

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	日立バランスファンド(株式70)	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型
	日立バランスファンド(株式50)	
	日立バランスファンド(株式30)	
信託期間	無期限	
運用方針	ベンチマークの動きに連動する投資成果を追求することにより、中長期的に投資信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要投資対象	日立バランスファンド(株式70)	以下の日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド、日立国内債券インデックスマザーファンド、日立外国株式インデックスマザーファンドおよび日立外国債券インデックスマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
	日立バランスファンド(株式50)	
	日立バランスファンド(株式30)	
	日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	わが国の証券取引所上場株式を主要投資対象とします。
	日立国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	日立外国株式インデックスマザーファンド	わが国を除く世界主要国・地域の株式を主要投資対象とします。
	日立外国債券インデックスマザーファンド	国際機関債およびわが国を除く世界主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日立バランスファンド(株式70)	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の80%以内とします。
	日立バランスファンド(株式50)	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以内、外貨建資産は、40%以内とします。
	日立バランスファンド(株式30)	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の40%以内、外貨建資産は、30%以内とします。
	日立国内株式TOPIX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は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。
	日立国内債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内、外貨建資産は、10%以内とします。
	日立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。
	日立外国債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。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	期中には分配を行わず、投資信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。	



日立バランスファンド(株式70)
日立バランスファンド(株式50)
日立バランスファンド(株式30)

運用報告書(全体版)

第19期

(決算日 2020年5月15日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。さて、日立バランスファンド(株式70)、日立バランスファンド(株式50)、日立バランスファンド(株式30)は、このたび、第19期の決算を行いました。ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

◎ 日立投資顧問株式会社

東京都千代田区神田練塀町3番地

〈運用報告書(全体版)に関するお問い合わせ先〉

企画総務グループ TEL : (03) 4554-5100

受付時間 : 9 : 00~17 : 00

土、日、祝日および12月31日~1月3日を除く

ホームページアドレス <http://www.hitachi-im.co.jp/>

■最近5期の運用実績

日立バランスファンド(株式70)

決算期	基準価額		複合ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率		騰落率					
15期(2016年5月16日)	17,758	△10.4	18,770	△10.2	67.2	2.2	29.4	—	17,347
16期(2017年5月15日)	20,454	15.2	21,677	15.5	67.9	2.0	28.8	—	19,493
17期(2018年5月15日)	22,493	10.0	23,910	10.3	67.7	2.2	28.9	—	21,985
18期(2019年5月15日)	21,572	△4.1	22,988	△3.9	67.2	1.9	29.8	—	22,796
19期(2020年5月15日)	21,213	△1.7	22,603	△1.7	67.8	2.2	28.8	—	22,157

(注1) 複合ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI総合指数、MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)ならびにFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分に応じて加重平均して求めた合成指数です。設定日の前営業日を10,000として指数化してあります。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日立バランスファンド(株式50)

決算期	基準価額		複合ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率		騰落率					
15期(2016年5月16日)	16,825	△6.0	17,680	△5.8	47.9	1.5	49.3	—	19,488
16期(2017年5月15日)	18,533	10.2	19,529	10.5	48.7	1.4	48.6	—	20,776
17期(2018年5月15日)	19,892	7.3	21,014	7.6	48.8	1.6	48.4	—	22,260
18期(2019年5月15日)	19,380	△2.6	20,517	△2.4	47.6	1.3	49.8	—	22,249
19期(2020年5月15日)	19,238	△0.7	20,341	△0.9	48.3	1.6	49.0	—	21,568

(注1) 複合ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI総合指数、MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)ならびにFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分に応じて加重平均して求めた合成指数です。設定日の前営業日を10,000として指数化してあります。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日立バランスファンド(株式30)

決算期	基準価額		複合ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率		騰落率					
15期(2016年5月16日)	15,596	△1.6	16,331	△1.4	28.7	0.8	69.0	—	7,217
16期(2017年5月15日)	16,414	5.2	17,233	5.5	29.3	0.8	68.6	—	7,612
17期(2018年5月15日)	17,187	4.7	18,082	4.9	29.2	0.9	68.6	—	8,093
18期(2019年5月15日)	16,988	△1.2	17,906	△1.0	28.3	0.7	69.5	—	8,624
19期(2020年5月15日)	16,987	△0.0	17,871	△0.2	28.7	0.9	69.0	—	8,526

(注1) 複合ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI総合指数、MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)ならびにFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分に応じて加重平均して求めた合成指数です。設定日の前営業日を10,000として指数化してあります。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

日立バランスファンド(株式70)

年 月 日	基 準 価 額		複 合 ベ ン チ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	円	騰 落 率				
(期 首) 2019年 5月15日	21,572	—	22,988	—	67.2	1.9	29.8	—
5月末	21,319	△1.2	22,725	△1.1	67.0	2.0	29.8	—
6月末	21,827	1.2	23,280	1.3	67.3	2.2	29.3	—
7月末	22,090	2.4	23,569	2.5	67.3	2.2	29.1	—
8月末	21,537	△0.2	22,980	△0.0	66.8	2.2	29.9	—
9月末	22,217	3.0	23,720	3.2	67.9	2.2	28.8	—
10月末	22,925	6.3	24,481	6.5	68.3	2.3	28.4	—
11月末	23,345	8.2	24,932	8.5	68.6	1.9	28.2	—
12月末	23,686	9.8	25,300	10.1	68.4	2.0	28.4	—
2020年 1月末	23,528	9.1	25,137	9.3	67.7	2.0	29.1	—
2月末	22,075	2.3	23,581	2.6	65.8	1.7	31.3	—
3月末	20,549	△4.7	21,878	△4.8	68.0	2.5	28.5	—
4月末	21,481	△0.4	22,882	△0.5	68.8	2.2	27.9	—
(期 末) 2020年 5月15日	21,213	△1.7	22,603	△1.7	67.8	2.2	28.8	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 複合ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI総合指数、MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)ならびにFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分に応じて加重平均して求めた合成指数です。設定日の前営業日を10,000として指数化してあります。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注4) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日立バランスファンド(株式50)

年 月 日	基 準 価 額		複 合 ベ ン チ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	円	騰 落 率				
(期 首) 2019年 5月15日	19,380	—	20,517	—	47.6	1.3	49.8	—
5月末	19,245	△0.7	20,380	△0.7	47.3	1.4	49.8	—
6月末	19,604	1.2	20,773	1.2	48.0	1.5	49.1	—
7月末	19,774	2.0	20,959	2.2	48.0	1.6	48.8	—
8月末	19,497	0.6	20,667	0.7	47.2	1.5	50.0	—
9月末	19,889	2.6	21,097	2.8	48.4	1.5	48.7	—
10月末	20,328	4.9	21,567	5.1	48.8	1.6	48.4	—
11月末	20,571	6.1	21,827	6.4	49.0	1.3	48.4	—
12月末	20,767	7.2	22,038	7.4	49.0	1.4	48.3	—
2020年 1月末	20,688	6.7	21,958	7.0	48.1	1.4	49.2	—
2月末	19,819	2.3	21,030	2.5	46.0	1.1	51.5	—
3月末	18,827	△2.9	19,886	△3.1	48.4	1.8	48.9	—
4月末	19,421	0.2	20,530	0.1	49.3	1.6	47.9	—
(期 末) 2020年 5月15日	19,238	△0.7	20,341	△0.9	48.3	1.6	49.0	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 複合ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI総合指数、MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)ならびにFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分に応じて加重平均して求めた合成指数です。設定日の前営業日を10,000として指数化してあります。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注4) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

日立バランスファンド(株式30)

年 月 日	基 準 価 額		複 合 ベ ン チ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率				
(期 首) 2019年 5月15日	円 16,988	% —		% —	% 28.3	% 0.7	% 69.5	% —
5月末	16,950	△0.2	17,870	△0.2	28.2	0.8	69.4	—
6月末	17,182	1.1	18,121	1.2	29.0	0.9	68.7	—
7月末	17,274	1.7	18,222	1.8	28.7	0.9	68.5	—
8月末	17,221	1.4	18,170	1.5	28.1	0.8	69.6	—
9月末	17,374	2.3	18,341	2.4	29.1	0.9	68.6	—
10月末	17,590	3.5	18,569	3.7	29.5	0.9	68.3	—
11月末	17,688	4.1	18,675	4.3	29.3	0.7	68.4	—
12月末	17,766	4.6	18,760	4.8	29.3	0.8	68.4	—
2020年 1月末	17,750	4.5	18,746	4.7	28.6	0.8	69.1	—
2月末	17,355	2.2	18,321	2.3	26.7	0.6	71.2	—
3月末	16,792	△1.2	17,651	△1.4	29.0	1.0	69.1	—
4月末	17,096	0.6	17,984	0.4	29.5	0.9	68.3	—
(期 末) 2020年 5月15日	16,987	△0.0	17,871	△0.2	28.7	0.9	69.0	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 複合ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)、NOMURA-BPI総合指数、MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)ならびにFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分に応じて加重平均して求めた合成指数です。設定日の前営業日を10,000として指数化してあります。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、各組入比率は実質比率を記載しております。

(注4) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

■当期中の市況推移

年 月 日	TOPIX(配当込み)		NOMURA-BPI総合指数		MSCIコクサイ指数 (除く日本、円ベース)		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・ 円ベース)	
		騰 落 率		騰 落 率		騰 落 率		騰 落 率
(期 首) 2019年 5月15日	2,323.81	% —	388.32	% —	30,102	% —	21,287	% —
5月末	2,275.96	△2.1	390.32	0.5	29,617	△1.6	21,362	0.4
6月末	2,338.89	0.6	392.69	1.1	30,691	2.0	21,638	1.7
7月末	2,360.18	1.6	393.15	1.2	31,533	4.8	21,704	2.0
8月末	2,280.58	△1.9	398.50	2.6	29,971	△0.4	21,847	2.6
9月末	2,418.29	4.1	394.27	1.5	30,939	2.8	21,949	3.1
10月末	2,539.02	9.3	392.61	1.1	32,173	6.9	22,166	4.1
11月末	2,588.40	11.4	391.33	0.8	33,378	10.9	22,179	4.2
12月末	2,625.91	13.0	390.14	0.5	34,396	14.3	22,276	4.7
2020年 1月末	2,569.77	10.6	391.77	0.9	34,444	14.4	22,461	5.5
2月末	2,305.76	△0.8	394.74	1.7	31,750	5.5	22,718	6.7
3月末	2,167.60	△6.7	388.45	0.0	26,978	△10.4	22,726	6.8
4月末	2,261.88	△2.7	389.79	0.4	29,635	△1.6	22,327	4.9
(期 末) 2020年 5月15日	2,246.06	△3.3	388.38	0.0	28,756	△4.5	22,382	5.1

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)は、MSCIコクサイ指数を基に、日立投資顧問が計算したもので、ファンド設定日前日である2001年12月4日を10,000としています。MSCIコクサイ指数はMSCI Inc.が開発した株価指数です。

(注3) FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年12月4日を10,000としています。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCが開発した債券指数です。

《当期中の運用経過》

■日立バランスファンド(株式70)

【期中の基準価額等の推移】

基準価額とベンチマークの推移



*期首を100として指数化

【基準価額の主な変動要因】

＜上昇要因＞

- ・国内株式は、2019年10月以降、米中間で第一段階の部分的合意に達する見込みが高まったことや、F R Bによる予防的利下げなどからリスクオンの展開となり、株価が上昇しプラスに影響しました。
- ・国内債券は、新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気低迷を受けて、日銀をはじめ各国の中央銀行が緩和的な金融政策スタンスを強化したことがプラスに影響しました。
- ・外国株式は、2019年10月以降、米中貿易協議における部分合意とその後の貿易協議進展期待に加え、良好な企業決算が好感され、主要指数が史上最高値を更新する展開となりプラスに影響しました。
- ・外国債券は、F R Bによる利下げや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大で景気の先行きに不透明感が高まった結果、金利が低下したことがプラスに影響しました。

＜下落要因＞

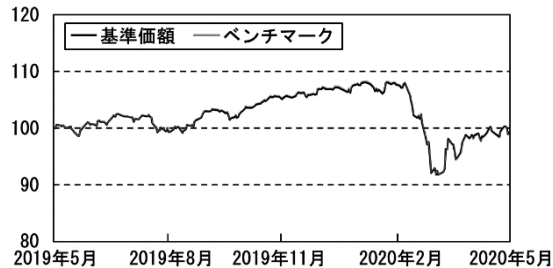
- ・国内株式は、2020年2月中旬以降、新型コロナウイルスの感染が欧米を中心に世界的に拡大し、渡航制限や外出自粛などによる需要蒸発や世界的なサプライチェーンの停滞から経済への甚大な影響は避けられず、景気鈍化懸念から株式市場が大きく下落しマイナスに影響しました。
- ・国内債券は、2019年後半、株価が堅調に推移したこと、期末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動の停滞を受けて、積極的な財政政策に伴う国債増発懸念がマイナスに影響しました。
- ・外国株式は、2020年2月中旬以降、新型コロナウイルスの感染が世界中に拡大し、世界景気の減速懸念が強まり株価が一気に調整したことがマイナスに影響しました。
- ・外国債券は、年明け以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景に相場が乱高下する局面において一時的に円高に振れたこと、金利が大幅に上昇したことなどがマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2019年5月15日	2020年1月20日	2020年3月17日	2020年5月15日
基準価額	21,572円	24,013円	18,959円	21,213円

■日立バランスファンド(株式50)

【期中の基準価額等の推移】

基準価額とベンチマークの推移



*期首を100として指数化

【基準価額の主な変動要因】

＜上昇要因＞

- ・国内株式は、2019年10月以降、米中間で第一段階の部分的合意に達する見込みが高まったことや、F R Bによる予防的利下げなどからリスクオンの展開となり、株価が上昇しプラスに影響しました。
- ・国内債券は、新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気低迷を受けて、日銀をはじめ各国の中央銀行が緩和的な金融政策スタンスを強化したことがプラスに影響しました。
- ・外国株式は、2019年10月以降、米中貿易協議における部分合意とその後の貿易協議進展期待に加え、良好な企業決算が好感され、主要指数が史上最高値を更新する展開となりプラスに影響しました。
- ・外国債券は、F R Bによる利下げや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大で景気の先行きに不透明感が高まった結果、金利が低下したことがプラスに影響しました。

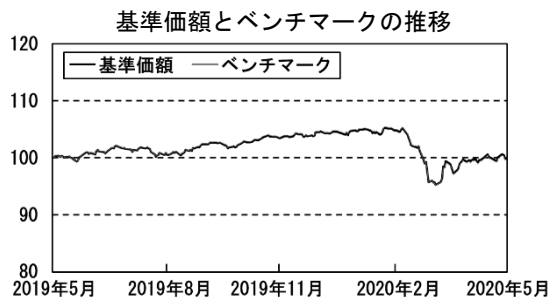
＜下落要因＞

- ・国内株式は、2020年2月中旬以降、新型コロナウイルスの感染が欧米を中心に世界的に拡大し、渡航制限や外出自粛などによる需要蒸発や世界的なサプライチェーンの停滞から経済への甚大な影響は避けられず、景気鈍化懸念から株式市場が大きく下落しマイナスに影響しました。
- ・国内債券は、2019年後半、株価が堅調に推移したこと、期末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動の停滞を受けて、積極的な財政政策に伴う国債増発懸念がマイナスに影響しました。
- ・外国株式は、2020年2月中旬以降、新型コロナウイルスの感染が世界中に拡大し、世界景気の減速懸念が強まり株価が一気に調整したことがマイナスに影響しました。
- ・外国債券は、年明け以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景に相場が乱高下する局面において一時的に円高に振れたこと、金利が大幅に上昇したことなどがマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2019年5月15日	2020年2月7日	2020年3月17日 2020年3月19日	2020年5月15日
基準価額	19,380円	20,954円	17,784円	19,238円

■日立バランスファンド(株式30)

【期中の基準価額等の推移】



*期首を100として指数化

【基準価額の主な変動要因】

〈上昇要因〉

- ・国内株式は、2019年10月以降、米中間で第一段階の部分的合意に達する見込みが高まったことや、FRBによる予防的利下げなどからリスクオンの展開となり、株価が上昇しプラスに影響しました。
- ・国内債券は、新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な景気低迷を受けて、日銀をはじめ各国の中央銀行が緩和的な金融政策スタンスを強化したことがプラスに影響しました。
- ・外国株式は、2019年10月以降、米中貿易協議における部分合意とその後の貿易協議進展期待に加え、良好な企業決算が好感され、主要指数が史上最高値を更新する展開となりプラスに影響しました。
- ・外国債券は、FRBによる利下げや、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大で景気の先行きに不透明感が高まった結果、金利が低下したことがプラスに影響しました。

〈下落要因〉

- ・国内株式は、2020年2月中旬以降、新型コロナウイルスの感染が欧米を中心に世界的に拡大し、渡航制限や外出自粛などによる需要蒸発や世界的なサプライチェーンの停滞から経済への甚大な影響は避けられず、景気鈍化懸念から株式市場が大きく下落しマイナスに影響しました。
- ・国内債券は、2019年後半、株価が堅調に推移したこと、期末にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に伴う経済活動の停滞を受けて、積極的な財政政策に伴う国債増発懸念がマイナスに影響しました。
- ・外国株式は、2020年2月中旬以降、新型コロナウイルスの感染が世界中に拡大し、世界景気の減速懸念が強まり株価が一気に調整したことがマイナスに影響しました。
- ・外国債券は、年明け以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を背景に相場が乱高下する局面において一時的に円高に振れたこと、金利が大幅に上昇したことなどがマイナスに影響しました。

	前期末	高 値	安 値	今期末
日 付	2019年5月15日	2020年2月7日	2020年3月19日	2020年5月15日
基準価額	16,988円	17,873円	16,184円	16,987円

【当ファンドのベンチマークとの差異】

※日立バランスファンド(株式70)

基準価額は前期末の21,572円から複合ベンチマークとほぼリンクして動き、21,213円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲1.7%となり、ベンチマーク騰落率▲1.7%に追隨したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となった一方、3月の相場が乱高下した局面でのリバランス効果がベンチマークを上回る主な要因となりました。

※日立バランスファンド(株式50)

基準価額は前期末の19,380円から複合ベンチマークとほぼリンクして動き、19,238円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲0.7%となり、ベンチマーク騰落率▲0.9%に追隨したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となった一方、3月の相場が乱高下した局面でのリバランス効果がベンチマークを上回る主な要因となりました。

※日立バランスファンド(株式30)

基準価額は前期末の16,988円から複合ベンチマークとほぼリンクして動き、16,987円で今期末を迎えました。通期の基準価額騰落率は▲0.0%となり、ベンチマーク騰落率▲0.2%に追隨したパフォーマンスとなりました。当ファンドから信託報酬の支払いが行われたことがベンチマークを下回る主な要因となった一方、3月の相場が乱高下した局面でのリバランス効果がベンチマークを上回る主な要因となりました。

【投資環境】

〈国内株式の市況〉

期初に米国が中国に対する追加関税(第3弾の2,000億ドル分に対し10%から25%へ関税引き上げ)を実施するとリスクオフの展開となり、日経平均株価は20,000円台前半まで調整しました。その後は、米欧中央銀行のハト派姿勢が強くと示されたことに加え、G20での米中首脳会談を契機に両国間での貿易摩擦懸念がやや後退したことが支援材料となり、戻す動きとなりました。

しかし、8月は米国が中国を為替操作国へ指定するなど米中貿易摩擦の激化が再燃したことや、米国で逆イールドが発生し、景気鈍化懸念の高まりから安全資産である円も買われました。結果、投資家のリスクオフ姿勢が強まり、株式市場はグローバルで全面安の展開となりました。

9月以降は、外部環境(香港政府が逃亡犯条例を正式撤回、英国の強制離脱懸念の緩和など)が次第に落ち着きを取り戻す中、FRBによる予防的利下げも実施され投資家心理の過度な悪化が後退しました。また、10月以降は、米中間で第一段階の部分的合意に達する見込みが高まり、加えてFRBによる3回目の予防的利下げも実施されたことで、リスクオンの展開となり、年末にかけて上昇基調が継続しました。

しかし、年明け以降は、イランの地政学リスクの台頭や中国での新型コロナウイルスの感染拡大への懸念から、弱含む動きとなりました。

その後、新型コロナウイルスの感染が欧米を中心に世界中に拡大しました。各国は外出規制や渡航制限などにより感染拡大防止に尽力するも、営業自粛等による需要蒸発や世界的なサプライチェーンの停滞から経済への甚大な影響は避けられず、景気鈍化懸念によりマーケット環境は一変しました。

リスク資産は大きく下落し、3月中旬に日経平均株価指数も一時17,000円を割り込みました。

ただし、各国政府や中央銀行が矢継ぎ早に財政出動や金融政策で対応したことが奏功し、3月中旬以降の株式市場は期末にかけて反転上昇し、急落前からの下落の約半値戻しとなりました。

結果、ベンチマークとするTOPIX(東証株価指数、配当込み)の当期の騰落率は▲3.3%となりました。

〈国内債券の市況〉

当期の国内長期金利は、日銀によるイールドカーブコントロール政策の下、期を通じて低水準で推移しました。

5月以降は、トランプ米大統領による対中関税の引き上げ表明によって通商問題悪化への懸念が高まったことや、欧米中央銀行の金融緩和に向けた姿勢が強まったことで、一段と金利低下が進み、8月には一時▲0.30%程度まで低下しました。9月に入ると、日銀の黒田総裁が過度な金利低下に対する警戒的な意見を表明したことや、日銀の国債買い入れ金額が減額されたことなどから、金利上昇に転じました。2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大による景気先行き不透明感の拡大から再び金利低下したのち、利益確定の売りや保有資産を現金へと逃避する動きを受けて金利上昇するなど上下に振れる展開となりました。

年限別にみると、中長期年限の金利が上昇した一方、超長期年限については高い利回りを求める安定した投資家需要に支えられて金利低下しました。その結果、イールドカーブはフラットニングが進みました。

スプレッド市場は拡大しました。新型コロナウイルスの感染拡大をきっかけとした急速な景気見通しの悪化を受けて、期末にかけて事業債のスプレッドは拡大しました。海外金融市場におけるリスク回避的な動きを反映して、円建外債のスプレッドも拡大しました。もっとも、本邦企業の健全な財務状況や緩やかな金融政策を背景に、海外金融市場に比べると小幅なスプレッド拡大にとどまりました。

当期の国内債券市場はNOMURA-BPI総合指数ベースで+0.0%となりました。

〈外国株式の市況〉

米国株式市場

5月にトランプ米大統領による対中関税引き上げ表明を受け、世界経済への悪影響が懸念され下落しましたが、G20での米中首脳会談開催期待や、米金融緩和と観測などを背景に、再び上昇へ転じました。

しかし、8月は、トランプ米大統領が対中関税第4弾の発動を表明したことに加え、香港やアルゼンチンの政治的混乱が嫌気され、弱含む展開となりました。その後は、良好な経済指標や米利下げ観測の台頭を背景に持ち直す局面がある一方、9月後半には、サウジアラビアの石油施設が攻撃され、地政学リスクの高まりから冴えない展開となるなど、ボックス圏の動きとなりました。

10月以降は、米中貿易協議における部分合意とその後の貿易協議進展期待に加え、良好な企業決算が好感され、主要指数が史上最高値を更新する展開が続きました。

しかし、2020年2月中旬以降は、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大を受け、世界景気の減速懸念が強まり、株価が一気に調整しました。米国政府の財政出動やFRBの緊急利下げ、量的緩和策の再開などにより、投資家心理が落ち着き、3月中旬以降は切り返して、期末にかけて上昇する展開となりました。ただし、通期ではマイナスとなりました。

欧州株式市場

欧州市場は、5月に英国のEU離脱を巡る先行き不透明感に加え、米国の対中関税引き上げ表明を嫌気して、下落しました。

6月以降は、米中貿易摩擦懸念の後退やイタリア財政問題への警戒感が和らいだことに加え、欧米の中央銀行による金融緩和期待を受けて、上昇基調となりました。しかし、8月に米国が対中関税第4弾の発動を表明したことなどが嫌気され、弱含みました。

9月以降は、中東情勢の悪化や低調なドイツ経済指標が嫌気され、相場の重石となる局面もありましたが、米中貿易協議進展期待や中国経済指標の改善が追い風となり、上昇基調が継続しました。

しかし、2020年2月下旬以降は、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大や、大幅な原油安が嫌気され、欧州株も大きく下落しました。各国政府や中央銀行が矢継ぎ早に財政出動や金融政策で対応したことで、投資家心理が落ち着き、3月中旬以降は切り返して、期末にかけて上昇する展開となりました。ただし、通期ではマイナスとなりました。

〈外国債券の市況〉

米国金利

市場の金融緩和期待が高まるなか、FRB(連邦準備制度理事会)は7月に利下げに舵を切り、9月、10月と3会合連続で政策金利を引き下げた結果、米国長期金利は5月の2.5%前後から、9月には1%半ばまで低下しました。追加利下げ観測の後退とともに、9月以降は1%台後半で安定的に推移しましたが、2月下旬から米国での新型コロナウイルス感染が急拡大し、株価が急落したことから再び大きく低下し、一時0.31%台をつけた後、0.6%台で期末を迎えました。年度では、短期ゾーンの低下幅が長期に比べ大きく「ブルスティープ」となりました。

ユーロ金利

ドイツ等コア国は、3月にやや上昇する局面もみられましたが、比較的落ち着いた展開が続き、年度を通してはやや低下しました。イタリアは、6月から緩和観測を背景に大きく低下し、9月に欧州中銀が大規模な緩和パッケージを発表した後は、緩やかな上昇に転じました。しかし3月以降、新型コロナウイルスの欧州での急拡大により、先行き不透明感が急速に高まり、イタリア、スペインの長期金利は急上昇し、欧州中銀による潤沢な流動性供給や量的緩和の拡大等で一旦低下に向かいましたが、4月以降も不安定な展開が続きました。

外国為替市況

米ドル・円レートは、期初より米国金利の低下等を背景に円高が進行しました。しかし、9月以降は株価の上昇からリスク選好が高まり、緩やかな上昇に転じました。年明け以降は新型コロナウイルス感染拡大を背景に乱高下し、3月には年度安値となる101円台を記録しましたが、投機的な動きに留まりその後は急反発し、年度では小幅の円高に留まりました。ユーロは、対ドルで安定的に推移しましたが、2月以降は新型コロナウイルス感染拡大を材料に乱高下し当期の高値と安値を記録し、小幅のユーロ安で期末を終えました。他の資源国、新興国通貨は、米中対立等を背景に神経質な展開が続きましたが、年明け以降、新型コロナウイルス感染拡大を背景に、グローバル景気後退懸念が高まり下落しました。

【当ファンドのポートフォリオ】

日立バランスファンド(株式70)、日立バランスファンド(株式50)、日立バランスファンド(株式30)については、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の4種類のインデックスマザーファンド受益証券を、規定の基本資産配分に従って組み入れ、運用を行いました。

期中では、各マザーファンドの値動きによって生じる基本資産配分からの乖離を修正するリバランスを随時行い、期を通して各マザーファンドの基本資産配分を維持いたしました。

期末における各マザーファンドの組入比率は、次のとおりです。

ファンド名 マザーファンド名	日立バランスファンド(株式70)			日立バランスファンド(株式50)			日立バランスファンド(株式30)		
	基本資産配分	実質組入率	差異	基本資産配分	実質組入率	差異	基本資産配分	実質組入率	差異
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	40.0%	40.1%	0.1%	30.0%	29.9%	△0.1%	20.0%	19.8%	△0.2%
日立国内債券 インデックスマザーファンド	20.0%	19.5%	△0.5%	40.0%	39.7%	△0.3%	60.0%	59.7%	△0.3%
日立外国株式 インデックスマザーファンド	30.0%	30.0%	0.0%	20.0%	19.9%	△0.1%	10.0%	9.8%	△0.2%
日立外国債券 インデックスマザーファンド	10.0%	9.5%	△0.5%	10.0%	9.6%	△0.4%	10.0%	9.7%	△0.3%

【今後の運用方針】

今後も、引き続き国内株式、国内債券、外国株式、外国債券の4種類のインデックスマザーファンド受益証券を、規定の基本資産配分に従って組み入れ、中長期的に投資信託財産の成長を目指した運用を行ってまいります。

日立バランスファンド(株式70)

■ 1 万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2019. 5. 16~2020. 5. 15)		
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	34円	0.154%	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22,214円です。 委託した資金の運用の対価 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)	(15)	(0.067)	
(販 売 会 社)	(10)	(0.043)	
(受 託 会 社)	(10)	(0.044)	
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕÷〔期中の平均受益権口数〕 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕÷〔期中の平均受益権口数〕 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	3	0.014	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕 保管費用は、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
(保 管 費 用)	(3)	(0.013)	
(そ の 他)	(0)	(0.002)	
合 計	37	0.170	

(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) 「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。

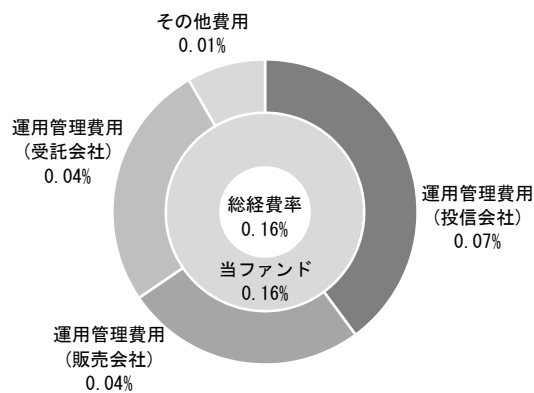
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

<参考情報>

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(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0.16%です。



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

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

(注)各比率は、年率換算した値です。

(注)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	656,481	1,026,700	554,593	904,500
日立国内債券インデックス マザーファンド	693,752	989,100	871,214	1,246,600
日立外国株式インデックス マザーファンド	503,646	1,109,400	407,068	1,026,600
日立外国債券インデックス マザーファンド	91,147	206,300	207,604	472,400

(注) 単位未満は切り捨て。

■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(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

項 目	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	日立外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,726,326千円	12,135,724千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,986,821千円	97,358,148千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.25	0.12

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■主要な売買銘柄(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

株式(日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	29.8	205,699	6,902	トヨタ自動車	23.51	169,102	7,192
NTTドコモ	41.4	119,843	2,894	ソニー	21.8	142,948	6,557
任天堂	2.6	101,918	39,199	ソフトバンクグループ	26.2	127,751	4,875
ソフトバンクグループ	20.5	98,993	4,828	KDDI	43.1	127,586	2,960
ソニー	15.8	98,482	6,233	キーエンス	2	104,020	52,010
三菱UFJフィナンシャル・グループ	179.5	89,638	499	武田薬品工業	24.5	94,675	3,864
日本電信電話	23.8	80,329	3,375	日本電信電話	22.2	81,415	3,667
日立製作所	19.5	75,683	3,881	本田技研工業	27.5	78,971	2,871
武田薬品工業	20.4	75,108	3,681	三菱UFJフィナンシャル・グループ	150.4	77,947	518
リクルートホールディングス	18.7	64,793	3,464	ソフトバンク	50.5	75,142	1,487

(注) 金額は受け渡し代金。

公社債(日立国内債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第138回 利付国債(5年)	916,038	第127回 利付国債(5年)	1,043,484
第402回 利付国債(2年)	805,616	第312回 利付国債(10年)	912,807
第357回 利付国債(10年)	743,054	第125回 利付国債(5年)	803,011
第140回 利付国債(5年)	734,257	第124回 利付国債(5年)	752,115
第356回 利付国債(10年)	713,077	第310回 利付国債(10年)	739,723
第141回 利付国債(5年)	659,729	第308回 利付国債(10年)	670,150
第355回 利付国債(10年)	618,768	第126回 利付国債(5年)	651,839
第350回 利付国債(10年)	596,520	第133回 利付国債(5年)	606,918
第354回 利付国債(10年)	594,575	第325回 利付国債(10年)	511,845
第142回 利付国債(5年)	559,531	第63回 利付国債(20年)	424,964

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

株式(日立外国株式インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	枚 数	金 額	平均単価	銘 柄	枚 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP(アメリカ)	19	311,229	16,125	APPLE INC(アメリカ)	4	126,318	26,316
APPLE INC(アメリカ)	10	277,706	26,961	BANK OF AMERICA CORP(アメリカ)	14	45,752	3,268
AMAZON COM INC(アメリカ)	1	265,017	203,859	JPMORGAN CHASE & CO(アメリカ)	3	43,020	13,036
FACEBOOK INC-A(アメリカ)	7	127,294	17,679	WELLS FARGO COMPANY(アメリカ)	8	41,916	4,817
PROSUS NV(オランダ)	12	104,505	8,237	ORACLE CORPORATION(アメリカ)	7	40,369	5,685
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.8	97,278	121,598	CITIGROUP INC(アメリカ)	5	35,237	7,047
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.8	97,265	121,582	PFIZER INC(アメリカ)	5	24,771	4,587
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A(アメリカ)	17	95,198	5,567	INTEL CORP(アメリカ)	4	23,434	5,579
NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	7	88,301	11,109	BOOKING HOLDINGS INC(アメリカ)	0.1	18,683	186,835
PROCTER & GAMBLE CO(アメリカ)	7	84,798	12,114	NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	1	18,258	11,305

(注) 金額は受け渡し代金。

公社債(日立外国債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	199,217	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	264,125
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,479	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	208,254
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,695	1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	174,107
2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,683	3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	162,702
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,976	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,925
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,928	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	144,559
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	151,535	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	143,524
1.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,070	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	134,765
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,033	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	133,482
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,226	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	128,420

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

<日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株 式	千円	千円	千円
	100,282	116,158	438,648

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立化成、日立金属、日立建機、日立製作所、日立ハイテク、日立キャピタル、日立物流です。

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
公 社 債	千円	千円	千円
	100,099	0	97,231

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立キャピタルです。

■組入資産の明細(2020年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	5,549,844	5,651,733	8,879,438
日立国内債券インデックスマザーファンド	3,226,570	3,049,108	4,324,246
日立外国株式インデックスマザーファンド	2,739,194	2,835,773	6,639,680
日立外国債券インデックスマザーファンド	1,037,998	921,541	2,110,422

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2020年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	8,879,438	39.8
日立国内債券インデックスマザーファンド	4,324,246	19.4
日立外国株式インデックスマザーファンド	6,639,680	29.7
日立外国債券インデックスマザーファンド	2,110,422	9.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	367,914	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	22,321,700	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 日立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(100,216,307千円)の投資信託財産総額(100,251,023千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 日立外国債券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(40,031,807千円)の投資信託財産総額(40,069,301千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=107.43円、1カナダドル=76.50円、1メキシコペソ=4.49円、1ユーロ=116.08円、1英ポンド=131.33円、1スイスフラン=110.35円、1スウェーデンクローナ=10.97円、1ノルウェークローネ=10.59円、1デンマーククローネ=15.57円、1ポーランドズロチ=25.46円、1オーストラリアドル=69.45円、1ニュージーランドドル=64.55円、1香港ドル=13.86円、1シンガポールドル=75.47円、1マレーシアリンギット=24.72円、1イスラエルシケル=30.32円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	22,321,700,104円
コール・ローン等	263,012,983
日立国内株式TOPIXインデックス マザーファンド(評価額)	4,324,246,335
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	8,879,438,239
日立外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,110,422,278
日立外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	6,639,680,269
未 収 入 金	104,900,000
(B) 負 債	163,988,484
未 払 解 約 金	145,825,449
未 払 信 託 報 酬	18,162,279
未 払 利 息	756
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	22,157,711,620
元 本	10,445,457,532
次 期 繰 越 損 益 金	11,712,254,088
(D) 受 益 権 総 口 数	10,445,457,532口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,213円

(注1) 当ファンドの期首元本額は10,567,991,472円、期中追加設定元本額は1,874,137,360円、期中一部解約元本額は1,996,671,300円です。
(注2) 1口当たり純資産額は2.1213円です。

■損益の状況

当期(自2019年5月16日 至2020年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△210,600円
支 払 利 息	△210,600
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△380,932,822
売 買 益	298,686,738
売 買 損	△679,619,560
(C) 信 託 報 酬 等	△42,541,700
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△423,685,122
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,192,316,374
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,943,622,836
(配 当 等 相 当 額)	(10,883,514,823)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,939,891,987)
(G) 計 (D + E + F)	11,712,254,088
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	11,712,254,088
追 加 信 託 差 損 益 金	7,943,622,836
(配 当 等 相 当 額)	(10,883,514,823)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△2,939,891,987)
分 配 準 備 積 立 金	4,903,886,186
繰 越 損 益 金	△1,135,254,934

(注1) 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2) 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3) 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4) 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(0円)、信託約款に規定する収益調整金(10,883,514,823円)および分配準備積立金(4,903,886,186円)より分配対象収益は15,787,401,009円(10,000口当たり15,114円)ですが、当期に分配した金額はありません。

<お知らせ>

2019年11月16日付で、日立バランスファンド(株式70)の信託報酬率を年率0.209%(税抜0.19%)から年率0.154%(税抜0.14%)に引き下げる約款変更を行いました。

日立バランスファンド(株式50)

■ 1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2019.5.16~2020.5.15)		
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	31円 (13) (9) (9)	0.154% (0.067) (0.043) (0.044)	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19,869円です。 委託した資金の運用の対価 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
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (新 株 予 約 権 証 券) (先 物 ・ オ フ シ ョ ン)	0 (0) (0) (0)	0.001 (0.000) (0.000) (0.000)	売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕÷〔期中の平均受益権口数〕 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式)	0 (0)	0.001 (0.001)	有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕÷〔期中の平均受益権口数〕 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	2 (2) (0)	0.010 (0.009) (0.001)	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕 保管費用は、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
合 計	33	0.166	

(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) 「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。

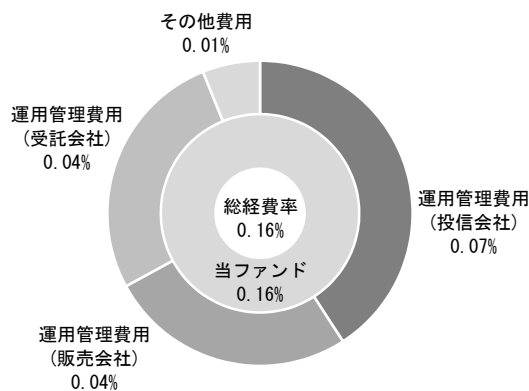
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

<参考情報>

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(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0.16%です。



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

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

(注)各比率は、年率換算した値です。

(注)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	663,289	1,014,800	576,951	954,100
日立国内債券インデックス マザーファンド	892,302	1,272,100	1,174,625	1,680,700
日立外国株式インデックス マザーファンド	405,793	885,100	343,638	851,400
日立外国債券インデックス マザーファンド	22,727	51,000	130,306	294,400

(注) 単位未満は切り捨て。

■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(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

項 目	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	日立外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,726,326千円	12,135,724千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,986,821千円	97,358,148千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.25	0.12

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■主要な売買銘柄(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

株式(日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	29.8	205,699	6,902	トヨタ自動車	23.51	169,102	7,192
NTTドコモ	41.4	119,843	2,894	ソニー	21.8	142,948	6,557
任天堂	2.6	101,918	39,199	ソフトバンクグループ	26.2	127,751	4,875
ソフトバンクグループ	20.5	98,993	4,828	KDDI	43.1	127,586	2,960
ソニー	15.8	98,482	6,233	キーエンス	2	104,020	52,010
三菱UFJフィナンシャル・グループ	179.5	89,638	499	武田薬品工業	24.5	94,675	3,864
日本電信電話	23.8	80,329	3,375	日本電信電話	22.2	81,415	3,667
日立製作所	19.5	75,683	3,881	本田技研工業	27.5	78,971	2,871
武田薬品工業	20.4	75,108	3,681	三菱UFJフィナンシャル・グループ	150.4	77,947	518
リクルートホールディングス	18.7	64,793	3,464	ソフトバンク	50.5	75,142	1,487

(注) 金額は受け渡し代金。

公社債(日立国内債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第138回 利付国債(5年)	916,038	第127回 利付国債(5年)	1,043,484
第402回 利付国債(2年)	805,616	第312回 利付国債(10年)	912,807
第357回 利付国債(10年)	743,054	第125回 利付国債(5年)	803,011
第140回 利付国債(5年)	734,257	第124回 利付国債(5年)	752,115
第356回 利付国債(10年)	713,077	第310回 利付国債(10年)	739,723
第141回 利付国債(5年)	659,729	第308回 利付国債(10年)	670,150
第355回 利付国債(10年)	618,768	第126回 利付国債(5年)	651,839
第350回 利付国債(10年)	596,520	第133回 利付国債(5年)	606,918
第354回 利付国債(10年)	594,575	第325回 利付国債(10年)	511,845
第142回 利付国債(5年)	559,531	第63回 利付国債(20年)	424,964

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

株式(日立外国株式インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	枚 数	金 額	平均単価	銘 柄	枚 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP(アメリカ)	19	311,229	16,125	APPLE INC(アメリカ)	4	126,318	26,316
APPLE INC(アメリカ)	10	277,706	26,961	BANK OF AMERICA CORP(アメリカ)	14	45,752	3,268
AMAZON COM INC(アメリカ)	1	265,017	203,859	JPMORGAN CHASE & CO(アメリカ)	3	43,020	13,036
FACEBOOK INC-A(アメリカ)	7	127,294	17,679	WELLS FARGO COMPANY(アメリカ)	8	41,916	4,817
PROSUS NV(オランダ)	12	104,505	8,237	ORACLE CORPORATION(アメリカ)	7	40,369	5,685
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.8	97,278	121,598	CITIGROUP INC(アメリカ)	5	35,237	7,047
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.8	97,265	121,582	PFIZER INC(アメリカ)	5	24,771	4,587
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A(アメリカ)	17	95,198	5,567	INTEL CORP(アメリカ)	4	23,434	5,579
NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	7	88,301	11,109	BOOKING HOLDINGS INC(アメリカ)	0.1	18,683	186,835
PROCTER & GAMBLE CO(アメリカ)	7	84,798	12,114	NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	1	18,258	11,305

(注) 金額は受け渡し代金。

公社債(日立外国債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	199,217	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	264,125
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,479	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	208,254
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,695	1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	174,107
2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,683	3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	162,702
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,976	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,925
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,928	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	144,559
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	151,535	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	143,524
1.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,070	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	134,765
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,033	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	133,482
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,226	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	128,420

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

<日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	千円	千円	千円
	100,282	116,158	438,648

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立化成、日立金属、日立建機、日立製作所、日立ハイテク、日立キャピタル、日立物流です。

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	千円	千円	千円
	100,099	0	97,231

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立キャピタルです。

■組入資産の明細(2020年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	4,024,426	4,110,765	6,458,423
日立国内債券インデックスマザーファンド	6,312,290	6,029,966	8,551,698
日立外国株式インデックスマザーファンド	1,771,692	1,833,847	4,293,769
日立外国債券インデックスマザーファンド	1,010,219	902,640	2,067,136

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2020年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	6,458,423	29.7
日立国内債券インデックスマザーファンド	8,551,698	39.4
日立外国株式インデックスマザーファンド	4,293,769	19.8
日立外国債券インデックスマザーファンド	2,067,136	9.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	360,419	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	21,731,445	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 日立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(100,216,307千円)の投資信託財産総額(100,251,023千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 日立外国債券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(40,031,807千円)の投資信託財産総額(40,069,301千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=107.43円、1カナダドル=76.50円、1メキシコペソ=4.49円、1ユーロ=116.08円、1英ポンド=131.33円、1スイスフラン=110.35円、1スウェーデンクローナ=10.97円、1ノルウェークローネ=10.59円、1デンマーククローネ=15.57円、1ポーランドズロチ=25.46円、1オーストラリアドル=69.45円、1ニュージーランドドル=64.55円、1香港ドル=13.86円、1シンガポールドル=75.47円、1マレーシアリンギット=24.72円、1イスラエルシケル=30.32円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	21,731,445,033円
コール・ローン等	228,817,671
日立国内株式TOPIXインデックス マザーファンド(評価額)	8,551,698,547
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	6,458,423,315
日立外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	2,067,136,008
日立外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	4,293,769,492
未 収 入 金	131,600,000
(B) 負 債	163,013,842
未 払 解 約 金	145,553,862
未 払 信 託 報 酬	17,459,322
未 払 利 息	658
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	21,568,431,191
元 本	11,211,589,502
次 期 繰 越 損 益 金	10,356,841,689
(D) 受 益 権 総 口 数	11,211,589,502口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,238円

(注1) 当ファンドの期首元本額は11,480,851,652円、期中追加設定元本額は1,147,563,792円、期中一部解約元本額は1,416,825,942円です。
 (注2) 1口当たり純資産額は1.9238円です。

■損益の状況

当期(自2019年5月16日 至2020年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△197,901円
支 払 利 息	△197,901
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△156,025,336
売 買 益	238,930,585
売 買 損	△394,955,921
(C) 信 託 報 酬 等	△39,795,383
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△196,018,620
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	5,079,566,401
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,473,293,908
(配 当 等 相 当 額)	(7,180,044,397)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,706,750,489)
(G) 計 (D + E + F)	10,356,841,689
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	10,356,841,689
追 加 信 託 差 損 益 金	5,473,293,908
(配 当 等 相 当 額)	(7,180,044,397)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,706,750,489)
分 配 準 備 積 立 金	5,559,140,977
繰 越 損 益 金	△675,593,196

(注1) 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2) 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3) 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4) 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(0円)、信託約款に規定する収益調整金(7,180,044,397円)および分配準備積立金(5,559,140,977円)より分配対象収益は12,739,185,374円(10,000口当たり11,362円)ですが、当期に分配した金額はありません。

<お知らせ>

2019年11月16日付で、日立バランスファンド(株式50)の信託報酬率を年率0.198%(税抜0.18%)から年率0.154%(税抜0.14%)に引き下げる約款変更を行いました。

日立バランスファンド(株式30)

■ 1 万口 (元本10,000円) 当たりの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2019. 5. 16～2020. 5. 15)		
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	27円	0.154%	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17,336円です。 委託した資金の運用の対価 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)	(0.068)	
（販 売 会 社）	(7)	(0.042)	
（受 託 会 社）	(8)	(0.044)	
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕÷〔期中の平均受益権口数〕 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株 式）	(0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕÷〔期中の平均受益権口数〕 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株 式）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝〔期中のその他費用〕÷〔期中の平均受益権口数〕 保管費用は、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
（保 管 費 用）	(1)	(0.005)	
（そ の 他）	(0)	(0.001)	
合 計	28	0.160	

(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) 「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。

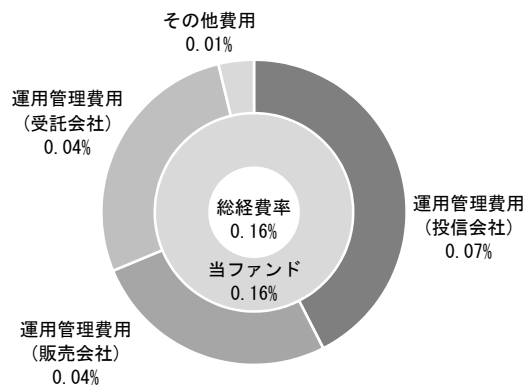
(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

<参考情報>

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（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0.16%です。



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

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

(注)各比率は、年率換算した値です。

(注)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

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

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	千口 267,286	千円 409,300	千口 229,043	千円 378,700
日立国内債券インデックス マザーファンド	446,543	637,500	517,099	739,900
日立外国株式インデックス マザーファンド	103,258	226,900	79,218	200,580
日立外国債券インデックス マザーファンド	5,753	12,900	35,426	80,700

(注) 単位未満は切り捨て。

■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(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

項 目	日立国内株式TOPIX インデックスマザーファンド	日立外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	12,726,326千円	12,135,724千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	48,986,821千円	97,358,148千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.25	0.12

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■主要な売買銘柄(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

株式(日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	29.8	205,699	6,902	トヨタ自動車	23.51	169,102	7,192
NTTドコモ	41.4	119,843	2,894	ソニー	21.8	142,948	6,557
任天堂	2.6	101,918	39,199	ソフトバンクグループ	26.2	127,751	4,875
ソフトバンクグループ	20.5	98,993	4,828	KDDI	43.1	127,586	2,960
ソニー	15.8	98,482	6,233	キーエンス	2	104,020	52,010
三菱UFJフィナンシャル・グループ	179.5	89,638	499	武田薬品工業	24.5	94,675	3,864
日本電信電話	23.8	80,329	3,375	日本電信電話	22.2	81,415	3,667
日立製作所	19.5	75,683	3,881	本田技研工業	27.5	78,971	2,871
武田薬品工業	20.4	75,108	3,681	三菱UFJフィナンシャル・グループ	150.4	77,947	518
リクルートホールディングス	18.7	64,793	3,464	ソフトバンク	50.5	75,142	1,487

(注) 金額は受け渡し代金。

公社債(日立国内債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第138回 利付国債(5年)	916,038	第127回 利付国債(5年)	1,043,484
第402回 利付国債(2年)	805,616	第312回 利付国債(10年)	912,807
第357回 利付国債(10年)	743,054	第125回 利付国債(5年)	803,011
第140回 利付国債(5年)	734,257	第124回 利付国債(5年)	752,115
第356回 利付国債(10年)	713,077	第310回 利付国債(10年)	739,723
第141回 利付国債(5年)	659,729	第308回 利付国債(10年)	670,150
第355回 利付国債(10年)	618,768	第126回 利付国債(5年)	651,839
第350回 利付国債(10年)	596,520	第133回 利付国債(5年)	606,918
第354回 利付国債(10年)	594,575	第325回 利付国債(10年)	511,845
第142回 利付国債(5年)	559,531	第63回 利付国債(20年)	424,964

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

株式(日立外国株式インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付				売 付			
銘 柄	枚 数	金 額	平均単価	銘 柄	枚 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP(アメリカ)	19	311,229	16,125	APPLE INC(アメリカ)	4	126,318	26,316
APPLE INC(アメリカ)	10	277,706	26,961	BANK OF AMERICA CORP(アメリカ)	14	45,752	3,268
AMAZON COM INC(アメリカ)	1	265,017	203,859	JPMORGAN CHASE & CO(アメリカ)	3	43,020	13,036
FACEBOOK INC-A(アメリカ)	7	127,294	17,679	WELLS FARGO COMPANY(アメリカ)	8	41,916	4,817
PROSUS NV(オランダ)	12	104,505	8,237	ORACLE CORPORATION(アメリカ)	7	40,369	5,685
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	0.8	97,278	121,598	CITIGROUP INC(アメリカ)	5	35,237	7,047
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	0.8	97,265	121,582	PFIZER INC(アメリカ)	5	24,771	4,587
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A(アメリカ)	17	95,198	5,567	INTEL CORP(アメリカ)	4	23,434	5,579
NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	7	88,301	11,109	BOOKING HOLDINGS INC(アメリカ)	0.1	18,683	186,835
PROCTER & GAMBLE CO(アメリカ)	7	84,798	12,114	NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	1	18,258	11,305

(注) 金額は受け渡し代金。

公社債(日立外国債券インデックスマザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	199,217	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	264,125
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,479	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	208,254
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,695	1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	174,107
2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,683	3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	162,702
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,976	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,925
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,928	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	144,559
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	151,535	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	143,524
1.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,070	3.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	134,765
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,033	2.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	133,482
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,226	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	128,420

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等(2019年5月16日から2020年5月15日まで)

利害関係人の発行する有価証券等

<日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
株 式	千円	千円	千円
	100,282	116,158	438,648

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立化成、日立金属、日立建機、日立製作所、日立ハイテク、日立キャピタル、日立物流です。

<日立国内債券インデックスマザーファンド>

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	期 末 保 有 額
公 社 債	千円	千円	千円
	100,099	0	97,231

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立キャピタルです。

■組入資産の明細(2020年5月15日現在)

親投資信託残高

項 目	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	1,037,127	1,075,369	1,689,513
日立国内債券インデックスマザーファンド	3,657,453	3,586,897	5,086,937
日立外国株式インデックスマザーファンド	334,550	358,590	839,603
日立外国債券インデックスマザーファンド	391,358	361,685	828,295

(注) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2020年5月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド	1,689,513	19.7
日立国内債券インデックスマザーファンド	5,086,937	59.3
日立外国株式インデックスマザーファンド	839,603	9.8
日立外国債券インデックスマザーファンド	828,295	9.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	137,530	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	8,581,878	100.0

(注1) 評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 日立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(100,216,307千円)の投資信託財産総額(100,251,023千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 日立外国債券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(40,031,807千円)の投資信託財産総額(40,069,301千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年5月15日における邦貨換算レートは1米ドル=107.43円、1カナダドル=76.50円、1メキシコペソ=4.49円、1ユーロ=116.08円、1英ポンド=131.33円、1スイスフラン=110.35円、1スウェーデンクローナ=10.97円、1ノルウェークローネ=10.59円、1デンマーククローネ=15.57円、1ポーランドズロチ=25.46円、1オーストラリアドル=69.45円、1ニュージーランドドル=64.55円、1香港ドル=13.86円、1シンガポールドル=75.47円、1マレーシアリンギット=24.72円、1イスラエルシケル=30.32円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年5月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	8,581,878,372円
コー ル ・ ロ ー ン 等	94,427,601
日立国内株式TOPIXインデックス マザーファンド(評価額)	5,086,937,974
日立国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,689,513,610
日立外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	828,295,299
日立外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	839,603,888
未 収 入 金	43,100,000
(B) 負 債	55,098,631
未 払 解 約 金	48,271,447
未 払 信 託 報 酬	6,826,913
未 払 利 息	271
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	8,526,779,741
元 本	5,019,703,148
次 期 繰 越 損 益 金	3,507,076,593
(D) 受 益 権 総 口 数	5,019,703,148口
1万口当たり基準価額(C/D)	16.987円

(注1) 当ファンドの期首元本額は5,077,035,901円、期中追加設定元本額は806,345,793円、期中一部解約元本額は863,678,546円です。
 (注2) 1口当たり純資産額は1.6987円です。

■損益の状況

当期(自2019年5月16日 至2020年5月15日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△79,604円
支 払 利 息	△79,604
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,559,448
売 買 益	83,091,874
売 買 損	△89,651,322
(C) 信 託 報 酬 等	△15,038,498
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△21,677,550
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,124,487,139
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,404,267,004
(配 当 等 相 当 額)	(2,607,914,438)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△203,647,434)
(G) 計 (D + E + F)	3,507,076,593
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	3,507,076,493
追 加 信 託 差 損 益 金	2,404,267,004
(配 当 等 相 当 額)	(2,607,914,438)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△203,647,434)
分 配 準 備 積 立 金	1,195,909,795
繰 越 損 益 金	△93,100,206

(注1) 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2) 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3) 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4) 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(0円)、信託約款に規定する収益調整金(2,607,914,438円)および分配準備積立金(1,195,909,795円)より分配対象収益は3,803,824,233円(10,000口当たり7,577円)ですが、当期に分配した金額はありません。

<お知らせ>

2019年11月16日付で、日立バランスファンド(株式30)の信託報酬率を年率0.187%(税抜0.17%)から年率0.154%(税抜0.14%)に引き下げる約款変更を行いました。

<補足情報>

日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンドの組入資産の明細(2020年5月15日現在)

下記は、日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド全体(29,429,674千口)の内容です。

(1) 国内株式

上場株式

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
水産・農林業(0.1%)		
極洋	1	2,686
日本水産	29.9	13,335
マルハニチロ	4.3	9,335
カネコ種苗	0.9	1,332
サカタのタネ	3.6	13,446
ホクト	2.3	4,505
ホクリヨウ	0.5	325
鉱業(0.2%)		
住石ホールディングス	6	672
日鉄鉱業	0.7	3,213
三井松島ホールディングス	1.2	972
国際石油開発帝石	120	81,840
石油資源開発	3.9	7,515
K&Oエナジーグループ	1.5	2,347
建設業(2.6%)		
ヒノキヤグループ	0.7	1,099
ショーボンドホールディングス	4.7	21,455
ミライト・ホールディングス	8.9	12,976
タマホーム	1.6	2,145
サンヨーホームズ	0.3	183
日本アクア	1.2	705
ファーストコーポレーション	0.9	445
ベステラ	0.5	489
TATERU	6.2	942
キャンディル	0.5	237
スペースバリューホールディングス	3.6	1,263
ダイセキ環境ソリューション	0.6	609
第一カッター興業	0.4	699
明豊ファシリティワークス	1	588
安藤・間	17.8	11,552
東急建設	8.8	4,875
コムシスホールディングス	10.6	32,012
ビーアールホールディングス	3.3	1,683
高松コンストラクショングループ	1.9	4,206
東建コーポレーション	0.9	6,507
ソネック	0.3	235
ヤマウラ	1.3	984
大成建設	23	81,190
大林組	69.1	62,881
清水建設	70.1	59,234
飛島建設	2	2,094
長谷工コーポレーション	26.7	30,705
松井建設	2.7	1,676
銭高組	0.3	1,096
鹿島建設	54.2	64,227
不動テトラ	1.8	2,354
大末建設	0.8	588
鉄建建設	1.5	3,201
西松建設	5.3	10,902
三井住友建設	16.7	7,097
大豊建設	1.6	3,857
前田建設工業	17.3	14,289

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
佐田建設	1.5	598
ナカノフドー建設	1.9	697
奥村組	3.7	8,931
東鉄工業	3	8,181
イチケン	0.5	609
富士ビー・エス	1	516
浅沼組	0.8	2,940
戸田建設	28.7	18,052
熊谷組	3.2	7,721
北野建設	0.4	1,027
植木組	0.3	718
矢作建設工業	3	2,211
ピーエス三菱	2.3	1,198
日本ハウスホールディングス	4.7	1,306
大東建託	7.5	78,037
新日本建設	2.9	2,024
NIPPO	5.7	14,056
東亜道路工業	0.4	1,230
前田道路	6.1	11,114
日本道路	0.7	4,697
東亜建設工業	2.2	3,245
日本国土開発	6.7	3,718
若築建設	1.2	1,327
東洋建設	7.7	3,157
五洋建設	27.4	14,768
世紀東急工業	3.3	2,471
福田組	0.8	3,640
住友林業	17.5	21,035
日本基礎技術	2.3	959
巴コーポレーション	3.1	1,066
大和ハウス工業	68.3	163,237
ライト工業	4	5,608
積水ハウス	75.6	136,306
日特建設	1.8	1,233
北陸電気工事	1.2	1,071
ユアテック	4	2,336
日本リーテック	1.4	2,732
四電工	0.4	920
中電工	2.8	6,168
関電工	9.8	8,878
きんでん	16.4	28,191
東京エネシス	2.3	1,704
トーエネック	0.7	2,331
住友電設	1.9	4,645
日本電設工業	3.8	8,481
協和エクシオ	10.5	26,397
新日本空調	1.8	4,140
九電工	4.8	13,992
三機工業	5	6,150
日揮ホールディングス	21.3	21,555
中外炉工業	0.7	1,076
ヤマト	2.2	1,372
太平電業	1.7	4,006

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
高砂熱学工業	6	9,948
三晃金属工業	0.3	629
朝日工業社	0.5	1,494
明星工業	4.5	3,298
大気社	3.4	10,189
ダイダン	1.6	4,396
日比谷総合設備	2.2	4,019
フィル・カンパニー	0.4	1,091
OSJBホールディングス	10.9	2,681
レイズネクスト	3.7	4,362
食料品(4.0%)		
日本製粉	6.5	10,380
日清製粉グループ本社	25	38,950
日東富士製粉	0.2	1,204
昭和産業	2	6,340
鳥越製粉	2	1,738
中部飼料	2.7	4,149
フィード・ワン	14.8	2,752
東洋精糖	0.4	484
日本甜菜製糖	1.2	1,964
三井製糖	1.9	4,168
塩水港精糖	2.4	492
日新製糖	1	1,918
森永製菓	5.2	22,256
中村屋	0.6	2,400
江崎グリコ	6.6	33,660
名糖産業	1.1	1,395
井村屋グループ	1.3	2,512
不二家	1.2	2,445
山崎製パン	16.6	31,423
第一屋製パン	0.4	376
モロゾフ	0.4	2,308
亀田製菓	1.3	6,942
寿スピリッツ	2.1	10,038
カルビー	10.1	29,724
森永乳業	4.1	18,532
六甲バター	1.5	2,139
ヤクルト本社	15.2	96,976
明治ホールディングス	14.6	111,836
雪印メグミルク	5.3	13,737
ブリマハム	3.5	8,361
日本ハム	8.4	30,786
林兼産業	0.7	404
丸大食品	2.4	4,802
S Foods	1.8	4,240
柿安本店	0.8	1,917
伊藤ハム米久ホールディングス	14.2	8,960
サッポロホールディングス	7.5	14,415
アサヒグループホールディングス	46.3	168,763
キリンホールディングス	93.7	187,212
宝ホールディングス	16.4	12,513
オエノンホールディングス	5.8	2,256
養命酒製造	0.7	1,332
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	15.5	28,907
サントリー食品インターナショナル	14.8	60,384
ダイドーグループホールディングス	1.1	5,148
伊藤園	6.7	40,602
キーコーヒー	2.2	5,077
ユニカフェ	0.6	562

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ジャパンフーズ	0.3	346
日清オイリオグループ	2.8	9,198
不二製油グループ本社	5.4	14,585
かどや製油	0.2	731
J-オイルミルズ	1.1	4,394
キッコーマン	15.9	77,433
味の素	48.8	94,086
キューピー	12.3	25,461
ハウス食品グループ本社	8.3	29,672
カゴメ	8.4	23,385
焼津水産化学工業	1.1	992
アリアケジャパン	2	14,040
ピエトロ	0.3	480
エバラ食品工業	0.5	1,062
やまみ	0.2	429
ニチレイ	10.5	31,143
東洋水産	11.4	59,964
イートランド	0.8	1,395
大冷	0.3	553
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1.2	1,432
日清食品ホールディングス	9.4	86,010
永谷園ホールディングス	1.1	2,412
一正蒲鉾	0.9	829
フジッコ	2.4	4,677
ロック・フィールド	2.4	3,156
日本たばこ産業	127.6	256,412
ケンコーマヨネーズ	1.2	2,428
わらべや日洋ホールディングス	1.4	2,326
なとり	1.2	2,050
イフジ産業	0.4	309
ピクルスコーポレーション	0.5	1,108
北の達人コーポレーション	7.7	4,004
ユーグレナ	9.5	6,374
ミヨシ油脂	0.8	860
理研ビタミン	2.1	4,410
繊維製品(0.5%)		
片倉工業	3.1	3,162
グンゼ	1.6	5,896
東洋紡	8.5	12,588
ユニチカ	6.3	2,129
富士紡ホールディングス	1	3,110
倉敷紡績	2.1	5,021
シキボウ	1.1	1,118
日本毛織	7.1	6,652
ダイトウボウ	3.5	427
トーア紡コーポレーション	0.9	423
ダイドーリミテッド	2.8	574
帝国繊維	2.4	5,743
帝人	17.6	29,075
東レ	156.2	74,429
サカイオーベックス	0.6	1,141
住江織物	0.5	936
日本フェルト	1.2	542
イチカワ	0.3	421
日東製網	0.2	273
アツギ	1.8	1,105
ダイニック	0.8	604
セーレン	5.3	6,789
ソトー	0.9	850

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
東海染工	0.3	331
小松マテーレ	3.5	2,544
ワコールホールディングス	5.6	12,062
ホギメディカル	2.5	8,437
レナウン	5.5	429
クラウディアホールディングス	0.5	211
T S Iホールディングス	7.2	3,117
マツオカコーポレーション	0.6	1,239
ワールド	3.1	4,098
三陽商会	1.1	1,114
ナイガイ	0.8	319
オンワードホールディングス	13	4,459
ルックホールディングス	0.7	557
ゴールドウイン	3.9	22,620
デサント	4.2	5,943
キング	1	488
ヤマトインターナショナル	1.9	609
パルプ・紙(0.3%)		
特種東海製紙	1.4	5,803
王子ホールディングス	90.2	47,625
日本製紙	9.5	13,974
三菱製紙	2.4	912
北越コーポレーション	12.9	5,147
中越パルプ工業	0.9	1,179
巴川製紙所	0.6	501
大王製紙	9.5	13,689
阿波製紙	0.6	294
レンゴー	20.4	18,013
トーモク	1.3	2,299
ザ・パック	1.6	5,008
化学(7.5%)		
クラレ	34	35,734
旭化成	143	107,235
共和レザー	1.2	801
昭和電工	15.4	36,051
住友化学	158.5	50,878
住友精化	1	3,020
日産化学	12	49,080
ラサ工業	0.8	1,156
クレハ	1.8	7,641
多木化学	0.8	4,600
テイカ	1.6	2,545
石原産業	3.9	2,753
片倉コープアグリ	0.6	693
日本曹達	3.2	9,059
東ソー	33.3	46,420
トクヤマ	6.2	14,594
セントラル硝子	4.4	8,448
東亜合成	13.5	13,284
大阪ソーダ	2.2	5,555
関東電化工業	5.1	4,901
デンカ	7.9	21,156
信越化学工業	37	442,150
日本カーバイド工業	0.7	819
堺化学工業	1.4	2,592
第一稀元素化学工業	2.3	1,775
エア・ウォーター	20.1	30,511
大陽日酸	20.7	36,825
日本化学工業	0.7	1,555

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
東邦アセチレン	0.3	383
日本パーカライズニング	10.9	12,208
高圧ガス工業	3.4	2,556
チタン工業	0.3	522
四国化成工業	3.3	3,534
戸田工業	0.5	708
ステラ ケミファ	1.2	3,222
保土谷化学工業	0.8	2,896
日本触媒	3.3	18,018
大日精化工業	1.9	4,506
カネカ	5.6	15,512
三菱瓦斯化学	20.1	28,923
三井化学	19.6	36,985
J S R	20.1	39,757
東京応化工業	3.7	19,314
大阪有機化学工業	2	3,456
三菱ケミカルホールディングス	144.2	84,414
KHネオケム	3.8	7,037
ダイセル	28.1	24,166
住友ベークライト	3.4	9,662
積水化学工業	46.4	61,526
日本ゼオン	19.5	18,135
アイカ工業	6.5	19,597
宇部興産	10.9	18,628
積水樹脂	3.9	8,482
タキロンシーアイ	4.7	2,937
旭有機材	1.2	1,585
日立化成	10	46,150
ニチバン	1.1	1,595
リケンテクノス	5.4	2,219
大倉工業	1	1,513
積水化成成品工業	2.9	1,705
群栄化学工業	0.5	1,332
タイガースポリマー	1.1	449
ミライアル	0.8	925
ダイキアクシス	0.8	586
ダイキョーニシカワ	4.5	2,520
竹本容器	0.8	568
森六ホールディングス	1.2	1,773
日本化薬	13.3	13,499
カーリットホールディングス	2.3	1,170
日本精化	1.7	2,278
扶桑化学工業	2.2	8,096
トリケミカル研究所	0.5	4,645
A D E K A	9.9	13,988
日油	8.1	30,415
新日本理化	3.6	622
ハリマ化成グループ	1.8	1,634
花王	52.7	460,545
第一工業製薬	0.8	3,748
石原ケミカル	0.6	1,128
日華化学	0.7	617
ニイタカ	0.4	1,166
三洋化成工業	1.3	5,720
有機合成薬品工業	1.7	569
大日本塗料	2.4	2,222
日本ペイントホールディングス	17.8	120,862
関西ペイント	24.2	49,610
神東塗料	1.7	306

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
中国塗料	6.1	4,587
日本特殊塗料	1.6	1,374
藤倉化成	2.9	1,377
太陽ホールディングス	1.6	7,448
D I C	9.1	23,559
サカタインクス	4.7	4,413
東洋インキSCホールディングス	4.6	9,126
T & K TOKA	1.7	1,225
富士フィルムホールディングス	42.2	216,401
資生堂	43.8	283,605
ライオン	28.6	70,356
高砂香料工業	1.4	3,116
マンダム	5	10,390
ミルボン	2.9	14,311
ファンケル	8.9	27,501
コーセー	4.1	54,448
コタ	1.3	1,543
シーボン	0.3	653
ポーラ・オルビスホールディングス	9.4	18,574
ノエビアホールディングス	1.9	9,234
アジュバンコスメジャパン	0.5	469
エステー	1.4	2,255
アグロ カネショウ	0.9	1,305
コニシ	3.6	5,421
長谷川香料	3.8	8,519
星光PMC	1.3	829
小林製薬	6.2	60,760
荒川化学工業	2	2,622
メック	1.5	3,141
日本高純度化学	0.6	1,609
タカラバイオ	5.8	13,804
J C U	2.7	8,005
新田ゼラチン	1.4	984
O A T アグリオ	0.4	422
デクセリアルズ	5.7	4,668
アース製薬	1.7	10,744
北興化学工業	2.3	1,322
大成ラミック	0.7	1,836
クミアイ化学工業	9.1	7,716
日本農薬	3.9	1,704
アキレス	1.5	2,394
有沢製作所	3.5	2,758
日東電工	15.2	81,168
レック	2.3	3,236
三光合成	2.5	770
きもと	3.7	555
藤森工業	2	6,450
前澤化成工業	1.4	1,460
未来工業	1.2	2,323
ウェーブロックホールディングス	0.8	548
J S P	1.3	1,787
エフピコ	2.4	18,648
天馬	1.5	2,242
信越ポリマー	4	3,336
東リ	5.5	1,358
ニフコ	8.1	17,042
バルカー	1.8	3,286
ユニ・チャーム	42.4	171,720
ショーエイコーポレーション	0.3	216

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
医薬品 (6.9%)		
協和キリン	22.2	57,342
武田薬品工業	183.2	734,998
アステラス製薬	190.9	329,875
大日本住友製薬	16.3	21,907
塩野義製薬	28.2	161,134
わかもと製薬	2.6	626
あすか製薬	2.5	2,890
日本新薬	5.8	44,138
ビオフェルミン製薬	0.4	887
中外製薬	23	301,415
科研製薬	3.8	21,242
エーザイ	26.4	196,785
ロート製薬	11.3	37,346
小野薬品工業	50.6	137,454
久光製薬	5.8	28,478
持田製薬	3.1	12,462
参天製薬	41	77,900
扶桑薬品工業	0.8	1,919
日本ケミファ	0.3	766
ツムラ	6.8	18,910
日医工	6.2	8,779
キッセイ薬品工業	3.9	9,582
生化学工業	4.3	4,691
栄研化学	3.9	6,813
日水製薬	0.9	1,112
鳥居薬品	1.4	3,927
J C R ファーマ	1.6	18,448
東和薬品	2.8	6,022
富士製薬工業	1.5	1,707
沢井製薬	4.5	24,030
ゼリア新薬工業	4	8,524
第一三共	63	531,216
キョーリン製薬ホールディングス	4.9	10,574
大幸薬品	2.7	5,194
ダイト	1.3	5,115
大塚ホールディングス	42	178,584
大正製薬ホールディングス	4.7	28,717
ペプチドリーム	11.2	48,888
石油・石炭製品 (0.4%)		
日本コークス工業	18.6	1,060
ニチレキ	2.6	3,754
ユシロ化学工業	1.2	1,411
ビービー・カストロール	0.8	940
富士石油	5.9	1,020
M O R E S C O	0.8	759
出光興産	24.4	59,682
J X T G ホールディングス	331.3	125,098
コスモエネルギーホールディングス	6.4	10,054
ゴム製品 (0.6%)		
横浜ゴム	12.8	17,804
T O Y O T I R E	12.6	17,766
ブリヂストン	63.4	202,119
住友ゴム工業	19.8	20,196
藤倉コンポジット	1.9	691
オカモト	1.3	5,336
フコク	1	617
ニッタ	2.5	5,170
住友理工	4.3	2,545

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
三ツ星ベルト	2.9	4,326
バンドー化学	3.9	2,343
ガラス・土石製品(0.8%)		
日東紡績	3.3	17,457
A G C	21.8	58,249
日本板硝子	10.5	3,790
石塚硝子	0.4	834
日本山村硝子	0.9	747
日本電気硝子	8.8	13,719
オハラ	0.9	801
住友大阪セメント	4.2	14,994
太平洋セメント	13.9	29,329
日本ヒューム	2.2	1,500
日本コンクリート工業	4.7	1,193
三谷セキサン	1	4,750
アジアパイルホールディングス	3.1	1,264
東海カーボン	23.1	20,535
日本カーボン	1.1	3,410
東洋炭素	1.3	2,095
ノリタケカンパニーリミテド	1.2	3,900
T O T O	15.7	59,267
日本碍子	26.4	36,168
日本特殊陶業	16.8	26,493
ダントーホールディングス	1.6	132
MARUWA	0.8	6,456
品川リフラクトリーズ	0.6	1,357
黒崎播磨	0.4	1,496
ヨータイ	1.7	1,025
イソライト工業	1.1	507
東京窯業	2.8	831
ニッカトー	1	601
フジインコーポレーテッド	2	6,180
クニミネ工業	0.9	918
エーアンドエーマテリアル	0.4	450
ニチアス	6	13,878
ニチハ	3.1	6,909
鉄鋼(0.6%)		
日本製鉄	97.5	86,599
神戸製鋼所	39.9	14,962
中山製鋼所	3	1,056
合同製鐵	1.2	2,383
ジェイ エフ イー ホールディングス	58.8	40,924
東京製鐵	10.6	7,536
共英製鋼	2.5	3,442
大和工業	4.6	9,857
東京鐵鋼	0.9	1,114
大阪製鐵	1.2	1,351
淀川製鋼所	2.9	4,901
丸一鋼管	7.1	19,347
モリ工業	0.7	1,592
大同特殊鋼	3.6	12,528
日本高周波鋼業	0.8	308
日本冶金工業	1.8	3,013
山陽特殊製鋼	1.5	1,452
愛知製鋼	1.2	3,202
日立金属	23.5	23,899
日本金属	0.5	317
大平洋金属	1.5	2,254
新日本電工	14	2,072

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
栗本鐵工所	1.1	1,982
虹技	0.3	364
日本鑄鐵管	0.2	271
三菱製鋼	1.6	1,086
日亜鋼業	3.2	825
日本精線	0.4	1,228
エンビプロ・ホールディングス	0.9	502
シンニッタン	3.4	853
新家工業	0.5	535
非鉄金属(0.7%)		
大紀アルミニウム工業所	3.6	1,951
日本軽金属ホールディングス	55.1	9,477
三井金属鉱業	5.9	11,953
東邦亜鉛	1.1	1,445
三菱マテリアル	14.4	32,097
住友金属鉱山	27.8	77,242
DOWAホールディングス	5.5	16,555
古河機械金属	3.9	4,102
大阪チタニウムテクノロジーズ	2.3	2,185
東邦チタニウム	3.9	2,437
U A C J	3.3	5,481
CKサンエツ	0.5	1,502
古河電気工業	6.8	13,668
住友電気工業	81.4	88,278
フジクラ	26.3	7,942
昭和電線ホールディングス	2.5	2,837
東京特殊電線	0.3	698
タツタ電線	4.3	2,567
カナレ電気	0.4	671
平河ヒューテック	1.1	1,069
リョービ	2.7	3,291
アーレスティ	2.9	986
アサヒホールディングス	3.8	10,195
金属製品(0.5%)		
稲葉製作所	1.2	1,642
宮地エンジニアリンググループ	0.7	1,097
トーカロ	6	6,450
アルファC o	0.8	708
SUMCO	26.1	43,038
川田テクノロジーズ	0.4	1,948
RS Technologies	0.6	1,965
信和	1.3	962
東洋製罐グループホールディングス	13.9	14,136
ホッカンホールディングス	1.2	1,831
コロナ	1.2	1,158
横河ブリッジホールディングス	4	7,800
駒井ハルテック	0.4	600
高田機工	0.2	446
三和ホールディングス	20.5	17,937
文化シャッター	6.4	4,992
三協立山	2.8	2,455
アルインコ	1.6	1,457
東洋シャッター	0.5	337
L I X I Lグループ	32.1	42,339
日本フィルコン	1.7	861
ノーリツ	4.5	5,548
長府製作所	2.2	4,994
リンナイ	4.2	35,490
ダイニチ工業	1.2	808

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
日東精工	3	1,299
三洋工業	0.3	510
岡部	4.4	3,392
ジーテクト	2.7	2,845
東プレ	4.1	5,239
高周波熱錬	4.2	2,318
東京製綱	1.6	849
サンコール	1.6	628
モリテック スチール	1.7	474
バイオラックス	3.2	4,992
エイチワン	2.1	1,075
日本発條	23.4	16,169
中央発條	0.3	804
アドバネクス	0.3	408
立川ブラインド工業	1	1,150
三益半導体工業	1.7	3,706
機械(5.1%)		
日本ドライケミカル	0.5	676
日本製鋼所	6.6	8,705
三浦工業	9.4	40,608
タクマ	7.4	8,954
ツガミ	4.5	4,279
オークマ	2.5	10,587
芝浦機械	2.5	5,245
アマダ	27	25,974
アイダエンジニアリング	5.7	4,115
滝澤鉄工所	0.7	700
F U J I	9.4	16,788
牧野フライス製作所	2.6	7,995
オーエスジー	10.1	14,382
ダイジェット工業	0.2	266
旭ダイヤモンド工業	5.7	2,644
DMG森精機	13.8	15,980
ソディック	5.1	4,105
ディスコ	3	75,210
日東工器	1.2	2,335
日進工具	0.9	2,580
パンチ工業	2	704
富士ダイス	1	614
豊和工業	1.2	930
OKK	0.9	426
東洋機械金属	1.6	644
津田駒工業	0.4	330
エンシュウ	0.5	500
島精機製作所	3.4	5,249
オプトラン	2.4	6,696
NCホールディングス	0.7	373
イワキポンプ	1.4	1,341
フリー	2.1	1,726
ヤマシンフィルタ	4.7	4,074
日阪製作所	2.7	1,995
やまびこ	4.2	3,784
平田機工	1	5,560
ペガサスミシン製造	2.2	708
マルマエ	0.8	703
タツモ	1	1,530
ナプテスコ	12.8	41,920
三井海洋開発	2.3	3,157
レオン自動機	2.1	2,589

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
SMC	6.9	360,870
ホソカワミクロン	0.8	4,424
ユニオンツール	0.8	2,290
オイレス工業	2.8	3,693
日精エー・エス・ビー機械	0.6	1,947
サトーホールディングス	3.1	6,863
技研製作所	1.9	7,799
日本エアージェット	0.7	837
カワタ	0.6	450
日精樹脂工業	1.8	1,728
オカダアイヨン	0.7	613
ワイエイシイホールディングス	0.9	376
小松製作所	99.7	203,388
住友重機械工業	12.6	28,299
日立建機	8.8	22,044
日工	3	1,779
巴工業	0.9	1,621
井関農機	2.2	2,615
TOWA	2.2	2,074
丸山製作所	0.4	519
北川鉄工所	1	1,615
ローツェ	1	5,110
タカキタ	0.8	423
クボタ	116.8	162,468
荏原実業	0.6	1,362
三菱化工機	0.8	1,272
月島機械	4.1	4,965
帝国電機製作所	1.8	2,370
東京機械製作所	0.9	213
新東工業	5.2	3,744
澁谷工業	1.9	5,059
アイチ コーポレーション	3.8	2,618
小森コーポレーション	5.6	4,116
鶴見製作所	1.7	3,117
住友精密工業	0.3	644
日本ギア工業	0.9	235
酒井重工業	0.4	822
荏原製作所	9.1	20,920
石井鐵工所	0.3	760
西島製作所	2.2	1,533
北越工業	2.3	2,288
ダイキン工業	28.1	405,342
オルガノ	0.8	5,248
トーヨーカネツ	1	1,882
栗田工業	11.9	35,652
椿本チエイン	3.1	7,768
大同工業	1	631
木村化工機	1.8	786
アネスト岩田	3.4	2,784
ダイフク	11.3	89,383
サムコ	0.5	934
加藤製作所	1.2	1,384
油研工業	0.4	542
タダノ	10.6	8,321
フジテック	8	11,808
CKD	6	11,082
キトー	1.7	1,946
平和	6.1	11,224
理想科学工業	1.9	2,739

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
SANKYO	4.9	13,426
日本金銭機械	2.4	1,284
マースグループホールディングス	1.4	2,277
フクシマガリレイ	1.4	4,410
オーイズミ	0.9	374
ダイコク電機	1	1,199
竹内製作所	3.7	6,093
アマノ	5.8	12,661
JUKI	3.1	1,856
サンデンホールディングス	2.9	1,012
蛇の目ミシン工業	2	846
マックス	3.4	5,168
グローリー	5.7	13,560
新晃工業	2	2,790
大和冷機工業	3.2	3,004
セガサミーホールディングス	21.8	30,149
日本ピストンリング	0.8	874
リケン	1	2,685
TPR	3	3,678
ツバキ・ナカシマ	4.5	3,568
ホシザキ	6.4	51,648
大豊工業	1.8	880
日本精工	41.5	30,336
NTN	51	10,251
ジェイテクト	21.1	16,036
不二越	2	6,440
日本トムソン	6.5	2,379
THK	12.8	32,896
ユーシン精機	1.7	1,127
前澤給装工業	0.8	1,632
イーグル工業	2.7	1,930
前澤工業	1.5	523
日本ビラー工業	2.2	3,062
キッツ	8.9	6,167
マキタ	28.7	96,862
日立造船	17.5	6,282
三菱重工業	36.9	94,058
IHI	15.9	19,970
スター精密	3.4	4,063
電気機器(14.7%)		
日清紡ホールディングス	14.7	10,348
イビデン	13.5	40,149
ユニカミノルタ	48.1	17,700
ブラザー工業	26.9	50,060
ミネベアミツミ	40.9	73,620
日立製作所	105.8	326,816
三菱電機	220.2	286,260
富士電機	13.3	35,790
東洋電機製造	0.8	987
安川電機	23.7	83,187
シンフォニアテクノロジー	2.9	3,004
明電舎	4	6,568
オリジン	0.6	873
山洋電気	1.1	5,164
デンヨー	1.9	3,573
東芝テック	2.8	9,422
芝浦メカトロニクス	0.4	1,109
マブチモーター	6.1	19,398
日本電産	53	319,590

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.3	416
トレックス・セミコンダクター	1.3	1,342
東光高岳	1.2	1,141
ダブル・スコープ	3.5	1,246
ダイヘン	2.4	8,712
ヤーマン	3.6	2,498
JVCケンウッド	17.9	2,810
ミマキエンジニアリング	2	800
第一精工	0.9	2,155
日新電機	5.2	5,527
大崎電気工業	4.4	2,191
オムロン	19.7	131,399
日東工業	3.2	5,904
IDEC	3.2	5,270
正興電機製作所	0.5	431
不二電機工業	0.4	492
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.4	11,965
サクサホールディングス	0.5	865
メルコホールディングス	0.8	1,999
テクノメディカ	0.5	903
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	0.5	241
日本電気	26.7	128,160
富士通	21.2	220,904
沖電気工業	8.9	9,184
岩崎通信機	1	839
電気興業	1.1	2,671
サンケン電気	2.4	4,936
ナカヨ	0.4	506
アイホン	1.2	1,918
ルネサスエレクトロニクス	105.3	58,757
セイコーエプソン	27.3	29,920
ワコム	14.8	7,015
アルバック	4	11,500
アクセル	0.9	626
EIZO	1.7	5,856
日本信号	5.6	5,740
京三製作所	5.2	2,600
能美防災	2.9	5,481
ホーチキ	1.6	2,067
星和電機	1.1	636
エレコム	2.4	10,728
パナソニック	251.6	199,543
シャープ	25.5	28,560
アンリツ	14.2	31,012
富士通ゼネラル	6	11,562
ソニー	138	947,370
TDK	10.6	100,064
帝国通信工業	1	1,199
タムラ製作所	7.4	3,204
アルプスアルパイン	19.5	22,405
池上通信機	0.7	594
日本電波工業	2	806
鈴木	1.1	822
日本トリム	0.3	904
ローランド ディー. ジー.	1.2	1,362
フォスター電機	2.3	2,615
SMK	0.6	1,471
ヨコオ	1.4	3,829
ティアック	1.6	238

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ホシデン	6	5,208
ヒロセ電機	3.4	41,038
日本航空電子工業	5	6,875
TOA	2.4	1,632
マクセルホールディングス	4.7	4,653
古野電気	2.8	2,186
ユニデンホールディングス	0.6	1,120
スミダコーポレーション	1.7	1,127
アイコム	1.2	3,195
リオン	0.9	2,085
本多通信工業	1.9	775
船井電機	2.2	1,023
横河電機	20.2	28,542
新電元工業	0.8	1,984
アズビル	13.9	37,919
東亜ディーケーケー	1.1	957
日本光電工業	9.1	30,621
チノー	0.8	1,032
共和電業	2.3	830
日本電子材料	0.9	872
堀場製作所	4.4	25,740
アドバンテスト	16.4	87,412
小野測器	0.9	442
エスベック	2	3,478
キーエンス	20	777,400
日置電機	1.2	3,714
シスメックス	15.7	125,238
日本マイクロニクス	3.8	3,294
メガチップス	2	3,606
OBARA GROUP	1.3	3,754
澤藤電機	0.3	485
原田工業	1	842
コーセル	2.9	2,549
イリソ電子工業	1.8	5,805
オプテックスグループ	3.6	4,453
千代田インテグレ	1	1,703
アイ・オー・データ機器	0.7	651
レーザーテック	9.7	74,205
スタンレー電気	15.5	36,797
岩崎電気	0.9	1,546
ウシオ電機	12.2	12,895
岡谷電機産業	1.7	535
ヘリオス テクノ ホールディング	2	678
エノモト	0.7	700
日本セラミック	2.2	4,411
遠藤照明	1.1	608
古河電池	1.6	875
双信電機	1.1	363
山一電機	1.6	2,408
図研	1.4	3,491
日本電子	4.3	14,469
カシオ計算機	19.5	31,453
ファナック	20.9	364,078
日本シイエムケイ	5.2	2,054
エンブラス	1.1	2,454
大真空	0.8	1,641
ローム	9.8	69,580
浜松ホトニクス	15.8	74,892
三井ハイテック	2.4	3,084

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
新光電気工業	7.4	10,012
京セラ	31	176,700
太陽誘電	9.8	30,233
村田製作所	64.7	396,093
双葉電子工業	3.5	3,500
北陸電気工業	0.9	828
ニチコン	7.5	5,122
日本ケミコン	1.7	2,019
KOA	3.3	2,930
市光工業	3.3	1,544
小糸製作所	13.2	53,460
ミツバ	4.1	1,722
SCREENホールディングス	3.8	21,052
キャノン電子	2.3	3,509
キャノン	118.5	254,834
リコー	56	40,208
象印マホービン	6.5	10,075
MUTOHホールディングス	0.3	406
東京エレクトロン	14	315,350
輸送用機器(7.2%)		
トヨタ紡織	6.4	8,243
芦森工業	0.5	407
ユニプレス	4.3	4,136
豊田自動織機	17.8	91,670
モリタホールディングス	3.8	6,315
三櫻工業	2.8	1,912
デンソー	48.5	180,711
東海理化電機製作所	5.8	8,091
三井E&Sホールディングス	8	3,976
川崎重工業	17.1	25,803
名村造船所	7.1	1,207
サノヤスホールディングス	2.7	410
日本車輛製造	0.8	2,174
三菱ロジスネクスト	2.9	2,688
近畿車輛	0.3	351
日産自動車	259.7	95,959
いすゞ自動車	63.8	54,791
トヨタ自動車	245.7	1,535,379
日野自動車	27.5	16,912
三菱自動車工業	81.5	23,879
エフテック	1.5	663
レシップホールディングス	0.9	436
GMB	0.4	271
ファルテック	0.4	254
武蔵精密工業	4.9	4,160
日産車体	4.3	3,857
新明和工業	5.9	6,212
極東開発工業	4.1	4,956
日信工業	4.5	10,008
トピー工業	1.8	2,223
ティラド	0.8	1,104
タチエス	3.6	3,312
NOK	11.8	14,407
フタバ産業	6.1	2,738
KYB	2.5	5,357
大同メタル工業	4.2	2,284
プレス工業	10.9	2,648
ミクニ	2.8	719
太平洋工業	4.6	4,190

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ケーヒン	5.1	12,994
河西工業	3	1,446
アイシン精機	18.1	55,748
マツダ	64.8	39,981
今仙電機製作所	2	1,508
本田技研工業	173.4	425,350
スズキ	43.6	152,861
SUBARU	68.4	145,110
安永	1.1	1,080
ヤマハ発動機	28.7	39,261
ショーワ	5.2	11,736
TBK	2.6	1,128
エクセディ	3	4,686
豊田合成	7.1	14,072
愛三工業	3.4	1,764
盟和産業	0.3	279
日本プラスト	1.7	737
ヨロズ	2.1	2,259
エフ・シー・シー	3.6	5,619
シマノ	8.2	154,816
テイ・エス テック	5.1	14,473
ジャムコ	1.1	673
精密機器(2.6%)		
テルモ	62.3	227,519
クリエートメディック	0.7	673
日機装	6.6	5,445
日本エム・ディ・エム	1.3	2,028
島津製作所	26.3	72,246
JMS	1.9	1,540
クボテック	0.6	196
長野計器	1.6	1,523
ブイ・テクノロジー	1	3,780
東京計器	1.4	1,057
愛知時計電機	0.3	1,305
インターアクション	1.2	2,865
オーバル	2	442
東京精密	4	14,660
マニー	8.8	22,061
ニコン	33.6	31,281
トプコン	11.1	9,013
オリンパス	121.9	198,453
理研計器	1.9	4,041
タムロン	1.8	3,146
HOYA	44	425,832
シード	0.9	711
ノーリツ鋼機	1.5	1,933
エー・アンド・デイ	2	1,366
朝日インテック	24.9	74,127
シチズン時計	25.8	8,823
リズム時計工業	0.7	406
大研医器	1.5	966
メニコン	3.1	14,058
シンシア	0.2	76
松風	1	1,488
セイコーホールディングス	3.1	5,012
ニプロ	15.2	18,604
その他製品(2.5%)		
中本ボックス	0.6	892
スノーピーク	1.2	1,054

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
パラマウントベッドホールディングス	2.3	9,786
トランザクション	1.2	1,147
粧美堂	0.6	210
ニホンフラッシュ	2.1	2,641
前田工織	2.4	4,965
永大産業	2.9	832
アートネイチャー	2.4	1,560
バンダイナムコホールディングス	22.8	125,559
アイフィスジャパン	0.6	408
共立印刷	3.7	518
SHOEI	1.9	4,212
フランスベッドホールディングス	3.1	2,703
パイロットコーポレーション	3.6	12,690
萩原工業	1.2	1,588
トッパン・フォームズ	4.7	4,385
フジシールインターナショナル	4.9	10,192
タカラトミー	9.9	9,009
廣済堂	1.5	1,179
エステールホールディングス	0.6	361
アーク	8.4	806
タカノ	0.9	624
プロネクサス	1.9	1,972
ホクシン	1.4	163
ウッドワン	0.7	772
大建工業	1.5	2,475
凸版印刷	31.1	45,250
大日本印刷	28.8	59,875
共同印刷	0.7	1,894
NISSHA	4.5	4,405
光村印刷	0.2	300
TAKARA & COMPANY	1.1	2,005
アシックス	18.2	18,218
ツツミ	0.7	1,206
小松ウオール工業	0.7	1,285
ヤマハ	13.1	61,111
河合楽器製作所	0.7	1,842
クリナップ	2	1,038
ビジョン	13.3	55,660
オリバー	0.5	1,295
兼松サステック	0.1	145
キングジム	1.8	1,575
リンテック	5.2	12,526
イトーキ	4.7	1,532
任天堂	13.5	607,635
三菱鉛筆	3.6	5,018
タカラスタンダード	4.5	6,894
コクヨ	10.6	13,546
ナカバヤシ	2.2	1,194
グローブライド	1	2,040
オカムラ	7.7	6,244
美津濃	2	3,562
電気・ガス業(1.7%)		
東京電力ホールディングス	175.8	61,354
中部電力	67.4	97,258
関西電力	83.4	83,691
中国電力	31.8	46,936
北陸電力	20.1	14,190
東北電力	55	57,090
四国電力	19.8	15,919

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
九州電力	45.4	39,044
北海道電力	20.6	8,507
沖縄電力	4.1	8,515
電源開発	17.5	33,512
エフオン	1.2	714
イーレックス	3.1	4,185
レノバ	3.7	3,200
東京瓦斯	42.4	104,791
大阪瓦斯	42.7	89,285
東邦瓦斯	10.8	62,856
北海道瓦斯	1.2	1,863
広島ガス	4.5	1,615
西部瓦斯	2.5	6,380
静岡ガス	6.3	5,997
メタウォーター	1.1	5,032
陸運業(4.3%)		
SBSホールディングス	1.9	3,448
東武鉄道	23	83,720
相鉄ホールディングス	7	20,223
東急	55.5	87,246
京浜急行電鉄	28.3	47,628
小田急電鉄	32.8	79,736
京王電鉄	11.4	67,374
京成電鉄	15.3	48,883
富士急行	3	9,090
新京成電鉄	0.6	1,254
東日本旅客鉄道	38.8	304,851
西日本旅客鉄道	19.6	124,832
東海旅客鉄道	18.3	321,165
西武ホールディングス	29.6	37,414
鴻池運輸	3.5	3,997
西日本鉄道	6.1	16,378
ハマキョウレックス	1.7	5,062
サカイ引越センター	1.2	7,008
近鉄グループホールディングス	20.9	107,008
阪急阪神ホールディングス	27.8	102,999
南海電気鉄道	9.9	24,759
京阪ホールディングス	9.3	45,105
神戸電鉄	0.5	1,905
名古屋鉄道	17.1	54,121
山陽電気鉄道	1.5	3,241
日本通運	7.2	35,064
ヤマトホールディングス	36.6	69,174
山九	5.8	22,910
丸運	1.2	273
丸全昭和運輸	1.7	4,731
センコーグループホールディングス	11.5	9,752
トナミホールディングス	0.5	2,660
ニッコンホールディングス	7.5	15,030
日本石油輸送	0.2	629
福山通運	2.7	8,815
セイノーホールディングス	15.6	20,389
エスライン	0.6	597
神奈川中央交通	0.5	2,045
日立物流	3.8	9,788
丸和運輸機関	2.2	6,096
C&Fロジホールディングス	2.1	2,904
九州旅客鉄道	18.3	53,307
SGホールディングス	21.9	67,561

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
海運業(0.1%)		
日本郵船	17.4	24,203
商船三井	13.2	23,047
川崎汽船	6.4	6,502
NSユナイテッド海運	1.1	1,470
明治海運	2.2	697
飯野海運	9.9	3,078
共栄タンカー	0.4	348
乾汽船	1.2	1,466
空運業(0.3%)		
日本航空	36.9	66,659
ANAホールディングス	38.1	88,163
パスコ	0.4	558
倉庫・運輸関連業(0.2%)		
トランコム	0.6	3,918
日新	1.8	2,899
三菱倉庫	6.6	15,912
三井倉庫ホールディングス	2.4	3,355
住友倉庫	7.5	9,315
澁澤倉庫	1.1	2,404
東陽倉庫	3.8	1,208
日本トランスシティ	4.6	2,226
ケイヒン	0.4	514
中央倉庫	1.3	1,350
川西倉庫	0.4	406
安田倉庫	1.7	1,411
ファイズホールディングス	0.4	400
東洋埠頭	0.6	778
宇徳	1.8	806
上組	11.6	22,562
サンリツ	0.5	281
キムラユニティ	0.6	606
キューソー流通システム	0.5	851
近鉄エクスプレス	4.4	6,745
東海運	1.2	309
エーアイテイ	1.5	1,101
内外トランスライン	0.7	734
日本コンセプト	0.7	980
情報・通信業(9.9%)		
NECネットエスアイ	2	10,480
クロスキャット	0.6	598
システナ	7.7	11,049
デジタルアーツ	1.1	8,789
日鉄ソリューションズ	3.2	8,595
キューブシステム	1.1	804
エイジア	0.4	511
コア	0.9	1,020
ラクーンホールディングス	1	678
ソリトンシステムズ	0.9	1,154
ソフトクリエイトホールディングス	0.9	1,631
TIS	21.6	47,520
ネオス	0.9	571
電算システム	0.8	2,362
グリー	13.3	5,945
コーエーテクモホールディングス	4.4	13,552
三菱総合研究所	0.9	3,505
ボルテージ	0.5	199
電算	0.2	409
AGS	1.2	867

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ファインデックス	1.8	1,807
ブレインパッド	0.6	2,850
KL a b	4.2	2,969
ポルトウイン・ビットクルーホールディ	2.6	2,399
イーブックイニシアティブジャパン	0.3	644
ネクソン	60.3	129,765
アイスタイル	6	1,650
エムアップホールディングス	0.6	1,402
エイチーム	1.5	1,038
エニグモ	2	1,898
テクノスジャパン	1.7	846
e n i s h	1	402
コロブラ	7.1	7,639
オルトプラス	1.3	552
ブロードリーフ	10.7	6,077
クロス・マーケティンググループ	1	299
デジタルハーツホールディングス	1.1	814
システム情報	1.6	1,579
メディアドゥホールディングス	0.7	2,856
じげん	5.3	1,717
ブイキューブ	1.3	1,445
エンカレッジ・テクノロジー	0.5	431
サイバーリンクス	0.3	442
ディー・エル・イー	1.7	205
フィックスターズ	2.3	2,817
CARTA HOLDINGS	1	887
オブティム	1.1	2,542
セレス	0.7	671
SHIFT	0.9	8,010
ティーガイア	1.9	4,081
セック	0.3	1,083
日本アジアグループ	2.3	538
テクマトリックス	1.5	4,575
プロシップ	0.6	726
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5.2	8,850
GMOペイメントゲートウェイ	4.6	50,876
ザッパラス	0.9	308
システムリサーチ	0.6	1,047
インターネットイニシアティブ	3.2	12,704
さくらインターネット	2.3	1,299
ヴィンクス	0.6	639
GMOクラウド	0.4	1,596
SRAホールディングス	1.1	2,405
システムインテグレータ	0.7	517
朝日ネット	1.5	1,528
eBASE	2.6	2,722
アバント	2.1	2,055
アドソル日進	0.8	1,984
フリービット	1.1	866
コムチュア	2.4	5,265
サイバーコム	0.4	757
アステリア	1.3	579
アイル	1.2	2,023
マークラインズ	1.1	2,016
メディカル・データ・ビジョン	1.6	1,552
g u m i	2.8	2,234
ショーケース	0.5	282
モバイルファクトリー	0.5	553
テラスカイ	0.8	2,244

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.8	1,116
P C Iホールディングス	0.8	644
パイブドHD	0.3	436
アイビーシー	0.4	390
ネオジャパン	0.4	500
P R T I M E S	0.2	463
ランドコンピュータ	0.3	309
ダブルスタンダード	0.3	1,374
オープンドア	1.1	1,158
マイネット	0.7	644
アカツキ	0.8	3,272
ベネフィットジャパン	0.2	294
U b i c o mホールディングス	0.5	652
L I N E	5	26,650
カナミックネットワーク	2	1,498
ノムラシステムコーポレーション	0.5	236
チェンジ	0.8	3,192
シンクロ・フード	0.9	278
オークネット	1.3	1,349
セグエグループ	0.5	386
エイトレッド	0.4	712
AOI TYO Holdings	2.2	1,001
マクミル	4.4	2,948
ビーグリー	0.4	610
オロ	0.6	1,818
ユーザーローカル	0.2	592
テモナ	0.5	348
ニーズウェル	0.4	264
サインポスト	0.4	545
ソルクシーズ	0.9	569
フェイス	0.8	488
プロトコーポレーション	1.9	1,938
ハイマックス	0.3	573
野村総合研究所	30.6	78,121
サイバネットシステム	1.5	1,023
C Eホールディングス	1.1	476
日本システム技術	0.3	356
インテージホールディングス	2.7	2,138
東邦システムサイエンス	0.6	557
ソースネクスト	10.2	3,233
インフォコム	2.4	6,160
HEROZ	0.3	1,059
ラクスル	1.7	4,365
F I G	2.3	598
システムサポート	0.2	594
イーソル	1	1,319
アルテリア・ネットワークス	2.4	5,061
東海ソフト	0.1	134
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディン	0.4	366
フォーカスシステムズ	1.3	1,020
クレスコ	1.3	1,855
フジ・メディア・ホールディングス	20.8	20,425
オービック	7.5	129,075
ジャストシステム	3.5	24,850
T D Cソフト	1.9	1,615
Zホールディングス	296.7	129,064
トレンドマイクロ	9.6	53,472
I Dホールディングス	0.8	1,187
日本オラクル	4.4	56,100

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
アルファシステムズ	0.7	2,509
フューチャー	2.6	4,251
CAC Holdings	1.4	1,551
SBテクノロジー	0.8	2,079
トーセ	0.6	499
オービックビジネスコンサルタント	2.2	10,967
伊藤忠テクノソリューションズ	9.8	34,202
アイティフォー	2.6	1,833
東計電算	0.3	1,141
エクスネット	0.3	288
大塚商会	11.7	56,452
サイボウズ	2.5	5,565
ソフトブレイン	1.3	626
電通国際情報サービス	1.3	5,889
ACCESS	2	1,720
デジタルガレージ	3.9	15,658
EMシステムズ	3	2,493
ウェザーニューズ	0.7	2,709
CIJ	1.5	1,227
ビジネスエンジニアリング	0.2	494
日本エンタープライズ	2.2	506
WOWOW	1	2,371
スカラ	1.4	792
インテリジェント ウェイブ	1.3	809
IMAGICA GROUP	1.8	658
ネットワンシステムズ	8.2	26,035
システムソフト	4.7	366
アルゴグラフィックス	1.8	6,534
マーベラス	3.3	1,848
エイベックス	3.7	3,200
日本ユニシス	6.7	21,507
兼松エレクトロニクス	1.2	4,542
東京放送ホールディングス	13.1	19,912
日本テレビホールディングス	18	19,980
朝日放送グループホールディングス	2.1	1,486
テレビ朝日ホールディングス	5.9	9,186
スカパーJSATホールディングス	14.2	5,793
テレビ東京ホールディングス	1.8	4,185
日本BS放送	0.7	716
ビジョン	2	1,528
スマートバリュー	0.6	512
USEN-NEXT HOLDINGS	0.8	1,026
ワイヤレスゲート	1	566
コネクシオ	1.2	1,842
日本通信	16.8	2,772
クロップス	0.4	275
日本電信電話	288.9	680,792
KDDI	161	509,565
ソフトバンク	196.4	279,280
光通信	2.2	47,740
NTTドコモ	159.6	487,258
エムティーアイ	2.1	1,281
GMOインターネット	8.5	21,513
ファイバーゲート	0.7	959
アйдマーケティングコミュニケーション	0.6	258
KADOKAWA	5.8	9,483
学研ホールディングス	2.9	4,845
ゼンリン	4.3	5,443
昭文社ホールディングス	1	398

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
インプレスホールディングス	1.8	257
アイネット	1.1	1,637
松竹	1.4	18,242
東宝	12.8	47,296
東映	0.8	10,864
エヌ・ティ・ティ・データ	57.5	64,227
ビー・シー・エー	0.4	1,590
ビジネスブレイン太田昭和	0.4	1,135
DTS	4.8	10,656
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9.2	43,884
シーイーシー	2.3	3,916
カプコン	10.2	35,853
アイ・エス・ビー	0.4	686
ジャステック	1.4	1,603
SCSK	5	24,425
日本システムウェア	0.7	1,424
アイネス	2.1	2,673
TKC	1.8	9,108
富士ソフト	2.8	12,236
NSD	6.9	10,936
コナミホールディングス	7.8	26,442
福井コンピュータホールディングス	0.8	2,252
JBCCHホールディングス	1.5	2,283
ミロク情報サービス	1.9	4,305
ソフトバンクグループ	171.5	784,441
卸売業(4.7%)		
ハウスイ	0.2	179
高千穂交易	0.8	760
カワニシホールディングス	0.3	370
伊藤忠食品	0.5	2,335
エレマテック	2	1,578
JALUX	0.6	956
あらた	1.7	7,327
トーメンデバイス	0.3	1,090
東京エレクトロン デバイス	0.8	2,225
フィールズ	1.7	544
双日	119.8	27,913
アルフレッサ ホールディングス	24.1	49,164
横浜冷凍	5.7	5,050
神栄	0.3	147
ラサ商事	1.1	921
アルコニックス	2.3	2,670
神戸物産	7.5	37,312
ハイパー	0.3	162
あい ホールディングス	3.1	4,017
ディーブイエックス	0.8	739
ダイワボウホールディングス	1.8	12,726
マクニカ・富士エレホールディングス	5.2	8,008
ラクト・ジャパン	0.8	2,952
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4.1	4,354
八洲電機	1.7	1,426
メディアスホールディングス	1.2	1,092
レスターホールディングス	2.3	4,406
ジュエテックホールディングス	0.5	496
大光	0.9	629
OCHIホールディングス	0.6	837
TOKAIホールディングス	11.5	11,120
黒谷	0.6	260
C o m i n i x	0.4	295

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
三洋貿易	2.2	1,929
ビューティガレージ	0.3	498
ウイン・パートナーズ	1.6	1,417
ミタチ産業	0.6	369
シップヘルスケアホールディングス	3.5	16,310
明治電機工業	0.7	912
デリカフーズホールディングス	0.8	494
スターティアホールディングス	0.5	273
コメダホールディングス	4.7	8,304
ビーバンドットコム	0.2	189
アセンテック	0.2	596
富士興産	0.7	282
協栄産業	0.2	224
小野建	1.9	2,280
南陽	0.5	709
佐鳥電機	1.5	1,261
エコートレーディング	0.5	254
伯東	1.3	1,246
コンドーテック	1.7	1,711
中山福	1.2	556
ナガイレーベン	2.9	7,540
三菱食品	2.4	6,021
松田産業	1.6	2,203
第一興商	3.2	10,880
メディバルホールディングス	23.4	46,098
S P K	0.9	1,208
萩原電気ホールディングス	0.8	1,674
アズワン	1.4	15,106
スズデン	0.8	938
尾家産業	0.6	882
シモジマ	1.3	1,680
ドウシシャ	2	3,014
小津産業	0.5	968
高速	1.3	1,718
たけびし	0.8	1,102
リックス	0.5	702
丸文	1.9	948
ハピネット	1.8	1,845
橋本総業ホールディングス	0.4	753
日本ライフライン	6.4	8,192
タカショー	1.4	663
マルカ	0.8	1,468
I D O M	5.8	2,499
進和	1.3	2,229
エスケイジャパン	0.5	155
ダイトロン	0.9	1,437
シークス	2.8	2,777
田中商事	0.7	473
オーハシテクニカ	1.2	1,716
白銅	0.8	1,044
伊藤忠商事	151.7	330,706
丸紅	225.8	104,997
高島	0.3	482
長瀬産業	12.2	15,762
蝶理	1.4	2,392
豊田通商	24.2	59,023
三共生興	3.3	1,395
兼松	8.1	9,541
ツカモトコーポレーション	0.4	446

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
三井物産	190.6	292,380
日本紙パルプ商事	1.2	4,332
カメイ	2.8	2,844
東都水産	0.3	891
OUGホールディングス	0.3	768
スターゼン	0.8	3,468
山善	8.5	7,556
椿本興業	0.4	1,292
住友商事	136.9	168,455
内田洋行	0.9	4,752
三菱商事	152.2	353,408
第一実業	1.1	3,949
キヤノンマーケティングジャパン	5.4	11,221
西華産業	1.2	1,359
佐藤商事	1.8	1,578
菱洋エレクトロ	2.2	5,709
東京産業	2	1,074
ユアサ商事	2.1	6,113
神鋼商事	0.5	919
トルク	1.3	374
阪和興業	4.1	7,105
正栄食品工業	1.4	5,586
カナデン	1.8	2,260
菱電商事	1.6	2,134
フルサト工業	1.2	1,615
岩谷産業	4.8	17,904
ナイス	0.9	720
昭光通商	0.7	413
ニチモウ	0.3	498
極東貿易	0.6	795
イワキ	2.8	1,237
三愛石油	5.3	5,337
稲畑産業	4.8	5,745
G S I クレオス	0.5	525
明和産業	2	964
クワザワ	0.8	407
ヤマエ久野	1.6	1,972
ワキタ	4.6	4,411
東邦ホールディングス	7	14,091
サンゲツ	5.9	9,044
ミツウロコグループホールディングス	3.2	3,814
シナネンホールディングス	0.9	2,491
伊藤忠エネクス	4.8	3,844
サンリオ	6.1	10,144
サンワテクノス	1.5	1,222
リョーサン	2.4	5,556
新光商事	3.4	2,961
トーホー	1	1,798
三信電気	1.2	1,855
東陽テクニカ	2.3	2,389
モスフードサービス	2.8	8,097
加賀電子	2.2	4,499
ソーダニッカ	2.2	1,251
立花エレテック	1.6	2,584
フォーバル	0.9	1,035
P A L T A C	3.5	18,095
三谷産業	2.9	1,110
太平洋興発	0.9	549
西本Wismettacホールディングス	0.4	740

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.2	384
国際紙パルプ商事	5.1	1,489
ヤマタネ	1.1	1,368
丸紅建材リース	0.2	288
日鉄物産	1.5	4,830
泉州電業	0.7	1,643
トラスコ中山	4.5	10,948
オートバックスセブン	8	10,104
モリト	1.6	1,081
加藤産業	3.1	10,927
北恵	0.5	409
イノテック	1.1	1,013
イエローハット	4.1	5,928
J Kホールディングス	2	1,564
日伝	2	4,180
北沢産業	1.6	440
杉本商事	1.2	2,084
因幡電機産業	6.2	13,844
東テック	0.7	1,421
ミスミグループ本社	27.2	70,964
アルテック	1.7	355
タキヒヨー	0.7	1,204
蔵王産業	0.4	565
スズケン	9.2	33,764
ジェコス	1.5	1,357
グローセル	2.2	928
小売業(4.9%)		
ローソン	5.5	30,030
サンエー	1.8	7,200
カワチ薬品	1.7	4,180
エービーシー・マート	3.4	20,162
ハードオフコーポレーション	0.9	582
アスクル	2.3	7,969
ゲオホールディングス	3.9	5,253
アダストリア	3	4,740
ジーフット	1.3	592
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	0.3	123
くら寿司	1.1	5,054
キャンドウ	1	1,910
パルグループホールディングス	2.2	2,805
エディオン	10	9,390
サーラコーポレーション	4.4	2,446
ワッツ	1	651
ハローズ	0.8	2,338
フジオフードシステム	1.8	2,469
あみやき亭	0.5	1,510
ひらまつ	4	620
大黒天物産	0.5	2,112
ハニーズホールディングス	1.9	2,213
ファーマライズホールディングス	0.5	333
アルペン	1.7	2,774
ハブ	0.6	409
クオールホールディングス	3.2	3,600
ジンズホールディングス	1.1	7,106
ビックカメラ	12.9	13,119
DCMホールディングス	12	12,876
Monotaro	15.4	58,751
東京一番フーズ	0.5	237
DDホールディングス	0.9	795

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
きちりホールディングス	0.6	365
アークランドサービスホールディングス	1.6	2,939
J. フロント リテイリング	25.9	22,274
ドトール・日レスホールディングス	3.5	6,055
マツモトキヨシホールディングス	9	34,425
ブロンコビリー	1.1	2,404
ZOZO	14.9	29,695
トレジャー・ファクトリー	0.6	398
物語コーポレーション	0.6	4,518
ココカラファイン	2.3	12,075
三越伊勢丹ホールディングス	37.9	24,597
H a m e e	0.8	1,061
ウエルシアホールディングス	6.4	49,664
クリエイトSDホールディングス	3.7	11,451
丸善CHIホールディングス	2.5	950
ミサワ	0.4	208
ティーライフ	0.3	281
エー・ピーカンパニー	0.4	166
チムニー	0.7	1,237
シュッピン	1.5	1,122
ネクステージ	3.1	2,436
ジョイフル本田	6.4	7,769
鳥貴族	0.6	1,026
キリン堂ホールディングス	0.9	1,793
ホットランド	1.4	1,605
すかいらーくホールディングス	24.3	40,095
SFPホールディングス	1.2	1,798
綿半ホールディングス	0.8	1,383
ヨシックス	0.4	795
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6.3	6,570
ゴルフダイジェスト・オンライン	1	509
B E E N O S	1	1,016
あさひ	1.6	2,243
日本調剤	1.3	2,137
コスモス薬品	1	28,600
トーエル	1	666
オンリー	0.4	230
セブン&アイ・ホールディングス	84.9	295,112
クリエイト・レストランツ・ホールディング	11.7	8,447
ツルハホールディングス	4.7	67,116
サンマルクホールディングス	1.7	3,029
フェリシモ	0.5	491
トリドールホールディングス	5.4	7,176
TOKYO BASE	2	648
ウイルプラスホールディングス	0.3	215
J Mホールディングス	1.6	3,929
サツドラホールディングス	0.3	609
アレンザホールディングス	1.1	936
串カツ田中ホールディングス	0.4	650
パロックジャパンリミテッド	1.5	891
クスリのアオキホールディングス	1.9	16,036
力の源ホールディングス	1	683
スシローグローバルホールディングス	11.9	23,657
L I X I L ビバ	2.1	4,193
メディカルシステムネットワーク	2.1	963
はるやまホールディングス	1	748
ノジマ	3.9	7,745
カッパ・クリエイト	3	4,299
ライトオン	1.6	836

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ジーンズメイト	0.7	167
良品計画	28.8	41,472
三城ホールディングス	2.3	602
アドヴァン	3.3	3,692
アルビス	0.8	1,599
コナカ	2.6	813
ハウス オブ ローゼ	0.3	465
G-7ホールディングス	1.3	2,780
イオン北海道	2.9	2,259
コジマ	3.7	1,531
ヒマラヤ	0.8	605
コーナン商事	3.1	8,397
エコス	0.8	1,485
ワタミ	2.6	2,875
マルシェ	0.6	366
パン・パシフィック・インターナショナル	47.7	96,354
西松屋チェーン	4.8	4,147
ゼンショーホールディングス	10.4	22,942
幸楽苑ホールディングス	1.4	2,268
ハークスレイ	0.5	476
サイゼリヤ	3.2	7,283
V Tホールディングス	9	2,628
魚力	0.6	906
ポブラ	0.6	264
フジ・コーポレーション	0.6	1,104
ユナイテッドアローズ	2.3	3,838
ハイデイ日高	3.1	5,536
京都きもの友禅	1.4	315
コロワイド	7.2	11,217
ピーシーデポコーポレーション	2.9	1,754
壺番屋	1.5	7,305
トップカルチャー	0.8	242
PLANT	0.6	333
スギホールディングス	4.3	28,810
薬王堂ホールディングス	0.9	2,349
ヴィア・ホールディングス	2.7	1,252
スクロール	3.3	1,148
ヨンドシーホールディングス	2.2	3,863
ファミリーマート	17.3	31,053
木曽路	2.8	6,610
SRSホールディングス	2.6	2,332
千趣会	3.9	1,372
タカキュー	1.7	232
ケーヨー	4.5	2,560
上新電機	2.5	5,255
日本瓦斯	3.4	14,212
ロイヤルホールディングス	3.8	6,467
東天紅	0.2	195
いなげや	2.7	4,463
島忠	4.1	11,258
チヨダ	2.3	2,364
ライフコーポレーション	1.6	5,248
リンガーハット	2.7	6,309
MrMaxHD	3	1,236
テナアライド	2	754
AOKIホールディングス	4.3	2,730
オークワ	3.4	4,729
コメリ	3.3	7,913
青山商事	4.5	3,978

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
しまむら	2.5	17,025
はせがわ	1.1	435
高島屋	15.8	14,978
松屋	4.4	2,596
エイチ・ツー・オー リテイリング	10.3	8,229
近鉄百貨店	0.8	2,220
丸井グループ	19.9	33,233
アクシアル リテイリング	1.8	6,840
井筒屋	1.2	206
イオン	83.5	184,576
イズミ	4.4	14,058
平和堂	4.4	7,893
フジ	2.6	4,672
ヤオコー	2.5	16,775
ゼビオホールディングス	2.6	2,337
ケーズホールディングス	20.9	26,229
Olympicグループ	1.1	737
日産東京販売ホールディングス	3.2	716
シルバーライフ	0.3	627
一家ダイニングプロジェクト	0.2	117
Genky DrugStores	1	2,471
ナルミヤ・インターナショナル	0.5	297
ブックオフグループホールディングス	1.3	1,014
アインホールディングス	2.7	17,469
元気寿司	0.5	1,174
ヤマダ電機	66.1	30,868
アークランドサカモト	3.4	3,661
ニトリホールディングス	9.4	162,526
グルメ杵屋	1.5	1,449
愛眼	1.7	363
ケーユーホールディングス	1.1	893
吉野家ホールディングス	7.1	16,429
松屋フーズホールディングス	1	3,945
サガミホールディングス	2.9	3,680
関西スーパーマーケット	1.8	1,978
王将フードサービス	1.6	9,504
ブレナス	2.4	4,435
ミニストップ	1.6	2,332
アークス	4.4	8,822
バローホールディングス	4.8	9,446
藤久	0.2	174
ベルク	1.1	6,787
大庄	1.2	1,560
ファーストリテイリング	2.9	148,045
サンドラッグ	8.2	30,381
サックスパー ホールディングス	1.8	943
ヤマザワ	0.5	856
やまや	0.4	887
ベルーナ	4.7	2,213
銀行業(4.9%)		
島根銀行	0.6	304
じもとホールディングス	14.7	1,381
めぶきフィナンシャルグループ	112.9	25,063
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.9	3,007
九州フィナンシャルグループ	47.5	19,950
ゆうちょ銀行	61.5	64,206
富山第一銀行	5.2	1,341
コンソルディア・フィナンシャルグループ	124.1	38,719
西日本フィナンシャルホールディングス	14.5	9,019

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
関西みらいフィナンシャルグループ	12.7	4,254
三十三フィナンシャルグループ	2	3,058
第四北越フィナンシャルグループ	3.8	8,230
新生銀行	15.9	20,479
あおぞら銀行	12.9	22,962
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,485.8	600,114
りそなホールディングス	238.4	79,673
三井住友トラスト・ホールディングス	41.1	121,142
三井住友フィナンシャルグループ	150.2	406,966
千葉銀行	72.5	32,190
群馬銀行	41.7	13,135
武蔵野銀行	3.2	4,204
千葉興業銀行	6	1,356
筑波銀行	9	1,548
七十七銀行	7.3	10,409
青森銀行	1.7	3,729
秋田銀行	1.4	1,978
山形銀行	2.4	3,012
岩手銀行	1.4	3,201
東邦銀行	19.4	4,384
東北銀行	1	897
みちのく銀行	1.4	1,570
ふくおかフィナンシャルグループ	18.3	28,291
静岡銀行	53.8	33,409
十六銀行	2.7	5,229
スルガ銀行	22.2	7,681
八十二銀行	52.4	18,182
山梨中央銀行	2.5	2,017
大垣共立銀行	4.3	8,759
福井銀行	1.9	2,996
北國銀行	2.2	6,463
清水銀行	0.9	1,626
富山銀行	0.4	865
滋賀銀行	4.4	9,864
南都銀行	3.6	7,952
百五銀行	19.5	5,733
京都銀行	7.8	27,378
紀陽銀行	7.7	11,757
ほくほくフィナンシャルグループ	14.5	11,919
広島銀行	32.1	14,316
山陰合同銀行	12.9	6,269
中国銀行	18.7	17,091
鳥取銀行	0.7	819
伊予銀行	31	17,639
百十四銀行	2.3	4,372
四国銀行	3.3	2,844
阿波銀行	3.5	7,742
大分銀行	1.2	2,850
宮崎銀行	1.4	3,262
佐賀銀行	1.3	1,510
沖縄銀行	2	6,040
琉球銀行	5	4,625
セブン銀行	72.6	20,691
みずほフィナンシャルグループ	2,951.4	354,758
高知銀行	0.8	568
山口フィナンシャルグループ	27.1	15,284
長野銀行	0.7	730
名古屋銀行	1.6	3,331
北洋銀行	32.7	6,114

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
愛知銀行	0.8	2,420
中京銀行	0.9	1,793
大光銀行	0.7	1,045
愛媛銀行	3	3,390
トマト銀行	0.8	814
京葉銀行	9.3	4,445
栃木銀行	10.5	1,690
北日本銀行	0.7	1,227
東和銀行	3.8	2,519
福島銀行	2	334
大東銀行	1.1	628
トモニホールディングス	16.8	5,846
フィデアホールディングス	21.1	2,257
池田泉州ホールディングス	25	4,225
証券、商品先物取引業(0.7%)		
F P G	6.7	3,530
マーキュリアインベストメント	1	524
S B I ホールディングス	24.3	52,026
日本アジア投資	1.8	401
ジャフコ	3.3	11,005
大和証券グループ本社	174.3	70,696
野村ホールディングス	382.2	154,982
岡三証券グループ	18.5	5,605
丸三証券	6.5	2,665
東洋証券	7.8	959
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	24.9	5,378
光世証券	0.5	249
水戸証券	6.3	1,184
いちよし証券	4.1	1,754
松井証券	12.4	9,287
だいこう証券ビジネス	1.1	1,012
マネックスグループ	15.9	3,466
極東証券	2.9	1,409
岩井コスモホールディングス	2.1	1,885
藍澤証券	3.9	2,636
マネーパートナーズグループ	2.3	443
スパークス・グループ	10	1,830
小林洋行	0.6	145
保険業(2.0%)		
かんぽ生命保険	7.7	9,879
SOMPOホールディングス	40.8	126,928
アニコム ホールディングス	1.8	8,199
MS&ADインシュアランスグループホール	56.8	162,732
ソニーフィナンシャルホールディングス	17.8	35,671
第一生命ホールディングス	122.9	158,479
東京海上ホールディングス	76.8	339,609
T&Dホールディングス	64.9	53,867
アドバンスクリエイト	0.5	1,147
その他金融業(1.1%)		
全国保証	6.1	21,045
ジェイリース	0.6	134
イントラスト	0.8	573
日本モーゲージサービス	0.4	690
C a s a	0.8	896
アルヒ	3.5	4,683
プレミアグループ	1.2	2,041
クレディセゾン	15.2	17,054
芙蓉総合リース	2.3	12,949
みずほリース	3.4	7,238

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
東京センチュリー	4.4	16,896
日本証券金融	9.6	4,665
アイフル	33.1	8,539
リコーリース	1.7	4,838
イオンフィナンシャルサービス	13.3	13,725
アコム	43.7	18,135
ジャックス	2.4	4,185
オリエン特コーポレーション	58.7	6,867
日立キャピタル	5.1	9,950
アプラスフィナンシャル	10.4	676
オリックス	135.9	168,719
三菱UFJリース	55.1	27,054
九州リースサービス	1.1	486
日本取引所グループ	62.3	130,580
イー・ギャランティ	2.3	4,894
アサックス	1.1	704
NECキャピタルソリューション	0.9	1,720
不動産業(2.1%)		
いちご	27.6	7,645
日本駐車場開発	21.4	2,803
スター・マイカ・ホールディングス	1.1	1,644
ADワークスグループ	4	680
ヒューリック	46.4	46,121
三栄建築設計	0.9	1,055
野村不動産ホールディングス	13.2	22,968
三重交通グループホールディングス	4.4	1,993
サムティ	3.1	4,361
ディア・ライフ	3.1	1,367
コーセーアールイー	0.6	277
日本商業開発	1.4	2,072
プレサンスコーポレーション	3.6	4,428
ユニゾホールディングス	0.7	4,186
THEグローバル社	1	335
ハウスコム	0.4	545
日本管理センター	1.4	1,432
サンセイランディック	0.6	432
エストラスト	0.3	180
フージャースホールディングス	4.3	2,597
オープンハウス	6.3	15,050
東急不動産ホールディングス	59.1	29,786
飯田グループホールディングス	18.1	25,140
イーグランド	0.3	187
ムゲンエステート	1.5	715
ビーロッド	1	647
ファーストブラザーズ	0.5	319
ハウストゥ	1.1	930
シーアールイー	0.5	571
プロパティエージェント	0.3	292
ケイアイスター不動産	0.7	751
アグレ都市デザイン	0.4	173
グッドコムアセット	0.5	746
ジェイ・エス・ビー	0.5	1,157
テンポイノベーション	0.5	352
グローバル・リンク・マネジメント	0.4	233
パーク24	11.7	22,159
バラカ	0.6	986
三井不動産	107.1	204,186
三菱地所	152.2	240,476
平和不動産	4	11,328

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
東京建物	22.9	27,044
ダイビル	5.6	5,560
京阪神ビルディング	3.5	4,991
住友不動産	48.8	135,224
テーオーシー	4.3	2,846
東京楽天地	0.4	1,678
レオパレス21	28.5	6,954
スターツコーポレーション	3	5,949
フジ住宅	2.5	1,167
空港施設	2.2	902
明和地所	1.2	481
ゴールドクレスト	1.7	2,641
エスリード	0.8	1,060
日神グループホールディングス	3.2	1,244
日本エスコ	3.9	2,905
タカラレーベン	9.9	3,445
AVANTIA	1.2	864
イオンモール	10.9	16,197
毎日コムネット	0.6	484
ファースト住建	0.9	764
カチタス	5.4	12,139
トーセイ	3	2,880
穴吹興産	0.5	780
サンフロンティア不動産	3	2,607
エフ・ジェー・ネクスト	1.9	1,502
インテリックス	0.6	319
ランドビジネス	0.7	200
日本社宅サービス	0.7	692
グランディハウス	1.7	562
日本空港ビルデング	6.9	27,738
サービス業(5.3%)		
日本工営	1.4	4,319
LIFULL	7.3	3,095
ジェイエシーリクルートメント	1.4	1,597
日本M&Aセンター	15.9	58,512
メンバーズ	0.6	979
中広	0.3	151
UTグループ	3.3	5,517
アイティメディア	0.8	765
タケエイ	2	1,640
E・Jホールディングス	0.4	603
ビーネックスグループ	2.6	1,942
コシダカホールディングス	5.1	2,356
アルトナー	0.5	336
パソナグループ	2.3	2,610
CDS	0.5	636
リンクアンドモチベーション	4.6	1,633
GCA	2.5	1,517
エス・エム・エス	6.5	16,425
サニーサイドアップグループ	0.7	468
パーソルホールディングス	21	26,313
リニカル	1	945
クックパッド	7.3	2,036
エスクリ	0.7	270
アイ・ケイ・ケイ	1	612
学情	0.7	839
スタジオアリス	1.1	1,659
シミックホールディングス	1	1,458
エプコ	0.4	420

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
N J S	0.5	867
総合警備保障	8.4	45,444
カカクコム	15.5	37,448
セントケア・ホールディング	1.4	586
サイネックス	0.4	251
ルネサンス	1.2	1,213
ディップ	3	7,224
オプトホールディング	1.1	1,557
新日本科学	2.3	1,465
ツクイ	5	2,305
キャリアデザインセンター	0.5	407
ベネフィット・ワン	7.7	16,362
エムスリー	46.4	174,696
ツカダ・グローバルホールディング	1.3	456
プラス	0.3	128
アウトソーシング	12	6,636
ウェルネット	2.1	1,398
ワールドホールディングス	0.7	1,192
ディー・エヌ・エー	10.3	14,440
博報堂DYホールディングス	29.3	32,581
ぐるなび	3.7	2,186
タカミヤ	2.2	1,009
ジャパンベスストレスキューシステム	1.7	1,076
ファンコミュニケーションズ	5.8	2,615
ライク	0.7	1,215
ビジネス・ブレイクスルー	0.9	334
エスプール	5.4	3,736
WDBホールディングス	1	2,441
手間いらず	0.1	445
ティア	1.2	612
CDG	0.2	292
バリューコマース	1.2	2,820
インフォマート	23.1	19,196
J Pホールディングス	6.6	1,782
E P Sホールディングス	2.8	3,057
レッグス	0.5	467
プレステージ・インターナショナル	7.9	6,754
アミューズ	1.1	2,351
ドリームインキュベータ	0.6	868
クイック	1.3	1,441
T A C	1.3	245
ケネディクス	19.6	9,525
電通グループ	21.7	48,825
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.8	491
びあ	0.6	1,956
イオンファンタジー	0.8	1,423
シーティーエス	2.4	1,653
ネクシーズグループ	0.6	576
みらかホールディングス	5.9	14,915
アルプス技研	1.9	3,397
ダイオーズ	0.4	420
日本空調サービス	2.2	1,540
オリエンタルランド	22.4	319,312
ダスキン	5.2	14,762
明光ネットワークジャパン	2.7	2,184
ファルコホールディングス	1.2	1,924
秀英予備校	0.5	208
田谷	0.4	205
ラウンドワン	5.9	5,150

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
リゾートトラスト	9.6	10,963
ビー・エム・エル	2.7	7,219
ワタベウェディング	0.3	111
りらいあコミュニケーションズ	3.8	4,582
リソー教育	9.6	2,534
早稲田アカデミー	0.9	839
ユー・エス・エス	23.6	40,285
東京個別指導学院	0.7	410
サイバーエージェント	13	63,505
楽天	98.1	97,805
クリーク・アンド・リバー社	1.1	1,063
テー・オー・ダブリュー	3.3	990
山田コンサルティンググループ	1.4	1,626
セントラルスポーツ	0.8	1,859
フルキャストホールディングス	2.1	2,984
エン・ジャパン	3.7	9,405
リソルホールディングス	0.2	670
テクノプロ・ホールディングス	4.2	25,788
アトラ	0.5	127
インターワークス	0.4	147
アイ・アールジャパンホールディングス	0.9	5,958
K e e P e r 技研	0.8	1,265
ファーストロジック	0.4	244
三機サービス	0.4	457
G u n o s y	1.3	1,168
デザインワン・ジャパン	0.6	124
イー・ガーディアン	0.9	1,785
リブセンス	1.3	367
ジャパンマテリアル	6.5	11,050
ベクトル	2.6	1,799
ウチヤマホールディングス	1	329
チャーム・ケア・コーポレーション	1.8	1,686
ライクキッズ	0.4	270
キャリアリンク	0.7	337
I B J	1.4	1,092
アサンテ	0.8	1,162
N・フィールド	1.4	677
バリューHR	0.8	1,114
M&Aキャピタルパートナーズ	1.7	5,669
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.8	1,169
E R Iホールディングス	0.6	400
アビスト	0.3	640
シグマクシス	1.4	2,277
ウィルグループ	1.4	880
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.9	571
リクルートホールディングス	150.7	498,515
エラン	1.2	2,053
土木管理総合試験所	0.9	298
ネットマーケティング	0.8	484
日本郵政	172.5	144,348
ベルシステム24ホールディングス	3.5	4,399
鎌倉新書	1.6	1,817
SMN	0.4	358
一蔵	0.2	74
L I T A L I C O	0.7	1,842
グローバルキッズCOMPANY	0.4	240
エアトリ	1.1	1,063
アトラエ	0.6	1,788
ストライク	0.8	3,348

銘柄	2020年5月15日現在	
	株数	評価額
	千株	千円
ソラスト	5.8	6,722
セラク	0.7	620
インソース	0.9	2,167
ベイクレント・コンサルティング	1.3	8,385
Orchestra Holdings	0.4	364
アイモバイル	0.7	438
キャリアインデックス	0.9	261
MS-Japan	0.7	569
船場	0.3	282
グレイステクノロジー	1	3,850
ジャパンエレベーターサービスホールディング	2.2	6,520
フルテック	0.3	383
グリーンズ	0.5	224
ツナググループ・ホールディングス	0.4	182
GameWith	0.6	424
ソウルドアウト	0.4	861
MS&Consulting	0.4	222
ミダック	0.3	357
日総工産	1.4	900
キュービーネットホールディングス	0.9	1,720
RPAホールディングス	1.6	1,233
スプリックス	0.6	516
マネジメントソリューションズ	0.9	885
and factory	0.2	222
カーブスホールディングス	5.8	3,346
フォーラムエンジニアリング	1.1	856
アドバンテッジリスクマネジメント	1.1	905
リロググループ	11.5	27,922
東祥	1.3	1,723
エイチ・アイ・エス	3.3	5,349
ラックランド	0.5	1,003
共立メンテナンス	3.5	10,160
イチネンホールディングス	2.4	2,731
建設技術研究所	1.5	2,476
スペース	1.4	1,416
長大	0.8	790
燦ホールディングス	0.9	968
スバル興業	0.1	791
東京テアトル	0.8	969
タナベ経営	0.4	496
ナガワ	0.7	5,208
よみうりランド	0.5	1,735
東京都競馬	1.4	5,117

銘柄	2020年5月15日現在		
	株数	評価額	
	千株	千円	
常磐興産	0.8	1,128	
カナモト	3.4	7,150	
東京ドーム	8.5	6,774	
西尾レントオール	1.9	4,145	
トランス・コスモス	2	4,336	
乃村工藝社	9	7,749	
藤田観光	0.9	1,579	
KNT-CTホールディングス	1.3	1,228	
日本管財	2.3	4,197	
トーカイ	2	5,298	
白洋舎	0.2	554	
セコム	22.3	199,674	
セントラル警備保障	1	4,570	
丹青社	4	2,732	
メイテック	2.6	13,026	
応用地質	2.3	2,918	
船井総研ホールディングス	4.3	10,784	
進学会ホールディングス	0.8	407	
オオバ	1.5	961	
いであ	0.5	738	
学究社	0.6	671	
ベネッセホールディングス	7	21,385	
イオンディライト	2.6	7,485	
ナック	1.2	1,075	
ニチイ学館	3	4,704	
ダイセキ	3.5	8,767	
ステップ	0.8	1,104	
合計	株数・金額	25,861	45,007,266
	銘柄数<比率>	2,149銘柄	<97.3%>

(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。

(注2) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		2020年5月15日現在	
		買建額	売建額
国内	T O P I X	百万円	百万円
		1,236	-

(注1) 単位未満は切り捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

(注2) -印は組み入れなし。

〈補足情報〉

日立国内債券インデックスマザーファンドの組入資産の明細(2020年5月15日現在)

下記は、日立国内債券インデックスマザーファンド全体(64,108,529千口)の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	2020年5月15日現在						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	64,445,000 (1,120,000)	71,055,606 (1,331,245)	78.2 (1.5)	— (—)	55.4 (1.4)	15.2 (0.1)	7.6 (—)
地 方 債 証 券	5,918,000 (5,918,000)	6,213,097 (6,213,097)	6.8 (6.8)	— (—)	3.2 (3.2)	3.3 (3.3)	0.3 (0.3)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	7,204,928 (7,192,755)	7,609,001 (7,596,520)	8.4 (8.4)	— (—)	4.7 (4.6)	3.2 (3.2)	0.6 (0.6)
金 融 債 券	500,000 (500,000)	499,856 (499,856)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	5,100,000 (5,100,000)	5,202,222 (5,202,222)	5.7 (5.7)	— (—)	2.3 (2.3)	2.5 (2.5)	0.9 (0.9)
合 計	83,167,928 (19,830,755)	90,579,783 (20,842,940)	99.6 (22.9)	— (—)	65.5 (11.5)	24.7 (9.5)	9.4 (1.9)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) —印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注6) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアキュムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債銘柄別

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第402回 利付国債(2年)	0.1	800,000	802,512	2021/ 7/ 1
第404回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,724	2021/ 9/ 1
第128回 利付国債(5年)	0.1	560,000	561,708	2021/ 6/20
第129回 利付国債(5年)	0.1	800,000	802,960	2021/ 9/20
第130回 利付国債(5年)	0.1	300,000	301,314	2021/12/20
第131回 利付国債(5年)	0.1	420,000	422,129	2022/ 3/20
第132回 利付国債(5年)	0.1	350,000	352,016	2022/ 6/20
第133回 利付国債(5年)	0.1	350,000	352,261	2022/ 9/20
第134回 利付国債(5年)	0.1	490,000	493,503	2022/12/20
第135回 利付国債(5年)	0.1	420,000	423,234	2023/ 3/20
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	141,152	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,873	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	600,000	605,526	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	300,000	302,895	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	520,000	525,241	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	550,000	555,764	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	550,000	555,841	2024/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	116,027	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	280,000	334,328	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	71,022	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	239,784	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	240,000	283,346	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	270,855	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	234,768	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	192,632	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	180,000	268,943	2051/ 3/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	275,463	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	257,621	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	150,000	206,884	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	200,000	258,388	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	340,000	330,167	2056/ 3/20
第 10回 利付国債(40年)	0.9	300,000	341,043	2057/ 3/20
第 11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	220,846	2058/ 3/20
第 12回 利付国債(40年)	0.5	100,000	100,162	2059/ 3/20
第315回 利付国債(10年)	1.2	700,000	710,514	2021/ 6/20
第317回 利付国債(10年)	1.1	630,000	640,804	2021/ 9/20
第318回 利付国債(10年)	1.0	400,000	406,324	2021/ 9/20
第319回 利付国債(10年)	1.1	300,000	306,129	2021/12/20
第320回 利付国債(10年)	1.0	710,000	723,369	2021/12/20
第321回 利付国債(10年)	1.0	400,000	408,668	2022/ 3/20
第322回 利付国債(10年)	0.9	200,000	203,964	2022/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	204,532	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	360,000	367,401	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	400,000	409,172	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	306,792	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	350,000	358,837	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	760,000	776,689	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	607,587	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	722,582	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	307,659	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	750,000	770,445	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	420,000	432,159	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	510,000	525,631	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	205,592	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	100,000	102,910	2024/12/20
第337回 利付国債(10年)	0.3	100,000	101,962	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	369,198	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	400,000	410,756	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	420,000	431,856	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	590,000	604,118	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	550,000	557,276	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	420,000	425,796	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	750,000	760,785	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	720,000	730,764	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	710,000	720,763	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	380,000	385,977	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	520,000	528,278	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	650,000	660,445	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	800,000	812,640	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	440,000	446,811	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	550,000	558,310	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	590,000	598,407	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	587,980	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	506,385	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	420,000	425,111	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	380,000	384,195	2029/12/20
第358回 利付国債(10年)	0.1	80,000	80,826	2030/ 3/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	50,558	2029/ 9/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	6,179	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	88,672	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	54,388	2032/11/22
第 11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	162,175	2033/ 6/20
第 12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	113,103	2033/ 9/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第 13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	87,249	2033/12/20
第 14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	156,391	2034/ 3/20
第 18回 利付国債(30年)	2.3	100,000	130,450	2035/ 3/20
第 19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	143,942	2035/ 6/20
第 20回 利付国債(30年)	2.5	100,000	134,237	2035/ 9/20
第 21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	131,553	2035/12/20
第 23回 利付国債(30年)	2.5	180,000	243,775	2036/ 6/20
第 25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	345,462	2036/12/20
第 26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	242,726	2037/ 3/20
第 27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	438,947	2037/ 9/20
第 28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	413,853	2038/ 3/20
第 29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	397,259	2038/ 9/20
第 30回 利付国債(30年)	2.3	280,000	380,528	2039/ 3/20
第 31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	296,687	2039/ 9/20
第 32回 利付国債(30年)	2.3	230,000	316,128	2040/ 3/20
第 33回 利付国債(30年)	2.0	240,000	317,613	2040/ 9/20
第 34回 利付国債(30年)	2.2	300,000	410,580	2041/ 3/20
第 35回 利付国債(30年)	2.0	320,000	426,972	2041/ 9/20
第 36回 利付国債(30年)	2.0	330,000	442,259	2042/ 3/20
第 37回 利付国債(30年)	1.9	380,000	503,093	2042/ 9/20
第 38回 利付国債(30年)	1.8	250,000	326,660	2043/ 3/20
第 39回 利付国債(30年)	1.9	180,000	239,603	2043/ 6/20
第 40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	196,722	2043/ 9/20
第 41回 利付国債(30年)	1.7	120,000	154,965	2043/12/20
第 42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	258,552	2044/ 3/20
第 43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	362,770	2044/ 6/20
第 44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	168,610	2044/ 9/20
第 45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	312,970	2044/12/20
第 46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	400,886	2045/ 3/20
第 47回 利付国債(30年)	1.6	100,000	127,799	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	246,302	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	271,073	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	326,190	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	231,592	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	263,369	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	311,427	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	348,067	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	150,000	163,069	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	326,358	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	282,679	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	326,379	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	265,585	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	160,000	178,321	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	223,015	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	211,866	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	260,000	255,015	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	225,556	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	240,000	235,329	2049/12/20
第 66回 利付国債(30年)	0.4	100,000	98,039	2050/ 3/20
第 51回 利付国債(20年)	2.0	30,000	30,717	2021/ 6/21
第 52回 利付国債(20年)	2.1	65,000	66,998	2021/ 9/21
第 53回 利付国債(20年)	2.1	60,000	62,178	2021/12/20
第 54回 利付国債(20年)	2.2	110,000	114,170	2021/12/20
第 55回 利付国債(20年)	2.0	100,000	104,017	2022/ 3/21
第 56回 利付国債(20年)	2.0	230,000	240,520	2022/ 6/20
第 57回 利付国債(20年)	1.9	130,000	135,673	2022/ 6/20
第 59回 利付国債(20年)	1.7	100,000	104,881	2022/12/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第 60回 利付国債(20年)	1.4	100,000	104,100	2022/12/20
第 61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	144,670	2023/ 3/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	236,856	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	171,046	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	247,026	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	80,000	85,632	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	175,000	190,839	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	130,398	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	165,673	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	109,626	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	290,000	318,309	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	121,883	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	263,592	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	209,655	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	110,857	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	200,466	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	200,518	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	291,033	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	224,994	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	340,000	380,575	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	226,104	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	285,570	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	287,117	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	228,466	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	310,032	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	69,279	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	160,650	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	229,154	2027/ 3/20
第 94回 利付国債(20年)	2.1	200,000	230,534	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	104,250	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	140,000	163,938	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	180,000	209,444	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	300,000	350,622	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	200,000	236,246	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	216,437	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	179,143	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	224,692	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	160,000	190,556	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	201,711	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	200,000	233,854	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	220,000	258,084	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	220,000	262,831	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	251,905	2029/ 9/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	145,531	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	121,704	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	220,000	265,581	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	140,000	168,082	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	118,043	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	300,000	365,565	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	230,000	277,837	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	250,000	308,272	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	250,000	302,877	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	250,000	300,180	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	200,000	240,808	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	119,301	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	300,000	358,806	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	177,712	2031/ 9/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	237,484	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	300,000	360,510	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	230,000	273,695	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	210,000	247,432	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	116,794	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	106,190	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	290,000	346,358	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	380,000	454,757	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	120,000	145,096	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	230,000	272,865	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	250,000	293,432	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	420,455	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	457,341	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	390,000	465,012	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	380,000	449,543	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	430,000	503,345	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	410,000	468,794	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	500,000	572,050	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	300,000	348,084	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	300,000	343,887	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	380,000	424,361	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	350,000	358,270	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	210,000	208,212	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	320,000	332,038	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	170,000	179,050	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	310,000	331,467	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	230,000	242,003	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	320,000	336,377	2037/ 9/20
第163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	294,280	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	350,000	361,543	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	350,764	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	330,695	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	329,817	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	222,730	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	280,000	278,238	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	248,185	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	208,265	2039/12/20
第172回 利付国債(20年)	0.4	30,000	30,306	2040/ 3/20
第 25回 メキシコ合衆国円貨債券(2018)	0.6	100,000	96,115	2023/ 4/20
小 計	—	64,445,000	71,055,606	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
第 10回 東京都公募公債(東京再生都債)	2.31	100,000	135,201	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	102,132	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,986	2024/12/20
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,151	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	110,420	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	102,257	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	102,255	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	118,201	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,180	2024/10/30
第 3回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	108,821	2027/ 7/16
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,869	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	102,005	2025/ 2/26
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	108,244	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	102,324	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	102,217	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,602	2034/ 5/15

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,934	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	118,195	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	102,285	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	102,052	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	116,527	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,636	2034/ 5/26
平成24年度第 9回 千葉県公募公債	0.82	100,000	102,195	2023/ 2/24
平成25年度第 1回 千葉県公募公債	0.58	100,000	101,618	2023/ 4/25
平成25年度第 3回 千葉県公募公債	0.89	100,000	102,669	2023/ 6/23
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	103,950	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,839	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	101,500	2028/10/31
第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	117,000	119,038	2022/ 5/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,813	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	101,776	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,139	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,855	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	102,809	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,221	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	103,453	2024/ 3/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,147	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,996	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,839	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	100,000	100,928	2027/ 7/23
平成28年度第 3回 島根県公募公債	0.001	100,000	99,956	2021/11/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	99,967	2026/11/30
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	102,194	2023/11/29
平成24年度第 1回 熊本市公募公債	0.796	100,000	101,948	2022/11/30
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,632	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	111,352	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	110,357	2024/ 6/20
第475回 名古屋市公募公債(10年)	1.15	100,000	101,223	2021/ 6/18
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	101,732	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	110,953	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,899	2027/ 8/13
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,975	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	111,573	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	102,337	2023/12/20
第 50回 川崎市公募公債(5年)	0.01	100,000	99,957	2022/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,885	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	107,365	2029/10/22
平成23年度第 5回 広島市公募公債	1.01	100,000	101,748	2022/ 2/25
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,765	2027/ 9/17
小 計	—	5,918,000	6,213,097	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 23回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.645	108,000	110,654	2024/ 3/18
第 38回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	99,988	2023/ 2/17
第 13回 道路債券	2.28	100,000	105,310	2022/ 9/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	135,125	2034/ 6/20
第 55回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.22	100,000	119,830	2030/ 2/ 8
第 92回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	101,707	2022/ 6/20
第 98回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,949	2022/12/20
第100回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.784	100,000	101,985	2022/12/20
第128回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	102,373	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	100,000	102,127	2024/ 6/20
第168回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	100,000	101,840	2022/ 7/29
第169回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	100,000	117,302	2032/ 7/30

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第173回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	106,000	108,051	2022/ 9/30
第186回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	100,000	101,881	2023/ 3/17
第224回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.72	100,000	127,251	2044/ 8/31
第239回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	112,421	2035/ 2/28
第 5回 政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.173	100,000	100,623	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	120,279	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	120,634	2031/ 1/28
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	117,078	2028/ 4/25
第 25回 地方公共団体金融機構債券	1.178	200,000	202,618	2021/ 6/28
第 34回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	101,740	2022/ 3/14
第 37回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	400,000	407,440	2022/ 6/17
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	101,763	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	115,175	2034/ 9/28
第 42回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	100,000	102,001	2022/11/14
第 46回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	101,881	2023/ 3/17
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	102,334	2024/ 9/13
第 76回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	102,131	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	101,412	2028/10/27
第119回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.04	100,000	99,911	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	106,888	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	102,880	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	102,334	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	136,926	2037/ 3/19
第216回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.483	100,000	116,539	2034/ 4/28
第229回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	200,000	204,762	2024/10/31
第261回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.381	100,000	101,969	2025/11/28
第288回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	100,000	99,809	2026/ 9/30
第354回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	100,000	100,654	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	108,642	2029/ 6/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,540	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	102,383	2023/10/20
第 22回 新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.05	100,000	100,035	2023/12/20
第 38回 関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.112	100,000	101,763	2021/12/20
第 1回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.51	11,225	11,378	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	12,945	13,347	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.82	11,365	11,571	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	13,623	14,177	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	15,251	15,960	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	117,549	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	15,164	15,929	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	23,450	23,991	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	12,173	12,480	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	40,870	43,877	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	23,104	24,999	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	20,962	22,450	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	27,786	29,779	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	28,700	30,436	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	28,951	30,635	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,044	13,632	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	59,490	63,319	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,331	15,114	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	30,400	32,197	2046/ 7/10
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	82,132	86,940	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	109,766	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	48,907	51,606	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	49,443	51,520	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	54,972	57,151	2049/10/10

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	56,395	58,400	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	61,493	62,807	2050/ 2/10
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	84,869	85,764	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	85,903	87,099	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	86,010	87,269	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	90,492	91,731	2053/ 2/10
第132回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.092	100,000	107,547	2028/ 3/17
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	94,225	94,951	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	95,873	96,219	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	97,859	96,751	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	99,521	99,532	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	101,905	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,294	2026/12/18
第 11回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.067	100,000	101,865	2022/ 2/18
第 13回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.802	100,000	102,111	2023/ 2/ 8
小 計	—	7,204,928	7,609,001	—
(金融債券)	%	千円	千円	
第327回 信金中金債(5年)	0.06	100,000	100,018	2022/ 2/25
第335回 信金中金債(5年)	0.1	100,000	100,097	2022/10/27
第341回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,147	2023/ 4/27
第238号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,594	2022/11/25
小 計	—	500,000	499,856	—
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第530回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	0.274	100,000	99,109	2029/ 6/25
第517回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.19	100,000	100,015	2023/ 6/20
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	100,109	2024/10/25
第308回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.769	100,000	102,328	2024/ 9/25
第508回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.465	100,000	100,301	2029/ 4/25
第451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	100,444	2027/ 5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	120,106	2030/12/13
第 36回 東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.06	100,000	100,054	2021/ 6/18
第 24回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.609	100,000	102,426	2024/ 9/20
第 30回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.17	100,000	100,238	2026/ 5/22
第 5回 大和ハウス工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.443	100,000	100,315	2021/ 6/18
第 16回 森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.395	100,000	99,718	2028/ 9/14
第 8回 明治ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.12	100,000	99,718	2023/ 1/30
第 12回 日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	0.11	100,000	99,573	2023/ 9/ 8
第 30回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.375	100,000	99,582	2027/ 7/16
第 32回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	100,000	99,508	2025/ 7/18
第 4回 日本土地建物株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.734	100,000	100,874	2028/10/25
第 57回 住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	100,000	99,743	2024/ 9/13
第 12回 ヤフー株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.37	100,000	97,832	2026/ 7/31
第 7回 新日鐵住金株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.12	100,000	99,447	2023/ 6/20
第 21回 ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.681	100,000	101,689	2024/ 7/30
第 16回 パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.3	100,000	99,867	2023/ 9/20
第 15回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.382	100,000	100,279	2021/ 6/18
第 84回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.5	100,000	101,377	2021/ 6/14
第 85回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.2	100,000	113,796	2029/ 7/13
第 20回 株式会社りそなホールディングス無担保社債(社債間限定同順位)	0.27	100,000	99,694	2025/ 7/23
株式会社三井住友フィナンシャルグループ第1回無担保劣後社債	0.849	100,000	100,457	2024/ 9/12
第 31回 株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位)	0.418	100,000	100,299	2021/ 6/18
第 80回 日立キャピタル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.28	100,000	97,231	2029/10/19
第 75回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.22	100,000	99,445	2025/ 1/23
第 71回 三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.31	100,000	98,530	2030/ 4/16
第 99回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.836	100,000	102,077	2024/ 7/29
第 5回 イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.903	100,000	101,619	2024/ 3/22
第 65回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	2.149	100,000	117,203	2029/12/21

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第 15回 西日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特)	2.26	100,000	115,034	2027/12/20
第 71回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	1.917	100,000	126,995	2044/10/28
第 22回 東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	0.215	100,000	99,860	2027/ 6/21
第 11回 日本通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.2	100,000	98,856	2026/ 7/14
第 25回 KDD I 株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.395	100,000	99,508	2028/11/22
第 35回 電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.126	100,000	102,393	2022/10/20
第 39回 電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.929	100,000	102,631	2024/ 2/20
第 7回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.46	100,000	100,524	2022/10/24
第 14回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.43	100,000	100,347	2023/ 7/24
第 34回 東京瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.064	100,000	101,367	2021/ 9/22
第 17回 北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.25	100,000	100,170	2024/ 3/14
第 3回 東京都競馬株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.18	100,000	99,595	2023/ 7/ 5
第 1回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20	0.64	100,000	99,948	2022/ 1/27
クレディ・アグリコル・エス・エー第6回 円貨社債	0.865	100,000	101,869	2024/11/28
第 1回 H S B Cホールディングス	0.45	100,000	99,829	2021/ 9/24
第 6回 ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債(2	0.65	100,000	98,131	2023/ 5/30
第 10回 オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201	0.293	100,000	100,162	2024/ 1/23
小 計	—	5,100,000	5,202,222	—
合 計	—	83,167,928	90,579,783	—

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<補足情報>

日立外国株式インデックスマザーファンドの組入資産の明細(2020年5月15日現在)

下記は、日立外国株式インデックスマザーファンド全体(42,749,029千口)の内容です。

(1) 外国株式
上場株式

銘柄	2020年5月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AERCAP HOLDINGS NV	31	80	8,633	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	70	373	40,074	素材
NXP SEMICONDUCTORS NV	72	679	73,045	半導体・半導体製造装置
AFLAC INC	191	626	67,354	保険
CHECK POINT SOFTWARE TECH	32	339	36,484	ソフトウェア・サービス
MYLAN INC	121	184	19,784	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
WIX.COM LTD	13	246	26,477	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	9	87	9,452	ソフトウェア・サービス
AGNC INVESTMENT CORP	144	178	19,198	各種金融
AES CORPORATION	156	184	19,809	公益事業
AT&T INC	1,889	5,400	580,182	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	457	4,196	450,864	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	443	3,985	428,134	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
ABIOMED INC	11	202	21,775	ヘルスケア機器・サービス
CHUBB LTD	117	1,163	125,001	保険
ACTIVISION BLIZZARD INC	199	1,451	155,978	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	9	68	7,372	資本財
ADOBE INC	125	4,442	477,244	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	17	205	22,122	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	274	1,493	160,454	半導体・半導体製造装置
AGILENT TECHNOLOGIES INC	80	660	71,006	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	56	1,283	137,916	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	42	408	43,870	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	164	2,951	317,115	ソフトウェア・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	141	15,194	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
SEAGATE TECHNOLOGY	64	307	33,050	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APTIV PLC	67	423	45,454	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	107	808	86,873	資本財
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48	106	11,426	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	117	251	26,992	メディア・娯楽
WILLIS TOWERS WATSON PLC	33	682	73,290	保険
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	16	57	6,179	食品・飲料・タバコ
TECHNIPFMC PLC	59	39	4,215	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	36	119	12,832	資本財
ALLEGION PLC	23	215	23,120	資本財
STERIS PLC	22	331	35,662	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC	34	180	19,386	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
AMCOR PLC	150	136	14,648	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	62	488	52,511	資本財
AON PLC	61	1,185	127,399	保険
PENTAIR PLC	35	120	12,892	資本財
MEDTRONIC PLC	347	3,258	350,107	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	84	107	11,595	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	201	575	61,784	資本財
LINDE PLC	81	1,468	157,790	素材
TE CONNECTIVITY LTD	86	606	65,187	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GARMIN LTD	32	247	26,573	耐久消費財・アパレル
ALBEMARLE CORP	28	167	17,961	素材
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	30	421	45,291	不動産
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	58	585	62,882	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	20	412	44,280	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	3	157	16,879	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	10	39	4,230	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	64	294	31,586	公益事業
ALLSTATE CORP	83	787	84,603	保険
ALLY FINANCIAL INC	89	134	14,447	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	27	367	39,506	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	79	10,774	1,157,499	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	77	10,488	1,126,782	メディア・娯楽
ALTICE USA INC- A	31	71	7,663	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	483	1,753	188,337	食品・飲料・タバコ
AMAZON COM INC	108	25,904	2,782,940	小売
AMERCO	2	58	6,235	運輸
AMEREN CORPORATION	64	444	47,780	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	26	23	2,555	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	128	1,005	108,041	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	180	1,510	162,264	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	18	99	10,693	保険

銘柄	2020年5月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	226	582	62,612	保険
AMERICAN TOWER CORP	115	2,640	283,682	不動産
AMERICAN WATER WORKS CO INC	47	546	58,707	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	41	344	37,012	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	32	395	42,463	各種金融
AMETEK INC	59	468	50,337	資本財
AMGEN INC	154	3,670	394,358	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	77	641	68,890	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANALOG DEVICES	95	1,012	108,749	半導体・半導体製造装置
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	347	205	22,105	各種金融
ANSYS INC	22	554	59,594	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	65	1,797	193,061	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	89	92	9,936	エネルギー
APPLE INC	1,147	35,532	3,817,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	239	1,303	140,057	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	59	137	14,819	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	145	497	53,465	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	14	287	30,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	18	110	11,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	15	133	14,349	保険
ATMOS ENERGY CORP	31	294	31,601	公益事業
AUTODESK INC	57	1,013	108,918	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	22	126	13,566	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	111	1,509	162,156	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	6	707	75,978	小売
AVALONBAY COMMUNITIES INC	36	551	59,237	不動産
AVERY DENNISON CORP	21	224	24,137	素材
BAKER HUGHES CO	151	212	22,802	エネルギー
BALL CORP	81	505	54,332	素材
BANK OF AMERICA CORP	2,210	4,798	515,523	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	215	699	75,137	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	126	1,097	117,889	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	69	1,808	194,294	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	9	146	15,783	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
WR BERKLEY CORP	35	165	17,822	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	339	5,803	623,424	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	62	480	51,670	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	6	274	29,506	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	47	431	46,346	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
BIOGEN INC	47	1,487	159,803	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	36	262	28,217	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	30	1,494	160,564	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	171	865	92,954	各種金融
BOEING CO	138	1,700	182,640	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	11	1,520	163,375	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	34	237	25,539	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	55	152	16,431	自動車・自動車部品
BOSTON PROPERTIES INC	40	306	32,959	不動産
BOSTON SCIENTIFIC CORP	361	1,283	137,856	ヘルスケア機器・サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	607	3,871	415,864	医薬・バイotech/ロジ・ライフサイエンス
BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR	87	324	34,885	食品・飲料・タバコ
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	30	344	37,021	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	102	2,739	294,341	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	58	214	22,998	保険
BROWN-FORMAN CORP -CLASS B	80	526	56,556	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	17	282	30,367	小売
CBOE GLOBAL MARKETS INC	27	268	28,814	各種金融
CBRE GROUP INC	84	301	32,351	不動産
CDK GLOBAL INC	26	95	10,242	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	38	378	40,700	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	123	13,230	素材
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	32	230	24,813	運輸
CIGNA CORP	96	1,776	190,892	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	93	1,678	180,357	各種金融
CMS ENERGY CORP	74	402	43,223	公益事業
CSX CORP	191	1,208	129,790	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	337	2,101	225,733	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	95	177	19,033	エネルギー

銘柄	2020年5月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
CADENCE DESIGN SYS INC	73	597	64,189	ソフトウェア・サービス
CAMDEN PROPERTY TRUST	26	216	23,244	不動産
CAMPBELL SOUP CO	38	203	21,891	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	120	714	76,806	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	77	364	39,198	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	42	321	34,514	小売
CARNIVAL CORP	98	120	12,921	消費者サービス
CARRIER GLOBAL CORP	212	351	37,755	資本財
CATERPILLAR INC	143	1,520	163,362	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	29	220	23,718	素材
CENTENE CORP	151	997	107,201	ヘルスケア機器・サービス
CENTROPOINT ENERGY INC	118	203	21,905	公益事業
CENTURYLINK INC	235	216	23,274	電気通信サービス
CERNER CORP	82	537	57,779	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	38	1,930	207,347	メディア・娯楽
CHENERE ENERGY INC	61	254	27,379	エネルギー
CHEVRON CORP	489	4,403	473,091	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	7	652	70,100	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	64	465	50,053	家庭用品・パーソナル用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	40	203	21,909	保険
CISCO SYSTEMS INC	1,097	4,812	516,959	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	21	497	53,415	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	565	2,376	255,318	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	115	231	24,894	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	33	496	53,318	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	32	675	72,529	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY	1,053	4,602	494,482	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	45	253	27,183	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	142	720	77,404	ソフトウェア・サービス
COLGATE-PALMOLIVE CO	211	1,414	152,009	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	1,174	4,200	451,207	メディア・娯楽
COMERICA INC	38	121	13,080	銀行
CONAGRA BRANDS INC	127	432	46,450	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	53	290	31,230	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	285	1,138	122,255	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	86	618	66,480	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	44	695	74,666	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	23	29	3,204	エネルギー
COOPER COS INC/THE	13	385	41,414	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	55	441	47,458	商業・専門サービス
CORNING INC	200	399	42,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	195	456	49,040	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	113	3,413	366,737	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	10	647	69,556	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	56	18	2,025	家庭用品・パーソナル用品
CROWN CASTLE INTL CORP	108	1,642	176,403	不動産
CROWN HOLDINGS INC	36	216	23,251	素材
CUMMINS INC	38	590	63,484	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DR HORTON INC	91	421	45,290	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	50	492	52,924	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	65	99	10,694	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	162	2,621	281,625	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	29	193	20,767	消費者サービス
DAVITA INC	32	250	26,862	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	77	979	105,190	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	43	181	19,481	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	37	71	7,703	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	56	212	22,788	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	107	125	13,430	エネルギー
DEXCOM INC	24	967	103,919	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	37	141	15,176	エネルギー
DIGITAL REALTY TRUST INC	68	902	96,955	不動産
THE WALT DISNEY CO	465	4,932	529,892	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	78	306	32,940	各種金融
DISCOVERY INC-A	43	88	9,503	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	87	160	17,294	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	62	153	16,448	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	28	341	36,701	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	67	1,216	130,640	小売
DOLLAR TREE INC	62	469	50,478	小売
DOMINION ENERGY INC	213	1,698	182,487	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	10	376	40,394	消費者サービス
DOVER CORP	38	324	34,899	資本財
DOW INC	193	647	69,508	素材
DROPBOX INC-CLASS A	65	139	15,013	ソフトウェア・サービス

銘柄	2020年5月15日現在			業種等
	株数	評価額		
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	千米ドル	千円	
DUKE REALTY CORP	97	295	31,772	不動産
DUKE ENERGY CORP	189	1,560	167,625	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	192	872	93,699	素材
EOG RESOURCES INC	152	722	77,662	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORP	55	213	22,925	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	35	111	11,945	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	36	216	23,289	素材
EATON VANCE CORP	25	85	9,220	各種金融
EBAY INC	201	846	90,930	小売
ECOLAB INC	67	1,289	138,514	素材
EDISON INTERNATIONAL	93	539	57,956	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	54	1,174	126,147	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	105	203	21,881	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	76	891	95,775	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	158	845	90,870	資本財
ENBRIDGE INC	137	421	45,270	エネルギー
ENERGY CORP	52	495	53,230	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	14	292	31,438	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	31	463	49,830	商業・専門サービス
EQUINIX INC	22	1,487	159,779	不動産
EQUITABLE HOLDINGS INC	102	166	17,916	各種金融
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	46	258	27,738	不動産
EQUITY RESIDENTIAL	97	557	59,939	不動産
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	7	113	12,208	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	52	204	21,965	公益事業
ESSEX PROPERTY TRUST INC	17	382	41,093	不動産
EVERGY INC	62	351	37,752	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	84	651	70,028	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	35	299	32,122	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORPORATION	252	910	97,851	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	33	212	22,820	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	41	299	32,144	運輸
EXTRA SPACE STORAGE INC	34	286	30,755	不動産
EXXON MOBIL CORPORATION	1,094	4,628	497,245	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	138	14,826	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FMC CORP	32	283	30,461	素材
FACEBOOK INC-A	622	12,863	1,381,934	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	9	251	26,985	各種金融
FASTENAL CO	150	580	62,330	資本財
FEDERAL REALTY INVS TRUST	20	140	15,044	不動産
FEDEX CORPORATION	64	703	75,546	運輸
F5 NETWORKS INC	16	219	23,569	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	159	2,071	222,585	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	72	183	19,736	保険
FIFTH THIRD BANCORP	181	296	31,879	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	44	423	45,463	銀行
FISERV INC	149	1,486	159,707	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	140	563	60,499	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	23	509	54,735	ソフトウェア・サービス
FLOWSERVE CORP	28	64	6,912	資本財
FORD MOTOR COMPANY	1,015	496	53,344	自動車・自動車部品
FORTINET INC	38	524	56,360	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	79	440	47,371	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	37	191	20,526	資本財
FOX CORP - CLASS A	93	242	26,018	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	42	107	11,560	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	74	133	14,333	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	381	316	33,955	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	49	423	45,528	保険
GAP INC	44	31	3,437	小売
GARTNER INC	21	232	24,960	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	63	848	91,182	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	2,263	1,290	138,600	資本財
GENERAL MILLS INC	157	980	105,354	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	334	745	80,051	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	38	270	29,060	小売
GILEAD SCIENCES INC	328	2,533	272,135	医薬・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	78	1,285	138,125	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	27	186	20,084	保険
GODADDY INC - CLASS A	41	312	33,567	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	83	1,449	155,701	各種金融
GRAINGER (W W) INC	11	311	33,420	資本財
GRUBHUB INC	19	103	11,169	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	20	184	19,803	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	71	704	75,642	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	2020年5月15日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	千香港ドル	千円		
CLP HOLDINGS LIMITED	429	3,410	47,270	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	312	7,787	107,935	各種金融	
MTR CORP	412	1,691	23,451	運輸	
HANG SENG BANK	201	2,635	36,522	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	352	1,052	14,587	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	370	1,855	25,717	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	2,663	3,617	50,136	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	560	2,889	40,049	消費者サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	160	334	4,634	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	980	2,332	32,327	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	335	247	3,426	資本財	
PCCW LTD	910	404	5,612	電気通信サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HDLG	150	196	2,723	耐久消費財・アパレル	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,645	1,465	20,317	不動産	
SINO LAND CO	807	836	11,588	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	415	4,013	55,620	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	115	550	7,634	不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	180	574	7,958	食品・飲料・タバコ	
WHEELOK & CO LTD	210	1,163	16,124	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	365	2,328	32,275	資本財	
LINK REIT	549	3,642	50,486	不動産	
SJM HOLDINGS LTD	400	317	4,401	消費者サービス	
WYNN MACAU LTD	440	598	8,293	消費者サービス	
AIA GROUP LTD	3,130	21,017	291,308	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD	880	1,045	14,489	電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	644	1,941	26,911	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	290	604	8,380	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	326	1,042	14,447	不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	707	564	7,822	公益事業	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	365	835	11,584	食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	2,335	1,662	23,042	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	707	3,959	54,883	資本財	
CX INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	185	869	12,051	公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LTD	682	3,219	44,617	不動産	
小計	株数・金額	24,209	82,746	1,146,863	
	銘柄数<比率>	37銘柄	—	<1.1%>	
(シンガポール)	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	390	129	9,742	資本財	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	468	887	66,966	銀行	
CITY DEVELOPMENTS	119	89	6,762	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	20	40	3,021	小売	
SATS LTD	108	29	2,233	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	218	214	16,189	各種金融	
CAPITALAND LIMITED	695	195	14,791	不動産	
CAPITALAND MALL TRUST	608	105	7,984	不動産	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	779	224	16,946	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	480	72	5,433	運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	136	51	3,910	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	330	640	48,315	銀行	
UOL GROUP LIMITED	133	87	6,624	不動産	
VENTURE CORP LTD	60	93	7,054	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	756	113	8,562	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	337	49	3,769	メディア・娯楽	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,144	570	43,058	電気通信サービス	
SUNTEC REIT	420	57	4,310	不動産	
SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED	221	33	2,558	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	864	752	56,792	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	525	203	15,333	食品・飲料・タバコ	
KEPPEL CORP	360	214	16,220	資本財	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	610	57	4,304	資本財	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	528	94	7,132	不動産	
GENTING SINGAPORE LTD	1,248	91	6,875	消費者サービス	
SINGAPORE AIRLINES LT-RIGHTS	204	15	1,170	運輸	
SINGAPORE AIRLINE-MCB RIGHTS	401	0.08024	6	運輸	
小計	株数・金額	13,166	5,115	386,074	
	銘柄数<比率>	27銘柄	—	<0.4%>	

銘柄	2020年5月15日現在			業種等	
	株数	評価額			
		外貨建金額	邦貨換算金額		
(イスラエル)	百株	千イスラエリシケル	千円		
BANK HAPOALIM BM	305	612	18,558	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	391	669	20,299	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	6	279	8,489	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	268	277	8,422	銀行	
ICL GROUP LTD	166	180	5,476	素材	
NICE LTD	16	959	29,100	ソフトウェア・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	176	665	20,162	医薬品/テクノロジー/ライフサイエンス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	27	182	5,539	銀行	
AZRIELI GROUP	11	198	6,010	不動産	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	106	3,240	素材	
小計	株数・金額	1,370	4,132	125,300	
	銘柄数<比率>	10銘柄	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	299,864	—	96,135,389	
	銘柄数<比率>	1,336銘柄	—	<96.0%>	

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

(注2) 邦貨換算金額欄の<>内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	2020年5月15日現在	
	買建額	売建額
	百万円	百万円
S&P500 EMINI	2,859	—
S&PTSE60 1006	147	—
SWISS MKT IX	166	—
EURX50 1006	409	—
SPI200 1006	110	—
FTSE100 IDX	225	—

(注1) 単位未満は切り捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

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

(注3) —印は組み入れなし。

<補足情報>

日立外国債券インデックスマザーファンドの組入資産の明細(2020年5月15日現在)

下記は、日立外国債券インデックスマザーファンド全体(17,471,283千口)の内容です。

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	2020年5月15日現在							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 153,160	千米ドル 172,772	千円 18,560,901	% 46.4	% -	% 20.9	% 17.2	% 8.3
カナダ	千カナダドル 8,470	千カナダドル 10,012	765,926	1.9	-	0.9	0.7	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 59,900	千メキシコペソ 65,734	295,149	0.7	-	0.4	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	19,870	24,549	2,849,679	7.1	-	4.3	2.0	0.8
イタリア	26,470	29,572	3,432,758	8.6	-	5.0	2.4	1.1
フランス	27,520	33,478	3,886,187	9.7	-	6.7	2.2	0.8
オランダ	5,200	6,501	754,733	1.9	-	1.2	0.5	0.1
スペイン	16,300	19,559	2,270,447	5.7	-	3.8	1.3	0.6
ベルギー	6,730	8,395	974,502	2.4	-	1.8	0.4	0.2
オーストリア	4,030	5,102	592,310	1.5	-	1.0	0.3	0.1
フィンランド	1,740	1,967	228,386	0.6	-	0.4	0.2	-
アイルランド	2,200	2,535	294,338	0.7	-	0.5	0.2	0.0
イギリス	千英ポンド 13,930	千英ポンド 20,047	2,632,773	6.6	-	5.3	1.0	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 8,350	千スウェーデンクローナ 9,729	106,733	0.3	-	0.1	0.1	-
ノルウェー	千ノルウェークローネ 8,610	千ノルウェークローネ 9,307	98,564	0.2	-	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 9,860	千デンマーククローネ 12,678	197,405	0.5	-	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,420	千ポーランドズロチ 9,145	232,837	0.6	-	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 9,730	千オーストラリアドル 11,481	797,424	2.0	-	1.3	0.5	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 2,070	千シンガポールドル 2,413	182,143	0.5	-	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 7,390	千マレーシアリンギット 7,952	196,593	0.5	-	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千シェケイ 4,000	千シェケイ 4,788	145,189	0.4	-	0.2	0.2	-
合 計	-	-	39,494,985	98.7	-	55.3	30.2	13.2

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

(注2) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注4) -印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	690	697	74,925	2021/ 6/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,070	1,082	116,279	2021/ 7/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,100	1,113	119,585	2021/ 8/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,300	1,317	141,492	2021/ 9/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,070	1,105	118,775	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	860	870	93,559	2021/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	700	720	77,380	2022/10/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,170	1,212	130,288	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	940	975	104,826	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,020	1,059	113,850	2023/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	800	840	90,274	2025/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	550	582	62,525	2026/ 8/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	807	86,785	2022/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,280	1,319	141,775	2022/ 9/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	900	931	100,078	2023/ 1/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	622	66,839	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	680	705	75,814	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,630	1,717	184,523	2024/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,810	1,929	207,254	2026/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	400	427	45,912	2027/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,300	1,409	151,420	2030/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	750	774	83,178	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,530	1,585	170,300	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	560	583	62,703	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	470	490	52,669	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	920	964	103,599	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	980	1,048	112,618	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,550	2,732	293,572	2026/ 5/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,181	126,952	2026/ 9/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,420	1,552	166,816	2029/ 8/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	500	509	54,751	2021/ 7/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,280	1,311	140,840	2021/11/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	503	54,133	2022/ 2/28
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	885	95,125	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	680	73,102	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	680	73,147	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	774	83,159	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	713	76,611	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,450	1,499	161,091	2022/ 7/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	632	67,979	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	930	969	104,148	2023/ 1/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,000	1,084	116,486	2026/12/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	660	677	72,787	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	910	937	100,762	2022/ 2/28
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	840	866	93,117	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	900	929	99,897	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	750	776	83,373	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	600	622	66,875	2022/ 7/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,160	1,204	129,447	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,350	1,403	150,786	2022/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	520	55,951	2022/10/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	950	1,014	109,027	2024/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,120	1,218	130,877	2026/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	682	73,367	2021/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	736	79,168	2021/ 8/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	920	944	101,422	2021/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	894	96,063	2021/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,114	119,731	2022/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	686	73,767	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,010	1,055	113,353	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,401	150,591	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	940	986	106,009	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	587	63,134	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,490	1,594	171,275	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,320	1,413	151,900	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,830	1,976	212,293	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,820	1,976	212,310	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,520	1,670	179,482	2026/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	490	576	61,902	2050/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	705	75,771	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,004	107,872	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	930	954	102,579	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	750	774	83,172	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	645	69,380	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,430	1,502	161,450	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,610	1,717	184,529	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	780	835	89,719	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,380	1,479	158,978	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	870	937	100,663	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	540	58,020	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,350	1,461	157,040	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	670	729	78,399	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	645	69,378	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	830	863	92,712	2022/ 4/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	870	933	100,269	2023/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	900	967	103,893	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	750	815	87,584	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,430	1,555	167,067	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	800	871	93,672	2024/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,350	1,487	159,839	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,210	1,353	145,396	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,110	1,249	134,265	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,080	1,219	131,025	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	949	102,014	2046/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,730	2,134	229,268	2049/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	780	826	88,757	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,720	1,872	201,178	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,250	1,446	155,448	2029/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,750	1,818	195,316	2022/ 1/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,560	1,623	174,399	2022/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	820	874	93,928	2023/ 3/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,630	1,775	190,720	2024/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	610	672	72,290	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	900	1,008	108,342	2026/ 2/28
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,048	112,601	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,054	113,248	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	979	105,178	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,400	1,437	154,420	2021/ 6/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	800	889	95,565	2025/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,230	1,383	148,635	2025/12/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	950	1,116	119,998	2029/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	840	868	93,336	2021/ 9/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	550	591	63,531	2023/ 4/30
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	700	754	81,017	2023/ 5/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,130	1,223	131,486	2023/ 8/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,090	2,273	244,262	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,060	1,158	124,471	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,040	2,387	256,448	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	651	70,005	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	800	1,071	115,070	2047/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	990	1,327	142,566	2047/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,200	1,245	133,820	2021/10/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	580	653	70,161	2025/ 4/30
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,180	1,330	142,940	2025/ 5/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,260	2,675	287,442	2028/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,640	1,948	209,357	2028/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	700	931	100,070	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	850	1,147	123,233	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	1,036	111,313	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,050	1,197	128,699	2025/ 9/30
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	300	406	43,670	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	610	835	89,728	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	840	1,154	124,032	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	630	870	93,478	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,298	139,460	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	1,256	135,036	2047/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,860	2,607	280,091	2048/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,300	1,837	197,388	2049/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	220	226	24,338	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	371	39,921	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	510	54,835	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	550	759	81,585	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	910	1,267	136,216	2044/ 8/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,620	2,324	249,701	2048/ 5/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	840	1,213	130,377	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	330	35,542	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	997	107,134	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	1,284	138,036	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	340	508	54,652	2041/ 8/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	270	408	43,871	2040/ 8/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	240	376	40,477	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	220	348	37,488	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	290	463	49,774	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	516	55,517	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	300	464	49,944	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	47	5,153	2038/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	372	39,970	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	370	609	65,440	2040/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	40	66	7,136	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	1,260	1,755	188,586	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	168	18,089	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	344	37,013	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	168	18,083	2028/ 8/15
6.000% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	540	713	76,653	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	370	524	56,375	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	239	25,711	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	180	279	30,016	2030/ 5/15
8.000% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	1,010	1,129	121,295	2021/11/15
小計	—	—	—	—	18,560,901	—

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)						
		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.50% CANADA GOV'T	国債証券	0.5	150	150	11,525	2022/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	760	764	58,516	2021/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	710	722	55,235	2022/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	290	301	23,054	2027/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	550	570	43,663	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	500	524	40,126	2024/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	210	224	17,138	2026/ 6/ 1
1.750% CANADA GOV'T	国債証券	1.75	460	479	36,648	2023/ 3/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	180	189	14,534	2023/ 9/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	390	437	33,463	2028/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV'T	国債証券	2.25	340	372	28,492	2025/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV'T	国債証券	2.5	490	533	40,784	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	670	704	53,865	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	330	466	35,698	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	180	287	22,016	2064/12/ 1
3.250% CANADA GOV'T	国債証券	3.25	490	505	38,652	2021/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV'T	国債証券	3.5	370	571	43,723	2045/12/ 1
4.000% CANADA GOV'T	国債証券	4.0	300	470	36,000	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV'T	国債証券	5.0	310	511	39,127	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	320	468	35,828	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	370	603	46,183	2033/ 6/ 1
8.000% CANADA GOV'T	国債証券	8.0	100	152	11,646	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	765,926	—
(メキシコ)						
		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	5,680	6,792	30,497	2024/12/ 5
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	840	1,108	4,978	2036/11/20
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	3,195	14,349	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	7,410	7,523	33,779	2021/ 6/10
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	8,200	8,445	37,918	2022/ 6/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	6,880	7,598	34,119	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,600	11,674	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	3,155	14,170	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	3,680	3,951	17,740	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,534	20,358	2023/12/ 7
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,550	5,044	22,650	2024/ 9/ 5
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	2,800	3,089	13,872	2047/11/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,880	4,539	20,384	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	4,154	18,654	2038/11/18
小計	—	—	—	—	295,149	—
(ユーロ…ドイツ)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	504	58,585	2021/10/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	600	608	70,616	2022/ 4/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	410	417	48,454	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	300	306	35,611	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	513	59,589	2023/10/13
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	360	372	43,201	2024/10/18
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	610	637	74,016	2026/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	200	210	24,458	2029/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	130	133	15,546	2050/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	800	842	97,804	2030/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	580	617	71,716	2027/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	650	699	81,208	2029/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	570	604	70,188	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	460	493	57,252	2026/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	610	662	76,947	2027/ 8/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	430	469	54,456	2028/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	340	365	42,478	2024/ 8/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	670	732	85,037	2025/ 8/15
1.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	360	501	58,266	2048/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	463	53,761	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	450	478	55,542	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	780	833	96,780	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	910	993	115,372	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	390	410	47,697	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	470	515	59,800	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	520	543	63,083	2022/ 1/ 4
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	410	447	51,938	2023/ 8/15
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	470	487	56,619	2021/ 9/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	790	1,315	152,713	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	550	941	109,294	2046/ 8/15
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	540	563	65,441	2021/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	300	536	62,265	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	820	1,428	165,832	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	290	548	63,636	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	400	578	67,108	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	370	648	75,230	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	440	897	104,147	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	340	563	65,393	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	480	714	82,942	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	180	226	26,276	2024/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	220	367	42,716	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	230	350	40,648	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.35	400	399	46,334	2021/11/ 1
0.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.45	420	420	48,816	2021/ 6/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	420	416	48,300	2023/10/15
0.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.85	420	401	46,637	2027/ 1/15
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	560	562	65,258	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	510	511	59,342	2023/ 3/15
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	640	630	73,147	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	750	759	88,130	2022/ 4/15
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	600	575	66,771	2030/ 4/ 1
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	460	467	54,240	2022/ 9/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	310	313	36,362	2024/11/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	670	675	78,426	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	380	383	44,467	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	358	41,583	2032/ 3/ 1
1.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.75	370	378	43,941	2024/ 7/ 1
1.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.85	400	411	47,732	2024/ 5/15
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	520	536	62,317	2025/12/ 1
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	490	504	58,562	2027/ 8/ 1
2.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.1	330	341	39,670	2026/ 7/15
2.150% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	400	409	47,583	2021/12/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	280	291	33,795	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	310	310	36,078	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	320	332	38,623	2033/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	443	51,449	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	330	336	39,007	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	590	640	74,308	2028/12/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	370	370	43,014	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	490	529	61,486	2038/ 9/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	330	368	42,726	2046/ 9/ 1
3.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.35	250	285	33,169	2035/ 3/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	400	461	53,540	2048/ 3/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	570	652	75,786	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	655	76,048	2021/ 8/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	380	420	48,777	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	630	772	89,650	2037/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	400	441	51,298	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	660	742	86,243	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	560	654	76,010	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	660	696	80,849	2021/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	570	638	74,131	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	600	739	85,862	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	370	508	59,029	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	530	571	66,296	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	1,120	1,312	152,384	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	570	764	88,701	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	550	763	88,679	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	650	904	105,014	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	610	790	91,789	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	530	586	68,092	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	440	489	56,872	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	440	618	71,750	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	600	837	97,172	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	660	881	102,339	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	130	175	20,384	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	127	14,763	2023/11/ 1
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	470	472	54,819	2021/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	570	576	66,900	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	990	1,005	116,688	2023/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	850	867	100,661	2025/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	710	712	82,721	2029/11/25
0.250% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	900	930	108,034	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	820	858	99,602	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	787	91,404	2026/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	789	91,682	2029/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	700	751	87,203	2028/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	710	763	88,598	2028/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	950	1,022	118,668	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	660	717	83,239	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	720	822	95,520	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	940	1,090	126,573	2031/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	200	244	28,349	2050/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	850	909	105,604	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	880	968	112,436	2024/11/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	470	584	67,804	2039/ 6/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	340	468	54,362	2066/ 5/25
2.000% FRANCE GOV' T	国債証券	2.0	630	845	98,199	2048/ 5/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	800	855	99,271	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV' T	国債証券	2.25	890	989	114,830	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV' T	国債証券	2.5	1,100	1,377	159,954	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV' T	国債証券	2.75	730	892	103,635	2027/10/25
3.000% FRANCE GOV' T	国債証券	3.0	1,040	1,111	129,065	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	1,070	1,127	130,937	2021/10/25
3.250% FRANCE GOV' T	国債証券	3.25	520	841	97,719	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV' T	国債証券	3.5	800	983	114,176	2026/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	630	1,035	120,182	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	410	824	95,713	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV' T	国債証券	4.0	310	655	76,140	2060/ 4/25

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	1,040	1,213	140,847	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV'T	国債証券	4.5	740	1,333	154,747	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV'T	国債証券	4.75	640	1,062	123,330	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV'T	国債証券	5.5	810	1,218	141,394	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV'T	国債証券	5.75	740	1,255	145,693	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV'T	国債証券	6.0	220	297	34,485	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	170	215	24,984	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	340	343	39,881	2022/ 1/15
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	190	194	22,569	2024/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	320	333	38,761	2025/ 7/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	160	168	19,583	2029/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.5	290	308	35,814	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	440	478	55,585	2027/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	150	164	19,069	2028/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	1.75	340	366	42,502	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.0	360	399	46,423	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.25	310	329	38,277	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.5	400	538	62,529	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.75	340	582	67,670	2047/ 1/15
3.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.25	150	156	18,179	2021/ 7/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	310	346	40,263	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	290	530	61,529	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	4.0	410	693	80,507	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	5.5	320	467	54,254	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	7.5	80	97	11,330	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.350% SPANISH GOV'T	国債証券	0.35	450	455	52,920	2023/ 7/30
0.400% SPANISH GOV'T	国債証券	0.4	720	729	84,630	2022/ 4/30
0.450% SPANISH GOV'T	国債証券	0.45	370	375	43,641	2022/10/31
0.600% SPANISH GOV'T	国債証券	0.6	410	406	47,131	2029/10/31
0.750% SPANISH GOV'T	国債証券	0.75	450	455	52,915	2021/ 7/30
1.300% SPANISH GOV'T	国債証券	1.3	460	487	56,573	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	430	457	53,123	2028/ 4/30
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	380	404	46,968	2028/ 7/30
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	450	480	55,777	2027/10/31
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	600	640	74,342	2029/ 4/30
1.500% SPANISH GOV'T	国債証券	1.5	370	396	46,080	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV'T	国債証券	1.6	420	449	52,185	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	480	526	61,078	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	650	723	84,038	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV'T	国債証券	2.15	440	485	56,330	2025/10/31
2.350% SPANISH GOV'T	国債証券	2.35	480	560	65,023	2033/ 7/30
2.700% SPANISH GOV'T	国債証券	2.7	370	469	54,554	2048/10/31
2.750% SPANISH GOV'T	国債証券	2.75	620	692	80,440	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV'T	国債証券	2.9	370	482	56,044	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV'T	国債証券	3.45	260	400	46,535	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV'T	国債証券	3.8	740	849	98,655	2024/ 4/30
4.200% SPANISH GOV'T	国債証券	4.2	490	715	83,094	2037/ 1/31
4.400% SPANISH GOV'T	国債証券	4.4	470	542	62,948	2023/10/31
4.650% SPANISH GOV'T	国債証券	4.65	400	491	57,092	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV'T	国債証券	4.7	370	596	69,294	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV'T	国債証券	4.8	420	494	57,412	2024/ 1/31
4.900% SPANISH GOV'T	国債証券	4.9	370	604	70,188	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV'T	国債証券	5.15	780	1,070	124,206	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV'T	国債証券	5.15	280	491	57,109	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV'T	国債証券	5.4	570	655	76,130	2023/ 1/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
5.500% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	360	379	44,099	2021/ 4/30
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	780	1,217	141,300	2032/ 7/30
5.850% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	460	508	58,971	2022/ 1/31
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	500	669	77,703	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	188	21,900	2029/ 1/31
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.200% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.2	220	225	26,127	2023/10/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	290	306	35,605	2025/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	250	267	31,004	2027/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	461	53,563	2028/ 6/22
0.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9	300	325	37,745	2029/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	290	311	36,214	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	380	416	48,389	2031/ 6/22
1.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	130	147	17,079	2033/ 4/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	90	104	12,134	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	320	391	45,432	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	190	235	27,390	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	120	179	20,859	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	340	369	42,865	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	120	175	20,377	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	420	472	54,823	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	180	247	28,706	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	200	343	39,885	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	300	325	37,794	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	150	217	25,247	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	180	191	22,250	2021/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	420	468	54,340	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	440	754	87,619	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	256	29,751	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	380	636	73,867	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	390	563	65,425	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.5	270	285	33,197	2029/ 2/20
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	490	525	60,957	2026/10/20
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	210	228	26,546	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	140	183	21,352	2047/ 2/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	60	89	10,387	2086/11/ 2
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	230	252	29,274	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	390	421	48,901	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	130	253	29,421	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	170	225	26,172	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	180	304	35,357	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	400	440	51,154	2022/11/22
3.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	160	168	19,586	2021/ 9/15
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	270	292	33,942	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	114	13,343	2062/ 1/26
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	250	418	48,596	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	235	27,354	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	450	661	76,760	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.125% FINNISH GOV' T	国債証券	0.125	80	80	9,318	2036/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	200	210	24,467	2026/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	80	84	9,825	2027/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	130	137	16,007	2029/ 9/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	180	196	22,841	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	96	11,183	2025/ 9/15
1.375% FINNISH GOV' T	国債証券	1.375	60	78	9,061	2047/ 4/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	100	106	12,323	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	240	252	29,330	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	220	242	28,106	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	120	184	21,388	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	161	18,789	2028/ 7/ 4
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	110	135	15,742	2025/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.800% IRISH GOV' T	国債証券	0.8	140	143	16,616	2022/ 3/15
0.900% IRISH GOV' T	国債証券	0.9	350	374	43,463	2028/ 5/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	230	245	28,489	2026/ 5/15
1.300% IRISH GOV' T	国債証券	1.3	150	168	19,522	2033/ 5/15
1.500% IRISH GOV' T	国債証券	1.5	80	94	10,946	2050/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	220	261	30,346	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	170	221	25,681	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	250	305	35,459	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	150	171	19,893	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	230	257	29,939	2023/ 3/20
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	230	292	33,979	2025/ 3/13
小計	—	—	—	—	15,283,344	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
0.125% UK TREASURY	国債証券	0.125	380	380	49,990	2023/ 1/31
0.625% UK TREASURY	国債証券	0.625	240	246	32,430	2025/ 6/ 7
0.750% UK TREASURY	国債証券	0.75	440	450	59,154	2023/ 7/22
0.875% UK TREASURY	国債証券	0.875	140	149	19,592	2029/10/22
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	340	368	48,411	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	468	61,588	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	460	564	74,161	2047/ 7/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	740	834	109,546	2028/10/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	250	393	51,740	2071/10/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	700	728	95,672	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	430	516	67,794	2037/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	310	440	57,880	2057/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	210	232	30,522	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	740	795	104,443	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	370	677	88,962	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	280	313	41,107	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	480	759	99,688	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	470	780	102,550	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	350	809	106,299	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	200	209	27,537	2021/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	350	680	89,393	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	570	611	80,315	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	310	703	92,359	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	380	49,926	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	511	67,219	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	460	724	95,100	2036/ 3/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	503	66,103	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	509	66,970	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	719	94,460	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	577	75,843	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	450	993	130,424	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	270	422	55,507	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	420	767	100,736	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	300	442	58,058	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	330	577	75,856	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	370	457	60,132	2025/ 3/ 7

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス) 6.000% UK TREASURY	国債証券	% 6.0	千英ポンド 230	千英ポンド 344	千円 45,287	2028/12/ 7
小計	—	—	—	—	2,632,773	—
(スウェーデン) 0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	% 0.75	千スウェーデンクローナ 470	千スウェーデンクローナ 505	千円 5,540	2028/ 5/12
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	300	323	3,552	2029/11/12
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	1,180	1,276	14,006	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,830	1,948	21,373	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	1,030	1,175	12,895	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	2,160	2,330	25,564	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	2,169	23,800	2039/ 3/30
小計	—	—	—	—	106,733	—
(ノルウェー) 1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	% 1.5	千ノルウェークローネ 880	千ノルウェークローネ 952	千円 10,085	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	909	9,636	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	960	1,063	11,259	2027/ 2/17
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	1,150	1,303	13,799	2029/ 9/ 6
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	2,360	2,503	26,511	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	830	926	9,807	2024/ 3/14
3.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,590	1,649	17,464	2021/ 5/25
小計	—	—	—	—	98,564	—
(デンマーク) 0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	% 0.5	千デンマーククローネ 1,740	千デンマーククローネ 1,861	千円 28,982	2027/11/15
0.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,710	1,844	28,712	2029/11/15
1.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,140	1,220	18,999	2023/11/15
1.750% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,250	1,406	21,897	2025/11/15
3.000% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,460	1,536	23,930	2021/11/15
4.500% KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,560	4,809	74,883	2039/11/15
小計	—	—	—	—	197,405	—
(ポーランド) 1.750% POLAND GOV' T	国債証券	% 1.75	千ポーランドズロチ 640	千ポーランドズロチ 649	千円 16,535	2021/ 7/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	830	857	21,839	2022/ 4/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	600	639	16,281	2024/10/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	780	820	20,897	2023/ 1/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	751	19,136	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	760	830	21,147	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	890	991	25,251	2028/ 4/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	300	339	8,637	2029/10/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	1,030	1,153	29,362	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	960	1,069	27,237	2023/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	280	301	7,666	2021/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	740	18,843	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	232,837	—
(オーストラリア) 2.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	% 2.0	千オーストラリアドル 90	千オーストラリアドル 92	千円 6,421	2021/12/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	590	657	45,658	2028/ 5/21
2.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.5	740	853	59,261	2030/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	460	504	35,007	2024/ 4/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	570	656	45,583	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	520	603	41,934	2028/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	200	234	16,254	2029/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	240	288	20,048	2035/ 6/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	80	94	6,561	2041/ 5/21
3.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.0	290	364	25,320	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	210	269	18,726	2039/ 6/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	900	1,025	71,249	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	710	857	59,585	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	320	430	29,900	2037/ 4/21

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)						
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
4.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	670	818	56,817	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	490	695	48,298	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	630	807	56,052	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	490	565	39,257	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	750	790	54,921	2021/ 5/15
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	780	872	60,563	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	797,424	—
(シンガポール)						
		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
1.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	1.75	160	164	12,415	2022/ 4/ 1
2.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.125	80	87	6,610	2026/ 6/ 1
2.250% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	240	245	18,502	2021/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	120	128	9,733	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	140	183	13,885	2042/ 4/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	148	11,211	2046/ 3/ 1
2.875% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.875	300	356	26,892	2029/ 7/ 1
3.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	200	222	16,755	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	110	117	8,839	2022/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	300	389	29,431	2033/ 9/ 1
3.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	310	369	27,864	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	182,143	—
(マレーシア)						
		%	千マレーシアリングギット	千マレーシアリングギット	千円	
3.480% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	309	7,645	2023/ 3/15
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	449	11,118	2027/ 5/31
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	360	372	9,210	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	940	999	24,712	2033/ 4/15
3.885% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.885	500	540	13,348	2029/ 8/15
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	300	321	7,942	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	250	265	6,574	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	641	15,852	2025/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	310	317	7,859	2021/ 9/30
4.160% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	760	777	19,213	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	990	1,055	26,087	2024/ 7/15
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	440	493	12,210	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	530	606	14,993	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	320	374	9,251	2037/ 4/ 7
4.893% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.893	180	214	5,295	2038/ 6/ 8
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	213	5,275	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	196,593	—
(イスラエル)						
		%	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル	千円	
0.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	0.75	650	662	20,078	2022/ 7/31
1.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	1.25	700	722	21,918	2022/11/30
2.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	2.25	700	800	24,282	2028/ 9/28
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	600	682	20,693	2024/ 3/31
3.750% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	3.75	650	941	28,535	2047/ 3/31
6.250% ISRAEL FIXED BOND	国債証券	6.25	700	978	29,681	2026/10/30
小計	—	—	—	—	145,189	—
合計	—	—	—	—	39,494,985	—

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

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

日立国内株式TOPIXインデックスマザーファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円	%	%	%	百万円
16期(2016年3月31日)	13,277	△10.9	98.4	1.6	39,779
17期(2017年3月31日)	15,232	14.7	97.8	2.3	42,177
18期(2018年4月2日)	17,569	15.3	98.3	1.9	46,669
19期(2019年4月1日)	17,009	△3.2	98.3	2.0	49,169
20期(2020年3月31日)	15,166	△10.8	97.2	2.8	44,832

(注) 株式先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		TOPIX(配当込み)		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首) 2019年 4月 1日	円 17,009	% —	2,431.59	% —	% 98.3	% 2.0
4月末	17,034	0.1	2,434.82	0.1	98.1	1.9
5月末	15,927	△6.4	2,275.96	△6.4	98.1	1.9
6月末	16,362	△3.8	2,338.89	△3.8	97.9	2.0
7月末	16,511	△2.9	2,360.18	△2.9	97.9	2.1
8月末	15,953	△6.2	2,280.58	△6.2	97.9	2.1
9月末	16,916	△0.5	2,418.29	△0.5	98.0	2.0
10月末	17,761	4.4	2,539.02	4.4	97.9	2.0
11月末	18,106	6.4	2,588.40	6.4	98.4	1.6
12月末	18,368	8.0	2,625.91	8.0	98.3	1.7
2020年 1月末	17,975	5.7	2,569.77	5.7	98.4	1.7
2月末	16,128	△5.2	2,305.76	△5.2	98.4	1.7
(期末) 2020年 3月31日	15,166	△10.8	2,167.60	△10.9	97.2	2.8

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項目	当期
	(2019.4.2～2020.3.31)
	金額
(a)売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (先物・オプション)	0円 (0) (0) (0)
(b)その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

(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。

(a)売買委託手数料、(b)その他費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上 場	千株 4,400 (435)	千円 7,776,661 (-)	千株 3,178	千円 6,195,821

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()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。

(2) 新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国 内	—	証 券 — (39,100)	千円 — (-)	証 券 — (33,100)	千円 — (132)

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

(3) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株 式 先 物 取 引	百万円 4,247	百万円 3,875	百万円 —	百万円 —

(注) 単位未満は切り捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

項 目	当 期
(a)期 中 の 株 式 売 買 金 額	13,972,482千円
(b)期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	49,339,416千円
(c)売 買 高 比 率(a)/(b)	0.28

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■主要な売買銘柄(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

株式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
トヨタ自動車	35.9	247,935	6,906	トヨタ自動車	22.41	162,454	7,249
N T T ドコモ	44.8	126,971	2,834	ソニー	20	129,513	6,475
ソフトバンクグループ	22	126,548	5,752	ソフトバンクグループ	25	125,662	5,026
ソニー	19.7	117,461	5,962	K D D I	42.6	125,430	2,944
ソフトバンク	83.5	114,009	1,365	キーエンス	2	110,668	55,334
三菱UFJフィナンシャル・グループ	217.4	112,011	515	武田薬品工業	23.6	91,563	3,879
任天堂	2.9	110,973	38,266	任天堂	2.2	87,076	39,580
日本電信電話	26.4	96,534	3,656	日本電信電話	20.3	78,306	3,857
武田薬品工業	25	95,330	3,813	本田技研工業	26.9	78,067	2,902
キーエンス	1.8	92,939	51,633	三菱UFJフィナンシャル・グループ	145	76,759	529

(注) 金額は受け渡し代金。

■利害関係人との取引状況等(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

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	期末保有額
株 式	千円 112,443	千円 53,678	千円 504,566

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立化成、日立金属、日立建機、日立製作所、日立ハイテク、日立キャピタル、日立物流です。

■組入資産の明細(2020年3月31日現在)

(1) 国内株式
上場株式

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業(0.1%)			
極洋	0.9	1	2,545
日本水産	28.3	30	14,340
マルハニチロ	4.1	4.3	9,709
カネコ種苗	0.9	0.9	1,201
サカタのタネ	3.5	3.6	11,808
ホクト	2.4	2.3	4,335
ホクリヨウ	0.4	0.5	305
鉱業(0.2%)			
住石ホールディングス	6.1	6.1	707
日鉄鉱業	0.6	0.7	2,964
三井松島ホールディングス	1.2	1.2	1,054
国際石油開発帝石	113.7	120.2	73,177
石油資源開発	4.1	3.9	6,930
K&Oエナジーグループ	1.4	1.5	2,244
建設業(2.7%)			
ヒノキヤグループ	0.6	0.7	1,026
ショーボンドホールディングス	2	4.7	20,304
ミライト・ホールディングス	8	8.9	11,988
タマホーム	1.4	1.6	1,953
サンヨーホームズ	0.4	0.3	182
日本アクア	0.7	1.2	764
ファーストコーポレーション	0.9	0.9	404
ベステラ	0.5	0.5	455
TATERU	3.5	6.2	675
キャンディル	—	0.3	125
スペースバリューホールディングス	3.5	3.7	1,380
ダイセキ環境ソリューション	0.5	0.6	488
第一カッター興業	0.3	0.4	646
明豊ファシリティワークス	—	0.7	328
安藤・間	18.1	17.8	12,264
東急建設	8.3	8.8	5,007
コムシスホールディングス	10	10.6	29,499
ミサワホーム	2.2	—	—
ビーアールホールディングス	2.3	3.3	1,666
高松コンストラクショングループ	1.8	1.9	4,409
東建コーポレーション	0.9	0.9	7,191
ソネック	0.3	0.3	210
ヤマウラ	1.1	1.3	1,054
大成建設	23.3	23.1	76,345
大林組	70.1	69.2	64,079
清水建設	71.5	70.2	59,319
飛島建設	2	2	2,006
長谷工コーポレーション	29.2	26.8	31,007
松井建設	2.6	2.7	1,795
銭高組	0.3	0.3	981
鹿島建設	54.8	54.3	60,218
不動テトラ	1.6	1.8	2,309
大末建設	0.8	0.8	611
鉄建建設	1.4	1.5	3,522
西松建設	5	5.3	10,976
三井住友建設	16.9	16.7	7,965
大豊建設	1.6	1.6	3,622
前田建設工業	16.7	17.3	13,788

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
佐田建設	1.5	1.5	489
ナカノフドー建設	1.8	1.9	689
奥村組	3.8	3.8	8,542
東鉄工業	2.8	3	8,751
イチケン	0.4	0.5	601
富士ピー・エス	0.7	1	530
浅沼組	0.8	0.8	3,020
戸田建設	27.2	28.7	18,052
熊谷組	3.3	3.2	8,003
青木あすなろ建設	1.1	—	—
北野建設	0.5	0.4	1,014
植木組	0.3	0.3	765
矢作建設工業	3.2	3.1	2,427
ピーエス三菱	2.5	2.3	1,179
日本ハウスホールディングス	4.5	4.7	1,377
大東建託	8.3	8.3	83,539
新日本建設	2.8	2.9	2,392
NIPPO	6.2	5.7	13,566
東亜道路工業	0.4	0.4	1,200
前田道路	7.3	6.1	12,328
日本道路	0.6	0.7	4,809
東亜建設工業	2	2.2	3,176
日本国土開発	—	5	2,655
若築建設	1.2	1.2	1,452
東洋建設	8.6	7.8	3,416
五洋建設	27.8	27.4	15,590
世紀東急工業	3.4	3.3	2,692
福田組	0.8	0.8	3,384
住友林業	16.6	17.5	24,237
日本基礎技術	2.4	2.3	846
巴コーポレーション	2.9	3.1	1,029
大和ハウス工業	64.7	68.5	183,408
ライト工業	4.5	4	4,908
積水ハウス	71.6	75.7	135,086
日特建設	2	1.8	1,328
北陸電気工事	1.1	1.2	1,092
ユアテック	3.7	4	2,460
四電工	0.4	0.4	991
中電工	3	2.8	6,162
関電工	10.6	9.8	8,437
きんでん	15.5	16.4	26,158
東京エネシス	2.4	2.3	1,890
トーエネック	0.7	0.7	2,226
住友電設	1.6	2	4,446
日本電設工業	4	3.8	8,006
協和エクシオ	9.2	10.5	25,263
新日本空調	2	1.8	3,893
九電工	4.6	4.9	14,322
三機工業	5.3	5	6,055
日揮ホールディングス	20.1	21.3	18,488
中外炉工業	0.7	0.7	1,027
ヤマト	2.1	2.2	1,399
太平電業	1.6	1.7	3,942
高砂熱学工業	5.7	6	9,966

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三晃金属工業	0.3	0.3	606
朝日工業社	0.5	0.5	1,597
明星工業	4.2	4.5	3,303
大気社	3.2	3.4	10,642
ダイダン	1.6	1.7	4,940
日比谷総合設備	2.1	2.2	4,263
東芝プラントシステム	5.1	—	—
フィル・カンパニー	—	0.3	811
OSJBホールディングス	10.3	10.9	2,605
千代田化工建設	16.9	—	—
レイズネクスト	4.2	3.7	4,532
食料品 (4.2%)			
日本製粉	6.6	6.5	10,965
日清製粉グループ本社	23.7	25	45,050
日東富士製粉	0.2	0.2	1,156
昭和産業	1.9	2	6,420
鳥越製粉	1.9	2	1,738
中部飼料	2.6	2.7	3,901
フィード・ワン	14.1	14.9	2,249
東洋精糖	0.3	0.4	469
日本甜菜製糖	1.2	1.2	2,062
三井製糖	1.7	1.9	3,946
塩水港精糖	2.3	2.4	468
日新製糖	1	1	1,998
森永製菓	5.3	5.2	22,984
中村屋	0.5	0.6	2,346
江崎グリコ	6.3	6.6	29,964
名糖産業	1	1.1	1,472
井村屋グループ	0.9	0.9	1,624
不二家	1.2	1.2	2,474
山崎製パン	17.1	16.6	37,466
第一屋製パン	0.4	0.4	368
モロゾフ	0.4	0.4	2,076
亀田製菓	1.3	1.3	6,428
寿スピリッツ	2.2	2.1	10,216
カルビー	9.5	10.1	29,502
森永乳業	4.2	4.1	17,138
六甲バター	1.5	1.5	2,053
ヤクルト本社	15.5	15.2	97,128
明治ホールディングス	14.8	14.6	112,128
雪印メグミルク	5	5.3	13,016
ブリマハム	2.9	3.5	8,585
日本ハム	9.1	8.5	32,002
林兼産業	0.7	0.7	391
丸大食品	2.2	2.4	4,692
S Foods	1.9	1.8	4,024
柿安本店	—	0.8	1,834
伊藤ハム米久ホールディングス	13.5	14.3	9,109
サッポロホールディングス	7.7	7.6	15,146
アサヒグループホールディングス	43.9	46.4	162,864
キリンホールディングス	94.7	93.9	200,711
宝ホールディングス	15.7	16.4	13,284
オエノンホールディングス	5.9	5.8	2,279
養命酒製造	0.6	0.7	1,372
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	16	15.5	34,394
サントリー食品インターナショナル	14	14.8	60,458
ダイドーグループホールディングス	1.2	1.1	4,020
伊藤園	6.4	6.7	38,324

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キーコーヒー	2.1	2.2	5,055
ユニカフェ	0.6	0.6	508
ジャパンフーズ	0.3	0.3	339
日清オイリオグループ	2.7	2.9	10,585
不二製油グループ本社	5.1	5.4	14,083
かどや製油	0.2	0.2	733
J-オイルミルズ	1.1	1.1	5,027
キッコーマン	13.8	15.9	73,219
味の素	46.3	48.9	98,313
キュービー	11.7	12.3	26,580
ハウス食品グループ本社	8	8.3	29,257
カゴメ	8.4	8.4	23,562
焼津水産化学工業	1	1.1	1,052
アリアケジャパン	1.9	2	13,640
ピエトロ	0.3	0.3	465
エバラ食品工業	0.5	0.5	1,080
やまみ	—	0.1	171
ニチレイ	10.9	10.6	32,383
東洋水産	10.8	11.4	59,508
イートランド	0.7	0.8	1,384
大冷	0.2	0.3	531
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.6	1.2	1,099
日清食品ホールディングス	8.9	9.4	84,600
永谷園ホールディングス	1.1	1.1	2,431
一正蒲鉾	0.8	0.9	864
フジッコ	2.3	2.4	4,672
ロック・フィールド	2.3	2.4	3,520
日本たばこ産業	120.9	127.9	255,288
ケンコーマヨネーズ	1.2	1.2	2,444
わらべや日洋ホールディングス	1.4	1.4	2,454
なとり	1.2	1.2	2,056
イフジ産業	0.4	0.4	315
ピックスコーポレーション	0.5	0.5	1,079
北の達人コーポレーション	8.2	7.7	4,096
ユーグレナ	8.9	9.4	6,514
ミヨシ油脂	0.8	0.8	882
理研ビタミン	1	2.1	4,601
繊維製品 (0.5%)			
片倉工業	2.5	3.1	3,292
グンゼ	1.4	1.6	5,808
東洋紡	8.7	8.5	9,715
ユニチカ	6	6.3	1,701
富士紡ホールディングス	1.1	1	2,884
倉敷紡績	2	2.1	5,436
シキボウ	1.1	1.1	1,076
日本毛織	6.7	7.1	6,659
ダイトウボウ	3.3	3.5	560
トーア紡コーポレーション	0.9	0.9	416
ダイドーリミテッド	2.4	2.8	565
帝国繊維	2.3	2.4	5,040
帝人	16.7	17.6	32,208
東レ	158.6	156.5	73,398
サカイオーベックス	0.5	0.6	1,140
住江織物	0.6	0.5	850
日本フェルト	1.2	1.2	524
イチカワ	0.3	0.3	413
日東製網	0.2	0.2	300
アツギ	1.7	1.8	1,126

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダイニック	0.8	0.8	615
セーレン	5	5.3	6,890
ソトー	0.8	0.9	854
東海染工	0.3	0.3	345
小松マテーレ	3.4	3.5	2,572
ワコールホールディングス	6	5.6	13,143
ホギメディカル	2.5	2.5	8,412
レナウン	5.9	5.6	408
クラウドシアホールディングス	0.5	0.5	210
T S Iホールディングス	7.5	7.2	2,851
マツオカコーポレーション	0.6	0.6	1,009
ワールド	2	3.1	4,671
三陽商会	1.2	1.1	1,483
ナイガイ	0.7	0.8	341
オンワードホールディングス	12.3	13	6,175
ルックホールディングス	0.7	0.7	532
ゴールドウイン	1.9	3.9	23,478
デサント	5	4.2	5,334
キング	1.1	1	538
ヤマトインターナショナル	1.3	1.3	364
パルプ・紙(0.3%)			
特種東海製紙	1.3	1.4	5,985
王子ホールディングス	92	90.4	52,341
日本製紙	9.8	9.6	14,774
三菱製紙	3.3	2.5	882
北越コーポレーション	13.6	14.3	5,777
中越パルプ工業	0.9	0.9	1,243
巴川製紙所	0.7	0.6	456
大王製紙	10	9.5	13,803
阿波製紙	0.5	0.6	263
レンゴー	21.1	20.4	17,176
トーモク	1.3	1.3	1,983
ザ・バック	1.5	1.6	5,792
化学(7.6%)			
クラレ	34.5	34	37,128
旭化成	145.4	143.3	109,595
共和レザー	1.3	1.2	860
昭和電工	13.6	15.4	34,449
住友化学	160.9	158.8	50,974
住友精化	1	1	2,658
日産化学	12.5	12	47,280
ラサ工業	0.7	0.8	1,068
クレハ	1.9	1.9	8,369
多木化学	0.6	0.6	2,256
テイカ	1.7	1.6	2,299
石原産業	3.9	3.9	2,152
片倉コープアグリ	0.6	0.6	663
日東エフシー	1.3	—	—
日本曹達	3.2	3.2	8,630
東ソー	31.6	33.4	41,082
トクヤマ	5.9	6.2	12,970
セントラル硝子	4.5	4.4	8,280
東亜合成	12.8	13.6	12,784
大阪ソーダ	2.2	2.2	5,662
関東電化工業	4.8	5.1	3,952
デンカ	8	7.9	17,988
信越化学工業	36	37.1	398,083
日本カーバイド工業	0.7	0.7	700

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
堺化学工業	1.4	1.4	2,515
第一稀元素化学工業	1.7	2.3	1,729
エア・ウォーター	16.7	20.1	29,868
大陽日酸	16.8	20.8	33,300
日本化学工業	0.7	0.7	1,554
東邦アセチレン	0.3	0.3	366
日本パーカライジング	11.2	10.9	12,208
高压ガス工業	3.2	3.4	2,454
チタン工業	0.3	0.3	486
四国化成工業	3.4	3.3	3,276
戸田工業	0.4	0.5	607
ステラ ケミファ	1.2	1.2	2,910
保土谷化学工業	0.7	0.8	2,464
日本触媒	3.4	3.4	16,830
大日精化学工業	1.7	1.9	4,482
カネカ	5.4	5.6	14,504
三菱瓦斯化学	21	20.1	23,637
三井化学	18.5	19.6	40,199
J S R	20.5	20.1	40,059
東京応化工業	3.5	3.7	15,336
大阪有機化学工業	1.9	2	3,004
三菱ケミカルホールディングス	136.6	144.5	92,884
KHネオケム	3.1	3.8	5,779
ダイセル	31.7	29.6	23,354
住友ベークライト	3.5	3.4	7,803
積水化学工業	44.7	46.5	66,634
日本ゼオン	18.4	19.5	15,873
アイカ工業	6.1	6.5	20,117
宇部興産	10.3	10.9	18,061
積水樹脂	3.4	3.9	7,761
タキロンシーアイ	4.4	4.7	2,815
旭有機材	1.4	1.2	1,674
日立化成	9.4	10	45,900
ニチバン	1.1	1.1	1,645
リケンテクノス	5.6	5.4	2,079
大倉工業	1	1	1,577
積水化成成品工業	3	2.9	1,624
群栄化学工業	0.5	0.5	1,224
タイガースポリマー	1.1	1.1	498
ミライアル	0.6	0.8	748
ダイキアクシス	0.7	0.8	592
ダイキョーニシカワ	4.3	4.6	2,272
竹本容器	0.7	0.8	503
森六ホールディングス	1.1	1.2	1,796
日本化薬	13	13.4	13,333
カーリットホールディングス	2.2	2.3	1,071
日本精化	1.6	1.7	2,541
扶桑化学工業	2.1	2.2	6,677
トリケミカル研究所	0.5	0.5	3,665
A D E K A	10.1	10	13,510
日油	7.9	8.1	27,783
新日本理化	3.7	3.6	558
ハリマ化成グループ	1.7	1.8	2,021
花王	50.7	52.8	466,224
第一工業製薬	0.8	0.8	3,000
石原ケミカル	0.5	0.6	1,157
日華化学	0.7	0.7	595
ニイタカ	0.3	0.3	901

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三洋化成工業	1.4	1.3	5,141
有機合成薬品工業	1.6	1.7	425
大日本塗料	2.3	2.4	1,908
日本ペイントホールディングス	16.9	17.8	100,748
関西ペイント	23	24.3	50,009
神東塗料	1.6	1.7	246
中国塗料	6.7	6.2	5,449
日本特殊塗料	1.5	1.6	1,265
藤倉化成	2.8	2.9	1,415
太陽ホールディングス	1.7	1.6	6,512
D I C	9.2	9.1	21,776
サカタインクス	4.5	4.7	4,272
東洋インキSCホールディングス	4.3	4.6	9,407
T & K TOKA	1.6	1.7	1,207
富士フイルムホールディングス	43.3	42.3	230,069
資生堂	41.5	43.9	280,169
ライオン	29.1	28.7	66,383
高砂香料工業	1.4	1.4	2,823
マンダム	4.7	5	10,355
ミルボン	2.6	3	16,350
ファンケル	9.3	8.9	21,600
コーセー	3.5	4.2	55,986
コタ	1.1	1.32	1,627
シーボン	0.2	0.3	610
ポーラ・オルビスホールディングス	8.9	9.4	18,753
ノエビアホールディングス	1.3	2.1	11,592
アジュバンコスメジャパン	0.5	0.5	462
エステー	1.5	1.4	2,241
アグロ カネショウ	0.8	0.7	1,064
コニシ	3.7	3.6	5,155
長谷川香料	2.5	2.9	5,907
星光PMC	1.4	1.3	825
小林製薬	5.8	6.2	62,000
荒川化学工業	1.9	2	2,406
メック	1.4	1.5	2,254
日本高純度化学	0.6	0.6	1,435
タカラバイオ	5.5	5.8	12,939
J C U	2.7	2.7	6,083
新田ゼラチン	1.3	1.4	827
O A T アグリオ	0.3	0.4	385
デクセリアルズ	5.4	5.7	3,978
アース製薬	1.6	1.7	9,741
北興化学工業	2.1	2.3	1,285
大成ラミック	0.7	0.7	1,765
クミアイ化学工業	8.6	9.1	7,616
日本農薬	5	3.9	1,630
アキレス	1.5	1.5	2,629
有沢製作所	3.3	3.5	2,807
日東電工	15.8	15.2	73,340
レック	2.2	2.4	2,604
三光合成	1.8	2.5	650
きもと	3.5	3.8	505
藤森工業	1.9	2	5,850
前澤化成工業	1.4	1.4	1,394
未来工業	1.1	1.2	2,400
ウェーブロックホールディングス	0.4	0.8	404
J S P	1.2	1.3	1,817

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エフピコ	1.7	2.4	17,208
天馬	1.4	1.5	2,418
信越ポリマー	3.7	4	3,376
東リ	5.2	5.5	1,430
ニフコ	8.4	8.1	15,714
バルカー	1.7	1.8	3,150
ユニ・チャーム	44.2	42.5	172,167
ショーエイコーポレーション	0.2	0.2	135
医薬品 (6.6%)			
協和キリン	24.5	22.2	53,768
武田薬品工業	182.2	183.6	607,348
アステラス製薬	192.4	191.4	319,829
大日本住友製薬	15.5	16.4	23,009
塩野義製薬	26.7	28.2	149,939
田辺三菱製薬	21.8	—	—
わかもと製薬	2.5	2.6	598
あすか製薬	2.6	2.5	2,745
日本新薬	5.5	5.8	49,184
ビオフェルミン製薬	0.4	0.4	943
中外製薬	21.8	23	287,500
科研製薬	3.8	3.8	19,114
エーザイ	25	26.4	209,378
ロート製薬	10.7	11.3	33,448
小野薬品工業	49.3	50.7	126,040
久光製薬	6.2	5.8	29,232
持田製薬	3.2	3.1	12,927
参天製薬	39.6	41.1	76,363
扶桑薬品工業	0.7	0.8	1,674
日本ケミファ	0.3	0.3	742
ツムラ	6.5	6.8	18,713
日医工	5.4	6.3	8,990
キッセイ薬品工業	3.7	3.9	10,845
生化学工業	4	4.3	4,850
栄研化学	3.7	3.9	7,686
日水製薬	0.9	0.9	1,104
鳥居薬品	1.1	1.4	3,778
J C R ファーマ	1.5	1.6	15,072
東和薬品	3	2.8	6,347
富士製薬工業	1.4	1.5	1,819
沢井製薬	4.3	4.5	25,965
ゼリア新薬工業	4.1	4	8,352
第一三共	59.7	63.2	469,828
キョーリン製薬ホールディングス	4.6	4.9	10,770
大幸薬品	0.9	2.7	4,201
ダイト	1.2	1.3	3,835
大塚ホールディングス	39.8	42	177,702
大正製薬ホールディングス	4.7	4.7	31,208
ペプチドリーム	10.5	11.2	42,224
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	17.6	18.6	1,134
ニチレキ	2.7	2.6	3,380
ユシロ化学工業	1.1	1.2	1,417
ビーピー・カストロール	0.7	0.8	914
富士石油	5.1	5.9	1,115
M O R E S C O	0.8	0.8	684
出光興産	24.09	24.8	61,454
J X T G ホールディングス	351	332	122,906

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コスモエネルギーホールディングス	6	6.4	9,734
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	12.1	12.8	17,190
TOYO TIRE	10.7	12.7	15,748
ブリヂストン	64.1	63.6	211,342
住友ゴム工業	18.7	19.8	20,176
藤倉コンポジット	1.8	1.9	672
オカモト	1.5	1.3	5,044
フコク	0.9	1	618
ニッタ	2.4	2.5	5,287
住友理工	4	4.3	2,515
三ツ星ベルト	2.7	2.9	3,540
バンドー化学	4	3.9	2,453
ガラス・土石製品 (0.7%)			
日東紡績	3.1	3.3	15,757
AGC	20.6	21.8	57,966
日本板硝子	10	10.6	3,529
石塚硝子	0.3	0.4	792
日本山村硝子	0.9	0.9	766
日本電気硝子	9	8.9	12,887
オハラ	0.8	0.9	784
住友大阪セメント	4.2	4.2	13,608
太平洋セメント	13.2	13.9	25,715
日本ヒューム	2.1	2.2	1,372
日本コンクリート工業	4.5	4.8	1,286
三谷セキサン	1	1	4,585
アジアパイルホールディングス	3	3.1	1,246
東海カーボン	18.9	23.1	20,605
日本カーボン	1	1.1	3,536
東洋炭素	1.2	1.3	1,818
ノリタケカンパニーリミテド	1.3	1.2	4,128
TOTO	16.1	15.8	56,801
日本碍子	25.5	26.9	38,117
日本特殊陶業	17.6	17.2	26,178
ダントーホールディングス	1.7	1.6	113
MARUWA	0.7	0.8	5,272
品川リフラクトリーズ	0.5	0.6	1,329
黒崎播磨	0.4	0.4	1,634
ヨータイ	1.8	1.8	1,134
イソライト工業	1.1	1.1	488
東京窯業	2.7	2.8	789
ニッカトー	0.9	1	584
フジミインコーポレーテッド	1.9	2	5,376
クニミネ工業	0.7	0.9	822
エーアンドエーマテリアル	0.4	0.4	464
ニチアス	5.7	6	12,144
ニチハ	2.9	3.1	6,348
鉄鋼 (0.6%)			
日本製鉄	95.9	97.7	90,411
神戸製鋼所	37.8	39.9	13,326
中山製鋼所	2.9	3	1,206
合同製鉄	1	1.2	2,522
ジェイ エフ イー ホールディングス	55.7	58.9	41,406
東京製鉄	11.1	10.6	7,165
共英製鋼	2.3	2.5	3,117
大和工業	4.4	4.6	8,528
東京製鋼	0.8	0.9	1,062
大阪製鉄	1.4	1.2	1,384

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
淀川製鋼所	2.8	2.9	5,124
丸一鋼管	7.3	7.1	18,452
モリ工業	0.6	0.7	1,745
大同特殊鋼	3.4	3.6	12,528
日本高周波鋼業	0.8	0.8	296
日本冶金工業	17.1	1.8	3,029
山陽特殊製鋼	2.6	1.5	1,452
愛知製鋼	1.2	1.2	3,774
日立金属	22.2	23.5	26,766
日本金属	0.5	0.5	300
大平洋金属	1.4	1.5	2,355
新日本電工	12.4	14.1	2,115
栗本鐵工所	1	1.1	2,084
虹技	0.3	0.3	298
日本鑄鉄管	0.2	0.2	256
三菱製鋼	1.5	1.6	1,273
日亜鋼業	3	3.2	902
日本精線	0.3	0.4	1,184
エンビプロ・ホールディングス	0.6	0.9	490
シンニッタン	3.2	3.4	761
新家工業	0.5	0.5	527
非鉄金属 (0.6%)			
大紀アルミニウム工業所	3.4	3.6	2,080
日本軽金属ホールディングス	56.2	55.2	9,328
三井金属鉱業	5.6	5.9	10,661
東邦亜鉛	1.1	1.1	1,320
三菱マテリアル	13.6	14.4	31,896
住友金属鉱山	28.3	27.9	61,882
DOWAホールディングス	4.8	5.5	15,559
古河機械金属	3.4	3.9	4,134
大阪チタニウムテクノロジーズ	2.4	2.3	2,150
東邦チタニウム	3.7	3.9	2,523
UACJ	3.1	3.3	5,124
CKサンエツ	0.4	0.5	1,470
古河電気工業	6	6.8	13,362
住友電気工業	77.2	81.6	92,860
フジクラ	24.9	26.4	8,263
昭和電線ホールディングス	2.4	2.5	2,525
東京特殊電線	0.3	0.3	725
タツタ電線	4.1	4.3	1,978
カナレ電気	0.3	0.4	641
平河ヒューテック	0.9	0.8	705
リョービ	2.5	2.7	3,582
アーレスティ	2.5	2.9	1,026
アサヒホールディングス	3.9	3.8	8,599
金属製品 (0.5%)			
稲葉製作所	1.2	1.2	1,531
宮地エンジニアリンググループ	0.6	0.7	1,134
トーカロ	5.3	6.1	6,215
アルファC o	0.7	0.8	729
SUMCO	22.8	26.1	36,357
川田テクノロジーズ	0.5	0.4	2,164
RS Technologies	0.4	0.6	1,271
信和	—	0.9	658
東洋製罐グループホールディングス	13.1	13.9	17,152
ホッカンホールディングス	1	1.2	1,851
コロナ	1.1	1.2	1,152
横河ブリッジホールディングス	3.8	4.1	8,068

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
駒井ハルテック	0.4	0.4	597
高田機工	0.2	0.2	449
三和ホールディングス	21.3	20.6	17,386
文化シャッター	6.1	6.4	5,024
三協立山	2.9	2.8	2,906
アルインコ	1.6	1.6	1,489
東洋シャッター	0.5	0.5	338
LIXILグループ	30.4	32.2	43,309
日本ファイルコン	1.6	1.7	817
ノーリツ	4.6	4.5	5,296
長府製作所	2.1	2.2	5,599
リンナイ	3.7	4.2	32,130
ダイニチ工業	1.1	1.2	730
日東精工	2.8	3	1,578
三洋工業	0.3	0.3	509
岡部	4.2	4.4	3,181
ジーテクト	2.3	2.7	2,983
中国工業	0.3	—	—
東プレ	3.9	4.1	4,920
高周波熱錬	4	4.2	2,956
東京製綱	1.3	1.6	987
サンコール	1.2	1.2	502
モリテック スチール	1.6	1.7	445
バイオラックス	3.3	3.2	4,860
エイチワン	2	2.1	1,045
日本発條	20.6	23.4	16,567
中央発條	0.2	0.3	775
アドバネクス	0.3	0.3	418
立川ブラインド工業	0.9	1	1,085
三益半導体工業	1.8	1.7	3,007
機械(4.9%)			
日本ドライケミカル	0.6	0.5	692
日本製鋼所	6.3	6.6	8,632
三浦工業	8.9	9.4	36,237
タクマ	7.5	7.4	8,894
ツガミ	4.6	4.5	3,393
オークマ	2.6	2.5	8,712
東芝機械	2.3	2.5	5,365
アマダホールディングス	31.8	27.7	23,628
アイダエンジニアリング	5.7	5.7	3,938
滝澤鉄工所	0.6	0.7	761
FUJI	6.2	9.4	15,510
牧野フライス製作所	2.4	2.6	7,417
オーエスジー	10.2	10.1	14,614
ダイジェット工業	0.2	0.2	248
旭ダイヤモンド工業	5.4	5.7	2,639
DMG森精機	13.1	13.8	12,447
ソディック	4.5	5.1	3,304
ディスコ	2.8	3	64,080
日東工器	1.1	1.2	2,048
日進工具	0.6	0.6	1,460
パンチ工業	1.4	2	818
富士ダイス	0.9	1	604
豊和工業	1.1	1.2	747
OKK	0.8	0.9	411
東洋機械金属	1.5	1.6	651
津田駒工業	0.4	0.4	319
エンシュウ	0.5	0.5	454

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
島精機製作所	2.8	3.4	4,858
オプトラン	2	2.4	6,172
NCホールディングス	0.7	0.7	418
イワキポンプ	—	1	858
フリーユ	1.6	2.1	1,730
ヤマシンフィルタ	3.6	4.7	3,351
日阪製作所	2.5	2.7	1,992
やまびこ	4	4.2	3,410
平田機工	1	1	4,605
ペガサスミシン製造	1.9	2.2	776
マルマエ	0.6	0.9	646
タツモ	0.6	1	1,049
ナブテスコ	11.4	12.9	32,185
三井海洋開発	2.2	2.3	3,006
レオン自動機	2	2.1	2,505
SMC	6.1	6.9	315,675
ヤマモーターロボティクスホールディング	1.6	1.9	1,417
ホソカワミクロン	0.7	0.8	3,828
ユニオンツール	0.9	0.8	2,026
オイレス工業	2.9	2.8	3,830
日精エー・エス・ビー機械	0.6	0.7	2,198
サトーホールディングス	2.5	3.1	6,578
技研製作所	1.4	1.9	6,716
日本エアージェット	0.6	0.7	676
カワタ	0.4	0.6	420
日精樹脂工業	1.7	1.8	1,665
オカダアイヨン	0.7	0.7	588
ワイエイシイホールディングス	0.8	0.9	371
小松製作所	94.5	100	177,850
住友重機械工業	11.9	12.6	24,582
日立建機	8.4	8.8	19,263
日工	0.6	3	1,827
巴工業	0.9	0.9	1,855
井関農機	2.1	2.2	2,510
TOWA	1.8	2.2	1,641
丸山製作所	0.5	0.5	560
北川鉄工所	0.9	1	1,543
ローツェ	0.9	1	3,105
タカキタ	0.7	0.8	436
クボタ	111.8	117.1	161,773
荏原実業	0.6	0.6	1,308
三菱化工機	0.7	0.8	1,283
月島機械	4.1	4.1	5,555
帝国電機製作所	1.5	1.8	2,363
東京機械製作所	0.8	0.9	228
新東工業	5	5.2	3,915
澁谷工業	1.8	1.9	4,829
アイチ コーポレーション	3.6	3.8	2,603
小森コーポレーション	5.7	5.6	4,127
鶴見製作所	1.6	1.7	3,299
住友精密工業	0.3	0.3	664
日本ギア工業	—	0.7	170
酒井重工業	0.4	0.4	968
荏原製作所	9.3	9.1	18,718
石井鐵工所	0.3	0.3	642
西島製作所	2.1	2.2	1,680
北越工業	2.1	2.3	2,490
ダイキン工業	28.5	28.1	370,077

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オルガノ	0.8	0.8	4,384
トーヨーカネツ	0.8	1	1,955
栗田工業	11.3	11.9	29,726
椿本チエイン	2.7	3.1	7,626
大同工業	1	1	694
木村化工機	1.7	1.8	786
アネスト岩田	3.2	3.4	3,386
ダイフク	11.5	11.3	77,405
サムコ	0.6	0.6	933
加藤製作所	1.1	1.2	1,418
油研工業	0.4	0.4	568
タダノ	10.1	10.6	8,204
フジテック	7.6	8	11,128
CKD	5.8	6.1	9,028
キトー	1.6	1.7	1,694
平和	5.8	6.2	12,530
理想科学工業	1.8	1.9	3,102
SANKYO	5.2	4.9	15,410
日本金銭機械	2.3	2.4	1,298
マースグループホールディングス	1.3	1.4	2,401
フクシマガリレイ	1.3	1.4	4,760
オーイズミ	0.9	0.9	320
ダイコク電機	1	1	1,228
竹内製作所	3.5	3.7	4,987
アマノ	6	5.8	13,844
JUKI	2.9	3.1	1,708
サンデンホールディングス	2.5	2.9	1,049
蛇の目マシン工業	1.9	2	584
マックス	3.2	3.4	5,661
グローリー	5.8	5.7	14,193
新晃工業	1.9	2.1	2,931
大和冷機工業	3	3.2	3,020
セガサミーホールディングス	20.7	21.9	28,798
日本ピストンリング	0.8	0.8	904
リケン	1	1	2,757
TPR	2.8	3	3,456
ツバキ・ナカシマ	3.2	4.5	3,042
ホシザキ	6.1	6.5	52,715
大豊工業	1.7	1.8	968
日本精工	42.9	41.6	28,870
NTN	44.8	51.1	9,657
ジェイテクト	20	21.2	15,582
不二越	1.9	2	5,842
日本トムソン	6.2	6.5	2,398
THK	13	12.8	28,313
ユーシン精機	1.6	1.7	1,144
前澤給装工業	0.8	0.8	1,532
イーグル工業	2.6	2.7	1,830
前澤工業	1.4	1.5	472
日本ビラー工業	2.1	2.2	2,767
キッツ	8.5	8.9	5,811
マキタ	25.4	28.8	95,472
日立造船	16.5	17.5	6,090
三菱重工業	35	37	101,102
IHI	16	15.9	20,065
スター精密	3.6	3.4	3,709
電気機器(14.2%)			
日清紡ホールディングス	11.6	14.7	10,598

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イビデン	12.8	13.5	32,008
コニカミノルタ	45.6	48.2	21,159
ブラザー工業	27.2	27	44,658
ミネベアミツミ	38.7	41	66,174
日立製作所	93.9	106.1	333,472
三菱電機	208.7	220.7	294,634
富士電機	13.5	13.3	32,571
東洋電機製造	0.8	0.8	900
安川電機	24.2	23.8	70,828
シンフォニアテクノロジー	2.9	2.9	2,784
明電舎	4.1	4.1	6,650
オリジン	0.6	0.6	851
山洋電気	1	1.1	4,790
デンヨー	1.9	1.9	3,657
東芝テック	2.6	2.8	9,520
芝浦メカトロニクス	0.4	0.4	953
マブチモーター	5.8	6.1	19,642
日本電産	25.1	53.1	297,731
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.1	1.3	287
トレックス・セミコンダクター	0.7	1.3	1,329
東光高岳	1.1	1.2	1,140
ダブル・スコープ	3	3.5	1,246
ダイヘン	2.3	2.4	6,974
ヤーマン	3	3.6	2,404
JVCケンウッド	15.9	18	3,510
ミマキエンジニアリング	1.9	2	826
第一精工	0.9	0.9	1,735
日新電機	4.9	5.2	4,815
大崎電気工業	4.1	4.4	2,349
オムロン	22.2	19.8	111,474
日東工業	3.3	3.2	5,532
IDEC	2.8	3.2	4,384
正興電機製作所	0.4	0.5	462
不二電機工業	0.2	0.3	331
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7.5	7.4	10,759
サクサホールディングス	0.5	0.5	755
メルコホールディングス	0.9	0.8	1,746
テクノメディカ	0.5	0.5	937
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	—	0.4	184
日本電気	27	26.8	105,726
富士通	20.1	21.3	207,781
沖電気工業	9	9	9,126
岩崎通信機	1	1	822
電気興業	1.1	1.1	2,744
サンケン電気	2.4	2.4	5,047
ナカヨ	0.4	0.4	580
アイホン	1.2	1.2	1,729
ルネサスエレクトロニクス	21.6	105.5	41,039
セイコーエプソン	25.9	27.4	32,058
ワコム	15.1	14.8	4,706
アルバック	4.2	4.1	10,619
アクセル	0.9	0.9	573
EIZO	1.9	1.7	5,355
ジャパンディスプレイ	49.3	—	—
日本信号	5.3	5.6	5,908
京三製作所	4.5	5.2	2,423
能美防災	2.8	2.9	5,805
ホーチキ	1.3	1.6	2,185

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
星和電機	0.8	1.1	592
エレコム	2	2.4	9,036
パナソニック	238.4	252.2	208,065
シャープ	20.7	25.5	28,942
アンリツ	13.4	14.2	28,485
富士通ゼネラル	6.4	6	11,718
ソニー	140	139.7	897,013
TDK	10.9	10.7	89,666
帝国通信工業	0.9	1	1,187
タムラ製作所	8	7.4	2,930
アルプスアルパイン	21.7	19.5	20,455
池上通信機	0.7	0.7	586
日本電波工業	1.9	2	678
鈴木	1.1	1.1	761
日本トリム	0.4	0.3	853
ローランド ディー. ジー.	1.1	1.2	1,398
フォスター電機	2.4	2.3	2,557
SMK	0.6	0.6	1,384
ヨコオ	1.5	1.4	3,026
ティアック	1.5	1.6	233
ホシデン	6.1	6	4,536
ヒロセ電機	3	3.4	38,080
日本航空電子工業	4.8	5.1	6,635
TOA	2.2	2.4	1,932
マクセルホールディングス	4.5	4.8	5,107
古野電気	2.7	2.8	2,360
ユニデンホールディングス	0.6	0.6	1,093
スミダコーポレーション	1.8	1.7	1,125
アイコム	1.2	1.2	3,066
リオン	1	0.9	2,036
本多通信工業	1.8	1.9	720
船井電機	2.1	2.2	1,060
横河電機	20.9	20.2	26,320
新電元工業	0.7	0.8	1,863
アズビル	13.5	13.9	38,975
東亜ディーケーケー	1	1.1	993
日本光電工業	9.2	9.1	36,946
チノー	0.7	0.8	980
共和電業	2.2	2.3	943
日本電子材料	0.8	0.9	731
堀場製作所	4.1	4.4	23,672
アドバンテスト	14.2	16.4	71,176
小野測器	1	0.9	459
エスベック	1.8	2	3,284
キーエンス	10.2	20	696,600
日置電機	1.1	1.2	3,690
シスメックス	16.3	15.8	123,966
日本マイクロニクス	3.4	3.8	2,967
メガチップス	1.6	2.1	3,265
OBARA GROUP	1.2	1.1	2,552
澤藤電機	0.3	0.3	387
原田工業	0.6	1	830
コーセル	2.7	2.9	2,862
イリソ電子工業	1.9	1.9	6,061
オプテックスグループ	3.7	3.6	3,600
千代田インテグレ	0.9	1	1,604
アイ・オー・データ機器	0.8	0.7	562
レーザーテック	4.3	9.7	49,082

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スタンレー電気	14.8	15.5	33,046
岩崎電気	0.8	0.9	1,148
ウシオ電機	12.1	12.2	12,602
岡谷電機産業	1.5	1.7	533
ヘリオス テクノ ホールディング	1.9	2	632
エノモト	0.4	0.7	579
日本セラミック	2.1	2.2	4,061
遠藤照明	1.1	1.1	642
古河電池	1.5	1.6	872
双信電機	1	1.1	388
山一電機	1.5	1.6	2,217
図研	1.4	1.4	3,228
日本電子	4.1	4.4	11,602
カシオ計算機	18.5	19.5	29,581
ファナック	19.8	21	307,755
日本シイエムケイ	5.3	5.2	2,314
エンプラス	0.9	1.1	2,332
大真空	0.8	0.8	1,188
ローム	10.1	9.8	58,114
浜松ホトニクス	15	15.8	69,836
三井ハイテック	2.3	2.4	2,704
新光電気工業	7	7.4	7,666
京セラ	31.8	31.1	199,288
太陽誘電	9.3	9.8	28,037
村田製作所	65.7	64.8	354,585
ユーシン	3.3	—	—
双葉電子工業	3.4	3.5	3,685
北陸電気工業	0.8	0.9	803
ニチコン	6.6	7.5	5,070
日本ケミコン	1.5	1.7	2,021
KOA	3.1	3.3	2,943
市光工業	3.1	3.3	1,587
小糸製作所	12.5	13.2	48,246
ミツバ	3.8	4.1	1,722
SCREENホールディングス	3.6	3.8	15,200
キャノン電子	1.9	2.3	3,668
キャノン	112.3	118.8	280,249
リコー	62.7	56.2	44,622
象印マホービン	3.9	6.5	9,626
MUTOHホールディングス	0.3	0.3	425
東京エレクトロン	13.9	14	284,970
輸送用機器 (7.3%)			
トヨタ紡織	7.3	6.4	8,236
芦森工業	0.4	0.5	438
ユニプレス	4	4.3	4,145
豊田自動織機	16.9	17.9	92,722
モリタホールディングス	3.6	3.9	6,485
三櫻工業	2.6	2.8	1,915
デンソー	45.9	48.6	169,662
東海理化電機製作所	5.5	5.8	7,806
三井E&Sホールディングス	7.5	8	4,168
川崎重工業	16.2	17.2	26,986
名村造船所	6.3	7.1	1,448
サノヤスホールディングス	2.7	2.7	369
日本車輛製造	0.8	0.8	2,196
三菱ロジスネクスト	2.5	2.9	2,534
近畿車輛	0.3	0.3	317
日産自動車	246.1	260.3	92,822

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
いすゞ自動車	66	64	45,779
トヨタ自動車	232.5	246.3	1,601,196
日野自動車	26.1	27.6	16,035
三菱自動車工業	77.2	81.7	25,000
エフテック	1.5	1.5	639
レシップホールディングス	0.7	0.9	389
GMB	0.4	0.4	226
ファルテック	0.4	0.4	259
武蔵精密工業	5.1	4.9	4,086
日産車体	4.1	4.3	4,037
新明和工業	8.7	5.9	6,643
極東開発工業	4.2	4.1	4,850
日信工業	3.8	4.5	9,918
トピー工業	1.7	1.8	2,476
ティラド	0.8	0.8	993
タチエス	3.5	3.6	3,528
NOK	11.2	11.9	14,196
フタバ産業	5.8	6.1	2,787
KYB	2.2	2.5	5,172
大同メタル工業	3.4	4.2	2,259
プレス工業	10.3	10.9	2,637
ミクニ	2.6	2.8	683
太平洋工業	4.4	4.6	4,328
ケーヒン	4.8	5.1	12,877
河西工業	2.6	3	1,584
アイシン精機	17.2	18.2	48,484
マツダ	65.5	64.9	37,122
今仙電機製作所	1.9	2	1,302
本田技研工業	176	173.8	422,334
スズキ	38.2	43.7	112,942
SUBARU	64.8	68.5	142,034
安永	1	1.1	1,090
ヤマハ発動機	29.5	28.8	37,641
ショーワ	4.9	5.2	11,710
TBK	2.5	2.6	1,214
エクセディ	2.8	3	4,797
豊田合成	6.7	7.1	13,163
愛三工業	3.3	3.5	1,767
盟和産業	0.3	0.3	269
日本プラスト	1.6	1.7	742
ヨロズ	1.9	2.1	2,217
エフ・シー・シー	3.8	3.6	5,684
シマノ	8.4	8.3	128,152
テイ・エス テック	4.8	5.1	13,045
ジャムコ	1	1.1	771
精密機器 (2.6%)			
テルモ	59.1	62.5	232,500
クリエートメディック	0.7	0.7	782
日機装	6.7	6.6	5,319
日本エム・ディ・エム	—	1.3	2,125
島津製作所	26.9	26.4	75,108
JMS	1.9	1.9	1,660
クボテック	0.4	0.6	169
長野計器	1.6	1.6	1,286
ブイ・テクノロジー	0.5	1	3,130
東京計器	1.3	1.4	973
愛知時計電機	0.3	0.3	1,227
インターアクション	1	1.2	2,607

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オーバル	2	2	430
東京精密	3.8	4	12,320
マニー	2.5	8.8	23,311
ニコン	36.4	35.7	35,628
トプコン	11.2	11.1	8,902
オリンパス	124.3	122.1	190,720
理研計器	1.8	1.9	3,879
タムロン	1.8	1.8	3,263
HOYA	42	44.1	405,720
シード	0.9	0.9	732
ノーリツ鋼機	1.6	1.5	1,392
エー・アンド・デイ	1.9	2	1,282
朝日インテック	8.8	18.7	49,966
シチズン時計	22.8	25.8	9,907
リズム時計工業	0.7	0.7	454
大研医器	1.7	1.5	985
メニコン	2.9	3.1	14,957
シンシア	0.3	0.2	78
松風	1	1	1,761
セイコーホールディングス	3.2	3.1	5,406
ニプロ	14.4	15.3	19,446
その他製品 (2.5%)			
中本ボックス	0.6	0.6	775
スノーピーク	0.8	1.1	774
バヤマウントベッドホールディングス	2.4	2.3	10,292
トランザクション	1.1	1.4	1,141
粧美堂	0.6	0.6	199
ニホンフラッシュ	0.9	2.1	1,995
前田工織	2.3	2.4	4,917
永大産業	2.7	2.9	800
アートネイチャー	2.2	2.4	1,543
バンダイナムコホールディングス	21.6	22.8	119,494
アイフィスジャパン	0.5	0.6	429
共立印刷	3.5	3.7	566
SHOEI	1	2.1	4,764
フランスベッドホールディングス	3	3.1	2,830
パイロットコーポレーション	3.6	3.6	12,942
萩原工業	1.2	1.2	1,693
トッパン・フォームズ	4.5	4.7	4,526
フジールインターナショナル	4.7	4.9	9,368
タカラトミー	8.7	9.9	7,543
廣済堂	1.9	1.5	1,063
エステールホールディングス	0.6	0.6	367
アーク	8	8.4	613
タカノ	0.8	0.9	683
プロネクサス	1.8	1.9	1,979
ホクシン	1.3	1.4	159
ウッドワン	0.7	0.7	717
大建工業	1.6	1.5	2,544
凸版印刷	29.5	31.2	51,667
大日本印刷	29.4	28.9	66,498
図書印刷	2	—	—
共同印刷	0.6	0.7	1,900
N I S S H A	4.3	4.5	3,231
光村印刷	0.2	0.2	280
TAKARA & COMPANY	1	1.1	1,844
アシックス	19.7	18.2	18,181
ツツミ	0.7	0.7	1,210

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
小松ウオール工業	0.6	0.7	1,374
ヤマハ	12.4	13.1	55,216
河合楽器製作所	0.6	0.7	1,692
クリナップ	1.9	2.1	1,123
ビジョン	12.6	13.3	55,128
オリバー	—	0.5	1,617
兼松サステック	0.1	0.1	143
キングジム	1.7	1.8	1,499
リンテック	5	5.2	11,824
イトーキ	3.8	4.7	1,499
任天堂	12.8	13.5	561,735
三菱鉛筆	3.4	3.6	5,115
タカラスタンダード	4.3	4.6	7,626
コクヨ	10	10.6	16,027
ナカバヤシ	2.1	2.2	1,185
グローブライド	1	1	1,871
オカムラ	7.3	7.7	6,660
美津濃	2.1	2	3,742
電気・ガス業(1.8%)			
東京電力ホールディングス	166.6	176.2	66,427
中部電力	63.8	67.5	102,903
関西電力	85.1	83.6	100,612
中国電力	28.8	31.8	47,954
北陸電力	20.4	20.2	15,291
東北電力	48.9	55.1	57,359
四国電力	18.8	19.9	16,994
九州電力	43	45.5	39,539
北海道電力	19.5	20.7	9,687
沖縄電力	3.9	4.1	8,118
電源開発	16.6	17.6	38,332
エフオン	1	1.2	550
イーレックス	3.6	3.1	3,816
レノバ	2.6	3.7	3,404
東京瓦斯	40.9	42.4	108,374
大阪瓦斯	40.5	42.8	87,140
東邦瓦斯	10.3	10.9	53,410
北海道瓦斯	1.1	1.2	1,854
広島ガス	4.3	4.5	1,611
西部瓦斯	2.3	2.5	6,527
静岡ガス	6.4	6.3	5,531
メタウォーター	1	1.1	4,251
陸運業(4.5%)			
SBSホールディングス	2.1	1.9	3,323
東武鉄道	22	23.3	87,841
相鉄ホールディングス	7.2	7.1	19,688
東急	56.7	55.7	94,690
京浜急行電鉄	28.6	28.3	51,421
小田急電鉄	33.4	32.8	77,801
京王電鉄	11.7	11.5	73,485
京成電鉄	15.6	15.4	48,048
富士急行	2.8	3	8,361
新京成電鉄	0.5	0.6	1,310
東日本旅客鉄道	37.1	38.8	317,228
西日本旅客鉄道	18.7	19.7	145,701
東海旅客鉄道	18.7	18.4	318,688
西武ホールディングス	26.6	29.6	35,164
鴻池運輸	3.3	3.5	4,053
西日本鉄道	5.8	6.1	16,207

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハマキョウレックス	1.6	1.7	4,474
サカイ引越センター	1.1	1.2	6,888
近鉄グループホールディングス	19.8	20.9	104,500
阪急阪神ホールディングス	26.4	27.9	101,416
南海電気鉄道	8.8	9.9	24,354
京阪ホールディングス	8.8	9.3	44,640
神戸電鉄	0.5	0.5	1,915
名古屋鉄道	16	17.2	52,116
山陽電気鉄道	1.5	1.5	3,012
日本通運	7.8	7.4	39,146
ヤマトホールディングス	34.6	36.6	62,110
山九	5.5	5.8	23,403
丸運	1.1	1.2	276
丸全昭和運輸	1.6	1.7	4,061
センコーグループホールディングス	10.9	11.5	9,637
トナミホールディングス	0.5	0.5	2,425
ニッコンホールディングス	7.5	7.5	15,877
日本石油輸送	0.2	0.2	532
福山通運	2.5	2.7	10,435
セイノーホールディングス	14.8	15.7	18,416
エスライン	0.6	0.6	510
神奈川中央交通	0.5	0.5	1,992
日立物流	4.3	3.8	8,926
丸和運輸機関	1	2.2	5,379
C&Fロジホールディングス	2	2.1	2,604
九州旅客鉄道	16.6	18.3	56,730
S Gホールディングス	18.7	21.9	56,348
海運業(0.1%)			
日本郵船	16.5	17.5	22,505
商船三井	11.7	13.2	23,060
川崎汽船	6.1	6.4	5,196
NSユナイテッド海運	1.1	1.1	1,525
明治海運	2.1	2.2	756
飯野海運	9.4	9.9	3,069
共栄タンカー	0.2	0.4	334
乾汽船	1.8	1.2	1,494
空運業(0.4%)			
日本航空	36.2	37.6	74,824
ANAホールディングス	36.1	38.2	100,809
パスコ	0.4	0.4	597
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	0.6	0.6	4,236
日新	1.7	1.8	2,878
三菱倉庫	6.8	6.6	14,401
三井倉庫ホールディングス	2.4	2.4	3,357
住友倉庫	7.4	7.7	9,109
澁澤倉庫	1.1	1.1	2,228
東陽倉庫	3.6	3.8	1,322
日本トランスシティ	4.4	4.6	2,143
ケイヒン	0.4	0.4	451
中央倉庫	1.2	1.3	1,566
川西倉庫	0.4	0.4	367
安田倉庫	1.6	1.7	1,434
ファイズホールディングス	0.3	0.4	359
東洋埠頭	0.6	0.6	780
宇徳	1.7	1.8	959
上組	12.2	11.7	21,387
サンリツ	0.5	0.5	268

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キムラユニティー	0.5	0.6	582
キューソー流通システム	0.5	0.5	798
近鉄エクスプレス	3.7	4.4	6,982
東海運	1.1	1.2	301
エーアイテイナー	1.3	1.5	1,095
内外トランスライン	0.6	0.7	813
日本コンセプト	0.5	0.7	956
情報・通信業(9.7%)			
NEC ネットエスアイ	2.3	2	8,800
クロスキャット	0.4	0.6	460
システナ	7.3	7.7	11,288
デジタルアーツ	1.1	1.1	5,137
日鉄ソリューションズ	3.1	3.2	8,422
キューブシステム	1.1	1.2	710
エイジア	0.4	0.4	471
コア	0.9	0.9	1,067
ソリトンシステムズ	1.2	0.9	1,084
ソフトクリエイトホールディングス	0.9	0.9	1,493
T I S	6.8	21.7	38,777
ネオス	0.7	0.9	461
電算システム	0.8	0.8	1,716
グリー	14.1	13.3	5,546
コエテックホールディングス	4.2	4.4	12,254
三菱総合研究所	0.8	0.9	2,961
ボルテージ	0.4	0.5	158
電算	0.2	0.2	401
AGS	1.2	1.2	961
ファインデックス	1.7	1.8	1,222
ブレインパッド	0.4	0.5	2,120
KL a b	3.7	4.2	2,847
ポルトカウイン・ビートルホールディ	2.7	2.6	2,009
イーブックイニシアティブジャパン	0.3	0.3	364
ネクソン	52.2	60.4	106,606
アイスタイル	5.2	6.1	1,262
エムアップ	0.7	0.6	1,275
エイチーム	1.3	1.5	901
エニグモ	—	1.5	1,240
テクノスジャパン	1.7	1.7	578
e n i s h	0.7	1	398
コロブラ	5.9	7.1	5,651
オルトプラス	1.3	1.6	822
ブロードリーフ	10.1	10.7	5,029
クロス・マーケティンググループ	0.6	1	267
デジタルハーツホールディングス	0.9	1.1	804
システム情報	—	1.1	665
メディアドゥホールディングス	0.6	0.7	2,117
じげん	2.2	5.4	1,425
ブイキューブ	1.1	1.3	1,548
エンカレッジ・テクノロジー	—	0.4	248
サイバーリンクス	0.3	0.3	275
ディー・エル・イー	1.4	1.7	192
フィックスターズ	2	2.3	2,352
CARTA HOLDINGS	1.1	1	820
オブティム	0.9	1.1	2,203
セレス	0.7	0.7	479
SHIFT	—	0.6	4,212
ティーガイア	2	1.9	3,891
セック	0.3	0.3	814

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本アジアグループ	2.2	2.3	565
豆蔵ホールディングス	1.4	0.3	561
テクマトリックス	1.4	1.5	3,313
プロシップ	0.6	0.6	642
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	49.3	5.2	7,862
GMOペイメントゲートウェイ	3.4	3.6	27,288
ザッパラス	1.1	0.9	273
システムリサーチ	0.3	0.6	832
インターネットイニシアティブ	3.3	3.2	11,344
さくらインターネット	2.4	2.3	1,071
ヴィンクス	0.7	0.6	417
GMOクラウド	0.5	0.4	666
SRAホールディングス	1.1	1.1	2,350
Minorityソリューションズ	0.4	—	—
システムインテグレーション	0.6	0.7	423
朝日ネット	1.7	1.5	1,072
e B A S E	1.2	2.6	1,911
アバント	0.7	1.5	1,153
アドソル日進	0.7	0.8	1,730
フリービット	1.2	1.1	709
コムチャア	1.1	2.4	5,280
サイバーコム	0.4	0.4	674
アステリア	1	1.3	408
アイル	—	0.8	1,028
マークラインズ	0.7	1.1	1,783
メディカル・データ・ビジョン	1.8	1.6	1,051
g u m i	2.6	2.8	1,694
ショーケース	0.4	0.5	213
モバイルファクトリー	0.6	0.5	529
テラスカイ	0.1	0.8	2,046
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.9	0.8	1,004
PCIホールディングス	0.4	0.9	807
パイブドHD	0.3	0.3	341
アイビーシー	0.3	0.4	312
ネオジャパン	0.4	0.4	412
P R T I M E S	0.1	0.2	329
ランドコンピュータ	0.2	0.3	291
ダブルスタンダード	0.1	0.3	1,225
オープンドア	1	1.1	811
マイネット	0.7	0.7	448
アカツキ	0.7	0.8	2,892
ベネフィットジャパン	0.1	0.2	244
Ubicomホールディングス	0.4	0.5	695
L I N E	6.2	5	26,050
カナミックネットワーク	0.3	1.3	679
ノムラシステムコーポレーション	0.2	0.5	172
チェンジ	0.3	0.4	1,105
シンクロ・フード	0.9	0.9	182
オークネット	1.1	1.3	1,713
セグエグループ	—	0.4	314
エイトレッド	—	0.3	371
AOI TYO Holdings	2.2	2.2	950
マクロミル	3.6	4.4	2,741
ビーグリー	0.4	0.4	546
オロ	0.2	0.6	1,585
ユーザローカル	—	0.2	474
テモナ	—	0.3	168
ニーズウェル	—	0.3	156

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サインポスト	—	0.3	374
ソルクシーズ	0.9	0.9	486
フェイス	0.8	0.8	465
プロトコーポレーション	—	1.9	1,628
ハイマックス	0.2	0.3	568
野村総合研究所	13	30.7	70,241
サイバネットシステム	1.7	1.5	840
CEホールディングス	0.5	1.2	508
日本システム技術	0.3	0.3	303
インテージホールディングス	2.6	2.7	2,165
東邦システムサイエンス	0.6	0.6	546
ソースネクスト	7.9	10.3	3,007
インフォコム	1.7	2.4	5,920
HEROZ	—	0.2	542
ラクスル	—	1.2	2,820
FIG	1.8	2.3	529
システムサポート	—	0.2	464
イーソル	—	0.8	779
アルテリア・ネットワークス	1.7	2.4	4,401
東海ソフト	—	0.2	232
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	0.5	0.5	461
フォーカスシステムズ	1.4	1.3	878
クレスコ	0.6	1.3	1,851
フジ・メディア・ホールディングス	21.2	20.9	22,509
オービック	7.1	7.5	106,200
ジャストシステム	2.9	3.5	17,202
TDCソフト	1.8	1.9	1,510
Zホールディングス	133.5	297.4	103,495
トレンドマイクロ	10.9	9.6	51,264
IDホールディングス	0.6	0.8	1,119
日本オラクル	4.1	4.4	41,536
アルファシステムズ	0.6	0.7	2,019
フューチャー	2.8	2.6	3,632
CAC Holdings	1.5	1.4	1,369
SBテクノロジー	0.9	0.8	1,704
トーセ	0.6	0.6	431
オービックビジネスコンサルタント	2.1	2.2	9,636
伊藤忠テクノソリューションズ	9.3	9.9	30,541
アイティフォー	2.5	2.6	1,471
東計電算	0.3	0.3	1,129
エクスネット	0.4	0.3	272
大塚商会	11.1	11.7	54,054
サイボウズ	2.4	2.5	4,767
ソフトブレイン	1.6	1.3	490
電通国際情報サービス	1.3	1.3	5,102
ACCESS	—	2	1,780
デジタルガレージ	4	3.9	13,474
EMシステムズ	1.7	3	2,706
ウェザーニューズ	0.7	0.7	2,474
CIJ	1.6	1.5	1,120
ビジネスエン지니어リング	0.2	0.2	474
日本エンタープライズ	2.1	2.2	451
WOWOW	1	1	2,400
スカラ	1.4	1.4	590
インテリジェント ウェイブ	—	0.9	446
IMAGICA GROUP	1.7	1.8	635
ネットワンシステムズ	7.2	8.3	18,658

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
システムソフト	4.8	5.1	336
アルゴグラフィックス	1.7	1.8	6,381
マーベラス	3.1	3.3	1,762
エイベックス	3.5	3.7	3,148
日本ユニシス	6.4	6.8	19,672
兼松エレクトロニクス	1.1	1.2	4,080
東京放送ホールディングス	13.6	13.2	19,852
日本テレビホールディングス	18.8	18.1	21,810
朝日放送グループホールディングス	2	2.1	1,451
テレビ朝日ホールディングス	5.6	5.9	9,628
スカパーJ SATホールディングス	15.6	14.2	5,452
テレビ東京ホールディングス	1.7	1.8	4,327
日本BS放送	0.7	0.7	710
ビジョン	0.6	2	1,338
スマートバリュー	0.4	0.6	502
USEN-NEXT HOLDINGS	0.8	0.8	1,061
ワイヤレスゲート	0.9	1	388
コネクシオ	1.4	1.2	1,626
日本通信	17.7	16.9	2,687
クロップス	0.4	0.4	186
日本電信電話	140.1	289.5	745,607
KDDI	180.5	161.4	514,866
ソフトバンク	162.8	196.8	270,501
光通信	2.4	2.2	39,886
NTTドコモ	129.7	160	540,320
エムティーアイ	2.4	2.1	1,146
GMOインターネット	7.5	8.5	15,436
ファイバーゲート	—	0.5	506
アイドママーケティングコミュニケーション	0.4	0.6	217
KADOKAWA	6	5.8	7,905
学研ホールディングス	0.7	2.9	5,353
ゼンリン	4.1	4.3	4,545
昭文社	0.9	1	374
インプレスホールディングス	1.7	1.8	232
アイネット	1.2	1.1	1,456
松竹	1.4	1.4	16,968
東宝	13.5	12.8	42,240
東映	0.9	0.8	10,848
エヌ・ティ・ティ・データ	54.5	57.7	60,008
ピー・シー・エー	0.3	0.3	919
ビジネスブレイン太田昭和	0.3	0.4	1,072
DTS	2.3	4.8	9,024
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9.5	9.2	44,390
シーイーシー	2.2	2.3	3,151
カプコン	8.8	10.2	34,578
アイ・エス・ビー	0.4	0.4	561
ジャステック	1.2	1.4	1,373
SCSK	5.4	5	24,075
日本システムウエア	0.7	0.7	1,217
アイネス	2.6	2.1	2,843
TKC	1.7	1.8	8,739
富士ソフト	3.1	2.8	9,730
NSD	3.4	7	10,080
コナミホールディングス	8.4	7.9	26,188
福井コンピュータホールディングス	0.7	0.9	1,956
JBCホールディングス	1.6	1.5	2,512
ミロク情報サービス	2	1.9	4,523

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソフトバンクグループ	85.6	171.8	650,778
卸売業(5.0%)			
ハウスイ	0.2	0.2	142
高千穂交易	0.8	0.8	766
伊藤忠食品	0.5	0.5	2,182
エレマテック	1	2	1,538
JALUX	0.6	0.6	904
あらた	1.1	1.7	7,862
トーマンデバイス	0.3	0.3	973
東京エレクトロン デバイス	0.7	0.8	1,800
フィールズ	1.8	1.7	482
双日	113.5	120.1	30,505
アルフレッサ ホールディングス	22.8	24.2	48,738
横浜冷凍	5.4	6.1	5,636
神栄	0.3	0.3	167
ラサ商事	1.1	1.2	980
ラクーンホールディングス	1	1	510
アルコニックス	2.2	2.3	2,481
神戸物産	3.1	7.5	31,950
あい ホールディングス	2.9	3.1	4,132
ディーブイエックス	0.8	0.8	727
ダイワボウホールディングス	1.9	1.8	9,342
マクニカ・富士エレホールディングス	5.7	5.2	6,973
ラクト・ジャパン	0.4	0.8	2,664
バイタルケエスケー・ホールディングス	3.9	4.1	4,497
八洲電機	1.6	1.7	1,395
メディアスホールディングス	1.2	1.2	1,003
レスターホールディングス	2.3	2.3	3,482
ジュテックホールディングス	0.5	0.5	486
大光	0.7	0.9	535
OCHIホールディングス	0.6	0.6	907
TOKAIホールディングス	10.9	11.5	10,775
黒谷	0.3	0.5	171
Cominix	0.4	0.4	273
三洋貿易	1	2.2	1,817
ビューティガレージ	0.3	0.3	360
ウイン・パートナーズ	1.3	1.6	1,568
ミタチ産業	0.6	0.7	378
シッパヘルスケアホールディングス	4.3	3.5	15,487
明治電機工業	0.6	0.7	960
デリカフーズホールディングス	0.4	0.8	528
スターティアホールディングス	0.4	0.5	237
コマダホールディングス	4.8	4.7	7,811
ピーバンドットコム	—	0.2	151
アセンテック	—	0.2	589
富士興産	0.8	0.7	259
協栄産業	0.2	0.2	216
小野建	1.8	1.9	2,156
南陽	0.4	0.5	628
佐鳥電機	1.5	1.5	1,330
エコートレーディング	0.5	0.5	250
伯東	1.4	1.3	1,257
コンドーテック	1.6	1.7	1,579
中山福	1.2	1.2	560
ナガイレーベン	3	3.1	8,224
三菱食品	2.3	2.4	6,669
松田産業	1.5	1.6	2,028
第一興商	3.1	3.2	9,219

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メディバルホールディングス	22.2	23.5	47,423
SPK	0.4	0.9	1,131
萩原電気ホールディングス	0.8	0.8	1,757
アズワン	1.5	1.4	13,328
スズデン	0.7	0.8	887
尾家産業	0.7	0.6	894
シモジマ	1.3	1.3	1,578
ドウシシャ	1.9	2	2,560
小津産業	0.5	0.5	849
高速	1.2	1.3	1,576
たけびし	0.7	0.8	1,056
リックス	0.5	0.5	787
丸文	1.8	1.9	904
ハピネット	1.7	1.8	1,972
橋本総業ホールディングス	0.44	0.4	724
日本ライフライン	6.4	6.4	8,716
タカショー	1	1.1	476
エクセル	0.8	—	—
マルカ	0.7	0.8	1,505
IDOM	6.9	5.9	2,318
日本エム・ディ・エム	1.2	—	—
進和	1.2	1.3	2,256
エスケイジャパン	0.5	0.5	138
ダイトロン	0.9	0.9	1,337
シークス	2.6	2.8	2,430
田中商事	0.7	0.7	455
オーハシテクニカ	1.2	1.2	1,598
白銅	0.7	0.8	1,028
伊藤忠商事	143.8	152	340,860
丸紅	202.7	226.3	121,975
高島	0.3	0.3	436
長瀬産業	11.6	12.2	15,603
蝶理	1.3	1.4	2,151
豊田通商	22.9	24.3	61,867
三共生興	3.5	3.3	1,626
兼松	8.2	8.1	8,982
ツカモトコーポレーション	0.4	0.4	421
三井物産	169.3	191.1	287,318
日本紙パルプ商事	1.2	1.2	4,524
日立ハイテク	6.2	7.5	59,850
カメイ	2.7	2.8	2,842
東都水産	0.3	0.3	778
OUGホールディングス	0.3	0.3	803
スターゼン	0.8	0.8	3,552
山善	8	8.5	7,658
椿本興業	0.5	0.4	1,440
住友商事	121.6	137.2	169,990
内田洋行	0.9	0.9	3,172
三菱商事	144.2	152.5	349,453
第一実業	0.9	1.1	3,784
キャノンマーケティングジャパン	5.9	6.2	13,292
西華産業	1.2	1.2	1,300
佐藤商事	1.8	1.8	1,512
菱洋エレクトロ	2.1	2.2	4,529
東京産業	2	2	974
ユアサ商事	2.1	2.1	6,001
神鋼商事	0.5	0.5	942
小林産業	1.2	1.3	349

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
阪和興業	3.6	4.1	6,896
正栄食品工業	1.1	1.4	5,544
カナデン	2	1.8	2,253
菱電商事	1.6	1.6	2,075
フルサト工業	1.1	1.2	1,730
岩谷産業	4.6	4.8	17,328
ナイス	0.9	0.9	828
昭光通商	0.7	0.7	429
ニチモウ	0.3	0.3	488
極東貿易	0.6	0.6	777
イワキ	2.5	2.8	1,206
三愛石油	5.5	5.4	6,096
稲畑産業	4.9	4.8	5,664
G S I クレオス	0.5	0.5	496
明和産業	1.9	2	996
クワザワ	—	0.8	378
ワキタ	4.4	4.6	4,544
東邦ホールディングス	6.1	7	15,869
サンゲツ	6.1	5.9	9,469
ミツウログループホールディングス	3	3.2	3,635
シナネンホールディングス	0.8	0.9	2,356
伊藤忠エネクス	4.5	4.8	4,051
サンリオ	6.3	6.1	8,765
サンワテクノス	1.2	1.5	1,222
リョーサン	2.3	2.4	5,733
新光商事	1.9	3.4	3,026
トーホー	0.9	1	1,681
三信電気	1.4	1.2	1,674
東陽テクニカ	2.4	2.5	2,427
モスフードサービス	2.7	2.9	7,267
加賀電子	2	2.2	3,744
ソーダニッカ	2.1	2.2	1,309
立花エレテック	1.5	1.6	2,316
フォーバル	0.9	1	1,133
PAL TAC	3.7	3.5	18,865
三谷産業	2.4	2.9	922
太平洋興発	0.8	0.9	585
西本Wismettacホールディングス	0.5	0.4	805
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.2	0.2	351
国際紙パルプ商事	3.6	5.1	1,300
ヤマタネ	1	1.1	1,218
丸紅建材リース	0.2	0.2	298
日鉄物産	1.5	1.5	5,475
泉州電業	0.7	0.7	1,692
トラスコ中山	4.3	4.5	10,539
オートバックスセブン	8.2	8.1	10,092
モリト	1.5	1.6	1,179
加藤産業	3.2	3.4	11,577
北恵	0.4	0.4	286
イノテック	1.2	1.3	1,118
イエローハット	3.9	4.1	6,162
J K ホールディングス	1.9	2	1,378
日伝	1.7	2	4,250
北沢産業	1.5	1.6	449
杉本商事	1.1	1.2	2,122
因幡電機産業	2.9	6.2	14,272
東テク	0.7	0.7	1,312
ミスミグループ本社	25.7	27.2	64,056

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルテック	1.5	1.7	311
タキヒヨー	0.6	0.7	1,077
蔵王産業	0.3	0.4	544
スズケン	9.4	9.2	36,202
ジェコス	1.4	1.5	1,176
グローセル	1.9	2.2	847
小売業(4.8%)			
ローソン	5.2	5.5	32,615
サンエー	1.6	1.8	8,109
カワチ薬品	1.6	1.7	4,032
エービーシー・マート	3.2	3.4	18,394
ハードオフコーポレーション	0.8	0.9	577
アスクル	2.1	2.3	7,360
ゲオホールディングス	3.1	3.9	5,101
アダストリア	2.8	3	3,672
ジーフット	1.2	1.3	566
シー・ヴィ・エス・バイエリア	0.3	0.3	130
くら寿司	1.2	1.1	4,433
キャンドウ	1	1	1,680
パルグループホールディングス	1	2.2	2,893
エディオン	8.7	10	8,930
サーラコーポレーション	4.2	4.4	2,450
ワッツ	0.7	1	589
ハローズ	0.8	0.8	2,181
フジオフードシステム	0.9	1.8	2,422
あみやき亭	0.4	0.5	1,492
ひらまつ	4.1	4	636
大黒天物産	0.5	0.5	1,530
ハニーズホールディングス	1.8	1.9	2,059
ファーマライズホールディングス	0.5	0.5	336
アルペン	1.6	1.7	2,728
ハブ	0.7	0.6	372
クオールホールディングス	3	3.2	4,240
ジンズホールディングス	1.4	1.2	7,116
ビックカメラ	11	12.9	11,287
DCMホールディングス	11.1	12	11,964
ペッパーフードサービス	1.6	—	—
MonotaRO	13	15.5	44,454
東京一番フーズ	0.5	0.6	289
DDホールディングス	0.5	0.9	718
きちりホールディングス	0.5	0.6	312
アークランドサービスホールディングス	1.5	1.6	2,315
J. フロント リテイリング	26.3	26	23,348
ドトール・日レスホールディングス	3.6	3.5	5,736
マツモトキヨシホールディングス	8.5	9	35,370
ブロンコビリー	1.1	1.1	2,394
ZOZO	22.2	14.9	21,619
トレジャー・ファクトリー	0.6	0.6	361
物語コーポレーション	0.5	0.6	3,738
ココカラファイン	2.3	2.3	12,903
三越伊勢丹ホールディングス	38.5	38	23,940
Hamee	0.6	0.8	805
ウエルシアホールディングス	5.4	6.5	49,075
クリエイトSDホールディングス	3	3.7	10,012
丸善CHIホールディングス	2.4	2.5	925
ミサワ	0.4	0.4	160
ティーライフ	0.3	0.3	268
エー・ピーカンパニー	0.4	0.4	169

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
チムニー	0.6	0.7	1,143
シュッピン	1.4	1.5	952
ネクステージ	3.2	3.1	2,191
ジョイフル本田	6	6.4	7,974
鳥貴族	0.7	0.7	1,132
キリン堂ホールディングス	0.8	0.9	1,557
ホットランド	1.1	1.4	1,321
すかいらくホールディングス	19.2	24.4	39,088
SFPホールディングス	0.9	0.9	1,245
綿半ホールディングス	0.8	0.8	1,270
ヨシックス	0.3	0.4	731
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	6	6.3	6,054
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.8	1	463
BEENOS	0.5	0.8	640
あさひ	1.7	1.6	1,795
日本調剤	0.7	1.3	2,151
コスモス薬品	0.9	1	25,780
トーエル	1	1	801
オンリー	0.3	0.4	243
セブン&アイ・ホールディングス	86.1	85	303,960
薬王堂	0.9	—	—
クリエイト・ストラーツ・ホールディング	5.5	11.7	7,382
ツルハホールディングス	4.5	4.7	67,022
サンマルクホールディングス	1.6	1.7	2,944
フェリシモ	0.5	0.5	476
トリドールホールディングス	2.5	5.4	6,247
TOKYO BASE	1.8	2	466
ウイルプラスホールディングス	0.2	0.3	153
JMホールディングス	0.8	1.1	2,425
サツドラホールディングス	0.3	0.3	572
デファクトスタンダード	0.1	—	—
アレンザホールディングス	1.1	1.1	784
串カツ田中ホールディングス	—	0.3	338
パロックジャパンリミテッド	1.7	1.5	940
クスリのアオキホールディングス	2	1.9	17,062
力の源ホールディングス	0.6	1	608
スシローグローバルホールディングス	2.3	9.5	15,114
LIXILビバ	1.7	2.1	3,855
メディカルシステムネットワーク	2.2	2.1	903
はるやまホールディングス	1	1	741
ノジマ	3.7	3.9	6,953
カップ・クリエイト	2.9	3	4,002
ライトオン	1.7	1.6	808
ジーンズメイト	0.6	0.7	159
良品計画	2.9	28.9	35,084
三城ホールディングス	2.5	2.3	570
アドヴァン	3.1	3.3	3,593
アルビス	0.8	0.8	1,652
コナカ	2.6	2.6	761
ハウス オブ ローゼ	0.3	0.3	482
G-7ホールディングス	0.6	1.3	3,016
イオン北海道	2.1	2.9	2,140
コジマ	3	3.7	1,261
ヒマラヤ	0.6	0.8	583
コーナン商事	2.7	3.1	6,782
エコス	0.8	0.8	1,331
ワタミ	2.7	2.6	2,423
マルシェ	0.5	0.6	321

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
バン・パシフィック・インターナショナルホ	12.3	47.8	97,942
西松屋チェーン	4.5	4.8	3,580
ゼンショーホールディングス	9.7	10.4	21,434
幸楽苑ホールディングス	1.3	1.4	1,909
ハークスレイ	0.4	0.5	544
サイゼリヤ	3.4	3.6	7,376
VTホールディングス	7	9	2,637
魚力	0.6	0.6	905
ポプラ	0.5	0.6	276
フジ・コーポレーション	0.4	0.6	1,120
ユナイテッドアローズ	2.3	2.3	3,737
ハイデイ日高	3	3.1	4,715
京都きもの友禅	1.3	1.4	343
コロワイド	6.8	7.2	11,772
ピーシーデポコーポレーション	2.7	2.9	1,244
壺番屋	1.4	1.5	6,712
トップカルチャー	0.7	0.8	258
PLANT	0.5	0.6	275
スギホールディングス	4.5	4.3	24,811
薬王堂ホールディングス	—	0.9	2,174
ヴィア・ホールディングス	2.5	2.7	1,331
スクロール	3.2	3.3	953
ヨンドシーホールディングス	2.3	2.2	4,274
ファミリーマート	23	17.4	33,721
木曽路	2.5	2.8	6,720
SRSホールディングス	2.4	2.6	2,347
千趣会	3.7	3.9	1,396
タカキュー	1.6	1.7	229
ケーヨー	3.8	4.5	2,223
上新電機	2.4	2.6	5,402
日本瓦斯	3.3	3.4	12,155
ロイヤルホールディングス	3.6	3.8	6,684
東天紅	0.2	0.2	165
いなげや	2.3	2.7	4,274
島忠	4.7	4.1	10,914
チヨダ	2.2	2.3	2,677
ライフコーポレーション	1.6	1.6	4,772
リンガーハット	2.5	2.7	5,578
MrMaxHD	2.8	3	1,011
テンアライド	1.9	2	774
AOKIホールディングス	4.1	4.3	3,121
オークワ	2.9	3.4	5,902
コメリ	3.2	3.4	6,582
青山商事	3.6	4.5	4,176
しまむら	2.4	2.5	16,300
はせがわ	1.1	1.1	452
高島屋	16.1	15.8	15,373
松屋	4.1	4.4	2,697
エイチ・ツー・オー リテイリング	10.5	10.3	8,147
近鉄百貨店	0.8	0.8	2,011
パルコ	2	—	—
丸井グループ	17.4	19.9	36,118
アクシアル リテイリング	1.7	1.8	7,164
井筒屋	1	1.2	184
イオン	79.1	83.6	200,556
イズミ	4.2	4.4	13,112
平和堂	4.2	4.4	8,377
フジ	2.5	2.6	4,674

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤオコー	2.3	2.5	16,675
ゼビオホールディングス	2.5	2.6	2,319
ケーズホールディングス	21.4	21	21,483
Olympicグループ	1.2	1.1	682
日産東京販売ホールディングス	3	3.2	688
シルバーライフ	—	0.2	396
Genky DrugStores	1	1	2,065
ナルミヤ・インターナショナル	—	0.4	221
総合メディカルホールディングス	1.8	1.9	4,820
ブックオフグループホールディングス	1.1	1.3	1,043
アインホールディングス	2.8	2.7	17,145
元気寿司	0.6	0.5	1,109
ヤマダ電機	62.6	66.2	28,532
アークランドサカモト	3.5	3.4	3,315
ニトリホールディングス	8.9	9.4	137,052
グルメ杵屋	1.5	1.5	1,468
愛眼	1.6	1.7	358
ケーユーホールディングス	1.1	1.1	935
吉野家ホールディングス	7.2	7.1	14,775
松屋フーズホールディングス	1	1	3,945
サガミホールディングス	2.7	2.9	3,509
関西スーパーマーケット	1.6	1.8	1,836
王将フードサービス	1.5	1.6	9,248
ブレナス	2.3	2.4	4,425
ミニストップ	1.5	1.6	2,329
アークス	3.9	4.4	8,571
パローホールディングス	4.4	4.8	9,230
藤久	0.2	0.2	125
ベルク	1	1.1	6,314
大庄	1.1	1.2	1,296
ファーストリテイリング	2.7	2.9	128,151
サンドラッグ	7.7	8.2	28,372
サックスパーホールディングス	1.7	1.8	1,103
ヤマザワ	0.4	0.5	789
やまや	0.4	0.4	805
ベルーナ	5	4.7	2,260
銀行業(5.2%)			
島根銀行	0.4	0.4	177
じもとホールディングス	13.9	14.7	1,337
めぶきフィナンシャルグループ	106.9	113.1	24,882
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.8	2.9	3,308
九州フィナンシャルグループ	33.8	35.7	14,744
ゆうちょ銀行	58.3	61.7	61,514
富山第一銀行	4.9	5.2	1,528
コンコルディア・フィナンシャルグループ	131.1	128	40,320
西日本フィナンシャルホールディングス	13.2	14.8	9,028
関西みらいフィナンシャルグループ	9.7	12.8	4,979
三十三フィナンシャルグループ	1.8	2	2,984
第四北越フィナンシャルグループ	3.6	3.8	8,979
新生銀行	15.1	16	23,072
あおぞら銀行	11.5	13	26,806
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,416.8	1,489.2	600,147
りそなホールディングス	225.9	238.9	77,690
三井住友トラスト・ホールディングス	40.5	41.1	128,396
三井住友フィナンシャルグループ	145.1	150.6	395,023
千葉銀行	72.9	72.7	34,387
群馬銀行	41.2	42.8	14,038
武蔵野銀行	3.1	3.2	4,403

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
千葉興業銀行	5.6	6	1,518
筑波銀行	8.6	9.1	1,547
七十七銀行	6.5	7.4	10,352
青森銀行	1.6	1.7	4,447
秋田銀行	1.3	1.4	2,175
山形銀行	2.3	2.4	3,213
岩手銀行	1.4	1.4	3,749
東邦銀行	18.4	19.5	5,265
東北銀行	1	1	873
みちのく銀行	1.3	1.4	1,670
ふくおかフィナンシャルグループ	18.144	18.3	26,187
静岡銀行	51.8	53.9	35,412
十六銀行	2.8	2.7	5,089
スルガ銀行	21.1	22.3	7,894
八十二銀行	37.3	52.5	20,527
山梨中央銀行	2.5	2.5	1,840
大垣共立銀行	3.3	4.3	9,352
福井銀行	1.8	1.9	2,880
北國銀行	2.2	2.2	7,414
清水銀行	0.8	0.9	1,662
富山銀行	0.4	0.4	744
滋賀銀行	4.1	4.4	11,299
南都銀行	2.4	3.6	8,028
百五銀行	18.5	19.6	5,919
京都銀行	7.4	7.8	26,832
紀陽銀行	7.3	7.7	12,289
ほくほくフィナンシャルグループ	13.7	14.5	14,036
広島銀行	30.4	32.1	14,477
山陰合同銀行	12.2	12.9	7,056
中国銀行	13.3	18.7	18,008
鳥取銀行	0.7	0.7	784
伊予銀行	27.3	31.1	17,011
百十四銀行	2.2	2.3	4,510
四国銀行	2.9	3.3	2,814
阿波銀行	3.3	3.6	8,215
大分銀行	1.3	1.3	2,479
宮崎銀行	1.4	1.5	3,577
佐賀銀行	1.2	1.3	1,492
沖縄銀行	1.9	2	6,310
琉球銀行	4.7	5	5,300
セブン銀行	69.5	72.7	20,283
みずほフィナンシャルグループ	2,796.8	2,958.1	365,621
高知銀行	0.7	0.8	507
山口フィナンシャルグループ	25.7	27.2	16,646
長野銀行	0.7	0.7	786
名古屋銀行	1.7	1.8	4,705
北洋銀行	31	32.8	6,691
愛知銀行	0.7	0.8	2,540
中京銀行	0.8	0.9	1,952
大光銀行	0.7	0.7	1,012
愛媛銀行	2.9	3	3,519
トマト銀行	0.8	0.8	836
京葉銀行	9.1	9.3	4,966
栃木銀行	10.7	10.5	1,627
北日本銀行	0.6	0.7	1,376
東和銀行	3.6	3.8	2,390
福島銀行	1.8	2	318
大東銀行	1	1.1	625

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トモニホールディングス	15.9	16.8	6,031
フィデアホールディングス	20	21.1	2,152
池田泉州ホールディングス	21.8	25	4,075
証券、商品先物取引業(0.8%)			
F P G	6.5	6.7	3,658
マーキュリアインベストメント	0.8	1	541
S B Iホールディングス	24.5	24.3	38,345
日本アジア投資	1.7	1.8	318
ジャフコ	3.4	3.3	9,292
大和証券グループ本社	165.2	174.7	73,234
野村ホールディングス	362.1	383	175,337
岡三証券グループ	17.5	18.5	6,327
丸三証券	6.1	6.5	2,944
東洋証券	7.4	7.8	1,029
東海証券フィナンシャル・ホールディングス	24.5	25	6,150
光世証券	0.5	0.5	262
水戸証券	6	6.3	1,197
いちよし証券	4.3	4.1	1,828
松井証券	10.1	12.4	9,833
だいこう証券ビジネス	0.8	1.1	598
マネックスグループ	19.2	16.4	2,804
カブドットコム証券	15.4	—	—
極東証券	2.8	2.9	1,687
岩井コスモホールディングス	2.1	2.1	1,976
藍澤証券	3.7	3.9	2,940
マネーパートナーズグループ	2.4	2.3	427
スパークス・グループ	—	7.5	1,245
小林洋行	0.6	0.6	135
保険業(2.2%)			
かんぽ生命保険	7.8	7.7	10,325
SOMPOホールディングス	36.3	40.9	136,728
アニコムホールディングス	1.7	1.8	6,453
MS&ADインシュアランスグループホール	53.8	56.9	172,122
ソニーフィナンシャルホールディングス	16.9	17.9	32,703
第一生命ホールディングス	116.4	123.2	159,605
東京海上ホールディングス	74.6	77.8	385,110
T&Dホールディングス	63.7	65.1	57,548
アドバンスクリエイト	0.5	0.5	840
その他金融業(1.1%)			
全国保証	5.8	6.1	20,709
ジェイリース	0.4	0.6	139
イントラスト	0.6	0.8	424
日本モーゲージサービス	0.3	0.4	700
C a s a	0.7	0.8	736
アルヒ	1.9	3.5	4,287
プレミアグループ	0.9	1.2	1,945
クレディセゾン	14.4	15.2	19,091
芙蓉総合リース	2.4	2.3	12,604
みずほリース	3.9	3.4	7,163
東京センチュリー	4.1	4.4	14,894
日本証券金融	9.1	9.6	4,732
アイフル	31.4	33.2	8,034
リコーリース	1.6	1.7	4,833
イオンフィナンシャルサービス	13.1	13.3	15,401
アコム	41.4	43.8	19,228
ジャックス	2.3	2.4	4,401
オリエントコーポレーション	55.7	58.9	7,126
日立キャピタル	4.9	5.1	10,388

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アプラスフィナンシャル	9.9	10.4	624
オリックス	137.3	136.2	177,128
三菱UFJリース	46.4	55.2	29,366
九州リースサービス	1	1.1	488
日本取引所グループ	55.6	62.5	119,125
イー・ギャランティ	1.9	2.3	3,636
アサックス	0.9	1.1	643
NECキャピタルソリューション	0.8	0.9	1,656
不動産業(2.1%)			
いちご	26.2	27.7	6,925
日本駐車場開発	24.8	23.9	3,226
スター・マイカ・ホールディングス	—	1.1	1,618
ヒューリック	43	46.5	51,057
三栄建築設計	0.8	0.9	1,070
スター・マイカ	0.9	—	—
野村不動産ホールディングス	13.7	13.2	23,166
三重交通グループホールディングス	4.2	4.4	2,239
サムティ	2.8	3.1	3,729
ディア・ライフ	2.6	2.8	1,086
コーセーアールイー	0.6	0.6	276
エー・ディー・ワークス	31.7	40.4	808
日本商業開発	1.3	1.4	1,873
プレサンスコーポレーション	3.3	3.6	3,430
ユニゾホールディングス	3.1	3.3	19,701
T H E グローバル社	1.1	1	302
ハウスコム	—	0.3	355
日本管理センター	1.4	1.4	1,491
サンセイランディック	0.5	0.6	385
エストラスト	0.3	0.3	162
フージャースホールディングス	4.5	4.3	2,567
オープンハウス	3.4	6.3	14,017
東急不動産ホールディングス	55.4	59.2	30,665
飯田グループホールディングス	17.2	18.2	27,245
イーグランド	0.3	0.3	184
ムゲンエステート	1.4	1.5	630
ビーロット	0.3	1	616
ファーストブラザーズ	0.6	0.5	353
ハウスドゥ	1.1	1.1	775
シーアールイー	0.7	0.5	537
プロパティエージェント	0.2	0.3	243
ケイアイスター不動産	0.6	0.7	788
アグレ都市デザイン	0.2	0.4	170
グッドコムアセット	0.4	0.5	623
ジェイ・エス・ビー	0.1	0.2	866
テンポイノベーション	0.2	0.5	327
グローバル・リンク・マネジメント	0.1	0.4	228
パーク24	12	11.7	18,614
パラカ	0.5	0.6	1,003
三井不動産	109.2	107.4	200,891
三菱地所	144.2	152.5	243,237
平和不動産	3.9	4	11,196
東京建物	22.5	22.9	26,266
ダイビル	6.1	5.6	4,995
京阪神ビルディング	3.7	3.5	4,676
住友不動産	46.3	48.9	128,851
テーオーシー	4.7	4.3	2,524
東京楽天地	0.3	0.4	1,628
レオパレス21	25.4	28.5	7,581

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スターツコーポレーション	2.8	3	6,015
フジ住宅	2.6	2.5	1,285
空港施設	2.4	2.2	884
明和地所	1.1	1.2	574
ゴールドクレスト	1.6	1.7	2,760
エスリード	0.8	0.8	1,116
日神グループホールディングス	3	3.2	1,264
日本エスコン	3.7	3.9	2,324
タカラレーベン	9.6	10	3,490
AVANTIA	1.2	1.2	705
イオンモール	10.3	10.9	14,856
毎日コムネット	0.4	0.6	471
ファースト住建	0.8	0.9	889
カチタス	2.3	5.4	9,369
トーセイ	2.8	3	2,793
穴吹興産	0.2	0.5	687
サンフロンティア不動産	2.8	3	2,460
エフ・ジェー・ネクスト	1.8	1.9	1,554
インテリックス	0.6	0.6	294
ランドビジネス	1	0.9	228
日本社宅サービス	—	0.5	441
グランディハウス	1.8	1.7	610
日本空港ビルデング	6.6	6.9	28,807
サービス業(4.9%)			
日本工営	1.3	1.4	4,113
LIFULL	7.7	7.4	2,249
ジェイエイシールートメント	1.6	1.4	1,422
日本M&Aセンター	14.9	15.9	46,984
メンバーズ	0.7	0.6	811
中広	0.2	0.2	86
UTグループ	—	2.5	2,775
アイティメディア	—	0.6	450
タケエイ	2.1	2	1,558
E・Jホールディングス	0.2	0.4	518
ビーネックスグループ	1.1	2.6	1,328
コシダカホールディングス	5.3	5.1	1,871
アルトナー	0.4	0.5	313
パソナグループ	2.4	2.3	1,978
CDS	0.5	0.5	567
リンクアンドモチベーション	3.7	4.6	1,407
GCA	2	2.5	1,407
エス・エム・エス	7.3	6.6	13,813
サニーサイドアップグループ	0.2	0.5	288
パーソルホールディングス	19.9	21.1	22,914
リニカル	1.1	1	817
クックパッド	6.3	7.4	2,220
エスクリ	0.5	0.7	257
アイ・ケイ・ケイ	1	1	624
学情	0.8	0.7	907
スタジオアリス	1	1.1	1,623
シミックホールディングス	1.1	1.2	1,724
エプコ	—	0.3	248
NJS	0.4	0.5	822
総合警備保障	7.9	8.4	44,184
カカコム	14.9	15.6	30,966
セントケア・ホールディング	1.1	1.4	530
サイネックス	0.3	0.4	236
ルネサンス	1.1	1.2	1,208

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ディップ	3.2	3	5,214
オプトホールディング	1.2	1.1	1,514
新日本科学	2.7	2.3	1,214
ツクイ	4.7	5	2,065
キャリアデザインセンター	0.5	0.5	380
ベネフィット・ワン	5.5	5.8	8,178
エムスリー	42	46.5	148,567
ツカダ・グローバルホールディング	1.3	1.3	442
プラス	0.1	0.2	83
アウトソーシング	10.5	12.1	5,687
ウェルネット	1.9	2.1	991
ワールドホールディングス	0.5	0.7	860
ディー・エヌ・エー	10.7	10.3	12,174
博報堂DYホールディングス	27.7	29.3	31,937
ぐるなび	2.8	3.7	2,053
タカミヤ	2.1	2.2	926
ジャパンベストレスキューシステム	1.6	1.4	854
ファンコミュニケーションズ	5.5	5.8	2,407
ライク	0.8	0.7	982
ビジネス・ブレークスルー	0.8	0.9	307
エスプール	—	4.1	2,255
WDBホールディングス	0.9	1	2,107
ティア	1	1.2	604
CDG	0.2	0.2	276
バリューコマース	1.3	1.2	2,136
インフォマート	10.9	23.1	16,424
J Pホールディングス	5.7	6.6	1,709
EPSホールディングス	3	3.2	3,612
レッグス	0.5	0.5	423
プレステージ・インターナショナル	3.7	7.9	6,549
アミューズ	1.2	1.1	2,501
ドリームインキュベータ	0.6	0.6	585
クイック	1.2	1.3	1,279
TAC	1.1	1.3	208
ケネディクス	17.5	19.7	8,077
電通グループ	24.3	21.7	45,287
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.8	0.8	446
びあ	0.6	0.6	1,338
イオンファンタジー	0.6	0.8	1,164
シーティーエス	2.2	2.4	1,315
ネクシーズグループ	0.6	0.7	683
みらかホールディングス	5.6	5.9	13,440
アルプス技研	1.7	1.9	2,770
ダイオーズ	0.5	0.4	412
日本空調サービス	2.3	2.2	1,487
オリエンタルランド	23.6	22.4	309,568
ダスキン	5.4	5.4	15,341
明光ネットワークジャパン	2.5	2.5	1,905
ファルコホールディングス	1.1	1.2	2,125
秀英予備校	0.4	0.5	200
田谷	0.4	0.4	224
ラウンドワン	6.2	5.9	3,315
リゾートトラスト	8.4	9.7	10,243
ビー・エム・エル	2.6	2.7	7,846
ワタベウエディング	0.3	0.3	104
りらいあコミュニケーションズ	3.6	3.8	3,971
リソー教育	10.1	9.6	2,745
早稲田アカデミー	0.6	0.7	638

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ユー・エス・エス	24.4	23.6	35,069
東京個別指導学院	0.7	0.7	318
サイバーエージェント	12.3	12.1	50,699
楽天	92.9	98.3	80,606
クリーク・アンド・リバー社	1.2	1.1	825
テー・オー・ダブリュー	1.7	3.4	921
山田コンサルティンググループ	1	1	953
セントラルスポーツ	0.7	0.8	1,833
フルキャストホールディングス	2	2.1	2,595
エン・ジャパン	2.2	3.7	7,481
リゾルホールディングス	0.2	0.2	675
テクノプロ・ホールディングス	4	4.2	21,294
アトラ	0.4	0.5	106
インターワークス	0.4	0.4	154
アイ・アルジャパンホールディングス	0.6	0.9	5,220
Keepers 技研	0.7	0.8	1,132
ファーストロジック	0.4	0.5	290
三機サービス	0.4	0.4	393
Gunosy	1.4	1.3	1,124
デザインワン・ジャパン	0.4	0.4	69
イー・ガーディアン	0.9	1.1	1,714
リブセンス	1.1	1.4	351
ジャパンマテリアル	5.5	6.5	9,223
ベクトル	2.4	2.6	1,692
ウチヤマホールディングス	1	1	321
チャム・ケア・コーポレーション	0.5	1.8	1,375
ライクキッズ	0.5	0.4	195
キャリアリンク	0.7	0.7	266
I B J	1.3	1.4	693
アサンテ	0.8	0.8	1,217
N・フィールド	1.3	1.4	525
バリューHR	0.4	0.8	1,090
M&Aキャピタルパートナーズ	0.5	1.5	3,859
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.8	0.8	1,068
ERIホールディングス	0.6	0.6	366
アビスト	0.3	0.3	525
シグマクシス	0.9	1.4	1,740
ウィルグループ	1.3	1.4	792
エスクロ・エージェント・ジャパン	2.7	2.9	443
日本ビューホテル	0.6	—	—
リクルートホールディングス	142.8	151.1	422,475
エラン	1.4	1.2	1,734
土木管理総合試験所	0.9	0.9	301
ネットマーケティング	—	0.6	330
日本郵政	163.4	172.9	146,221
ベルシステム24ホールディングス	3.3	3.5	3,944
鎌倉新書	1.5	1.6	1,699
SMN	—	0.3	176
一蔵	0.2	0.2	77
LITALICO	0.5	0.7	1,465
グローバルキッズCOMPANY	0.2	0.3	150
エアトリ	0.6	0.9	646
アトラエ	0.4	0.5	1,289
ストライク	0.5	0.8	2,816
ソラスト	4.9	5.8	5,823
セラク	0.4	0.7	473
インソース	0.7	1	2,422
ペイカレント・コンサルティング	1.1	1.3	6,578

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
Orchestra Holdings	0.3	0.4	304
アイモバイル	0.5	0.6	321
キャリアインデックス	0.7	0.9	247
MS-Japan	0.8	0.7	443
船場	0.3	0.3	266
グレイステクノロジー	0.5	1	2,555
ジャパンエレベーターサービスホールディング	1.2	2.2	5,460
フルテック	0.2	0.3	378
グリーンズ	0.6	0.5	189
ツナググループ・ホールディングス	0.2	0.3	104
GameWith	—	0.5	223
ソウルドアウト	—	0.3	581
MS&Consulting	0.3	0.3	146
ミダック	—	0.2	180
日総工産	0.5	1.4	611
キュービーネットホールディングス	0.9	0.9	1,449
RPAホールディングス	—	1.2	900
スプリックス	0.6	0.7	448
マネジメントソリューションズ	—	0.7	619
and factory	—	0.2	220
カーブスホールディングス	—	5.2	2,667
アドバンテッジリスクマネジメント	0.8	1.1	662
リロググループ	10.9	11.5	26,070
東祥	1.2	1.3	1,290
エイチ・アイ・エス	3.6	3.3	4,662
ラックランド	0.4	0.5	778
共立メンテナンス	3	3.5	8,344
イチネンホールディングス	2.1	2.4	2,755
建設技術研究所	1.4	1.5	2,512
スペース	1.3	1.4	1,527
長大	0.8	0.8	634
燦ホールディングス	0.4	0.9	1,073
スバル興業	0.1	0.1	782
東京テアトル	0.8	0.8	912
タナベ経営	0.4	0.4	496
ナガワ	0.6	0.7	4,809
よみうりランド	0.4	0.5	1,645
東京都競馬	1.3	1.4	3,913
常磐興産	0.8	0.8	1,098
カナモト	3	3.5	7,360
東京ドーム	7.5	8.5	6,154
西尾レントオール	2	2.1	4,760
トランス・コスモス	2.2	2	3,828
乃村工藝社	4.7	9	7,380
藤田観光	0.8	0.9	1,403
KNT-CTホールディングス	1.1	1.3	941
日本管財	2.1	2.3	4,068
トーカイ	1.9	2	5,874
白洋舎	0.2	0.2	536
セコム	21.2	22.4	201,017
セントラル警備保障	1	1	3,900
丹青社	3.8	4	2,912
メイテック	2.5	2.6	11,180
応用地質	2.1	2.3	2,826
船井総研ホールディングス	4.1	4.4	9,446
進学会ホールディングス	0.9	0.8	354
オオバ	1.6	1.5	760
いであ	0.4	0.4	548

銘柄	期首 (前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
学究社	0.7	0.6	693
ベネッセホールディングス	7.3	7	19,257
イオンディライト	2.5	2.6	8,593
ナック	1.3	1.2	945
ニチイ学館	2.8	3	3,102
ダイセキ	3.3	3.5	8,050
ステップ	0.7	0.8	1,148
合計	株数・金額 24,274	25,937	43,572,977
	銘柄数<比率> 2,110銘柄	2,146銘柄	<97.2%>

(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。

(注2) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注4) ー印は組み入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
TOPIX	1,234	ー

(注1) 単位未満は切り捨て。ただし、金額が単位未満の場合は小数で記載。

(注2) ー印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成(2020年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 43,572,977	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,387,420	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	44,960,397	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	44,960,397,684円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	636,636,736
株 式(評価額)	43,572,977,580
未 収 入 金	49,709,134
未 収 配 当 金	579,204,104
前 払 金	25,510,130
差 入 委 託 証 拠 金	96,360,000
(B) 負 債	127,415,494
未 払 金	89,612,311
未 払 解 約 金	37,800,000
未 払 利 息	1,831
そ の 他 未 払 費 用	1,352
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	44,832,982,190
元 本	29,562,431,909
次 期 繰 越 損 益 金	15,270,550,281
(D) 受 益 権 総 口 数	29,562,431,909口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	15,166円

(注1) 当ファンドの期首元本額は28,908,555,626円、期中追加設定元本額は4,172,526,553円、期中一部解約元本額は3,518,650,270円です。

(注2) 元本の内訳

日立国内株式インデックスファンド	11,315,925,709円
日立国内株式TOPIXインデックスファンド(非課税適格機関投資家専用)	7,219,366,450円
日立バランスファンド(株式70)	5,662,824,236円
日立バランスファンド(株式50)	4,239,472,402円
日立バランスファンド(株式30)	1,124,843,112円

(注3) 1口当たり純資産額は1,5166円です。

■損益の状況

当期(自2019年4月2日 至2020年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,271,596,697円
受 取 配 当 金	1,271,578,911
そ の 他 収 益 金	740,563
支 払 利 息	△722,777
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,325,514,217
売 買 益	2,505,493,094
売 買 損	△8,831,007,311
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△119,372,139
取 引 益	100,300,019
取 引 損	△219,672,158
(D) 信 託 報 酬 等	△8,775
(E) 当 期 損 益 金 (A + B + C + D)	△5,173,298,434
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	20,260,596,928
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,544,307,461
(H) 解 約 差 損 益 金	△2,361,055,674
(I) 計 (E + F + G + H)	15,270,550,281
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	15,270,550,281

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

(注2) 損益の状況の中で(D)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) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

日立国内債券インデックスマザーファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	円	騰落率			
16期(2016年3月31日)	13,974	5.4	99.6	—	122,106
17期(2017年3月31日)	13,813	△1.2	100.2	—	102,643
18期(2018年4月2日)	13,944	0.9	99.8	—	92,283
19期(2019年4月1日)	14,186	1.7	99.5	—	97,559
20期(2020年3月31日)	14,183	△0.0	100.2	—	98,352

(注) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合指数		債券組入比率	債券先物比率
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2019年4月1日	14,186	—	388.52	—	99.5	—
4月末	14,162	△0.2	387.94	△0.1	99.5	—
5月末	14,252	0.5	390.32	0.5	99.1	—
6月末	14,337	1.1	392.69	1.1	99.4	—
7月末	14,354	1.2	393.15	1.2	98.6	—
8月末	14,545	2.5	398.50	2.6	99.4	—
9月末	14,391	1.4	394.27	1.5	99.2	—
10月末	14,336	1.1	392.61	1.1	99.5	—
11月末	14,287	0.7	391.33	0.7	99.3	—
12月末	14,245	0.4	390.14	0.4	99.2	—
2020年1月末	14,305	0.8	391.77	0.8	99.1	—
2月末	14,416	1.6	394.74	1.6	99.3	—
(期末) 2020年3月31日	14,183	△0.0	388.45	△0.0	100.2	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項目	当期
	(2019.4.2～2020.3.31)
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)
合計	0

(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。

(a) その他費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

国内		買付額	売付額
		千円	千円
	国債証券	16,970,665	15,829,252
	地方債証券	960,671	958,329
	特殊債証券	1,938,184	922,530 (121,195)
	社債証券	1,330,171	812,859

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は償還等による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債証券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■主要な売買銘柄 (2019年4月2日から2020年3月31日まで)

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第138回 利付国債(5年)	916,038	第127回 利付国債(5年)	1,103,780
第402回 利付国債(2年)	805,616	第312回 利付国債(10年)	912,807
第357回 利付国債(10年)	743,054	第125回 利付国債(5年)	803,011
第356回 利付国債(10年)	713,077	第124回 利付国債(5年)	752,115
第141回 利付国債(5年)	659,729	第310回 利付国債(10年)	739,723
第350回 利付国債(10年)	596,520	第308回 利付国債(10年)	670,150
第354回 利付国債(10年)	594,575	第126回 利付国債(5年)	651,839
第140回 利付国債(5年)	582,745	第133回 利付国債(5年)	606,918
第142回 利付国債(5年)	559,531	第101回 利付国債(20年)	377,294
第32回 利付国債(30年)	550,171	第314回 利付国債(10年)	375,083

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等 (2019年4月2日から2020年3月31日まで)

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	期末保有額
公 社 債	千円 100,099	千円 0	千円 97,121

(注1) 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。

(注2) 当期買付額及び当期売付額は、受渡代金、当期末保有額は評価額です。

(注3) 当ファンドに係る利害関係人とは、日立キャピタルです。

■組入資産の明細 (2020年3月31日現在)

公社債

(A) 債券種類別開示

国内(邦貨建)公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	69,995,000 (1,220,000)	77,504,348 (1,452,180)	78.8 (1.5)	— (—)	55.6 (1.4)	15.8 (0.1)	7.4 (—)
地 方 債 証 券	6,428,000 (6,428,000)	6,720,652 (6,720,652)	6.8 (6.8)	— (—)	3.5 (3.5)	3.0 (3.0)	0.3 (0.3)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	7,926,041 (7,913,641)	8,354,716 (8,341,977)	8.5 (8.5)	— (—)	4.5 (4.5)	3.4 (3.4)	0.5 (0.5)
金 融 債 証 券	500,000 (500,000)	498,592 (498,592)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債)	5,400,000 (5,400,000)	5,496,393 (5,496,393)	5.6 (5.6)	— (—)	2.3 (2.3)	2.3 (2.3)	0.9 (0.9)
合 計	90,249,041 (21,461,641)	98,574,702 (22,509,796)	100.2 (22.9)	— (—)	65.9 (11.7)	25.1 (9.3)	9.2 (1.8)

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) ー印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注6) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアクムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

(B) 個別銘柄開示

国内(邦貨建)公社債銘柄別

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第402回 利付国債(2年)	0.1	800,000	802,400	2021/ 7/ 1
第404回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,668	2021/ 9/ 1
第128回 利付国債(5年)	0.1	560,000	561,568	2021/ 6/20
第129回 利付国債(5年)	0.1	800,000	802,768	2021/ 9/20
第130回 利付国債(5年)	0.1	300,000	301,215	2021/12/20
第131回 利付国債(5年)	0.1	420,000	421,986	2022/ 3/20
第132回 利付国債(5年)	0.1	350,000	351,907	2022/ 6/20
第133回 利付国債(5年)	0.1	350,000	352,170	2022/ 9/20
第134回 利付国債(5年)	0.1	490,000	493,341	2022/12/20
第135回 利付国債(5年)	0.1	420,000	423,129	2023/ 3/20
第136回 利付国債(5年)	0.1	140,000	141,086	2023/ 6/20
第137回 利付国債(5年)	0.1	100,000	100,802	2023/ 9/20
第138回 利付国債(5年)	0.1	900,000	907,398	2023/12/20
第139回 利付国債(5年)	0.1	300,000	302,628	2024/ 3/20
第140回 利付国債(5年)	0.1	370,000	373,448	2024/ 6/20
第141回 利付国債(5年)	0.1	650,000	656,422	2024/ 9/20
第142回 利付国債(5年)	0.1	550,000	555,610	2024/12/20
第120回 利付国債(20年)	1.6	100,000	115,877	2030/ 6/20
第121回 利付国債(20年)	1.9	280,000	333,782	2030/ 9/20
第122回 利付国債(20年)	1.8	60,000	70,900	2030/ 9/20
第133回 利付国債(20年)	1.8	200,000	238,696	2031/12/20
第148回 利付国債(20年)	1.5	440,000	516,313	2034/ 3/20
第 1回 利付国債(40年)	2.4	180,000	274,347	2048/ 3/20
第 2回 利付国債(40年)	2.2	160,000	237,849	2049/ 3/20
第 3回 利付国債(40年)	2.2	130,000	195,228	2050/ 3/20
第 4回 利付国債(40年)	2.2	180,000	273,036	2051/ 3/20
第 5回 利付国債(40年)	2.0	190,000	279,729	2052/ 3/20
第 6回 利付国債(40年)	1.9	180,000	261,689	2053/ 3/20
第 7回 利付国債(40年)	1.7	150,000	210,516	2054/ 3/20
第 8回 利付国債(40年)	1.4	200,000	262,966	2055/ 3/20
第 9回 利付国債(40年)	0.4	620,000	614,203	2056/ 3/20
第10回 利付国債(40年)	0.9	300,000	347,745	2057/ 3/20
第11回 利付国債(40年)	0.8	200,000	225,624	2058/ 3/20
第12回 利付国債(40年)	0.5	100,000	102,336	2059/ 3/20
第315回 利付国債(10年)	1.2	700,000	711,368	2021/ 6/20
第316回 利付国債(10年)	1.1	400,000	406,004	2021/ 6/20
第317回 利付国債(10年)	1.1	630,000	641,421	2021/ 9/20
第318回 利付国債(10年)	1.0	400,000	406,660	2021/ 9/20
第319回 利付国債(10年)	1.1	300,000	306,363	2021/12/20
第320回 利付国債(10年)	1.0	710,000	723,830	2021/12/20
第321回 利付国債(10年)	1.0	400,000	408,952	2022/ 3/20
第322回 利付国債(10年)	0.9	200,000	204,082	2022/ 3/20
第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	204,630	2022/ 6/20
第324回 利付国債(10年)	0.8	360,000	367,531	2022/ 6/20
第325回 利付国債(10年)	0.8	900,000	921,087	2022/ 9/20
第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	306,879	2022/12/20
第327回 利付国債(10年)	0.8	650,000	666,685	2022/12/20
第328回 利付国債(10年)	0.6	760,000	776,750	2023/ 3/20
第329回 利付国債(10年)	0.8	590,000	607,735	2023/ 6/20
第330回 利付国債(10年)	0.8	700,000	722,694	2023/ 9/20
第331回 利付国債(10年)	0.6	300,000	307,635	2023/ 9/20
第332回 利付国債(10年)	0.6	750,000	770,175	2023/12/20
第333回 利付国債(10年)	0.6	630,000	648,074	2024/ 3/20
第334回 利付国債(10年)	0.6	510,000	525,682	2024/ 6/20
第335回 利付国債(10年)	0.5	200,000	205,666	2024/ 9/20
第336回 利付国債(10年)	0.5	100,000	102,992	2024/12/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第337回 利付国債(10年)	0.3	100,000	102,018	2024/12/20
第338回 利付国債(10年)	0.4	360,000	369,446	2025/ 3/20
第339回 利付国債(10年)	0.4	400,000	411,140	2025/ 6/20
第340回 利付国債(10年)	0.4	420,000	432,264	2025/ 9/20
第341回 利付国債(10年)	0.3	590,000	604,620	2025/12/20
第342回 利付国債(10年)	0.1	550,000	557,436	2026/ 3/20
第343回 利付国債(10年)	0.1	720,000	730,152	2026/ 6/20
第344回 利付国債(10年)	0.1	750,000	761,257	2026/ 9/20
第345回 利付国債(10年)	0.1	720,000	731,469	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	710,000	721,984	2027/ 3/20
第347回 利付国債(10年)	0.1	380,000	386,790	2027/ 6/20
第348回 利付国債(10年)	0.1	520,000	529,422	2027/ 9/20
第349回 利付国債(10年)	0.1	650,000	661,401	2027/12/20
第350回 利付国債(10年)	0.1	800,000	813,176	2028/ 3/20
第351回 利付国債(10年)	0.1	440,000	446,921	2028/ 6/20
第352回 利付国債(10年)	0.1	550,000	558,200	2028/ 9/20
第353回 利付国債(10年)	0.1	590,000	598,271	2028/12/20
第354回 利付国債(10年)	0.1	580,000	587,302	2029/ 3/20
第355回 利付国債(10年)	0.1	500,000	505,775	2029/ 6/20
第356回 利付国債(10年)	0.1	420,000	424,174	2029/ 9/20
第357回 利付国債(10年)	0.1	480,000	484,190	2029/12/20
第 1回 利付国債(30年)	2.8	40,000	50,583	2029/ 9/20
第 4回 利付国債(30年)	2.9	200,000	259,904	2030/11/20
第 5回 利付国債(30年)	2.2	5,000	6,163	2031/ 5/20
第 6回 利付国債(30年)	2.4	70,000	88,318	2031/11/20
第 8回 利付国債(30年)	1.8	45,000	54,112	2032/11/22
第11回 利付国債(30年)	1.7	135,000	161,285	2033/ 6/20
第12回 利付国債(30年)	2.1	90,000	112,504	2033/ 9/20
第13回 利付国債(30年)	2.0	70,000	86,767	2033/12/20
第14回 利付国債(30年)	2.4	120,000	155,659	2034/ 3/20
第18回 利付国債(30年)	2.3	100,000	129,856	2035/ 3/20
第19回 利付国債(30年)	2.3	110,000	143,270	2035/ 6/20
第20回 利付国債(30年)	2.5	300,000	400,839	2035/ 9/20
第21回 利付国債(30年)	2.3	100,000	131,008	2035/12/20
第22回 利付国債(30年)	2.5	200,000	269,092	2036/ 3/20
第23回 利付国債(30年)	2.5	180,000	243,127	2036/ 6/20
第24回 利付国債(30年)	2.5	200,000	270,974	2036/ 9/20
第25回 利付国債(30年)	2.3	260,000	344,988	2036/12/20
第26回 利付国債(30年)	2.4	180,000	242,595	2037/ 3/20
第27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	439,424	2037/ 9/20
第28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	414,993	2038/ 3/20
第29回 利付国債(30年)	2.4	290,000	398,674	2038/ 9/20
第30回 利付国債(30年)	2.3	280,000	382,211	2039/ 3/20
第31回 利付国債(30年)	2.2	220,000	298,544	2039/ 9/20
第32回 利付国債(30年)	2.3	530,000	733,138	2040/ 3/20
第33回 利付国債(30年)	2.0	240,000	319,612	2040/ 9/20
第34回 利付国債(30年)	2.2	300,000	413,661	2041/ 3/20
第35回 利付国債(30年)	2.0	320,000	430,166	2041/ 9/20
第36回 利付国債(30年)	2.0	330,000	445,615	2042/ 3/20
第37回 利付国債(30年)	1.9	380,000	507,459	2042/ 9/20
第38回 利付国債(30年)	1.8	250,000	329,865	2043/ 3/20
第39回 利付国債(30年)	1.9	180,000	241,990	2043/ 6/20
第40回 利付国債(30年)	1.8	150,000	198,682	2043/ 9/20
第41回 利付国債(30年)	1.7	270,000	352,144	2043/12/20
第42回 利付国債(30年)	1.7	200,000	261,146	2044/ 3/20
第43回 利付国債(30年)	1.7	280,000	366,438	2044/ 6/20
第44回 利付国債(30年)	1.7	130,000	170,326	2044/ 9/20
第45回 利付国債(30年)	1.5	250,000	316,490	2044/12/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第 46回 利付国債(30年)	1.5	320,000	405,424	2045/ 3/20
第 47回 利付国債(30年)	1.6	200,000	258,532	2045/ 6/20
第 48回 利付国債(30年)	1.4	200,000	249,110	2045/ 9/20
第 49回 利付国債(30年)	1.4	220,000	274,183	2045/12/20
第 50回 利付国債(30年)	0.8	300,000	329,778	2046/ 3/20
第 51回 利付国債(30年)	0.3	240,000	234,026	2046/ 6/20
第 52回 利付国債(30年)	0.5	260,000	266,221	2046/ 9/20
第 53回 利付国債(30年)	0.6	300,000	314,484	2046/12/20
第 54回 利付国債(30年)	0.8	320,000	351,584	2047/ 3/20
第 55回 利付国債(30年)	0.8	300,000	329,859	2047/ 6/20
第 56回 利付国債(30年)	0.8	300,000	330,108	2047/ 9/20
第 57回 利付国債(30年)	0.8	260,000	286,306	2047/12/20
第 58回 利付国債(30年)	0.8	300,000	330,183	2048/ 3/20
第 59回 利付国債(30年)	0.7	250,000	268,675	2048/ 6/20
第 60回 利付国債(30年)	0.9	260,000	293,228	2048/ 9/20
第 61回 利付国債(30年)	0.7	210,000	225,647	2048/12/20
第 62回 利付国債(30年)	0.5	210,000	214,613	2049/ 3/20
第 63回 利付国債(30年)	0.4	290,000	288,489	2049/ 6/20
第 64回 利付国債(30年)	0.4	230,000	228,792	2049/ 9/20
第 65回 利付国債(30年)	0.4	220,000	218,836	2049/12/20
第 51回 利付国債(20年)	2.0	30,000	30,783	2021/ 6/21
第 52回 利付国債(20年)	2.1	65,000	67,145	2021/ 9/21
第 53回 利付国債(20年)	2.1	60,000	62,307	2021/12/20
第 54回 利付国債(20年)	2.2	110,000	114,418	2021/12/20
第 55回 利付国債(20年)	2.0	100,000	104,206	2022/ 3/21
第 56回 利付国債(20年)	2.0	230,000	240,929	2022/ 6/20
第 57回 利付国債(20年)	1.9	130,000	135,887	2022/ 6/20
第 59回 利付国債(20年)	1.7	100,000	105,024	2022/12/20
第 60回 利付国債(20年)	1.4	100,000	104,205	2022/12/20
第 61回 利付国債(20年)	1.0	140,000	144,754	2023/ 3/20
第 62回 利付国債(20年)	0.8	230,000	236,913	2023/ 6/20
第 63回 利付国債(20年)	1.8	400,000	424,956	2023/ 6/20
第 64回 利付国債(20年)	1.9	160,000	171,294	2023/ 9/20
第 65回 利付国債(20年)	1.9	230,000	247,316	2023/12/20
第 66回 利付国債(20年)	1.8	80,000	85,724	2023/12/20
第 68回 利付国債(20年)	2.2	175,000	191,143	2024/ 3/20
第 69回 利付国債(20年)	2.1	120,000	130,592	2024/ 3/20
第 70回 利付国債(20年)	2.4	150,000	166,029	2024/ 6/20
第 71回 利付国債(20年)	2.2	100,000	109,838	2024/ 6/20
第 72回 利付国債(20年)	2.1	290,000	319,011	2024/ 9/20
第 75回 利付国債(20年)	2.1	110,000	122,202	2025/ 3/20
第 76回 利付国債(20年)	1.9	240,000	264,223	2025/ 3/20
第 78回 利付国債(20年)	1.9	190,000	210,212	2025/ 6/20
第 79回 利付国債(20年)	2.0	100,000	111,163	2025/ 6/20
第 80回 利付国債(20年)	2.1	180,000	201,038	2025/ 6/20
第 81回 利付国債(20年)	2.0	180,000	201,070	2025/ 9/20
第 82回 利付国債(20年)	2.1	260,000	291,868	2025/ 9/20
第 83回 利付国債(20年)	2.1	200,000	225,638	2025/12/20
第 84回 利付国債(20年)	2.0	340,000	381,626	2025/12/20
第 85回 利付国債(20年)	2.1	200,000	226,684	2026/ 3/20
第 86回 利付国債(20年)	2.3	250,000	286,360	2026/ 3/20
第 87回 利付国債(20年)	2.2	230,000	262,068	2026/ 3/20
第 88回 利付国債(20年)	2.3	250,000	287,907	2026/ 6/20
第 89回 利付国債(20年)	2.2	200,000	229,072	2026/ 6/20
第 90回 利付国債(20年)	2.2	270,000	310,953	2026/ 9/20
第 91回 利付国債(20年)	2.3	60,000	69,492	2026/ 9/20
第 92回 利付国債(20年)	2.1	140,000	161,165	2026/12/20
第 93回 利付国債(20年)	2.0	200,000	229,950	2027/ 3/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第 94回 利付国債(20年)	2.1	200,000	231,356	2027/ 3/20
第 96回 利付国債(20年)	2.1	90,000	104,663	2027/ 6/20
第 97回 利付国債(20年)	2.2	140,000	164,609	2027/ 9/20
第 98回 利付国債(20年)	2.1	180,000	210,283	2027/ 9/20
第 99回 利付国債(20年)	2.1	300,000	351,897	2027/12/20
第100回 利付国債(20年)	2.2	300,000	355,413	2028/ 3/20
第102回 利付国債(20年)	2.4	180,000	217,022	2028/ 6/20
第103回 利付国債(20年)	2.3	150,000	179,610	2028/ 6/20
第105回 利付国債(20年)	2.1	190,000	225,134	2028/ 9/20
第106回 利付国債(20年)	2.2	160,000	190,950	2028/ 9/20
第107回 利付国債(20年)	2.1	170,000	202,101	2028/12/20
第108回 利付国債(20年)	1.9	200,000	234,260	2028/12/20
第109回 利付国債(20年)	1.9	220,000	258,293	2029/ 3/20
第112回 利付国債(20年)	2.1	220,000	263,199	2029/ 6/20
第113回 利付国債(20年)	2.1	210,000	251,886	2029/ 9/20
第114回 利付国債(20年)	2.1	320,000	384,947	2029/12/20
第115回 利付国債(20年)	2.2	120,000	145,520	2029/12/20
第116回 利付国債(20年)	2.2	100,000	121,624	2030/ 3/20
第117回 利付国債(20年)	2.1	320,000	386,016	2030/ 3/20
第118回 利付国債(20年)	2.0	140,000	167,927	2030/ 6/20
第119回 利付国債(20年)	1.8	100,000	117,912	2030/ 6/20
第123回 利付国債(20年)	2.1	300,000	364,800	2030/12/20
第124回 利付国債(20年)	2.0	230,000	277,232	2030/12/20
第125回 利付国債(20年)	2.2	250,000	307,452	2031/ 3/20
第126回 利付国債(20年)	2.0	250,000	302,020	2031/ 3/20
第127回 利付国債(20年)	1.9	250,000	299,302	2031/ 3/20
第128回 利付国債(20年)	1.9	320,000	384,118	2031/ 6/20
第129回 利付国債(20年)	1.8	100,000	118,926	2031/ 6/20
第130回 利付国債(20年)	1.8	300,000	357,432	2031/ 9/20
第131回 利付国債(20年)	1.7	150,000	177,016	2031/ 9/20
第132回 利付国債(20年)	1.7	200,000	236,386	2031/12/20
第134回 利付国債(20年)	1.8	300,000	358,614	2032/ 3/20
第135回 利付国債(20年)	1.7	230,000	272,230	2032/ 3/20
第136回 利付国債(20年)	1.6	250,000	292,960	2032/ 3/20
第138回 利付国債(20年)	1.5	100,000	116,198	2032/ 6/20
第139回 利付国債(20年)	1.6	90,000	105,658	2032/ 6/20
第140回 利付国債(20年)	1.7	290,000	344,604	2032/ 9/20
第141回 利付国債(20年)	1.7	380,000	452,390	2032/12/20
第142回 利付国債(20年)	1.8	120,000	144,354	2032/12/20
第143回 利付国債(20年)	1.6	230,000	271,211	2033/ 3/20
第144回 利付国債(20年)	1.5	250,000	291,630	2033/ 3/20
第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	418,148	2033/ 6/20
第146回 利付国債(20年)	1.7	380,000	454,768	2033/ 9/20
第147回 利付国債(20年)	1.6	390,000	462,294	2033/12/20
第149回 利付国債(20年)	1.5	380,000	446,446	2034/ 6/20
第150回 利付国債(20年)	1.4	430,000	499,758	2034/ 9/20
第151回 利付国債(20年)	1.2	410,000	465,628	2034/12/20
第152回 利付国債(20年)	1.2	600,000	682,230	2035/ 3/20
第153回 利付国債(20年)	1.3	300,000	345,927	2035/ 6/20
第154回 利付国債(20年)	1.2	300,000	341,940	2035/ 9/20
第155回 利付国債(20年)	1.0	380,000	422,149	2035/12/20
第156回 利付国債(20年)	0.4	380,000	386,969	2036/ 3/20
第157回 利付国債(20年)	0.2	130,000	128,286	2036/ 6/20
第158回 利付国債(20年)	0.5	320,000	330,822	2036/ 9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6	170,000	178,403	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7	310,000	330,553	2037/ 3/20
第161回 利付国債(20年)	0.6	330,000	346,490	2037/ 6/20
第162回 利付国債(20年)	0.6	320,000	336,214	2037/ 9/20

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
第163回 利付国債(20年)	0.6	280,000	294,131	2037/12/20
第164回 利付国債(20年)	0.5	450,000	465,340	2038/ 3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5	340,000	351,441	2038/ 6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7	310,000	331,411	2038/ 9/20
第167回 利付国債(20年)	0.5	320,000	330,464	2038/12/20
第168回 利付国債(20年)	0.4	220,000	223,346	2039/ 3/20
第169回 利付国債(20年)	0.3	330,000	329,399	2039/ 6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3	250,000	249,540	2039/ 9/20
第171回 利付国債(20年)	0.3	210,000	209,609	2039/12/20
第25回 メキシコ合衆国円貨債券(2018)	0.6	100,000	98,874	2023/ 4/20
小 計	—	69,995,000	77,504,348	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
第 10回 東京都公募公債(東京再生都債)	2.31	100,000	135,918	2039/ 9/20
第734回 東京都公募公債	0.551	100,000	102,067	2024/ 6/20
第740回 東京都公募公債	0.463	100,000	101,898	2024/12/20
第748回 東京都公募公債	0.456	100,000	101,937	2025/ 9/19
第754回 東京都公募公債	0.06	100,000	99,762	2026/ 3/19
平成27年度第 9回 北海道公募公債	0.486	100,000	101,973	2025/10/30
第 3回 神奈川県公募公債	2.11	100,000	110,443	2025/ 6/20
第201回 神奈川県公募公債	0.704	100,000	102,215	2023/ 9/20
第209回 神奈川県公募公債	0.549	100,000	102,182	2024/ 9/20
第 6回 大阪府公募公債(20年)	1.98	100,000	118,341	2030/ 9/13
第389回 大阪府公募公債(10年)	0.53	100,000	102,148	2024/10/30
第405回 大阪府公募公債(10年)	0.19	100,000	100,410	2026/ 2/26
第420回 大阪府公募公債(10年)	0.17	110,000	110,077	2027/ 5/28
第 3回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	108,592	2027/ 7/16
第 9回 兵庫県公募公債(20年)	2.25	100,000	119,729	2029/11/19
平成26年度第 17回 兵庫県公募公債	0.46	100,000	101,958	2025/ 2/26
第 5回 静岡県公募公債(15年)	1.087	100,000	107,903	2028/11/20
平成26年度第 9回 静岡県公募公債	0.554	100,000	102,250	2024/10/24
平成27年度第 8回 静岡県公募公債	0.481	100,000	102,073	2025/ 9/19
平成26年度第 4回 愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,156	2034/ 5/15
平成29年度第 4回 広島県公募公債	0.22	100,000	100,567	2027/11/24
第 10回 埼玉県公募公債(20年)	1.94	100,000	118,151	2030/11/12
平成26年度第 6回 埼玉県公募公債	0.554	100,000	102,212	2024/ 9/26
平成26年度第 7回 埼玉県公募公債	0.476	100,000	101,965	2024/12/25
平成20年度第 2回 福岡県公募公債(20年)	2.05	100,000	116,266	2028/12/20
平成26年度第 1回 福岡県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,180	2034/ 5/26
平成24年度第 9回 千葉県公募公債	0.82	100,000	102,186	2023/ 2/24
平成25年度第 1回 千葉県公募公債	0.58	100,000	101,575	2023/ 4/25
平成25年度第 3回 千葉県公募公債	0.89	100,000	102,659	2023/ 6/23
平成30年度第 1回 新潟県公募公債	0.653	100,000	104,516	2038/ 8/20
平成28年度第 1回 岐阜県公募公債(10年)	0.06	100,000	99,604	2026/10/30
平成30年度第 2回 大分県公募公債	0.289	100,000	101,092	2028/10/31
第110回 共同発行市場公募地方債	0.89	117,000	119,072	2022/ 5/25
第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,838	2022/ 6/24
第112回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	101,793	2022/ 7/25
第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,128	2023/ 2/24
第120回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,827	2023/ 3/24
第124回 共同発行市場公募地方債	0.91	100,000	102,798	2023/ 7/25
第128回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	102,181	2023/11/24
第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	101,000	103,407	2024/ 3/25
第140回 共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,065	2024/11/25
第143回 共同発行市場公募地方債	0.448	100,000	101,898	2025/ 2/25
第163回 共同発行市場公募地方債	0.06	100,000	99,606	2026/10/23
第172回 共同発行市場公募地方債	0.225	200,000	201,110	2027/ 7/23
平成28年度第 3回 島根県公募公債	0.001	100,000	99,891	2021/11/25
平成28年度第 1回 佐賀県公募公債	0.08	100,000	99,729	2026/11/30

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
平成25年度第 1回 滋賀県公募公債	0.65	100,000	102,154	2023/11/29
平成24年度第 1回 熊本市公募公債	0.796	100,000	101,946	2022/11/30
平成28年度第 1回 浜松市公募公債	0.18	100,000	100,401	2027/ 1/25
第 19回 大阪市公募公債(20年)	1.138	100,000	111,106	2035/ 4/24
第 2回 名古屋市公募公債(20年)	2.56	100,000	110,530	2024/ 6/20
第475回 名古屋市公募公債(10年)	1.15	100,000	101,311	2021/ 6/18
第482回 名古屋市公募公債(10年)	0.639	100,000	101,698	2023/ 3/20
第 2回 京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	110,994	2025/ 9/19
平成29年度第 4回 神戸市公募公債	0.22	100,000	100,531	2027/ 8/13
平成28年度第 5回 横浜市公募公債	0.23	100,000	100,749	2027/ 2/19
第 1回 札幌市公募公債(20年)	2.14	100,000	111,606	2025/12/19
平成25年度第 9回 札幌市公募公債(10年)	0.68	100,000	102,303	2023/12/20
第 50回 川崎市公募公債(5年)	0.01	100,000	99,876	2022/ 6/20
第 87回 川崎市公募公債	0.441	100,000	101,794	2024/12/20
北九州市第 1回 15年公募公債	0.936	100,000	107,102	2029/10/22
平成23年度第 5回 広島市公募公債	1.01	100,000	101,799	2022/ 2/25
平成29年度第 1回 相模原市公募公債	0.2	100,000	100,404	2027/ 9/17
小 計	—	6,428,000	6,720,652	—
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第 23回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.645	108,000	110,674	2024/ 3/18
第 38回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	200,000	199,856	2023/ 2/17
第 13回 道路債券	2.28	100,000	105,550	2022/ 9/20
第 33回 日本高速道路債券・機構承継債	2.91	100,000	134,518	2034/ 6/20
第 55回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.22	100,000	119,846	2030/ 2/ 8
第 92回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	101,773	2022/ 6/20
第 98回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,998	2022/12/20
第100回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.784	100,000	102,036	2022/12/20
第128回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	100,000	102,444	2024/ 6/20
第130回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	100,000	102,192	2024/ 6/20
第135回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.939	100,000	107,228	2029/ 6/20
第148回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.485	100,000	102,098	2024/12/20
第168回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	100,000	101,894	2022/ 7/29
第169回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	100,000	116,691	2032/ 7/30
第173回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.819	106,000	108,103	2022/ 9/30
第186回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	100,000	101,900	2023/ 3/17
第224回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.72	100,000	128,493	2044/ 8/31
第239回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	111,632	2035/ 2/28
第 5回 政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.173	100,000	100,586	2024/ 1/29
第 6回 地方公共団体金融機構債券	2.242	100,000	120,113	2030/ 3/28
第 13回 地方公共団体金融機構債券	2.132	100,000	120,413	2031/ 1/28
第 24回 公営企業債券(20年)	2.29	100,000	117,159	2028/ 4/25
第 25回 地方公共団体金融機構債券	1.178	200,000	202,840	2021/ 6/28
第 34回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	101,826	2022/ 3/14
第 37回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	400,000	407,696	2022/ 6/17
第 37回 地方公共団体金融機構債券	0.852	100,000	101,830	2022/ 6/28
20年第 39回 地方公共団体金融機構債券	1.425	100,000	114,349	2034/ 9/28
第 42回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	100,000	102,045	2022/11/14
第 46回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	101,900	2023/ 3/17
第 56回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	200,000	205,528	2024/ 1/19
第 64回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.544	100,000	102,332	2024/ 9/13
第 76回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	102,039	2025/ 9/12
第113回 地方公共団体金融機構債券	0.299	100,000	101,347	2028/10/27
第119回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.04	100,000	99,909	2029/ 4/13
F 197回 地方公共団体金融機構債券	1.052	100,000	106,882	2027/10/29
第 26回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.911	100,000	102,923	2023/ 7/19
第 31回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.544	100,000	102,332	2024/ 9/13
第 34回 日本政策投資銀行債券	2.67	100,000	136,742	2037/ 3/19
第216回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.483	100,000	115,793	2034/ 4/28

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))	%	千円	千円	
第220回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	102,646	2024/ 6/28
第229回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	200,000	204,756	2024/10/31
第261回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.381	100,000	101,869	2025/11/28
第288回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	100,000	99,739	2026/ 9/30
第354回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	100,000	100,664	2028/ 7/31
第 93回 都市再生債券	1.102	100,000	108,761	2029/ 6/20
第 65回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,617	2024/ 5/29
第 16回 政府保証民間都市開発債券	0.699	100,000	102,401	2023/10/20
第 22回 新関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.05	100,000	99,999	2023/12/20
第 38回 関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.112	100,000	101,864	2021/12/20
第 1回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	11,522	11,688	2036/ 5/10
第 1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	13,217	13,643	2042/ 5/10
第 3回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	11,589	11,812	2036/ 5/10
第 4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	13,865	14,443	2042/ 8/10
第 13回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.16	15,611	16,339	2043/ 5/10
第 15回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.38	100,000	117,645	2028/ 3/17
第 16回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.21	15,391	16,178	2043/ 8/10
第 20回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	23,848	24,443	2039/ 7/10
第 23回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	12,400	12,739	2039/10/10
第 24回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	41,724	44,824	2044/ 5/10
第 25回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	23,370	25,313	2044/ 6/10
第 26回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	21,317	22,845	2044/ 7/10
第 33回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.88	28,359	30,414	2045/ 2/10
第 36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	29,850	31,646	2045/ 5/10
第 37回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.71	30,077	31,836	2045/ 6/10
第 42回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	13,380	13,995	2041/ 5/10
第 48回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	60,946	64,868	2046/ 5/10
第 49回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	14,508	15,277	2041/12/10
第 50回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	30,892	32,722	2046/ 7/10
第 57回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	83,806	88,699	2047/ 2/10
第 64回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	110,076	2025/12/19
第 69回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	49,676	52,371	2048/ 2/10
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	50,534	52,603	2049/ 5/10
第 89回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	55,764	57,905	2049/10/10
第 90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	57,342	59,300	2049/11/10
第 93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	62,431	63,660	2050/ 2/10
第102回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.441	100,000	109,092	2027/ 3/19
第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	85,637	86,356	2051/12/10
第117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	86,690	87,712	2052/ 2/10
第118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	86,916	88,003	2052/ 3/10
第129回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	91,291	92,359	2053/ 2/10
第132回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.092	100,000	107,499	2028/ 3/17
第140回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	95,000	95,515	2054/ 1/10
第144回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	96,596	96,729	2054/ 5/10
第149回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	98,492	97,157	2054/10/10
第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	100,000	99,800	2055/ 3/10
第181回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	102,025	2026/ 1/20
第198回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.155	100,000	100,226	2026/12/18
第 11回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	1.067	100,000	101,956	2022/ 2/18
第 13回 成田国際空港株式会社社債(一般担保付)	0.802	100,000	102,160	2023/ 2/ 8
小 計	—	7,926,041	8,354,716	—
(金融債券)	%	千円	千円	
第327回 信金中金債(5年)	0.06	100,000	99,837	2022/ 2/25
第335回 信金中金債(5年)	0.1	100,000	99,832	2022/10/27
第341回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	99,799	2023/ 4/27
第238号 商工債(3年)	0.02	200,000	199,124	2022/11/25
小 計	—	500,000	498,592	—

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(普通社債券(含む投資法人債券))	%	千円	千円	
第530回 中部電力株式会社社債(一般担保付)	0.274	100,000	98,523	2029/6/25
第517回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.19	100,000	99,744	2023/6/20
第382回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.517	100,000	100,446	2021/5/25
第402回 中国電力株式会社社債(一般担保付)	0.25	100,000	99,774	2024/10/25
第308回 北陸電力株式会社社債(一般担保付)	0.769	100,000	102,054	2024/9/25
第508回 東北電力株式会社社債(一般担保付)	0.465	100,000	99,781	2029/4/25
第451回 九州電力株式会社社債(一般担保付)	0.45	100,000	100,103	2027/5/25
第 6回 国際協力機構債券	2.098	100,000	119,887	2030/12/13
第 36回 東日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.06	100,000	100,029	2021/6/18
第 24回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.609	100,000	102,450	2024/9/20
第 30回 西日本高速道路株式会社社債(一般担保付、独立行政法人)	0.17	100,000	100,182	2026/5/22
第 5回 大和ハウス工業株式会社無担保社債(特定社債間限定同順位)	0.443	100,000	100,323	2021/6/18
第 16回 森永乳業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.395	100,000	99,755	2028/9/14
第 8回 明治ホールディングス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.12	100,000	99,657	2023/1/30
第 12回 日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	0.11	100,000	99,471	2023/9/8
第 30回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.375	100,000	99,796	2027/7/16
第 32回 東レ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	100,000	99,530	2025/7/18
第 4回 日本土地建物株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.734	100,000	100,928	2028/10/25
第 57回 住友化学株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.24	100,000	99,720	2024/9/13
第 12回 ヤフー株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.37	100,000	97,865	2026/7/31
第 7回 新日鐵住金株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.12	100,000	99,407	2023/6/20
第 21回 ダイキン工業株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.681	100,000	101,678	2024/7/30
第 16回 パナソニック株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.3	100,000	100,016	2023/9/20
第 15回 トヨタ自動車株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.382	100,000	100,268	2021/6/18
第 84回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.5	100,000	101,481	2021/6/14
第 85回 丸紅株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.2	100,000	114,233	2029/7/13
第 20回 株式会社りそなホールディングス無担保社債(社債間限定同順位)	0.27	100,000	99,671	2025/7/23
株式会社三井住友フィナンシャルグループ第1回無担保劣後社債	0.849	100,000	99,766	2024/9/12
第 2回 NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.26	100,000	99,722	2026/12/18
第 31回 株式会社ホンダファイナンス無担保社債(社債間限定同順位)	0.418	100,000	100,305	2021/6/18
第 80回 日立キャピタル株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.28	100,000	97,121	2029/10/19
第 75回 三菱UFJリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.22	100,000	98,924	2025/1/23
第 71回 三井不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.31	100,000	98,343	2030/4/16
第 99回 住友不動産株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.836	100,000	102,078	2024/7/29
第 5回 イオンモール株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.903	100,000	101,594	2024/3/22
第 65回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	2.149	100,000	116,542	2029/12/21
第126回 東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	0.275	100,000	99,602	2028/1/26
第 15回 西日本旅客鉄道株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	2.26	100,000	114,623	2027/12/20
第 71回 東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債(社債間限定同順位)	1.917	100,000	128,473	2044/10/28
第 22回 東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	0.215	100,000	99,292	2027/6/21
第 11回 日本通運株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.2	100,000	98,910	2026/7/14
第 25回 KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.395	100,000	99,544	2028/11/22
第 35回 電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.126	100,000	102,388	2022/10/20
第 39回 電源開発株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.929	100,000	102,403	2024/2/20
第 7回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.46	100,000	100,363	2022/10/24
第 14回 東京電力パワーグリッド株式会社社債(一般担保付)	0.43	100,000	99,965	2023/7/24
第 34回 東京瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	1.064	100,000	101,416	2021/9/22
第 17回 北海道瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.25	100,000	99,847	2024/3/14
第 3回 東京都競馬株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.18	100,000	99,546	2023/7/5
第 1回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債(20クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債)	0.64	100,000	99,936	2022/1/27
第 1回 H S B Cホールディングス	0.865	100,000	101,880	2024/11/28
第 1回 H S B Cホールディングス	0.45	100,000	99,511	2021/9/24
第 6回 ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー円貨社債(2)	0.65	100,000	97,390	2023/5/30
第 10回 オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債(201)	0.293	100,000	100,137	2024/1/23
小 計	—	5,400,000	5,496,393	—
合 計	—	90,249,041	98,574,702	—

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

■投資信託財産の構成(2020年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 98,574,702	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,438,263	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	100,012,965	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨て。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	100,012,965,968円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	905,575,088
公 社 債(評価額)	98,574,702,909
未 収 入 金	406,911,000
未 収 利 息	124,710,044
前 払 費 用	1,066,927
(B) 負 債	1,660,109,993
未 払 金	1,644,906,300
未 払 解 約 金	15,200,000
未 払 利 息	2,605
そ の 他 未 払 費 用	1,088
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	98,352,855,975
元 本	69,344,130,164
次 期 繰 越 損 益 金	29,008,725,811
(D) 受 益 権 総 口 数	69,344,130,164口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	14,183円

(注1) 当ファンドの期首元本額は68,772,463,677円、期中追加設定元本額は7,455,857,381円、期中一部解約元本額は6,884,190,894円です。

(注2) 元本の内訳

日立国内債券特化型ファンドN(非課税適格機関投資家専用)

45,750,587,717円

日立国内債券インデックスファンド

11,293,170,697円

日立バランスファンド(株式50)

5,863,871,238円

日立バランスファンド(株式30)

3,541,012,796円

日立バランスファンド(株式70)

2,895,487,716円

(注3) 1口当たり純資産額は1.4183円です。

■損益の状況

当期(自2019年4月2日 至2020年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	941,380,318円
受 取 利 息	941,844,641
そ の 他 収 益 金	93,000
支 払 利 息	△557,323
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,041,720,796
売 買 益	237,370,002
売 買 損	△1,279,090,798
(C) 信 託 報 酬 等	△3,961
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△100,344,439
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,787,331,899
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,280,547,457
(G) 解 約 差 損 益 金	△2,958,809,106
(H) 計 (D + E + F + G)	29,008,725,811
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	29,008,725,811

(注1) 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2) 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3) 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4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

日立外国株式インデックスマザーファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
		期中 騰落率			
	円	%	%	%	百万円
16期(2016年3月31日)	18,376	△9.6	94.2	5.7	71,980
17期(2017年3月31日)	21,066	14.6	95.8	4.1	74,497
18期(2018年4月2日)	22,589	7.2	95.0	4.9	79,742
19期(2019年4月1日)	24,884	10.2	95.5	4.5	89,873
20期(2020年3月31日)	21,978	△11.7	95.4	4.7	94,939

(注1) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCIコクサイ指数 (除く日本、 円ベース)		株式組入 比率	株式先物 比率
		騰落率		騰落率		
(期首) 2019年 4月 1日	円 24,884	% -	26,721	% -	% 95.5	% 4.5
4月末	25,801	3.7	27,718	3.7	96.2	3.7
5月末	24,179	△2.8	25,983	△2.8	95.8	4.1
6月末	25,049	0.7	26,926	0.8	95.3	4.6
7月末	25,727	3.4	27,664	3.5	95.3	4.7
8月末	24,453	△1.7	26,293	△1.6	95.4	4.5
9月末	25,238	1.4	27,142	1.6	95.3	4.7
10月末	26,240	5.4	28,225	5.6	95.1	4.8
11月末	27,217	9.4	29,282	9.6	95.6	4.2
12月末	28,040	12.7	30,175	12.9	95.6	4.3
2020年 1月末	28,075	12.8	30,218	13.1	95.6	4.4
2月末	25,867	4.0	27,854	4.2	96.4	3.5
(期末) 2020年 3月31日	21,978	△11.7	23,667	△11.4	95.4	4.7

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

(注3) MSCIコクサイ指数(除く日本、円ベース)は、MSCIコクサイ指数を基に、日立投資顧問が計算したもので、ファンド設定日前日である2000年4月2日を10,000としています。MSCIコクサイ指数はMSCI Inc.が開発した株価指数です。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項目	当 期	
	(2019. 4. 2~2020. 3. 31)	
	金 額	
(a) 売買委託手数料 (株 式) (先物・オプション)	1円 (1) (0)	
(b) 有価証券取引税 (株 式)	1 (1)	
(c) その他費用 (保 管 費 用) (そ の 他)	11 (10) (1)	
合 計	13	

(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。

(a) 売買委託手数料、(b) 有価証券取引税、(c) その他費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付		
		株 数	金 額	株 数	金 額	
外	ア メ リ カ	百株 15,653 (2,338)	千米ドル 119,524 (10,853)	百株 1,786 (2,301)	千米ドル 7,348 (12,785)	
	カ ナ ダ	百株 1,919 (558)	千カナダドル 8,926 (2,124)	百株 500 (801)	千カナダドル 430 (2,093)	
	ユ ー ロ	ド イ ツ	百株 1,293 (17)	千ユーロ 4,806 (-)	百株 89 (40)	千ユーロ 205 (219)
		イ タ リ ア	1,677	954	-	-
		フ ラ ン ス	1,229 (32)	5,627 (74)	105 (-)	205 (51)
		オ ラ ン ダ	1,211 (375)	3,526 (1,785)	20 (336)	114 (1,736)
		ス ペ イ ン	2517 (3,949)	1646 (343)	87 (3,830)	73 (209)
		ベ ル ギ ー	92	669	-	-
		オ ー ス ト リ ア	17	69	-	-
		ル ク セ ン ブ ル ク	160 (5)	190 (3)	8	35
		フ ィ ン ラ ン ド	477 (65)	580 (6)	-	-
ア イ ル ラ ン ド		115	316	36	38	
ポ ル ト ガ ル	160	98	-	-		
イ ギ リ ス	百株 14,374 (47,429)	千英ポンド 8,235 (662)	百株 1,073 (46,908)	千英ポンド 367 (1,014)		
ス イ ス	百株 829 (96)	千スイスフラン 5,656 (552)	百株 16 (-)	千スイスフラン 166 (662)		
ス ウ ェ ー デ ン	百株 1,188 (306)	千スウェーデンクローナ 16,273 (3,753)	百株 125 (125)	千スウェーデンクローナ 366 (3,753)		
ノ ル ウ ェ ー	百株 294 (21)	千ノルウェークローネ 3,358 (184)	百株 63 (-)	千ノルウェークローネ 897 (184)		
デ ン マ ー ク	百株 194 (4)	千デンマーククローネ 8,320 (204)	百株 27 (-)	千デンマーククローネ 965 (204)		
オ ー ス ト ラ リ ア	百株 4,069 (1,136)	千オーストラリアドル 6,089 (1,683)	百株 104 (1,115)	千オーストラリアドル 131 (1,644)		
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	百株 388	千ニューージーランドドル 274	百株 -	千ニューージーランドドル -		
香 港	百株 4,679 (254)	千香港ドル 18,443 (32)	百株 1,112	千香港ドル 1,934		
シ ン ガ ポ ー ル	百株 2,300 (270)	千シンガポールドル 1,135 (46)	百株 966 (167)	千シンガポールドル 22 (8)		
イ ス ラ エ ル	百株 429 (12)	千イスラエルシェケル 1,125 (13)	百株 473 (-)	千イスラエルシェケル 122 (13)		

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

(注3) ()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。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株 式 先 物 取 引	百万円 25,139	百万円 24,467	百万円 -	百万円 -

(注1) 単位未満は切り捨て。

(注2) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	20,144,044千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	97,159,047千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.20

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

■主要な売買銘柄(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

株式

買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
MICROSOFT CORP(アメリカ)	33	499,431	15,043	APPLE INC(アメリカ)	4	126,318	26,316
APPLE INC(アメリカ)	19	478,264	24,780	BANK OF AMERICA CORP(アメリカ)	14	45,752	3,268
AMAZON COM INC(アメリカ)	2	430,096	204,807	JPMORGAN CHASE & CO(アメリカ)	3	43,020	13,036
FACEBOOK INC-A(アメリカ)	11	219,727	18,620	WELLS FARGO COMPANY(アメリカ)	8	41,916	4,817
ALPHABET INC-CL A(アメリカ)	1	179,578	128,270	ORACLE CORPORATION(アメリカ)	7	40,369	5,685
ALPHABET INC-CL C(アメリカ)	1	179,227	128,019	CITIGROUP INC(アメリカ)	5	35,237	7,047
JOHNSON & JOHNSON(アメリカ)	11	160,980	14,246	PFIZER INC(アメリカ)	5	24,771	4,587
JPMORGAN CHASE & CO(アメリカ)	14	155,494	11,027	INTEL CORP(アメリカ)	4	23,434	5,579
NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	13	148,553	10,785	BOOKING HOLDINGS INC(アメリカ)	0.1	18,683	186,835
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B(アメリカ)	6	142,335	21,565	NESTLE SA-REGISTERED(スイス)	1	18,258	11,305

(注) 金額は受け渡し代金。

■利害関係人との取引状況等(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細(2020年3月31日現在)

(1) 外国株式
上場株式

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AERCAP HOLDINGS NV	31	31	70	7,707	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	68	70	347	37,770	素材
NXP SEMICONDUCTORS NV	71	72	617	67,149	半導体・半導体製造装置
AFLAC INC	158	191	693	75,521	保険
CHECK POINT SOFTWARE TECH	25	32	321	34,964	ソフトウェア・サービス
MYLAN INC	105	121	182	19,844	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WIX.COM LTD	10	13	135	14,781	ソフトウェア・サービス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	—	9	78	8,497	ソフトウェア・サービス
AGNC INVESTMENT CORP	111	144	168	18,304	各種金融
AES CORPORATION	129	156	213	23,191	公益事業
AT&T INC	1,539	1,889	5,712	621,675	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	372	457	3,627	394,833	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	317	383	2,883	313,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	9	11	163	17,836	ヘルスケア機器・サービス
CHUBB LTD	95	117	1,342	146,089	保険
ACTIVISION BLIZZARD INC	153	199	1,163	126,629	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	9	9	77	8,399	資本財
ADOBE INC	103	125	3,979	433,129	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	15	17	164	17,853	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	204	274	1,311	142,715	半導体・半導体製造装置
AFFILIATED MANAGERS GROUP	11	—	—	—	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	66	80	588	64,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	45	56	1,175	127,892	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	33	42	395	43,052	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	134	164	2,785	303,096	ソフトウェア・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	13	129	14,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES, INC	31	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEAGATE TECHNOLOGY	57	64	319	34,735	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AON PLC	53	61	1,045	113,819	保険
INGERSOLL-RAND PLC	52	—	—	—	資本財
APTIV PLC	54	67	334	36,399	自動車・自動車部品
EATON CORP PLC	92	107	845	92,011	資本財
LIBERTY GLOBAL PLC-A	48	48	81	8,878	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	117	117	185	20,155	メディア・娯楽
WILLIS TOWERS WATSON PLC	27	33	585	63,675	保険
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	7	16	58	6,407	食品・飲料・タバコ
TECHNIPFMC PLC	43	59	41	4,526	エネルギー
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	36	36	105	11,502	資本財
ALLEGION PLC	18	23	218	23,781	資本財
STERIS PLC	—	22	307	33,517	ヘルスケア機器・サービス
PERRIGO CO PLC	27	34	169	18,437	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMCOR PLC	—	150	124	13,516	素材
TRANE TECHNOLOGIES PLC	—	62	526	57,257	資本財
PENTAIR PLC	35	35	106	11,582	資本財
MEDTRONIC PLC	283	347	3,197	347,978	ヘルスケア機器・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	70	84	109	11,966	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	195	201	532	57,992	資本財
ALLERGAN PLC	71	85	1,504	163,748	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINDE PLC	57	81	1,448	157,661	素材
TE CONNECTIVITY LTD	70	86	553	60,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GARMIN LTD	24	32	245	26,707	耐久消費財・アパレル
ALBEMARLE CORP	23	28	155	16,942	素材
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	23	30	433	47,226	不動産
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	46	58	506	55,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	16	20	359	39,161	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	3	3	192	20,989	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	10	10	34	3,732	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	46	64	323	35,222	公益事業

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ALLSTATE CORP	73	83	793	86,362	保険
ALLY FINANCIAL INC	89	89	136	14,838	各種金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17	27	293	31,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALPHABET INC-CL C	66	79	9,111	991,602	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	63	77	8,860	964,340	メディア・娯楽
ALTICE USA INC- A	73	31	71	7,729	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	395	483	1,804	196,371	食品・飲料・タバコ
AMAZON COM INC	87	108	21,297	2,317,760	小売
AMERCO	2	2	59	6,442	運輸
AMEREN CORPORATION	48	64	505	55,058	公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	26	26	31	3,466	運輸
AMERICAN ELECTRIC POWER	101	128	1,077	117,311	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	152	180	1,626	177,049	各種金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	14	18	128	14,018	保険
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	187	226	581	63,305	保険
AMERICAN TOWER CORP	92	115	2,651	288,581	不動産
AMERICAN WATER WORKS CO INC	36	47	595	64,817	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	35	41	361	39,310	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	32	32	351	38,297	各種金融
AMETEK INC	49	59	438	47,736	資本財
AMGEN INC	135	154	3,215	349,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	63	77	583	63,544	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADAECO PETROLEUM CORP	107	—	—	—	エネルギー
ANALOG DEVICES	76	95	872	95,002	半導体・半導体製造装置
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	296	347	196	21,412	各種金融
ANSYS INC	18	22	517	56,296	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	54	65	1,516	165,018	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	75	89	36	3,993	エネルギー
APPLE INC	1,002	1,147	29,249	3,183,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	209	239	1,132	123,296	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	49	59	124	13,541	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	116	145	522	56,810	食品・飲料・タバコ
ARCONIC INC	91	91	149	16,302	資本財
ARISTA NETWORKS INC	11	14	288	31,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARROW ELECTRONICS INC	18	18	96	10,523	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	12	15	160	17,521	保険
ATMOS ENERGY CORP	24	31	318	34,688	公益事業
AUTODESK INC	45	57	888	96,715	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	17	22	102	11,185	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	91	111	1,541	167,763	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	5	6	585	63,727	小売
AVALONBAY COMMUNITIES INC	29	36	552	60,104	不動産
AVERY DENNISON CORP	18	21	230	25,061	素材
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	52	—	—	—	各種金融
BB&T CORPORATION	164	—	—	—	銀行
BAKER HUGHES CO	105	151	166	18,083	エネルギー
BALL CORP	69	81	537	58,545	素材
BANK OF AMERICA CORP	1,985	2,210	4,871	530,179	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	207	215	733	79,776	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL INC	104	126	1,037	112,927	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	55	69	1,558	169,566	ヘルスケア機器・サービス
BEIGENE LTD-ADR	7	9	112	12,281	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WR BERKLEY CORP	18	35	190	20,763	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	273	339	6,218	676,809	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	57	62	372	40,517	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	6	209	22,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	37	47	387	42,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	43	47	1,488	162,044	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACK KNIGHT INC	—	36	212	23,095	ソフトウェア・サービス
BLACKROCK INC	25	30	1,366	148,667	各種金融
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	—	171	808	87,987	各種金融

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
H&R BLOCK INC	42	—	—	—	消費者サービス
BOEING CO	113	138	2,113	229,961	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	10	11	1,439	156,612	小売
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	—	34	242	26,375	ソフトウェア・サービス
BORGWARNER INC	42	55	135	14,712	自動車・自動車部品
BOSTON PROPERTIES INC	33	40	371	40,467	不動産
BOSTON SCIENTIFIC CORP	294	361	1,143	124,467	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	24	—	—	—	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	342	607	3,301	359,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRITISH AMERICAN TOB-SP ADR	87	87	289	31,455	食品・飲料・タバコ
BROADRIDGE FINANCIAL Solutio	25	30	290	31,649	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	87	102	2,467	268,550	半導体・半導体製造装置
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	51	—	—	—	不動産
BROWN & BROWN INC	—	58	216	23,544	保険
BROWN-FORMAN CORP -CLASS B	56	80	454	49,489	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	14	17	276	30,069	小売
CBS CORP-CL B	75	—	—	—	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	23	27	251	27,336	各種金融
CBRE GROUP INC	69	84	344	37,508	不動産
CDK GLOBAL INC	26	26	88	9,663	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	32	38	368	40,077	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	50	50	133	14,485	素材
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	27	32	208	22,702	運輸
CIGNA CORP	79	96	1,717	186,880	ヘルスケア機器・サービス
CIT GROUP INC	24	—	—	—	銀行
CME GROUP INC	75	93	1,618	176,098	各種金融
CMS ENERGY CORP	60	74	458	49,882	公益事業
CSX CORP	167	191	1,113	121,146	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	271	337	2,012	219,023	ヘルスケア機器・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	95	95	166	18,103	エネルギー
CADENCE DESIGN SYS INC	61	73	488	53,157	ソフトウェア・サービス
CAMDEN PROPERTY TRUST	18	26	216	23,581	不動産
CAMPBELL SOUP CO	38	38	179	19,480	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	98	120	651	70,850	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	61	77	373	40,666	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	37	42	238	25,931	小売
CARNIVAL CORP	87	98	125	13,655	消費者サービス
CATERPILLAR INC	124	143	1,599	174,093	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	29	29	214	23,386	素材
CELGENE CORP	149	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENTENE CORP	86	151	874	95,188	ヘルスケア機器・サービス
CENTRPOINT ENERGY INC	103	118	191	20,842	公益事業
CENTURYLINK INC	206	235	231	25,245	電気通信サービス
CERNER CORP	63	82	526	57,328	ヘルスケア機器・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	33	38	1,749	190,346	メディア・娯楽
CHEMOURS CO/THE	35	—	—	—	素材
CHENIERE ENERGY INC	45	61	198	21,602	エネルギー
CHEVRON CORP	404	489	3,518	382,926	エネルギー
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	6	7	447	48,753	消費者サービス
CHURCH & DWIGHT CO INC	52	64	414	45,140	家庭用品・パーソナル用品
CIMAREX ENERGY CO	22	—	—	—	エネルギー
CINCINNATI FINANCIAL CORP	31	40	322	35,059	保険
CISCO SYSTEMS INC	951	1,097	4,424	481,537	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINTAS CORP	18	21	392	42,693	商業・専門サービス
CITIGROUP INC	523	565	2,490	271,067	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	100	115	225	24,592	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	30	33	495	53,958	ソフトウェア・サービス
CLOROX COMPANY	26	32	571	62,168	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA COMPANY	855	1,053	4,739	515,828	食品・飲料・タバコ
COGNEX CORP	38	45	204	22,263	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	122	142	672	73,220	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
COLGATE-PALMOLIVE CO	173	211	1,404	152,888	家庭用品・パーソナル用品
COMCAST CORP-CL A	957	1,174	4,168	453,636	メディア・娯楽
COMERICA INC	33	38	119	13,028	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	37	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONAGRA BRANDS INC	100	127	360	39,266	食品・飲料・タバコ
CONCHO RESOURCES INC	42	53	217	23,694	エネルギー
CONOCOPHILLIPS	241	285	834	90,847	エネルギー
CONSOLIDATED EDISON INC	65	86	697	75,892	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	34	44	644	70,123	食品・飲料・タバコ
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	16	23	17	1,929	エネルギー
COOPER COS INC/THE	10	13	364	39,635	ヘルスケア機器・サービス
COPART INC	43	55	395	43,000	商業・専門サービス
CORNING INC	183	200	426	46,457	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CORTEVA INC	—	195	471	51,320	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	91	113	3,315	360,833	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	8	10	599	65,296	商業・専門サービス
COTY INC-CL A	101	56	30	3,304	家庭用品・パーソナル用品
CROWN CASTLE INTL CORP	88	108	1,599	174,024	不動産
CROWN HOLDINGS INC	28	36	210	22,927	素材
CUMMINS INC	32	38	511	55,614	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DR HORTON INC	76	91	336	36,616	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	39	50	499	54,397	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	59	65	94	10,326	ソフトウェア・サービス
DANAHER CORP	132	162	2,283	248,517	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	26	29	164	17,942	消費者サービス
DAVITA INC	32	32	244	26,610	ヘルスケア機器・サービス
DEERE & CO	64	77	1,090	118,687	資本財
DELL TECHNOLOGIES -C	34	43	172	18,763	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA AIR LINES INC	37	37	106	11,544	運輸
DENTSPLY SIRONA INC	47	56	219	23,890	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	107	107	68	7,409	エネルギー
DEXCOM INC	19	24	667	72,611	ヘルスケア機器・サービス
DIAMONDBACK ENERGY INC	32	37	87	9,499	エネルギー
DIGITAL REALTY TRUST INC	43	68	950	103,465	不動産
THE WALT DISNEY CO	380	465	4,647	505,829	メディア・娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	78	78	293	31,974	各種金融
DISCOVERY INC-A	27	43	86	9,379	メディア・娯楽
DISCOVERY INC-C	59	87	156	16,999	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	45	62	128	14,030	メディア・娯楽
DOCUSIGN INC	—	28	246	26,858	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	56	67	983	107,018	小売
DOLLAR TREE INC	50	62	496	54,060	小売
DOMINION ENERGY INC	157	213	1,638	178,319	公益事業
DOMINO'S PIZZA INC	9	10	346	37,736	消費者サービス
DOVER CORP	31	38	325	35,416	資本財
DOW INC	—	193	553	60,201	素材
DOWDUPONT INC	483	—	—	—	素材
DROPBOX INC-CLASS A	—	65	117	12,839	ソフトウェア・サービス
DUKE REALTY CORP	71	97	320	34,889	不動産
DUKE ENERGY CORP	151	189	1,582	172,203	公益事業
DUPONT DE NEMOURS INC	—	192	648	70,524	素材
EOG RESOURCES INC	122	152	531	57,864	エネルギー
E*TRADE FINANCIAL CORP	55	55	194	21,135	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	27	35	94	10,242	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	30	36	171	18,653	素材
EATON VANCE CORP	25	25	84	9,190	各種金融
EBAY INC	207	201	628	68,349	小売
ECOLAB INC	54	67	1,081	117,686	素材
EDISON INTERNATIONAL	68	93	528	57,476	公益事業
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44	54	1,058	115,220	ヘルスケア機器・サービス
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	41	105	237	25,838	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ELECTRONIC ARTS INC	64	76	743	80,927	メディア・娯楽
EMERSON ELECTRIC CO	132	158	738	80,414	資本財
ENBRIDGE INC	137	137	387	42,208	エネルギー
ENERGY CORP	38	52	522	56,838	公益事業
EPAM SYSTEMS INC	—	14	263	28,677	ソフトウェア・サービス
EQUIFAX INC	25	31	390	42,495	商業・専門サービス
EQUINIX INC	16	22	1,454	158,328	不動産
EQUITABLE HOLDINGS INC	—	102	157	17,161	各種金融
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	46	260	28,334	不動産
EQUITY RESIDENTIAL	78	97	607	66,062	不動産
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	—	7	122	13,281	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	—	52	223	24,362	公益事業
ESSEX PROPERTY TRUST INC	14	17	383	41,721	不動産
EVERGY INC	54	62	366	39,884	公益事業
EVERSOURCE ENERGY	64	84	705	76,798	公益事業
EXACT SCIENCES CORP	—	35	204	22,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXELON CORPORATION	203	252	939	102,229	公益事業
EXPEDIA GROUP INC	26	33	186	20,251	小売
EXPEDITORS INTL WASH INC	36	41	274	29,882	運輸
EXTRA SPACE STORAGE INC	26	34	328	35,799	不動産
EXXON MOBIL CORPORATION	895	1,094	4,103	446,564	エネルギー
FLIR SYSTEMS INC	31	31	99	10,843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FMC CORP	27	32	264	28,779	素材
FACEBOOK INC-A	508	622	10,322	1,123,353	メディア・娯楽
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	—	9	241	26,256	各種金融
FASTENAL CO	61	150	477	51,911	資本財
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16	20	150	16,324	不動産
FEDEX CORPORATION	53	64	801	87,192	運輸
F5 NETWORKS INC	13	16	175	19,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	69	159	2,000	217,701	ソフトウェア・サービス
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	59	72	192	20,962	保険
FIFTH THIRD BANCORP	152	181	288	31,375	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	115	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	34	44	380	41,372	銀行
FISERV INC	84	149	1,471	160,176	ソフトウェア・サービス
FIRSTENERGY CORP	109	140	570	62,101	公益事業
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	18	23	446	48,564	ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	25	—	—	—	資本財
FLOWERVE CORP	28	28	62	6,853	資本財
FORD MOTOR COMPANY	767	1,015	510	55,587	自動車・自動車部品
FORTINET INC	29	38	383	41,748	ソフトウェア・サービス
FORTIVE CORP	63	79	412	44,838	資本財
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	30	37	164	17,922	資本財
FOX CORP - CLASS A	73	93	228	24,863	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	30	42	101	11,082	メディア・娯楽
FRANKLIN RESOURCES INC	74	74	131	14,302	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	278	381	237	25,892	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	37	49	407	44,378	保険
GAP INC	44	44	33	3,603	小売
GARTNER INC	19	21	226	24,639	ソフトウェア・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	52	63	853	92,850	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	1,823	2,263	1,785	194,351	資本財
GENERAL MILLS INC	125	157	852	92,813	食品・飲料・タバコ
GENERAL MOTORS CO	267	334	712	77,496	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	30	38	251	27,399	小売
GILEAD SCIENCES INC	272	328	2,490	271,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	34	78	1,183	128,786	ソフトウェア・サービス
GLOBE LIFE INC	—	27	205	22,414	保険
GODADDY INC - CLASS A	36	41	242	26,397	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	71	83	1,326	144,321	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	52	—	—	—	自動車・自動車部品

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GRAINGER (W W) INC	11	11	286	31,182	資本財
GRUBHUB INC	19	19	75	8,178	小売
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	—	20	166	18,083	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	61	71	645	70,284	ヘルスケア機器・サービス
HCP INC	96	—	—	—	不動産
HD SUPPLY HOLDINGS INC	38	38	105	11,430	資本財
HP INC	342	385	688	74,878	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	187	203	129	14,108	エネルギー
HANESBRANDS INC	71	71	57	6,227	耐久消費財・アパレル
HARLEY-DAVIDSON INC	35	35	62	6,853	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	24	—	—	—	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	77	94	338	36,789	保険
HASBRO INC	23	34	243	26,449	耐久消費財・アパレル
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	130	316	34,450	不動産
HEICO CORP	—	9	69	7,531	資本財
HEICO CORP-CLASS A	—	20	132	14,367	資本財
HELMERICH & PAYNE	20	—	—	—	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	15	20	312	33,965	ソフトウェア・サービス
HERSHEY CO/THE	28	39	537	58,478	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	54	72	229	25,019	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	322	322	324	35,291	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	60	70	483	52,567	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	36	36	93	10,194	エネルギー
HOLOGIC INC	57	68	239	26,069	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT INC	239	282	5,541	603,069	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC.	155	184	2,433	264,815	資本財
HORMEL FOODS CORP	60	77	360	39,201	食品・飲料・タバコ
HOST HOTELS & RESORTS INC	158	189	216	23,560	不動産
HUMANA INC	29	34	1,058	115,161	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	19	23	215	23,418	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	235	273	228	24,882	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	9	11	208	22,690	資本財
IAC/INTERACTIVECORP	16	21	378	41,140	メディア・娯楽
IPG PHOTONICS CORP	7	10	109	11,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IDEX CORP	16	20	273	29,793	資本財
IDEXX LABORATORIES INC	18	22	530	57,706	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS	62	83	1,183	128,831	資本財
ILLUMINA INC	31	38	1,049	114,236	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	38	48	346	37,700	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGERSOLL-RAND INC	—	93	222	24,205	資本財
INGREDION INC	15	15	115	12,615	食品・飲料・タバコ
INSULET CORP	—	15	261	28,499	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	964	1,124	6,240	679,125	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	120	144	1,211	131,799	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	191	229	2,586	281,506	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16	24	263	28,634	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	82	97	306	33,363	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	83	102	166	18,155	メディア・娯楽
INTUIT INC	52	67	1,598	173,991	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	24	29	1,487	161,879	ヘルスケア機器・サービス
INVITATION HOMES INC	57	141	298	32,516	不動産
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	36	173	18,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IQVIA HOLDINGS INC	33	42	482	52,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IRON MOUNTAIN INCORPORATED	53	76	189	20,569	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	703	811	7,584	825,424	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	26	33	257	28,009	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	65	65	91	9,903	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	567	680	9,045	984,433	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	9	13	139	15,200	不動産
JUNIPER NETWORKS INC	70	89	180	19,613	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KLA CORPORATION	34	40	608	66,228	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KKR & CO INC -A	105	130	318	34,690	各種金融
KANSAS CITY SOUTHERN	22	26	336	36,609	運輸
KELLOGG CO	53	67	408	44,413	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	215	241	261	28,409	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	39	49	419	45,679	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	73	89	1,183	128,817	家庭用品・パーソナル用品
KIMCO REALTY CORP	82	102	103	11,211	不動産
KINDER MORGAN INC	423	530	704	76,623	エネルギー
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	26	35	116	12,680	運輸
KOHL'S CORP	36	36	58	6,316	小売
KRAFT HEINZ CO/THE	125	175	441	48,065	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	174	208	618	67,304	食品・生活必需品小売り
L BRANDS INC	49	—	—	—	小売
LKQ CORP	63	76	159	17,369	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	17	—	—	—	資本財
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	57	1,038	113,073	資本財
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	20	24	316	34,464	ヘルスケア機器・サービス
LAM RESEARCH CORP	32	38	970	105,580	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	31	39	224	24,464	食品・飲料・タバコ
LAS VEGAS SANDS CORP	84	91	395	43,070	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	47	58	958	104,295	家庭用品・パーソナル用品
LEAR CORP	15	15	132	14,455	自動車・自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	29	29	81	8,859	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	27	34	317	34,571	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-A	62	73	291	31,746	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	7	9	168	18,333	資本財
LIBERTY BROADBAND CORP	23	28	319	34,750	メディア・娯楽
LIBERTY PROPERTY TRUST	31	—	—	—	不動産
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM A	20	20	60	6,586	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-SIRIUSXM C	40	40	122	13,303	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	37	49	130	14,174	メディア・娯楽
LILLY (ELI) & CO	193	223	3,092	336,553	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	46	46	126	13,808	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	32	40	180	19,689	メディア・娯楽
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	53	65	2,287	248,938	資本財
LOEWS CORP	56	64	230	25,047	保険
LOWE'S COMPANIES	171	199	1,769	192,603	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	22	29	562	61,208	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	28	31	336	36,577	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	110	130	149	16,312	消費者サービス
MSCI INC	19	22	646	70,324	各種金融
MACERICH CO/THE	23	—	—	—	不動産
MACY'S	61	—	—	—	小売
MANPOWERGROUP	13	13	73	7,962	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	182	182	59	6,429	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	142	160	390	42,500	エネルギー
MARKEL CORP	2	3	340	37,101	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	10	351	38,234	各種金融
MARSH & MCLENNAN COS	106	131	1,176	127,990	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	65	71	547	59,585	消費者サービス
MARTIN MARIETTA MATERIALS	13	16	294	32,040	素材
MASCO CORP	62	71	252	27,521	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	194	232	5,875	639,419	ソフトウェア・サービス
MATCH GROUP INC	—	14	93	10,157	メディア・娯楽
MATTEL INC	64	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	57	71	354	38,565	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	26	32	458	49,852	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORPORATION	163	195	3,284	357,443	消費者サービス
MCKESSON CORP	43	43	600	65,370	ヘルスケア機器・サービス
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	123	216	23,546	不動産
MELCO RESORTS AND ENTERTAINMENT LIMITED	51	51	64	6,971	消費者サービス

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MERCADOLIBRE INC	9	12	567	61,809	小売
MERCK & CO. INC.	556	658	5,070	551,810	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	181	203	651	70,852	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	6	411	44,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICRO FOCUS INTL-SPN ADR	44	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MICRO FOCUS INTL-SPN ADR	—	36	18	1,999	ソフトウェア・サービス
MICROSOFT CORP	1,540	1,872	30,004	3,265,338	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	51	62	427	46,550	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	239	287	1,278	139,185	半導体・半導体製造装置
MID-AMERICA APARTMENT COMM	24	30	321	34,976	不動産
MIDDLEBY CORP	12	12	68	7,443	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	12	15	120	13,084	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	40	50	201	21,929	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	308	373	1,909	207,788	食品・飲料・タバコ
MONGODB INC	—	13	177	19,301	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	88	105	609	66,277	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	36	44	985	107,281	各種金融
MORGAN STANLEY	273	315	1,098	119,561	各種金融
MOSAIC CO/THE	77	77	77	8,379	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	34	44	599	65,243	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NRG ENERGY INC	64	64	182	19,815	公益事業
NVR INC	0.8	0.9	244	26,585	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	22	30	298	32,466	各種金融
NATIONAL OILWELL VARCO INC	75	91	85	9,318	エネルギー
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	32	39	128	13,980	不動産
NEKTAR THERAPEUTICS	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	54	54	223	24,364	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NETFLIX INC	92	113	4,191	456,198	メディア・娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	21	192	20,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWELL BRANDS INC	100	100	136	14,884	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORP	113	149	693	75,443	素材
NEWS CORP-CLASS A	79	79	70	7,677	メディア・娯楽
NEXTERA ENERGY INC	101	126	3,110	338,521	公益事業
NIKE INC -CL B	268	322	2,755	299,831	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	78	99	258	28,099	公益事業
NOBLE ENERGY INC	100	113	60	6,530	エネルギー
NORDSTROM INC	25	25	39	4,293	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	58	67	1,005	109,386	運輸
NORTHERN TRUST CORP	45	52	395	43,063	各種金融
NORTHROP GRUMMAN CORP	35	42	1,317	143,397	資本財
NORTONLIFELOCK INC	—	164	313	34,089	ソフトウェア・サービス
NUCOR CORP	67	73	256	27,909	素材
NVIDIA CORP	121	150	3,983	433,562	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	42	53	169	18,399	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	17	19	604	65,794	小売
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	161	234	258	28,100	エネルギー
OKTA INC	—	28	349	38,072	ソフトウェア・サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	13	24	323	35,174	運輸
OMNICOM GROUP	47	57	315	34,307	メディア・娯楽
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	53	140	15,337	不動産
ON SEMICONDUCTOR CORP	89	109	141	15,385	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	85	109	218	23,772	エネルギー
ORACLE CORPORATION	561	594	2,994	325,859	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	21	29	115	12,586	資本財
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	97	113	1,147	124,907	銀行
PPG INDUSTRIES INC	51	61	528	57,562	素材
PPL CORPORATION	148	189	488	53,208	公益事業
PVH CORP	16	16	61	6,655	耐久消費財・アパレル
PTC INC	24	29	171	18,706	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	73	89	558	60,822	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	19	22	199	21,730	素材

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PALO ALTO NETWORKS INC	20	26	432	47,104	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	28	33	438	47,750	資本財
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	47	—	—	—	エネルギー
PAYCHEX INC	68	83	538	58,589	ソフトウェア・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	—	13	277	30,152	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	235	288	2,797	304,501	ソフトウェア・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	84	119	136	14,906	銀行
PEPCICO INC	296	360	4,522	492,134	食品・飲料・タバコ
PERKINELMER INC	—	29	221	24,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,226	1,431	4,676	508,987	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC	329	402	2,921	317,893	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	91	115	625	68,078	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	22	27	211	23,025	公益事業
PINTEREST INC- CLASS A	—	79	121	13,257	メディア・娯楽
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	36	43	285	31,115	エネルギー
PLAINS GP HOLDINGS L	33	—	—	—	エネルギー
POLARIS INC.	13	13	61	6,673	耐久消費財・アパレル
T ROWE PRICE GROUP INC	50	61	602	65,609	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	58	66	219	23,854	保険
PROCTER & GAMBLE CO	526	644	7,410	806,445	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	120	151	1,153	125,487	保険
PROLOGIS INC	132	191	1,586	172,612	不動産
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	85	105	565	61,561	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	104	131	586	63,776	公益事業
PUBLIC STORAGE	34	41	826	89,967	不動産
PULTE GROUP INC	58	68	161	17,583	耐久消費財・アパレル
QORVO INC	24	29	238	25,937	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	257	295	2,038	221,890	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS	26	32	268	29,269	ヘルスケア機器・サービス
QURATE RETAIL INC	92	—	—	—	小売
RPM INTERNATIONAL INC	—	31	189	20,613	素材
RALPH LAUREN CORP	11	11	78	8,530	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	26	30	193	21,025	各種金融
RAYTHEON COMPANY	60	72	1,019	110,986	資本財
REALTY INCOME CORP	63	85	451	49,148	不動産
RED HAT INC	37	—	—	—	ソフトウェア・サービス
REGENCY CENTERS CORP	30	44	175	19,130	不動産
REGENERON PHARMACEUTICALS	17	21	993	108,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	249	249	237	25,830	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	12	15	130	14,189	保険
REPUBLIC SERVICES INC	47	58	448	48,757	商業・専門サービス
RESMED INC	29	38	585	63,774	ヘルスケア機器・サービス
RINGCENTRAL INC-CLASS A	—	20	456	49,633	ソフトウェア・サービス
ROBERT HARF INTL INC	27	27	110	12,037	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	25	30	461	50,225	資本財
ROKU INC	—	24	215	23,405	メディア・娯楽
ROLLINS INC	27	36	129	14,041	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	22	27	857	93,282	資本財
ROSS STORES INC	80	94	797	86,822	小売
S&P GLOBAL INC	52	62	1,553	169,074	各種金融
SBA COMMUNICATIONS CORP	25	29	808	87,947	不動産
SEI INVESTMENTS COMPANY	26	34	157	17,183	各種金融
SL GREEN REALTY CORP	19	19	87	9,528	不動産
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	49	60	262	28,554	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	11	13	202	22,039	銀行
SABRE CORP	60	60	37	4,068	ソフトウェア・サービス
SALESFORCE.COM INC	162	215	3,231	351,669	ソフトウェア・サービス
SAREPTA THERAPEUTICS INC	—	18	177	19,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENRY SCHEIN INC	32	39	203	22,108	ヘルスケア機器・サービス
SCHLUMBERGER LTD	294	360	478	52,117	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	258	299	1,028	111,904	各種金融

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SEALED AIR CORP	41	41	106	11,632	素材
SEATTLE GENETICS INC	21	31	357	38,895	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	56	73	883	96,175	公益事業
SERVICENOW INC	37	49	1,403	152,722	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO	17	21	1,028	111,954	素材
SIGNATURE BANK	12	12	99	10,842	銀行
SIMON PROPERTY GROUP INC	64	79	448	48,801	不動産
SIRIUS XM HOLDINGS INC	334	396	190	20,729	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	36	42	378	41,188	半導体・半導体製造装置
SMITH (A. O.) CORP	28	34	131	14,282	資本財
JM SMUCKER CO/THE COM	22	29	326	35,577	食品・飲料・タバコ
SNAP-ON INC	12	15	169	18,451	資本財
SNAP INC - A	—	195	231	25,147	メディア・娯楽
SOUTHERN CO	213	272	1,578	171,805	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES COMPANY	30	30	107	11,696	運輸
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	22	22	53	5,806	資本財
SPLUNK INC	32	40	508	55,381	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	184	218	184	20,055	電気通信サービス
SQUARE INC - A	64	91	500	54,469	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	31	39	399	43,511	資本財
STARBUCKS CORP	263	306	2,077	226,105	消費者サービス
STATE STREET CORP	80	95	493	53,659	各種金融
STEEL DYNAMICS INC	46	46	100	10,928	素材
STRYKER CORP	70	87	1,430	155,641	ヘルスケア機器・サービス
SUN COMMUNITIES INC	—	24	293	31,949	不動産
SUNTRUST BANKS INC	95	—	—	—	銀行
SYMANTEC CORP	138	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	32	39	504	54,883	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	161	161	270	29,403	各種金融
SYSCO CORP	105	126	585	63,704	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	58	66	233	25,455	各種金融
TJX COMPANIES INC	260	313	1,489	162,097	小売
T-MOBILE US INC	69	89	743	80,961	電気通信サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	16	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	25	30	355	38,692	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	55	69	91	9,919	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	106	131	1,260	137,150	小売
TARGA RESOURCES CORP	45	55	35	3,878	エネルギー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	—	9	265	28,931	資本財
TELEFLEX INC	10	12	346	37,656	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	—	41	226	24,648	半導体・半導体製造装置
TESLA, INC.	27	35	1,757	191,263	自動車・自動車部品
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	23	89	75	8,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXAS INSTRUMENTS INC	204	242	2,469	268,788	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	53	53	148	16,212	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	84	104	2,971	323,395	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
3M CO	122	148	2,049	222,994	資本財
TIFFANY & CO	26	28	362	39,447	小売
TORCHMARK CORP	22	—	—	—	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	34	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	28	28	239	26,069	小売
TRANSDIGM GROUP INC	10	13	445	48,491	資本財
TRANSUNION	38	49	334	36,358	商業・専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	57	67	690	75,161	保険
TRIMBLE INCORPORATED	51	60	186	20,261	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRIPADVISOR INC	25	25	44	4,861	メディア・娯楽
TRUIST FINANCIAL CORP	—	348	1,134	123,505	銀行
TWILIO INC - A	—	31	300	32,725	ソフトウェア・サービス
TWITTER INC	138	192	491	53,471	メディア・娯楽
TYLER TECHNOLOGIES INC	—	10	300	32,737	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	63	77	455	49,567	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
UDR INC	53	77	290	31,609	不動産
UGI CORP	36	51	137	14,935	公益事業
US BANCORP	324	384	1,380	150,270	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	—	112	311	33,921	運輸
ULTA BEAUTY INC	12	15	269	29,336	小売
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	37	37	35	3,853	耐久消費財・アパレル
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	37	37	31	3,410	耐久消費財・アパレル
UNION PACIFIC CORP	155	179	2,512	273,483	運輸
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	16	16	48	5,251	運輸
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	145	181	1,772	192,887	運輸
UNITED RENTALS INC	16	19	180	19,676	資本財
UNITED TECHNOLOGIES CORP	173	212	2,091	227,610	資本財
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC	203	244	6,147	669,012	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	18	21	210	22,884	ヘルスケア機器・サービス
UNUM GROUP	45	45	73	7,950	保険
VF CORP	70	88	526	57,326	耐久消費財・アパレル
VAIL RESORTS INC	8	10	148	16,211	消費者サービス
VALERO ENERGY CORP	89	107	508	55,301	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	18	24	248	27,090	ヘルスケア機器・サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	26	34	536	58,441	ヘルスケア機器・サービス
VENTAS INC	75	98	282	30,705	不動産
VEREIT INC	178	285	142	15,473	不動産
VERISIGN INC	23	27	513	55,937	ソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	874	1,069	5,856	637,339	電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	34	41	602	65,533	商業・専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	53	67	1,553	169,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIACOM INC-CL B	76	—	—	—	メディア・娯楽
VIACOMCBS INC - CLASS B	—	148	209	22,798	メディア・娯楽
VICI PROPERTIES INC	—	111	178	19,376	不動産
VISA INC-CLASS A SHARES	371	442	7,324	797,159	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	72	87	139	15,205	公益事業
VMWARE INC-CLASS A	18	22	265	28,855	ソフトウェア・サービス
VORNADO REALTY TRUST	33	40	151	16,478	不動産
VOYA FINANCIAL INC	39	39	161	17,601	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	26	34	351	38,255	素材
WABCO HOLDINGS INC	11	14	189	20,587	資本財
WP CAREY INC	33	45	266	29,046	不動産
WEC ENERGY GROUP INC	67	82	755	82,173	公益事業
WABTEC CORP	39	47	235	25,599	資本財
WALMART INC	308	367	4,234	460,853	食品・生活必需品小売り
WALGREEN BOOTS ALLIANCE INC	173	197	892	97,086	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	56	69	536	58,333	商業・専門サービス
WASTE MANAGEMENT INC	88	110	1,043	113,608	商業・専門サービス
WATERS CORPORATION	15	17	333	36,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A	12	17	88	9,622	小売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO COMPANY	957	1,039	3,109	338,442	銀行
WELLTOWER INC	77	106	500	54,426	不動産
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	—	18	273	29,738	ヘルスケア機器・サービス
WESTERN DIGITAL CORP	59	77	338	36,811	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WESTERN UNION CO	92	110	209	22,761	ソフトウェア・サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	8	8	30	3,297	素材
WESTROCK CO	49	59	173	18,851	素材
WEYERHAEUSER CO	160	194	330	35,926	不動産
WHIRLPOOL CORP	14	14	128	13,936	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	254	316	437	47,653	エネルギー
WORKDAY INC-CLASS A	31	43	590	64,252	ソフトウェア・サービス
WORLDPAY INC-CLASS A	40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WYNN RESORTS LTD	20	23	140	15,293	消費者サービス
XPO LOGISTICS INC	25	25	128	13,992	運輸

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
XCEL ENERGY INC	108	136	850	92,594	公益事業	
XILINX INC	53	65	517	56,356	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	41	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	37	47	314	34,227	資本財	
XEROX HOLDINGS CORP	—	41	75	8,202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YUM! BRANDS INC	67	79	560	60,958	消費者サービス	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	46	—	—	—	電気通信サービス	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	—	14	263	28,697	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ZILLOW GROUP INC - C	28	34	126	13,713	メディア・娯楽	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	42	53	530	57,682	ヘルスケア機器・サービス	
ZIONS BANCORP, N.A.	38	46	126	13,777	銀行	
ZOETIS INC	99	123	1,443	157,115	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	85	107	326	35,563	保険	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	32	32	84	9,162	保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	46	46	83	9,046	素材	
BUNGE LIMITED	27	34	134	14,649	食品・飲料・タバコ	
CAPRI HOLDINGS LTD	32	32	36	3,917	耐久消費財・アパレル	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	77	77	34	3,720	食品・生活必需品小売り	
EVEREST RE GROUP LTD	8	10	198	21,601	保険	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	260	318	120	13,116	不動産	
IHS MARKIT LTD	81	99	614	66,877	商業・専門サービス	
INVESCO LTD	78	97	93	10,175	各種金融	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	48	58	272	29,667	資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	45	53	109	11,968	資本財	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	123	166	376	41,009	半導体・半導体製造装置	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	44	52	55	6,043	消費者サービス	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8	11	167	18,209	保険	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	34	47	139	15,227	消費者サービス	
FLEX LTD	103	136	114	12,489	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小 計	株数・金額 銘柄数 <比率>	66,248 638銘柄	80,153 652銘柄	592,478 —	64,479,470 <67.9%>	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
ARC RESOURCES LTD	68	—	—	—	エネルギー	
AGNCIO EAGLE MINES LTD	51	63	356	27,328	素材	
AIR CANADA	—	33	53	4,064	運輸	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	129	230	17,658	公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	94	227	746	57,172	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD	61	61	71	5,499	公益事業	
ATCO LTD -CLASS I	14	14	52	4,022	公益事業	
AURORA CANNABIS INC	131	170	21	1,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BCE INC	33	41	230	17,666	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	136	166	1,129	86,499	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	259	316	1,737	133,057	銀行	
BARRICK GOLD CORP	358	462	1,261	96,646	素材	
BAUSCH HEALTH COS INC	67	78	168	12,945	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKBERRY LTD	106	106	58	4,498	ソフトウェア・サービス	
BOMBARDIER INC 'B'	450	450	19	1,466	資本財	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	176	231	1,443	110,589	各種金融	
CAE INC	62	62	112	8,594	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	30	37	146	11,206	素材	
CGI INC	53	63	468	35,904	ソフトウェア・サービス	
CI FINANCIAL CORP	51	51	68	5,245	各種金融	
CAMECO CORP	74	112	116	8,961	エネルギー	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	21	87	6,740	不動産	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	94	116	916	70,196	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	154	185	2,008	153,846	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	258	311	489	37,526	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	29	35	1,086	83,211	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	13	13	112	8,583	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD A	25	37	123	9,435	公益事業	

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CANOPY GROWTH CORP	41	50	102	7,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CENOVUS ENERGY INC	213	249	60	4,608	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	5	637	48,866	ソフトウェア・サービス
CRONOS GROUP INC	38	38	34	2,625	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOLLARAMA INC	66	79	322	24,677	小売
EMERA INC	13	58	313	23,991	公益事業
EMPIRE CO LTD 'A'	36	48	131	10,056	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	330	—	—	—	エネルギー
ENBRIDGE INC	287	387	1,548	118,636	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	7	286	21,961	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	31	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	46	62	4,763	不動産
FIRST CAPITAL REALTY INC	28	—	—	—	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	134	165	115	8,870	素材
FORTIS INC	86	115	603	46,238	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	38	49	678	51,977	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	40	50	90	6,897	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	192	—	—	—	素材
GREAT-WEST LIFE CO INC	57	72	169	12,993	保険
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	26	26	22	1,704	不動産
HUSKY ENERGY INC	70	70	22	1,728	エネルギー
HYDRO ONE LTD	62	81	204	15,660	公益事業
IGM FINANCIAL INC	21	21	50	3,844	各種金融
IA FINANCIAL CORP INC	26	26	110	8,490	保険
IMPERIAL OIL LTD	58	58	86	6,615	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	30	37	427	32,740	保険
INTER PIPELINE LTD	92	92	72	5,525	エネルギー
KEYERA CORP	49	49	57	4,398	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	278	337	194	14,899	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	—	66	285	21,880	素材
LOBLAW COMPANIES LTD	45	45	312	23,964	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	147	147	73	5,663	素材
MAGNA INTERNATIONAL INC	77	77	349	26,736	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	421	509	866	66,336	保険
METHANEX CORP	19	19	32	2,498	素材
METRO INC	50	67	383	29,366	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	67	88	458	35,136	銀行
NEWMONT CORP	—	63	412	31,572	素材
NUTRIEN LTD	131	143	660	50,571	素材
ONEX CORPORATION	20	20	102	7,836	各種金融
OPEN TEXT CORP	58	72	349	26,765	ソフトウェア・サービス
OVINTIV INC	—	66	22	1,742	エネルギー
PARKLAND FUEL CORP	—	37	92	7,099	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	102	144	342	26,211	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	76	145	312	23,908	保険
POWER FINANCIAL CORP	50	—	—	—	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	39	39	27	2,139	エネルギー
QUEBECOR INC -CL B	—	41	128	9,826	メディア・娯楽
RESTAURANT BRANDS INTERNATIO	50	74	423	32,439	消費者サービス
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	33	33	53	4,102	不動産
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	77	94	541	41,466	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	302	371	3,153	241,548	銀行
SNC-LAVALIN GROUP	39	—	—	—	資本財
SAPUTO INC	50	66	219	16,830	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	47	—	—	—	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	102	125	279	21,431	メディア・娯楽
SHOPIFY INC - CLASS A	19	27	1,651	126,474	ソフトウェア・サービス
SMARTCENTRES REIT VAR VT UN	17	17	31	2,418	不動産
STARS GROUP INC/THE	42	58	149	11,440	消費者サービス
SUN LIFE FINANCIAL INC	130	154	681	52,184	保険
SUNCOR ENERGY INC	342	401	761	58,355	エネルギー

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
TC ENERGY CORP	—	242	1,412	108,194	エネルギー
TECK RESOURCES LTD-CLS B	111	111	109	8,371	素材
TELUS CORP	41	106	229	17,549	電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	57	57	545	41,772	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	383	469	2,745	210,342	銀行
TOURMALINE OIL CORP	60	—	—	—	エネルギー
TRANSCANADA CORPORATION	192	—	—	—	エネルギー
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	221	—	—	—	素材
VERMILION ENERGY INC	34	—	—	—	エネルギー
WSP GLOBAL INC	22	29	219	16,791	資本財
WEST FRASER TIMBER CO. LTD.	16	16	42	3,273	素材
WESTON (GEORGE) LTD	15	19	191	14,675	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	99	118	465	35,676	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 9,025	10,201	38,844	2,975,482	
	銘柄 数 < 比 率 > 92銘柄	90銘柄	—	< 3.1% >	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	39	46	969	115,925	耐久消費財・アパレル
FRESENIUS SE & CO KGAA	90	109	371	44,451	ヘルスケア機器・サービス
UNITEDINTERNET AG-REG SHARE	25	25	67	8,050	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	12	19	63	7,551	素材
HANNOVER RUECK SE	13	16	206	24,671	保険
GEA GROUP AG	36	36	65	7,833	資本財
CONTINENTAL AG	23	29	186	22,253	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG	205	258	635	76,019	運輸
AXEL SPRINGER SE	11	—	—	—	メディア・娯楽
MERCK KGAA	26	34	305	36,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	110	153	354	42,344	公益事業
SAP SE	206	254	2,588	309,475	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	470	586	560	66,967	公益事業
HENKEL AG + CO KGAA	20	24	160	19,206	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	1	19	106	12,688	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	196	254	1,343	160,583	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	38	46	334	40,046	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	193	238	1,013	121,152	素材
BEIERSDORF AG	21	26	249	29,832	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	4	4	27	3,291	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	29	35	131	15,670	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE	44	56	327	39,174	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	90	108	1,640	196,070	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	47	67	59	7,142	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	31	37	682	81,539	保険
VOLKSWAGEN AG	6	7	97	11,685	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	39	48	511	61,120	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	192	236	644	77,075	自動車・自動車部品
THYSSENKRUPP AG	89	89	41	4,990	素材
SIEMENS AG	160	198	1,493	178,543	資本財
1 AND 1 DRILLISCH AG	12	—	—	—	電気通信サービス
DEUTSCHE BANK AG -REG	413	516	302	36,113	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	70	86	396	47,345	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10	16	59	7,120	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	710	866	1,037	124,067	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	7	9	208	24,907	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	245	327	443	52,980	半導体・半導体製造装置
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	—	9	82	9,862	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	39	49	622	74,387	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE(PFD)	31	36	137	16,403	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	9	9	37	4,467	運輸
WIRECARD AG	24	30	308	36,906	ソフトウェア・サービス
LANXESS	19	19	70	8,376	素材
MTU AERO ENGINES AG	11	13	187	22,440	資本財

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
DEUTSCHE WOHNEN SE	77	94	324	38,767	不動産
SYMRISE AG	26	33	279	33,375	素材
BRENTAG AG	34	41	135	16,200	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	31	47	87	10,463	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	126	243	53	6,382	電気通信サービス
HUGO BOSS AG-ORD	13	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	218	274	93	11,165	銀行
OSRAM LICHT AG	17	—	—	—	資本財
KION GROUP AG	14	14	57	6,892	資本財
VONOVIA SE	102	134	605	72,341	不動産
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	46	—	—	—	メディア・娯楽
KNORR-BREMSE AG	—	11	85	10,170	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	29	36	130	15,579	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	33	33	24	2,909	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE-NEW	28	—	—	—	公益事業
ZALANDO SE	23	37	124	14,834	小売
COVESTRO AG	39	45	125	14,946	素材
UNIPER SE	44	54	124	14,937	公益事業
DELIVERY HERO SE	20	28	187	22,454	小売
小 計	株 数 ・ 金 額 5,016	6,198	21,569	2,578,655	
	銘柄 数 < 比 率 > 61銘柄	57銘柄	—	< 2.7% >	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ASSICURAZIONI GENERALI	253	274	339	40,633	保険
INTESA SANPAOLO	3,191	3,882	570	68,259	銀行
MEDIOBANCA SPA	139	139	69	8,289	銀行
ENEL SPA	1,736	2,110	1,348	161,155	公益事業
ENI SPA	538	664	570	68,218	エネルギー
SNAM SPA	459	536	221	26,509	公益事業
TELECOM ITALIA SPA	2,355	2,355	84	10,138	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC	1,307	1,307	46	5,607	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	103	117	125	14,953	運輸
TERNA SPA	287	374	216	25,828	公益事業
RECORDATI SPA	22	28	112	13,425	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEONARDO SPA	85	85	51	6,123	資本財
PRYSMIAN SPA	55	55	84	10,135	資本財
MONCLER SPA	37	44	151	18,132	耐久消費財・アパレル
FINECOBANK SPA	—	151	127	15,203	銀行
UNICREDIT SPA	428	526	382	45,770	銀行
POSTE ITALIANE SPA	116	142	112	13,493	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	132	132	88	10,521	食品・飲料・タバコ
PIRELLI & C SPA	89	89	29	3,556	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額 11,340	13,017	4,734	565,957	
	銘柄 数 < 比 率 > 18銘柄	19銘柄	—	< 0.6% >	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BOUYGUES SA	42	59	164	19,701	資本財
VEOLIA ENVIRONNEMENT	112	142	281	33,593	公益事業
L OREAL	53	65	1,603	191,746	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	58	71	2,519	301,224	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	0.59	0.59	41	4,972	資本財
THALES SA	22	28	207	24,776	資本財
CAPGEMINI	32	41	326	39,052	ソフトウェア・サービス
CASINO GUICHARD PERRACHON	11	11	40	4,795	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	12	15	143	17,111	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PUBLICIS GROUPE	44	58	135	16,226	メディア・娯楽
FAURECIA	16	16	45	5,393	自動車・自動車部品
ICADE	7	7	56	6,762	不動産
BOLLORE	183	185	44	5,352	メディア・娯楽
MICHELIN (CGDE)-B	34	44	343	41,052	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	45	55	723	86,455	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	38	45	78	9,360	自動車・自動車部品

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
REMY COINTREAU	5	5	58	6,987	食品・飲料・タバコ	
SEB SA	3	5	60	7,239	耐久消費財・アパレル	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	117	143	1,137	136,009	資本財	
VIVENDI SA	218	210	383	45,822	メディア・娯楽	
ORANGE S. A.	428	520	583	69,773	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	6	8	529	63,255	耐久消費財・アパレル	
BIC	6	—	—	—	商業・専門サービス	
DASSAULT SYSTEMES SA	26	34	457	54,687	ソフトウェア・サービス	
KERING	16	19	948	113,399	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	36	36	31	3,763	保険	
CARREFOUR SA	129	160	228	27,289	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	19	23	141	16,912	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	236	292	2,352	281,193	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR SA	39	47	118	14,185	消費者サービス	
SOCIETE GENERAL-A	163	212	328	39,282	銀行	
TELEPERFORMANCE	12	15	279	33,403	商業・専門サービス	
EURAZEO	10	11	46	5,579	各種金融	
SODEXO	18	21	125	15,010	消費者サービス	
AXA	409	503	771	92,281	保険	
PEUGEOT SA	121	156	184	22,054	自動車・自動車部品	
JC DECAUX SA	17	17	27	3,250	メディア・娯楽	
ESSILORLUXOTTICA	61	73	734	87,763	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE	249	306	204	24,506	銀行	
BNP PARIBAS	237	292	826	98,819	銀行	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	108	129	278	33,285	資本財	
WENDEL	5	5	42	5,075	各種金融	
KLEPIERRE	40	49	90	10,804	不動産	
GECINA SA	9	12	149	17,924	不動産	
COVIVIO	10	11	58	7,029	不動産	
ILIAD SA	4	4	63	7,569	電気通信サービス	
IMERYS	8	—	—	—	素材	
SAFRAN SA	70	85	724	86,567	資本財	
ENGIE	388	477	451	53,944	公益事業	
ALSTOM	30	46	174	20,894	資本財	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	37	37	33	4,050	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE	120	147	102	12,253	公益事業	
IPSEN	8	8	38	4,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	13	16	100	12,009	素材	
LEGRAND SA	58	69	402	48,158	資本財	
EIFFAGE	16	21	139	16,680	資本財	
TOTAL SA	511	621	2,087	249,602	エネルギー	
ADP	6	6	59	7,170	運輸	
NATIXIS	188	263	82	9,812	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	17	24	166	19,876	メディア・娯楽	
SCOR SE	32	39	79	9,482	保険	
REXEL SA	58	—	—	—	資本財	
VINCI SA	107	133	976	116,699	資本財	
DANONE	130	160	917	109,668	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE	91	122	1,382	165,264	素材	
BUREAU VERITAS SA	55	70	120	14,378	商業・専門サービス	
GETLINK SE	101	101	108	12,964	運輸	
SUEZ	83	83	79	9,474	公益事業	
EDENRED	51	64	244	29,267	ソフトウェア・サービス	
VALEO SA	47	57	83	10,029	自動車・自動車部品	
BIOMERIEUX	9	9	99	11,847	ヘルスケア機器・サービス	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21	29	144	17,331	不動産	
WORLDLINE SA	—	31	167	20,057	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	6	6	119	14,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	13	13	71	8,552	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,778	6,935	27,157	3,246,620	
	銘柄 数 < 比 率 >	74銘柄	72銘柄	—	< 3.4% >	

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AIRBUS SE	123	151	924	110,559	資本財	
RANDSTAD NV	27	27	84	10,151	商業・専門サービス	
WOLTERS KLUWER	61	71	446	53,341	商業・専門サービス	
VOPAK	12	18	85	10,168	エネルギー	
AEGON NV	402	433	101	12,092	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	677	950	203	24,369	電気通信サービス	
STMICROELECTRONS NV	141	179	348	41,626	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	197	235	864	103,386	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	55	67	494	59,168	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	23	30	206	24,686	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	37	47	492	58,906	素材	
UNILEVER NV-CVA	324	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
UNILEVER NV	—	380	1,664	199,050	家庭用品・パーソナル用品	
ASML HOLDING NV	86	110	2,697	322,531	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	259	287	617	73,801	食品・生活必需品小売り	
FERRARI NV	26	31	439	52,534	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	200	241	124	14,831	資本財	
AKZO NOBEL	46	52	325	38,906	素材	
PROSUS NV	—	126	792	94,757	小売	
NN GROUP NV	68	82	201	24,039	保険	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	233	292	184	22,035	自動車・自動車部品	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	—	27	190	22,723	小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	87	101	74	8,864	銀行	
EXOR NV	24	29	136	16,363	各種金融	
ALTICE EUROPE NV	—	174	60	7,175	メディア・娯楽	
QIAGEN N.V.	50	60	219	26,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV	1	2	217	26,049	ソフトウェア・サービス	
ING GROEP NV-CVA	830	1,016	507	60,679	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	4,000 24銘柄	5,230 27銘柄	12,706 —	1,519,096 <1.6%>	
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ENDESA SA	70	85	165	19,773	公益事業	
BANKINTER SA	122	165	52	6,245	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	1,412	1,740	508	60,772	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	77	77	121	14,577	公益事業	
REPSOL SA	291	348	264	31,615	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	3,422	4,317	956	114,308	銀行	
TELEFONICA SA	989	1,220	505	60,384	電気通信サービス	
ENAGAS	46	61	109	13,129	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	50	65	88	10,605	資本財	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	51	63	104	12,459	資本財	
FERROVIAL SA	107	128	276	33,028	資本財	
MAPFRE SA	248	248	38	4,627	保険	
BANCO DE SABADELL SA	1,065	1,393	63	7,596	銀行	
CAIXABANK S.A	717	852	142	17,042	銀行	
IBERDROLA SA	1,312	1,597	1,391	166,298	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	93	112	491	58,773	ソフトウェア・サービス	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	86	103	175	21,004	公益事業	
INDITEX	234	284	645	77,203	小売	
AENA SME SA	14	16	162	19,461	運輸	
CELLNEX TELECOM SA	—	66	280	33,511	電気通信サービス	
GRIFOLS SA	67	79	245	29,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANKIA SA	273	273	28	3,416	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	10,755 21銘柄	13,303 22銘柄	6,819 —	815,213 <0.9%>	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KBC GROEP NV	50	65	265	31,742	銀行	
SOLVAY SA	14	17	116	13,892	素材	
UCB SA	25	33	253	30,263	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	11	11	56	6,773	食品・生活必需品小売り	

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	15	19	136	16,341	各種金融
PROXIMUS	33	33	72	8,617	電気通信サービス
GALAPAGOS NV	—	12	210	25,151	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELENET GROUP HOLDING NV	8	8	25	3,049	メディア・娯楽
AGEAS	38	43	151	18,145	保険
UMICORE	43	52	161	19,337	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	162	198	771	92,226	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	404 10銘柄	496 11銘柄	2,221 —	265,541 <0.3%>
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
OMV AG	30	35	89	10,665	エネルギー
VERBUND AG	16	16	53	6,410	公益事業
VOESTALPINE AG	23	23	42	5,136	素材
ERSTE GROUP BANK AG	59	71	121	14,570	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	32	32	43	5,259	銀行
ANDRITZ AG	15	15	42	5,080	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	177 6銘柄	194 6銘柄	394 —	47,124 <0.0%>
(ユーロ…ルクセンブルク)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EUROFINS SCIENTIFIC	2	2	120	14,412	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA	97	97	54	6,487	エネルギー
SES	71	90	47	5,683	メディア・娯楽
RTL GROUP	8	—	—	—	メディア・娯楽
AROUNDTOWN SA	170	295	127	15,233	不動産
ARCELORMITTAL	135	156	125	14,947	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	486 6銘柄	643 5銘柄	474 —	56,764 <0.1%>
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ	99	99	64	7,667	資本財
UPM-KYMMENE OYJ	116	140	327	39,170	素材
ENSO OY-R SHS	107	157	138	16,519	素材
SAMPO OYJ-A SHS	96	116	300	35,906	保険
FORTUM OYJ	97	119	156	18,685	公益事業
ELISA OYJ	29	37	208	24,936	電気通信サービス
METSO OYJ	19	30	62	7,417	資本財
NOKIA OYJ	1,194	1,478	404	48,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	27	111	313	37,509	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	20	29	55	6,606	自動車・自動車部品
KONE OYJ	73	89	450	53,868	資本財
ORION OYJ	21	28	105	12,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORDEA BANK ABP	—	10	5	610	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,904 12銘柄	2,447 13銘柄	2,591 —	309,860 <0.3%>
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CRH PLC	169	206	483	57,763	素材
KINGSPAN GROUP PLC	33	40	188	22,519	資本財
KERRY GROUP PLC-A	32	41	428	51,186	食品・飲料・タバコ
IRISH BANK RESOLUTION CORPORATION	97	97	—	—	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	47	55	137	16,388	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	187	236	42	5,073	銀行
AIB GROUP PLC	183	183	18	2,214	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	16	20	154	18,458	消費者サービス
RYANAIR HOLDINGS PLC	36	—	—	—	運輸
LINDE PLC	57	57	909	108,734	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	861 10銘柄	940 9銘柄	2,361 —	282,340 <0.3%>
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO ESPRITO SANTO-REG	346	346	4	497	銀行
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	554	677	240	28,710	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	104	123	122	14,700	エネルギー

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ポルトガル)	百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS	44	63	101	12,129	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 1,050	1,211	468	56,037	
	銘柄数 <比率> 4銘柄	4銘柄	—	<0.1%>	
(ユーロ…その他)	百株	百株	千ユーロ	千円	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	39	39	129	15,450	食品・飲料・タバコ
TECHNIPFMC PLC	43	43	25	3,083	エネルギー
RELX PLC	197	197	384	45,941	商業・専門サービス
BGP HOLDINGS PLC	2,938	2,938	—	—	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額 3,219	3,219	539	64,474	
	銘柄数 <比率> 4銘柄	4銘柄	—	<0.1%>	
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 44,996	53,839	82,038	9,807,686	
	銘柄数 <比率> 250銘柄	249銘柄	—	<10.3%>	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	82	109	79	10,653	素材
ASHTAD GROUP PLC	98	113	185	24,740	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	207	244	108	14,506	耐久消費財・アパレル
BRITISH LAND COMPANY PLC	197	197	64	8,554	不動産
AVIVA PLC	839	1,033	276	36,883	保険
DIAGEO PLC	517	608	1,566	208,874	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	27	27	68	9,138	各種金融
DCC PLC	18	23	122	16,284	資本財
BAE SYSTEMS PLC	684	838	426	56,829	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	397	509	1,341	178,838	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	—	101	188	25,192	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HAMMERSON PLC	148	—	—	—	不動産
STANDARD CHARTERED PLC	574	713	324	43,323	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	196	248	331	44,181	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	4,244	5,259	2,433	324,388	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,279	1,570	301	40,243	保険
MEGGITT PLC	162	162	43	5,835	資本財
MORRISON (WM) SUPERMARKETS	493	652	118	15,863	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	72	94	165	22,068	食品・飲料・タバコ
PEARSON PLC	165	212	119	15,916	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	61	85	155	20,704	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	553	677	678	90,496	保険
RIO TINTO PLC - REG	247	292	1,074	143,188	素材
ST JAMES' S PLACE PLC	112	145	109	14,602	各種金融
SSE PLC	219	271	343	45,747	公益事業
BP PLC	4,251	5,253	1,700	226,645	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	15,018	18,246	611	81,490	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	678	811	95	12,691	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	2,084	2,554	595	79,400	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	181	229	330	44,122	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,042	1,292	1,915	255,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	52	52	35	4,689	資本財
BABCOCK INTL GROUP PLC	43	—	—	—	商業・専門サービス
ASTRAZENECA PLC	266	339	2,413	321,752	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	1,758	2,211	264	35,210	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	37	37	33	4,507	消費者サービス
MARKS & SPENCER PLC	299	397	39	5,250	小売
BARCLAYS PLC	3,629	4,513	424	56,568	銀行
INTERTEK GROUP PLC	32	42	198	26,473	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	90	109	143	19,136	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	27	33	132	17,619	小売
KINGFISHER PLC	465	576	82	10,963	小売
ITV PLC	676	884	55	7,358	メディア・娯楽
SAINSBURY (J) PLC	378	484	101	13,568	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	317	317	27	3,700	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	41	51	114	15,205	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS	23	29	107	14,393	耐久消費財・アパレル

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
CENTRICA PLC	1,241	1,241	47	6,351	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	964	1,083	1,436	191,496	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	786	968	1,222	162,975	エネルギー
BUNZL PLC	72	90	141	18,801	資本財
RENTOKIL INITIAL PLC	—	493	190	25,409	商業・専門サービス
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	63	82	600	80,114	各種金融
UNILEVER PLC	233	287	1,156	154,177	家庭用品・パーソナル用品
TUI AG-DI	105	105	38	5,154	消費者サービス
INVESTEC PLC	136	—	—	—	各種金融
EXPERIAN PLC	190	237	556	74,220	商業・専門サービス
MONDI PLC	77	117	157	21,037	素材
NEW SEVERN TRENT PLC	45	58	135	18,024	公益事業
NEW WHITBREAD PLC	36	32	97	12,955	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	58	81	111	14,842	各種金融
SMITHS GROUP PLC	79	95	106	14,207	資本財
ANGLO AMERICAN PLC	216	269	361	48,152	素材
3I GROUP PLC	201	258	197	26,330	各種金融
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	141	184	1,142	152,298	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	217	306	528	70,502	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	41	—	—	—	素材
UNITED UTILITIES GROUP PLC	136	165	156	20,850	公益事業
OCADO GROUP PLC	—	121	150	20,045	小売
GLENCORE PLC	2,445	2,798	333	44,402	素材
WOOD GROUP (JOHN) PLC	132	—	—	—	エネルギー
GVC HOLDINGS PLC	107	148	74	9,880	消費者サービス
SEGR0 PLC	242	290	217	29,013	不動産
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	349	462	148	19,819	資本財
EVRAZ PLC	—	116	26	3,520	素材
NMC HEALTH PLC	22	22	20	2,797	ヘルスケア機器・サービス
EASYJET PLC	28	28	15	2,077	運輸
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	1,051	1,167	137	18,276	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	221	290	174	23,245	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	273	336	173	23,107	メディア・娯楽
COCA-COLA HBC AG-CDI	45	45	74	9,956	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	—	16	58	7,745	ソフトウェア・サービス
CONVATEC GROUP PLC	252	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
COMPASS GROUP PLC	339	414	493	65,828	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	52	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NATIONAL GRID PLC	705	905	863	115,162	公益事業
ROYAL MAIL PLC	174	—	—	—	運輸
MERLIN ENTERTAINME	150	—	—	—	消費者サービス
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	565	565	126	16,801	各種金融
WORLDPAY INC-CLASS A	23	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FERGUSON PLC	50	—	—	—	資本財
BHP GROUP PLC	446	549	669	89,301	素材
VODAFONE GROUP PLC	5,703	6,962	796	106,142	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROU	38	46	157	20,932	消費者サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	—	43	17	2,316	ソフトウェア・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	31	133	17,761	素材
FERGUSON PLC	—	59	293	39,173	資本財
M&G PLC	—	600	70	9,412	各種金融
RSA INSURANCE GROUP PLC	199	248	104	13,878	保険
INFORMA PLC	251	296	125	16,736	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC	218	218	96	12,886	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	—	19	160	21,451	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	315	315	87	11,639	保険
LAND SECURITIES GROUP PLC	164	164	90	12,003	不動産
JD SPORTS FASHION PLC	—	112	51	6,870	小売
CRODA INTERNATIONAL PLC	27	—	—	—	素材

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
MELROSE INDUSTRIES PLC	1,077	1,309	114	15,271	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	43	52	94	12,581	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	63,765 97銘柄	77,587 96銘柄	34,587 —	4,611,165 < 4.9% >	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
SGS SOC GEN SURVEILLANCE-R	1	1	357	40,500	商業・専門サービス	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.53	0.75	146	16,548	食品・飲料・タバコ	
SWISSCOM AG-REG	5	6	365	41,323	電気通信サービス	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	0.21	0.26	197	22,326	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	245	27,781	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	2	2	716	81,168	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	31	38	1,291	146,196	保険	
NOVARTIS AG-REG SHS	459	555	4,325	489,648	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	382	479	798	90,383	資本財	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	148	181	5,612	635,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG (REG)	30	37	139	15,793	商業・専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	99	129	442	50,061	素材	
CLARIANT AG-REG	50	50	80	9,142	素材	
NESTLE SA-REGISTERED	648	769	7,680	869,532	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG	9	11	146	16,587	保険	
TEMENOS GROUP AG-REG	12	17	215	24,383	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG-REG	12	13	229	26,031	ヘルスケア機器・サービス	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	2	2	175	19,844	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG	543	668	534	60,490	各種金融	
THE SWATCH GROUP AG-B	6	7	139	15,782	耐久消費財・アパレル	
THE SWATCH GROUP AG-REG	10	10	39	4,443	耐久消費財・アパレル	
LONZA AG-REG	16	19	764	86,533	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	7	8	287	32,511	保険	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1	2	131	14,941	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	15	18	174	19,761	不動産	
PARGESA HOLDING SA-BR	6	9	63	7,219	各種金融	
DUFREY AG-REG	8	8	26	3,022	小売	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	3	4	327	37,084	各種金融	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8	10	224	25,441	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	4	5	108	12,263	資本財	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	10	13	172	19,479	運輸	
GEBERIT AG-REG	7	9	412	46,668	資本財	
JULIUS BAER GROUP LTD	44	59	196	22,295	各種金融	
SWISS RE AG	65	77	541	61,313	保険	
CIE FINANCIERE RICHEMON-RE	110	136	708	80,221	耐久消費財・アパレル	
SIKA AG-REG	27	33	527	59,670	素材	
ALCON INC	—	108	529	59,967	ヘルスケア機器・サービス	
UBS GROUP AG	813	1,004	910	103,026	各種金融	
VIFOR PHARMA AG	8	11	141	16,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 < 比率 >	3,618 38銘柄	4,528 39銘柄	30,128 —	3,410,812 < 3.6% >	
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
LUNDBERGS AB-B SHS	12	20	805	8,708	各種金融	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	343	429	2,840	30,704	銀行	
SWEDBANK AB-A SHARES	193	239	2,586	27,956	銀行	
SWEDISH MATCH AB	34	42	2,272	24,565	食品・飲料・タバコ	
SECURITAS AB-B SHS	68	68	723	7,820	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	98	119	5,342	57,756	各種金融	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	182	206	2,527	27,327	小売	
ERICSSON LM-B SHS	638	802	6,312	68,239	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA COMPANY AB	599	667	2,370	25,619	電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	78	91	1,351	14,604	資本財	
LUNDIN PETROLEUM AB	40	40	696	7,526	エネルギー	
ALFA LAVAL AB	59	78	1,345	14,545	資本財	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	12	24	679	7,341	電気通信サービス	

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
ICA GRUPPEN AB	13	22	936	10,125	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	69	105	519	5,619	耐久消費財・アパレル	
ELECTROLUX AB-SER B	55	55	668	7,222	耐久消費財・アパレル	
SKF AB-B SHARES	78	103	1,369	14,801	資本財	
VOLVO AB-B SHS	328	389	4,431	47,900	資本財	
SANDVIK AB	229	296	4,169	45,069	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	35	35	691	7,480	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	52	69	2,854	30,859	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELE2 AB -B SHS	110	134	1,775	19,197	電気通信サービス	
KINNEVIK AB-B	48	—	—	—	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A SHS	144	175	5,810	62,806	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	77	103	2,983	32,255	資本財	
BOLIDEN AB	53	—	—	—	素材	
EPIROC AB-A	134	162	1,601	17,307	資本財	
EPIROC AB-B	77	108	1,069	11,556	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	128	158	4,846	52,396	家庭用品・パーソナル用品	
BOLIDEN AB	—	65	1,122	12,132	素材	
KINNEVIK AB - B	—	59	968	10,469	各種金融	
ELECTROLUX PROFESSIONAL AB-B	—	55	134	1,449	耐久消費財・アパレル	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	328	409	3,264	35,286	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	215	262	4,768	51,550	資本財	
NORDEA BANK ABP	654	838	4,564	49,344	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	5,200 32銘柄	6,443 33銘柄	78,404 —	847,549 <0.9%>	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
DNB ASA	197	251	2,836	29,103	銀行	
TELENOR ASA	152	191	2,908	29,838	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	251	264	3,179	32,618	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	36	43	1,412	14,494	素材	
MOWI ASA	87	104	1,634	16,770	食品・飲料・タバコ	
NORSK HYDRO ASA	246	329	731	7,509	素材	
AKER BP ASA	23	23	284	2,915	エネルギー	
ORKLA ASA	158	198	1,831	18,795	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	42	42	733	7,523	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	21	21	392	4,029	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,217 10銘柄	1,470 10銘柄	15,945 —	163,598 <0.2%>	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円		
CARLSBERG AS-B	21	28	2,127	34,068	食品・飲料・タバコ	
A. P. MOLLER MAERSK	1	1	913	14,623	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	0.78	0.78	422	6,768	運輸	
DANSKE BANK A/S	148	169	1,244	19,925	銀行	
GENMAB A/S	13	17	2,314	37,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	43	49	2,701	43,246	資本財	
H LUNDBECK A/S	15	15	289	4,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV PANALPINA A/S	37	55	3,379	54,099	運輸	
PANDORA A/S	22	22	472	7,572	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	21	25	1,282	20,536	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	48	56	1,734	27,772	素材	
COLOPLAST-B	25	31	2,997	47,996	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	382	458	18,558	297,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ISS A/S	32	32	295	4,734	商業・専門サービス	
TRYG A/S	22	33	559	8,954	保険	
ORSTED A/S	39	49	3,343	53,525	公益事業	
DEMANT A/S	22	22	333	5,332	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	899 17銘柄	1,070 17銘柄	42,971 —	687,975 <0.7%>	
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	26	43	256	16,919	ヘルスケア機器・サービス	
AUST&NZ BANKING GROUP LTD	606	738	1,239	81,939	銀行	

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
AMCOR PLC-CDI	229	274	356	23,574	素材
WESTPAC BANKING CORPORATION	723	928	1,501	99,208	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	82	—	—	—	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	315	373	376	24,915	素材
TELSTRA CORPORATION LTD	863	1,109	360	23,828	電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	94	94	60	4,010	銀行
COCA-COLA AMATIL LIMITED	117	117	102	6,750	食品・飲料・タバコ
ASX LTD	37	51	399	26,378	各種金融
BHP GROUP LIMITED	620	764	2,309	152,605	素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	56	56	124	8,253	エネルギー
MIRVAC GROUP	724	1,069	213	14,138	不動産
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	136	136	41	2,744	小売
COMPUTERSHARE LIMITED	97	137	133	8,813	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	95	117	3,678	243,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	9	13	110	7,271	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	577	714	868	57,397	運輸
COCHLEAR LIMITED	12	15	284	18,823	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	392	479	212	14,050	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	376	459	2,936	194,045	銀行
BORAL LIMITED	274	274	55	3,668	素材
RIO TINTO LIMITED	81	97	850	56,229	素材
APA GROUP	257	316	329	21,755	公益事業
ARISTOCRAT LEISURE LTD	120	137	295	19,556	消費者サービス
INSURANSE AUSTRALIA GROUP LTD	467	614	393	25,998	保険
TPG TELECOM LTD	87	87	62	4,128	電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	6	6	6	451	消費者サービス
GENERAL PROPERTY TRUST	348	435	155	10,249	不動産
ORICA LTD	70	93	153	10,116	素材
LENLEASE GROUP	108	140	144	9,558	不動産
BLUESCOPE STEEL LTD	123	123	113	7,472	素材
WORLEY LTD	77	77	46	3,040	エネルギー
SUNCORP GROUP LTD	286	338	307	20,348	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	577	751	1,226	81,031	銀行
NEWCREST MINING LTD	164	202	497	32,849	素材
OIL SEARCH LTD	306	306	71	4,713	エネルギー
INCITEC PIVOT LTD	299	299	58	3,875	素材
AMP LIMITED	600	855	114	7,545	各種金融
QANTAS AIRWAYS LTD	—	190	60	4,026	運輸
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	277	315	271	17,930	保険
CHALLENGER LTD	109	109	43	2,899	各種金融
SANTOS LIMITED	392	392	132	8,768	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LIMITED	97	121	296	19,628	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	27	27	48	3,181	エネルギー
STOCKLAND	548	548	126	8,380	不動産
TABCORP HOLDINGS LIMITED	424	424	103	6,870	消費者サービス
WESFARMERS LTD	241	296	1,062	70,250	小売
ALUMINA LIMITED	441	613	96	6,368	素材
WOODSIDE PETROLEUM LIMITED	191	249	448	29,648	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	273	328	1,254	82,884	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	—	31	132	8,753	各種金融
DEXUS	226	264	238	15,730	不動産
GOODMAN GROUP	348	434	518	34,241	不動産
SEEK LTD	78	78	116	7,728	商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	13	—	—	—	消費者サービス
BRAMBLES LTD	350	382	405	26,796	商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LIMITED	68	88	755	49,954	各種金融
CROWN RESORTS LTD	63	95	68	4,541	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	91	108	203	13,475	素材
TREASURY WINE ESTATES LTD	160	196	193	12,788	食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT	202	270	161	10,646	運輸
AURIZON HOLDINGS LTD	379	484	233	15,460	運輸

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千オーストラリアドル	千円		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD-CDI	144	144	70	4,669	不動産	
SCENTRE GROUP	1,147	1,254	185	12,233	不動産	
COCHLEAR LTD	—	3	42	2,775	ヘルスケア機器・サービス	
AUSNET SERVICES	451	451	78	5,176	公益事業	
MEDIBANK PRIVATE LTD	531	679	191	12,672	保険	
AGL ENERGY LTD	144	173	294	19,475	公益事業	
SOUTH32 LTD	1,063	1,204	223	14,802	素材	
CIMIC GROUP LTD	19	19	45	2,991	資本財	
VICINITY CENTRES	656	656	63	4,228	不動産	
COLES GROUP LTD	228	299	503	33,281	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	—	38	61	4,065	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	19,847 70銘柄	23,834 72銘柄	29,183 —	1,928,711 <2.0%>	
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
RYMAN HEALTHCARE LTD	86	86	88	5,755	ヘルスケア機器・サービス	
A2 MILK CO LTD	156	196	333	21,579	食品・飲料・タバコ	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	127	152	462	29,936	ヘルスケア機器・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	166	166	53	3,441	素材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	324	458	186	12,102	電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	—	190	80	5,221	公益事業	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	204	204	107	6,936	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	311	311	125	8,132	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,377 7銘柄	1,766 8銘柄	1,437 —	93,104 <0.1%>	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	67	67	458	6,443	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	440	560	828	11,636	不動産	
BANK OF EAST ASIA	261	367	596	8,380	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	354	429	3,011	42,282	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	251	312	7,238	101,627	各種金融	
MTR CORP	345	412	1,628	22,858	運輸	
HANG LUNG GROUP LTD	150	—	—	—	不動産	
HANG SENG BANK	155	201	2,633	36,968	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	250	352	1,015	14,257	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	280	370	1,687	23,688	公益事業	
THE WHARF (HOLDINGS)	266	—	—	—	不動産	
HONG KONG & CHINA GAS	1,997	2,663	3,228	45,327	公益事業	
HYSAN DEVELOPMENT CO	112	—	—	—	不動産	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	510	560	2,273	31,921	消費者サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	160	160	306	4,304	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	750	980	2,067	29,031	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	335	335	252	3,551	資本財	
PCCW LTD	910	910	380	5,340	電気通信サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	150	150	176	2,472	耐久消費財・アパレル	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,355	1,645	1,340	18,825	不動産	
SHANGRI-LA ASIA LTD	223	—	—	—	消費者サービス	
SINO LAND CO	647	807	739	10,379	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	330	415	4,108	57,683	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	115	115	559	7,855	不動産	
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	—	180	417	5,863	食品・飲料・タバコ	
WHELOCK & CO LTD	160	210	1,086	15,257	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	265	365	1,784	25,059	資本財	
LINK REIT	455	549	3,541	49,716	不動産	
MINTH GROUP LTD	160	—	—	—	自動車・自動車部品	
SJM HOLDINGS LTD	400	400	258	3,622	消費者サービス	
WYNN MACAU LTD	300	440	522	7,338	消費者サービス	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	200	—	—	—	消費者サービス	
AIA GROUP LTD	2,536	3,130	21,330	299,486	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD	880	880	918	12,898	電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	536	644	1,803	25,316	消費者サービス	

銘柄	期首 (前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
SWIRE PROPERTIES LTD	210	290	604	8,489	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	266	326	993	13,947	不動産	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	422	707	534	7,506	公益事業	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	—	365	729	10,238	食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	1,940	2,335	1,643	23,079	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	557	707	3,641	51,124	資本財	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LIMITED	130	185	733	10,298	公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LTD	552	682	2,778	39,014	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	20,387 41銘柄	24,209 37銘柄	77,855 —	1,093,095 <1.2%>	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	280	390	115	8,845	資本財	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	966	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	381	468	856	65,406	銀行	
CITY DEVELOPMENTS	80	119	83	6,361	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	20	20	37	2,897	小売	
SATS LTD	108	108	34	2,639	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	170	218	194	14,850	各種金融	
CAPITALAND LIMITED	530	695	191	14,649	不動産	
CAPITALAND MALL TRUST	608	608	106	8,125	不動産	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	523	779	211	16,136	不動産	
COMFORTDELGRO CORP LTD	480	480	71	5,425	運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	96	136	78	6,024	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	290	330	633	48,413	銀行	
UOL GROUP LIMITED	76	133	85	6,510	不動産	
VENTURE CORP LTD	60	60	79	6,048	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	536	756	112	8,606	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	337	337	59	4,562	メディア・娯楽	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,717	2,144	519	39,641	電気通信サービス	
SUNTEC REIT	420	420	52	3,977	不動産	
SEMBCORP INDUSTRIES LIMITED	221	221	34	2,657	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	669	864	736	56,281	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	400	525	161	12,308	食品・飲料・タバコ	
KEPPEL CORP	294	360	188	14,406	資本財	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	610	610	50	3,866	資本財	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	528	96	7,338	不動産	
GENTING SINGAPORE LTD	1,248	1,248	79	6,099	消費者サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	11,124 25銘柄	12,561 25銘柄	4,872 —	372,080 <0.4%>	
(イスラエル)	百株	百株	千イスラエルシェケル	千円		
BANK HAPOLIM BM	213	305	634	19,332	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	332	391	743	22,646	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	460	—	—	—	電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	3	6	274	8,361	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	—	268	273	8,330	銀行	
ISRAEL CHEMICALS LTD	166	166	181	5,536	素材	
NICE LTD	12	16	892	27,197	ソフトウェア・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	176	176	517	15,754	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	27	27	182	5,554	銀行	
AZRIELI GROUP	7	11	221	6,731	不動産	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	2	2	97	2,954	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,401 10銘柄	1,370 10銘柄	4,018 —	122,399 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	249,109 1,327銘柄	299,036 1,338銘柄	— —	90,593,133 <95.4%>	

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

(注2) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

(注3) 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、株数が単位未満の場合は小数で記載。

(注4) —印は組み入れなし。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
		百万円	百万円
外	S&P500 EMINI	3,196	—
	S&PTSE60 1006	157	—
	SWISS MKT IX	192	—
国	EURX50 1006	502	—
	SPI200 1006	120	—
	FTSE100 IDX	266	—

(注1) 単位未満は切り捨て。

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

(注3) ー印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成(2020年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円	%
株 式	90,593,133	87.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,626,763	12.2
投 資 信 託 財 産 総 額	103,219,896	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(94,922,644千円)の投資信託財産総額(103,219,896千円)に対する比率は92.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年3月31日における邦貨換算レートは1米ドル=108.83円、1カナダドル=76.60円、1ユーロ=119.55円、1英ポンド=133.32円、1スイスフラン=113.21円、1スウェーデンクローナ=10.81円、1ノルウェークローネ=10.26円、1デンマーククローネ=16.01円、1オーストラリアドル=66.09円、1ニュージーランドドル=64.76円、1香港ドル=14.04円、1シンガポールドル=76.37円、1イスラエルシェケル=30.46円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	103,421,206,587円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	10,859,079,824
株 式(評価額)	90,593,133,862
未 収 入 金	442,626,970
未 収 配 当 金	159,783,515
差 入 委 託 証 拠 金	1,366,582,416
(B) 負 債	8,481,483,812
未 払 金	8,144,782,342
未 払 解 約 金	336,700,000
未 払 利 息	1,017
そ の 他 未 払 費 用	453
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	94,939,722,775
元 本	43,196,918,916
次 期 繰 越 損 益 金	51,742,803,859
(D) 受 益 権 総 口 数	43,196,918,916口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,978円

(注1) 当ファンドの期首元本額は36,117,425,950円、期中追加設定元本額は9,579,733,820円、期中一部解約元本額は2,500,240,854円です。

(注2) 元本の内訳

日立外国株式特化型ファンド(非課税適格機関投資家専用)

25,752,281,545円

日立外国株式インデックスファンド

12,168,503,138円

日立バランスファンド(株式70)

2,970,928,164円

日立バランスファンド(株式50)

1,922,454,827円

日立バランスファンド(株式30)

382,751,242円

(注3) 1口当たり純資産額は2,1978円です。

■損益の状況

当期(自2019年4月2日 至2020年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,117,912,951円
受 取 配 当 金	2,096,241,869
受 取 利 息	3,428,362
そ の 他 収 益 金	18,312,934
支 払 利 息	△70,214
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△12,975,199,358
売 買 益	5,059,041,446
売 買 損	△18,034,240,804
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△152,664,484
取 引 益	878,677,406
取 引 損	△1,031,341,890
(D) 信 託 報 酬 等	△44,186,062
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△11,054,136,953
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	53,756,082,211
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	12,981,596,852
(H) 解 約 差 損 益 金	△3,940,738,251
(I) 計 (E+F+G+H)	51,742,803,859
次 期 繰 越 損 益 金(I)	51,742,803,859

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

(注2) 損益の状況の中で(D)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) 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

日立外国債券インデックスマザーファンド

■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 比率	純資産 総額
	円	騰落率			
16期(2016年3月31日)	21,780	△3.4	98.7	—	百万円 31,196
17期(2017年3月31日)	20,758	△4.7	98.9	—	29,623
18期(2018年4月2日)	21,500	3.6	98.9	—	31,109
19期(2019年4月1日)	22,105	2.8	99.1	—	39,970
20期(2020年3月31日)	23,297	5.4	99.0	—	41,812

(注) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)		債券組入 比率	債券先物 比率
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2019年 4月 1日	22,105	—	23,154	—	99.1	—
4月末	22,040	△0.3	23,091	△0.3	98.9	—
5月末	21,865	△1.1	22,907	△1.1	98.8	—
6月末	22,150	0.2	23,203	0.2	98.9	—
7月末	22,214	0.5	23,273	0.5	99.0	—
8月末	22,365	1.2	23,427	1.2	99.0	—
9月末	22,468	1.6	23,537	1.7	99.0	—
10月末	22,688	2.6	23,769	2.7	99.0	—
11月末	22,703	2.7	23,783	2.7	98.8	—
12月末	22,801	3.1	23,887	3.2	99.0	—
2020年 1月末	22,984	4.0	24,085	4.0	98.9	—
2月末	23,259	5.2	24,361	5.2	98.9	—
(期末) 2020年 3月31日	23,297	5.4	24,370	5.3	99.0	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買い建て比率－売り建て比率。

(注3) FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE世界国債インデックスを基に、日立投資顧問が計算したものでファンド設定日前日である2001年3月28日を10,000としています。FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCが開発した債券指数です。

■1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項目	当期
	(2019.4.2～2020.3.31)
	金額
(a) その他費用 (保管費用)	3円 (3)
(その他)	(0)
合計	3

(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。

(a) その他費用は、期中の各金額を各月末現在の受益権口数の単純平均で除したものです。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買及び取引の状況(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

公社債

			買 付 額	売 付 額	
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 39,500	千米ドル 33,771	
	カナダ	国債証券	千カナダドル 1,823	千カナダドル 1,614	
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 9,880	千メキシコペソ 4,579	
	ユー ロ	ドイツ	国債証券	千ユーロ 3,476	千ユーロ 3,877
		イタリア	国債証券	4,046	3,400
		フランス	国債証券	4,746	4,538
		オランダ	国債証券	458	637
		スペイン	国債証券	2,292	2,461
		ベルギー	国債証券	934	1,042
		オーストリア	国債証券	539	607
		フィンランド	国債証券	330	513
		アイルランド	国債証券	298	399
	イギリス	国債証券	千英ポンド 2,044	千英ポンド 2,863	
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 317	千スウェーデンクローナ 2,749	
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 1,209	千ノルウェークローネ 961	
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 1,093	千デンマーククローネ 825	
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 1,243	千ポーランドズロチ 1,590	
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 1,150	千オーストラリアドル 1,218	
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 376	千シンガポールドル 101	
マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit 903	千マレーシアリングgit 382		
南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 3,467	千南アフリカランド 1,728		

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切り捨て。

■主要な売買銘柄(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	199,217	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	264,125
2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	179,434	3.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	162,702
1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	177,479	2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	143,524
1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	163,695	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	124,601
2.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	154,683	1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	121,036
1.750% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,976	1.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	116,744
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	153,928	3.500% FRANCE GOV' T(ユーロ・フランス)	104,972
1.625% US TREASURY N/B(アメリカ)	151,535	1.500% US TREASURY N/B(アメリカ)	98,489
1.875% US TREASURY N/B(アメリカ)	149,070	2.250% US TREASURY N/B(アメリカ)	91,019
2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	139,226	2.375% US TREASURY N/B(アメリカ)	90,005

(注1) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 現先取引によるものは含まれておりません。

■利害関係人との取引状況等(2019年4月2日から2020年3月31日まで)

期中における利害関係人との取引はありません。

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

■組入資産の明細(2020年3月31日現在)

公社債

(A) 債券種類別開示

外国(外貨建)公社債

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 170,400	千米ドル 192,003	千円 20,895,747	% 50.0	% —	% 22.7	% 18.5	% 8.7
カナダ	千カナダドル 8,530	千カナダドル 9,812	751,650	1.8	—	0.9	0.6	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 60,900	千メキシコペソ 62,888	287,398	0.7	—	0.3	0.3	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	17,210	21,197	2,534,111	6.1	—	3.5	1.9	0.7
イタリア	25,900	29,748	3,556,489	8.5	—	4.9	2.5	1.1
フランス	26,850	32,988	3,943,809	9.4	—	6.5	2.3	0.7
オランダ	4,980	6,220	743,626	1.8	—	1.2	0.4	0.2
スペイン	15,120	18,443	2,204,939	5.3	—	3.6	1.2	0.4
ベルギー	6,370	8,016	958,430	2.3	—	1.7	0.4	0.1
オーストリア	3,670	4,687	560,376	1.3	—	0.9	0.4	0.0
フィンランド	1,670	1,892	226,304	0.5	—	0.4	0.2	—
アイルランド	2,070	2,413	288,484	0.7	—	0.4	0.2	0.0
イギリス	千英ポンド 13,660	千英ポンド 19,393	2,585,511	6.2	—	5.0	0.9	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 7,850	千スウェーデンクローナ 9,271	100,221	0.2	—	0.1	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 7,610	千ノルウェークローネ 8,052	82,619	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 9,630	千デンマーククローネ 12,499	200,122	0.5	—	0.4	0.0	0.1
ポーランド	千ポーランドズロチ 8,020	千ポーランドズロチ 8,560	225,313	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 9,210	千オーストラリアドル 10,943	723,256	1.7	—	1.2	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 2,020	千シンガポールドル 2,264	172,904	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 7,290	千マレーシアリンギット 7,552	189,858	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 34,280	千南アフリカランド 26,075	157,756	0.4	—	0.3	0.0	0.0
合 計	—	—	41,388,933	99.0	—	55.0	30.8	13.1

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注3) 単位未満は切り捨て。

(注4) —印は組み入れなし。

(注5) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示
 外国(外貨建)公社債銘柄別

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	490	494	53,809	2021/ 2/28
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	690	698	75,996	2021/ 6/30
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,070	1,083	117,921	2021/ 7/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,100	1,114	121,265	2021/ 8/31
1.125% US TREASURY N/B	国債証券	1.125	1,300	1,317	143,391	2021/ 9/30
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	730	738	80,345	2021/ 3/31
1.250% US TREASURY N/B	国債証券	1.25	1,070	1,102	119,959	2023/ 7/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,330	1,347	146,643	2021/ 4/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	860	871	94,895	2021/ 5/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,500	1,542	167,836	2022/10/15
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,170	1,209	131,648	2023/ 6/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	940	973	105,968	2023/ 8/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	1,020	1,056	114,987	2023/ 9/30
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	620	649	70,658	2025/ 1/31
1.375% US TREASURY N/B	国債証券	1.375	550	579	63,097	2026/ 8/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	790	808	87,963	2022/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,280	1,318	143,470	2022/ 9/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	900	930	101,283	2023/ 1/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	621	67,603	2023/ 2/28
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	630	652	71,032	2023/ 3/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,630	1,713	186,525	2024/10/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	1,810	1,921	209,062	2026/ 8/15
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	400	425	46,324	2027/ 1/31
1.500% US TREASURY N/B	国債証券	1.5	600	647	70,460	2030/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	750	774	84,300	2022/ 8/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,530	1,583	172,363	2022/11/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	560	582	63,425	2023/ 4/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	970	1,009	109,903	2023/ 5/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	920	962	104,777	2023/10/31
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,480	1,577	171,676	2026/ 2/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	2,550	2,720	296,075	2026/ 5/15
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,100	1,176	128,064	2026/ 9/30
1.625% US TREASURY N/B	国債証券	1.625	1,420	1,543	167,988	2029/ 8/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	500	510	55,541	2021/ 7/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,280	1,312	142,817	2021/11/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	490	504	54,851	2022/ 2/28
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	860	886	96,430	2022/ 3/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	680	74,094	2022/ 4/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	660	681	74,167	2022/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	750	774	84,281	2022/ 5/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	690	713	77,621	2022/ 6/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,450	1,500	163,252	2022/ 7/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	610	632	68,834	2022/ 9/30
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	930	968	105,442	2023/ 1/31
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,070	1,118	121,679	2023/ 5/15
1.750% US TREASURY N/B	国債証券	1.75	1,000	1,080	117,587	2026/12/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	660	678	73,808	2021/11/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	910	938	102,153	2022/ 2/28
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	840	867	94,395	2022/ 3/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	900	930	101,275	2022/ 4/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	750	776	84,485	2022/ 5/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	600	622	67,777	2022/ 7/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,160	1,205	131,164	2022/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,350	1,405	152,912	2022/ 9/30
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	500	520	56,668	2022/10/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	950	1,012	110,157	2024/ 8/31
1.875% US TREASURY N/B	国債証券	1.875	1,120	1,213	132,088	2026/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	220	223	24,354	2021/ 2/28
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	670	684	74,465	2021/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	720	738	80,347	2021/ 8/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	920	945	102,876	2021/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	870	895	97,441	2021/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,080	1,116	121,457	2022/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	660	686	74,745	2022/ 7/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,010	1,054	114,813	2022/10/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,340	1,401	152,531	2022/11/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	940	985	107,295	2023/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	550	586	63,854	2024/ 4/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,490	1,591	173,152	2024/ 5/31
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,320	1,411	153,644	2024/ 6/30
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,830	1,970	214,500	2025/ 2/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	1,820	1,969	214,380	2025/ 8/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	2,040	2,234	243,156	2026/11/15
2.000% US TREASURY N/B	国債証券	2.0	430	505	55,037	2050/ 2/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	690	706	76,934	2021/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	980	1,006	109,486	2021/ 8/15
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	930	956	104,082	2021/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	750	774	84,307	2021/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	620	646	70,336	2022/ 6/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,430	1,502	163,517	2022/12/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,610	1,715	186,660	2023/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	780	833	90,763	2024/ 2/29
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,380	1,477	160,792	2024/ 3/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	870	936	101,879	2024/ 7/31
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	500	539	58,678	2024/ 9/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,350	1,459	158,788	2024/11/30
2.125% US TREASURY N/B	国債証券	2.125	1,670	1,813	197,393	2025/ 5/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	510	520	56,669	2021/ 3/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,900	1,943	211,542	2021/ 4/30
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	630	647	70,437	2021/ 7/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,380	1,436	156,321	2022/ 4/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	870	932	101,457	2023/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	900	965	105,086	2024/ 1/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	750	813	88,573	2024/10/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,430	1,552	168,976	2024/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	800	870	94,743	2024/12/31
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,350	1,483	161,486	2025/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,210	1,350	146,951	2027/ 2/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,280	1,437	156,388	2027/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,600	1,800	195,975	2027/11/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	780	949	103,310	2046/ 8/15
2.250% US TREASURY N/B	国債証券	2.25	1,730	2,126	231,469	2049/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,020	1,043	113,608	2021/ 4/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	780	826	89,907	2023/ 1/31
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,720	1,869	203,493	2024/ 8/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,170	1,320	143,665	2027/ 5/15
2.375% US TREASURY N/B	国債証券	2.375	1,250	1,439	156,623	2029/ 5/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,750	1,821	198,219	2022/ 1/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,560	1,625	176,950	2022/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	820	873	95,103	2023/ 3/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,160	1,244	135,474	2023/ 8/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	1,630	1,773	192,984	2024/ 5/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	610	671	73,123	2025/ 1/31
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	900	1,005	109,459	2026/ 2/28
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,047	113,969	2045/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	830	1,054	114,731	2046/ 2/15
2.500% US TREASURY N/B	国債証券	2.5	770	979	106,595	2046/ 5/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,400	1,441	156,909	2021/ 6/15
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	800	887	96,620	2025/ 3/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	1,230	1,381	150,311	2025/12/31
2.625% US TREASURY N/B	国債証券	2.625	950	1,111	120,940	2029/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	840	870	94,759	2021/ 9/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	850	914	99,472	2023/ 4/30
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	700	754	82,067	2023/ 5/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,130	1,223	133,123	2023/ 8/31
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,090	2,272	247,339	2023/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	1,060	1,158	126,030	2024/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	2,040	2,378	258,905	2028/ 2/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	490	638	69,499	2042/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	500	652	70,958	2042/11/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	800	1,068	116,298	2047/ 8/15
2.750% US TREASURY N/B	国債証券	2.75	990	1,323	144,007	2047/11/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,200	1,248	135,901	2021/10/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	580	651	70,937	2025/ 4/30
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,180	1,328	144,542	2025/ 5/31
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	2,260	2,666	290,150	2028/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	1,640	1,940	211,137	2028/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	900	1,197	130,376	2043/ 5/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	850	1,147	124,839	2045/ 8/15
2.875% US TREASURY N/B	国債証券	2.875	760	1,036	112,783	2046/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,050	1,194	130,028	2025/ 9/30
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	300	406	44,217	2042/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	920	1,258	136,934	2044/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	840	1,153	125,570	2045/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,284	139,834	2045/11/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	930	1,298	141,332	2047/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	900	1,257	136,865	2047/ 5/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,860	2,602	283,195	2048/ 2/15
3.000% US TREASURY N/B	国債証券	3.0	1,300	1,830	199,198	2049/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	780	806	87,739	2021/ 5/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	270	371	40,472	2041/11/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	370	509	55,499	2042/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	550	759	82,667	2043/ 2/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	910	1,267	137,891	2044/ 8/15
3.125% US TREASURY N/B	国債証券	3.125	1,620	2,317	252,218	2048/ 5/15
3.375% US TREASURY N/B	国債証券	3.375	840	1,212	131,969	2044/ 5/15
3.500% US TREASURY N/B	国債証券	3.5	230	330	35,915	2039/ 2/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	670	997	108,519	2043/ 8/15
3.625% US TREASURY N/B	国債証券	3.625	860	1,284	139,820	2044/ 2/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	360	539	58,688	2041/ 8/15
3.750% US TREASURY N/B	国債証券	3.75	830	1,259	137,116	2043/11/15
3.875% US TREASURY N/B	国債証券	3.875	270	408	44,459	2040/ 8/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	240	375	40,877	2039/ 5/15
4.250% US TREASURY N/B	国債証券	4.25	220	348	37,930	2040/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	290	462	50,339	2039/11/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	200	320	34,856	2040/ 5/15
4.375% US TREASURY N/B	国債証券	4.375	320	517	56,292	2041/ 5/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	630	973	105,905	2036/ 2/15
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	30	47	5,201	2038/ 5/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		%	千米ドル	千米ドル	千円	
4.500% US TREASURY N/B	国債証券	4.5	230	371	40,393	2039/ 8/15
4.625% US TREASURY N/B	国債証券	4.625	430	707	77,010	2040/ 2/15
4.750% US TREASURY N/B	国債証券	4.75	380	639	69,645	2041/ 2/15
5.000% US TREASURY N/B	国債証券	5.0	40	66	7,190	2037/ 5/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	1,260	1,750	190,497	2028/11/15
5.250% US TREASURY N/B	国債証券	5.25	120	167	18,248	2029/ 2/15
5.375% US TREASURY N/B	国債証券	5.375	230	342	37,268	2031/ 2/15
5.500% US TREASURY N/B	国債証券	5.5	120	167	18,274	2028/ 8/15
6.000% US TREASURY N/B	国債証券	6.0	540	713	77,658	2026/ 2/15
6.125% US TREASURY N/B	国債証券	6.125	370	524	57,039	2027/11/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	200	240	26,132	2023/ 8/15
6.250% US TREASURY N/B	国債証券	6.25	180	278	30,267	2030/ 5/15
6.500% US TREASURY N/B	国債証券	6.5	90	125	13,625	2026/11/15
8.000% US TREASURY N/B	国債証券	8.0	1,010	1,137	123,829	2021/11/15
小計	—	—	—	—	20,895,747	—
(カナダ)		%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
0.50% CANADA GOV'T	国債証券	0.5	150	150	11,495	2022/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	490	491	37,650	2021/ 3/ 1
0.750% CANADA GOV'T	国債証券	0.75	760	762	58,443	2021/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	710	718	55,067	2022/ 9/ 1
1.000% CANADA GOV'T	国債証券	1.0	290	296	22,712	2027/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	550	566	43,414	2023/ 6/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	500	519	39,800	2024/ 9/ 1
1.500% CANADA GOV'T	国債証券	1.5	400	420	32,229	2026/ 6/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	180	188	14,464	2023/ 9/ 1
2.000% CANADA GOV'T	国債証券	2.0	390	430	32,992	2028/ 6/ 1
2.250% CANADA GOV'T	国債証券	2.25	340	368	28,209	2025/ 6/ 1
2.500% CANADA GOV'T	国債証券	2.5	490	528	40,483	2024/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	670	702	53,841	2022/ 6/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	330	444	34,074	2048/12/ 1
2.750% CANADA GOV'T	国債証券	2.75	140	209	16,049	2064/12/ 1
3.250% CANADA GOV'T	国債証券	3.25	490	505	38,740	2021/ 6/ 1
3.500% CANADA GOV'T	国債証券	3.5	370	548	42,043	2045/12/ 1
4.000% CANADA GOV'T	国債証券	4.0	330	499	38,265	2041/ 6/ 1
5.000% CANADA GOV'T	国債証券	5.0	310	497	38,077	2037/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	320	460	35,283	2029/ 6/ 1
5.750% CANADA GOV'T	国債証券	5.75	220	349	26,751	2033/ 6/ 1
8.000% CANADA GOV'T	国債証券	8.0	100	150	11,558	2027/ 6/ 1
小計	—	—	—	—	751,650	—
(メキシコ)		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	6,680	7,582	34,650	2024/12/ 5
10.00%MEX BONOS DESARR F	国債証券	10.0	840	1,029	4,704	2036/11/20
5.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	5.75	3,150	2,976	13,602	2026/ 3/ 5
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	8,910	8,886	40,612	2021/ 6/10
6.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	6.5	6,200	6,175	28,220	2022/ 6/ 9
7.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.5	6,880	7,023	32,098	2027/ 6/ 3
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,320	2,392	10,932	2031/ 5/29
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	2,800	2,888	13,198	2034/11/23
7.750%MEX BONOS DESARR F	国債証券	7.75	4,180	4,068	18,594	2042/11/13
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,140	4,338	19,827	2023/12/ 7
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	4,550	4,789	21,887	2024/ 9/ 5
8.000%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.0	2,800	2,786	12,732	2047/11/ 7
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,880	4,171	19,063	2029/ 5/31
8.500%MEX BONOS DESARR F	国債証券	8.5	3,570	3,779	17,272	2038/11/18
小計	—	—	—	—	287,398	—
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	330	332	39,711	2021/ 4/ 9

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	505	60,426	2021/10/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	600	608	72,791	2022/ 4/ 8
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	480	489	58,462	2022/10/ 7
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	300	306	36,686	2023/ 4/14
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	500	513	61,376	2023/10/13
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	290	299	35,810	2024/10/18
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	610	637	76,156	2026/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	200	210	25,198	2029/ 8/15
0.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	—	130	133	15,900	2050/ 8/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	580	617	73,825	2027/ 2/15
0.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.25	650	699	83,683	2029/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	570	604	72,272	2025/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	460	492	58,930	2026/ 2/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	460	500	59,810	2027/ 8/15
0.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	0.5	430	469	56,146	2028/ 2/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	340	366	43,776	2024/ 8/15
1.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.0	320	349	41,836	2025/ 8/15
1.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.25	340	471	56,389	2048/ 8/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	440	464	55,500	2022/ 9/ 4
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	450	479	57,321	2023/ 2/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	430	460	55,061	2023/ 5/15
1.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.5	310	338	40,521	2024/ 5/15
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	390	412	49,263	2022/ 7/ 4
1.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	1.75	470	516	61,689	2024/ 2/15
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	520	545	65,181	2022/ 1/ 4
2.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.0	410	448	53,652	2023/ 8/15
2.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.25	470	489	58,537	2021/ 9/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	540	896	107,171	2044/ 7/ 4
2.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	2.5	550	934	111,693	2046/ 8/15
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	540	566	67,759	2021/ 7/ 4
3.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	3.25	300	537	64,212	2042/ 7/ 4
4.000% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.0	470	821	98,166	2037/ 1/ 4
4.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.25	290	550	65,802	2039/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	400	582	69,597	2028/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	370	652	77,948	2034/ 7/ 4
4.750% DEUTSCHLAND REP	国債証券	4.75	320	654	78,214	2040/ 7/ 4
5.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.5	340	567	67,884	2031/ 1/ 4
5.625% DEUTSCHLAND REP	国債証券	5.625	480	719	86,012	2028/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	180	227	27,251	2024/ 1/ 4
6.250% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.25	220	370	44,322	2030/ 1/ 4
6.500% DEUTSCHLAND REP	国債証券	6.5	230	352	42,152	2027/ 7/ 4
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.35	400	400	47,872	2021/11/ 1
0.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.45	420	421	50,341	2021/ 6/ 1
0.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.65	420	421	50,331	2023/10/15
0.900% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.9	560	565	67,664	2022/ 8/ 1
0.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	0.95	420	425	50,853	2023/ 3/15
1.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.25	640	647	77,353	2026/12/ 1
1.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.35	750	764	91,348	2022/ 4/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	460	470	56,301	2022/ 9/15
1.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.45	310	318	38,094	2024/11/15
1.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.5	670	688	82,357	2025/ 6/ 1
1.600% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.6	380	392	46,928	2026/ 6/ 1
1.650% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.65	370	372	44,560	2032/ 3/ 1
1.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.75	370	384	45,976	2024/ 7/ 1
1.850% BUONI POLIENNALI	国債証券	1.85	400	417	49,967	2024/ 5/15
2.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.0	520	548	65,609	2025/12/ 1

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.050% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.05	490	519	62,152	2027/ 8/ 1
2.100% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.1	330	350	41,861	2026/ 7/15
2.150% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.15	400	412	49,273	2021/12/15
2.200% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.2	470	503	60,194	2027/ 6/ 1
2.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.25	310	325	38,883	2036/ 9/ 1
2.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.45	320	347	41,599	2033/ 9/ 1
2.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.5	420	451	53,926	2024/12/ 1
2.700% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.7	330	356	42,607	2047/ 3/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	590	660	78,921	2028/12/ 1
2.800% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.8	370	396	47,436	2067/ 3/ 1
2.950% BUONI POLIENNALI	国債証券	2.95	430	487	58,330	2038/ 9/ 1
3.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.25	360	426	50,939	2046/ 9/ 1
3.350% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.35	250	298	35,682	2035/ 3/ 1
3.450% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.45	400	490	58,593	2048/ 3/ 1
3.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.5	570	675	80,770	2030/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	30	30	3,704	2021/ 3/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	660	685	81,932	2021/ 5/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	659	78,811	2021/ 8/ 1
3.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	3.75	630	709	84,828	2024/ 9/ 1
4.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.0	630	808	96,623	2037/ 2/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	540	605	72,329	2023/ 5/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	660	755	90,343	2024/ 3/ 1
4.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.5	560	671	80,230	2026/ 3/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	660	701	83,873	2021/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	570	648	77,547	2023/ 8/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	600	763	91,305	2028/ 9/ 1
4.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	4.75	320	466	55,819	2044/ 9/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	530	576	68,949	2022/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	570	681	81,513	2025/ 3/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	570	795	95,094	2034/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	450	655	78,415	2039/ 8/ 1
5.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.0	650	950	113,577	2040/ 9/ 1
5.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.25	610	817	97,771	2029/11/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	530	593	71,009	2022/ 9/ 1
5.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.5	440	496	59,329	2022/11/ 1
5.750% BUONI POLIENNALI	国債証券	5.75	440	644	77,082	2033/ 2/ 1
6.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.0	600	868	103,822	2031/ 5/ 1
6.500% BUONI POLIENNALI	国債証券	6.5	660	909	108,775	2027/11/ 1
7.250% BUONI POLIENNALI	国債証券	7.25	130	180	21,577	2026/11/ 1
9.000% BUONI POLIENNALI	国債証券	9.0	100	129	15,482	2023/11/ 1
(ユーロ…フランス)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	470	473	56,548	2021/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	720	729	87,229	2022/ 5/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	840	854	102,139	2023/ 3/25
0.000% FRANCE GOV' T	国債証券	—	180	181	21,727	2029/11/25
0.250% FRANCE GOV' T	国債証券	0.25	950	983	117,627	2026/11/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	1,170	1,226	146,615	2025/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	788	94,271	2026/ 5/25
0.500% FRANCE GOV' T	国債証券	0.5	750	794	94,952	2029/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	700	755	90,262	2028/ 5/25
0.750% FRANCE GOV' T	国債証券	0.75	710	767	91,721	2028/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	950	1,023	122,397	2025/11/25
1.000% FRANCE GOV' T	国債証券	1.0	660	719	86,004	2027/ 5/25
1.250% FRANCE GOV' T	国債証券	1.25	720	829	99,125	2036/ 5/25
1.500% FRANCE GOV' T	国債証券	1.5	860	1,005	120,260	2031/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	850	912	109,096	2023/ 5/25
1.750% FRANCE GOV' T	国債証券	1.75	880	971	116,134	2024/11/25

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	470	587	70,263	2039/ 6/25
1.750% FRANCE GOV'T	国債証券	1.75	400	541	64,759	2066/ 5/25
2.000% FRANCE GOV'T	国債証券	2.0	630	850	101,692	2048/ 5/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	800	859	102,765	2022/10/25
2.250% FRANCE GOV'T	国債証券	2.25	890	992	118,688	2024/ 5/25
2.500% FRANCE GOV'T	国債証券	2.5	680	859	102,812	2030/ 5/25
2.750% FRANCE GOV'T	国債証券	2.75	730	897	107,282	2027/10/25
3.000% FRANCE GOV'T	国債証券	3.0	1,040	1,118	133,756	2022/ 4/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	1,070	1,135	135,747	2021/10/25
3.250% FRANCE GOV'T	国債証券	3.25	520	846	101,249	2045/ 5/25
3.500% FRANCE GOV'T	国債証券	3.5	800	988	118,134	2026/ 4/25
3.750% FRANCE GOV'T	国債証券	3.75	730	763	91,312	2021/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	720	1,190	142,318	2038/10/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	410	828	99,016	2055/ 4/25
4.000% FRANCE GOV'T	国債証券	4.0	310	658	78,749	2060/ 4/25
4.250% FRANCE GOV'T	国債証券	4.25	1,040	1,220	145,965	2023/10/25
4.500% FRANCE GOV'T	国債証券	4.5	740	1,345	160,833	2041/ 4/25
4.750% FRANCE GOV'T	国債証券	4.75	640	1,074	128,410	2035/ 4/25
5.500% FRANCE GOV'T	国債証券	5.5	940	1,426	170,532	2029/ 4/25
5.750% FRANCE GOV'T	国債証券	5.75	740	1,268	151,623	2032/10/25
6.000% FRANCE GOV'T	国債証券	6.0	220	298	35,743	2025/10/25
8.500% FRANCE GOV'T	国債証券	8.5	170	217	26,040	2023/ 4/25
(ユーロ…オランダ)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	340	344	41,146	2022/ 1/15
0.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	—	190	194	23,284	2024/ 1/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	320	334	39,946	2025/ 7/15
0.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.25	160	168	20,202	2029/ 7/15
0.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.5	320	340	40,696	2026/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	440	479	57,273	2027/ 7/15
0.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	0.75	150	164	19,657	2028/ 7/15
1.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	1.75	340	367	43,951	2023/ 7/15
2.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.0	360	401	47,974	2024/ 7/15
2.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.25	310	331	39,591	2022/ 7/15
2.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.5	260	352	42,117	2033/ 1/15
2.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	2.75	300	515	61,626	2047/ 1/15
3.250% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.25	250	262	31,408	2021/ 7/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	130	146	17,495	2023/ 1/15
3.750% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	3.75	340	620	74,144	2042/ 1/15
4.000% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	4.0	370	628	75,126	2037/ 1/15
5.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	5.5	320	470	56,198	2028/ 1/15
7.500% NETHERLANDS GOV'T	国債証券	7.5	80	98	11,782	2023/ 1/15
(ユーロ…スペイン)						
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.400% SPANISH GOV'T	国債証券	0.4	850	860	102,908	2022/ 4/30
0.450% SPANISH GOV'T	国債証券	0.45	280	284	33,972	2022/10/31
0.750% SPANISH GOV'T	国債証券	0.75	450	456	54,534	2021/ 7/30
1.300% SPANISH GOV'T	国債証券	1.3	460	490	58,622	2026/10/31
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	510	550	65,787	2028/ 4/30
1.400% SPANISH GOV'T	国債証券	1.4	380	410	49,045	2028/ 7/30
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	580	625	74,740	2027/10/31
1.450% SPANISH GOV'T	国債証券	1.45	600	651	77,877	2029/ 4/30
1.500% SPANISH GOV'T	国債証券	1.5	370	399	47,758	2027/ 4/30
1.600% SPANISH GOV'T	国債証券	1.6	420	451	53,966	2025/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	480	529	63,357	2026/ 4/30
1.950% SPANISH GOV'T	国債証券	1.95	650	738	88,291	2030/ 7/30
2.150% SPANISH GOV'T	国債証券	2.15	440	488	58,404	2025/10/31
2.350% SPANISH GOV'T	国債証券	2.35	450	539	64,535	2033/ 7/30
2.700% SPANISH GOV'T	国債証券	2.7	170	221	26,501	2048/10/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
2.750% SPANISH GOV' T	国債証券	2.75	570	639	76,409	2024/10/31
2.900% SPANISH GOV' T	国債証券	2.9	370	501	59,980	2046/10/31
3.450% SPANISH GOV' T	国債証券	3.45	290	467	55,883	2066/ 7/30
3.800% SPANISH GOV' T	国債証券	3.8	740	853	102,002	2024/ 4/30
4.200% SPANISH GOV' T	国債証券	4.2	490	739	88,408	2037/ 1/31
4.400% SPANISH GOV' T	国債証券	4.4	470	544	65,049	2023/10/31
4.650% SPANISH GOV' T	国債証券	4.65	400	495	59,282	2025/ 7/30
4.700% SPANISH GOV' T	国債証券	4.7	370	616	73,693	2041/ 7/30
4.800% SPANISH GOV' T	国債証券	4.8	420	496	59,379	2024/ 1/31
4.900% SPANISH GOV' T	国債証券	4.9	370	624	74,644	2040/ 7/30
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	780	1,089	130,250	2028/10/31
5.150% SPANISH GOV' T	国債証券	5.15	280	511	61,163	2044/10/31
5.400% SPANISH GOV' T	国債証券	5.4	570	657	78,617	2023/ 1/31
5.500% SPANISH GOV' T	国債証券	5.5	360	382	45,702	2021/ 4/30
5.750% SPANISH GOV' T	国債証券	5.75	500	800	95,669	2032/ 7/30
5.850% SPANISH GOV' T	国債証券	5.85	460	511	61,130	2022/ 1/31
5.900% SPANISH GOV' T	国債証券	5.9	460	622	74,383	2026/ 7/30
6.000% SPANISH GOV' T	国債証券	6.0	130	192	22,985	2029/ 1/31
(ユーロ…ベルギー)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.200% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.2	220	225	26,900	2023/10/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	290	306	36,666	2025/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	250	267	31,991	2027/ 6/22
0.800% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.8	430	463	55,411	2028/ 6/22
0.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	0.9	90	98	11,738	2029/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	340	365	43,748	2026/ 6/22
1.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.0	230	254	30,375	2031/ 6/22
1.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.25	130	148	17,756	2033/ 4/22
1.450% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.45	140	164	19,682	2037/ 6/22
1.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.6	320	395	47,337	2047/ 6/22
1.900% BELGIUM KINGDOM	国債証券	1.9	190	238	28,543	2038/ 6/22
2.150% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.15	120	179	21,470	2066/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	340	370	44,256	2023/ 6/22
2.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.25	140	205	24,621	2057/ 6/22
2.600% BELGIUM KINGDOM	国債証券	2.6	420	473	56,597	2024/ 6/22
3.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.0	180	250	29,892	2034/ 6/22
3.750% BELGIUM KINGDOM	国債証券	3.75	200	347	41,596	2045/ 6/22
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	300	327	39,157	2022/ 3/28
4.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.0	150	220	26,305	2032/ 3/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	180	192	23,066	2021/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	360	403	48,236	2022/ 9/28
4.250% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.25	330	573	68,617	2041/ 3/28
4.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	4.5	200	257	30,769	2026/ 3/28
5.000% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.0	380	644	77,038	2035/ 3/28
5.500% BELGIUM KINGDOM	国債証券	5.5	440	641	76,651	2028/ 3/28
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.5	270	285	34,115	2029/ 2/20
0.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	0.75	240	256	30,654	2026/10/20
1.200% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.2	210	228	27,309	2025/10/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	140	179	21,471	2047/ 2/20
1.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.5	60	81	9,695	2086/11/ 2
1.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.65	230	251	30,125	2024/10/21
1.750% REP OF AUSTRIA	国債証券	1.75	390	421	50,443	2023/10/20
2.100% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.1	100	177	21,270	2117/ 9/20
2.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	2.4	170	224	26,784	2034/ 5/23
3.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.15	200	332	39,714	2044/ 6/20
3.400% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.4	250	276	33,079	2022/11/22
3.500% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.5	160	169	20,277	2021/ 9/15

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
3.650% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.65	270	293	35,112	2022/ 4/20
3.800% REP OF AUSTRIA	国債証券	3.8	50	109	13,044	2062/ 1/26
4.150% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.15	300	499	59,715	2037/ 3/15
4.850% REP OF AUSTRIA	国債証券	4.85	180	236	28,269	2026/ 3/15
6.250% REP OF AUSTRIA	国債証券	6.25	450	663	79,292	2027/ 7/15
(ユーロ…フィンランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.125% FINNISH GOV' T	国債証券	0.125	80	80	9,565	2036/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	100	104	12,543	2026/ 4/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	80	84	10,098	2027/ 9/15
0.500% FINNISH GOV' T	国債証券	0.5	150	158	19,001	2029/ 9/15
0.750% FINNISH GOV' T	国債証券	0.75	180	196	23,539	2031/ 4/15
0.875% FINNISH GOV' T	国債証券	0.875	90	96	11,486	2025/ 9/15
1.375% FINNISH GOV' T	国債証券	1.375	30	38	4,608	2047/ 4/15
1.500% FINNISH GOV' T	国債証券	1.5	100	106	12,710	2023/ 4/15
1.625% FINNISH GOV' T	国債証券	1.625	240	253	30,284	2022/ 9/15
2.000% FINNISH GOV' T	国債証券	2.0	220	242	29,017	2024/ 4/15
2.625% FINNISH GOV' T	国債証券	2.625	120	183	21,914	2042/ 7/ 4
2.750% FINNISH GOV' T	国債証券	2.75	130	162	19,378	2028/ 7/ 4
4.000% FINNISH GOV' T	国債証券	4.0	150	185	22,153	2025/ 7/ 4
(ユーロ…アイルランド)		%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
0.800% IRISH GOV' T	国債証券	0.8	140	143	17,158	2022/ 3/15
0.900% IRISH GOV' T	国債証券	0.9	350	377	45,168	2028/ 5/15
1.000% IRISH GOV' T	国債証券	1.0	330	353	42,295	2026/ 5/15
1.500% IRISH GOV' T	国債証券	1.5	80	95	11,467	2050/ 5/15
1.700% IRISH GOV' T	国債証券	1.7	150	181	21,718	2037/ 5/15
2.000% IRISH GOV' T	国債証券	2.0	190	251	30,092	2045/ 2/18
2.400% IRISH GOV' T	国債証券	2.4	250	309	36,961	2030/ 5/15
3.400% IRISH GOV' T	国債証券	3.4	150	171	20,561	2024/ 3/18
3.900% IRISH GOV' T	国債証券	3.9	150	169	20,236	2023/ 3/20
5.400% IRISH GOV' T	国債証券	5.4	280	358	42,823	2025/ 3/13
小 計	—	—	—	—	15,016,571	—
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
0.625% UK TREASURY	国債証券	0.625	220	225	29,999	2025/ 6/ 7
0.750% UK TREASURY	国債証券	0.75	610	622	82,976	2023/ 7/22
0.875% UK TREASURY	国債証券	0.875	140	148	19,754	2029/10/22
1.250% UK TREASURY	国債証券	1.25	440	475	63,412	2027/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	430	466	62,223	2026/ 7/22
1.500% UK TREASURY	国債証券	1.5	460	545	72,740	2047/ 7/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	740	830	110,683	2028/10/22
1.625% UK TREASURY	国債証券	1.625	330	496	66,167	2071/10/22
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	700	727	97,019	2022/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	250	294	39,306	2037/ 9/ 7
1.750% UK TREASURY	国債証券	1.75	310	425	56,682	2057/ 7/22
2.000% UK TREASURY	国債証券	2.0	210	231	30,894	2025/ 9/ 7
2.250% UK TREASURY	国債証券	2.25	740	793	105,809	2023/ 9/ 7
2.500% UK TREASURY	国債証券	2.5	370	639	85,283	2065/ 7/22
2.750% UK TREASURY	国債証券	2.75	280	312	41,648	2024/ 9/ 7
3.250% UK TREASURY	国債証券	3.25	480	740	98,690	2044/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	470	761	101,503	2045/ 1/22
3.500% UK TREASURY	国債証券	3.5	350	782	104,284	2068/ 7/22
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	200	210	28,069	2021/ 9/ 7
3.750% UK TREASURY	国債証券	3.75	350	662	88,331	2052/ 7/22
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	540	580	77,399	2022/ 3/ 7
4.000% UK TREASURY	国債証券	4.0	310	683	91,114	2060/ 1/22
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	380	50,675	2027/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	507	67,627	2032/ 6/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	460	715	95,412	2036/ 3/ 7

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	495	66,033	2039/ 9/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	300	504	67,193	2040/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	380	701	93,516	2046/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	290	561	74,909	2049/12/ 7
4.250% UK TREASURY	国債証券	4.25	350	752	100,337	2055/12/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	350	542	72,368	2034/ 9/ 7
4.500% UK TREASURY	国債証券	4.5	440	786	104,873	2042/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	300	439	58,618	2030/12/ 7
4.750% UK TREASURY	国債証券	4.75	330	559	74,568	2038/12/ 7
5.000% UK TREASURY	国債証券	5.0	360	445	59,418	2025/ 3/ 7
6.000% UK TREASURY	国債証券	6.0	230	344	45,964	2028/12/ 7
小計	—	—	—	—	2,585,511	—
(スウェーデン)		%	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ	千円	
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	470	506	5,480	2028/ 5/12
0.750% SWEDEN GOV' T	国債証券	0.75	300	326	3,526	2029/11/12
1.000% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.0	1,180	1,281	13,850	2026/11/12
1.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	1.5	1,830	1,956	21,145	2023/11/13
2.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	2.5	1,030	1,181	12,776	2025/ 5/12
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,660	1,801	19,478	2022/ 6/ 1
3.500% SWEDEN GOV' T	国債証券	3.5	1,380	2,216	23,963	2039/ 3/30
小計	—	—	—	—	100,221	—
(ノルウェー)		%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
1.500% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.5	880	920	9,445	2026/ 2/19
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	840	886	9,092	2025/ 3/13
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	960	1,023	10,497	2027/ 2/17
1.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	1.75	1,150	1,235	12,674	2029/ 9/ 6
2.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	2.0	1,360	1,425	14,624	2023/ 5/24
3.000% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.0	830	909	9,335	2024/ 3/14
3.750% NORWEGIAN GOV' T	国債証券	3.75	1,590	1,652	16,949	2021/ 5/25
小計	—	—	—	—	82,619	—
(デンマーク)		%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
0.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,740	1,861	29,801	2027/11/15
0.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	0.5	1,010	1,087	17,413	2029/11/15
1.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.5	1,140	1,224	19,605	2023/11/15
1.750%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	1.75	1,720	1,935	30,993	2025/11/15
3.000%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	3.0	1,460	1,544	24,735	2021/11/15
4.500%KINGDOM OF DENMARK	国債証券	4.5	2,560	4,845	77,573	2039/11/15
小計	—	—	—	—	200,122	—
(ポーランド)		%	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	
1.750% POLAND GOV' T	国債証券	1.75	640	647	17,038	2021/ 7/25
2.000% POLAND GOV' T	国債証券	2.0	200	202	5,329	2021/ 4/25
2.250% POLAND GOV' T	国債証券	2.25	830	852	22,439	2022/ 4/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	780	813	21,410	2023/ 1/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	690	731	19,254	2026/ 7/25
2.500% POLAND GOV' T	国債証券	2.5	760	803	21,157	2027/ 7/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	890	952	25,078	2028/ 4/25
2.750% POLAND GOV' T	国債証券	2.75	300	326	8,586	2029/10/25
3.250% POLAND GOV' T	国債証券	3.25	1,030	1,131	29,779	2025/ 7/25
4.000% POLAND GOV' T	国債証券	4.0	960	1,060	27,910	2023/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	280	301	7,929	2021/10/25
5.750% POLAND GOV' T	国債証券	5.75	660	737	19,400	2022/ 9/23
小計	—	—	—	—	225,313	—
(オーストラリア)		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
2.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.0	90	91	6,058	2021/12/21
2.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.25	590	663	43,871	2028/ 5/21
2.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.5	340	396	26,178	2030/ 5/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	460	504	33,332	2024/ 4/21

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)						
		%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	570	660	43,682	2027/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	520	608	40,202	2028/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	200	236	15,631	2029/11/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	240	290	19,199	2035/ 6/21
2.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	2.75	80	94	6,243	2041/ 5/21
3.000% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.0	370	467	30,921	2047/ 3/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	210	271	17,922	2039/ 6/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	500	568	37,591	2025/ 4/21
3.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.25	710	857	56,688	2029/ 4/21
3.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	3.75	320	430	28,421	2037/ 4/21
4.250% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.25	670	819	54,179	2026/ 4/21
4.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.5	490	703	46,521	2033/ 4/21
4.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	4.75	630	807	53,361	2027/ 4/21
5.500% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.5	690	796	52,652	2023/ 4/21
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	750	795	52,605	2021/ 5/15
5.750% AUSTRALIAN GOV' T	国債証券	5.75	780	877	57,988	2022/ 7/15
小計	—	—	—	—	723,256	—
(シンガポール)						
		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
1.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	1.75	160	163	12,463	2022/ 4/ 1
2.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.125	80	84	6,480	2026/ 6/ 1
2.250% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.25	240	244	18,658	2021/ 6/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	220	233	17,802	2023/ 7/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	140	170	13,042	2042/ 4/ 1
2.750% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.75	110	136	10,409	2046/ 3/ 1
2.875% SINGAPORE GOV' T	国債証券	2.875	100	114	8,722	2029/ 7/ 1
3.000% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.0	250	271	20,757	2024/ 9/ 1
3.125% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.125	110	116	8,866	2022/ 9/ 1
3.375% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.375	300	371	28,350	2033/ 9/ 1
3.500% SINGAPORE GOV' T	国債証券	3.5	310	358	27,351	2027/ 3/ 1
小計	—	—	—	—	172,904	—
(マレーシア)						
		%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
3.480% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.48	300	304	7,663	2023/ 3/15
3.502% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.502	430	436	10,982	2027/ 5/31
3.795% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.795	360	368	9,253	2022/ 9/30
3.844% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.844	940	931	23,407	2033/ 4/15
3.885% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.885	500	519	13,066	2029/ 8/15
3.899% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.899	800	827	20,815	2027/11/16
3.900% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.9	250	258	6,504	2026/11/30
3.955% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	3.955	600	622	15,639	2025/ 9/15
4.048% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.048	310	315	7,942	2021/ 9/30
4.160% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.16	760	773	19,456	2021/ 7/15
4.181% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.181	640	667	16,784	2024/ 7/15
4.498% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.498	440	470	11,836	2030/ 4/15
4.736% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.736	280	302	7,613	2046/ 3/15
4.762% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.762	320	351	8,844	2037/ 4/ 7
4.893% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.893	180	198	5,000	2038/ 6/ 8
4.935% MALAYSIAN GOV' T	国債証券	4.935	180	200	5,047	2043/ 9/30
小計	—	—	—	—	189,858	—
(南アフリカ)						
		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
10.50% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	10.5	5,270	5,266	31,864	2026/12/21
6.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.25	2,710	1,578	9,550	2036/ 3/31
6.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.5	3,820	2,160	13,069	2041/ 2/28
6.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	6.75	280	284	1,721	2021/ 3/31
7.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.0	3,270	2,310	13,980	2031/ 2/28
7.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	7.75	1,700	1,721	10,413	2023/ 2/28
8.000% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.0	2,150	1,701	10,294	2030/ 1/31
8.250% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.25	1,420	1,083	6,556	2032/ 3/31

銘柄名	種類	利率	額面金額	評価額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(南アフリカ)		%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
8.500% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.5	3,550	2,584	15,637	2037/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	2,680	1,933	11,700	2044/ 1/31
8.750% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.75	5,830	4,217	25,515	2048/ 2/28
8.875% REPUBLIC OF SOUTH	国債証券	8.875	1,600	1,231	7,452	2035/ 2/28
小計	—	—	—	—	157,756	—
合計	—	—	—	—	41,388,933	—

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

(注2) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

(注3) —印は組み入れなし。

■投資信託財産の構成(2020年3月31日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公債	千円 41,388,933	% 99.0
コール・ローン等、その他	424,044	1.0
投資信託財産総額	41,812,977	100.0

(注1) 金額の単位未満は切り捨て。

(注2) 当期末における外貨建純資産(41,794,823千円)の投資信託財産総額(41,812,977千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、2020年3月31日における邦貨換算レートは1米ドル=108.83円、1カナダドル=76.60円、1メキシコペソ=4.57円、1ユーロ=119.55円、1英ポンド=133.32円、1スウェーデンクローナ=10.81円、1ノルウェークローネ=10.26円、1デンマーククローネ=16.01円、1ポーランドズロチ=26.32円、1オーストラリアドル=66.09円、1シンガポールドル=76.37円、1マレーシアリングギット=25.14円、1南アフリカランド=6.05円です。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

2020年3月31日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	41,823,857,640円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	113,649,583
公 社 債(評価額)	41,388,933,601
未 収 入 金	10,880,000
未 収 利 息	301,757,845
前 払 費 用	8,636,611
(B) 負 債	10,881,240
未 払 金	10,881,000
未 払 利 息	52
そ の 他 未 払 費 用	188
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	41,812,976,400
元 本	17,947,491,892
次 期 繰 越 損 益 金	23,865,484,508
(D) 受 益 権 総 口 数	17,947,491,892口
1万口当たり基準価額(C / D)	23,297円

(注1) 当ファンドの期首元本額は18,082,227,329円、期中追加設定元本額は807,475,440円、期中一部解約元本額は942,210,877円です。

(注2) 元本の内訳

日立外国債券特化型ファンドU(為替ヘッジなし)(非課税適格機関投資家専用)	8,957,832,316円
日立外国債券インデックスファンド	6,866,613,862円
日立バランスファンド(株式50)	890,236,499円
日立バランスファンド(株式70)	869,598,579円
日立バランスファンド(株式30)	363,210,636円

(注3) 1口当たり純資産額は2,3297円です。

■損益の状況

当期(自2019年4月2日 至2020年3月31日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	933,858,456円
受 取 利 息	933,905,151
支 払 利 息	△46,695
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,231,609,837
売 買 益	3,055,409,685
売 買 損	△1,823,799,848
(C) 信 託 報 酬 等	△5,750,062
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	2,159,718,231
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	21,888,167,997
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	999,126,336
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,181,528,056
(H) 計 (D + E + F + G)	23,865,484,508
次 期 繰 越 損 益 金(H)	23,865,484,508

(注1) 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2) 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3) 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4) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。