2.9	1,142	
アイ・アールジャパンホールディングス	4.7	5.4	51,570	
Keeper 技研	4.3	5	8,205	
ファーストロジック	2.9	2.8	1,713	
三機サービス	2.5	2.7	2,986	
G u n o s y	8.1	8.4	7,778	
デザインワン・ジャパン	2.7	4.4	1,174	
イー・ガーディアン	5.9	5.9	15,015	
リブセンス	6.9	9	2,529	
ジャパンマテリアル	31.7	40.8	71,563	
ベクトル	14.2	16.6	14,159	
ウチヤマホールディングス	5.9	6.9	2,608	
チャーム・ケア・コーポレーション	3.8	11.4	10,225	
ライクキッズ	2.9	2.4	1,773	
キャリアリンク	4.6	4.6	2,640	
I B J	7.9	9.2	7,746	
アサンテ	4.7	5.4	8,310	
N・フィールド	7.6	9.3	4,975	
バリューHR	2.5	5.3	7,753	
M&Aキャピタルパートナーズ	4.1	10.8	43,254	
ライドオンエクспレスホールディングス	4.9	5.1	8,670	
E R I ホールディングス	3.4	3.9	2,624	
アビスト	1.8	2.1	5,142	
シグマクシス	5.6	9.1	17,371	
ウィルグループ	7.7	8.8	6,406	
エスクロー・エージェント・ジャパン	16.3	18.9	3,855	
日本ビューホテル	3.8	—	—	
リクルートホールディングス	826.7	947.9	3,516,709	
エラン	8	7.9	14,212	
土木管理総合試験所	5.3	6.1	2,360	
ネットマーケティング	—	5.3	3,614	
日本郵政	946	1,084.6	850,434	
ベルシステム24ホールディングス	19.4	22.3	30,261	
鎌倉新書	8.5	10.1	12,089	
SMN	1.6	3	2,739	
一蔵	1.5	1.8	770	
L I T A L I C O	2.7	4.6	12,939	
グローバルキッズCOMPANY	1.9	2.6	1,622	
エアトリ	5	6.9	8,659	
アトラエ	3	4	12,860	
ストライク	4.4	5	24,000	
ソラスト	28.4	36.6	45,676	
セラク	3.8	4.3	4,205	
インソース	4.5	5.5	15,994	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ベイカレント・コンサルティング	8.2	8	60,560	
Orchestra Holdings	2.1	2.9	3,735	
アイモバイル	3.8	4.9	3,660	
キャリアインデックス	4.1	5.8	1,943	
MS-Japan	4.8	4.4	3,964	
船場	2	2.3	2,219	
グレイステクノロジー	4.2	6.1	26,443	
ジャパンエレベーター	9.1	14	46,550	
サーピスホールディングス				
フルテック	1.7	2	2,612	
グリーンズ	4.4	3.6	1,983	
ツナググループ・ホールディングス	1.6	2.5	1,190	
GameWith	—	4.1	2,730	
ソウルドアウト	1.2	2.8	6,210	
MS&Consulting	2	2.7	1,746	
ミダック	—	1.8	2,959	
日総工産	7.7	9	6,345	
キュービーネットホールディングス	7	5.5	11,792	
RPAホールディングス	2.3	10.2	9,353	
スプリックス	3.9	3.9	3,494	
マネジメントソリューションズ	—	5.9	6,372	
プロレド・パートナーズ	—	1.8	9,432	
and factory	—	1.4	1,759	
ギークス	—	1.5	2,040	
カープスホールディングス	—	36.5	24,126	
フォーラムエンジニアリング	—	7	6,426	
アドバンテッジリスクマネジメント	4.7	6.8	6,140	
リログループ	63.1	72.4	178,176	
東祥	7.2	8.3	11,769	
エイチ・アイ・エス	20.6	20.6	40,726	
ラックランド	2.4	3.1	6,513	
共立メンテナンス	17.7	22	75,680	
イチネンホールディングス	12.1	14.9	18,222	
建設技術研究所	8.1	9.2	16,173	
スペース	7.6	8.7	8,813	
長大	4.8	5.4	5,562	
燦ホールディングス	2.6	5.9	6,962	
スバル興業	0.8	0.8	6,296	
東京テアトル	4.6	5.3	6,752	
タナベ経営	2.3	2.6	3,335	
ナガワ	3.2	4.2	33,600	
よみうりランド	2.5	2.9	10,875	
東京都競馬	7.6	8.7	30,841	
カナモト	17.3	21.7	50,387	
東京ドーム	43.3	53.7	48,330	
西尾レントオール	11.8	12.3	29,151	
トランス・コスモス	12.9	12.6	31,941	
乃村工藝社	54	56.8	55,436	
藤田観光	4.6	5.8	10,950	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
KNT-CTホールディングス	6.1	8.2	9,913	
日本管財	12.4	14.2	26,341	
トーカイ	11.2	12.8	35,212	
白洋舎	1.4	1.6	4,608	
セコム	122.5	140.4	1,310,493	
セントラル警備保障	5.6	6.4	29,024	
丹青社	21.9	25.2	18,975	
メイテック	14.3	16.2	84,240	
応用地質	12.5	14.3	19,204	
船井総研ホールディングス	23.9	27.4	69,459	
進学会ホールディングス	5.5	5.4	2,786	
オオバ	9.2	9.6	6,297	
いであ	2.4	3.3	5,857	
学究社	3.9	4	4,520	
ベネッセホールディングス	42.3	44.1	128,639	
イオンディライト	14.3	16.3	50,285	
ナック	7.4	7.5	6,945	
ニチイ学館	16.5	18.9	30,901	
ダイセキ	19.4	22.2	62,359	
ステップ	4.3	4.9	7,154	
合 計	株 数・金 額 銘柄数<比率>	140,334 2,078	162,264 2,102	304,033,610 <97.0%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<国内新株予約権証券>

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	評 価 (千円)	額 (千円)
千葉興業銀行第7回新株予約権	—	38,100	—	—
合 計	証 券 数・金 額 銘柄数<比率>	— —	38,100 1	— <—%>

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	5,440	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	304,033,610	96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,854,107	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	313,887,717	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年5月29日現在
(A)資 産	314,236,713,295円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,890,233,378
株 式(評価額)	304,033,610,080
未 収 入 金	3,121,635,512
未 収 配 当 金	3,191,234,325
(B)負 債	788,647,808
前 受 金	362,427,200
未 払 金	72,987,000
未 払 解 約 金	353,225,006
未 払 利 息	8,602
(C)純 資 産 総 額(A-B)	313,448,065,487
元 本	212,335,378,830
次 期 繰 越 損 益 金	101,112,686,657
(D)受 益 権 総 口 数	212,335,378,830口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,762円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A)配 当 等 収 益	7,604,285,657円
受 取 配 当 金	7,602,413,988
受 取 利 息	9,261
そ の 他 収 益 金	3,857,899
支 払 利 息	△1,995,491
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	8,380,434,231
売 買 益	32,786,368,842
売 買 損	△24,405,934,611
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	494,851,340
取 引 益	1,325,902,390
取 引 損	△831,051,050
(D)そ の 他 費 用	△2,167
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	16,479,569,061
(F)前 期 繰 越 損 益 金	79,635,221,720
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	22,559,756,391
(H)解 約 差 損 益 金	△17,561,860,515
(I)計 (E+F+G+H)	101,112,686,657
次 期 繰 越 損 益 金(I)	101,112,686,657

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は192,648,275,463円、期中追加設定元本額は57,404,489,163円、期中一部解約元本額は37,717,385,796円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	51,398,165,781円
DCマイセクション50	20,076,868,336円
DCマイセクション75	18,038,129,668円
分散投資コア戦略ファンドS	15,498,874,548円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	13,556,829,429円
SMT TOPIXインデックス・オープン	9,597,759,896円
DCマイセクションS50	8,608,682,819円
DCマイセクション25	7,529,986,081円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,030,044,149円
DC日本株式インデックス・オープン	5,859,526,247円
分散投資コア戦略ファンドA	5,599,750,637円
DCマイセクションS75	5,385,777,867円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,930,460,291円
日本株式インデックス・オープン	4,272,449,559円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,086,047,882円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,052,532,100円
DCマイセクションS25	3,227,803,983円
DC世界経済インデックスファンド	2,894,315,806円
世界経済インデックスファンド	2,238,030,171円
日本株式ファンド・シリーズ2	2,083,123,000円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,033,776,175円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,672,213,786円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,064,693,052円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,002,792,632円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	856,763,230円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	774,615,025円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	700,749,358円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	685,206,125円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	631,511,562円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	584,094,810円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	573,894,818円
コア投資戦略ファンド(切替型)	561,696,405円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	557,996,502円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	495,066,105円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	468,469,284円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	449,394,641円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	345,589,296円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	342,138,642円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	322,645,065円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	295,806,428円
グローバル経済コア	269,825,330円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	262,532,624円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	262,426,915円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	239,188,128円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	207,812,783円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	76,211,965円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	74,781,332円
SMT インデックスバランス・オープン	67,960,476円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	55,956,109円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	52,628,155円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	49,383,233円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	40,561,470円

世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	40,131,391円
マイセレーション50VA1(適格機関投資家専用)	36,718,016円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	34,958,991円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,642,992円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	30,632,949円
SMT 世界経済インデックス・オープン	22,297,368円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	18,089,720円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	16,669,302円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,227,555円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	13,088,994円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	11,959,698円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,032,673円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,775,748円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	3,529,303円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,628,611円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	192,405円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	123,495円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	76,163円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	63,745円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日 2020年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	投資信託 証券 組入比率	純 資 産 額
		騰 落 率		騰 落 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
第16期(2016年5月30日)	18,911	△13.9	516.33	△16.9	91.4	5.9	2.6	266,540
第17期(2017年5月29日)	22,222	17.5	596.68	15.6	95.1	2.5	2.5	306,484
第18期(2018年5月29日)	24,481	10.2	644.41	8.0	92.8	4.9	2.2	336,874
第19期(2019年5月29日)	25,011	2.2	644.69	0.0	95.0	2.5	2.7	345,116
第20期(2020年5月29日)	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5	399,725

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率			
(当 期 首) 2019年 5月29日	円 25,011	% －	644.69	% －	% 95.0	% 2.5	% 2.7
5月末	24,841	△0.7	641.25	△0.5	94.7	2.6	2.7
6月末	25,739	2.9	660.42	2.4	95.7	1.6	2.6
7月末	26,441	5.7	677.74	5.1	94.8	2.5	2.6
8月末	25,126	0.5	642.81	△0.3	94.4	2.8	2.8
9月末	25,933	3.7	663.94	3.0	95.6	2.7	2.8
10月末	26,960	7.8	687.28	6.6	93.9	3.6	2.7
11月末	27,963	11.8	711.98	10.4	94.8	2.4	2.7
12月末	28,811	15.2	732.76	13.7	96.5	3.0	2.7
2020年 1月末	28,845	15.3	730.36	13.3	94.5	2.7	2.7
2月末	26,575	6.3	677.62	5.1	94.1	3.1	2.8
3月末	22,580	△9.7	568.35	△11.8	92.6	4.8	2.6
4月末	24,792	△0.9	624.92	△3.1	93.7	3.8	2.5
(当 期 末) 2020年 5月29日	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5

(注1)騰落率は期首比です。

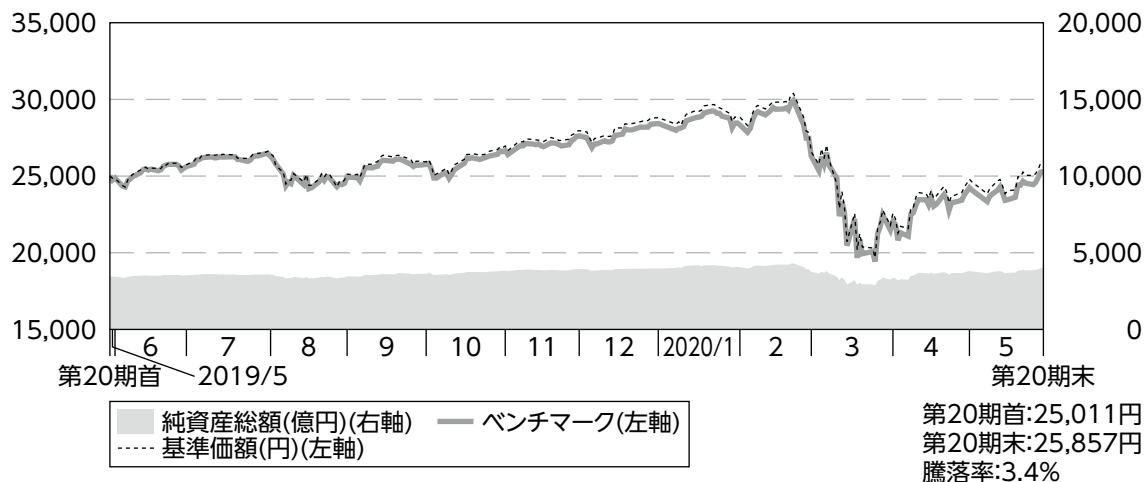
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は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及び公表を停止する権利を有しています。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

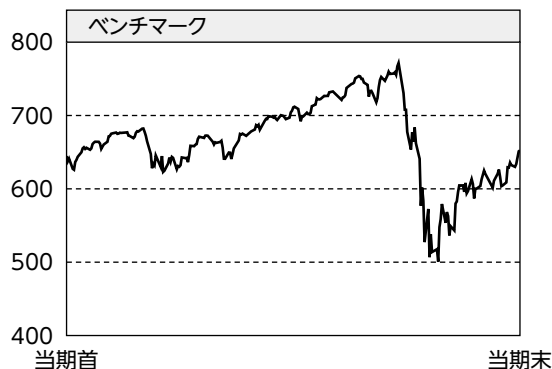


(注)ベンチマークは、2019年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、米中通商協議の進展期待や概ね堅調な企業業績、良好な経済指標などを背景に、2020年2月中旬まで堅調に推移しました。しかしその後は、新型コロナウイルスの世界的な感染急拡大を受けた外出制限措置などによる経済活動の停滞長期化への懸念や、OPEC（石油輸出国機構）と非加盟産油国における協調減産交渉の決裂により原油価格が急落したことなどを背景に、3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、各国の大型経済対策への期待や世界的な金融緩和政策、米欧各地で感染拡大ペースの鈍化を示す兆候が見られ段階的に経済活動再開を探る動きが始まったことなどを背景に急速に値を戻し、前期末の水準を上回って期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス（円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

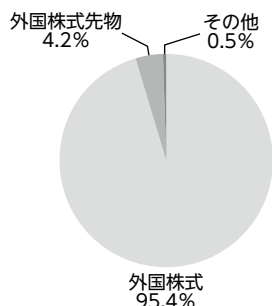
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	3.6%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.4%
3	S&P 500 EMIN 2006	アメリカ	2.9%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.6%
5	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.4%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.1%

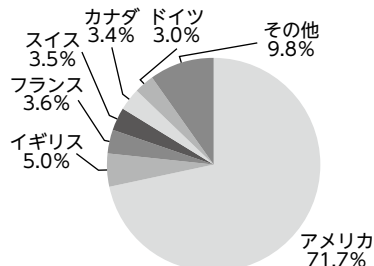
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.1%
8	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.0%
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	0.9%
10	NESTLE SA - REGISTERED	スイス	0.8%
組入銘柄数			1,325

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

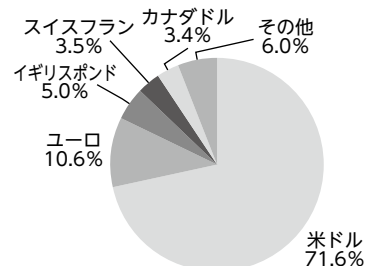
○資産別配分



○国別配分



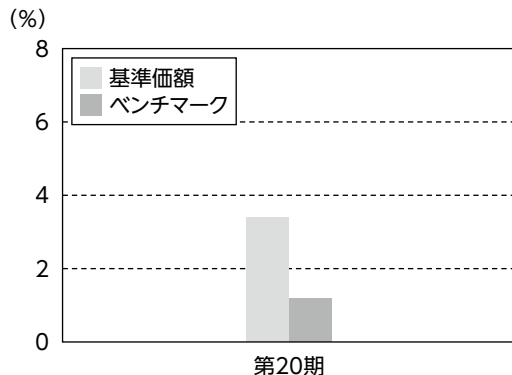
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して4.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、配当要因※1、為替評価差要因※2 (いずれもプラス要因) です。

※1 ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる差異要因です。

※2 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

今後の運用方針

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)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。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年5月30日～2020年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (0) (－) (－) (－) (0) (－) (1)	0.004% (0.001) (－) (－) (－) (0.000) (－) (0.002)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	1 (1) (－) (－) (－) (－) (0)	0.005 (0.005) (－) (－) (－) (－) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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) (監査費用) (その他)	8 (8) (－) (0)	0.030 (0.029) (－) (0.001)	(c) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	10	0.039	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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。

(注2) 各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(26,217円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 37,706 (3,446)	千米ドル 286,007 (16,739)	百株 10,496 (1,808)	千米ドル 69,891 (25,545)
	カ ナ ダ	5,121 (△224)	千カナダドル 23,619 (634)	2,863 (536)	千カナダドル 4,402 (1,333)
	ド イ ツ	2,842 (69)	千ユーロ 11,452 (△39)	439	千ユーロ 2,414
	イ タ リ ア	4,493	2,622	739	645
	フ ラ ン ス	3,001 (38)	14,213 (△11)	552	2,349
	オ ラ ン ダ	3,658	10,310	241	905
	ス ペ イ ン	5,688 (9,718)	3,704 (342)	6,061 (3,582)	808 (205)
	ベ ル ギ ー	230	1,861	33	201
	オ ー ス ト リ ア	71	166	—	—
	ル ク セ ン ブ ル ク	645	604	35	148
	フ ィ ン ラ ン ド	966 (34)	1,315 (20)	51 (34)	197 (40)
	ア イ ル ラ ン ド	138 (1)	556 (—)	—	—
	ポ ル ト ガ ル	139	165	—	—
	イ ギ リ ス	33,773 (2,665)	千イギリスポンド 18,524 (96)	8,037 (95)	千イギリスポンド 4,249 (249)
	ス イ ス	2,175 (—)	千スイスフラン 14,489 (△215)	631	千スイスフラン 2,948
	ス ウ ェ ー デ ン	2,764 (422)	千スウェーデンクローナ 36,750 (1,131)	848 (181)	千スウェーデンクローナ 9,469 (915)
	ノ ル ウ ェ ー	438	千ノルウェークローネ 7,423	—	千ノルウェークローネ —
	デ ン マ ー ク	489	千デンマーククローネ 23,590	49	千デンマーククローネ 3,054
	オ ー ス ト ラ リ ア	9,671 (△9)	千オーストラリアドル 16,086 (△63)	1,219 (1,052)	千オーストラリアドル 3,099 (1,705)
国	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	1,474	千ニュージーランドドル 881	—	千ニュージーランドドル —
	香 港	11,307 (929)	千香港ドル 42,023 (—)	4,219	千香港ドル 13,360
	シ ン ガ ポ ー ル	5,789 (2,578)	千シンガポールドル 2,650 (404)	4,355 (1,928)	千シンガポールドル 518 (209)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外国	イスラエル	205 (48)	千イスラエルシェケル 1,793 (56)	48 (一)	千イスラエルシェケル 47 (56)

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1	137	—	—
	BOSTON PROPERTIES	1	111	—	—
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20	842	—	—
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	12	105	—	—
	PROLOGIS INC	9 (11)	726 (797)	3	255
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	311	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	2	70	—	—
	DUKE REALTY CORP	5	145	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	4	682	—	—
	ESSEX PROPERTY TRUST	0.629	135	—	—
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	4	321	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	92	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6	133	—	—
	WELLTOWER INC	6	412	—	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4 (△16)	231 (△797)	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	2	70	—	—
	MACERICH CO/THE	—	—	10	270
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1 (7)	114 (一)	—	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.678	70	—	—
	REALTY INCOME CORP	5	415	—	—
	UDR INC	3	116	—	—
	SIMON PROPERTY GROUP	3	354	—	—
	PUBLIC STORAGE	2	443	0.782	187
	SUN COMMUNITIES INC	1	259	—	—
	VENTAS INC	3	214	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2	218	—	—
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8	1,076	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50	999	—	—
	VEREIT INC	28	270	—	—
	AMERICAN TOWER CORPORATION	5	1,114	—	—
	WP CAREY INC	3	253	—	—

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	INVITATION HOMES INC	27	733	—	—
	EQUINIX INC	1	704	—	—
	VICI PROPERTIES INC	44	1,025	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1	351	—	—
	小 計	278 (1)	13,267 (—)	13	712
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	446	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	— (12)	— (261)	—	—
	小 計	8 (12)	446 (261)	—	—
	フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
	COVIVIO (FP)	1	89	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2	236	1	149
	小 計	4	325	1	149
	ユ ー ロ 計	4	325	1	149
	イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
	SEGRO PLC	24	194	20	153
	小 計	24	194	20	153
	オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
	MIRVAC GROUP	86	263	—	—
	APA GROUP	24	264	—	—
	GPT GROUP	31	199	—	—
	GOODMAN GROUP	22	258	—	—
	LENLEASE GROUP	11	119	—	—
	小 計	177	1,105	—	—
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	19	1,306	—	—
	小 計	19	1,306	—	—
	シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	44 (31)	129 (88)	— (—)	— (8)
	SUNTEC REIT	— (—)	— (△1)	—	—
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	220 (—)	534 (△0.066)	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	— (31)	— (8)	— (31)	— (8)
	小 計	264 (63)	664 (94)	— (31)	— (16)

(注1) 金額は受渡代金です。

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		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 124,324	百万円 117,556	百万円 －	百万円 －

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	55,575,383千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	351,538,499千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.15

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為 替 直 物 取 引	百万円 84,605	百万円 67	% 0.1	百万円 49,908	百万円 12	% 0.0
金 銭 信 託	237	237	100.0	97	97	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	194,147	29,137	15.0	193,796	29,195	15.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当期首(前期末)	当	期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価	額	
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ABBOTT LABORATORIES	1,487	1,686	15,534	1,670,435	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	526	617	796	85,604	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	767	844	10,520	1,131,260	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	386	432	5,350	575,321	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	190	210	5,063	544,470	素材
ALLEGHANY CORP	12	12	674	72,488	保険
RALPH LAUREN CORPORATION	45	45	366	39,371	耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	301	309	3,039	326,824	保険
HONEYWELL INTL INC	624	694	10,241	1,101,273	資本財
HESS CORP	220	248	1,203	129,406	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	611	663	6,508	699,831	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	414	471	4,012	431,460	公益事業
AFLAC	652	686	2,512	270,207	保険
AMERICAN INT'L GROUP	769	831	2,587	278,180	保険
ANADARKO PETROLEUM CORP	443	—	—	—	エネルギー
JONES LANG LASALLE INC	36	44	467	50,241	不動産
VALERO ENERGY CORP	353	392	2,634	283,304	エネルギー
APACHE CORP	342	642	762	82,036	エネルギー
ALBEMARLE CORP	86	101	772	83,117	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	477	521	2,035	218,863	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	94	107	827	89,016	公益事業
AMEREN CORPORATION	210	231	1,709	183,821	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	66	78	531	57,184	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	66	101	650	69,906	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	20	22	2,622	281,959	小売
AVERY DENNISON CORP	74	74	836	89,959	素材
BALL CORP	271	291	2,055	221,017	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,096	1,258	23,296	2,505,112	各種金融
BANK NEW YORK CO	716	792	2,978	320,324	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	440	462	4,083	439,049	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	225	258	6,231	670,117	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	190	222	2,044	219,797	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	3,497	3,944	21,977	2,363,189	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	139	140	818	88,041	保険
BEST BUY COMPANY INC	218	227	1,736	186,724	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	21	1,021	109,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	273	291	2,649	284,925	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	432	505	2,158	232,088	公益事業
BLOCK H & R INC	169	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO	456	519	7,781	836,777	資本財
ROBERT HALF INTL INC	95	95	491	52,902	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	159	198	638	68,654	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,162	1,330	4,984	535,961	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	22	1,791	192,652	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,403	2,235	13,372	1,437,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	44	—	—	—	各種金融

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
ONEOK INC	340	369	1,377	148,150	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	70	70	446	48,006	保険
UNITED RENTALS INC	64	64	887	95,389	資本財
SEMPRA ENERGY	232	269	3,428	368,674	公益事業
FEDEX CORP	216	241	3,160	339,871	運輸
AMPHENOL CORPORATION	262	276	2,639	283,792	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	220	290	1,914	205,852	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	358	358	693	74,537	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	140	158	785	84,500	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	140	159	2,806	301,822	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	252	279	1,520	163,512	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	496	536	6,482	697,092	資本財
CENTURYLINK INC	833	939	955	102,754	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,767	3,001	29,969	3,222,586	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	212	234	1,736	186,729	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	327	356	7,146	768,421	ヘルスケア機器・サービス
CLOROX COMPANY	109	119	2,457	264,207	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,420	3,881	18,279	1,965,629	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	710	776	5,600	602,232	家庭用品・パーソナル用品
AON PLC	201	—	—	—	保険
COMERICA INC	143	143	539	58,028	銀行
NRG ENERGY INC	267	230	840	90,428	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	399	459	1,559	167,702	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	274	317	2,322	249,700	公益事業
CMS ENERGY CORP	245	267	1,549	166,581	公益事業
THE COOPER COS INC	41	46	1,484	159,613	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	662	723	1,668	179,445	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	146	146	472	50,796	素材
HEICO CORP-CLASS A	64	64	571	61,489	資本財
CUMMINS INC	125	136	2,317	249,251	資本財
L3 TECHNOLOGIES INC	69	—	—	—	資本財
DR HORTON INC	289	321	1,798	193,412	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	542	597	9,789	1,052,665	ヘルスケア機器・サービス
MOODY'S CORP	150	162	4,294	461,829	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	418	484	5,735	616,719	小売
DEERE&CO	263	290	4,452	478,778	資本財
MORGAN STANLEY	1,081	1,158	5,144	553,154	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	184	217	1,845	198,465	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,521	1,719	20,069	2,158,054	メディア・娯楽
DOVER CORP	120	138	1,346	144,735	資本財
OMNICOM GROUP	190	208	1,149	123,602	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	156	183	1,978	212,745	公益事業
DUKE ENERGY CORP	598	699	6,001	645,312	公益事業
FLOWSERVE CORP	108	108	290	31,221	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	100	112	895	96,308	消費者サービス
BANK OF AMERICA CORP	7,894	8,211	20,414	2,195,156	銀行
CITIGROUP	1,974	2,082	10,238	1,100,941	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	118	118	811	87,279	素材
EATON CORP	376	401	3,421	367,900	資本財
EATON VANCE CORP	100	100	381	41,013	各種金融
ECOLAB INC	217	247	5,234	562,889	素材

銘	柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
PERKINELMER INC		94	106	1,057	113,664	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SALESFORCE.COM INC		645	794	14,391	1,547,554	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO		534	592	3,614	388,673	資本財
ATMOS ENERGY CORP		93	114	1,161	124,851	公益事業
ENTERGY CORP		156	186	1,926	207,209	公益事業
EOG RESOURCES INC		498	555	2,869	308,538	エネルギー
EQUIFAX INC		107	117	1,815	195,254	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER CO-CL A		189	212	4,089	439,695	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	3,587	4,035	18,175	1,954,381	エネルギー	
FMC CORP		121	121	1,183	127,242	素材
NEXTERA ENERGY INC		409	466	11,718	1,260,133	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		32	36	1,100	118,368	各種金融
ASSURANT INC		47	58	602	64,755	保険
M & T BANK CORP		117	117	1,280	137,713	銀行
MACY’S INC		259	—	—	—	小売
FRANKLIN RESOURCES INC		260	260	492	53,010	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	1,124	1,389	1,262	135,793	素材	
ARTHUR J GALLAGHER & CO		149	178	1,676	180,252	保険
GAP		218	218	209	22,574	小売
GENERAL DYNAMICS CORP		210	239	3,549	381,710	資本財
GENERAL MILLS INC		502	576	3,571	384,079	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO		127	139	1,175	126,350	小売
GARTNER INC		81	85	1,043	112,183	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP		166	154	2,422	260,479	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	7,457	8,485	5,753	618,620	資本財	
GRAINGER (WW) INC		39	44	1,379	148,325	資本財
HALLIBURTON CO		766	976	1,182	127,119	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC		281	304	6,119	658,008	各種金融
HARLEY-DAVIDSON		146	146	344	37,009	自動車・自動車部品
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC		97	214	4,226	454,501	資本財
HEICO CORP		36	36	378	40,675	資本財
HELMERICH & PAYNE		83	—	—	—	エネルギー
HERSHEY FOODS CORPORATION		125	138	1,889	203,186	食品・飲料・タバコ
HP INC	1,340	1,415	2,124	228,474	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CROWN HOLDINGS INC		103	129	863	92,874	素材
JUNIPER NETWORKS INC		313	313	742	79,844	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP		141	141	444	47,747	エネルギー
UNUM GROUP		185	185	295	31,796	保険
HOME DEPOT		955	1,046	25,664	2,759,723	小売
HORMEL FOODS CORP		234	271	1,300	139,818	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC		427	481	867	93,323	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC		28	28	618	66,496	資本財
HUMANA INC		119	126	5,104	548,850	ヘルスケア機器・サービス
RED HAT INC		150	—	—	—	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP		69	69	1,089	117,106	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS		280	312	5,400	580,715	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		86	97	1,303	140,210	素材
INT’L PAPER CO		338	338	1,186	127,546	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS		338	338	590	63,449	メディア・娯楽
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		120	120	1,013	109,000	資本財
JOHNSON & JOHNSON	2,277	2,512	36,927	3,970,833	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	柄	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 (千円)		邦貨換算金額 (千円)
HARTFORD FINANCIAL SVCS		317	344	1,352	145,454	保険
DEVON ENERGY CORPORATION		378	378	441	47,470	エネルギー
KELLOGG CO		210	240	1,576	169,477	食品・飲料・タバコ
KEY CORP		870	943	1,140	122,622	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP		294	327	4,606	495,312	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC		99	145	7,809	839,803	各種金融
KOHL'S CORP		146	146	294	31,684	小売
KROGER CO		681	765	2,454	263,895	食品・生活必需品小売り
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC		—	35	1,295	139,264	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA		88	88	904	97,219	素材
LEGGETT & PLATT INC		105	105	340	36,613	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A		235	285	1,718	184,749	耐久消費財・アパレル
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN		257	257	383	41,241	各種金融
LILLY (ELI) & CO		755	824	12,416	1,335,170	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
L BRANDS INC		194	—	—	—	小売
LINCOLN NATIONAL CORP		177	177	699	75,198	保険
UNITED PARCEL SERVICE B		595	680	6,788	730,014	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES		273	295	2,562	275,551	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP		220	246	9,825	1,056,496	資本財
LOEWS CORP		220	257	868	93,377	保険
CARNIVAL CORPORATION		351	461	734	79,011	消費者サービス
LOWES COMPANIES		679	733	9,401	1,010,951	小売
DOMINION ENERGY INC		681	785	6,573	706,844	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL		446	586	1,010	108,674	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS		99	118	2,036	219,038	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP		651	720	13,598	1,462,294	消費者サービス
S&P GLOBAL INC		217	233	7,434	799,388	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD		33	39	802	86,336	保険
MANPOWER GROUP		51	51	387	41,618	商業・専門サービス
MARKEL CORP		11	13	1,220	131,288	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP		178	199	4,422	475,534	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS		425	481	5,134	552,071	保険
MASCO CORP		245	276	1,297	139,476	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS		49	59	1,180	126,987	素材
METLIFE INC		715	746	2,722	292,735	保険
MEDTRONIC PLC		1,136	1,278	12,547	1,349,189	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP		1,110	1,241	8,261	888,308	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO		2,205	2,428	19,191	2,063,692	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER		88	88	1,550	166,730	ヘルスケア機器・サービス
3 M COMPANY		491	558	8,760	941,992	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC		50	50	471	50,708	耐久消費財・アパレル
MOTOROLA SOLUTIONS INC		139	163	2,223	239,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN		87	96	1,469	157,966	運輸
FORD MOTOR COMPANY		3,155	3,751	2,194	235,986	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC		303	371	480	51,668	エネルギー
NEWMONT CORPORATION		694	782	4,594	494,089	素材
NVR INC		2	3	1,085	116,699	耐久消費財・アパレル
NIKE B		1,073	1,192	11,738	1,262,262	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC		382	—	—	—	エネルギー
NORDSTROM INC		100	100	182	19,667	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP		228	253	4,568	491,232	運輸

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種
			株 数 (百株)	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	
EVERSOURCE ENERGY	281	309	2,501	268,945	公益事業
NISOURCE INC	323	357	859	92,417	公益事業
TAPESTRY INC	259	259	363	39,096	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	142	155	5,331	573,333	資本財
WELLS FARGO & CO	3,634	3,867	10,526	1,131,916	銀行
NUCOR CORP	278	290	1,234	132,755	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	395	444	3,049	327,925	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	644	854	1,165	125,346	エネルギー
OGE ENERGY CORP	156	192	613	65,925	公益事業
ORACLE CORP	2,107	2,191	11,751	1,263,675	ソフトウェア・サービス
EXELON CORP	809	—	—	—	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	113	125	2,236	240,452	資本財
PPL CORPORATION	596	691	1,896	203,920	公益事業
PENTAIR PLC	135	135	534	57,430	資本財
PERRIGO CO PLC	113	113	623	67,061	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	4,674	5,277	20,151	2,166,859	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	208	895	96,264	公益事業
CONOCOPHILLIPS	968	1,047	4,504	484,399	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES	144	158	1,466	157,660	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,584	1,782	6,916	743,779	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	391	418	4,843	520,778	銀行
BROWN & BROWN INC	—	229	923	99,307	保険
POLARIS INC	46	46	416	44,807	耐久消費財・アパレル
FLUOR CORP	112	—	—	—	資本財
PPG INDUSTRIES INC	199	221	2,270	244,113	素材
QUEST DIAGNOSTICS	122	128	1,522	163,703	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,109	2,378	27,601	2,967,977	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	486	557	4,273	459,503	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	445	472	2,413	259,492	公益事業
PULTE GROUP INC	219	219	755	81,250	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	139	286	5,104	548,893	ソフトウェア・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	118	119	846	90,972	各種金融
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	32	51	865	93,118	保険
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	54	54	504	54,270	保険
RESMED INC	123	134	2,142	230,398	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,291	1,415	5,169	555,898	銀行
ROLLINS INC	105	145	583	62,776	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	87	101	3,861	415,235	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	105	112	2,433	261,642	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	138	152	790	85,007	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	—	124	922	99,242	素材
RAYTHEON COMPANY	246	—	—	—	資本財
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	40	40	196	21,160	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	538	605	12,216	1,313,668	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	220	240	2,587	278,226	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	272	586	8,113	872,425	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	1,190	1,322	2,485	267,229	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,018	1,101	3,966	426,517	各種金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	173	196	2,515	270,465	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	117	136	528	56,868	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	218	241	7,049	758,085	ヘルスケア機器・サービス

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末	業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価	額	
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
AMERISOURCEBERGEN CORP	128	146	1,378	148,242	ヘルスケア機器・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	72	79	4,678	503,109	素材
CENTENE CORP	359	557	3,728	400,965	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	121	121	565	60,849	資本財
ACUITY BRANDS INC	35	35	311	33,490	資本財
SNAP-ON INC	49	49	655	70,472	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	352	376	2,331	250,666	保険
ADVANCE AUTO PARTS	61	61	856	92,087	小売
EDISON INTL	289	336	1,950	209,705	公益事業
SOUTHERN CO	885	1,000	5,695	612,387	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	641	1,280	4,883	525,172	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	203	233	2,104	226,329	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	114	114	373	40,128	運輸
AT&T INC	6,160	6,966	21,638	2,326,812	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,617	1,803	16,388	1,762,206	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	132	147	1,871	201,274	資本財
STATE STREET CORP	323	347	2,169	233,338	各種金融
STRYKER CORP	290	321	6,281	675,426	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS	383	—	—	—	銀行
SYSCO CORP	428	454	2,542	273,362	食品・生活必需品小売り
TELEFLEX INC	36	44	1,586	170,558	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	806	1,084	1,401	150,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON	218	215	667	71,828	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	345	382	13,109	1,409,623	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	93	104	1,332	143,299	小売
GLOBE LIFE INC	84	98	760	81,781	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	142	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DAVITA INC	118	90	719	77,387	ヘルスケア機器・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	37	1,375	147,905	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	243	282	1,767	190,101	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	139	180	581	62,487	公益事業
MARATHON OIL CORP	745	745	424	45,685	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	621	674	11,497	1,236,325	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	701	1,470	9,889	1,063,374	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	816	903	27,464	2,953,268	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	72	72	777	83,588	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	82	82	1,021	109,874	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	287	324	1,910	205,397	耐久消費財・アパレル
VIACOMCBS INC-CLASS B	286	—	—	—	メディア・娯楽
VULCAN MATERIALS CO	107	126	1,396	150,214	素材
WALMART INC	1,227	1,356	16,776	1,803,984	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	367	412	4,391	472,198	商業・専門サービス
WATERS CORP	65	63	1,259	135,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	293	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	70	1,458	156,831	ヘルスケア機器・サービス
JM SMUCKER CO	94	108	1,203	129,465	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	35	35	713	76,681	消費者サービス
WABTEC CORP	111	177	1,092	117,436	資本財
WEYERHAEUSER CO	621	696	1,492	160,474	不動産
WHIRLPOOL CORP	53	60	739	79,532	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS	1,051	1,142	2,279	245,137	エネルギー

銘	柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種					
		株	数	株	数	評				価	額			
						外	貨					建	金	額
		株	(百株)	株	(百株)	外	貨	建	金	額	邦貨換算金額	(千円)		
WEC ENERGY GROUP INC		279		301		2,679		288,156		公益事業				
CARMAX INC		142		157		1,399		150,445		小売				
XEROX CORP		167	—	—		—		—		テクノロジー・ハードウェアおよび機器				
CIMAREX ENERGY CO		75	—	—		—		—		エネルギー				
TJX COMPANIES INC		1,068		1,155		6,247		671,832		小売				
CBRE GROUP INC-A		268		302		1,332		143,313		不動産				
WELLCARE HEALTH PLANS INC		44	—	—		—		—		ヘルスケア機器・サービス				
REGIONS FINL CORP		838		924		1,062		114,303		銀行				
DOMINO'S PIZZA INC		34		37		1,360		146,263		消費者サービス				
WESTLAKE CHEMICAL CORP		34		34		164		17,721		素材				
LAS VEGAS SANDS CORP		323		331		1,607		172,801		消費者サービス				
MOSAIC CO/THE		319		319		389		41,862		素材				
CELANESE CORP-SERIES A		110		110		1,020		109,748		素材				
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B		151		182		698		75,065		食品・飲料・タバコ				
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		210		190		557		59,962		素材				
AMERIPRISE FINANCIAL INC		118		118		1,702		183,030		各種金融				
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		495		531		5,041		542,121		各種金融				
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		159		159		144		15,521		耐久消費財・アパレル				
LIVE NATION ENTERTAINMENT		126		126		619		66,597		メディア・娯楽				
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		20		25		2,564		275,744		消費者サービス				
TRANSIDGM GROUP INC		40		46		2,023		217,564		資本財				
MASTERCARD INC-CLASS A		777		856		25,880		2,782,963		ソフトウェア・サービス				
HANESBRANDS INC		311		311		317		34,183		耐久消費財・アパレル				
WESTERN UNION CO		387		387		789		84,934		ソフトウェア・サービス				
OWENS CORNING		79		104		547		58,903		資本財				
LEIDOS HOLDINGS		109		128		1,338		143,964		ソフトウェア・サービス				
AERCAP HOLDINGS NV		113		113		367		39,509		資本財				
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		84		84		194		20,911		資本財				
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC		96		109		1,308		140,692		ソフトウェア・サービス				
DELTA AIR LINES INC		150		150		387		41,650		運輸				
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		76		76		100		10,854		エネルギー				
DISCOVER FINANCIAL SERVICES		295		290		1,438		154,680		各種金融				
TE CONNECTIVITY LTD		284		319		2,645		284,442		テクノロジー・ハードウェアおよび機器				
CONCHO RESOURCES INC		174		192		1,057		113,693		エネルギー				
WABCO HOLDINGS INC		38		49		679		73,088		資本財				
VMWARE INC-CLASS A		67		78		1,120		120,495		ソフトウェア・サービス				
INVESCO LTD		309		309		251		27,050		各種金融				
MSCI INC		79		79		2,552		274,424		各種金融				
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		1,331		1,484		10,909		1,173,071		食品・飲料・タバコ				
VISA INC-CLASS A SHARES		1,490		1,633		31,728		3,411,764		ソフトウェア・サービス				
AMERICAN WATER WORKS CO INC		161		169		2,093		225,123		公益事業				
MARATHON PETROLEUM CORP		577		620		2,184		234,907		エネルギー				
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC		128		128		783		84,204		資本財				
KINDER MORGAN INC		1,672		1,946		3,059		329,020		エネルギー				
XYLEM INC		160		175		1,195		128,591		資本財				
LYONDELLBASELL INDU-CL A		251		255		1,643		176,675		素材				
PVH CORP		72		72		359		38,647		耐久消費財・アパレル				
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC		35		35		706		76,001		資本財				
EPAM SYSTEMS INC		46		52		1,201		129,145		ソフトウェア・サービス				
HCA HEALTHCARE INC		229		259		2,845		305,924		ヘルスケア機器・サービス				
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		72		80		1,992		214,250		ソフトウェア・サービス				

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末	業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)		評 価 額	
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	141	158	1,728	185,827	銀行
CIT GROUP INC	107	—	—	—	銀行
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	134	1,058	113,778	ソフトウェア・サービス
TARGA RESOURCES CORP	200	200	366	39,402	エネルギー
LEAR CORP	52	52	569	61,188	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	223	245	4,523	486,420	小売
GENERAL MOTORS CO	1,063	1,209	3,226	346,924	自動車・自動車部品
WORLDPAY INC-CLASS A	257	—	—	—	ソフトウェア・サービス
XPO LOGISTICS INC	100	80	628	67,580	運輸
ALLY FINANCIAL INC	360	360	661	71,167	各種金融
CAPRI HOLDINGS LTD	115	115	189	20,325	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	232	244	1,801	193,676	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	381	424	3,334	358,522	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	79	799	85,962	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	58	58	490	52,723	食品・飲料・タバコ
IQVIA HOLDINGS INC	142	157	2,304	247,792	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SERVICENOW INC	149	179	6,802	731,514	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	80	93	2,147	230,950	ソフトウェア・サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	67	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,272	1,681	15,141	1,628,167	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC	417	454	6,276	674,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	178	178	286	30,824	消費者サービス
COTY INC-CL A	305	305	127	13,757	家庭用品・パーソナル用品
SPRINT CORP	648	—	—	—	電気通信サービス
IHS MARKIT LTD	—	356	2,465	265,092	商業・専門サービス
HOWMET AEROSPACE INC	365	365	485	52,193	資本財
TWILIO INC - A	80	112	2,159	232,197	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	579	673	1,228	132,137	メディア・娯楽
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	162	162	132	14,217	耐久消費財・アパレル
BLACK KNIGHT INC	—	144	1,084	116,640	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	444	576	944	101,592	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	129	129	770	82,854	食品・飲料・タバコ
ALTICE USA INC- A	124	124	314	33,768	メディア・娯楽
TECHNIPFMC PLC	360	550	422	45,424	エネルギー
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	70	1,829	196,731	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	107	107	439	47,242	運輸
BURLINGTON STORES INC	60	60	1,281	137,786	小売
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	236	360	770	82,903	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	102	123	2,516	270,627	ヘルスケア機器・サービス
TWITTER INC	613	704	2,227	239,500	メディア・娯楽
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	138	508	54,703	資本財
EVERGY INC	213	213	1,329	142,915	公益事業
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	98	—	—	—	エネルギー
ALLEGION PLC	74	89	895	96,292	資本財
STERIS PLC	72	81	1,320	141,998	ヘルスケア機器・サービス
KKR & CO INC	448	474	1,340	144,099	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	235	256	2,068	222,465	消費者サービス
ARAMARK	199	240	644	69,261	消費者サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	138	155	709	76,253	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOW INC	657	708	2,741	294,845	素材
AMCOR PLC	—	1,534	1,534	165,013	素材

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
PINTEREST INC- CLASS A	—	321	637	68,535	メディア・娯楽
XEROX HOLDINGS CORP	—	167	281	30,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KONTOOR BRANDS INC	41	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CARRIER GLOBAL CORP	—	755	1,480	159,230	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	—	377	1,925	206,996	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	157	384	1,313	141,190	運輸
CORTEVA INC	—	701	1,894	203,678	素材
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	629	3,567	383,581	各種金融
VOYA FINANCIAL INC	140	125	570	61,303	各種金融
GRUBHUB INC	82	82	436	46,929	小売
INGERSOLL-RAND INC	—	315	907	97,573	資本財
PAYCOM SOFTWARE INC	42	47	1,365	146,851	ソフトウェア・サービス
AON PLC	—	223	4,440	477,489	保険
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	204	—	—	—	エネルギー
ARISTA NETWORKS INC	43	49	1,101	118,414	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PNF GROUP	249	249	755	81,219	保険
SYNCHRONY FINANCIAL	530	530	1,127	121,265	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	400	400	986	106,094	銀行
WAYFAIR INC- CLASS A	53	—	—	—	小売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	158	176	1,826	196,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	152	—	—	—	電気通信サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	176	176	410	44,148	素材
GODADDY INC - CLASS A	149	163	1,250	134,504	ソフトウェア・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	275	348	509	54,748	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	693	750	2,366	254,434	資本財
TRANSUNION	153	169	1,448	155,780	商業・専門サービス
SQUARE INC - A	279	331	2,642	284,123	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	1,932	707	3,572	384,202	素材
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	170	226	890	95,775	食品・飲料・タバコ
WESTROCK CO	212	247	714	76,784	素材
FORTIVE CORP	258	285	1,754	188,615	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	230	246	2,319	249,448	商業・専門サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,297	1,237	1,187	127,642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EQUITABLE HOLDINGS INC	226	402	790	84,972	各種金融
FIRST DATA CORP- CLASS A	476	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DXC TECHNOLOGY CO	234	234	389	41,868	ソフトウェア・サービス
CHEMOURS CO/THE	154	—	—	—	素材
LINDE PLC	472	512	10,250	1,102,252	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	133	133	391	42,137	保険
VISTRA ENERGY CORP	295	350	730	78,514	公益事業
CHENIERE ENERGY INC	184	219	973	104,637	エネルギー
AMAZON.COM	355	403	96,797	10,408,683	小売
ABIOMED INC	35	44	960	103,330	ヘルスケア機器・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	784	1,009	5,223	561,717	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	412	461	17,536	1,885,726	ソフトウェア・サービス
AMGEN	539	566	12,702	1,365,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	6	6	198	21,396	運輸
ANALOG DEVICES	322	351	3,901	419,524	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	190	207	2,371	255,004	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	3,839	4,329	17,124	1,841,399	メディア・娯楽
ANSYS INC	68	80	2,212	237,953	ソフトウェア・サービス

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期末		業種
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
APPLE INC	4,025	4,242	135,029	14,519,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	807	881	4,820	518,310	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	182	209	4,247	456,780	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	367	412	5,978	642,852	ソフトウェア・サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	114	131	1,066	114,650	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	95	107	1,441	154,992	メディア・娯楽
VERISIGN INC	95	100	2,148	230,998	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,295	1,484	843	90,670	メディア・娯楽
CSX CORP	685	717	5,115	550,050	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	228	228	1,172	126,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	108	119	1,291	138,876	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	594	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITRIX SYSTEMS INC	113	124	1,756	188,911	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	257	300	2,126	228,688	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	124	148	899	96,725	保険
CINTAS CORP	79	82	2,082	223,901	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	3,746	4,045	18,447	1,983,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COPART INC	175	197	1,763	189,591	商業・専門サービス
COGNEX CORP	162	162	1,023	110,018	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARRIOTT INTL A	250	265	2,437	262,098	消費者サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	483	522	2,808	301,975	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	30	35	2,306	247,988	商業・専門サービス
DOLLAR TREE INC	196	226	2,211	237,818	小売
EBAY	786	739	3,269	351,586	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	211	211	963	103,613	各種金融
CADENCE DESIGN SYSTEMS	252	263	2,322	249,690	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	182	241	751	80,825	メディア・娯楽
ELECTRONIC ARTS INC	268	278	3,382	363,747	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	378	40,649	保険
EXPEDITORS INTL WASH INC	138	158	1,200	129,097	運輸
FASTENAL CO	469	558	2,253	242,317	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	582	679	1,367	147,063	銀行
FISERV INC	337	551	5,856	629,702	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	116	116	524	56,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	404	489	486	52,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	178	201	948	102,006	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,113	1,206	9,089	977,406	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP	489	554	18,824	2,024,235	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	106	124	915	98,486	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	124	140	866	93,142	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	53	53	761	81,834	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	244	244	1,279	137,605	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	161	171	1,813	194,979	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	71	83	988	106,343	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	856	990	901	96,938	銀行
NEKTAR THERAPEUTICS	135	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	172	172	5,174	556,361	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	221	248	7,050	758,138	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	72	81	2,508	269,764	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	112	128	723	77,786	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	3,864	4,148	25,595	2,752,337	半導体・半導体製造装置

銘柄	当期首(前期末) 株数 (百株)	当 期 末 株数 (百株)	評価額		業 種
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	72	73	1,309	140,762	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	161	175	1,760	189,255	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP	138	150	2,632	283,045	半導体・半導体製造装置
EAST WEST BANCORP INC	138	138	504	54,239	銀行
LAM RESEARCH CORP	128	138	3,695	397,372	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	141	154	1,589	170,935	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	246	258	1,462	157,276	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC	613	733	5,148	553,591	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	359	359	578	62,162	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	6,186	6,920	125,541	13,499,477	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	952	1,056	4,909	527,914	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	43	43	306	32,904	資本財
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	207	228	2,180	234,415	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	547	605	1,815	195,239	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	426	494	853	91,781	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	127	140	5,233	562,780	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	449	500	3,204	344,597	公益事業
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	84	1,018	109,545	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	205	205	908	97,730	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	375	375	510	54,851	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	—	672	639	68,812	エネルギー
NORTHERN TRUST CORP	173	195	1,560	167,750	各種金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE	52	91	1,509	162,326	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	70	72	2,989	321,495	小売
PACCAR INC	300	323	2,397	257,791	資本財
EXELON CORP	—	928	3,550	381,804	公益事業
PAYCHEX INC	276	302	2,177	234,181	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	62	71	1,772	190,588	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	1,193	1,329	17,593	1,891,816	食品・飲料・タバコ
GARMIN LTD	95	127	1,159	124,716	耐久消費財・アパレル
IPG PHOTONICS CORP	32	32	488	52,475	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	375	421	13,043	1,402,613	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	200	218	2,631	282,949	各種金融
QUALCOMM	1,026	1,089	8,508	914,946	半導体・半導体製造装置
EXACT SCIENCES CORP	107	132	1,113	119,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGENERON PHARMACEUTICALS	69	77	4,467	480,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEATTLE GENETICS INC	96	114	1,738	186,933	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	345	387	1,126	121,147	保険
ROSS STORES INC	318	343	3,373	362,732	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,222	1,373	7,061	759,347	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	109	120	2,471	265,716	保険
BOOKING HOLDINGS INC	39	40	6,595	709,263	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	108	122	661	71,102	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	231	266	1,085	116,765	保険
SVB FINANCIAL GROUP	43	49	1,065	114,595	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	63	78	2,120	228,068	メディア・娯楽
STARBUCKS CORP	1,045	1,133	8,902	957,329	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	182	182	492	52,973	素材
NETFLIX INC	368	417	17,280	1,858,222	メディア・娯楽
NORTONLIFELOCK INC	583	596	1,248	134,263	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	122	143	2,499	268,737	ソフトウェア・サービス

銘柄	柄	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
INTUITIVE SURGICAL INC		98	110	6,312	678,763	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC		—	160	1,036	111,407	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS		810	891	10,332	1,111,001	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY		113	112	1,334	143,445	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS		206	238	1,002	107,840	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VIACOMCBS INC-CLASS B		—	539	1,144	123,045	メディア・娯楽
VERTEX PHARMACEUTICALS INC		216	245	6,805	731,797	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		674	724	3,029	325,784	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP		235	284	1,241	133,462	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC		145	161	1,859	199,992	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD		80	93	773	83,220	消費者サービス
NASDAQ INC		90	109	1,277	137,383	各種金融
CME GROUP INC		307	341	6,171	663,581	各種金融
LKQ CORP		246	293	813	87,455	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION		192	241	1,180	126,913	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP		234	258	974	104,818	各種金融
XILINX INC		221	235	2,098	225,690	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A		46	51	1,328	142,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION		151	151	516	55,552	銀行
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		73	106	1,419	152,640	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK		43	52	556	59,841	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-A		155	155	327	35,237	メディア・娯楽
MARKETAXESS HOLDINGS INC		32	35	1,737	186,806	各種金融
DEXCOM INC		78	85	3,096	332,971	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY INC - A		128	128	281	30,241	メディア・娯楽
EXPEDIA GROUP INC		111	133	1,054	113,370	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-C		462	421	866	93,133	メディア・娯楽
VIACOM INC-CLASS B		318	—	—	—	メディア・娯楽
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC		60	60	173	18,648	運輸
QURATE RETAIL INC		350	—	—	—	小売
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR		176	176	282	30,406	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC		367	367	427	45,921	銀行
INSULET CORP		—	59	1,093	117,559	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC		84	105	3,013	324,064	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC		37	42	3,540	380,682	小売
ULTA BEAUTY INC		49	53	1,304	140,286	小売
DISCOVERY INC-C		236	311	620	66,752	メディア・娯楽
ALKERMES PLC		125	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SPLUNK INC		131	147	2,655	285,530	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC		134	145	2,451	263,559	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		49	49	590	63,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV		250	270	2,686	288,897	半導体・半導体製造装置
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		206	217	1,258	135,336	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC		129	138	1,871	201,257	ソフトウェア・サービス
TESLA INC		108	129	10,407	1,119,155	自動車・自動車部品
TRIPADVISOR INC		103	103	219	23,625	メディア・娯楽
FACEBOOK INC-A		2,036	2,297	51,802	5,570,284	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC		134	204	881	94,771	エネルギー
SAREPTA THERAPEUTICS INC		—	71	1,093	117,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORKDAY INC-CLASS A		125	156	2,860	307,593	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC		282	410	4,070	437,732	電気通信サービス

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
PTC INC		99	99	747	80,411	ソフトウェア・サービス
NEWS CORP-CLASS A		334	334	397	42,749	メディア・娯楽
HD SUPPLY HOLDINGS INC		152	152	487	52,392	資本財
CDW CORP/DE		124	137	1,506	162,027	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		99	99	108	11,712	運輸
IHS MARKIT LTD		327	—	—	—	商業・専門サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C		186	186	638	68,703	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A		63	63	229	24,630	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C		152	152	546	58,804	メディア・娯楽
OKTA INC		86	100	1,854	199,410	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC		337	378	10,713	1,152,047	半導体・半導体製造装置
MONGODB INC		26	46	996	107,177	ソフトウェア・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		104	—	—	—	保険
COMMSCOPE HOLDING CO INC		149	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOCUSIGN INC		86	101	1,292	139,017	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD		39	50	1,039	111,731	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A		162	242	547	58,825	ソフトウェア・サービス
FOX CORP - CLASS A		302	339	982	105,669	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B		121	150	432	46,510	メディア・娯楽
SABRE CORP		241	241	177	19,136	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT		—	20	21	2,317	メディア・娯楽
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL		31	31	316	34,060	ソフトウェア・サービス
CDK GLOBAL INC		106	106	423	45,553	ソフトウェア・サービス
QORVO INC		106	106	1,069	114,956	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-C		86	102	1,357	145,933	メディア・娯楽
KRAFT HEINZ CO/THE		530	641	1,950	209,752	食品・飲料・タバコ
MATCH GROUP INC		—	46	409	43,988	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A		252	285	40,523	4,357,478	メディア・娯楽
PAYPAL HOLDINGS INC		944	1,064	15,831	1,702,366	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC-C		99	123	709	76,298	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL C		266	294	41,773	4,491,926	メディア・娯楽
BEIGENE LTD-ADR		23	38	626	67,372	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MONSTER BEVERAGE CORP		349	376	2,667	286,826	食品・飲料・タバコ
ROKU INC		—	83	912	98,106	メディア・娯楽
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		136	143	7,669	824,680	メディア・娯楽
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD		339	339	145	15,674	食品・生活必需品小売り
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		987	987	362	38,950	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		201	201	804	86,454	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		205	205	410	44,109	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC		94	106	1,089	117,111	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	258,018 616	286,867 608	2,465,787 —	265,146,182 <66.3%>	
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES		214	234	2,049	159,900	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B		361	841	3,606	281,324	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP		1,490	1,709	5,642	440,173	素材
ATCO LTD -CLASS I		52	52	204	15,928	公益事業
BANK MONTREAL		553	615	4,269	333,090	銀行
BANK NOVA SCOTIA		1,060	1,169	6,705	523,080	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA		282	332	2,053	160,166	銀行
BCE INC		125	153	875	68,277	電気通信サービス

銘柄	当期首(前期末)	株数 (百株)	当 期 末		業 種
			株数 (百株)	評 価 額	
				外貨建金額 邦貨換算金額 (千円)	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC, CLASS-A	733	1,265	5,549	432,924	各種金融
BAUSCH HEALTH COS INC	—	278	711	55,539	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER B	1,513	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	204	244	840	65,602	食品・飲料・タバコ
BLACKBERRY LIMITED	394	394	249	19,425	ソフトウェア・サービス
CGI INC - CL A	211	233	2,068	161,395	ソフトウェア・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	131	593	46,328	素材
CAE INC	259	259	559	43,626	資本財
CAMECO CORP	287	410	598	46,671	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	320	350	2,016	157,294	電気通信サービス
CANADIAN IMPERIAL BANK	379	429	3,863	301,353	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,033	1,223	3,083	240,574	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A	54	54	640	49,968	小売
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	341	26,633	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	611	698	8,311	648,352	運輸
FIRST CAPITAL REALTY INC	124	—	—	—	不動産
GILDAN ACTIVEWEAR INC	176	176	342	26,752	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	246	246	1,388	108,288	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	114	152	473	36,910	食品・生活必需品小売り
VERMILION ENERGY INC	100	—	—	—	エネルギー
FORTIS INC	384	426	2,274	177,431	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	569	569	467	36,486	素材
TELUS CORP	164	329	778	60,738	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC	237	237	534	41,697	保険
IMPERIAL OIL	247	247	547	42,672	エネルギー
ENBRIDGE	1,738	1,939	8,642	674,206	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	250	19,531	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,729	1,901	3,294	257,018	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	156	179	1,221	95,270	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	279	279	1,624	126,741	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	539	569	2,740	213,756	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	23	26	1,023	79,843	保険
METRO INC	191	249	1,423	111,020	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	314	314	131	10,276	エネルギー
EMERA INC	40	237	1,303	101,684	公益事業
METHANEX CORP	70	70	166	12,991	素材
ONEX CORP	66	66	430	33,610	各種金融
TC ENERGY CORP	763	885	5,436	424,092	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	297	515	1,170	91,328	保険
POWER FINANCIAL CORP	207	—	—	—	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	452	35,287	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA	1,234	1,372	12,533	977,730	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	147	—	—	—	資本財
CP RAILWAY LIMITED	118	131	4,551	355,084	運輸
ENCANA CORP	1,386	—	—	—	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	359	450	1,048	81,775	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY	1,344	1,473	3,538	276,065	エネルギー
LUNDIN MINING CORP	622	622	407	31,755	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B	456	456	606	47,320	素材
THOMSON REUTERS CORP	161	187	1,750	136,532	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	1,543	1,734	10,457	815,769	銀行

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
WEST FRASER TIMBER CO LTD		43	43	169	13,252	素材
WESTON (GEORGE) LTD		68	68	680	53,114	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP		1,076	1,253	1,136	88,684	素材
INTACT FINANCIAL CORP		111	130	1,735	135,355	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		368	455	2,708	211,273	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC		17	19	3,044	237,498	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		167	182	3,549	276,900	素材
CI FINANCIAL CORP		186	186	307	23,959	各種金融
TOURMALINE OIL CORP		199	—	—	—	エネルギー
KEYERA CORP		149	186	396	30,932	エネルギー
PARKLAND CORP		—	110	415	32,445	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD		314	243	379	29,592	公益事業
PEMBINA PIPELINE CORP		422	538	1,859	145,089	エネルギー
DOLLARAMA INC		267	267	1,237	96,520	小売
ALGONQUIN POWER & UTILITIES		—	518	1,005	78,421	公益事業
CENOVUS ENERGY INC		966	966	582	45,471	エネルギー
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		170	268	1,400	109,223	素材
INTER PIPELINE LTD		303	354	439	34,296	エネルギー
STARS GROUP INC/THE		118	—	—	—	消費者サービス
NUTRIEN LTD		514	555	2,633	205,452	素材
CRONOS GROUP INC		159	159	148	11,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WSP GLOBAL INC		94	94	840	65,593	資本財
IA FINANCIAL CORP INC		82	82	366	28,595	保険
OVINTIV INC		—	234	270	21,069	エネルギー
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		183	183	169	13,198	エネルギー
AIR CANADA		—	115	185	14,467	運輸
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		213	254	1,903	148,490	消費者サービス
AURORA CANNABIS INC		530	44	93	7,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHOPIFY INC - CLASS A		83	98	10,081	786,475	ソフトウェア・サービス
CANOPY GROWTH CORP		164	164	501	39,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYDRO ONE LTD		322	322	844	65,913	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	34,068 85	35,565 82	164,934 —	12,866,555 <3.2%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		150	172	4,133	492,395	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG		804	804	302	36,084	銀行
FRESENIUS SE&CO KGAA		367	404	1,743	207,710	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		95	95	350	41,795	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF		57	57	209	24,958	素材
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE		47	57	851	101,446	保険
GEA GROUP AG		133	133	362	43,170	資本財
CONTINENTAL AG		99	99	919	109,520	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		849	917	2,655	316,344	運輸
AXEL SPRINGER SE		38	—	—	—	メディア・娯楽
MERCK KGAA		104	120	1,277	152,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM		428	564	1,704	203,029	公益事業
SAP SE		842	938	10,572	1,259,537	ソフトウェア・サービス
E.ON SE		1,832	2,161	2,183	260,064	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		86	101	735	87,646	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE		7	77	498	59,393	耐久消費財・アパレル
BAYER		783	941	5,926	706,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
HENKEL AG & CO KGAA -PFD		157	172	1,371	163,422	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE		772	880	4,448	529,953	素材
BEIERSDORF AG		91	91	878	104,597	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG		13	22	184	21,930	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG		138	148	683	81,478	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA		179	199	1,511	180,037	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG		357	398	6,651	792,448	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		232	232	227	27,086	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.		126	138	2,881	343,255	保険
VOLKSWAGEN STAMM		25	32	483	57,590	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD		159	179	2,469	294,229	自動車・自動車部品
DAIMLER AG		785	874	3,064	365,118	自動車・自動車部品
THYSSEN KRUPP		330	330	206	24,626	素材
SIEMENS		656	731	7,251	863,860	資本財
I&I DRILLISCH AG		37	—	—	—	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK NAMEN		1,611	1,905	1,491	177,728	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		289	319	1,726	205,682	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		49	49	210	25,103	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM		2,794	3,193	4,576	545,181	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		32	32	1,012	120,649	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES		998	1,222	2,365	281,815	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR		34	34	313	37,367	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE		156	182	2,738	326,206	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE		140	140	712	84,861	自動車・自動車部品
FRAPORT AG		35	35	163	19,488	運輸
WIRECARD AG		98	113	1,068	127,271	ソフトウェア・サービス
LANXESS		72	72	352	41,937	素材
MTU AERO ENGINES AG		47	47	723	86,179	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE		290	337	1,364	162,520	不動産
SYMRISE AG		115	124	1,220	145,416	素材
BRENNTAG AG		116	152	731	87,189	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		134	197	452	53,937	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		669	669	190	22,688	電気通信サービス
HUGO BOSS AG		48	—	—	—	耐久消費財・アパレル
KION GROUP AG		58	58	305	36,412	資本財
VONOVIA SE		439	495	2,573	306,559	不動産
KNORR-BREMSE AG		41	41	394	47,039	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG		125	148	684	81,541	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG		137	137	119	14,201	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE		110	—	—	—	公益事業
ZALANDO SE		91	139	845	100,761	小売
COVESTRO AG		161	150	528	62,969	素材
UNIPER SE		147	201	579	69,085	公益事業
DELIVERY HERO SE		86	114	986	117,467	小売
国 小 計	株 数 銘 柄 数	19,932 61	22,405 57	95,175 —	11,338,246 <2.8%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		896	1,093	1,396	166,352	保険
INTESA SANPAOLO		12,867	14,606	2,276	271,212	銀行
UNICREDIT SPA		1,771	1,853	1,420	169,247	銀行
MEDIOBANCA		539	539	319	38,089	銀行

銘	柄	当期首(前期末)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価	額	
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
LEONARDO SPA		354	354	206	24,603	資本財
ENEL		6,812	7,846	5,329	634,861	公益事業
ENI		2,162	2,484	2,110	251,383	エネルギー
SNAM SPA		2,053	2,036	853	101,626	公益事業
TELECOM ITALIA ORD		8,525	8,525	285	34,044	電気通信サービス
TELECOM ITALIA RNC		4,701	4,701	162	19,322	電気通信サービス
ATLANTIA SPA		420	514	766	91,284	運輸
TERNA SPA		1,302	1,302	779	92,868	公益事業
RECORDATI SPA		74	114	479	57,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PRYSMIAN SPA		256	211	406	48,387	資本財
MONCLER SPA		157	157	548	65,368	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA		441	531	562	67,047	銀行
POSTE ITALIANE SPA		460	460	362	43,215	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		425	644	476	56,784	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA		390	390	161	19,259	自動車・自動車部品
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	44,615	48,369	18,904	2,252,059	
(フランス)		19	19	—	<0.6%>	
BOUYGUES ORD		168	193	537	64,024	資本財
AIR LIQUIDE		362	453	5,456	650,033	素材
VEOLIA ENVIRONNEMENT		457	526	1,053	125,484	公益事業
LOREAL		211	240	6,255	745,244	家庭用品・パーソナル用品
LVMH		234	265	10,279	1,224,608	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA		2	2	161	19,259	資本財
THALES SA		96	96	686	81,748	資本財
CAPGEMINI SA		132	154	1,435	171,024	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON		36	58	198	23,678	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP		46	62	774	92,297	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE		176	214	575	68,543	メディア・娯楽
FAURECIA		59	59	215	25,722	自動車・自動車部品
BOLLORE		618	618	167	19,923	メディア・娯楽
MICHELIN		153	164	1,550	184,664	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD		184	199	2,855	340,145	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA		173	173	380	45,296	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU		15	23	263	31,384	食品・飲料・タバコ
SEB SA		20	20	254	30,281	耐久消費財・アパレル
VINCI S. A.		430	494	4,148	494,196	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE		477	530	4,693	559,148	資本財
VIVENDI		773	773	1,591	189,625	メディア・娯楽
TOTAL SA		2,039	2,295	7,877	938,426	エネルギー
VALEO SA		193	193	421	50,252	自動車・自動車部品
ORANGE		1,768	1,881	2,027	241,568	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		26	30	2,282	271,897	耐久消費財・アパレル
SOCIETE BIC SA		24	—	—	—	商業・専門サービス
DASSAULT SYSTEMES SA		117	125	1,872	223,114	ソフトウェア・サービス
KERING		63	72	3,498	416,825	耐久消費財・アパレル
CNP ASSURANCES		118	118	122	14,558	保険
CARREFOUR		537	592	790	94,206	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		76	97	655	78,146	ソフトウェア・サービス
SANOFI		966	1,079	9,553	1,138,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR		179	179	469	55,966	消費者サービス

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
SOCIETE GENERALE		637	790	1,100	131,093	銀行
TELEPERFORMANCE		45	57	1,286	153,300	商業・専門サービス
EURAZEO SA		33	33	153	18,300	各種金融
SODEXO		81	81	509	60,744	消費者サービス
AXA		1,656	1,859	3,148	375,079	保険
PEUGEOT SA		528	528	710	84,608	自動車・自動車部品
JC DECAUX SA		46	95	177	21,178	メディア・娯楽
ESSILORLUXOTTICA		250	272	3,264	388,946	耐久消費財・アパレル
CREDIT AGRICOLE SA		928	1,074	859	102,365	銀行
BNP PARIBAS		943	1,101	3,712	442,320	銀行
SAINT-GOBAIN		407	453	1,308	155,833	資本財
WENDEL		20	20	174	20,750	各種金融
ILIAD SA		20	12	196	23,353	電気通信サービス
IMERYS SA		30	—	—	—	素材
DANONE (GROUPE)		523	592	3,687	439,272	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA		289	315	2,805	334,250	資本財
ENGIE		1,620	1,710	1,856	221,199	公益事業
ALSTOM		138	187	736	87,741	資本財
EUTELSAT COMMUNICATIONS		119	119	114	13,653	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE		497	613	489	58,366	公益事業
IPSEN		27	27	196	23,396	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA		53	75	596	71,021	素材
LEGRAND SA		217	245	1,494	178,064	資本財
EIFFAGE		60	72	594	70,851	資本財
ADP		23	23	225	26,844	運輸
NATIXIS		699	699	148	17,677	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT		68	93	631	75,205	メディア・娯楽
SCOR SE		133	133	315	37,576	保険
BUREAU VERITAS SA		195	250	470	56,005	商業・専門サービス
GETLINK		364	441	568	67,720	運輸
SUEZ		280	280	287	34,192	公益事業
EDENRED		189	227	868	103,503	ソフトウェア・サービス
BIOMERIEUX		32	41	519	61,872	ヘルスケア機器・サービス
WORLDLINE SA		70	127	825	98,357	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		30	30	693	82,667	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA		47	62	420	50,139	各種金融
国 小 計		22,257	24,744	108,258	12,896,893	
銘 柄 数 <比 率>		69	67	—	<3.2%>	
(オランダ)						
AIRBUS SE		489	561	3,373	401,843	資本財
RANDSTAD NV		95	123	484	57,772	商業・専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD NV		982	1,032	2,342	279,005	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL		197	195	1,476	175,903	素材
UNILEVER NV-CVA		1,231	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
WOLTERS KLUWER		228	257	1,783	212,429	商業・専門サービス
QIAGEN N.V.		218	218	859	102,431	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KONINKLIJKE DSM NV		152	171	1,986	236,707	素材
VOPAK		63	63	310	36,936	エネルギー
AEGON		1,662	1,662	418	49,914	保険
ASML HOLDING NV		352	407	12,006	1,430,341	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)		2,615	3,543	778	92,738	電気通信サービス

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
STMICROELECTRONICS		575	662	1,471	175,254	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS		806	872	3,573	425,753	ヘルスケア機器・サービス
ING GROEP NV-CVA		3,320	3,778	2,283	272,090	銀行
HEINEKEN NV		226	243	2,049	244,213	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV		107	107	814	97,076	食品・飲料・タバコ
UNILEVER NV		—	1,405	6,499	774,243	家庭用品・パーソナル用品
FERRARI NV		99	112	1,710	203,769	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV		930	930	538	64,143	資本財
PROSUS		—	458	3,417	407,172	小売
NN GROUP NV		276	276	791	94,240	保険
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		963	1,113	918	109,465	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY		—	113	1,101	131,247	小売
ABN AMRO BANK NV-CVA		331	531	395	47,117	銀行
EXOR NV		103	103	510	60,794	各種金融
ALTICE NV -A		—	500	182	21,681	メディア・娯楽
ADYEN NV		8	10	1,170	139,382	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	16,040 24	19,456 27	53,250 —	6,343,674 <1.6%>	
(スペイン)						
IBERDROLA SA		5,208	5,905	5,679	676,599	公益事業
ENDESA		247	317	688	81,964	公益事業
BANKINTER SA		588	588	234	27,917	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA		5,561	6,474	1,897	226,064	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		322	301	506	60,357	公益事業
REPSOL SA		1,246	1,330	1,179	140,551	エネルギー
BANCO SANTANDER SA		13,663	15,998	3,411	406,425	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		396	396	633	75,470	公益事業
TELEFONICA		4,100	4,381	1,900	226,455	電気通信サービス
INDITEX		938	1,019	2,585	307,974	小売
ENAGAS		182	252	529	63,020	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY		174	251	372	44,407	資本財
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS		208	220	522	62,217	資本財
GRIFOLS SA		276	276	759	90,467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERROVIAL SA		390	460	1,143	136,199	資本財
MAPFRE SA		909	909	150	17,962	保険
BANCO DE SABADELL SA		4,429	4,496	133	15,925	銀行
CAIXABANK		2,863	3,286	580	69,172	銀行
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		365	418	2,025	241,348	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		1,100	1,100	91	10,949	銀行
FERROVIAL SA-RTS		—	460	15	1,828	資本財
AENA SME SA		56	65	863	102,873	運輸
CELLNEX TELECOM SA		165	246	1,220	145,340	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	43,396 22	49,159 23	27,125 —	3,231,493 <0.8%>	
(ベルギー)						
UMICORE		176	176	711	84,730	素材
KBC GROEP NV		227	240	1,202	143,253	銀行
SOLVAY SA		69	69	503	60,008	素材
UCB (GROUPE)		104	124	1,098	130,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		41	54	291	34,737	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		62	82	605	72,168	各種金融

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
AGEAS		160	160	513	61,146	保険
PROXIMUS		131	131	253	30,206	電気通信サービス
GALAPAGOS NV		—	43	815	97,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELENET GROUP HOLDING NV		49	49	185	22,089	メディア・娯楽
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		640	728	3,160	376,460	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,662 10	1,860 11	9,340 —	1,112,714 <0.3%>	
(オーストリア)						
OMV AG		121	149	468	55,800	エネルギー
VERBUND AG		74	74	294	35,135	公益事業
VOESTALPINE AG		81	124	226	27,006	素材
ERSTE GROUP BANK AG		275	275	569	67,798	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		124	124	206	24,550	銀行
ANDRITZ AG		52	52	169	20,245	資本財
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	730 6	801 6	1,935 —	230,538 <0.1%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		9	11	692	82,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		406	406	237	28,260	エネルギー
SES		313	313	210	25,037	メディア・娯楽
ARCELORMITTAL		539	662	592	70,622	素材
RTL GROUP		35	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA		592	1,113	580	69,108	不動産
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,897 6	2,507 5	2,312 —	275,469 <0.1%>	
(フィンランド)						
WARTSILA OYJ		343	343	253	30,231	資本財
UPM KYMMENE OYJ		439	506	1,319	157,220	素材
STORA ENSO OYJ R		472	547	598	71,311	素材
SAMPO OYJ-A SHS		399	430	1,432	170,623	保険
FORTUM OYJ		383	419	719	85,656	公益事業
ELISA A		117	155	847	100,967	電気通信サービス
METSO OYJ		95	95	282	33,623	資本財
NOKIA OYJ		4,898	5,456	1,952	232,639	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		332	401	1,472	175,394	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ		102	102	229	27,353	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B		301	322	1,999	238,235	資本財
ORION OYJ-CLASS B		79	98	462	55,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,966 12	8,880 12	11,569 —	1,378,313 <0.3%>	
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC		118	153	846	100,834	資本財
CRH PLC		711	800	2,356	280,776	素材
KERRY GROUP PLC-A		131	146	1,601	190,813	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		195	195	575	68,571	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC		840	840	143	17,071	銀行
AIB GROUP PLC		702	702	73	8,764	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		71	72	859	102,343	消費者サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,769 7	2,909 7	6,456 —	769,175 <0.2%>	

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
(ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		2,359	2,359	987	117,672	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		398	491	542	64,582	エネルギー
JERONIMO MARTINS		202	249	384	45,831	食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,960 3	3,100 3	1,914 —	228,087 <0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	164,230 239	184,195 237	336,243 —	40,056,666 <10.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC		358	358	315	41,846	素材
ASHTHEAD GROUP PLC		420	420	1,038	137,666	資本財
SEVERN TRENT PLC		181	250	608	80,578	公益事業
BHP GROUP PLC		1,796	2,028	3,224	427,395	素材
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		964	964	513	68,016	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC		277	332	640	84,823	資本財
AVIVA PIC		3,480	3,812	998	132,337	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC		99	134	699	92,689	素材
DIAGEO		2,046	2,245	6,632	878,946	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC		86	117	353	46,813	各種金融
DCC PLC		91	91	610	80,922	資本財
BAE SYSTEMS PLC		2,820	3,087	1,577	209,091	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO		1,972	2,193	7,180	951,569	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC		323	371	864	114,548	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC		2,335	2,547	998	132,386	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		832	914	1,375	182,275	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC		181	168	370	49,056	素材
ANGLO AMERICAN PLC		874	960	1,644	217,915	素材
COMPASS GROUP PLC		1,363	1,517	1,941	257,296	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)		16,939	19,413	7,461	988,905	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP		4,900	5,501	1,145	151,809	保険
UNILEVER PLC		932	1,062	4,598	609,485	家庭用品・パーソナル用品
MEGGITT PLC		662	662	195	25,908	資本財
MORRISON SUPERMARKETS		1,681	2,093	389	51,610	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC		588	671	604	80,096	公益事業
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP		865	865	349	46,334	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		288	367	688	91,283	食品・飲料・タバコ
PEARSON		663	663	305	40,483	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC		263	315	737	97,706	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL		2,173	2,468	2,671	354,091	保険
RIO TINTO PLC REG		971	1,078	4,624	612,896	素材
VODAFONE GROUP PLC		23,093	25,147	3,373	447,058	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER PLC		609	679	4,847	642,474	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		1,713	1,859	3,594	476,444	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC		1,577	1,810	895	118,615	商業・専門サービス
ROYAL BANK OF SCOTLAND		3,955	4,790	565	74,953	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC		447	447	424	56,282	各種金融
SSE PLC		932	1,003	1,234	163,588	公益事業
BP PLC		16,948	19,381	6,084	806,407	エネルギー
SAGE GROUP PLC		893	1,113	771	102,240	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC		371	371	497	65,967	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC		59,687	66,371	2,082	276,023	銀行

銘	柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種	
		株	数 (百株)	株	数 (百株)	評	価			額
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)			
TAYLOR WIMPEY PLC		2,705		2,705		418		55,496	耐久消費財・アパレル	
TESCO		8,563		9,196		2,152		285,308	食品・生活必需品小売り	
3I GROUP PLC		792		881		736		97,563	各種金融	
SMITH & NEPHEW PLC		710		830		1,414		187,444	ヘルスケア機器・サービス	
GLAXOSMITHKLINE		4,254		4,775		8,039		1,065,440	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIR GROUP PLC/THE		185		185		185		24,602	資本財	
WPP PLC		1,130		1,130		712		94,432	メディア・娯楽	
ASTRAZENECA		1,086		1,255		10,915		1,446,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC		7,302		8,172		970		128,614	電気通信サービス	
CARNIVAL PLC		137		267		316		41,929	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC		2,831		3,340		3,097		410,479	公益事業	
MARKS & SPENCER GROUP PLC		1,352		2,052		206		27,389	小売	
BARCLAYS		14,716		16,694		2,047		271,300	銀行	
INTERTEK GROUP PLC		147		154		873		115,752	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC		353		404		639		84,804	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC		112		132		672		89,160	小売	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		1,490		1,490		475		63,003	資本財	
KINGFISHER PLC		1,709		1,709		331		43,997	小売	
ITV PLC		2,954		2,954		248		32,975	メディア・娯楽	
LONDON STOCK EXCHANGE PLC		262		302		2,491		330,187	各種金融	
SAINSBURY (J) PLC		1,483		1,483		285		37,784	食品・生活必需品小売り	
G4S PLC		1,325		1,325		122		16,274	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC		162		162		386		51,185	保険	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS		105		105		443		58,715	耐久消費財・アパレル	
CENTRICA PLC		4,405		4,405		172		22,800	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		3,807		3,998		5,268		698,204	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS		3,208		3,573		4,517		598,764	エネルギー	
INTERCONTINENTAL HOTELS		160		160		652		86,482	消費者サービス	
WHITBREAD PLC		146		116		297		39,480	消費者サービス	
TUI AG-DI		379		379		197		26,180	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		1,934		2,333		616		81,729	各種金融	
INVESTEC PLC		542		—		—		—	各種金融	
EXPERIAN PLC		812		874		2,508		332,395	商業・専門サービス	
MONDI PLC		340		477		734		97,390	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC		270		330		612		81,147	各種金融	
FRESNILLO PLC		177		—		—		—	素材	
OCADO GROUP PLC		387		446		937		124,279	小売	
GLENCORE PLC		9,416		10,330		1,624		215,267	素材	
WOOD GROUP (JOHN) PLC		540		—		—		—	エネルギー	
GVC HOLDINGS PLC		425		592		482		63,970	消費者サービス	
EVRAZ PLC		430		430		125		16,566	素材	
NMC HEALTH PLC		95		—		—		—	ヘルスケア機器・サービス	
EASYJET PLC		116		116		86		11,408	運輸	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		1,137		1,137		307		40,690	保険	
COCA-COLA HBC AG-CDI		179		179		373		49,508	食品・飲料・タバコ	
AVEVA GROUP PLC		—		67		271		35,937	ソフトウェア・サービス	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL		290		290		130		17,303	ソフトウェア・サービス	
MERLIN ENTERTAINME		650		—		—		—	消費者サービス	
FERGUSON PLC		192		222		1,431		189,694	資本財	
M&G PLC		—		2,291		343		45,545	各種金融	
INFORMA PLC		1,008		1,179		566		75,133	メディア・娯楽	

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
WHITBREAD PLC-NIL		—	58	61	8,167	消費者サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		800	973	531	70,474	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC		62	72	724	96,035	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		—	46	489	64,832	消費者サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC		4,084	4,084	514	68,130	資本財
JD SPORTS FASHION PLC		—	320	212	28,151	小売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	253,548 94	281,854 94	142,707 —	18,913,057 <4.7%>	
(スイス)				千スイスフラン		
BARRY CALLEBAUT AG-REG		1	2	533	59,453	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		1	1	815	90,928	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.08	0.1	833	92,896	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG		38	48	668	74,537	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG		7	10	807	90,057	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG		39	39	149	16,644	耐久消費財・アパレル
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		6	8	579	64,644	素材
SWISS PRIME SITE-REG		62	74	683	76,226	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR		33	33	247	27,654	各種金融
DUFREY AG-REG		25	38	113	12,639	小売
SCHINDLER HOLDING AG-REG		14	21	476	53,135	資本財
SIKA AG-BR		105	122	2,061	229,846	素材
SGS SA		4	5	1,317	146,908	商業・専門サービス
SWISSCOM		20	24	1,202	134,150	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG		30	34	1,619	180,597	資本財
GIVAUDAN-REG		8	8	2,963	330,491	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG		126	143	4,501	502,047	保険
NOVARTIS		1,841	2,053	17,119	1,909,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD		1,534	1,768	3,411	380,432	資本財
ROCHE HOLDING GENUSS		594	671	22,908	2,554,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		132	132	617	68,826	商業・専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		403	475	1,898	211,668	素材
CLARIANT AG-REG		173	173	315	35,234	素材
NESTLE SA - REGISTERED		2,618	2,839	29,201	3,256,542	食品・飲料・タバコ
TEMENOS AG - REG		52	65	957	106,737	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG		51	51	1,051	117,254	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		50	50	719	80,183	運輸
CREDIT SUISSE GROUP AG		2,242	2,416	2,206	246,028	各種金融
SWATCH GROUP AG(BEARER)		24	24	484	54,065	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG		65	69	3,338	372,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		29	32	1,123	125,291	保険
VIFOR PHARMA AG		36	44	672	74,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG		14	18	1,439	160,519	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		37	37	849	94,756	資本財
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)		447	487	2,770	308,962	耐久消費財・アパレル
JULIUS BAER GROUP LTD		211	211	882	98,410	各種金融
SWISS RE LTD		262	283	1,905	212,548	保険
ALCON INC		375	393	2,399	267,631	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG		3,349	3,701	3,884	433,224	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	15,076 39	16,620 39	119,731 —	13,352,432 <3.3%>	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末) 株数 (百株)	当 期 末		業 種
			評 価 額	外 貨 建 金 額	
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A	596	636	24,340	274,798	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	3,274	36,969	各種金融
SKF AB-B	283	354	6,100	68,872	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,387	1,557	12,973	146,473	銀行
SWEDBANK AB-A	802	867	10,546	119,068	銀行
VOLVO B	1,259	1,530	20,963	236,680	資本財
SWEDISH MATCH AB	151	160	10,582	119,471	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	380	500	6,291	71,031	電気通信サービス
ELECTROLUX AB-SER B	181	181	2,848	32,155	耐久消費財・アパレル
SECURITAS B	228	228	2,952	33,334	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	404	439	22,012	248,526	各種金融
HENNES & MAURITZ B	739	773	11,319	127,797	小売
ASSA ABLOY AB-B	888	1,017	20,110	227,047	資本財
SVENSKA HANDELSBK A	1,363	1,503	13,754	155,286	銀行
ERICSSON (LM) B	2,687	2,987	25,675	289,870	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANDVIK AB	1,007	1,007	16,011	180,764	資本財
TELIA CO AB	2,354	2,578	8,461	95,532	電気通信サービス
SKANSKA B	285	285	5,373	60,668	資本財
LUNDIN ENERGY AB	141	172	3,959	44,700	エネルギー
BOLIDEN AB	263	239	4,928	55,646	素材
ALFA LAVAL AB	256	256	5,018	56,662	資本財
KINNEVIK AB - B	181	236	5,520	62,331	各種金融
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	61	86	2,026	22,884	電気通信サービス
ICA GRUPPEN AB	57	79	3,439	38,827	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	2,710	30,602	耐久消費財・アパレル
ATLAS COPCO B	365	365	12,598	142,234	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	127	167	3,541	39,982	各種金融
HEXAGON AB-B SHS	215	265	13,670	154,342	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EPIROC AB-A	538	538	5,743	64,849	資本財
EPIROC AB-B	299	299	3,218	36,342	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	549	570	17,707	199,920	家庭用品・パーソナル用品
BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	263	—	—	—	素材
NORDEA BANK ABP	2,505	3,099	20,307	229,267	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	21,287 33	23,444 32	327,984 —	3,702,946 <0.9%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	802	968	12,917	141,965	銀行
NORSK HYDRO	1,061	1,061	2,703	29,713	素材
TELENOR ASA	608	718	10,564	116,107	電気通信サービス
ORKLA	698	698	5,979	65,713	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	809	921	13,630	149,795	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	134	184	6,311	69,360	素材
MOWI ASA	409	409	7,538	82,843	食品・飲料・タバコ
AKER BP ASA	103	103	1,708	18,771	エネルギー
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,309	36,375	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	69	69	1,625	17,865	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,881 10	5,320 10	66,288 —	728,511 <0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	96	103	9,237	147,607	食品・飲料・タバコ

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
A P MOLLER-MAERSK A/S-B		5	6	4,270	68,241	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A		2	2	1,873	29,934	運輸
DANSKE BANK A/S		593	593	5,055	80,785	銀行
GENMAB A/S		48	63	13,101	209,359	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		176	218	7,901	126,272	素材
DSV PANALPINA A S		168	204	14,768	236,007	運輸
DEMANT A/S		74	116	2,180	34,842	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSYEMS		177	176	11,753	187,814	資本財
NOVO NORDISK A/S-B		1,449	1,692	74,322	1,187,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S		48	48	1,264	20,199	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B		94	112	12,407	198,264	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S		98	98	1,850	29,572	保険
PANDORA A/S		84	84	2,848	45,524	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S		90	103	6,644	106,184	素材
ISS A/S		142	142	1,718	27,468	商業・専門サービス
ORSTED A/S		159	184	14,073	224,887	公益事業
小 計	株 数 : 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,512 17	3,952 17	185,271 —	2,960,638 <0.7%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		122	162	1,134	80,930	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD		513	642	1,093	78,005	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP		2,481	2,715	5,088	363,029	銀行
AMCOR PLC-CDI		1,052	—	—	—	素材
WESTPAC BANKING		2,883	3,383	6,222	443,997	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		356	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,346	1,346	1,820	129,915	素材
TELSTRA CORP		3,423	4,031	1,306	93,192	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		424	424	277	19,831	銀行
BRAMBLES LTD		1,292	1,603	1,849	131,994	商業・専門サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED		461	461	409	29,227	食品・飲料・タバコ
ASX LTD		158	202	1,795	128,124	各種金融
BHP GROUP LTD		2,534	2,815	9,898	706,259	素材
AMPOL LTD		206	206	551	39,372	エネルギー
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		451	451	152	10,859	小売
COMPUTERSHARE LIMITED		443	443	599	42,744	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED		380	433	12,460	889,069	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD		35	52	533	38,035	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP		2,385	2,623	3,822	272,722	運輸
COCHLEAR LIMITED		48	62	1,203	85,856	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED		1,655	1,655	985	70,300	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUST		1,510	1,691	11,115	793,126	銀行
BORAL LIMITED		817	817	255	18,194	素材
RIO TINTO LTD		325	355	3,325	237,304	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD		527	527	1,415	101,021	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.		2,093	2,093	1,289	92,014	保険
TPG TELECOM LTD		314	314	268	19,133	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		32	32	43	3,136	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		373	432	1,157	82,567	素材
ORICA LTD		292	442	780	55,707	素材
CIMIC GROUP LIMITED		92	92	231	16,538	資本財
BLUESCOPE STEEL LTD		493	493	572	40,826	素材

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
MACQUARIE GROUP LIMITED		268	329	3,717	265,228	各種金融
WORLEY LTD		345	345	309	22,092	エネルギー
SUNCORP GROUP LIMITED		1,029	1,193	1,117	79,708	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		2,377	2,756	5,179	369,592	銀行
NEWCREST MINING LIMITED		703	740	2,208	157,549	素材
OIL SEARCH LTD		1,187	1,187	407	29,069	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD		1,505	1,505	310	22,135	素材
AMP LTD		2,442	3,436	582	41,560	各種金融
QANTAS AIRWAYS LIMITED		—	850	347	24,804	運輸
QBE INSURANCE GROUP		1,130	1,271	1,129	80,567	保険
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE		440	440	231	16,538	各種金融
SANTOS		1,564	1,564	851	60,720	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD		326	389	1,138	81,258	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		128	128	249	17,781	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD		1,668	1,668	552	39,403	消費者サービス
WESFARMERS LTD		1,002	1,093	4,454	317,855	小売
ALUMINA LIMITED		1,704	1,704	265	18,972	素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD		835	908	2,095	149,508	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,136	1,208	4,201	299,776	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD		—	109	648	46,278	各種金融
SEEK LTD		263	263	534	38,158	メディア・娯楽
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		55	—	—	—	消費者サービス
AUSNET SERVICES		1,202	1,871	326	23,300	公益事業
CROWN RESORTS LTD		303	303	296	21,184	消費者サービス
AURIZON HOLDINGS LTD		1,594	1,914	907	64,762	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		583	705	703	50,177	食品・飲料・タバコ
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,145	2,698	761	54,297	保険
SOUTH32 LTD		4,081	4,818	939	67,039	素材
COLES GROUP LTD		932	1,284	1,965	140,268	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD		—	180	379	27,047	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	60,492 59	67,883 59	108,474 —	7,739,679 <1.9%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		849	849	543	36,214	運輸
RYMAN HEALTHCARE LTD		363	363	469	31,254	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD		668	668	1,243	82,828	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		455	545	1,605	106,949	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		766	766	263	17,562	素材
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,454	1,989	881	58,701	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		—	850	402	26,780	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		1,105	1,105	541	36,080	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,662 7	7,137 8	5,950 —	396,371 <0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		237	237	1,641	22,763	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,730	1,730	2,851	39,543	不動産
BANK EAST ASIA		1,091	1,091	1,565	21,711	銀行
CLP HOLDINGS		1,480	1,570	11,971	166,041	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		500	675	2,639	36,606	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		1,030	1,150	31,004	430,025	各種金融
MTR CORP		1,420	1,510	5,564	77,177	運輸

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
HANG SENG BANK		680	742	9,015	125,042	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN		1,138	1,252	3,525	48,894	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED		1,110	1,375	5,912	82,006	公益事業
WHARF HOLDINGS		910	—	—	—	不動産
HONG KONG & CHINA GAS		8,159	9,815	12,602	174,796	公益事業
HYSAN DEVELOPMENT CO		590	—	—	—	不動産
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		1,980	2,110	11,056	153,352	消費者サービス
KERRY PROPERTIES LTD		645	645	1,237	17,158	不動産
BOC HONG KONG HOLDINGS -R		3,100	3,605	7,876	109,252	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,630	1,630	1,007	13,971	資本財
PCCW LTD		3,570	3,570	1,513	20,994	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		685	685	805	11,173	耐久消費財・アパレル
NEW WORLD DEVELOPMENT		4,915	6,215	4,940	68,530	不動産
SHANGRI-LA ASIA LTD		980	—	—	—	消費者サービス
SINO LAND CO		3,154	3,154	2,807	38,933	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,285	1,510	13,846	192,053	不動産
SWIRE PACIFIC A		405	405	1,646	22,834	不動産
VITASOY INTL HOLDINGS LTD		640	640	1,939	26,896	食品・飲料・タバコ
WHEELOCK & CO LTD		650	820	4,247	58,914	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,190	1,345	9,119	126,481	資本財
SJM HOLDINGS LTD		1,320	1,320	1,148	15,928	消費者サービス
WYNN MACAU LTD		1,408	1,408	1,850	25,661	消費者サービス
MGM CHINA HOLDINGS LTD		672	—	—	—	消費者サービス
AIA GROUP LTD		10,354	11,552	74,741	1,036,663	保険
SANDS CHINA LTD		2,028	2,428	7,417	102,881	消費者サービス
SWIRE PROPERTIES LTD		962	962	1,671	23,190	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		950	1,400	4,025	55,826	不動産
BUDWEISER BREWING CO APAC LT		—	1,045	2,220	30,800	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD		6,990	9,365	6,002	83,261	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,339	2,564	12,375	171,654	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD		2,159	2,579	10,771	149,398	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	74,089 37	82,106 34	272,561 —	3,780,423 <0.9%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING		1,090	2,046	644	48,910	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		4,190	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP		1,563	1,748	3,433	260,535	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		312	428	328	24,912	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		99	99	211	16,017	小売
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S		512	512	144	10,957	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		623	783	638	48,428	各種金融
CAPITALAND LTD		1,871	2,235	645	49,018	不動産
GENTING SINGAPORE LTD		4,250	6,150	476	36,171	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD		1,123	1,699	1,014	76,975	資本財
COMFORTDELGRO CORP LTD		1,665	1,665	249	18,953	運輸
OCBC BANK		2,642	3,156	2,729	207,175	銀行
SINGAPORE AIRLINES		433	1,083	413	31,405	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		1,198	1,203	2,386	181,130	銀行
UOL GROUP LIMITED		475	475	318	24,151	不動産
VENTURE CORP LTD		257	257	395	30,016	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,271	1,271	185	14,082	メディア・娯楽

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		6,674	7,522	1,888	143,290	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		1,070	1,070	161	12,261	資本財
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,786	1,786	703	53,402	食品・飲料・タバコ
YANGZIJANG SHIPBUILDING		1,999	1,999	186	14,184	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	35,103 21	37,187 20	17,156 —	1,301,982 <0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOALIM BM		840	983	2,114	64,729	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,406	1,406	2,607	79,823	銀行
ELBIT SYSTEMS LTD		14	21	1,047	32,056	資本財
ISRAEL DISCOUNT BANK-A		995	995	1,105	33,837	銀行
ICL LTD		677	677	821	25,157	素材
NICE LTD		48	61	3,909	119,683	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		82	125	857	26,262	銀行
AZRIELI GROUP		43	43	794	24,334	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,108 8	4,313 8	13,259 —	405,885 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	934,079 1,265	1,036,450 1,248	— —	371,351,334 <92.9%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当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、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期		末
	口	数 (千口)	口	数 (千口)	評 価 額
					外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)					千米ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		9		10	1,682 180,935
BOSTON PROPERTIES		13		14	1,297 139,551
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		—		20	650 69,981
SL GREEN REALTY CORP		8		8	354 38,089
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		112		125	794 85,440
PROLOGIS INC		53		70	6,546 703,958
AVALONBAY COMMUNITIES INC		11		13	2,122 228,206
CAMDEN PROPERTY TRUST		8		8	813 87,457
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		14		16	537 57,786
DUKE REALTY CORP		29		35	1,220 131,234
CROWN CASTLE INTL CORP		34		39	6,695 719,991
ESSEX PROPERTY TRUST		5		6	1,572 169,122
EQUITY RESIDENTIAL PTY		31		35	2,159 232,209
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6		7	583 62,770
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		41		47	1,205 129,607
WELLTOWER INC		31		38	1,952 209,953
KIMCO REALTY CORP		35		35	414 44,583
LIBERTY PROPERTY TRUST		11		—	— —
IRON MOUNTAIN INC		24		27	707 76,123
MACERICH CO/THE		10		—	— —
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		7		16	1,035 111,320
HOST HOTELS AND RESORTS INC		67		67	814 87,587
MID-AMERICA APARTMENT COMM		10		10	1,284 138,096
REALTY INCOME CORP		24		30	1,679 180,557
REGENCY CENTERS CORP		14		14	637 68,579
UDR INC		24		28	1,078 116,010
SIMON PROPERTY GROUP		25		29	1,752 188,494
PUBLIC STORAGE		13		15	3,019 324,704
SUN COMMUNITIES INC		7		9	1,255 135,033
VENTAS INC		30		34	1,264 135,988
VORNADO REALTY TRUST		15		15	583 62,720
EXTRA SPACE STORAGE INC		10		12	1,198 128,867
DIGITAL REALTY TRUST INC		17		25	3,664 394,048
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		—		50	908 97,653
AGNC INVESTMENT CORP		46		46	605 65,114
VEREIT INC		77		105	589 63,366

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		
		口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
AMERICAN TOWER CORPORATION		37	42	10,905	1,172,703
WP CAREY INC		13	16	1,027	110,499
INVITATION HOMES INC		24	51	1,348	144,971
EQUINIX INC		6	8	5,641	606,661
VICI PROPERTIES INC		—	44	857	92,159
SBA COMMUNICATIONS CORP		9	10	3,340	359,174
小 計	口 数 ・ 金 額	977	1,244	75,805	8,151,318
	銘 柄 数 <比 率>	39	40	—	<2.0%>
(カナダ)				千カナダドル	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		5	5	117	9,128
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		—	8	419	32,757
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT		9	9	97	7,641
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		15	15	228	17,823
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	12	172	13,448
小 計	口 数 ・ 金 額	30	51	1,035	80,798
	銘 柄 数 <比 率>	3	5	—	<0.0%>
(フランス)				千ユーロ	
ICADE		2	2	187	22,385
KLEPIERRE		17	17	304	36,228
GECINA SA		4	4	512	61,034
COVIVIO(FP)		3	4	272	32,452
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		12	13	698	83,205
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	40	43	1,975	235,307
	銘 柄 数 <比 率>	5	5	—	<0.1%>
(イギリス)				千イギリスポンド	
BRITISH LAND CO PLC		79	79	315	41,804
SEGRO PLC		102	106	907	120,251
LAND SECURITIES GROUP PLC		58	58	351	46,635
小 計	口 数 ・ 金 額	240	244	1,574	208,690
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.1%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP		306	392	939	67,003
APA GROUP		89	114	1,323	94,450
GPT GROUP		136	167	693	49,471
SYDNEY AIRPORT		89	89	542	38,725
STOCKLAND		207	207	748	53,423
DEXUS		94	94	853	60,889
GOODMAN GROUP		140	162	2,500	178,417

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		
		口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
VICINITY CENTERS		291	291	475	33,960
LENDLEASE GROUP		44	55	725	51,776
SCENTRE GROUP		486	486	1,158	82,641
小 計	口 数 ・ 金 額	1,885	2,062	9,961	710,759
	銘 柄 数 <比 率>	10	10	—	<0.2%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		179	199	11,343	157,327
HKT TRUST AND HKT LTD		375	375	4,237	58,774
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		220	220	1,693	23,488
小 計	口 数 ・ 金 額	775	794	17,273	239,589
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.1%>
(シンガポール)				千シンガポールドル	
CAPITALAND MALL TRUST		200	200	386	29,337
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		197	274	832	63,213
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		243	243	403	30,612
SUNTEC REIT		173	173	252	19,168
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		—	220	431	32,723
小 計	口 数 ・ 金 額	813	1,110	2,306	175,055
	銘 柄 数 <比 率>	4	5	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	4,762	5,551	—	9,801,520
	銘 柄 数 <比 率>	67	71	—	<2.5%>

(注1) 邦貨換算金額は、当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、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	S&P 500 EMIN	11,662	—
	S&P/TSE 60	617	—
	SWISS MKT IX	642	—
	DJ EURO STOXX	2,073	—
	SPI 200 FUTU	584	—
	FTSE 100	1,022	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	371,351,334	92.8
投 資 信 託 受 益 証 券	267,214	0.1
投 資 証 券	9,534,306	2.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,823,253	4.7
投 資 信 託 財 産 総 額	399,976,107	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(399,219,015千円)の投資信託財産総額(399,976,107千円)に対する比率は99.8%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=107.53円

1カナダドル=78.01円

1ユーロ=119.13円

1イギリスポンド=132.53円

1スイスフラン=111.52円

1スウェーデンクローナ=11.29円

1ノルウェークローネ=10.99円

1デンマーククローネ=15.98円

1オーストラリアドル=71.35円

1ニュージーランドドル=66.61円

1香港ドル=13.87円

1シンガポールドル=75.89円

1イスラエルシェケル=30.61円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年5月29日現在
(A) 資 産	402,195,345,012円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,894,244,271
株 式(評価額)	371,351,334,199
投資信託受益証券(評価額)	267,214,149
投 資 証 券(評価額)	9,534,306,488
未 収 入 金	3,852,666,128
未 収 配 当 金	591,109,903
差 入 委 託 証 拠 金	5,704,469,874
(B) 負 債	2,470,278,214
未 払 金	2,220,284,050
未 払 解 約 金	249,992,491
未 払 利 息	1,673
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	399,725,066,798
元 本	154,591,953,075
次 期 繰 越 損 益 金	245,133,113,723
(D) 受 益 権 総 口 数	154,591,953,075口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,857円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年5月30日 至 2020年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	7,290,542,790円
受 取 配 当 金	7,248,829,634
受 取 利 息	33,535,852
そ の 他 収 益 金	18,881,038
支 払 利 息	△10,703,734
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,624,586,067
売 益	49,060,780,330
売 損	△40,436,194,263
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,634,186,238
取 引 益	5,651,157,190
取 引 損	△4,016,970,952
(D) そ の 他 費 用	△112,036,334
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	17,437,278,761
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	207,130,884,261
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	63,398,090,856
(H) 解 約 差 損 益 金	△42,833,140,155
(I) 計 (E+F+G+H)	245,133,113,723
次 期 繰 越 損 益 金(I)	245,133,113,723

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

＜注記事項＞

※当ファンドの期首元本額は137,985,205,997円、期中追加設定元本額は42,423,393,809円、期中一部解約元本額は25,816,646,731円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国株式SMTBセクション(SMA専用)	37,420,761,750円
SMT グローバル株式インデックス・オープン	27,044,464,309円
DC世界経済インデックスファンド	10,665,752,729円
DC外国株式インデックス・オープン	9,537,913,014円
世界経済インデックスファンド	8,312,169,752円
分散投資コア戦略ファンドS	6,179,969,248円
DCマイセクション50	5,187,086,692円
DCマイセクション75	5,058,962,760円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,503,070,291円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,390,972,142円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,327,586,550円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,264,957,748円
DCマイセクションS50	2,218,627,505円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	2,179,602,892円
分散投資コア戦略ファンドA	2,163,193,200円
FOFs用 外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	2,050,262,713円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,831,169,460円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,785,124,825円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,784,023,314円
DCマイセクションS75	1,610,296,090円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,292,706,846円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	1,251,074,322円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,232,594,809円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,178,678,308円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,169,273,352円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,148,728,270円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,043,837,929円
グローバル経済コア	1,001,463,806円
DCマイセクション25	1,000,534,355円
SMTAMバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	822,817,503円
外国株式インデックス・オープン	809,534,821円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	745,043,764円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	662,558,161円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	475,028,107円
DCマイセクションS25	432,611,322円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	404,388,381円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	402,638,376円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	399,488,655円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	340,736,198円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	335,306,185円
SMT インデックスバランス・オープン	240,558,752円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	201,852,207円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	167,156,979円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	152,906,563円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	145,758,315円

DCターゲット・イヤー ファンド2045	134,582,718円
SMT 世界経済インデックス・オープン	122,636,450円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	106,366,419円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	91,763,771円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	79,463,450円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	78,721,853円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	69,716,759円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	67,823,626円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	61,516,677円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	43,038,653円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	42,090,277円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	37,622,795円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	31,616,644円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	11,500,216円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,163,979円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,327,323円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	8,055,290円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,862,004円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,234,272円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,032,367円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	673,604円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	422,278円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	260,858円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	217,522円

お知らせ

該当事項はありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第11期（決算日 2019年11月11日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年12月12日から無期限です。
運用方針	主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)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。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株式先物 比率	投資信託 証券組入比率	純 資 産 総 額
		期 騰 落 率		期 騰 落 率				
第 7 期 (2015年11月10日)	円	%		%	%	%	%	百万円
	23,378	△5.9	20,671	△8.0	93.8	5.4	0.8	25,618
第 8 期 (2016年11月10日)	21,467	△8.2	18,491	△10.5	98.6	0.7	0.7	29,752
第 9 期 (2017年11月10日)	30,310	41.2	25,570	38.3	98.5	1.0	0.5	47,713
第10期 (2018年11月12日)	26,828	△11.5	22,122	△13.5	96.2	3.2	0.5	49,931
第11期 (2019年11月11日)	28,752	7.2	23,119	4.5	96.3	3.0	0.6	62,222

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株式先物 比率	投資信託 証券組入比率
		騰 落 率		騰 落 率			
(当 期 首) 2018年11月12日	円	%		%	%	%	%
	26,828	－	22,122	－	96.2	3.2	0.5
11月末	27,333	1.9	22,525	1.8	97.3	2.2	0.5
12月末	25,568	△4.7	21,025	△5.0	98.4	1.6	0.5
2019年 1月末	27,378	2.1	22,466	1.6	97.9	1.3	0.6
2月末	28,504	6.2	23,403	5.8	97.7	1.7	0.5
3月末	28,154	4.9	23,074	4.3	98.6	0.9	0.5
4月末	29,225	8.9	23,953	8.3	97.9	1.6	0.6
5月末	26,480	△1.3	21,641	△2.2	96.8	1.5	1.6
6月末	27,867	3.9	22,615	2.2	96.9	2.5	0.5
7月末	27,887	3.9	22,540	1.9	94.7	4.7	0.5
8月末	25,520	△4.9	20,541	△7.1	94.7	4.6	0.6
9月末	26,692	△0.5	21,497	△2.8	94.7	5.9	0.6
10月末	28,135	4.9	22,554	2.0	96.0	3.2	0.6
(当 期 末) 2019年11月11日	28,752	7.2	23,119	4.5	96.3	3.0	0.6

(注1) 騰落率は期首比です。

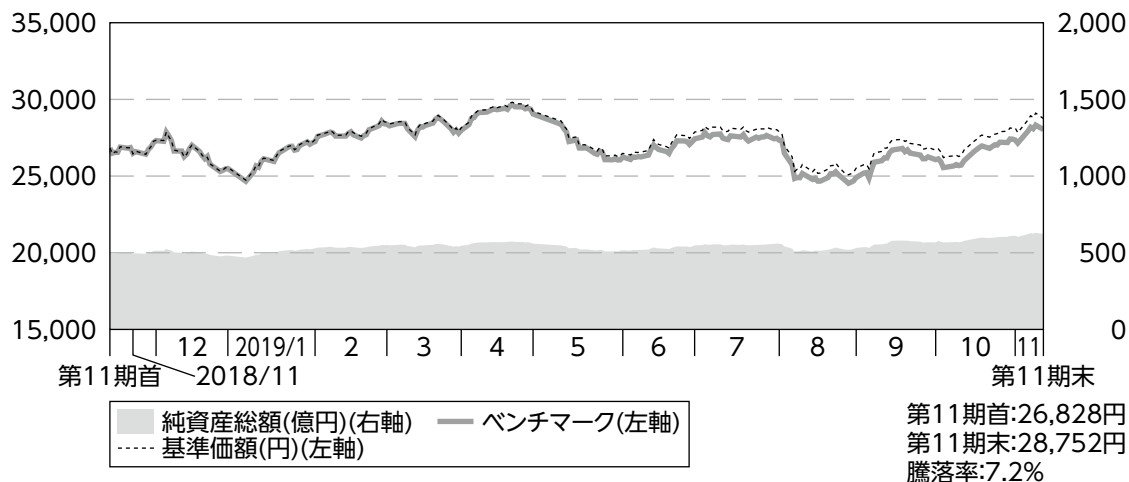
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利は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及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

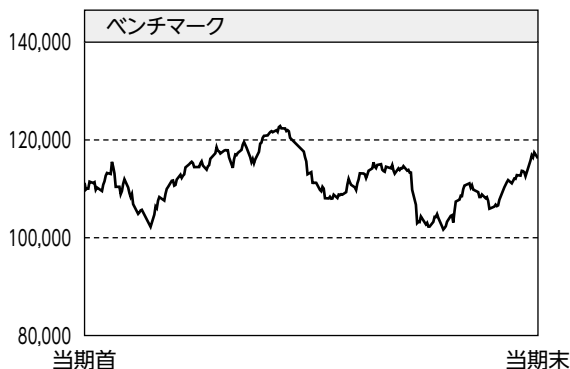


(注)ベンチマークは、2018年11月12日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



新興国株式市場は、上昇しました。2019年4月末までは、中国などのマクロ経済指標の改善を受けて世界景気の減速懸念が和らいだことなどから堅調に推移しました。その後は、米中貿易摩擦の激化などが嫌気されて下落基調で推移しましたが、9月以降は米欧を中心に金融緩和政策への期待が強まったことなどから、新興国株式市場は上昇して当期末を迎えました。国別では、インド株式市場は、総選挙でモディ首相率いる与党が勝利したことで大規模なインフラ投資などによる経済成長への期待が強まったことや、大幅な法人減税が好感されて上昇しました。ブラジル株式市場は、年金改革法案や利下げへの期待が強まったことなどを受けて過去最高値を更新しました。外国為替市場では、ブラジル・レアルや韓国ウォンなどの新興国通貨に対して円高が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

資金の流出入などには、コスト抑制の観点から海外の株価指数先物を利用し、DR(預託証券)および先物を含む株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

DRを含むベンチマーク構成銘柄に分散投資し、ベンチマークとの連動を目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

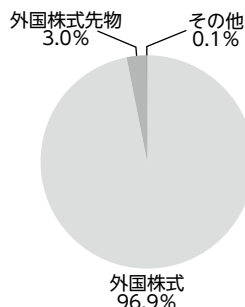
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン諸島	4.5%
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	4.2%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	4.0%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.6%
5	MSCI EMERG M 1912	ー	3.0%
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.3%

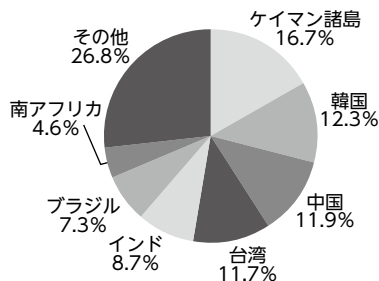
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	1.1%
8	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.1%
9	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.0%
10	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	0.9%
組入銘柄数			1,042

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

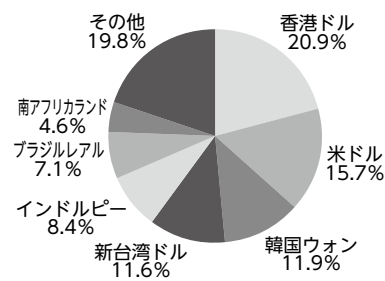
○資産別配分



○国別配分



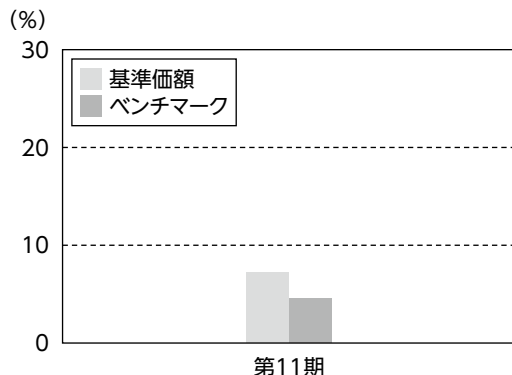
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.0%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当要因※(プラス要因)およびコスト要因(マイナス要因)です。

※ベンチマークは配当金を除いた指数である一方、当ファンドでは税引き後の配当金が計上されることによる差異要因です。

今後の運用方針

主として、取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年11月13日~2019年11月11日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	9円 (7) (0) (－) (－) (0) (－) (2)	0.035% (0.026) (0.000) (－) (－) (0.000) (－) (0.008)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	4 (4) (0) (－) (－) (－) (0)	0.013 (0.013) (0.000) (－) (－) (－) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 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) (監査費用) (その他)	43 (42) (－) (0)	0.155 (0.154) (－) (0.001)	(c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	56	0.203	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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。

(注2) 各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(27,395円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株 式＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 4,878 (416)	千米ドル 14,156 (1)	百株 2,219	千米ドル 2,522
	メ キ シ コ	10,810 (－)	千メキシコペソ 35,599 (△377)	3,930 (433)	千メキシコペソ 13,453 (5,354)
	ブ ラ ジ ル	7,325 (3,988)	千ブラジルリアル 21,916 (725)	1,450 (291)	千ブラジルリアル 3,706 (1,722)
	チ リ	26,933 (14,299)	千チリペソ 718,590 (91,092)	366 (7,052)	千チリペソ 121,570 (3,707)
	コ ロ ン ビ ア	90	千コロンビアペソ 376,323	－	千コロンビアペソ －
	オ ラ ン ダ	－ (400)	千ユーロ － (2,165)	400	千ユーロ 2,728
	ギ リ シ ャ	3,442	362	2,077	142
	イ ギ リ ス	267	千イギリスポンド 254	－	千イギリスポンド －
	ト ル コ	2,388 (2,503)	千トルコリラ 2,603 (312)	6,479 (1,760)	千トルコリラ 2,815 (180)
	チ ェ コ	420	千チェココルナ 3,364	45	千チェココルナ 1,109
	ポ ー ラ ン ド	864	千ポーランドズロチ 2,683	250	千ポーランドズロチ 1,004
	香 港	138,308 (780)	千香港ドル 138,629 (△152)	74,168	千香港ドル 31,237
	マ レ ー シ ア	9,468 (280)	千マレーシアリンギット 5,052 (141)	7,400	千マレーシアリンギット 1,088
	タ イ	42,451 (9,252)	千タイバーツ 145,114 (43)	10,533 (0.12)	千タイバーツ 14,784 (84)

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	フィリピン	百株 17,953 (190)	千フィリピンペソ 31,020 (－)	百株 －	千フィリピンペソ －
	インドネシア	66,914 (10,960)	千インドネシアルピア 20,652,194 (－)	19,611	千インドネシアルピア 7,529,727
	韓国	2,899 (9)	千韓国ウォン 9,872,103 (18,267)	873 (0.82)	千韓国ウォン 3,230,658 (9,458)
	台湾	44,290 (2,872)	千新台幣ドル 228,988 (797)	12,689 (－)	千新台幣ドル 73,211 (69)
	インド	11,152 (9,098)	千インドルピー 529,657 (18,743)	1,774 (3,610)	千インドルピー 111,188 (6,890)
	パキスタン	－	千パキスタンルピー －	370	千パキスタンルピー 5,407
	カタール	2,784 (19,203)	千カタールリアル 4,704 (－)	801	千カタールリアル 802
	南アフリカ	5,073 (723)	千南アフリカランド 55,846 (1,622)	1,724 (148)	千南アフリカランド 24,719 (36,559)
	アラブ首長国連邦	6,335	千アラブ首長国連邦ディルハム 4,085	4,778	千アラブ首長国連邦ディルハム 506
	サウジアラビア	13,232 (8)	千サウジアラビアリアル 54,359 (－)	－	千サウジアラビアリアル －
	中国オフショア	58,839 (391)	千香港・オフショア人民元 76,129 (24)	1,927	千香港・オフショア人民元 1,054

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) ()内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<新株予約権証券>

		当期			
		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	イ	証券 — (48,923)	千タイバーツ — (41)	証券 48,923	千タイバーツ 45

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国					
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ISHARES MSCI SAUDI CAPD USDA	1,100,000	5,213	1,100,000	5,438
	小計	1,100,000	5,213	1,100,000	5,438
	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	— (一)	— (△284)	—	—
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	— (43,300)	— (5,354)	—	—
	小計	— (43,300)	— (5,069)	—	—
	ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	11,900	524	—	—
	ENERGISA SA-UNITS	16,500	812	—	—
	KLABIN SA-UNIT	27,900	448	—	—
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	1,372	—	—
	小計	81,700	3,158	—	—
	トルコ	口	千トルコリラ	口	千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	—	—	135,630	219
	小計	—	—	135,630	219
	南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
	FORTRESS REIT LTD-A	139,667	2,983	—	—
	FORTRESS REIT LTD-B	—	—	85,801	874
	RESILIENT REIT LTD	—	—	23,098	1,361
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	—	—	22,923	1,600
	小計	139,667	2,983	131,822	3,836

(注1) 金額は受渡代金です。

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当		期	
		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 16,298	百万円 16,131	百万円 －	百万円 －

(注) 金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	13,954,628千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	52,502,204千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.26

(注1) (b) 当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 283	百万円 283	% 100.0	百万円 287	百万円 287	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	17,677	2,819	15.9	17,650	2,806	15.9

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘	柄	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)				千米ドル		
BBVA ARGENTINA SA-ADR		—	312	107	11,702	銀行
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR		169	169	258	28,220	素材
CREDICORP LTD		58	64	1,329	145,140	銀行
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR		398	398	374	40,850	電気通信サービス
SOUTHERN COPPER CORP		54	54	204	22,284	素材
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR		—	63	57	6,275	電気通信サービス
TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B		—	73	49	5,398	エネルギー
YPF S. A. -SPONSORED ADR		—	155	146	15,949	エネルギー
BANCO MACRO SA-ADR		—	40	95	10,394	銀行
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR		122	134	1,617	176,592	消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR		362	474	564	61,583	小売
FANG HOLDINGS LTD-ADR		125	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR		—	56	79	8,653	公益事業
TAL EDUCATION GROUP- ADR		295	387	1,728	188,657	消費者サービス
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS		20	20	67	7,315	各種金融
NIO INC - ADR		—	538	106	11,645	自動車・自動車部品
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR		—	90	127	13,865	メディア・娯楽
58.COM INC-ADR		73	94	522	56,993	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR		52	52	387	42,351	メディア・娯楽
GLOBANT SA		—	31	309	33,776	ソフトウェア・サービス
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		1,016	1,374	25,732	2,808,973	小売
YUM CHINA HOLDINGS INC		333	333	1,460	159,424	消費者サービス
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR		—	299	672	73,401	運輸
TRIP.COM GROUP LTD		380	454	1,553	169,584	小売
SINA CORP		57	57	244	26,691	メディア・娯楽
NETEASE INC-ADR		68	68	2,054	224,226	メディア・娯楽
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR		—	87	108	11,881	銀行
51JOB INC-ADR		16	16	134	14,656	商業・専門サービス
BAIDU INC - SPON ADR		241	267	3,332	363,759	メディア・娯楽
HUAZHU GROUP LTD-ADR		109	139	516	56,347	消費者サービス
YY INC-ADR		43	61	402	43,905	メディア・娯楽
GDS HOLDINGS LTD - ADR		44	44	189	20,638	ソフトウェア・サービス
WEIBO CORP-SPON ADR		52	52	286	31,324	メディア・娯楽
JD.COM INC-ADR		683	719	2,389	260,856	小売
MOMO INC-SPON ADR		129	129	504	55,047	メディア・娯楽
BAOZUN INC-SPN ADR		35	35	149	16,267	小売
PINDUODUO INC-ADR		—	177	766	83,648	小売
IQIYI INC-ADR		—	119	233	25,520	メディア・娯楽
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR		—	36	81	8,907	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B		1,040	1,040	91	10,035	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B		453	544	59	6,535	不動産
LUKOIL PJSC-SPON ADR		428	367	3,473	379,151	エネルギー
GAZPROM OAO-SPON ADR		4,871	5,238	4,334	473,112	エネルギー
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR		1,290	1,472	746	81,514	銀行
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR		1,604	1,604	1,163	127,031	エネルギー
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		86	92	1,966	214,684	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S		155	155	319	34,841	素材
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR		564	664	1,925	210,215	素材
ROSNEFT OJSC-GDR		1,081	1,335	948	103,530	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S		253	387	547	59,762	素材
TATNEFT-SPONSORED ADR		221	261	1,932	210,934	エネルギー
VTB BANK PJSC -GDR-REG S		2,059	2,059	294	32,120	銀行
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		309	398	481	52,541	食品・生活必需品小売り
RUSHYDRO PJSC-ADR		1,095	—	—	—	公益事業
SBERBANK-SPONSORED ADR		2,395	2,537	3,838	418,990	銀行
PHOSAGRO OAO-GDR REG S		186	268	342	37,412	素材
POLYUS PJSC-REG S-GDR		71	71	400	43,665	素材
DP WORLD PLC		211	211	275	30,039	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	23,322	26,398	72,085	7,868,833	
		44	56	—	<12.6%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A		2,429	3,599	6,168	35,223	資本財
COCA-COLA FEMSA SAB-SER		433	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		1,791	1,791	31,732	181,194	食品・飲料・タバコ
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		109	109	1,066	6,088	小売
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		2,097	2,580	11,402	65,107	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		1,324	1,324	4,749	27,117	食品・飲料・タバコ
GRUMA S. A. B. -B		142	259	5,276	30,128	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		169	169	3,132	17,884	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		375	375	2,520	14,393	資本財
CEMEX SAB-SPONS		12,310	14,556	10,611	60,593	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		2,193	2,476	25,490	145,550	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		968	968	4,186	23,907	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		145	145	3,432	19,600	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		1,818	1,818	6,952	39,696	家庭用品・パーソナル用品
ALSEA SAB DE CV		343	343	1,809	10,331	消費者サービス
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		154	233	7,487	42,754	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		3,007	3,812	20,139	114,998	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L		30,378	33,042	50,356	287,536	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		2,525	2,525	6,234	35,597	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM		336	336	3,600	20,559	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V		4,685	5,102	28,672	163,720	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B		310	310	6,289	35,910	運輸

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
MEGACABLE HOLDINGS-CPO		—	314	2,500	14,275	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N		377	377	3,181	18,164	公益事業
BANCO SANTANDER MEXICO-B		1,697	—	—	—	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	70,122	76,570	246,993	1,410,333	
	銘 柄 数 <比 率>	24	23	—	<2.3%>	
(ブラジル)				千ブラジルレアル		
BRF SA		525	525	1,808	47,367	食品・飲料・タバコ
VALE SA		2,781	3,024	14,875	389,598	素材
TIM PARTICIPACOES SA		729	729	933	24,457	電気通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B		177	177	700	18,333	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		300	241	921	24,123	公益事業
BANCO DO BRASIL S.A.		691	811	3,811	99,828	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR		3,700	4,435	6,103	159,850	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF		637	637	1,238	32,423	小売
GERDAU SA-PREF		870	870	1,326	34,747	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		2,533	2,927	9,632	252,281	エネルギー
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA		277	760	2,118	55,493	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		3,463	4,024	12,081	316,407	エネルギー
COGNA EDUCACAO		1,381	1,381	1,356	35,538	消費者サービス
CCR SA		1,011	1,256	2,180	57,105	運輸
WEG SA		668	848	2,396	62,771	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF		2,921	3,834	13,129	343,859	銀行
BANCO BRADESCO S.A.		969	1,163	3,727	97,612	銀行
NATURA COSMETICOS SA		207	414	1,390	36,409	家庭用品・パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		717	630	774	20,294	素材
SUZANO SA		403	506	1,925	50,436	素材
ITAU UNIBANCO HOLDING SA		2,845	4,669	16,937	443,590	銀行
PORTO SEGURO SA		73	73	411	10,781	保険
FIBRIA CELULOSE SA		225	—	—	—	素材
BRASKEM SA-PREF A		148	148	462	12,112	素材
ENGIE BRASIL SA		134	167	757	19,828	公益事業
LOCALIZA RENT A CAR		590	590	2,451	64,205	運輸
LOJAS RENNER S.A.		603	829	4,055	106,221	小売
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA		266	—	—	—	公益事業
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA		287	756	1,548	40,549	エネルギー
COSAN SA		184	184	1,092	28,624	エネルギー
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		240	130	1,303	34,132	公益事業
EMBRAER SA		697	697	1,260	33,004	資本財
M DIAS BRANCO SA		63	63	226	5,928	食品・飲料・タバコ
ODONTOPREV S.A.		124	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
B2W CIA DIGITAL		—	269	1,404	36,772	小売
BR MALLS PARTICIPACOES SA		570	859	1,303	34,130	不動産
JBS SA		1,119	1,186	3,272	85,698	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF		659	980	1,284	33,628	公益事業

銘 柄		当期首(前期末)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP		261	347	1,870	48,983	公益事業
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS		454	454	1,305	34,196	不動産
HYPERA SA		353	353	1,240	32,487	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO		1,725	1,905	9,277	242,977	各種金融
TELEFONICA BRASIL S.A.		318	484	2,613	68,450	電気通信サービス
MAGAZINE LUIZA SA		71	568	2,488	65,171	小売
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF		148	148	1,200	31,431	食品・生活必需品小売り
CIELO SA		992	992	768	20,122	ソフトウェア・サービス
RAIA DROGASIL SA		211	211	2,352	61,615	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES		563	690	2,393	62,688	保険
NOTRE DAME INTERMED PAR SA		—	336	1,975	51,725	ヘルスケア機器・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC		415	415	783	20,509	食品・生活必需品小売り
AMBEV SA		4,066	4,620	7,992	209,326	食品・飲料・タバコ
RUMO SA		977	977	2,294	60,105	運輸
IRB BRASIL RESSEGUROS SA		72	691	2,425	63,521	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	44,421	53,992	161,186	4,221,466	
	銘 柄 数 <比 率>	51	50	—	<6.8%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE		62,798	62,798	286,987	41,900	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION		25	51	206,669	30,173	銀行
BANCO DE CHILE		23,352	37,356	342,557	50,013	銀行
EMPRESAS CMPC SA		1,359	1,359	247,456	36,128	素材
EMPRESAS COPEC SA		447	447	301,703	44,048	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA		93	93	65,913	9,623	食品・飲料・タバコ
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		185	185	103,796	15,154	電気通信サービス
ENEL AMERICAS SA		21,625	39,900	574,561	83,885	公益事業
COLBUN SA		4,758	4,758	57,725	8,427	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A		1,632	2,862	93,025	13,581	公益事業
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		152	152	31,108	4,541	食品・飲料・タバコ
LATAM AIRLINES GROUP SA		221	325	270,538	39,498	運輸
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B		98	98	195,168	28,494	素材
S. A. C. I. FALABELLA		530	708	255,013	37,231	小売
ITAU CORPBANCA		167,491	167,491	74,533	10,881	銀行
CENCOSUD SA		1,379	1,379	143,507	20,952	食品・生活必需品小売り
BANCO DE CREDITO E INVERSIONS-RIGHTS		1	—	—	—	銀行
ENEL CHILE SA		25,612	25,612	153,266	22,376	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	311,768	345,582	3,403,533	496,915	
	銘 柄 数 <比 率>	18	17	—	<0.8%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		505	505	1,020,322	33,364	公益事業
ECOPETROL SA		4,889	4,889	1,530,504	50,047	エネルギー
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF		125	125	352,964	11,541	各種金融
GRUPO AVAL ACCIONES-PF		3,037	3,037	428,228	14,003	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		320	320	220,875	7,222	素材

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
GRUPO ARGOS SA		177	177	324,330	10,605	素材
BANCOLOMBIA SA		203	293	1,253,180	40,978	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		382	382	1,715,619	56,100	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		208	208	683,312	22,344	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	9,848 9	9,939 9	7,529,338 —	246,209 <0.4%>	
(ギリシャ)				千ユーロ		
ALPHA BANK AE		1,291	1,291	229	27,656	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		401	531	148	17,812	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		202	202	271	32,699	電気通信サービス
EUROBANK ERGASIAS SA		1,489	2,910	256	30,803	銀行
MOTOR OIL (HELLAS) SA		90	90	196	23,636	エネルギー
OPAP SA		176	176	171	20,608	消費者サービス
JUMBO SA		85	85	157	18,881	小売
TITAN CEMENT CO. S.A.		43	—	—	—	素材
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T		—	43	80	9,694	素材
PIRAEUS BANK S.A		186	—	—	—	銀行
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,967 9	5,332 8	1,511 —	181,793 <0.3%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC		—	267	323	45,116	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	267 1	323 —	45,116 <0.1%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		1,760	2,763	2,028	38,414	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE		112	417	851	16,127	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS		153	153	283	5,369	耐久消費財・アパレル
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		238	238	450	8,528	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		1,167	1,167	846	16,032	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		32	132	893	16,931	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS		624	624	1,239	23,482	資本財
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		528	—	—	—	素材
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		431	431	191	3,630	資本財
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		67	—	—	—	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		621	621	796	15,077	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		950	950	1,248	23,648	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI		2,399	2,399	2,349	44,499	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C		3,316	1,730	1,064	20,152	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		116	116	1,479	28,019	エネルギー
ULKER BISKUVI SANAYI		96	—	—	—	食品・飲料・タバコ
YAPI VE KREDI BANKASI		2,133	—	—	—	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING		614	1,143	983	18,630	各種金融
COCA-COLA ICECEK AS		44	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		214	428	2,043	38,705	食品・生活必需品小売り

銘 柄		当期首(前期末)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価	額	
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		519	—	—	—	銀行
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		98	98	269	5,111	運輸
TURKIYE HALK BANKASI		524	—	—	—	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	16,766	13,417	17,020	322,360	
	銘 柄 数 <比 率>	23	16	—	<0.5%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		74	74	5,880	27,757	銀行
02 CZECH REPUBLIC AS		45	—	—	—	電気通信サービス
CEZ AS		137	137	7,177	33,878	公益事業
MONETA MONEY BANK AS		267	687	5,382	25,407	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	524	899	18,441	87,043	
	銘 柄 数 <比 率>	4	3	—	<0.1%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT		151	151	84,845	30,586	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY		328	328	100,062	36,072	エネルギー
OTP BANK NYRT		195	195	274,467	98,945	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	675	675	459,375	165,604	
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA		330	993	586	16,529	銀行
M BANK SA		7	16	636	17,945	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		20	—	—	—	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA		131	131	1,265	35,686	素材
BANK PEKAO SA		155	155	1,629	45,930	銀行
ORANGE POLSKA SA		556	556	352	9,931	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA		264	264	2,786	78,556	エネルギー
LPP SA		1	1	1,056	29,782	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA		23	36	1,116	31,468	銀行
CD PROJEKT SA		67	67	1,748	49,287	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA		765	765	2,983	84,110	銀行
CCC SA		31	31	351	9,907	耐久消費財・アパレル
GRUPA LOTOS SA		55	110	1,048	29,548	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		1,464	1,464	732	20,648	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA		235	235	674	19,014	メディア・娯楽
GRUPA AZOTY SA		27	—	—	—	素材
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA		634	634	604	17,047	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		509	620	2,355	66,410	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S		41	41	86	2,445	素材
ALIOR BANK SA		88	88	251	7,084	銀行
DINO POLSKA SA		44	44	627	17,683	食品・生活必需品小売り
PLAY COMMUNICATIONS SA		189	—	—	—	電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	5,645	6,258	20,894	589,019	
	銘 柄 数 <比 率>	22	19	—	<0.9%>	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H		830	830	768	10,714	素材

銘 柄	当期首(前期末)	当	期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	680	680	724	10,104	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	1,760	943	13,150	運輸
ANGANG STEEL CO LTD-H	580	754	206	2,879	素材
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	5,450	5,945	38,226	532,875	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,100	1,100	5,423	75,596	素材
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	1,380	1,380	219	3,058	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	390	390	1,419	19,789	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H	3,700	3,700	1,402	19,548	公益事業
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,860	2,860	2,362	32,931	ヘルスケア機器・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,420	1,420	1,153	16,073	エネルギー
HENGAN INTL GROUP CO LTD	665	665	3,597	50,151	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,840	1,840	561	7,823	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	660	4,680	1,998	27,857	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	2,500	2,500	2,330	32,480	自動車・自動車部品
CHINA INTL MARINE CO-H	265	—	—	—	資本財
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	3,800	4,520	9,469	132,003	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	3,270	3,810	10,326	143,947	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	2,431	2,651	9,265	129,162	不動産
CITIC LTD	5,020	5,850	6,095	84,974	資本財
CHINA TRAVEL INTL INV HK	1,180	—	—	—	消費者サービス
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	1,080	857	11,953	運輸
LENOVO GROUP LTD	5,780	7,320	4,260	59,387	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	19,760	19,760	7,805	108,804	エネルギー
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	1,080	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	5,080	7,000	5,376	74,941	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,418	1,418	2,782	38,789	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	21,754	25,574	12,019	167,555	エネルギー
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	370	370	270	3,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	1,433	19,976	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,420	2,420	2,117	29,517	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	610	751	6,646	92,650	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	2,580	2,580	1,904	26,542	公益事業
TOWNGAS CHINA CO LTD	460	460	264	3,680	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,043	1,043	679	9,469	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	3,580	5,780	1,017	14,180	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	975	1,655	2,158	30,092	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	870	12,133	素材
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	—	800	1,846	25,738	各種金融
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	520	1,279	2,169	30,243	運輸
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	620	1,340	1,760	24,544	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,360	1,722	5,983	83,416	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	1,520	21,201	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,210	4,710	7,319	102,031	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,360	3,360	1,068	14,894	不動産

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末	評 価 額		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	860	860	3,925	54,727	公益事業
BYD CO LTD-H	495	685	2,702	37,670	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	11,000	13,560	4,515	62,945	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,920	1,920	2,142	29,869	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	14,500	1,957	27,287	メディア・娯楽
SINOTRANS LIMITED-H	1,100	1,100	276	3,848	運輸
MAANSHAN IRON & STEEL-H	—	2,920	867	12,089	素材
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD-R	3,850	3,850	2,402	33,495	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,660	1,660	834	11,639	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	6,132	6,132	6,218	86,689	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,240	1,240	467	6,516	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,754	1,754	1,813	25,282	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	2,037	3,527	2,412	33,634	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	6,670	7,100	15,087	210,319	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	7,290	2,157	30,080	素材
MMG LIMITED	1,680	1,680	312	4,355	素材
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	—	1,440	396	5,520	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	1,080	2,440	2,252	31,394	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,650	2,650	2,607	36,349	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	1,438	2,118	2,931	40,862	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	860	860	296	4,135	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,990	1,990	459	6,408	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	380	380	576	8,030	資本財
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	1,480	2,280	2,704	37,694	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	280	460	2,182	30,426	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	2,220	2,720	4,624	64,458	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,660	1,660	619	8,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,420	1,420	5,956	83,039	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	630	8,795	運輸
CNOOC LTD-R	15,380	17,120	21,742	303,089	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	5,790	7,260	8,566	119,421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	2,270	—	—	—	運輸
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,570	2,570	7,748	108,014	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	5,015	5,517	180,516	2,516,396	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	4,465	5,255	49,449	689,326	保険
LI NING CO LTD	—	1,940	4,956	69,096	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	4,080	6,100	2,513	35,034	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	5,939	5,939	427	5,961	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,650	6,660	1,125	15,690	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	1,180	1,180	897	12,517	運輸
ZTE CORP-H	485	829	1,927	26,870	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	1,680	1,680	418	5,831	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	2,870	3,440	5,552	77,397	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	1,465	1,465	462	6,453	運輸

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	9,474	9,474	5,220	72,774	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	1,700	1,224	17,062	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	84,226	91,176	58,991	822,334	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	700	700	7,637	106,459	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	2,151	29,998	自動車・自動車部品
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,420	1,420	1,601	22,328	不動産
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,290	1,290	1,006	14,026	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,300	3,300	2,442	34,041	素材
BANK OF CHINA LTD-H	74,082	77,262	25,573	356,497	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,095	2,095	337	4,701	不動産
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	1,325	1,325	3,630	50,609	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	560	—	—	—	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	688	1,352	1,806	25,179	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,574	3,764	15,169	211,467	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	62,395	62,625	36,698	511,574	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	905	905	779	10,862	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	576	8,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	3,500	3,120	1,691	23,573	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	6,170	3,950	2,472	34,469	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	980	980	312	4,357	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	350	350	667	9,309	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	395	623	1,909	26,618	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,160	1,160	2,685	37,434	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,030	1,030	288	4,020	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	6,572	7,702	8,904	124,128	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	3,360	3,360	913	12,740	素材
CHINA CITIC BANK-H	9,512	9,512	4,508	62,851	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	890	890	754	10,520	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	611	743	9,718	135,475	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,110	1,110	8,702	121,311	耐久消費財・アパレル
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	3,202	44,643	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	5,780	3,213	44,798	不動産
CHINA AOYUAN GROUP LTD	—	690	789	11,003	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	1,875	5,285	1,622	22,621	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	—	1,940	857	11,953	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	1,130	1,130	334	4,662	不動産
KINGSOFT CORP LTD	660	660	1,264	17,627	ソフトウェア・サービス
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	10,350	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	425	425	604	8,424	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	3,000	4,740	2,341	32,641	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	628	8,765	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	850	850	1,259	17,560	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	1,915	1,915	1,723	24,025	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	3,790	5,600	3,757	52,380	食品・飲料・タバコ

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,264	2,708	8,259	115,136	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	2,380	1,860	3,712	51,753	不動産
CRRC CORP LTD-H	5,110	5,110	2,841	39,609	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,950	1,950	1,770	24,682	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	1,310	1,310	293	4,090	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	796	796	258	3,606	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	996	996	2,833	39,500	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	2,100	2,100	1,890	26,346	素材
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	1,430	1,430	244	3,408	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2,523	2,523	2,210	30,814	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	—	1,015	457	6,381	素材
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	4,630	1,510	638	8,903	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,530	2,530	1,138	15,870	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,918	26,741	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,060	3,060	914	12,754	公益事業
SIHUA PHARMACEUTICAL HLDGS	3,210	3,210	353	4,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,110	2,340	8,962	124,933	不動産
YUZHOU PROPERTIES CO	1,000	1,040	376	5,252	不動産
LONGFOR PROPERTIES	1,235	1,785	5,881	81,989	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	670	1,156	3,849	53,661	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	5,514	5,514	3,126	43,582	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,560	1,560	549	7,654	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	264	314	302	4,212	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	2,230	6,850	2,568	35,808	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	24,180	29,290	9,694	135,148	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	420	420	1,180	16,451	小売
FAR EAST HORIZON LTD	1,410	1,410	1,037	14,466	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,990	1,990	3,072	42,831	各種金融
FUTURE LAND DEVELOPMENT HOLD	1,280	1,280	1,091	15,220	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,000	1,000	1,242	17,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	2,768	2,768	2,341	32,643	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	600	715	3,689	51,430	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE’S INSURANCE CO GROU-H	6,920	6,920	2,311	32,219	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	555	555	1,304	18,181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,760	2,760	1,587	22,122	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	715	715	338	4,714	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	3,285	3,285	1,428	19,919	各種金融
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LIMITED	6,500	—	—	—	半導体・半導体製造装置
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	920	920	740	10,323	自動車・自動車部品
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,350	4,350	0.00004	—	食品・飲料・タバコ
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	1,800	1,587	22,131	商業・専門サービス
JIAYUAN INTERNATIONAL GROUP	700	—	—	—	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	592	592	745	10,398	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	2,020	7,300	3,869	53,933	銀行

銘 柄		当期首(前期末)	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING		—	340	1,834	25,570	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP		640	820	1,558	21,718	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD		1,820	1,360	3,699	51,566	商業・専門サービス
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT		2,500	2,500	577	8,050	自動車・自動車部品
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN		—	270	321	4,486	消費者サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H		29,180	41,560	7,023	97,909	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B		—	8,238	7,282	101,516	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTEC CO LTD-H		—	276	2,703	37,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN DIANPING-CLASS B		—	1,027	9,715	135,432	小売
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI		—	370	1,341	18,697	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD		1,517	2,244	1,021	14,236	半導体・半導体製造装置
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H		8,320	8,320	1,414	19,716	各種金融
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L		940	940	1,159	16,169	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		1,595	1,595	5,064	70,593	資本財
CHINA VANKE CO LTD-H		1,208	1,740	4,967	69,249	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD		815	815	541	7,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAR INC		420	—	—	—	運輸
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD		450	450	683	9,522	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H		13,420	13,420	2,791	38,911	公益事業
FULLSHARE HOLDINGS LTD		5,575	—	—	—	資本財
BAIC MOTOR CORP LTD-H		1,170	1,170	594	8,285	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H		1,056	886	775	10,806	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H		272	272	665	9,270	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		1,588	1,588	2,007	27,980	各種金融
3SBIO INC		1,190	1,190	1,627	22,693	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGEND HOLDINGS CORP-H		211	211	370	5,164	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC		1,575	1,575	1,138	15,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME		9,270	9,270	1,140	15,894	各種金融
CHINA LITERATURE LTD		118	322	1,001	13,959	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD		1,140	1,140	774	10,790	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DALI FOODS GROUP CO LTD		1,205	1,205	650	9,070	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H		570	2,360	1,118	15,593	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHONG SING HOLDINGS FINTECH		11,480	—	—	—	各種金融
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H		11,400	2,390	315	4,397	保険
MEITU INC		1,430	1,430	240	3,348	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOC AVIATION LTD		325	325	2,489	34,703	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H		107	457	1,190	16,595	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H		636	1,320	1,964	27,380	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC		390	545	4,875	67,957	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD		16,560	16,560	198	2,770	小売
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B		455	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV		—	6,500	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	823,722	888,643	928,695	12,946,021	
	銘 柄 数 <比 率>	205	207	—	<20.8%>	

銘 柄	当期首(前期末)	当	期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額	邦貨換算金額 (千円)	
			外 貨 建 金 額		
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	1,302	1,302	539	14,214	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	141	3,736	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	4,315	4,446	2,400	63,312	銀行
DIGI.COM BERHAD	3,117	3,117	1,464	38,631	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	535	535	455	11,998	運輸
RHB BANK BHD	531	2,064	1,191	31,407	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	382	378	9,972	資本財
GAMUDA BHD	1,392	1,392	524	13,838	資本財
YTL CORPORATION BERHAD	2,523	2,523	229	6,055	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	149	149	258	6,804	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	612	1,045	27,573	銀行
IJM CORP BHD	1,981	1,981	425	11,231	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	548	548	1,234	32,543	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	85	85	294	7,764	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	3,523	3,598	3,177	83,779	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	706	706	196	5,175	銀行
MISC BHD	1,250	1,250	1,035	27,301	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	69	69	1,005	26,510	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	526	526	960	25,338	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	251	595	15,699	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	755	755	1,232	32,492	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	109	109	192	5,087	食品・飲料・タバコ
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	265	7,013	電気通信サービス
SP SETIA BHD	1,809	1,851	244	6,443	不動産
TENAGA NATIONAL BHD	2,944	2,944	4,075	107,471	公益事業
UMW HOLDINGS BHD	340	—	—	—	自動車・自動車部品
QL RESOURCES BHD	—	832	604	15,928	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	2,229	4,136	1,423	37,524	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	2,564	2,985	5,952	156,967	銀行
AIRASIA GROUP BHD	648	648	125	3,315	運輸
TOP GLOVE CORP BHD	984	984	428	11,287	ヘルスケア機器・サービス
MY EG SERVICES BHD	3,203	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GENTING BHD	2,053	2,053	1,274	33,619	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	2,241	3,697	1,201	31,684	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	1,796	1,796	779	20,559	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	1,672	1,672	382	10,099	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	720	1,586	848	22,375	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,783	2,816	1,230	32,460	電気通信サービス
MAXIS BHD	1,355	2,679	1,449	38,219	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,101	2,101	1,607	42,383	素材
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	1,185	—	—	—	メディア・娯楽
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	2,293	1,263	33,316	ヘルスケア機器・サービス
FGV HOLDINGS BHD	803	—	—	—	食品・飲料・タバコ

銘 柄		当期首(前期末)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価	額	
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
WESTPORTS HOLDINGS BHD		700	700	297	7,845	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN		1,443	1,443	688	18,150	素材
SIME DARBY PROPERTY BHD		1,672	1,672	122	3,241	不動産
SIME DARBY PLANTATION BHD		1,672	2,470	1,232	32,507	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP SDN BHD		1,538	—	—	—	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	66,264	68,612	44,478	1,172,885	
	銘 柄 数 <比 率>	47	43	—	<1.9%>	
(タイ)				千タイバツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED		162	519	9,238	33,257	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR		678	1,027	5,057	18,208	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR		2,472	4,386	7,369	26,529	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR		—	543	4,126	14,856	公益事業
ROBINSON PCL-NVDR		348	348	2,288	8,237	小売
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		1,480	1,475	17,478	62,923	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR		6,077	9,614	4,999	17,997	電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR		516	783	11,940	42,986	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR		13,365	13,365	1,951	7,024	銀行
IRPC PCL - NVDR		5,728	8,295	3,052	10,989	エネルギー
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		1,185	3,648	4,450	16,022	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR		232	232	8,027	28,897	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR		—	2,437	16,449	59,219	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		3,407	3,407	9,028	32,502	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		1,059	1,059	24,357	87,685	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		2,316	4,712	7,869	28,330	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR		323	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR		9,612	10,978	49,949	179,819	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		2,400	2,400	3,384	12,182	食品・飲料・タバコ
LAND & HOUSES PUB - NVDR		1,323	8,720	8,807	31,705	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR		272	734	28,846	103,846	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR		4,281	4,281	34,355	123,678	運輸
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		1,264	1,264	19,402	69,848	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR		1,321	1,725	11,428	41,141	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		4,557	8,196	19,342	69,633	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR		256	328	4,313	15,527	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		1,618	3,233	12,043	43,355	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR		1,201	1,201	8,737	31,454	エネルギー
GLOW ENERGY PCL - NVDR		296	—	—	—	公益事業
CP ALL PCL-NVDR		4,080	5,668	44,635	160,687	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		3,675	4,711	6,406	23,065	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		1,247	1,247	15,525	55,890	エネルギー
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR		—	660	4,158	14,968	電気通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		1,019	2,064	6,811	24,520	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		2,249	2,249	12,483	44,941	素材
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		1,855	1,855	8,301	29,884	公益事業

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO		3,912	8,170	8,823	31,764	運輸
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR		—	524	8,960	32,257	公益事業
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR		—	898	5,500	19,800	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	85,787 34	126,957 37	459,900 —	1,655,643 <2.7%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC		6,370	6,370	29,939	64,668	不動産
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		2,379	2,379	13,324	28,781	資本財
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS		598	598	5,834	12,603	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		5,906	5,906	6,272	13,547	資本財
DMCI HOLDINGS INC		3,454	3,454	2,635	5,693	資本財
GLOBE TELECOM INC		17	46	8,911	19,247	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC		632	1,445	17,889	38,640	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC		2,303	2,303	18,083	39,059	資本財
JOLLIBEE FOODS CORPORATION		610	610	13,910	30,046	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST		515	1,612	10,894	23,533	銀行
BDO UNIBANK INC		1,737	1,737	27,708	59,850	銀行
MEGAWORLD CORP		6,380	6,380	3,126	6,752	不動産
PLDT INC		62	62	6,909	14,925	電気通信サービス
ROBINSONS LAND CO		930	930	2,483	5,363	不動産
SECURITY BANK CORP		308	308	6,254	13,509	銀行
SM PRIME HOLDINGS INC		8,875	8,875	35,502	76,684	不動産
UNIVERSAL ROBINA CORP		633	633	9,602	20,740	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP		228	228	24,401	52,706	資本財
AYALA CORPORATION		223	223	18,980	40,998	資本財
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		7,357	23,557	10,954	23,660	各種金融
ABOITIZ POWER CORP		895	895	3,544	7,655	公益事業
MANILA ELECTRIC COMPANY		291	291	10,182	21,994	公益事業
GT CAPITAL HOLDINGS INC		63	68	6,172	13,331	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	50,772 23	68,917 23	293,516 —	633,995 <1.0%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
BARITO PACIFIC TBK PT		—	41,347	4,052,006	31,605	素材
UNITED TRACTORS TBK PT		1,289	2,009	4,675,947	36,472	エネルギー
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT		4,291	4,291	3,325,525	25,939	食品・飲料・タバコ
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		17,212	21,527	14,261,637	111,240	自動車・自動車部品
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT		9,799	7,923	6,021,480	46,967	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT		308	596	3,188,600	24,871	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		9,179	9,179	1,890,874	14,748	食品・飲料・タバコ
INDOCEMENT TUNGGA PRAKARSA		1,900	1,900	3,904,500	30,455	素材
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK		2,442	2,442	2,002,440	15,619	素材
BUKIT ASAM TBK PT		—	4,473	1,154,034	9,001	エネルギー
BANK DANAMON INDONESIA TBK		1,965	—	—	—	銀行
BANK MANDIRI		18,180	18,180	12,908,481	100,686	銀行

銘 柄		当期首(前期末)	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB		1,855	—	—	—	小売
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT		—	867	1,023,060	7,979	素材
UNILEVER INDONESIA TBK PT		1,186	1,186	5,117,590	39,917	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA		48,861	52,460	20,931,540	163,266	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT		7,915	7,915	1,583,000	12,347	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT		8,102	8,102	6,218,285	48,502	銀行
KALBE FARMA TBK PT		12,534	27,559	4,368,101	34,071	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK		2,346	2,346	3,008,745	23,468	素材
BANK CENTRAL ASIA PT		8,312	9,150	28,731,000	224,101	銀行
TELEKOMUNIKASI INDONESIA		45,431	45,431	18,672,141	145,642	電気通信サービス
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT		1,235	1,235	629,850	4,912	運輸
BUMI SERPONG DAMAI PT		6,834	6,834	960,177	7,489	不動産
ADARO ENERGY PT		14,393	14,393	2,036,609	15,885	エネルギー
PAKUWON JATI TBK PT		16,104	16,104	934,032	7,285	不動産
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		1,610	1,610	1,815,275	14,159	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		1,334	—	—	—	電気通信サービス
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO		8,946	6,691	1,264,599	9,863	銀行
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT		3,924	—	—	—	資本財
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		5,330	5,330	626,275	4,884	メディア・娯楽
小 計	株 数 ・ 金 額	262,817	321,080	155,305,805	1,211,385	
	銘 柄 数 <比 率>	28	27	—	<1.9%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
CHEIL COMMUNICATIONS INC		50	50	125,736	11,844	メディア・娯楽
HANMI SCIENCE CO LTD		6	6	26,281	2,475	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD		28	28	239,457	22,556	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS		25	31	731,934	68,948	保険
DB INSURANCE CO LTD		42	42	228,127	21,489	保険
WOONGJIN COWAY CO LTD		39	50	463,312	43,644	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP		106	106	1,063,182	100,151	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION		9	9	92,160	8,681	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION		14	45	185,831	17,505	公益事業
CJ CORP		12	12	111,930	10,543	資本財
KAKAO CORP		41	59	897,560	84,550	メディア・娯楽
SK TELECOM		16	21	525,624	49,513	電気通信サービス
DGB FINANCIAL GROUP INC		122	—	—	—	銀行
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD		39	41	389,620	36,702	資本財
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD		310	310	234,433	22,083	各種金融
NCSOFT CORPORATION		16	16	872,850	82,222	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP		279	141	197,296	18,585	電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES		33	—	—	—	資本財
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR		82	82	39,696	3,739	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP		59	59	113,772	10,717	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE		9	9	1,160,278	109,298	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD		44	44	1,432,828	134,972	素材

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	期末		業種
		株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	4	86,459	8,144	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	1	1	102,735	9,677	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	376	454	1,993,421	187,780	銀行
S-OIL CORPORATION	34	58	585,312	55,136	エネルギー
HANWHA CHEMICAL CORP	107	107	184,678	17,396	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	—	479	214,849	20,238	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	57	201,582	18,989	各種金融
POSCO CHEMICAL CO LTD	—	11	55,458	5,224	素材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	14	14	317,800	29,936	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	30	30	252,927	23,825	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	33	33	399,819	37,662	資本財
HYUNDAI MOBIS	55	64	1,552,188	146,216	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	513	521	4,294,578	404,549	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	63	63	289,014	27,225	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	30	30	224,023	21,103	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	131	143	1,784,856	168,133	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	72	72	238,623	22,478	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	180	283	347,042	32,691	銀行
KCC CORP	8	8	206,625	19,464	資本財
KIA MOTORS CORPORATION	268	253	1,093,145	102,974	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	7	7	340,213	32,048	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	244	244	660,609	62,229	公益事業
HANWHA CORPORATION	28	28	70,201	6,612	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	55	55	148,332	13,972	運輸
OCI COMPANY LTD	11	11	73,367	6,911	素材
CJ LOGISTICS	8	8	135,765	12,789	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10	10	80,296	7,563	素材
KT CORP	38	—	—	—	電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	91	110	764,718	72,036	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	23	23	87,808	8,271	資本財
HANSSEM CO LTD	6	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LG CORP	83	83	602,585	56,763	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	112	112	142,919	13,463	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	33	67	220,038	20,727	資本財
NAVER CORP	119	131	2,156,728	203,163	メディア・娯楽
HYUNDAI DEPT STORE CO	12	12	94,582	8,909	小売
DONGSUH COMPANIES INC	15	—	—	—	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	328,122	30,909	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.68	0.68	39,304	3,702	食品・飲料・タバコ
PACIFIC CORP	21	21	177,871	16,755	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	86	132	402,183	37,885	消費者サービス
POSCO	72	78	1,753,472	165,177	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	103	185	351,804	33,139	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	47	52	1,239,987	116,806	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	株数 (百株)	期末		業種
		評価額		金額		
					外貨建金額	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	45	56	649,948	61,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,215	4,610	24,022,736	2,262,941	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	371	371	270,087	25,442	資本財	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	767	796	3,394,794	319,789	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SHINSEGAE CO LTD	5	5	134,620	12,681	小売	
YUHAN CORPORATION	6	6	137,970	12,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANON SYSTEMS	190	190	219,450	20,672	自動車・自動車部品	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	43	91	257,558	24,261	保険	
GS HOLDINGS CORP	42	42	214,731	20,227	エネルギー	
LG DISPLAY CO LTD	187	240	349,029	32,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CELLTRION INC	75	91	1,724,524	162,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANA FINANCIAL GROUP	264	332	1,197,216	112,777	銀行	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	14	14	221,887	20,901	運輸	
LOTTE SHOPPING CO	10	10	137,522	12,954	小売	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	74	74	557,016	52,470	保険	
AMOREPACIFIC CORP	28	28	550,179	51,826	家庭用品・パーソナル用品	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7	7	68,231	6,427	家庭用品・パーソナル用品	
SAMSUNG CARD CO	18	18	66,465	6,261	各種金融	
SK INNOVATION CO LTD	61	55	904,932	85,244	エネルギー	
CJ CHEILJEDANG CORP	7	7	189,487	17,849	食品・飲料・タバコ	
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	136,636	12,871	運輸	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	9	—	—	—	商業・専門サービス	
LG INNOTEK CO LTD	14	14	173,337	16,328	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SK HOLDINGS CO LTD	27	38	1,041,511	98,110	資本財	
KB FINANCIAL GROUP INC	340	381	1,652,284	155,645	銀行	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	51	51	200,311	18,869	資本財	
BNK FINANCIAL GROUP INC	232	232	167,851	15,811	銀行	
HANMI PHARM CO LTD	4	4	156,084	14,703	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HANWHA LIFE INSURANCE	298	833	201,268	18,959	保険	
FILA KOREA LTD	—	40	253,368	23,867	耐久消費財・アパレル	
EMART	16	27	349,905	32,961	食品・生活必需品小売り	
GS RETAIL CO LTD	13	13	51,981	4,896	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE & TECHONOLGY CO	70	70	249,783	23,529	自動車・自動車部品	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	22	22	68,341	6,437	資本財	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	8	8	282,285	26,591	資本財	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	5	5	99,918	9,412	食品・生活必需品小売り	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	19	19	213,251	20,088	食品・飲料・タバコ	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	39	39	115,275	10,858	保険	
NETMARBLE CORP	24	24	231,710	21,827	メディア・娯楽	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	—	556	684,052	64,437	銀行	
SAMSUNG SDS CO LTD	31	31	622,639	58,652	ソフトウェア・サービス	
WOORI BANK	452	—	—	—	銀行	
SAMSUNG C&T CORP	63	77	789,455	74,366	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	15	15	609,570	57,421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘 柄		当期首(前期末)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
DOOSAN BOBCAT INC		43	43	141,517	13,330	資本財
CJ ENM CO LTD		8	8	128,484	12,103	小売
HLB INC		23	23	354,424	33,386	耐久消費財・アパレル
HELIXMITH CO LTD		10	16	157,864	14,870	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION PHARM INC		11	11	42,923	4,043	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDY-TOX INC		3	3	108,818	10,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP		3	3	67,566	6,364	メディア・娯楽
SILLAJEN INC		56	56	99,455	9,368	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD		24	60	314,840	29,657	ヘルスケア機器・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	13,340	15,374	78,463,067	7,391,220	
	銘 柄 数 <比 率>	115	112	—	<11.9%>	
(台湾)				千新台湾ドル		
ACER INC		2,558	2,558	4,681	16,805	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC		630	630	13,564	48,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP		629	609	13,712	49,227	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP		2,971	2,341	10,139	36,401	素材
WALSIN TECHNOLOGY CORP		270	270	4,644	16,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN BUSINESS BANK		1,996	4,766	6,053	21,730	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO		750	600	5,382	19,321	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD		287	287	2,700	9,695	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC		2,422	2,422	14,972	53,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP		421	421	1,981	7,114	不動産
EVA AIRWAYS CORP		1,511	1,641	2,355	8,456	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		577	577	16,098	57,792	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK		4,122	4,204	9,754	35,019	銀行
CHINA AIRLINES LTD		1,302	1,302	1,178	4,230	運輸
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD		1,770	1,770	8,560	30,733	自動車・自動車部品
CHINA STEEL		11,202	11,202	26,662	95,717	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD		1,631	3,077	8,033	28,839	保険
ADVANTECH CO LTD		564	284	8,762	31,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS		4,317	4,317	8,117	29,140	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC		1,869	1,869	26,072	93,601	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP		1,030	1,030	7,457	26,771	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		3,573	3,473	39,420	141,518	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP		10,400	9,450	7,598	27,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD		1,522	1,522	17,655	63,382	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE		1,258	1,329	1,695	6,086	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION		4,320	3,480	10,527	37,794	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD		329	362	7,404	26,581	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD		119	199	7,825	28,092	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD		530	530	11,245	40,371	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP		3,888	4,528	44,105	158,337	素材
FORMOSA TAFFETA CO.		400	400	1,378	4,947	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE		3,140	3,540	31,405	112,744	素材

銘 柄	当期首(前期末)	当	期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
GIANT MANUFACTURING	254	254	5,640	20,248	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,298	1,388	57,464	206,298	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	5,510	6,490	29,598	106,257	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	8,529	7,579	16,902	60,678	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	260	260	14,638	52,550	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,570	1,570	11,884	42,666	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	7,721	9,451	18,808	67,522	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,319	7,319	31,254	112,202	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,567	12,567	12,567	45,118	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	7,146	9,785	27,008	96,960	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	11,162	11,962	108,738	390,372	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	9,023	10,753	32,797	117,744	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	100	100	47,790	171,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	9,451	9,647	13,989	50,220	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	6,246	11,664	12,131	43,551	保険
INVENTEC CO LTD	3,495	2,805	6,381	22,910	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HTC CORPORATION	374	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	1,504	2,254	11,362	40,792	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,568	11,568	14,692	52,746	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	13,772	18,712	40,886	146,782	銀行
MACRONIX INTERNATIONAL	1,295	—	—	—	半導体・半導体製造装置
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	7,241	10,040	22,893	82,187	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	477	1,237	11,671	41,900	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	3,997	4,677	34,005	122,079	素材
WISTRON CORP	2,426	2,426	6,880	24,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	1,537	2,737	11,279	40,494	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	4,463	4,463	32,586	116,986	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	455	665	20,562	73,817	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,092	1,092	10,771	38,668	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	334	334	1,583	5,684	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	221	221	1,660	5,960	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	928	928	6,220	22,333	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	357	357	2,220	7,971	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,281	1,281	4,675	16,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	4,657	4,694	19,201	68,934	素材
TATUNG CO LTD	—	2,100	3,864	13,871	耐久消費財・アパレル
TECO ELECTRIC & MACHINERY	1,110	—	—	—	資本財
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	21,683	23,783	726,597	2,608,486	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	9,770	12,100	17,242	61,900	半導体・半導体製造装置
WINBOND ELECTRONICS CORP	2,040	2,040	3,396	12,193	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	227	227	6,988	25,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,770	1,770	6,460	23,193	運輸
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	7,750	7,750	5,401	19,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	1,436	1,436	5,467	19,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘 柄		当期首(前期末)	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
HIWIN TECHNOLOGIES CORP		206	212	5,606	20,127	資本財
PEGATRON CORP		1,594	1,594	10,732	38,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP		120	120	5,250	18,847	資本財
CHAILEASE HOLDING CO LTD		1,401	1,320	18,549	66,591	各種金融
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		219	759	11,198	40,202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL		7,472	7,696	16,239	58,298	銀行
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA		—	3,308	17,535	62,952	銀行
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT		2,933	3,793	29,700	106,624	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		160	160	4,744	17,030	耐久消費財・アパレル
GENERAL INTERFACE SOLUTION		140	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		890	890	5,776	20,736	半導体・半導体製造装置
PHISON ELECTRONICS CORP		115	115	3,415	12,263	半導体・半導体製造装置
TAIMED BIOLOGICS INC		130	130	1,729	6,207	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WIN SEMICONDUCTORS CORP		320	320	10,000	35,900	半導体・半導体製造装置
GLOBALWAFERS CO LTD		180	180	6,534	23,457	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	283,635 89	318,108 87	2,004,327 —	7,195,534 <11.6%>	
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD		2,502	2,753	398,018	612,948	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		661	661	33,241	51,192	エネルギー
ASIAN PAINTS LTD		249	249	44,799	68,991	素材
EICHER MOTORS LTD		13	12	27,198	41,886	自動車・自動車部品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD		629	756	43,888	67,587	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD		9	9	18,007	27,731	素材
ICICI BANK LTD		2,308	2,223	108,804	167,559	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP		594	594	17,467	26,900	エネルギー
STATE BANK OF INDIA		1,674	1,674	52,907	81,477	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD		66	264	15,103	23,258	運輸
LIC HOUSING FINANCE LTD		279	279	12,294	18,933	銀行
TATA STEEL LTD		258	258	10,282	15,835	素材
JSW STEEL LTD		802	802	20,071	30,909	素材
BRITANNIA INDUSTRIES LTD		27	51	16,131	24,841	食品・飲料・タバコ
NESTLE INDIA LIMITED		23	23	34,658	53,374	食品・飲料・タバコ
GAIL INDIA LTD		531	1,747	22,204	34,194	公益事業
VEDANTA LTD		1,105	1,987	30,909	47,599	素材
TITAN INDUSTRIES LTD		278	278	32,179	49,556	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD		1,028	2,527	34,949	53,822	エネルギー
LUPIN LTD		163	265	19,084	29,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAJAJ FINANCE LTD		176	167	69,591	107,171	各種金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		1,402	1,585	353,991	545,146	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE		493	794	22,848	35,186	メディア・娯楽
INFOSYS LTD		3,144	3,265	231,231	356,096	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD		890	1,187	30,437	46,874	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD		1,176	1,937	25,974	40,000	エネルギー

銘 柄	株 数 (百株)	当期首(前期末)	期 末		業 種
		株 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	596	596	124,537	191,787	家庭用品・パーソナル用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	458	527	60,643	93,391	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	581	581	27,524	42,387	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	32	103	27,419	42,226	自動車・自動車部品
DR. REDDY’S LABORATORIES	104	104	29,417	45,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	1,247	1,994	73,609	113,358	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	178	324	20,563	31,667	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	829	829	35,013	53,920	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI’S LABORATORIES LTD	—	90	15,398	23,713	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	94	105	75,843	116,798	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	160	160	4,593	7,074	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	203	203	8,946	13,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	768	768	9,931	15,294	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	121	190	21,235	32,702	各種金融
PETRONET LNG LTD	494	494	14,006	21,569	エネルギー
CIPLA LTD	313	313	14,479	22,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	354	445	63,445	97,706	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	73	92	38,449	59,211	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	1,436	1,436	10,992	16,928	資本財
BOSCH LTD	4	9	14,816	22,817	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	819	865	184,355	283,907	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	1,454	2,600	30,526	47,010	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	67	67	11,904	18,333	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YES BANK LTD	1,529	1,529	10,546	16,241	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	371	735	14,872	22,902	素材
BHARAT FORGE LTD	133	303	12,936	19,922	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,342	1,213	24,738	38,097	素材
ITC LTD	3,165	3,471	90,431	139,263	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	81	81	10,979	16,908	素材
UNITED PHOSPHORUS LTD	262	542	30,129	46,399	素材
SIEMENS INDIA LTD	53	—	—	—	資本財
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	279	384	28,251	43,507	家庭用品・パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	480	480	37,067	57,083	ソフトウェア・サービス
IDEA CELLULAR LTD	1,422	4,679	1,754	2,702	電気通信サービス
MARICO LTD	424	424	15,737	24,235	家庭用品・パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	6	6	14,666	22,586	耐久消費財・アパレル
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,132	1,667	31,963	49,223	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	625	625	24,144	37,182	運輸
REC LTD	481	481	6,683	10,292	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	31	31	27,929	43,011	保険
BAJAJ AUTO LTD	94	83	27,139	41,794	自動車・自動車部品
COAL INDIA LTD	419	1,473	30,829	47,476	エネルギー
TATA MOTORS LTD	1,470	1,470	24,858	38,282	自動車・自動車部品
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	509	—	—	—	資本財

銘 柄		当期首(前期末)	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
TATA POWER CO LTD		932	932	5,553	8,551	公益事業
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS		279	279	9,188	14,150	各種金融
BHARTI INFRATEL LTD		452	358	7,816	12,036	電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE L		269	269	6,504	10,017	銀行
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD		—	388	22,089	34,017	保険
BANDHAN BANK LTD		—	360	19,869	30,598	銀行
AXIS BANK LTD		1,520	2,000	145,139	223,515	銀行
HAVELLS INDIA LTD		234	234	16,609	25,578	資本財
CADILA HEALTHCARE LTD		105	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GRASIM INDUSTRIES LTD		273	273	21,162	32,590	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD		110	110	21,708	33,431	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA		—	91	12,053	18,561	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD		83	83	12,790	19,697	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	49,464 79	64,329 80	3,410,075 —	5,251,515 <8.4%>	
(パキスタン)				千パキスタンルピー		
MCB BANK LTD		533	533	10,243	7,170	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD		1,100	730	9,530	6,671	エネルギー
HABIB BANK LTD		665	665	9,005	6,303	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,298 3	1,928 3	28,779 —	20,145 <0.0%>	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR INSURANCE CO		189	1,896	584	17,446	保険
QATAR NATIONAL BANK		412	4,325	8,374	250,140	銀行
COMMERCIAL BANK QSC		203	2,039	903	26,992	銀行
OOREDOO QSC		72	728	535	15,982	電気通信サービス
DOHA BANK QSC		123	—	—	—	銀行
QATAR FUEL QSC		—	573	1,274	38,069	エネルギー
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		37	624	1,002	29,944	公益事業
INDUSTRIES QATAR		159	1,594	1,655	49,446	資本財
QATAR ISLAMIC BANK		82	1,142	1,770	52,886	銀行
MASRAF AL RAYAN		269	4,065	1,565	46,751	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		87	2,074	705	21,072	不動産
EZDAN HOLDING GROUP		677	—	—	—	不動産
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI		—	4,439	1,123	33,547	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,317 11	23,504 11	19,493 —	582,281 <0.9%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
BIDVEST GROUP LTD		277	277	5,955	43,716	資本財
CLICKS GROUP LTD		204	269	6,730	49,400	食品・生活必需品小売り
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		473	473	2,394	17,578	小売
DISCOVERY LIMITED		349	349	4,465	32,779	保険
GOLD FIELDS LTD		645	835	6,388	46,892	素材
REMGRO LTD		461	554	10,027	73,602	各種金融

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
THE FOSCHINI GROUP LIMITED		240	240	3,853	28,284	小売
EXXARO RESOURCES LTD		196	196	2,479	18,198	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		32	43	6,358	46,671	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD		62	62	724	5,316	保険
MTN GROUP LTD		1,426	1,565	15,156	111,248	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		484	384	10,877	79,842	素材
TELKOM SA LTD		113	113	703	5,166	電気通信サービス
FIRSTRAND LTD		2,843	3,126	21,370	156,860	各種金融
PSG GROUP LTD		184	184	4,517	33,161	各種金融
NASPERS LTD-N SHS		381	424	91,243	669,729	小売
CORONATION FUND MANAGERS LTD		101	—	—	—	各種金融
NEDBANK GROUP LTD		380	380	9,229	67,745	銀行
NETCARE LTD		991	991	1,695	12,447	ヘルスケア機器・サービス
PICK N PAY STORES LTD		521	622	4,283	31,443	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD		743	743	6,053	44,429	各種金融
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED		31	52	5,871	43,098	素材
SAPPI LIMITED		499	499	1,889	13,868	素材
SASOL LTD		482	570	16,844	123,641	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD		344	447	6,173	45,311	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD		212	212	3,436	25,223	小売
STANDARD BANK GROUP LTD		1,127	1,260	22,275	163,498	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE		146	232	4,689	34,419	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		836	836	4,987	36,608	小売
IMPERIAL HOLDINGS LTD		124	—	—	—	運輸
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		301	372	4,216	30,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABSA GROUP LTD		610	709	11,541	84,716	銀行
TIGER BRANDS LTD		130	130	3,053	22,415	食品・飲料・タバコ
SANLAM LTD		1,724	1,724	14,147	103,845	保険
INVESTEC LTD		288	288	2,479	18,198	各種金融
KUMBA IRON ORE LTD		53	53	1,961	14,397	素材
PIONEER FOODS LTD		88	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MONDI LTD		98	—	—	—	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		798	1,565	3,774	27,703	ヘルスケア機器・サービス
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED		680	680	1,395	10,243	保険
RAND MERCHANT INVESTMENT HD		404	1,360	4,248	31,186	保険
VODACOM GROUP		712	589	7,951	58,366	電気通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC		309	321	4,111	30,178	不動産
OLD MUTUAL LTD		4,070	4,896	9,973	73,204	保険
REINET INVESTMENTS SCA		116	116	3,212	23,579	各種金融
MULTICHOICE GROUP LTD		—	405	5,410	39,713	メディア・娯楽
BID CORP LTD		264	330	11,547	84,757	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	25,576 46	29,500 43	369,705 —	2,713,638 <4.4%>	
(アラブ首長国連邦)				千アラブ首長国 連邦ディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK		1,285	1,285	676	20,135	銀行

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦貨換算金額 (千円)
DUBAI INVESTMENTS PJSC		2,966	—	—	—	資本財
EMAAR PROPERTIES PJSC		3,006	3,006	1,241	36,961	不動産
EMAAR DEVELOPMENT PJSC		305	305	109	3,273	不動産
EMAAR MALLS PJSC		1,796	1,796	346	10,321	不動産
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO		1,812	—	—	—	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO		1,377	1,682	2,793	83,156	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		1,845	2,694	2,099	62,496	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		1,075	2,598	3,975	118,340	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC		2,714	6,372	1,459	43,444	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	18,185 10	19,742 8	12,701 —	378,130 <0.6%>	
(サウジアラビア)				千サウジアラビリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL		—	198	1,045	30,491	素材
JARIR MARKETING CO		—	50	806	23,513	小売
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE		—	66	449	13,112	保険
ETIHAD ETISALAT CO		—	344	755	22,017	電気通信サービス
SAUDI BRITISH BANK		—	322	1,063	31,001	銀行
AL RAJHI BANK		—	1,204	7,517	219,198	銀行
BANK ALBILAD		—	323	840	24,497	銀行
BANK AL-JAZIRA		—	358	477	13,931	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI		—	483	1,700	49,600	銀行
RIYAD BANK		—	1,065	2,291	66,821	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP		—	1,016	2,953	86,135	銀行
SAUDI TELECOM CO		—	393	3,773	110,023	電気通信サービス
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO		—	145	1,129	32,933	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		—	734	6,723	196,057	素材
SAUDI CEMENT		—	74	501	14,631	素材
SAUDI ELECTRICITY CO		—	747	1,547	45,130	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP		—	210	453	13,227	素材
SAVOLA		—	253	784	22,865	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C		—	319	397	11,581	素材
ALMARAI CO		—	229	1,167	34,041	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY		—	461	432	12,606	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH		—	322	524	15,306	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO		—	98	465	13,579	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		—	661	696	20,319	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV		—	470	566	16,505	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE		—	235	484	14,138	エネルギー
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE		—	16	170	4,973	保険
ALINMA BANK		—	824	1,791	52,230	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO		—	368	1,538	44,851	素材
SAUDI AIRLINES CATERING CO		—	44	395	11,540	消費者サービス
NATIONAL COMMERCIAL BANK		—	1,194	5,387	157,103	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	13,240 31	48,832 —	1,423,968 <2.3%>	

銘 柄	株 数 (百株)	当期首(前期末)	期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
(中国オフショア)			千香港・オフショア人民元		
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	—	170	546	8,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	—	82	762	11,906	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	—	99	481	7,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	—	112	276	4,311	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	306	4,787	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	—	137	570	8,905	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	132	2,067	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	—	221	783	12,225	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	—	97	261	4,087	ヘルスケア機器・サービス
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	44	98	839	13,097	食品・飲料・タバコ
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	—	54	514	8,027	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	2,983	2,983	1,231	19,231	公益事業
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	166	1,683	5,800	90,549	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	226	226	180	2,811	資本財
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	—	1,394	833	13,012	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	—	268	600	9,370	食品・飲料・タバコ
IFLYTEK CO LTD - A	—	108	372	5,816	ソフトウェア・サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	—	240	680	10,621	銀行
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	2,321	1,845	1,223	19,094	各種金融
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	—	324	1,084	16,927	食品・飲料・タバコ
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	170	170	270	4,222	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	—	1,288	1,941	30,299	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	—	91	906	14,145	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	38	164	2,207	34,455	食品・飲料・タバコ
SUNING.COM CO LTD-A	—	458	493	7,699	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	—	1,146	415	6,493	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	—	250	467	7,301	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	—	185	1,176	18,369	耐久消費財・アパレル
MIDEA GROUP CO LTD-A	206	206	1,228	19,171	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	—	424	1,458	22,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PING AN BANK CO LTD-A	—	851	1,416	22,118	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	—	639	2,484	38,781	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	—	2,072	998	15,589	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	—	537	1,435	22,414	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	—	758	740	11,563	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	—	606	835	13,044	各種金融
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	169	201	258	4,040	資本財
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	—	248	407	6,355	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	—	455	427	6,669	銀行
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	—	371	572	8,930	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	—	68	578	9,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	—	63	476	7,436	資本財
IND & COMM BK OF CHINA-A	—	2,612	1,533	23,933	銀行

銘 柄	当期首(前期末) 株数 (百株)	当 期 株数 (百株)	期 末		業 種
			評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	3,536	1,276	19,926	銀行
CHINA MERCHANTS BANK-A	—	855	3,227	50,383	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	238	504	4,494	70,153	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	—	952	1,892	29,543	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	—	1,383	1,738	27,136	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	1,922	2,736	1,696	26,479	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	1,011	15,793	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	24	51	6,145	95,931	食品・飲料・タバコ
CITIC SECURITIES CO-A	—	432	968	15,118	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	—	182	669	10,457	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	—	444	257	4,019	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	688	1,040	1,872	29,221	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	613	1,223	947	14,795	運輸
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	—	2,109	1,088	16,987	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	—	4,943	2,634	41,126	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	—	1,194	912	14,239	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	—	343	1,010	15,779	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	—	580	327	5,106	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	—	7,492	4,465	69,702	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	—	387	217	3,389	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	—	294	1,285	20,073	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	—	562	913	14,255	各種金融
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	211	439	641	10,018	不動産
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	118	207	1,895	29,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
QINGDAO HAIER CO LTD-A	—	260	482	7,532	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	—	419	590	9,215	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	918	14,330	銀行
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	—	406	609	9,519	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	—	475	2,206	34,448	素材
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	—	140	402	6,287	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	210	210	188	2,935	メディア・娯楽
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	—	486	1,093	17,077	資本財
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	—	148	1,339	20,908	消費者サービス
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	1,458	4,610	608	9,498	素材
AIR CHINA LTD-A	259	259	229	3,586	運輸
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	—	1,632	721	11,260	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	414	6,465	運輸
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	—	343	880	13,738	自動車・自動車部品
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	236	236	331	5,175	素材
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	233	3,644	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	—	505	446	6,976	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	—	573	783	12,236	ヘルスケア機器・サービス
ZHONGJIN GOLD CORP-A	340	340	277	4,330	素材
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	107	149	450	7,033	素材

銘 柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額 邦貨換算金額 (千円)		
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A		104	316	754	11,784	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A		409	409	288	4,507	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A		—	405	325	5,082	食品・生活必需品小売り
SHENERGY COMPANY LIMITED-A		1,500	1,500	871	13,604	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A		400	400	216	3,371	運輸
LIAONING CHENG DA CO LTD-A		170	170	240	3,757	小売
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A		—	572	1,693	26,429	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A		984	3,746	932	14,560	運輸
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A		373	373	847	13,228	自動車・自動車部品
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A		633	633	192	3,003	運輸
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A		—	39	433	6,761	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A		—	195	301	4,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A		—	67	608	9,493	食品・飲料・タバコ
TONGWEI CO LTD-A		—	316	407	6,368	食品・飲料・タバコ
ANXIN TRUST CO LTD-A		319	319	138	2,161	各種金融
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A		—	163	367	5,737	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG ZHENENG ELECTRIC-A		1,133	—	—	—	公益事業
HLA CORP LTD-A		214	214	169	2,645	耐久消費財・アパレル
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A		—	383	323	5,045	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A		43	118	1,342	20,963	食品・飲料・タバコ
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A		—	1,738	874	13,646	公益事業
CHINA NUCLEAR ENGINEERING -A		318	—	—	—	資本財
HUAAN SECURITIES CO LTD-A		434	434	271	4,234	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A		—	578	416	6,505	銀行
CHINA FILM CO LTD-A		170	170	232	3,627	メディア・娯楽
ORIENT SECURITIES CO LTD-A		—	317	318	4,973	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A		83	83	361	5,642	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A		1,018	1,018	1,170	18,274	各種金融
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A		—	128	435	6,795	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	26,603	83,906	109,550	1,710,079	
	銘柄 数 <比 率>	46	114	—	<2.7%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	2,197,848	2,583,182	—	59,921,143	
	銘柄 数 <比 率>	943	1,031	—	<96.3%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当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、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	口数 (口)	当期首(前期末) 当 期 末			
		口数 (口)	評価額		邦貨換算金額 (千円)
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	308,400	8,937	51,032	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	—	43,300	4,795	27,379	
小 計	口数・金額 銘柄数<比率>	308,400 1	351,700 2	13,732 —	78,412 <0.1%>
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
SUL AMERICA SA-UNITS	16,562	16,562	837	21,922	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	28,000	39,900	1,858	48,685	
ENERGISA SA-UNITS	—	16,500	775	20,310	
KLABIN SA-UNIT	55,100	83,000	1,459	38,236	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	—	25,400	1,709	44,769	
小 計	口数・金額 銘柄数<比率>	99,662 3	181,362 5	6,640 —	173,924 <0.3%>
(トルコ)			千トルコリラ		
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	135,630	—	—	—	
小 計	口数・金額 銘柄数<比率>	135,630 1	— —	— —	— <—%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
REDEFINE PROPERTIES LTD	547,985	547,985	4,466	32,781	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	295,047	6,812	50,004	
FORTRESS REIT LTD-A	49,578	189,245	3,945	28,961	
FORTRESS REIT LTD-B	85,801	—	—	—	
RESILIENT REIT LTD	23,098	—	—	—	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	22,923	—	—	—	
小 計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,024,432 6	1,032,277 3	15,224 —	111,747 <0.2%>
合 計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,568,124 11	1,565,339 10	— —	364,084 <0.6%>

(注1) 邦貨換算金額は、当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、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 MSCI EMERG M	1,848	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末 率
	評 価	額	比
株 式		千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券		59,921,143	96.1
投 資 証 券		201,304	0.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他		162,780	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額		2,095,573	3.3
		62,380,800	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(62,325,338千円)の投資信託財産総額(62,380,800千円)に対する比率は99.9%です。

(注2) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=109.16円	1メキシコペソ=5.71円	1ブラジルレアル=26.19円
1チリペソ=0.146円	1コロンビアペソ=0.0327円	1ユーロ=120.25円
1イギリスポンド=139.65円	1トルコリラ=18.94円	1チェココルナ=4.72円
1ハンガリーフォリント=0.3605円	1ポーランドズロチ=28.19円	1香港ドル=13.94円
1マレーシアリンギット=26.37円	1タイバーツ=3.60円	1フィリピンペソ=2.16円
1インドネシアルピア=0.0078円	1韓国ウォン=0.0942円	1新台幣ドル=3.59円
1インドルピー=1.54円	1パキスタンルピー=0.70円	1カタールリアル=29.87円
1南アフリカランド=7.34円	1アラブ首長国連邦ディルハム=29.77円	1サウジアラビアリアル=29.16円
1香港・オフショア人民元=15.61円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2019年11月11日現在
(A) 資 産	62,538,944,370円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,605,956,562
株 式(評価額)	59,921,143,911
投資信託受益証券(評価額)	201,304,191
投 資 証 券(評価額)	162,780,354
未 収 入 金	255,660,297
未 収 配 当 金	45,372,200
差 入 委 託 証 拠 金	346,726,855
(B) 負 債	315,984,729
未 払 金	158,264,985
未 払 解 約 金	157,719,621
未 払 利 息	123
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	62,222,959,641
元 本	21,641,099,794
次 期 繰 越 損 益 金	40,581,859,847
(D) 受 益 権 総 口 数	21,641,099,794口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,752円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年11月13日 至 2019年11月11日
(A) 配 当 等 収 益	1,356,578,887円
受 取 配 当 金	1,343,051,163
受 取 利 息	10,556,307
そ の 他 収 益 金	3,043,746
支 払 利 息	△72,329
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,874,917,716
売 買 益	8,238,457,646
売 買 損	△5,363,539,930
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	119,509,917
取 引 益	372,317,907
取 引 損	△252,807,990
(D) そ の 他 費 用	△84,097,003
(E) 当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	4,266,909,517
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	31,319,588,723
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,137,657,416
(H) 解 約 差 損 益 金	△2,142,295,809
(I) 計 (E+F+G+H)	40,581,859,847
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	40,581,859,847

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

＜注記事項＞

※当ファンドの期首元本額は18,612,081,328円、期中追加設定元本額は4,226,155,080円、期中一部解約元本額は1,197,136,614円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,226,018,612円
DC新興国株式インデックス・オープン	4,234,127,011円
世界経済インデックスファンド	3,346,340,769円
DC世界経済インデックスファンド	2,974,985,965円
分散投資コア戦略ファンドS	1,121,980,051円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	462,186,782円
グローバル経済コア	455,493,089円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	429,925,000円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	352,022,725円
分散投資コア戦略ファンドA	343,089,679円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	219,772,619円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	210,909,297円
SMT インデックスバランス・オープン	114,889,824円
SMT 世界経済インデックス・オープン	56,807,786円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	32,889,811円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	20,918,752円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,781,144円
i-SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	18,446,830円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	1,388,661円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	36,269円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	33,160円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	29,706円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	26,252円

お知らせ

該当事項はありません。

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／国内／債券	
信 託 期 間	信託期間は2010年6月14日から無期限です。	
運 用 方 針	主として、「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等（短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。）を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 短期金融資産ファンド （適格機関投資家専用）	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	短期金融資産 マザーファンド	わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	FOFs用 短期金融資産ファンド （適格機関投資家専用）	外貨建資産への投資は行いません。
	短期金融資産 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	毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、分配を行います。 (1) 分配対象額の範囲 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。）等の全額とします。 (2) 分配対象額についての分配方針 委託者が、基準価額水準、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。	

FOFs用短期金融資産ファンド
（適格機関投資家専用）

運用報告書（全体版）

第10期（決算日 2020年9月25日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 騰 落 率	期 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
第 6 期 (2016年9月26日)	9,962	0	△0.1	35.9	—	4
第 7 期 (2017年9月25日)	9,941	0	△0.2	3.9	—	6
第 8 期 (2018年9月25日)	9,920	0	△0.2	3.7	—	9
第 9 期 (2019年9月25日)	9,897	0	△0.2	—	—	115
第10期 (2020年9月25日)	9,879	0	△0.2	—	—	15

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

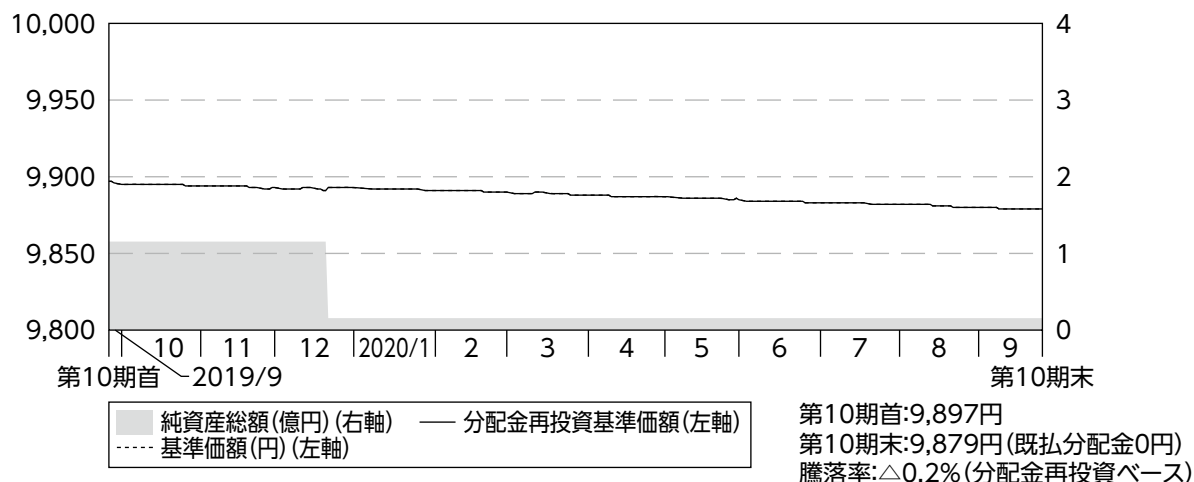
年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
(当 期 首) 2019年 9月25日	円 9,897	% —	% —	% —
9月末	9,895	△0.0	—	—
10月末	9,894	△0.0	—	—
11月末	9,893	△0.0	—	—
12月末	9,893	△0.0	—	—
2020年 1月末	9,891	△0.1	—	—
2月末	9,890	△0.1	—	—
3月末	9,888	△0.1	—	—
4月末	9,887	△0.1	—	—
5月末	9,885	△0.1	—	—
6月末	9,883	△0.1	—	—
7月末	9,882	△0.2	—	—
8月末	9,880	△0.2	—	—
(当 期 末) 2020年 9月25日	9,879	△0.2	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

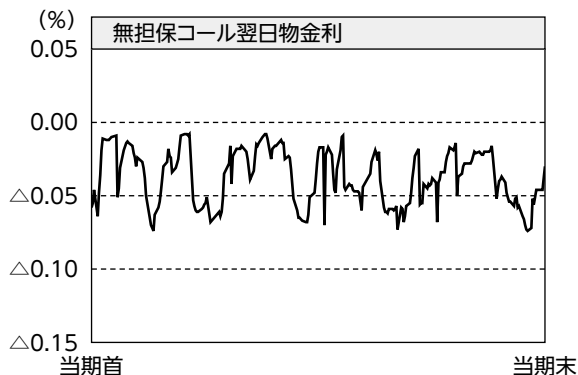


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2019年9月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～△0.01%近辺で推移しました。このような中、コールローン等の比率を高めた運用を行いましたが、マイナス利回りや信託報酬などの要因により、基準価額(分配金再投資ベース)は小幅に下落しました。

投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～△0.01%近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

主要投資対象である「短期金融資産 マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れ、これを維持しました。

【「短期金融資産 マザーファンド」の運用経過】

日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、市場運用ができない資金は受託銀行の金銭信託へ預け入れました。

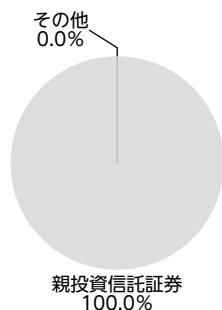
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

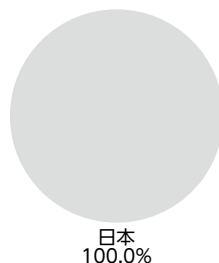
	当期末
	2020年9月25日
短期金融資産 マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

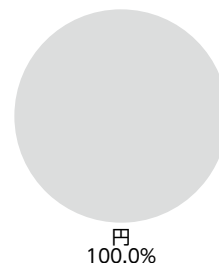
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用の基本方針に適した指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指数を特定しておりません。

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目		第10期
		2019年9月26日～2020年9月25日
当期分配金	(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	(円)	483

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

主として、短期金融資産 マザーファンドの受益証券への投資を通じて、わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年9月26日～2020年9月25日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.143%	(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9,888円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(11)	(0.110)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	－	－	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(商品)	(－)	(－)	
(先物・オプション)	(－)	(－)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(－)	(－)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(－)	(－)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	15	0.148	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注2) 各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。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 9	千円 9	千口 98,554	千円 99,805

利害関係人[※]との取引状況等

■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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.004352	百万円 0.004352	% 100.0	百万円 0.004352	百万円 0.004352	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	9	1	11.1	9	1	11.1

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<短期金融資産 マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 2,717	百万円 2,717	% 100.0	百万円 2,717	百万円 2,717	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	4,374,378	666,575	15.2	4,373,871	668,664	15.3

<平均保有割合 0.2%>

(注1) 平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

< 親投資信託残高 >

	当 期 首(前 期 末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
短 期 金 融 資 産 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 113,922	千口 15,377	千円 15,568

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,234,430千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
短 期 金 融 資 産 マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 15,568	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	21	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	15,589	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年9月25日現在
(A) 資 産	15,589,372円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	20,821
短期金融資産 マザーファンド(評価額)	15,568,469
未 収 入 金	82
(B) 負 債	13,176
未 払 信 託 報 酬	11,101
そ の 他 未 払 費 用	2,075
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	15,576,196
元 本	15,767,297
次 期 繰 越 損 益 金	△191,101
(D) 受 益 権 総 口 数	15,767,297口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,879円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年9月26日 至 2020年9月25日
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	29,549円
売 買 益	19,700
売 買 損	9,849
(B) 信 託 報 酬 等	△57,669
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	△28,120
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△28,372
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△134,609
(配 当 等 相 当 額)	(748,899)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△883,508)
(F) 計 (C+D+E)	△191,101
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	△191,101
追 加 信 託 差 損 益 金	△134,609
(配 当 等 相 当 額)	(748,899)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△883,508)
分 配 準 備 積 立 金	12,737
繰 越 損 益 金	△69,229

- (注1) (A) 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) (B) 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) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は116,655,179円、期中追加設定元本額は10,111円、期中一部解約元本額は100,897,993円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	－円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	748,899円
(D) 分配準備積立金額	12,737円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	761,636円
(F) 期末残存口数	15,767,297口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	483円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2020年3月14日)

短期金融資産 マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2020年9月25日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2007年9月26日から無期限です。
運用方針	わが国の短期金融資産等（短期公社債および短期金融商品を含みます。以下同じ。）を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の短期金融資産等を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		参 考 指 数		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰	中 落 率	期 騰	中 落 率			
第 9 期 (2016年9月26日)	円 10,153	% 0.0	10,116	% 0.0	% 36.0	% —	百万円 7,659
第10期 (2017年9月25日)	10,146	△0.1	10,111	△0.0	3.9	—	7,717
第11期 (2018年9月25日)	10,138	△0.1	10,106	△0.1	3.7	—	8,170
第12期 (2019年9月25日)	10,129	△0.1	10,100	△0.1	—	—	8,839
第13期 (2020年9月25日)	10,124	△0.0	10,096	△0.0	—	—	9,348

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
	期 騰	中 落 率	期 騰	中 落 率		
(当 期 首) 2019年 9月25日	円 10,129	% —	10,100	% —	% —	% —
9月末	10,128	△0.0	10,099	△0.0	—	—
10月末	10,128	△0.0	10,099	△0.0	—	—
11月末	10,128	△0.0	10,099	△0.0	—	—
12月末	10,127	△0.0	10,099	△0.0	—	—
2020年 1月末	10,127	△0.0	10,098	△0.0	—	—
2月末	10,127	△0.0	10,098	△0.0	—	—
3月末	10,126	△0.0	10,098	△0.0	—	—
4月末	10,126	△0.0	10,097	△0.0	—	—
5月末	10,126	△0.0	10,097	△0.0	—	—
6月末	10,125	△0.0	10,097	△0.0	—	—
7月末	10,125	△0.0	10,096	△0.0	—	—
8月末	10,124	△0.0	10,096	△0.0	—	—
(当 期 末) 2020年 9月25日	10,124	△0.0	10,096	△0.0	—	—

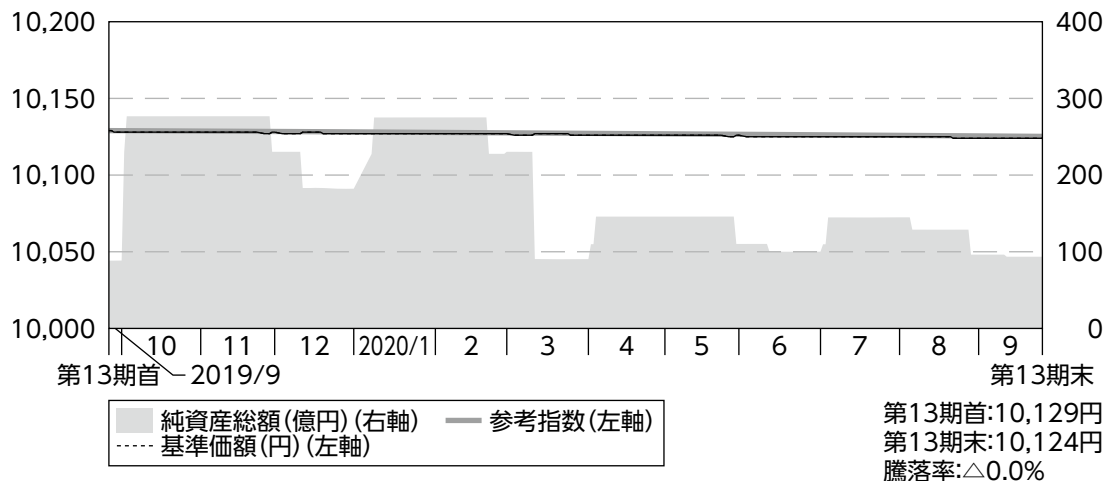
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

参考指数は、無担保コール翌日物金利の累積投資収益率で、設定日を10,000として指数化しております。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

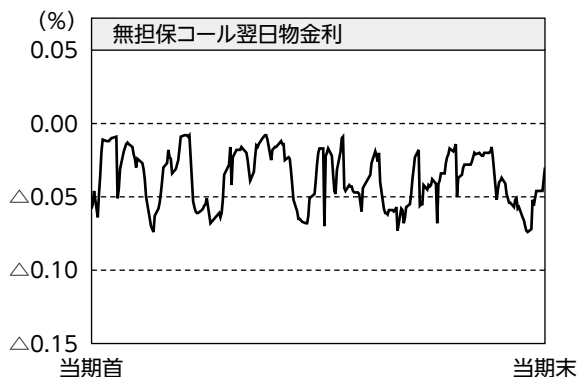


(注)参考指数は、2019年9月25日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～△0.01%近辺で推移しました。このような中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、基準価額は横ばい推移となりました。

投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～△0.01%近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等の比率を高めた運用を行い、市場運用ができない資金は受託銀行の金銭信託へ預け入れました。

当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

○資産別配分



短期金融資産等
100.0%

○国別配分



日本
100.0%

○通貨別配分



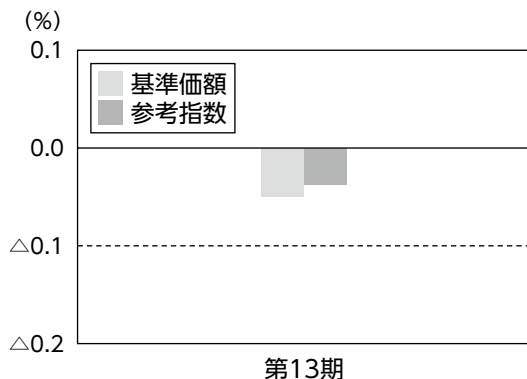
円
100.0%

(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



今後の運用方針

わが国の短期金融資産等(短期公社債および短期金融商品を含みます。)を中心に投資を行い、わが国の無担保コール翌日物金利の累積投資収益率を上回る運用成果をめざします。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2019年9月26日~2020年9月25日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)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。

(注2) 各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(10,126円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人※との取引状況等

■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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 2,717	百万円 2,717	% 100.0	百万円 2,717	百万円 2,717	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	4,374,378	666,575	15.2	4,373,871	668,664	15.3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 9,350,286	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	9,350,286	100.0

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

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年9月25日現在
(A)資 産	9,350,286,816円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,350,286,816
(B)負 債	1,441,891
未 払 解 約 金	1,430,082
未 払 利 息	11,809
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	9,348,844,925
元 本	9,234,430,779
次 期 繰 越 損 益 金	114,414,146
(D)受 益 権 総 口 数	9,234,430,779口
1万口当たり基準価額 (C/D)	10,124円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年9月26日 至 2020年9月25日
(A)配 当 等 収 益	△8,256,605円
受 取 利 息	62,186
支 払 利 息	△8,318,791
(B)そ の 他 費 用	△20,510
(C)当 期 損 益 金 (A+B)	△8,277,115
(D)前 期 繰 越 損 益 金	112,176,004
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	487,039,330
(F)解 約 差 損 益 金	△476,524,073
(G)計 (C+D+E+F)	114,414,146
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	114,414,146

(注1) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注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。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は8,727,644,976円、期中追加設定元本額は38,322,395,751円、期中一部解約元本額は37,815,609,948円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	6,760,615,573円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	2,321,282,475円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	83,124,453円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	40,627,081円
FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	15,377,785円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
ブラジル国債ファンド(毎月分配型)	2,120,953円
米国成長株式ファンド	493,486円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	352,611円
アメリカ高配当株オープン(毎月決算型)	296,510円
ブラジル国債ファンド(年2回決算型)	140,627円
アメリカ高配当株オープン(年2回決算型)	98,901円
日本株配当戦略投信2020-09(適格機関投資家専用)	9,878円
北米株配当戦略投信2018-08(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	9,878円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に
所要の変更を行いました。

(変更日:2020年3月14日)