

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	信託期間は2005年10月21日から無期限です。
運用方針	投資信託証券への投資を通じて、外国債券と内外の株式に投資し、インカムゲインを確保しつつ、分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。
主要運用対象	以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用) Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class ビクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用) フランクリン・テンブルトン・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用) ビクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用) ビクテ・グローバル・セクション・ファンド グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券 FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)
組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
分配方針	原則として、毎月14日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

## 毎月分配パッケージファンド (愛称:分配ファミリー)

### 運用報告書(全体版)

第222期(決算日 2024年5月14日) 第225期(決算日 2024年8月14日)  
第223期(決算日 2024年6月14日) 第226期(決算日 2024年9月17日)  
第224期(決算日 2024年7月16日) 第227期(決算日 2024年10月15日)

### 受益者のみなさまへ

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

### 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

**【本運用報告書の記載について】**

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

## 最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準 (分配落)	価額			投資信託証券 組入比率	純総 資産額
			税 分 配	込 金 騰 落	中 率		
第34	第198期(2022年 5月16日)	円 6,843	円 20	% △2.3	% 98.5	百万円 11,312	
	第199期(2022年 6月14日)	6,982	20	2.3	98.4	11,528	
	第200期(2022年 7月14日)	6,950	20	△0.2	98.8	11,421	
	第201期(2022年 8月15日)	7,040	20	1.6	98.4	11,544	
	第202期(2022年 9月14日)	7,219	20	2.8	98.7	11,773	
	第203期(2022年10月14日)	6,761	20	△6.1	98.6	10,974	
第35	第204期(2022年11月14日)	6,871	20	1.9	98.5	11,078	
	第205期(2022年12月14日)	6,910	20	0.9	98.6	11,062	
	第206期(2023年 1月16日)	6,567	20	△4.7	98.4	10,489	
	第207期(2023年 2月14日)	6,617	20	1.1	98.7	10,518	
	第208期(2023年 3月14日)	6,625	20	0.4	98.4	10,469	
	第209期(2023年 4月14日)	6,723	20	1.8	98.8	10,586	
第36	第210期(2023年 5月15日)	6,818	20	1.7	98.5	10,653	
	第211期(2023年 6月14日)	6,942	20	2.1	98.3	10,770	
	第212期(2023年 7月14日)	6,937	20	0.2	98.4	10,683	
	第213期(2023年 8月14日)	7,090	20	2.5	98.5	10,877	
	第214期(2023年 9月14日)	7,113	20	0.6	98.4	10,869	
	第215期(2023年10月16日)	6,991	20	△1.4	98.5	10,656	
第37	第216期(2023年11月14日)	7,122	20	2.2	98.5	10,794	
	第217期(2023年12月14日)	7,149	20	0.7	98.5	10,806	
	第218期(2024年 1月15日)	7,264	20	1.9	98.6	10,926	
	第219期(2024年 2月14日)	7,338	20	1.3	98.4	10,997	
	第220期(2024年 3月14日)	7,376	20	0.8	98.5	10,989	
	第221期(2024年 4月15日)	7,525	20	2.3	98.4	11,140	
第38	第222期(2024年 5月14日)	7,703	20	2.6	98.5	11,359	
	第223期(2024年 6月14日)	7,779	20	1.2	98.4	11,439	
	第224期(2024年 7月16日)	7,967	20	2.7	98.1	11,765	
	第225期(2024年 8月14日)	7,433	20	△6.5	98.5	10,939	
	第226期(2024年 9月17日)	7,316	20	△1.3	98.5	10,745	
	第227期(2024年10月15日)	7,598	20	4.1	98.3	11,123	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

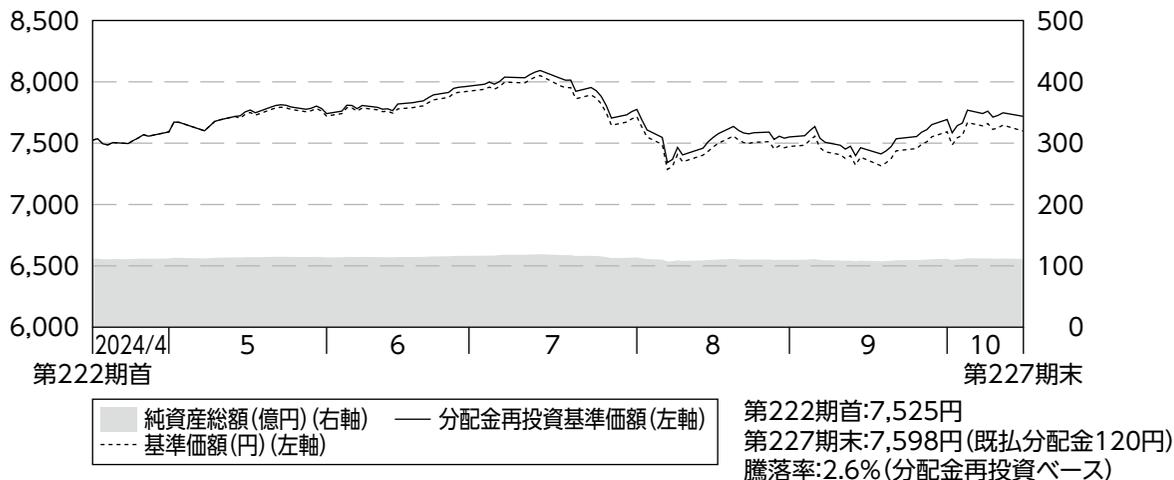
## 当作成期中の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託証券 組 入 比 率
			騰 落 率	
第222期	(期 首)2024年 4月15日	円 7,525	% —	% 98.4
	(期 末)2024年 5月14日	7,723	2.6	98.5
第223期	(期 首)2024年 5月14日	7,703	—	98.5
	(期 末)2024年 6月14日	7,799	1.2	98.4
第224期	(期 首)2024年 6月14日	7,779	—	98.4
	(期 末)2024年 7月16日	7,987	2.7	98.1
第225期	(期 首)2024年 7月16日	7,967	—	98.1
	(期 末)2024年 8月14日	7,453	△6.5	98.5
第226期	(期 首)2024年 8月14日	7,433	—	98.5
	(期 末)2024年 9月17日	7,336	△1.3	98.5
第227期	(期 首)2024年 9月17日	7,316	—	98.5
	(期 末)2024年10月15日	7,618	4.1	98.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

# 当作成期中の運用経過と今後の運用方針

## 基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2024年4月15日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。円高・米ドル安の進行などが下落要因となったものの、欧米で長期金利が低下(価格は上昇)したことや、米経済のソフトランディング期待が高まったこと、中国で大規模な景気刺激策が発表されたことなどが上昇要因となりました。

組入ファンド	投資資産	基本組入比率	当作成対象期間末組入比率	騰落率
FOFs用外国債券オープン	先進国債券	20.0%	19.9%	1.8%
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class	先進国債券	15.0%	14.8%	2.2%
ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム	先進国債券	15.0%	14.9%	1.3%
フランクリン・templton・オーストラリア毎月分配型ファンド	先進国債券	15.0%	14.9%	2.8%
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド	新興国債券	15.0%	15.0%	2.8%
ピクテ・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド	世界株式	10.0%	9.7%	15.4%
FOFs用日本株式インデックス・オープン	国内株式	10.0%	9.1%	△0.9%

(注1)ファンド名の「(適格機関投資家専用)」は省略しております。また、「ピクテ・グローバル・セレクション・ファンドーグローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券」は「ピクテ・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド」と表記しております。以下同様の表記をすることがあります。

(注2)比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

### ○先進国債券市場

主要国の長期金利は、米国で雇用関連指標が労働市場の減速を示したほか物価指標の鈍化が続いたことからFRB(米連邦準備理事会)による利下げ期待が高まったことや、中東情勢の悪化懸念などを背景に、当作成期初から2024年9月中旬にかけて低下(価格は上昇)基調で推移しました。当作成期末にかけては、米国で雇用関連指標が上振れたことなどをを受けてFRBの大幅利下げに対する期待が後退し、長期金利は上昇(価格は下落)しました。

### ○国内株式市場

当作成期初から2024年7月上旬にかけては、国内企業の底堅い業績や為替市場で円安・米ドル高が進んだことなどから国内株式市場は底堅く推移しました。その後、米当局による対中国への半導体規制強化の報道を受けて貿易摩擦の激化に対する懸念が高まったことや、円高・米ドル安を受けて外需企業を中心に業績の先行き不透明感が高まったことから下落しましたが、米国景気の悪化に対する懸念が後退したことや、中国の景気刺激策に対する期待の高まりなどをを受けて反発しました。

### ○世界株式市場

中東情勢や米国の景気悪化懸念などから調整する局面もありましたが、米経済のソフトランディング期待が高まったことや、金融当局の政策金利見通しや発言、経済指標などをを受けて欧米の利下げに対する期待が高まったこと、中国で大規模な景気刺激策が発表されたことなどから、外国株式市場は上昇基調で推移しました。

### ○新興国債券市場

米回国債と新興国債券の利回り格差(スプレッド)は、南アフリカやインドでの総選挙やメキシコの大統領選挙などの結果を受けて政治に対する不透明感が高まったことや、米国景気の悪化懸念が拡大要因となる局面もあったものの、中国で大規模な景気刺激策が発表されたことなどが縮小要因となり、前作成期末比でほぼ横ばいとなりました。スプレッドは横ばいとなったものの、米国金利が低下したことから、新興国債券市場は上昇しました。

### ○当ファンド

下記の投資信託証券への投資を通じて外国の債券と内外の株式に分散投資し、インカムゲインを確保しつつ、投資信託財産の中長期的な成長を目指した運用を行いました。

当作成期中、当ファンドは各投資信託証券に基本配分比率にしたがって投資を行いました。

#### ・FOFs用外国債券オープン

「外国債券インデックス マザーファンド」を通じて、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行いました。

#### ・Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class

主として米国の投資適格地方債（一般財源保証債およびレベニュー債）に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。

#### ・ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム

「ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド」を通じて、質の高いユーロ通貨採用国の国債に投資し、安定的かつより優れた分配金原資の獲得を目的として運用を行いました。

#### ・フランクリン・templton・オーストラリア毎月分配型ファンド

「フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンド」を通じて、主として豪ドル建の公社債に投資を行い、信託財産の成長と毎月の安定した分配を目指して運用を行いました。

#### ・ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド

「ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド」を通じて、主としてエマージング・カントリーのドル建てのソブリン債券および準ソブリン債券に投資し、利子等収益の確保と売買益の獲得を目指して運用を行いました。

#### ・ピクテ・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド

主に新興国の企業を含む世界の公益企業の発行する高配当利回りの株式への投資を通じて安定的な収益分配を行うこと、また、長期的な元本の成長を目指すことを目的として運用を行いました。

#### ・FOFs用日本株式インデックス・オープン

「国内株式インデックス マザーファンド」を通じて、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

<投資対象ファンドについては、各運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

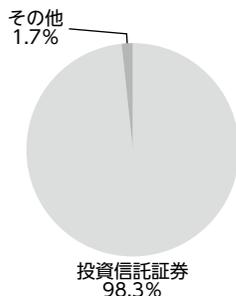
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

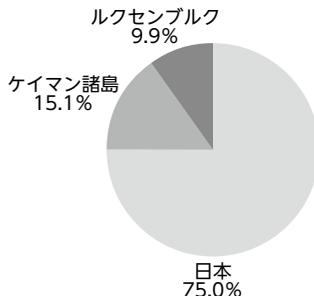
	当作成期末
	2024年10月15日
FOFs用外国債券オープン	19.9%
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド	15.0%
フランクリン・templton・オーストラリア毎月分配型ファンド	14.9%
ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム	14.9%
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class	14.8%
ピクテ・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド	9.7%
FOFs用日本株式インデックス・オープン	9.1%
その他	1.7%
組入ファンド数	7

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

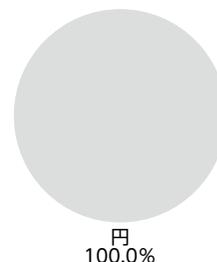
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

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

## 分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
	2024年4月16日～ 2024年5月14日	2024年5月15日～ 2024年6月14日	2024年6月15日～ 2024年7月16日	2024年7月17日～ 2024年8月14日	2024年8月15日～ 2024年9月17日	2024年9月18日～ 2024年10月15日
当期分配金 (円)	20	20	20	20	20	20
(対基準価額比率) (%)	(0.259)	(0.256)	(0.250)	(0.268)	(0.273)	(0.263)
当期の収益 (円)	20	18	20	7	12	20
当期の収益以外 (円)	－	1	－	12	7	－
翌期繰越分配対象額 (円)	564	563	587	575	568	569

(注1)「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。

(注2)当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税引前)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注3)－印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

### ○当ファンド

主として、下記の投資信託証券(以下「投資対象ファンド」といいます。)への投資を通じて、外国債券と内外の株式への分散投資を行い、インカムゲインを確保しつつ、分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。

投資対象ファンドの基準配分比率は、その主要投資対象資産ごとに以下の通りとします。また、基準配分比率には一定の変動幅を設けます。

主要投資対象資産			基準配分比率
外国債券	先進国債券	グローバル債券	20%
		米国債券	15%
		欧州債券	15%
		オーストラリア債券	15%
	新興国債券	15%	
内外株式	世界株式	10%	
	国内株式	10%	

#### ・FOFs用外国債券オープン

日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。

#### ・Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class

主として米国の投資適格地方債(一般財源保証債及びレベニュー債)等に投資します。

ポートフォリオの構築は、米国の地方財政や米国地方債における各セクターの幅広いテクニカル要因及びファンダメンタルズ要因等の状況を精査した上で、個別銘柄に対する詳細な分析に基づいて行います。

#### ・ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム

「ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、原則として最高格付のユーロ通貨採用国の国債に投資し、利金等収益の確保と売買益の獲得を目指します。

## 今後の運用方針

---

- ・ **フランクリン・テンプレートン・オーストラリア毎月分配型ファンド**

フランクリン・テンプレートン・豪ドル債券マザーファンドを通じて、主として豪ドル建の公社債に投資を行い、信託財産の成長と毎月の安定した分配を目指します。

- ・ **ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド**

「ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主としてエマージング・カントリーのドル建てソブリン債券および準ソブリン債券に投資し、利子等収益の確保と売買益の獲得を目指します。

- ・ **ピクテ・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド**

主に高配当利回りの世界（新興国を含めます。）の公益株に投資し、安定的な収益分配を行うこと、また長期的な元本の成長を目指すことを目的として運用を行います。

- ・ **FOFs用日本株式インデックス・オープン**

主として、「国内株式インデックス マザーファンド受益証券」に投資し、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当作成期		項目の概要
	(2024年4月16日~2024年10月15日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	33円	0.425%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は7,669円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(8)	(0.105)	
(販売会社)	(23)	(0.303)	
(受託会社)	(1)	(0.017)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(商品)	(—)	(—)	
(先物・オプション)	(—)	(—)	
(c) 有価証券取引税	—	—	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(公社債)	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(d) その他費用	0	0.003	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(—)	(—)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(—)	(—)	
合計	33	0.428	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

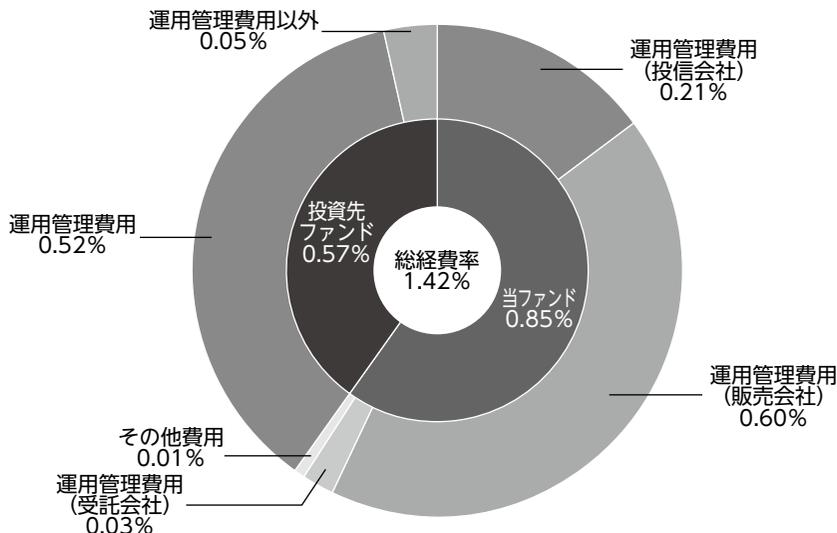
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

## <参考情報>

### 総経費率

当作成期中の運用・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1.42%です。



総経費率(①+②+③)	1.42%
①当ファンドの費用の比率	0.85%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.52%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.05%

(注1)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2)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3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

## 売買および取引の状況

### <投資信託受益証券>

		当 作 成 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国	FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	千口 —	千円 —	千口 38,541	千円 40,332
	FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	70,911	50,000	—	—
	ビクテ・ハイインカム・ツプリン・ファンド(適格機関投資家専用)	—	—	45,582	49,933
	フランクリン・テンブルトン・オーストラリア 毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用)	—	—	65,252	49,863
内	Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class	—	—	4	60,000

(注)金額は受渡代金です。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

区 分	当 作 成 期					
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
投資信託受益証券	百万円 50	百万円 50	% 100.0	百万円 200	百万円 140	% 70.0
コール・ローン	22,674	4,803	21.2	22,642	4,793	21.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### <当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 作 成 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
<b>債券ファンド</b>	千口	千円	%
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	2,146,999	2,213,556	19.9
ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用)	2,418,996	1,653,384	14.9
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)	1,496,715	1,665,246	15.0
フランクリン・templton・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用)	2,192,873	1,658,250	14.9
Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class	131	1,649,371	14.8
<b>株式ファンド</b>			
FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,542,743	1,016,667	9.1
ピクテ・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド	208	1,080,102	9.7
合 計	9,798,668	10,936,578	98.3

(注)比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円	%
	10,936,578	97.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	234,466	2.1
投 資 信 託 財 産 総 額	11,171,044	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第222期末 2024年5月14日現在	第223期末 2024年6月14日現在	第224期末 2024年7月16日現在	第225期末 2024年8月14日現在	第226期末 2024年9月17日現在	第227期末 2024年10月15日現在
(A)資産	11,397,524,696円	11,480,342,069円	11,808,893,908円	10,979,872,502円	10,787,407,432円	11,171,044,711円
コール・ローン等	185,838,981	188,306,985	265,581,980	202,652,613	184,689,634	180,650,688
投資信託受益証券(評価額)	11,190,289,135	11,260,825,285	11,539,334,458	10,769,937,564	10,578,801,602	10,936,578,495
未収入金	10,091,728	19,904,939	—	—	19,938,128	49,862,158
未収配当金	11,304,512	11,304,512	3,976,975	7,281,120	3,976,975	3,952,296
未収利息	340	348	495	1,205	1,093	1,074
(B)負債	37,986,298	40,960,442	43,452,857	40,705,222	42,374,759	47,362,975
未払収益分配金	29,495,443	29,412,591	29,535,074	29,433,328	29,373,326	29,281,126
未払解約金	893,695	3,271,904	5,200,599	3,650,647	4,292,830	10,845,348
未払信託報酬	7,548,154	8,222,565	8,660,954	7,572,087	8,652,430	7,189,823
その他未払費用	49,006	53,382	56,230	49,160	56,173	46,678
(C)純資産総額(A-B)	11,359,538,398	11,439,381,627	11,765,441,051	10,939,167,280	10,745,032,673	11,123,681,736
元本	14,747,721,704	14,706,295,675	14,767,537,108	14,716,664,345	14,686,663,108	14,640,563,395
次期繰越損益金	△3,388,183,306	△3,266,914,048	△3,002,096,057	△3,777,497,065	△3,941,630,435	△3,516,881,659
(D)受益権総口数	14,747,721,704口	14,706,295,675口	14,767,537,108口	14,716,664,345口	14,686,663,108口	14,640,563,395口
1万口当たり基準価額(C/D)	7.703円	7.779円	7.967円	7.433円	7.316円	7.598円

### ■損益の状況

項目	第222期 自 2024年4月16日 至 2024年5月14日	第223期 自 2024年5月15日 至 2024年6月14日	第224期 自 2024年6月15日 至 2024年7月16日	第225期 自 2024年7月17日 至 2024年8月14日	第226期 自 2024年8月15日 至 2024年9月17日	第227期 自 2024年9月18日 至 2024年10月15日
(A)配当等収益	32,173,763円	29,029,386円	66,644,858円	19,152,158円	27,539,908円	32,293,179円
受取配当金	32,164,704	29,019,275	66,631,826	19,128,964	27,506,534	32,264,179
受取利息	9,059	10,111	13,032	23,194	33,374	29,000
(B)有価証券売買損益	267,039,050	120,299,646	248,274,897	△767,679,569	△161,365,392	416,477,904
売買益	289,839,358	143,415,871	248,682,234	1,707,116	7,937,534	417,625,511
売買損	△22,800,308	△23,116,225	△407,337	△769,386,685	△169,302,926	△1,147,607
(C)信託報酬等	△7,597,160	△8,275,947	△8,717,184	△7,621,247	△8,708,603	△7,236,501
(D)当期損益金(A+B+C)	291,615,653	141,053,085	306,202,571	△756,148,658	△142,534,087	441,534,582
(E)前期繰越損益金	△1,401,792,991	△1,135,863,710	△1,020,805,576	△740,942,105	△1,522,801,296	△1,688,414,921
(F)追加信託差損益金	△2,248,510,525	△2,242,690,832	△2,257,957,978	△2,250,972,974	△2,246,921,726	△2,240,720,194
(配当等相当額)	(213,821,917)	(213,500,359)	(218,948,988)	(218,627,941)	(218,406,355)	(218,046,508)
(売買損益相当額)	(△2,462,332,442)	(△2,456,191,191)	(△2,476,906,966)	(△2,469,600,915)	(△2,465,328,081)	(△2,458,766,702)
(G)計(D+E+F)	△3,358,687,863	△3,237,501,457	△2,972,560,983	△3,748,063,737	△3,912,257,109	△3,487,600,533
(H)収益分配金	△29,495,443	△29,412,591	△29,535,074	△29,433,328	△29,373,326	△29,281,126
次期繰越損益金(G+H)	△3,388,183,306	△3,266,914,048	△3,002,096,057	△3,777,497,065	△3,941,630,435	△3,516,881,659
追加信託差損益金	△2,248,510,525	△2,242,690,832	△2,257,957,978	△2,250,972,974	△2,246,921,726	△2,240,720,194
(配当等相当額)	(213,821,917)	(213,500,359)	(218,948,988)	(218,627,941)	(218,406,355)	(218,046,508)
(売買損益相当額)	(△2,462,332,442)	(△2,456,191,191)	(△2,476,906,966)	(△2,469,600,915)	(△2,465,328,081)	(△2,458,766,702)
分配準備積立金	619,119,618	615,203,697	648,565,236	628,133,200	616,153,335	616,463,137
繰越損益金	△1,758,792,399	△1,639,426,913	△1,392,703,315	△2,154,657,291	△2,310,862,044	△1,892,624,602

(注1) (B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

※当ファンドの第222期首元本額は14,805,777,497円、第222～227期中追加設定元本額は144,579,005円、第222～227期中一部解約元本額は309,793,107円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 222 期	第 223 期	第 224 期	第 225 期	第 226 期	第 227 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	31,357,068円	27,420,542円	64,800,302円	11,530,911円	18,831,305円	31,772,151円
(B) 有価証券売却等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	213,821,917円	213,500,359円	218,948,988円	218,627,941円	218,406,355円	218,046,508円
(D) 分配準備積立金額	617,257,993円	617,195,746円	613,300,008円	646,035,617円	626,695,356円	613,972,112円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	862,436,978円	858,116,647円	897,049,298円	876,194,469円	863,933,016円	863,790,771円
(F) 期末残存口数	14,747,721,704口	14,706,295,675口	14,767,537,108口	14,716,664,345口	14,686,663,108口	14,640,563,395口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	584円	583円	607円	595円	588円	589円
(H) 分配金額(1万口当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円
(I) 収益分配金額(F×H/10,000)	29,495,443円	29,412,591円	29,535,074円	29,433,328円	29,373,326円	29,281,126円

## 分配金のお知らせ

	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
1万口当たり分配金	20円	20円	20円	20円	20円	20円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

### 【分配金の課税上の取扱いについて】

- ・収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

受益者が収益分配金を受け取る際、

- A. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合又は当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、
- B. 当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、当該収益分配金から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

- ・課税上の詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。
- ・税法が改正された場合などは、上記の内容が変更になる場合があります。

## お知らせ

---

ファンドにおける資金の借入について、要件の緩和を行うため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2024年7月13日)

## 組入投資信託証券の内容

### ■FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)

#### ●ファンドの概要

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	日本を除く世界の主要国の公社債
運用の基本方針	この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債に投資し、インカムゲインを確保しつつ、海外の主要な債券市場の動きをとらえることを目指して運用を行います。

#### ●損益の状況

項目	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
	自 2024年4月9日 至 2024年5月7日	自 2024年5月8日 至 2024年6月7日	自 2024年6月8日 至 2024年7月8日	自 2024年7月9日 至 2024年8月7日	自 2024年8月8日 至 2024年9月9日	自 2024年9月10日 至 2024年10月7日
(A) 配当等収益	32円	32円	37円	25円	337円	325円
受取利息	32	32	37	25	337	325
(B) 有価証券売買損益	27,974,854	51,444,862	72,913,964	△141,559,032	△23,444,131	63,749,947
売買益	27,974,854	51,615,892	73,088,076	—	—	63,762,085
売買損	—	△171,030	△174,112	△141,559,032	△23,444,131	△12,138
(C) 信託報酬等	△698,577	△759,668	△769,063	△734,809	△777,433	△654,750
(D) 当期損益金(A+B+C)	27,276,309	50,685,226	72,144,938	△142,293,816	△24,221,227	63,095,522
(E) 前期繰越損益金	203,085,387	226,949,024	271,550,404	339,812,873	194,499,359	166,059,145
(F) 追加信託差損益金	△153,180,866	△152,503,131	△151,175,447	△151,175,447	△151,175,447	△150,479,588
(配当等相当額)	(242,381)	(241,309)	(239,208)	(239,208)	(239,208)	(238,107)
(売買損益相当額)	(△153,423,247)	(△152,744,440)	(△151,414,655)	(△151,414,655)	(△151,414,655)	(△150,717,695)
(G) 計(D+E+F)	77,180,830	125,131,119	192,519,895	46,343,610	19,102,685	78,675,079
(H) 収益分配金	△2,404,094	△3,698,979	△3,882,469	△3,019,698	△3,451,084	△3,005,799
次期繰越損益金(G+H)	74,776,736	121,432,140	188,637,426	43,323,912	15,651,601	75,669,280
追加信託差損益金	△153,180,866	△152,503,131	△151,175,447	△151,175,447	△151,175,447	△150,479,588
(配当等相当額)	(242,381)	(241,309)	(239,208)	(239,208)	(239,208)	(238,107)
(売買損益相当額)	(△153,423,247)	(△152,744,440)	(△151,414,655)	(△151,414,655)	(△151,414,655)	(△150,717,695)
分配準備積立金	289,978,939	289,990,754	339,812,873	340,924,554	341,826,320	341,527,359
繰越損益金	△62,021,337	△16,055,483	—	△146,425,195	△174,999,272	△115,378,491

#### ●組入資産の明細

##### <親投資信託残高>

種類	第 221 期 末	第 227 期 末
	口 数	口 数 評 価 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 633,617	千口 615,410 千円 2,220,339

下記は、外国債券インデックス マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

第 銘	227 期 柄	期 末			
		利 率 (%)	評 価 額		
			額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.25% 09/30/25	0.25	3,000	2,887	428,661	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,454	512,881	2025/10/31
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,624	1,132,037	2026/1/31
T 0.375% 07/31/27	0.375	16,100	14,621	2,170,845	2027/7/31
T 0.375% 09/30/27	0.375	2,440	2,203	327,200	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,874	426,810	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,822	567,596	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	4,500	4,285	636,249	2026/2/28
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,700	400,984	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,206	476,124	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	6,960	6,360	944,345	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,235	628,899	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,780	1,006,630	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	7,500	6,929	1,028,879	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	9,100	7,636	1,133,822	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	10,800	10,176	1,510,837	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	9,949	1,477,139	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,263	336,043	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	9,600	8,670	1,287,290	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,688	1,141,563	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	6,000	5,719	849,132	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	9,500	9,035	1,341,484	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,795	563,536	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	9,630	9,073	1,347,163	2026/8/31
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,590	1,126,887	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	2,900	2,733	405,856	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,374	1,391,863	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	13,000	11,701	1,737,287	2028/7/31
T 1.125% 02/15/31	1.125	4,080	3,464	514,444	2031/2/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,314	1,085,918	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,105	164,171	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	5,200	3,332	494,801	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	12,030	10,857	1,612,019	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	8,480	7,769	1,153,582	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,314	1,085,918	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,550	2,888	428,854	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	6,000	5,475	812,908	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,000	8,197	1,217,013	2028/6/30
T 1.25% 08/15/31	1.25	9,230	7,779	1,155,025	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	9,500	8,601	1,276,994	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,621	983,103	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,733	999,706	2026/12/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	5,700	3,053	453,387	2050/8/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	3,520	3,196	474,568	2028/10/31
T 1.375% 11/15/31	1.375	12,580	10,629	1,578,105	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	3,986	591,803	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	8,680	7,854	1,166,215	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,685	844,086	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,744	852,871	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	15,500	14,829	2,201,772	2026/8/15
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,833	1,014,612	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,600	5,422	805,027	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	10,770	10,377	1,540,745	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	10,980	9,557	1,418,975	2031/5/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,108	906,887	2029/8/15
T 1.625% 10/31/26	1.625	12,300	11,746	1,743,931	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	3,949	586,453	2050/11/15

第 銘	227 期 柄	期 末			
		利 率 (%)	評 価 額		
			額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,558	676,752	2026/11/30
T 1.75% 01/31/29	1.75	10,200	9,361	1,389,841	2029/1/31
T 1.75% 08/15/41	1.75	7,080	4,914	729,719	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,718	403,670	2029/11/15
T 1.875% 02/15/32	1.875	11,720	10,208	1,515,694	2032/2/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	5,672	842,137	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	4,025	597,644	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	6,500	6,204	921,212	2027/2/28
T 1.875% 02/28/29	1.875	8,470	7,805	1,158,877	2029/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,003	742,837	2026/7/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	3,300	2,000	296,975	2051/11/15
T 2% 02/15/50	2.0	2,750	1,746	259,361	2050/2/15
T 2% 08/15/51	2.0	7,850	4,921	730,707	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	6,320	6,077	902,299	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	6,200	4,464	662,770	2041/11/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,494	518,895	2026/5/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	5,550	5,347	793,880	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	4,300	2,858	424,437	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	1,085,295	2026/3/31	
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	4,906	728,516	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	7,530	7,205	1,069,853	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	1,640	1,146	170,262	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	3,716	551,784	2049/8/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,310	640,024	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,294	1,082,998	2027/11/15
T 2.375% 02/15/42	2.375	5,500	4,194	622,725	2042/2/15
T 2.375% 03/31/29	2.375	4,600	684,094	2029/3/31	
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,536	376,582	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	11,690	11,258	1,671,613	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	6,010	5,645	838,139	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	7,450	5,122	760,487	2051/5/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	4,100	2,841	421,912	2049/11/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	2,810	2,100	311,922	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	2,450	1,810	268,835	2046/2/15
T 2.5% 03/31/27	2.5	7,100	6,874	1,020,659	2027/3/31
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,450	1,068	158,593	2046/5/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,604	683,567	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	7,740	7,368	1,094,056	2029/2/15
T 2.625% 05/31/27	2.625	2,400	2,326	345,345	2027/5/31
T 2.625% 07/31/29	2.625	15,200	14,399	2,137,956	2029/7/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,717	848,939	2025/12/31
T 2.75% 02/15/28	2.75	8,550	8,255	1,225,683	2028/2/15
T 2.75% 04/30/27	2.75	5,450	5,302	787,320	2027/4/30
T 2.75% 05/31/29	2.75	5,700	5,439	807,584	2029/5/31
T 2.75% 08/15/32	2.75	12,900	11,889	1,765,259	2032/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	7,100	5,733	851,256	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,087	458,352	2047/8/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	6,020	4,839	718,453	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,319	344,348	2047/11/15
T 2.875% 04/30/29	2.875	3,300	3,168	470,429	2029/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	10,060	9,734	1,445,299	2028/5/15
T 2.875% 05/15/32	2.875	10,100	9,417	1,398,151	2032/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	5,050	4,109	610,128	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	6,080	4,686	695,764	2049/5/15
T 2.875% 05/15/52	2.875	10,800	8,259	1,226,345	2052/5/15
T 2.875% 08/15/28	2.875	13,220	11,966	1,896,456	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	1,829	271,557	2045/8/15
T 2.875% 11/15/46	2.875	940	738	109,681	2046/11/15
T 2.875% 11/30/25	2.875	9,000	8,873	1,317,491	2025/11/30

銘柄	利率 (%)	227 期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 3% 02/15/47	3.0	3,920	3,139	466,102	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	1,000	795	118,042	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	1,000	790	117,401	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	2,450	2,063	306,403	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	700	569	84,576	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	1,710	1,366	202,933	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	3,250	2,575	382,365	2048/8/15
T 3% 08/15/52	3.0	5,200	4,081	606,039	2052/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,151	616,412	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	4,940	733,453	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,287	339,620	2044/11/15
T 3% 11/15/45	3.0	2,300	1,866	277,093	2045/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	905	134,445	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,800	3,224	478,742	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,780	3,882	576,467	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,840	1,536	228,173	2044/8/15
T 3.125% 08/31/27	3.125	6,150	6,029	895,149	2027/8/31
T 3.125% 08/31/29	3.125	7,150	6,926	1,028,366	2029/8/31
T 3.125% 11/15/28	3.125	10,410	10,130	1,504,095	2028/11/15
T 3.25% 05/15/42	3.25	4,150	3,616	537,013	2042/5/15
T 3.25% 06/30/29	3.25	6,500	6,338	941,041	2029/6/30
T 3.375% 05/15/33	3.375	13,630	13,066	1,940,052	2033/5/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	7,110	6,192	919,421	2044/5/15
T 3.375% 08/15/42	3.375	2,300	2,035	302,150	2042/8/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	4,489	666,505	2048/11/15
T 3.5% 01/31/30	3.5	4,000	3,936	584,415	2030/1/31
T 3.5% 02/15/33	3.5	11,200	10,851	1,611,191	2033/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	721	107,145	2039/2/15
T 3.5% 04/30/30	3.5	3,500	3,441	510,977	2030/4/30
T 3.625% 02/15/44	3.625	4,890	4,423	656,791	2044/2/15
T 3.625% 02/15/53	3.625	9,550	8,480	1,259,096	2053/2/15
T 3.625% 05/15/53	3.625	2,300	2,043	303,391	2053/5/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	4,700	4,266	633,479	2043/8/15
T 3.75% 04/15/26	3.75	6,570	6,545	971,751	2026/4/15
T 3.75% 06/30/30	3.75	3,000	2,985	443,191	2030/6/30
T 3.75% 11/15/43	3.75	6,130	5,657	839,906	2043/11/15
T 3.75% 12/31/30	3.75	6,160	6,120	908,751	2030/12/31
T 3.875% 01/15/26	3.875	6,500	6,484	962,717	2026/1/15
T 3.875% 02/15/43	3.875	2,500	2,365	351,137	2043/2/15
T 3.875% 08/15/33	3.875	11,070	11,002	1,633,483	2033/8/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,401	208,104	2040/8/15
T 3.875% 09/30/29	3.875	3,540	3,547	526,692	2029/9/30
T 3.875% 11/30/29	3.875	8,130	8,146	1,209,512	2029/11/30
T 4% 01/15/27	4.0	7,200	7,216	1,071,364	2027/1/15
T 4% 02/15/26	4.0	6,500	6,495	964,414	2026/2/15
T 4% 02/15/34	4.0	11,600	11,628	1,726,423	2034/2/15
T 4% 02/28/30	4.0	1,350	1,361	202,098	2030/2/28
T 4% 07/31/30	4.0	3,980	4,011	595,573	2030/7/31
T 4% 10/31/29	4.0	6,550	6,600	979,924	2029/10/31
T 4% 11/15/52	4.0	7,400	7,038	1,044,988	2052/11/15
T 4.125% 03/31/29	4.125	3,350	3,391	503,494	2029/3/31
T 4.125% 07/31/31	4.125	3,500	3,551	527,358	2031/7/31
T 4.125% 08/15/53	4.125	4,300	4,182	620,989	2053/8/15
T 4.125% 08/31/30	4.125	9,200	9,330	1,385,345	2030/8/31
T 4.125% 10/31/27	4.125	3,100	3,124	463,933	2027/10/31
T 4.125% 11/15/32	4.125	8,000	8,115	1,204,973	2032/11/15
T 4.25% 02/15/54	4.25	10,550	10,503	1,559,505	2054/2/15
T 4.25% 02/28/31	4.25	9,000	9,194	1,365,068	2031/2/28
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	913	135,611	2039/5/15
T 4.25% 08/15/54	4.25	1,000	997	148,110	2054/8/15
T 4.25% 10/15/25	4.25	6,900	6,904	1,025,120	2025/10/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	740	747	110,972	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,035	153,712	2038/2/15

銘柄	利率 (%)	227 期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 4.375% 05/15/34	4.375	6,310	6,512	966,854	2034/5/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	1,949	289,376	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	650	665	98,782	2041/5/15
T 4.375% 07/15/27	4.375	800	810	120,395	2027/7/15
T 4.375% 08/15/26	4.375	6,000	6,045	897,640	2026/8/15
T 4.375% 08/15/43	4.375	1,500	1,513	224,671	2043/8/15
T 4.375% 08/31/28	4.375	14,150	14,423	2,141,390	2028/8/31
T 4.375% 11/15/39	4.375	960	985	146,375	2039/11/15
T 4.375% 11/30/30	4.375	4,500	4,624	686,657	2030/11/30
T 4.375% 12/15/26	4.375	13,000	13,128	1,949,184	2026/12/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,149	170,657	2036/2/15
T 4.5% 04/15/27	4.5	9,150	9,288	1,379,010	2027/4/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	575	85,473	2038/5/15
T 4.5% 07/15/26	4.5	10,000	10,091	1,498,358	2026/7/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	1,771	262,948	2039/8/15
T 4.5% 11/15/33	4.5	9,270	9,650	1,432,821	2033/11/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,454	216,021	2040/2/15
T 4.625% 04/30/31	4.625	7,070	7,376	1,095,237	2031/4/30
T 4.625% 05/15/54	4.625	3,900	4,134	613,820	2054/5/15
T 4.625% 09/30/30	4.625	3,010	3,132	465,102	2030/9/30
T 4.625% 10/15/26	4.625	9,620	9,648	1,432,537	2026/10/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	802	119,077	2041/2/15
T 4.75% 11/15/53	4.75	3,880	4,189	621,968	2053/11/15
T 4.875% 05/31/26	4.875	3,400	3,447	511,778	2036/5/31
T 4.875% 10/31/30	4.875	4,960	5,231	776,698	2030/10/31
T 4.875% 11/30/25	4.875	9,700	9,777	1,451,663	2025/11/30
T 5.0% 05/15/37	5.0	400	439	65,257	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,371	205,566	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,122	313,109	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,748	259,625	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,547	229,804	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,176	174,746	2030/5/15
小 計				167,857,819	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	1,340	1,284	140,442	2026/3/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,320	1,990	217,592	2030/12/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	769	84,115	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,469	160,677	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	1,880	1,800	196,877	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,950	3,583	391,800	2030/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	910	885	96,777	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,300	2,986	326,483	2031/6/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	3,620	3,249	355,181	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	2,920	2,063	225,608	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	410	396	43,342	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,520	1,404	153,496	2032/6/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	3,750	2,854	312,086	2051/12/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	240	233	25,480	2029/6/1
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	2,190	2,194	239,900	2032/12/1
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	1,200	1,163	127,188	2033/6/1
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	1,600	1,586	173,467	2027/9/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	980	886	96,891	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	1,990	1,767	193,246	2055/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	620	550	60,232	2064/12/1
CAN 3% 04/01/26	3.0	1,340	1,333	145,814	2026/4/1
CAN 3% 06/01/34	3.0	2,620	2,577	281,772	2034/6/1
CAN 3% 10/01/25	3.0	3,290	3,273	357,895	2025/10/1
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	1,890	1,906	208,471	2028/9/1
CAN 3.25% 12/01/33	3.25	2,370	2,383	260,544	2033/12/1
CAN 3.25% 12/01/34	3.25	1,140	1,143	125,054	2034/12/1
CAN 3.5% 03/01/28	3.5	1,160	1,178	128,821	2028/3/1
CAN 3.5% 09/01/29	3.5	2,360	2,411	263,669	2029/9/1

第 227 期 末		評 価 額				償還年月日
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	債 額	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	960	986	107,878	2045/12/1	
CAN 4% 03/01/29	4.0	2,180	2,268	248,020	2029/3/1	
CAN 4% 05/01/26	4.0	2,250	2,272	248,460	2026/5/1	
CAN 4% 08/01/26	4.0	1,490	1,510	165,097	2026/8/1	
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	740	807	88,246	2041/6/1	
CAN 4.5% 02/01/26	4.5	300	304	33,258	2026/2/1	
CAN 4.5% 11/01/25	4.5	1,580	1,596	174,518	2025/11/1	
CAN 5% 06/01/37	5.0	490	577	63,113	2037/6/1	
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,490	1,670	182,602	2029/6/1	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,620	1,931	211,162	2033/6/1	
小 計				6,915,294		
<b>(メキシコ)</b>		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
<b>国債証券</b>						
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	8,915	68,675	2036/11/20	
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	33,260	30,572	235,499	2027/3/4	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	46,850	44,405	342,061	2026/3/5	
MBONO 7% 09/03/26	7.0	14,580	13,927	107,285	2026/9/3	
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	30,430	27,080	208,604	2033/5/26	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	33,800	32,419	249,728	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	38,870	35,972	277,099	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	32,960	27,343	210,633	2042/11/13	
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	18,410	16,466	126,840	2034/11/23	
MBONO 8% 07/31/53	8.0	28,240	23,534	181,285	2053/7/31	
MBONO 8% 11/07/47	8.0	24,600	20,672	159,241	2047/11/7	
MBONO 8.5% 03/01/29	8.5	25,020	24,318	187,331	2029/3/1	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	32,230	31,315	241,222	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	21,430	19,638	151,276	2038/11/18	
小 計				2,746,784		
<b>(ドイツ)</b>		千ユーロ	千ユーロ			
<b>国債証券</b>						
BKO 2.5% 03/19/26	2.5	1,110	1,113	181,301	2026/3/19	
BKO 2.7% 09/17/26	2.7	2,650	2,675	435,701	2026/9/17	
BKO 2.9% 06/18/26	2.9	730	737	120,169	2026/6/18	
BKO 3.1% 12/12/25	3.1	1,820	1,834	298,795	2025/12/12	
DBR 0% 02/15/30	—	1,260	1,132	184,419	2030/2/15	
DBR 0% 02/15/31	—	1,660	1,461	238,092	2031/2/15	
DBR 0% 02/15/32	—	3,100	2,667	434,499	2032/2/15	
DBR 0% 05/15/35	—	2,380	1,875	305,535	2035/5/15	
DBR 0% 05/15/36	—	2,430	1,859	302,859	2036/5/15	
DBR 0% 08/15/26	—	2,920	2,809	457,585	2026/8/15	
DBR 0% 08/15/29	—	2,950	2,679	436,443	2029/8/15	
DBR 0% 08/15/30	—	2,350	2,092	340,740	2030/8/15	
DBR 0% 08/15/30	—	1,980	1,763	287,156	2030/8/15	
DBR 0% 08/15/31	—	3,990	3,473	565,733	2031/8/15	
DBR 0% 08/15/50	—	5,040	2,681	436,812	2050/8/15	
DBR 0% 08/15/52	—	3,020	1,531	249,505	2052/8/15	
DBR 0% 11/15/27	—	2,820	2,649	431,603	2027/11/15	
DBR 0% 11/15/28	—	1,990	1,835	299,004	2028/11/15	
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	2,490	2,388	388,988	2027/2/15	
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,970	1,829	298,047	2029/2/15	
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,090	1,958	318,941	2028/8/15	
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,931	477,441	2026/2/15	
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,360	1,295	210,994	2028/2/15	
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	350	335	54,673	2027/8/15	
DBR 1% 05/15/38	1.0	2,360	1,976	321,852	2038/5/15	
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,430	2,669	434,730	2048/8/15	
DBR 1.7% 08/15/32	1.7	2,600	2,529	411,934	2032/8/15	
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	3,700	3,179	517,807	2053/8/15	
DBR 2.1% 11/15/29	2.1	3,430	3,435	559,508	2029/11/15	
DBR 2.2% 02/15/34	2.2	2,900	2,904	473,098	2034/2/15	
DBR 2.3% 02/15/33	2.3	4,320	4,378	713,184	2033/2/15	
DBR 2.4% 11/15/30	2.4	2,000	2,034	331,389	2030/11/15	
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,930	2,922	476,063	2044/7/4	

第 227 期 末		評 価 額				償還年月日
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	債 額	
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,010	3,005	489,454	2046/8/15	
DBR 2.5% 08/15/54	2.5	1,540	1,542	251,192	2054/8/15	
DBR 2.6% 05/15/41	2.6	300	304	49,516	2041/5/15	
DBR 2.6% 08/15/33	2.6	2,890	2,994	487,688	2033/8/15	
DBR 2.6% 08/15/34	2.6	1,350	1,395	227,306	2034/8/15	
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,030	2,247	366,010	2042/7/4	
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,570	3,013	490,888	2037/1/4	
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,810	2,027	359,470	2039/7/4	
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,430	1,569	255,585	2028/7/4	
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,500	3,054	497,423	2034/7/4	
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,060	2,665	434,199	2040/7/4	
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	3,100	3,713	604,821	2031/1/4	
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,810	3,123	508,721	2028/1/4	
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,570	1,891	308,092	2030/1/4	
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	2,690	3,002	489,042	2027/7/4	
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	2,972	484,081	2026/4/10	
OBL 0% 04/16/27	—	2,780	2,640	430,092	2027/4/16	
OBL 0% 10/09/26	—	2,680	2,569	418,415	2026/10/9	
OBL 0% 10/10/25	—	3,000	2,929	477,084	2025/10/10	
OBL 1.3% 10/15/27	1.3	3,550	3,477	566,371	2027/10/15	
OBL 2.1% 04/12/29	2.1	2,780	2,784	453,490	2029/4/12	
OBL 2.2% 04/13/28	2.2	870	874	142,436	2028/4/13	
OBL 2.4% 10/19/28	2.4	4,270	4,327	704,785	2028/10/19	
<b>(イタリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
BTPS 0% 04/01/26	—	2,240	2,159	351,656	2026/4/1	
BTPS 0% 08/01/26	—	3,230	3,089	503,234	2026/8/1	
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	2,030	1,873	305,111	2028/3/15	
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	1,640	1,487	242,287	2029/2/15	
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,859	302,838	2026/2/1	
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	1,300	1,200	195,583	2028/7/15	
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	1,960	1,666	271,453	2031/8/1	
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,340	2,256	367,478	2027/1/15	
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,920	2,566	416,350	2031/4/1	
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,320	972	158,320	2037/3/1	
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,320	1,977	322,116	2032/6/1	
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	1,180	1,054	171,790	2030/8/1	
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,640	1,566	255,177	2027/9/15	
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,848	301,044	2031/12/1	
BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	2,350	2,270	369,824	2027/4/1	
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,670	1,628	265,202	2026/12/1	
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	2,250	2,076	338,120	2030/4/1	
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,730	1,394	227,171	2036/3/1	
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	833	135,776	2045/4/30	
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,080	1,065	173,490	2026/6/1	
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	2,430	2,198	358,568	2032/3/1	
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,348	382,559	2030/12/1	
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,520	964	157,111	2051/9/1	
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	960	722	117,704	2041/3/1	
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,210	2,218	361,354	2028/2/1	
BTPS 2% 12/01/25	2.0	3,220	3,200	521,193	2025/12/1	
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	1,280	1,263	205,844	2027/8/1	
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	1,440	1,430	233,027	2026/7/15	
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	690	435	70,992	2072/3/1	
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	1,020	706	115,112	2052/9/1	
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,263	368,605	2027/6/1	
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,650	1,441	234,824	2036/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	1,510	1,417	230,801	2033/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,380	1,043	169,887	2050/9/1	
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	860	859	140,002	2025/11/15	
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	2,520	2,396	390,393	2032/12/1	
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	1,760	1,764	287,406	2027/12/1	
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,110	907	147,868	2047/3/1	

第 227 期 末		利率 (%)	評 価 額			償還年月日
銘 柄	額面金額		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	950	726	118,292	2067/3/1	
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	2,610	2,609	425,082	2029/6/15	
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,420	1,426	232,362	2028/12/1	
BTPS 2.95% 02/15/27	2.95	860	867	141,360	2027/2/15	
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	1,380	1,266	206,265	2038/9/1	
BTPS 3% 08/01/29	3.0	1,150	1,160	189,080	2029/8/1	
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,303	212,241	2040/3/1	
BTPS 3.2% 01/28/26	3.2	2,000	2,014	328,097	2026/1/28	
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	2,080	1,979	322,346	2038/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	2,270	2,040	332,389	2046/9/1	
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	2,330	2,310	376,299	2035/3/1	
BTPS 3.35% 07/01/29	3.35	1,600	1,636	266,519	2029/7/1	
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	1,550	1,588	258,747	2028/4/1	
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,820	1,679	273,468	2048/3/1	
BTPS 3.45% 07/15/31	3.45	340	347	56,545	2031/7/15	
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	1,840	1,860	302,977	2026/1/15	
BTPS 3.5% 02/15/31	3.5	2,440	2,502	407,528	2031/2/15	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,360	2,437	397,076	2030/3/1	
BTPS 3.7% 06/15/30	3.7	1,730	1,796	292,528	2030/6/15	
BTPS 3.8% 04/15/26	3.8	1,870	1,904	310,162	2026/4/15	
BTPS 3.8% 08/01/28	3.8	1,760	1,829	297,964	2028/8/1	
BTPS 3.85% 07/01/34	3.85	1,480	1,533	249,700	2034/7/1	
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,580	1,543	251,387	2049/9/1	
BTPS 3.85% 09/15/26	3.85	860	881	143,521	2026/9/15	
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	2,860	2,993	487,469	2029/12/15	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,070	3,210	522,893	2037/2/1	
BTPS 4% 04/30/35	4.0	880	924	150,584	2035/4/30	
BTPS 4% 10/30/31	4.0	1,250	1,325	215,836	2031/10/30	
BTPS 4% 11/15/30	4.0	2,310	2,435	396,717	2030/11/15	
BTPS 4.1% 02/01/29	4.1	1,140	1,201	195,651	2029/2/1	
BTPS 4.15% 10/01/39	4.15	1,010	1,048	170,714	2039/10/1	
BTPS 4.2% 03/01/34	4.2	1,920	2,048	333,603	2034/3/1	
BTPS 4.3% 10/01/54	4.3	700	714	116,395	2054/10/1	
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	2,090	2,257	367,694	2033/11/1	
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	1,060	1,150	187,461	2033/5/1	
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	1,560	1,659	270,335	2043/9/1	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,135	347,774	2026/3/1	
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	1,510	1,609	262,172	2053/10/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	2,829	460,795	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,850	2,053	334,505	2044/9/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,830	3,211	523,134	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,640	2,992	487,451	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,680	3,041	495,377	2039/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,350	3,736	608,577	2029/11/1	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,690	438,145	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,140	1,343	218,745	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,700	3,013	490,837	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,534	249,945	2026/11/1	
<b>(フランス)</b>						
<b>国債証券</b>						
FRTR 0% 02/25/26	—	4,020	3,890	633,651	2026/2/25	
FRTR 0% 02/25/27	—	4,000	3,780	615,768	2027/2/25	
FRTR 0% 05/25/32	—	3,780	3,069	499,954	2032/5/25	
FRTR 0% 11/25/29	—	4,820	4,228	688,725	2029/11/25	
FRTR 0% 11/25/30	—	6,120	5,213	849,138	2030/11/25	
FRTR 0% 11/25/31	—	5,340	4,409	718,133	2031/11/25	
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	3,700	3,538	576,246	2026/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	4,500	4,366	711,223	2026/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	4,260	3,881	632,226	2029/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	2,690	1,783	290,494	2040/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	1,290	468	76,233	2072/5/25	
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	2,030	1,205	196,379	2044/6/25	
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	5,200	4,916	800,716	2028/2/25	

第 227 期 末		利率 (%)	評 価 額			償還年月日
銘 柄	額面金額		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,660	5,328	867,791	2028/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	2,940	1,537	250,340	2052/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	3,040	1,549	252,296	2053/5/25	
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	4,550	4,239	690,466	2028/11/25	
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,970	4,794	780,943	2027/5/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	4,200	4,131	672,874	2025/11/25	
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	5,510	4,738	771,786	2034/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,450	3,662	596,355	2036/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	2,920	2,291	373,191	2038/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,280	4,909	799,591	2031/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,050	2,038	332,055	2050/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,680	1,058	172,404	2066/5/25	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,570	2,963	482,699	2039/6/25	
FRTR 2% 05/25/48	2.0	2,860	2,198	358,043	2048/5/25	
FRTR 2% 11/25/32	2.0	2,900	2,729	444,548	2032/11/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,570	5,537	901,909	2030/5/25	
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	1,910	1,679	273,601	2043/5/25	
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	3,690	3,697	602,201	2026/9/24	
FRTR 2.5% 09/24/27	2.5	1,900	1,904	310,113	2027/9/24	
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	4,840	4,877	794,451	2029/2/25	
FRTR 2.75% 02/25/30	2.75	2,170	2,182	355,402	2030/2/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,460	5,512	897,761	2027/10/25	
FRTR 3% 05/25/33	3.0	4,210	4,253	692,732	2033/5/25	
FRTR 3% 05/25/54	3.0	2,450	2,202	358,786	2054/5/25	
FRTR 3% 06/25/49	3.0	770	713	116,169	2049/6/25	
FRTR 3% 11/25/34	3.0	990	990	161,369	2034/11/25	
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,860	2,805	456,987	2045/5/25	
FRTR 3.25% 05/25/55	3.25	920	865	140,904	2055/5/25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,730	4,808	783,137	2026/4/25	
FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	4,100	4,293	699,332	2033/11/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,540	2,738	446,030	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,970	2,141	348,741	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	2,140	2,320	379,543	2038/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,490	4,231	655,012	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,460	4,004	652,181	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,920	6,655	1,084,050	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,370	5,286	860,979	2032/10/25	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	1,967	320,365	2025/10/25	
<b>(オランダ)</b>						
<b>国債証券</b>						
NETHER 0% 01/15/26	—	1,190	1,155	188,255	2026/1/15	
NETHER 0% 01/15/27	—	1,730	1,647	268,341	2027/1/15	
NETHER 0% 01/15/29	—	1,770	1,610	262,337	2029/1/15	
NETHER 0% 01/15/38	—	1,390	976	159,106	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,740	854	139,249	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,350	1,184	192,929	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,370	1,172	190,922	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	950	865	140,945	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,470	1,069	174,177	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,750	1,699	276,736	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	1,300	1,129	183,880	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,060	1,020	166,337	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	960	910	148,221	2028/7/15	
NETHER 2% 01/15/54	2.0	1,300	1,116	181,789	2054/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	1,210	1,222	199,097	2030/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,210	1,218	198,344	2033/1/15	
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	1,170	1,174	191,331	2033/7/15	
NETHER 2.5% 07/15/34	2.5	1,090	1,089	177,415	2034/7/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,900	1,909	310,973	2047/1/15	
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	840	904	147,298	2044/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,700	1,936	315,379	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,660	1,895	308,744	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,600	1,764	287,408	2028/1/15	

銘柄	利率 (%)	227 期 末			
		額面金額	評価額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(スペイン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SPGB 0% 01/31/26	—	2,660	2,575	419,477	2026/1/31
SPGB 0% 01/31/27	—	2,910	2,755	448,793	2027/1/31
SPGB 0% 01/31/28	—	3,050	2,819	459,155	2028/1/31
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	2,460	2,091	340,615	2031/4/30
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,210	2,875	468,404	2030/4/30
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	2,570	2,217	361,105	2031/10/31
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	1,970	1,794	292,236	2029/10/31
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,500	2,161	352,081	2032/4/30
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,337	380,688	2027/7/30
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	2,210	2,041	332,537	2029/7/30
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,760	1,328	216,308	2037/7/30
SPGB 1% 07/30/42	1.0	1,350	919	149,804	2042/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,000	1,143	186,214	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,110	1,544	251,492	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,370	3,120	508,250	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,070	2,027	330,204	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	2,230	2,155	351,100	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	2,400	2,313	376,791	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,574	419,291	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	1,960	1,907	310,679	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	340	55,466	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,500	1,468	239,176	2027/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,190	1,957	318,804	2035/7/30
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	1,890	1,327	216,180	2052/10/31
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,300	2,284	372,017	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,020	1,955	318,544	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,570	1,563	254,676	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	1,890	1,820	296,472	2033/7/30
SPGB 2.5% 05/31/27	2.5	2,330	2,336	380,503	2027/5/31
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	2,500	2,462	401,109	2032/10/31
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,710	1,478	240,827	2048/10/31
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	2,220	2,232	363,657	2026/5/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,780	1,614	262,998	2046/10/31
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	2,170	2,224	362,318	2033/4/30
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	2,150	2,208	359,621	2034/4/30
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	1,290	1,279	208,433	2043/7/30
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,530	1,446	235,584	2066/7/30
SPGB 3.45% 10/31/34	3.45	1,790	1,863	303,566	2034/10/31
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	1,980	2,066	336,592	2029/5/31
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	2,270	2,391	389,469	2033/10/31
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	1,660	1,768	288,115	2039/7/30
SPGB 4% 10/31/54	4.0	770	812	132,309	2054/10/31
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,800	1,995	324,930	2037/1/31
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,780	2,076	338,163	2041/7/30
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,880	2,229	363,136	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,710	4,096	667,170	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,640	2,031	330,834	2044/10/31
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,250	2,725	443,860	2032/7/30
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,310	2,452	399,378	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	910	1,042	169,737	2029/1/31
<b>(ベルギー)</b>					
<b>国債証券</b>					
BGB 0% 10/22/27	—	900	840	136,950	2027/10/22
BGB 0% 10/22/31	—	1,460	1,220	198,860	2031/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,420	1,242	202,407	2030/6/22
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	1,220	1,026	167,143	2032/6/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	660	435	70,867	2040/6/22
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	530	223	36,406	2071/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,510	1,453	236,700	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,600	1,515	246,865	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,790	1,671	272,285	2029/6/22

銘柄	利率 (%)	227 期 末			
		額面金額	評価額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,560	1,526	248,639	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,770	1,603	261,085	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,310	1,173	191,082	2033/4/22
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	1,050	667	108,754	2053/6/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	630	526	85,796	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	950	691	112,605	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,100	786	128,122	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,020	886	144,372	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	880	651	106,108	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	670	516	84,137	2057/6/22
BGB 2.7% 10/22/29	2.7	610	617	100,532	2029/10/22
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	730	699	113,699	2039/4/22
BGB 2.85% 10/22/34	2.85	1,110	1,112	181,129	2034/10/22
BGB 3% 06/22/33	3.0	1,450	1,482	241,438	2033/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,050	171,075	2034/6/22
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	1,020	992	161,573	2054/6/22
BGB 3.45% 06/22/43	3.45	440	451	73,524	2043/6/22
BGB 3.5% 06/22/55	3.5	690	693	112,873	2055/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	930	992	161,659	2045/6/22
BGB 4% 03/28/32	4.0	880	960	156,462	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,680	1,904	310,205	2041/3/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,175	191,407	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,810	2,152	350,505	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,040	2,254	367,190	2028/3/28
<b>(オーストリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
RAGB 0% 02/20/30	—	1,790	1,572	256,091	2030/2/20
RAGB 0% 02/20/31	—	1,670	1,425	232,098	2031/2/20
RAGB 0% 10/20/28	—	880	801	130,607	2028/10/20
RAGB 0% 10/20/40	—	650	405	66,108	2040/10/20
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	720	529	86,257	2036/10/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,800	1,663	270,975	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,490	1,426	232,376	2027/4/20
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	420	194	31,702	2071/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	880	836	136,244	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	461	75,197	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	1,480	1,436	234,030	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	230	105	17,159	2120/6/30
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	1,120	994	161,959	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,190	1,174	191,263	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,080	813	132,542	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	400	245	40,050	2086/11/2
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	660	526	85,717	2049/5/23
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	650	505	82,310	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	930	905	147,548	2034/5/23
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	1,510	1,536	250,310	2033/2/20
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	1,060	1,075	175,105	2034/2/20
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	350	358	58,336	2029/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	844	137,516	2044/6/20
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	440	444	72,392	2053/10/20
RAGB 3.2% 07/15/39	3.2	330	338	55,191	2039/7/15
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	330	347	56,602	2030/10/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	488	79,526	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,550	1,753	285,630	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,170	1,210	197,204	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,305	212,653	2027/7/15
<b>(フィンランド)</b>					
<b>国債証券</b>					
RFGB 0% 09/15/26	—	460	439	71,658	2026/9/15
RFGB 0% 09/15/30	—	720	622	101,393	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	440	323	52,643	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	219	35,769	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	710	602	98,102	2031/9/15

第 227 期 末		評 価 額				
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外 貨 建 金 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	350	230	37,497	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	570	554	90,298	2026/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	490	318	51,839	2043/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	540	513	83,618	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	780	726	118,299	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	530	483	78,684	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	510	456	74,323	2031/4/15	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	640	555	90,551	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	350	342	55,735	2027/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	570	421	68,722	2047/4/15	
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	570	524	85,475	2032/9/15	
RFGB 2.5% 04/15/30	2.5	460	461	75,121	2030/4/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	470	447	72,920	2042/7/4	
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	400	392	63,882	2038/4/15	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	680	690	112,535	2028/7/4	
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	340	346	56,515	2029/4/15	
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	350	344	56,039	2055/4/15	
RFGB 3% 09/15/33	3.0	520	533	86,882	2033/9/15	
RFGB 3% 09/15/34	3.0	430	439	71,654	2034/9/15	
<b>(アイルランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
IRISH 0% 10/18/31	—	1,120	949	154,701	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	670	636	103,747	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	910	802	130,720	2030/10/18	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	450	383	62,406	2032/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	690	550	89,579	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	410	289	47,080	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	770	736	119,928	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,000	980	159,621	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	980	930	151,531	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	430	392	63,914	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	370	348	56,759	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	609	99,207	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	740	661	107,671	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,010	876	142,752	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	930	934	152,171	2030/5/15	
IRISH 2.6% 10/18/34	2.6	200	200	32,731	2034/10/18	
IRISH 3% 10/18/43	3.0	370	380	62,001	2043/10/18	
ユ ー ロ 計				108,396,623		
<b>(イギリス)</b>						
<b>国債証券</b>						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,260	1,201	234,107	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	1,510	1,338	260,873	2028/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	2,490	1,949	379,927	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	2,980	2,776	541,087	2026/10/22	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,180	1,772	345,416	2030/10/22	
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	2,880	2,495	486,327	2029/1/31	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	2,420	722	140,730	2061/10/22	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,250	1,563	304,597	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	1,450	585	114,030	2050/10/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,530	762	148,583	2046/1/31	
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	3,400	2,605	507,699	2033/7/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,460	1,262	246,044	2029/10/22	
UKT 1% 01/31/32	1.0	3,700	3,007	585,992	2032/1/31	
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	2,130	1,402	273,339	2039/1/31	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	1,050	382	74,492	2073/10/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	1,250	1,163	226,759	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	2,610	1,264	246,345	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,030	1,256	244,763	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,800	2,681	522,474	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,450	817	159,207	2047/7/22	
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	1,680	847	165,212	2053/7/31	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,460	1,340	261,224	2028/10/22	

第 227 期 末		評 価 額				
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	外 貨 建 金 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,340	691	134,831	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,790	809	157,800	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,080	630	122,811	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,900	994	193,696	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,400	1,802	351,291	2037/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,420	883	172,071	2065/7/22	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,310	1,916	373,450	2044/1/22	
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	3,960	3,737	728,317	2033/1/31	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,000	1,710	333,209	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,470	1,179	229,773	2068/7/22	
UKT 3.5% 10/22/25	3.5	2,350	2,327	453,533	2025/10/22	
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	2,430	2,292	446,733	2038/1/29	
UKT 3.75% 03/07/27	3.75	1,970	1,953	380,613	2027/3/7	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,150	987	192,460	2052/7/22	
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	3,060	2,614	509,487	2053/10/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,250	1,116	217,529	2060/1/22	
UKT 4% 10/22/31	4.0	1,140	1,138	221,741	2031/10/22	
UKT 4% 10/22/63	4.0	1,440	1,279	249,270	2063/10/22	
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	3,540	3,539	689,582	2027/1/29	
UKT 4.125% 07/22/29	4.125	1,210	1,215	236,843	2029/7/22	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,730	1,735	338,135	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,320	1,345	262,137	2032/6/7	
UKT 4.25% 07/31/34	4.25	1,650	1,665	324,521	2034/7/31	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,270	1,247	243,029	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,800	1,817	354,174	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,450	1,414	275,610	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,930	1,826	355,978	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,440	1,354	263,917	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,700	1,587	309,283	2055/12/7	
UKT 4.375% 01/31/40	4.375	500	496	96,723	2040/1/31	
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	1,390	1,322	257,705	2054/7/31	
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	3,370	3,422	666,960	2028/6/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,390	1,432	279,164	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,290	2,279	444,243	2042/12/7	
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	2,230	2,318	451,752	2034/1/31	
UKT 4.75% 10/22/43	4.75	1,830	1,869	364,206	2043/10/22	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,910	1,996	389,029	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,800	1,874	365,250	2038/12/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	2,010	2,174	423,626	2028/12/7	
小 計				19,329,739		
<b>(スウェーデン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	5,280	4,703	67,355	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,780	6,565	94,020	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,770	6,417	91,899	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	7,940	7,816	111,931	2026/11/12	
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	4,610	4,506	64,531	2033/11/11	
SGB 2.25% 06/10/32	2.25	5,300	5,409	77,459	2032/6/1	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	3,970	4,576	65,528	2039/3/30	
小 計				572,727		
<b>(ノルウェー)</b>						
<b>国債証券</b>						
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	4,780	4,166	57,959	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	5,200	4,663	64,864	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	5,320	5,162	71,815	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,770	4,585	63,786	2027/2/17	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	4,100	3,802	52,891	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	4,150	3,961	55,102	2028/4/26	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,730	3,425	47,655	2032/5/18	
NGB 3% 08/15/33	3.0	5,180	5,036	70,055	2033/8/15	
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	1,860	1,878	26,130	2042/10/6	
NGB 3.625% 04/13/34	3.625	3,760	3,826	53,222	2034/4/13	
小 計				563,484		

銘柄	利率 (%)	227 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(デンマーク)</b>					
国債証券		千デンマーク クローネ	千デンマーク クローネ		
DGB 0% 11/15/31	—	6,540	5,682	124,095	2031/11/15
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	5,940	3,393	74,107	2052/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	4,990	4,779	104,380	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	5,490	5,106	111,525	2029/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	6,560	6,531	142,640	2025/11/15
DGB 2.25% 11/15/26	2.25	2,040	2,051	44,812	2026/11/15
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	3,880	3,925	85,740	2033/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	9,470	12,003	262,163	2039/11/15
小計				949,467	
<b>(ポーランド)</b>					
国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
POLGB 0% 10/25/25	—	1,480	1,415	53,390	2025/10/25
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	4,500	4,109	155,063	2026/10/25
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	3,900	3,127	118,002	2030/10/25
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	4,610	3,621	136,639	2032/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,900	4,716	177,941	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	4,530	4,259	160,698	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	4,250	3,962	149,513	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,000	5,386	203,214	2029/10/25
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	2,110	2,054	77,500	2027/5/25
POLGB 4.75% 07/25/29	4.75	1,650	1,621	61,174	2029/7/25
POLGB 5% 10/25/34	5.0	1,160	1,127	42,537	2034/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	6,360	6,527	246,272	2029/4/25
POLGB 6% 10/25/33	6.0	4,350	4,552	171,764	2033/10/25
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	3,970	4,314	162,785	2028/7/25
小計				1,916,499	
<b>(オーストラリア)</b>					
国債証券		千オーストラリア ドル	千オーストラリア ドル		
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	1,960	1,883	190,207	2025/11/21
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,390	2,248	227,123	2026/9/21
ACGB 1% 11/21/31	1.0	2,780	2,283	230,587	2031/11/21
ACGB 1% 12/21/30	1.0	1,500	1,268	128,137	2030/12/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,770	2,282	230,550	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,250	2,801	282,921	2031/6/21
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,860	1,041	105,156	2051/6/21
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,000	1,692	170,940	2032/11/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,040	1,946	196,574	2028/5/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	2,340	2,192	221,426	2030/5/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,330	1,071	108,197	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,950	1,723	174,042	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,530	1,491	150,637	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,604	162,050	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,780	1,701	171,815	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,350	1,050	106,119	2047/3/21
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,840	1,696	171,298	2033/11/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,110	2,073	209,425	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	940	834	84,234	2039/6/21
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	1,690	1,609	162,582	2034/12/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,440	1,381	139,536	2037/4/21
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	2,340	2,285	230,795	2034/5/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,770	1,783	180,182	2026/4/21
ACGB 4.25% 06/21/34	4.25	750	761	76,953	2034/6/21
ACGB 4.25% 12/21/35	4.25	940	951	96,088	2035/12/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,720	2,818	284,656	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,160	2,218	224,080	2027/4/21
ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	720	733	74,090	2054/6/21
小計				4,790,414	
<b>(ニュージーランド)</b>					
国債証券		千ニュージー ランドドル	千ニュージー ランドドル		
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	1,340	1,185	108,539	2028/5/15
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	730	692	63,410	2026/5/15

銘柄	利率 (%)	227 期 末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(シンガポール)</b>					
国債証券		千シンガポール ドル	千シンガポール ドル		
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	1,000	855	78,254	2031/5/15
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	460	301	27,589	2041/5/15
NZGB 2% 05/15/32	2.0	900	775	71,004	2032/5/15
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	630	521	47,737	2037/4/15
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	600	409	37,457	2051/5/15
NZGB 3% 04/20/29	3.0	940	909	83,271	2029/4/20
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	1,320	1,253	114,687	2033/4/14
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	750	748	68,525	2034/5/15
NZGB 4.25% 05/15/36	4.25	610	597	54,691	2036/5/15
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	930	948	86,550	2027/4/15
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	570	586	53,708	2030/5/15
NZGB 4.5% 05/15/35	4.5	440	444	40,684	2035/5/15
NZGB 5% 05/15/54	5.0	380	383	35,071	2054/5/15
小計				971,482	
<b>(マレーシア)</b>					
国債証券		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット		
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	790	771	87,779	2025/11/1
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	870	847	96,414	2026/11/1
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	560	523	59,623	2031/7/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	730	611	69,542	2050/3/1
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	420	349	39,744	2051/10/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	1,030	1,022	116,392	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	760	720	81,944	2036/8/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	560	532	60,568	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	720	722	82,164	2028/5/1
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	460	457	52,022	2032/8/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	820	817	92,977	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	627	71,375	2042/4/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	900	910	103,618	2029/7/1
SIGB 2.875% 08/01/28	2.875	140	141	16,118	2028/8/1
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	420	424	48,259	2027/9/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	840	850	96,823	2030/9/1
SIGB 3% 04/01/29	3.0	150	152	17,382	2029/4/1
SIGB 3% 08/01/72	3.0	490	532	60,629	2072/8/1
SIGB 3.25% 06/01/54	3.25	210	232	26,450	2054/6/1
SIGB 3.375% 05/01/34	3.375	160	168	19,186	2034/5/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	880	924	105,240	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	740	756	86,080	2027/3/1
小計				1,490,341	
<b>(マレーシア)</b>					
国債証券		千マレーシア リンギット	千マレーシア リンギット		
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,650	1,548	53,921	2031/4/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,515	52,761	2027/5/31
MGS 3.519% 04/20/28	3.519	710	711	24,770	2028/4/20
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	1,310	1,296	45,120	2032/7/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,930	2,956	102,924	2028/6/15
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	2,950	2,874	100,050	2040/5/22
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,770	1,783	62,090	2034/7/5
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,830	1,841	64,090	2033/4/15
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	2,160	2,195	76,414	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,144	39,838	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,999	69,605	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,470	2,501	87,094	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	1,210	1,222	42,566	2026/7/15
MGS 4.054% 04/18/39	4.054	460	468	16,298	2039/4/18
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	3,070	3,027	105,406	2050/6/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,490	2,568	89,413	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,750	1,816	63,226	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,750	1,778	61,919	2026/4/15
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	1,740	1,819	63,324	2053/3/31
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	2,930	3,060	106,537	2030/4/15
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	720	750	26,118	2029/4/30

銘柄	利率 (%)	227 期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債建金額	
			外債建金額	邦貨換算金額 (千円)		
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	2,010	2,146	74,715	2033/11/7	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	1,970	2,138	74,448	2042/10/15	
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	980	1,067	37,168	2046/3/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,780	3,013	104,903	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	2,130	2,348	81,744	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,680	1,878	65,404	2048/7/6	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,030	1,150	40,039	2043/9/30	
小 計				1,831,917		
(中国オフショア)		千オフショア 人民元	千オフショア 人民元			
国債証券						
CGB 1.62% 08/15/27	1.62	21,000	21,021	440,014	2027/8/15	
CGB 1.67% 06/15/26	1.67	34,680	34,818	728,799	2026/6/15	
CGB 1.85% 05/15/27	1.85	42,700	42,955	899,129	2027/5/15	
CGB 1.91% 07/15/29	1.91	23,000	23,071	482,915	2029/7/15	
CGB 1.99% 03/15/26	1.99	25,520	25,740	538,788	2026/3/15	
CGB 2.04% 02/25/27	2.04	41,310	41,736	873,602	2027/2/25	
CGB 2.05% 04/15/29	2.05	36,880	37,168	777,994	2029/4/15	
CGB 2.11% 08/25/34	2.11	16,500	16,416	343,628	2034/8/25	
CGB 2.12% 06/25/31	2.12	32,000	32,064	671,155	2031/6/25	
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	35,600	35,987	753,284	2026/8/15	
CGB 2.27% 05/25/34	2.27	38,000	38,282	801,305	2034/5/25	
CGB 2.28% 03/25/31	2.28	50,700	51,726	1,082,712	2031/3/25	
CGB 2.28% 11/25/25	2.28	30,220	30,510	638,623	2025/11/25	
CGB 2.3% 05/15/26	2.3	47,100	47,695	998,350	2026/5/15	
CGB 2.33% 12/15/25	2.33	35,250	35,610	745,390	2025/12/15	
CGB 2.35% 02/25/34	2.35	25,200	25,525	534,293	2034/2/25	
CGB 2.37% 01/15/29	2.37	34,560	35,337	739,677	2029/1/15	
CGB 2.37% 01/20/27	2.37	43,880	44,706	935,773	2027/1/20	
CGB 2.39% 11/15/26	2.39	42,750	43,367	907,756	2026/11/15	
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	42,610	43,526	911,076	2028/7/15	
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	17,700	18,102	378,905	2027/10/15	
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	29,300	29,634	620,288	2026/2/15	
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	20,000	20,435	427,753	2027/4/15	
CGB 2.48% 09/25/28	2.48	26,500	27,183	569,004	2028/9/25	
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	26,760	27,357	572,643	2027/7/25	
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	58,370	59,902	1,253,847	2033/8/25	
CGB 2.54% 12/25/30	2.54	30,500	31,339	655,991	2030/12/25	
CGB 2.55% 10/15/28	2.55	27,250	27,991	585,916	2028/10/15	
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	32,050	33,067	692,156	2032/9/1	
CGB 2.6% 09/15/30	2.6	30,500	31,437	658,028	2030/9/15	
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	34,000	34,992	732,444	2028/4/15	
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	36,400	37,518	785,315	2030/6/25	
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	20,940	21,732	454,890	2029/9/25	
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	38,220	39,323	823,098	2028/1/15	
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	34,280	35,563	744,403	2033/5/25	
CGB 2.67% 11/25/33	2.67	23,400	24,307	508,789	2033/11/25	
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	30,700	31,742	664,419	2030/5/21	
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	32,900	33,577	702,829	2026/8/12	
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	19,420	20,158	421,960	2032/8/15	
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	14,500	15,117	316,431	2032/2/17	
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	25,490	26,517	555,048	2029/6/15	
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	13,150	13,724	287,282	2032/5/15	
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	30,300	31,582	661,072	2029/12/15	
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	23,080	24,017	502,729	2029/3/24	
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	39,490	41,282	864,111	2030/3/25	
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	4,600	4,824	100,991	2032/11/15	
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	31,030	32,017	670,185	2027/6/4	
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	11,300	11,921	249,535	2033/2/25	
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	24,210	25,572	535,282	2031/11/18	
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	24,320	25,361	530,852	2028/10/14	
CGB 3% 10/15/53	3.0	13,770	15,749	329,658	2053/10/15	
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	12,590	13,135	274,948	2028/5/13	

銘柄	利率 (%)	227 期 末				償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債建金額	
			外債建金額	邦貨換算金額 (千円)		
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	27,560	29,256	612,384	2031/5/27	
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	49,870	50,730	1,061,871	2025/10/22	
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	18,800	19,227	402,465	2026/3/11	
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	12,970	15,032	314,656	2052/10/25	
CGB 3.19% 04/15/53	3.19	18,360	21,563	451,367	2053/4/15	
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,378	154,452	2030/11/19	
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	14,110	14,840	310,644	2027/12/3	
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	35,000	37,336	781,510	2029/5/23	
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	18,600	21,811	456,549	2052/4/15	
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	20,930	25,088	525,141	2050/3/16	
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	8,350	10,316	215,944	2051/10/18	
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	15,140	19,096	399,720	2051/4/12	
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	24,020	30,761	643,890	2050/9/14	
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	18,180	23,325	488,245	2049/7/22	
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	19,370	25,512	534,014	2048/10/22	
小 計				40,287,944		
(イスラエル)		千イスラエル シェゲル	千イスラエル シェゲル			
国債証券						
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	3,260	3,090	120,353	2026/2/27	
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	3,530	2,920	113,736	2030/3/31	
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	2,970	2,328	90,684	2032/4/30	
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	2,880	1,939	75,541	2037/5/31	
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	2,530	2,386	92,946	2027/3/31	
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,700	2,479	96,570	2028/9/28	
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	1,520	947	36,907	2052/11/29	
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	2,690	2,601	101,328	2029/2/28	
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,570	2,038	79,415	2047/3/31	
ILGOV 3.75% 09/30/27	3.75	970	949	36,991	2027/9/30	
ILGOV 4% 03/30/35	4.0	1,490	1,383	53,867	2035/3/30	
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	2,190	2,267	88,314	2042/1/31	
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,340	1,387	54,048	2026/10/30	
小 計				1,040,706		
合 計				359,661,249		

(注)邦貨換算金額は、当該日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。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	227 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 EURO-SCHATZ	226	—
US 5YR NOTE	597	—
EURO-BOBL FU	330	—
EURO-BUND	697	—
国 US 10YR NOTE	385	—
US LONG BOND	452	—

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

## 組入投資信託証券の内容

### ■Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund JPY Dividend Retail Class

#### ●ファンドの概要

投資顧問会社	ヌビーン・アセット・マネジメント・エルエルシー
主な投資対象・投資地域	米国の投資適格地方債
運用の基本方針等	主として米国の投資適格地方債(一般財源保証債及びレベニュー債)等に投資し、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

以下の「損益の状況」は「U. S. MUNICIPAL BOND FUND, A SERIES TRUST OF GLOBAL MULTI STRATEGY Annual Report and Audited Financial Statements For the year ended 31<sup>st</sup> December 2023」の情報に基に、「組入上位10銘柄」は当該ファンドの運用会社からの情報を基に掲載しています。

## Global Multi Strategy - U.S. Municipal Bond Fund

### ● 損益の状況 (2023年12月31日までの会計期間)

	<b>2023</b> <b>US\$</b>	<b>2022</b> <b>US\$</b>
<b>Investment loss</b>		
Interest income on cash and cash equivalents	601,159	135,924
Interest income from debt securities at fair value through profit or loss	34,487,517	30,459,539
Net foreign exchange (loss)/gain	(538,144)	18,097
Net loss on financial assets and liabilities at fair value through profit or loss	<u>(54,768,459)</u>	<u>(297,405,309)</u>
<b>Total investment loss</b>	<b><u>(20,217,927)</u></b>	<b><u>(266,791,749)</u></b>
<b>Expenses</b>		
Trustee fees	247,405	244,789
Manager fees	2,885,418	2,855,854
Administration fees	494,670	489,577
Custodian fees	237,918	247,596
FX Manager fees	141,245	148,174
FX Calculation Agent fees	193,358	213,200
Audit fees	37,086	40,587
Negative yield expense	6,373	2,734
Other fees and expenses	<u>27,421</u>	<u>27,090</u>
<b>Total operating expenses</b>	<u>4,270,894</u>	<u>4,269,601</u>
<b>Operating loss before finance costs</b>	<b><u>(24,488,821)</u></b>	<b><u>(271,061,350)</u></b>
<b>Finance costs</b>		
Distributions	<u>(9,530,996)</u>	<u>(7,150,510)</u>
<b>Total finance costs</b>	<b><u>(9,530,996)</u></b>	<b><u>(7,150,510)</u></b>
<b>Decrease in Net Assets attributable to Holders of Redeemable Participating Units from operations</b>	<b><u>(34,019,817)</u></b>	<b><u>(278,211,860)</u></b>

The accompanying notes form an integral part of these financial statements.

●組入上位10銘柄(2023年12月末時点)

	銘 柄	種 別	満 期	クーポン(%)	比 率
1	ロサンゼルス市水道・電力局	レベニュー債	2039/7/1	6.008	2.77%
2	クック郡	一般財源保証債	2034/11/15	6.229	2.30%
3	ジョブズオハイオ・ビバレッジ・システム	レベニュー債	2033/1/1	4.433	2.27%
4	シカゴ市交通公社	レベニュー債	2040/12/1	6.200	2.23%
5	ダラス市	一般財源保証債	2024/2/15	0.800	2.12%
6	ロイヤルオーク市	一般財源保証債	2037/10/1	4.524	1.99%
7	ダラス・コンベンションセンター・ホテル開発公社	レベニュー債	2042/1/1	7.088	1.98%
8	ペンシルベニア州経済開発資金調達公社	レベニュー債	2039/6/15	6.532	1.97%
9	ロサンゼルス統一学校区	一般財源保証債	2034/7/1	5.750	1.94%
10	ニューヨーク州ドミトリー公社(モンテフィオーレ・メディカル・センター・レベニュー)	レベニュー債	2048/8/1	4.946	1.85%

※上記の比率は、純資産総額に占める割合です。

## 組入投資信託証券の内容

### ■ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用)

#### ●ファンドの概要

運用会社	ピクテ・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	ユーロ通貨採用国の国債
運用の基本方針	ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンドを通じて、質の高いユーロ通貨採用国の国債に投資し、安定的かつより優れた分配金原資の獲得を目的として運用を行います。

#### ●損益の状況

項 目	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
	自 2024年4月9日 至 2024年5月7日	自 2024年5月8日 至 2024年6月7日	自 2024年6月8日 至 2024年7月8日	自 2024年7月9日 至 2024年8月7日	自 2024年8月8日 至 2024年9月9日	自 2024年9月10日 至 2024年10月7日
(A) 配 当 等 収 益	20円	9円	31円	90円	338円	313円
受 取 利 息	20	9	31	90	338	313
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,114,272	29,191,609	44,245,156	△84,819,410	△20,547,782	43,190,579
売 買 益	13,114,272	29,191,609	44,245,156	—	—	43,190,579
売 買 損	—	—	—	△84,819,410	△20,547,782	—
(C) 信 託 報 酬 等	△676,328	△736,477	△745,755	△717,682	△763,856	△644,060
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	12,437,964	28,455,141	43,499,432	△85,537,002	△21,311,300	42,546,832
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△580,354,712	△570,335,744	△544,299,599	△503,219,163	△591,175,161	△614,905,457
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466
(配 当 等 相 当 額)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)
(G) 計 (D+E+F)	△749,890,214	△723,854,069	△682,773,633	△770,729,631	△794,459,927	△754,332,091
(H) 収 益 分 配 金	△2,418,996	△2,418,996	△2,418,996	△2,418,996	△2,418,996	△2,418,996
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△752,309,210	△726,273,065	△685,192,629	△773,148,627	△796,878,923	△756,751,087
追 加 信 託 差 損 益 金	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466	△181,973,466
(配 当 等 相 当 額)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)	(10,508,599)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)	(△192,482,065)
分 配 準 備 積 立 金	283,943,828	287,868,773	291,855,838	295,089,823	298,663,174	301,858,514
繰 越 損 益 金	△854,279,572	△832,168,372	△795,075,001	△886,264,984	△913,568,631	△876,636,135

#### ●組入資産の明細

##### < 親投資信託残高 >

種 類	第 221 期 末	第 227 期 末
	口 数	口 数 評 価 額
ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド	千口 727,165	千口 719,027 千円 1,658,222

下記は、ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘		柄		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 (千円)	
(ドイツ)					千ユーロ	千ユーロ		
	国債証券	4.75% DEUTSCHLAND		4.75	10,550	13,643	2,222,077	2040/7/4
		6.25% BUNDESREPUB. DEUTS		6.25	4,900	5,902	961,266	2030/1/4
		6.5% DEUTSCHLAND		6.5	11,400	12,722	2,072,097	2027/7/4
(フランス)								
	国債証券	5.75% FRANCE GOVT		5.75	2,300	2,780	452,930	2032/10/25
(オランダ)								
	国債証券	3.75% NETHERLANDS GOVERN		3.75	3,985	4,534	738,604	2042/1/15
合 計							6,446,976	

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

## 組入投資信託証券の内容

### ■フランクリン・templton・オーストラリア毎月分配型ファンド (適格機関投資家専用)

#### ●ファンドの概要

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	豪ドル建の公社債
運用の基本方針	フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンドを通じて、主として豪ドル建の公社債に投資を行い、信託財産の成長と毎月の安定した分配を目指します。

#### ●損益の状況

項目	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
	自 2024年4月9日 至 2024年5月7日	自 2024年5月8日 至 2024年6月7日	自 2024年6月8日 至 2024年7月8日	自 2024年7月9日 至 2024年8月7日	自 2024年8月8日 至 2024年9月9日	自 2024年9月10日 至 2024年10月7日
(A) 有価証券売買損益	25,629,717円	48,417,951円	68,733,826円	△164,060,636円	4,588,236円	81,273,164円
売 買 益	25,629,718	48,508,616	68,826,792	—	4,588,236	81,273,165
売 買 損	△1	△90,665	△92,966	△164,060,636	—	△1
(B) 信託報酬等	△719,698	△789,657	△798,745	△755,021	△800,913	△684,661
(C) 当期損益金(A+B)	24,910,019	47,628,294	67,935,081	△164,815,657	3,787,323	80,588,503
(D) 前期繰越損益金	△348,263,948	△324,824,957	△277,338,551	△212,732,084	△380,876,355	△380,417,646
(E) 追加信託差損益金	△225,940,228	△224,615,211	△222,032,976	△222,032,976	△222,032,976	△222,032,976
(配当等相当額)	(55,153,244)	(54,829,800)	(54,199,462)	(54,199,462)	(54,199,462)	(54,199,462)
(売買損益相当額)	(△281,093,472)	(△279,445,011)	(△276,232,438)	(△276,232,438)	(△276,232,438)	(△276,232,438)
(F) 計 (C+D+E)	△549,294,157	△501,811,874	△431,436,446	△599,580,717	△599,122,008	△521,862,119
(G) 収益分配金	△3,387,188	△3,367,325	△3,328,614	△3,328,614	△3,328,614	△3,328,614
次期繰越損益金(F+G)	△552,681,345	△505,179,199	△434,765,060	△602,909,331	△602,450,622	△525,190,733
追加信託差損益金	△225,940,228	△224,615,211	△222,032,976	△222,032,976	△222,032,976	△222,032,976
(配当等相当額)	(55,153,244)	(54,829,800)	(54,199,462)	(54,199,462)	(54,199,462)	(54,199,462)
(売買損益相当額)	(△281,093,472)	(△279,445,011)	(△276,232,438)	(△276,232,438)	(△276,232,438)	(△276,232,438)
分配準備積立金	9,903,598	11,496,209	13,195,248	13,862,291	14,829,696	15,860,576
繰越損益金	△336,644,715	△292,060,197	△225,927,332	△394,738,646	△395,247,342	△319,018,333

#### ●組入資産の明細

##### <親投資信託残高>

種 類	第 221 期 末	第 227 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンド	千口 543,197	千口 526,039	千円 1,697,899

下記は、フランクリン・templton・豪ドル債券マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

第	227		期 末		
	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額 ドル	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
<b>(オーストラリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
AUSTRALIAN GOVT	1.0	4,000	3,260	329,291	2031/11/21
AUSTRALIAN GOVT	1.25	4,400	3,601	363,760	2032/5/21
AUSTRALIAN GOVT	1.75	2,300	1,931	195,048	2032/11/21
AUSTRALIAN GOVT	4.5	7,560	7,776	785,377	2033/4/21
AUSTRALIAN GOVT	3.75	5,700	5,524	557,951	2034/5/21
AUSTRALIAN GOVT	3.5	3,440	3,250	328,298	2034/12/21
AUSTRALIAN GOVT	2.75	13,650	11,953	1,207,259	2035/6/21
AUSTRALIAN GOVT	3.75	8,900	8,457	854,233	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVT	3.25	9,990	8,764	885,175	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVT	2.75	5,850	4,657	470,408	2041/5/21
AUSTRALIAN GOVT	3.0	8,000	6,147	620,944	2047/3/21
AUSTRALIAN GOVT	1.75	6,660	3,657	369,394	2051/6/21
AUSTRALIAN GOVT	4.75	750	751	75,897	2054/6/21
<b>地方債証券</b>					
AUCKLAND COUNCIL	3.5	500	492	49,762	2026/3/9
AUCKLAND COUNCIL	2.9	1,500	1,429	144,370	2027/9/16
AUST CAPITAL TERRITORY	2.25	1,000	912	92,148	2029/5/22
AUST CAPITAL TERRITORY	5.25	900	920	93,006	2033/10/24
AUST CAPITAL TERRITORY	5.25	500	498	50,371	2036/10/23
KUNTARAOHITUS OVJ	3.5	1,000	986	99,614	2026/2/4
MANITOBA PROVANCE	3.5	1,500	1,443	145,821	2028/8/22
NEW S WALES TREAS CORP	3.0	4,840	4,533	457,902	2030/2/20
NEW S WALES TREASURY	3.0	5,700	5,417	547,207	2029/4/20
NEW S WALES TREASURY	2.0	9,900	8,528	861,407	2031/3/20
NEW S WALES TREASURY	1.5	5,900	4,755	480,300	2032/2/20
NEW S WALES TREASURY	2.0	5,300	4,283	432,586	2033/3/8
NEW S WALES TREASURY	1.75	5,000	3,810	384,813	2034/3/20
NEW S WALES TREASURY	4.75	3,000	2,937	296,732	2035/2/20
NEW S WALES TREASURY	4.75	400	384	38,792	2037/2/20
NORTHERN TERRITORY TREAS	3.5	500	488	49,290	2028/4/21
NORTHERN TERRITORY TREAS	2.0	1,000	899	90,892	2029/5/21
NORTHERN TERRITORY TREAS	3.75	4,000	3,635	367,202	2033/4/21
NORTHERN TERRITORY TREAS	4.5	500	465	46,975	2035/3/21
PROVINCE OF QUEBEC	3.7	1,000	988	99,799	2026/5/20
QUEENSLAND TREASURY	2.5	3,200	2,984	301,414	2029/3/6
QUEENSLAND TREASURY	3.25	2,100	2,007	202,756	2029/8/21
QUEENSLAND TREASURY	1.75	4,700	3,927	396,710	2031/8/21
QUEENSLAND TREASURY	1.5	2,750	2,212	223,415	2032/3/2
QUEENSLAND TREASURY	1.5	2,200	1,740	175,803	2032/8/20
QUEENSLAND TREASURY	6.5	4,000	4,482	452,726	2033/3/14
QUEENSLAND TREASURY	1.75	3,600	2,710	273,767	2034/7/20
QUEENSLAND TREASURY	4.5	2,800	2,671	269,854	2035/8/22
SOUTH AUST GOVT FIN	3.0	200	192	19,450	2028/5/24
SOUTH AUST GOVT FIN	2.75	2,500	2,300	232,346	2030/5/24
SOUTH AUST GOVT FIN	1.75	3,000	2,442	246,678	2032/5/24
SOUTH AUST GOVT FIN	1.75	1,000	756	76,394	2034/5/24
TASMANIAN PUBLIC FINANCE	4.0	550	511	51,677	2034/1/20
TREASURY CORP VICTORIA	3.0	3,300	3,154	318,571	2028/10/20
TREASURY CORP VICTORIA	2.5	4,500	4,126	416,767	2029/10/22
TREASURY CORP VICTORIA	4.75	1,600	1,626	164,237	2030/11/20
TREASURY CORP VICTORIA	1.5	3,900	3,278	331,092	2030/11/20
TREASURY CORP VICTORIA	1.5	3,000	2,447	247,223	2031/9/10
TREASURY CORP VICTORIA	4.25	1,400	1,348	136,241	2032/12/20
TREASURY CORP VICTORIA	2.25	8,600	6,942	701,188	2033/9/15
TREASURY CORP VICTORIA	2.25	5,300	4,119	416,065	2034/11/20
TREASURY CORP VICTORIA	2.0	5,200	3,823	386,135	2035/9/17

第	227		期 末		
	利 率 (%)	額面金額	評 価 外貨建金額 千円	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
WESTERN AUST TREAS CORP	2.75	700	655	66,240	2029/7/24
WESTERN AUST TREAS CORP	1.75	1,100	918	92,773	2031/10/22
WESTERN AUST TREAS CORP	4.25	2,000	1,941	196,063	2033/7/20
WESTERN AUST TREAS CORP	2.0	1,900	1,474	148,931	2034/10/24
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
ASIAN DEVELOPMENT BANK	3.3	500	483	48,822	2028/8/8
ASIAN DEVELOPMENT BANK	4.8	1,000	1,008	101,828	2033/1/17
CORP ANDINA DE FOMENTO	4.5	6,500	6,457	652,199	2025/6/5
EUROPEAN INVESTMENT BANK	3.3	1,100	1,048	105,873	2029/5/25
EUROPEAN INVESTMENT BANK	4.55	1,200	1,189	120,111	2033/6/2
INTER-AMERICAN DEVEL BK	3.85	2,000	1,961	198,149	2029/1/24
INTL BK RECON & DEVELOP	1.1	1,000	819	82,796	2030/11/18
INTL FINANCE CORP	3.15	1,500	1,425	143,937	2029/6/26
INTL FINANCE CORP	1.25	2,000	1,640	165,724	2031/2/6
OLMPS 2024-2 A1S	1.0	800	799	80,777	2056/7/10
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
AGI FINANCE PTY LTD	2.119	1,000	927	93,718	2027/6/24
AGI FINANCE PTY LTD	1.8152	1,900	1,670	168,732	2028/11/23
AGI FINANCE PTY LTD	6.109	1,500	1,564	157,997	2030/6/28
AIRSERVICES AUSTRALIA	5.4	500	513	51,841	2028/11/15
AIRSERVICES AUSTRALIA	2.2	1,000	873	88,224	2030/5/15
AIRSERVICES AUSTRALIA	6.0	1,500	1,586	160,251	2032/11/15
APPLE INC	3.6	500	493	49,884	2026/6/10
AUCKLAND INTL AIRPORT	6.482	500	533	53,851	2033/11/16
AUST & NZ BANKING FRN	6.405	500	522	52,726	2034/9/20
AUST & NZ BANKING GROUP	5.35	900	921	93,048	2027/11/4
AUST & NZ BANKING GROUP	4.95	500	505	51,087	2028/9/11
AUST & NZ BANKING GROUP	5.0	700	710	71,718	2029/6/18
AUSTRALIAN CATHOLIC UNI	3.7	1,290	1,252	126,499	2027/8/3
AUSTRALIAN GAS LIGHT	2.1486	1,900	1,718	173,562	2028/4/28
AUSTRALIAN GAS LIGHT	2.82	2,000	1,706	172,348	2031/4/28
AUSTRALIAN NATIONAL UNIV	3.98	500	496	50,170	2025/11/18
BANCO SANTANDER SA	5.678	1,300	1,318	133,156	2028/3/9
BANCO SANTANDER SA	5.796	900	919	92,847	2029/1/23
BANCO SANTANDER SA	6.499	900	931	94,072	2031/1/23
BANK OF AMERICA CORP	5.815	500	520	52,548	2028/10/30
BANK OF MONTREAL	5.338	800	807	81,563	2029/6/27
BANK OF QUEENSLAND	4.7	800	795	80,353	2027/1/27
BENDIGO AND ADELAIDE BK	3.0	1,000	992	100,192	2025/3/17
BENDIGO AND ADELAIDE BK	5.1	600	607	61,397	2028/6/16
BNG BANK NV	3.3	500	481	48,669	2028/7/17
BNG BANK NV	3.3	2,000	1,908	192,766	2029/4/26
BNG BANK NV	1.55	1,000	801	80,921	2032/2/19
BPCE SA	2.0	2,500	2,451	247,596	2025/6/5
BPCE SA	5.2018	1,000	1,002	101,267	2025/9/29
BWP TRUST	3.3	2,100	2,051	207,235	2026/4/10
BWP TRUST	2.2	1,250	1,136	114,805	2028/3/24
CHARTER HALL EXCH FIN	2.317	1,200	1,016	102,616	2030/9/25
CIBC AUSTRALIA	4.4	1,000	997	100,784	2025/7/15
CLIFFORD CAPITAL PTE LTD	4.753	500	507	51,278	2028/8/31
COMMONWEALTH BANK AU FRN	6.86	800	847	84,942	2032/11/9
COMMONWEALTH BANK AUST	3.25	3,000	2,923	295,255	2026/11/17
COMMONWEALTH BANK AUST	2.4	1,100	1,050	106,150	2027/1/14
COMMONWEALTH BANK AUST	4.4	3,000	2,920	302,003	2027/8/18
COMMONWEALTH BANK AUST	5.0	750	759	76,703	2028/1/13
CPPIB CAPITAL INC	4.4	700	699	70,688	2026/1/16
CPPIB CAPITAL INC	4.45	800	804	81,258	2027/9/1
CPPIB CAPITAL INC	4.4	500	500	50,549	2029/1/15
CPPIB CAPITAL INC	5.2	1,000	1,022	103,279	2034/3/4

第	227					期	末	
	銘	柄	利率 (%)	額				償還年月日
				額面金額	外貨建金額			
CREDIT AGRICOLE SA	5.3636	500	507	51,262	2028/6/1			
DBS BANK LTD	4.678	500	500	50,569	2026/2/24			
DBS BANK LTD	4.7	600	601	60,714	2027/2/26			
DEUTSCHE BAHN FIN GMBH	3.8	1,000	977	98,732	2027/9/27			
DEXUS FINANCE PTY LTD	4.75	1,500	1,496	151,186	2025/11/5			
DEXUS FINANCE PTY LTD	4.25	2,700	2,640	266,671	2027/5/11			
DEXUS FINANCE PTY LTD	2.5	1,600	1,390	140,425	2029/10/17			
DEXUS FINANCE PTY LTD	3.0	1,500	1,243	125,566	2032/2/3			
DEXUS WHOLESALE PROPERTY	4.75	1,000	997	100,736	2025/6/16			
DWPF FINANCE PTY LTD	1.9	1,700	1,502	151,744	2028/8/4			
DWPF FINANCE PTY LTD	2.6	2,430	1,927	194,637	2032/8/4			
EDITH COWAN UNIVERSITY	3.0	1,500	1,382	139,633	2029/4/11			
EDITH COWAN UNIVERSITY	2.741	600	482	48,769	2033/7/15			
EXPORT FIN & INS	1.465	500	414	41,871	2031/8/18			
EXPORT FIN & INS	5.315	2,000	2,111	213,245	2033/11/2			
FONTERRA COOPERATIVE GAO	4.0	2,500	2,447	247,235	2027/11/2			
GAIF BOND ISSUER P/L	2.584	3,100	2,882	291,146	2027/11/18			
GAIF BOND ISSUER P/L	1.9	1,600	1,404	141,872	2028/12/14			
GENERAL PROPERTY TRUST	2.849	600	490	49,509	2032/2/20			
GPT WHL OFFICE FD NOI	4.52	1,950	1,921	194,055	2027/2/22			
GPT WHL OFFICE FD NOI	3.222	2,300	1,959	197,864	2031/11/5			
HSBC LTD SYDNEY	5.1	500	507	51,217	2028/3/3			
HSBC LTD/SYDNEY FRN	5.4496	1,000	1,008	101,844	2028/3/3			
ICPF FINANCE PTY LTD	4.25	2,500	2,422	244,702	2027/4/21			
ICPF FINANCE PTY LTD	2.725	2,900	2,447	247,153	2030/10/11			
ING BANK (AUSTRALIA) LTD	4.837	500	501	50,627	2027/3/22			
ING BANK (AUSTRALIA) LTD	4.554	500	498	50,352	2027/8/20			
JOHN DEERE FINANCIAL LTD	4.9	500	500	50,504	2025/7/28			
JP MORGAN CHASE & CO	4.5	3,000	2,979	300,882	2026/1/30			
KFW	4.2	500	499	50,421	2029/2/8			
KIWI BANK LTD	4.885	500	500	50,550	2027/4/2			
KOMMUNALBANKEN AS	3.0	1,000	973	98,308	2026/12/9			
KOMMUNALBANKEN AS	4.35	500	500	50,584	2028/1/18			
KOMMUNALBANKEN AS	2.4	1,000	902	91,195	2029/11/21			
L-BANK BW FOERDERBANK	3.45	1,000	963	97,335	2028/4/11			
LA TROBE UNIVERSITY	5.311	500	508	51,404	2030/8/8			
LANDWIRTSCH. RENTENBANK	3.2	1,000	954	96,452	2029/5/25			
LLOYDS BANKING GROUP FRN	5.687	1,000	1,016	102,647	2030/3/6			
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5.802	500	510	51,579	2029/3/17			
MACQUARIE BANK LTD	4.946	800	805	81,353	2026/9/14			
MACQUARIE UNIVERSITY	3.5	2,000	1,905	192,488	2028/9/7			
MACQUARIE UNIVERSITY	2.25	2,700	2,317	234,108	2030/5/22			
MET LIFE GLOB FUNDIN FRN	5.6075	1,000	999	100,944	2029/7/11			
METLIFE GLOB FUNDING I	4.0	3,767	3,688	372,538	2027/7/13			
MIRVAC GROUP FINANCE LTD	2.6	1,500	1,332	134,574	2029/9/18			
MITSUBISHI HC CAP US PLC	5.805	500	507	51,265	2026/12/7			
MIZUHO BANK LTD FRN	5.1527	700	700	70,776	2027/9/6			
MIZUHO FINANCIAL GRO FRN	6.025	800	832	84,087	2029/8/28			
MONASH UNIVERSITY	4.05	600	579	58,506	2029/4/6			
MTR CORP CI LTD	3.3	1,000	955	96,485	2027/6/28			
NATIONAL AUSTRALIA B FRN	5.5511	2,500	2,537	256,297	2027/11/25			
NATIONAL AUSTRALIA BANK	3.9	500	497	50,277	2025/5/30			
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2.9	1,300	1,253	126,575	2027/2/25			
NATIONWIDE BLDG SOCIETY	5.35	1,000	1,007	101,736	2028/3/15			
NATWEST MARKETS PLC	5.0546	500	500	50,562	2025/8/12			
NATWEST MARKETS PLC	5.899	1,300	1,339	135,311	2028/8/23			
NBN CO LTD	1.0	3,300	3,165	319,682	2025/12/3			
NBN CO LTD	2.15	1,200	1,095	110,649	2028/6/2			
NBN CO LTD	2.2	2,500	2,125	214,696	2030/12/16			
NEDER WATERSCHAPS BANK	3.15	500	489	49,399	2026/9/2			
NEDER WATERSCHAPS BANK	3.45	1,000	969	97,876	2028/7/17			
NEDER WATERSCHAPS BANK	3.3	1,500	1,427	144,153	2029/5/2			

第	227					期	末	
	銘	柄	利率 (%)	額				償還年月日
				額面金額	外貨建金額			
NESTLE CAPITAL CORP	5.25	700	706	71,402	2034/4/4			
NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	5.35	1,100	1,120	113,183	2028/9/19			
NEW YORK LIFE GLOBAL FDG	5.1	900	906	91,589	2029/7/24			
NEW YORK LIFE GLOBAL FRN	5.57	1,000	998	100,865	2029/7/24			
NORFINA LTD FRN	5.3614	800	800	80,851	2029/9/27			
OPTUS FINANCE PTY LTD	1.6	500	487	49,278	2025/7/1			
OPTUS FINANCE PTY LTD	2.6	2,000	1,820	183,866	2028/11/24			
OPTUS FINANCE PTY LTD	2.5	3,500	3,022	305,254	2030/7/1			
QIC SHOPPING CENTRE FUND	2.0	1,800	1,756	177,447	2025/8/15			
QIC SHOPPING CENTRE FUND	5.8	600	611	61,766	2031/5/21			
RABOBANK NEDERLAND(AUST)	5.051	1,200	1,216	122,820	2029/2/26			
REGISTRY FINANCE PTY LTD	5.472	900	908	91,791	2031/12/19			
SGSP AUSTRALIA ASSETS	1.843	2,700	2,385	240,936	2028/9/15			
SHINHAN BANK	1.183	2,700	2,609	263,512	2025/9/29			
SPARK FINANCE LTD	1.9	500	478	48,291	2026/6/5			
SPARK FINANCE LTD	4.0	2,000	1,954	197,440	2027/10/20			
SPARK FINANCE LTD	2.6	3,100	2,735	276,263	2030/3/18			
STOCKLAND TRUST MGMT	2.3	3,500	3,175	320,748	2028/3/24			
STOCKLAND TRUST MGMT	5.45	500	503	50,895	2030/4/26			
STOCKLAND TRUST MGMT	6.1	500	508	51,377	2034/9/12			
SUNCORP-METWAY LTD	3.25	5,000	4,881	493,056	2026/8/24			
SUNCORP-METWAY LTD	4.8	1,900	1,910	192,930	2027/12/14			
SVENSKA HANDELSBANKEN AB	5.0	500	503	50,826	2028/3/2			
SWEDISH EXPORT CREDIT	5.4	800	827	83,615	2030/11/1			
TELSTRA CORP LTD	4.0	2,000	1,972	199,182	2027/4/19			
TELSTRA CORP LTD	4.9	800	805	81,376	2028/3/8			
TELSTRA GROUP LTD	5.25	1,000	1,008	101,886	2031/9/6			
TORONTO-DOMINION BANK	5.248	500	501	50,698	2029/7/23			
TRANSPOWER NEW ZEALAND L	4.977	900	910	91,975	2028/11/29			
UBS AG AUSTRALIA	1.2	900	874	88,304	2025/7/30			
UBS AG AUSTRALIA	1.1	2,500	2,382	240,592	2026/2/26			
UBS AG AUSTRALIA	5.808	600	623	63,023	2028/11/24			
UNIT OF TECHNOLOGY/SIDNEY	3.75	1,830	1,784	180,218	2027/7/20			
UNITED ENERGY DISTRIBUTI	3.85	2,400	2,399	242,301	2024/10/23			
UNITED ENERGY DISTRIBUTI	2.2	2,500	2,372	239,667	2026/10/29			
UNIVERSITY OF SYDNEY	3.75	1,500	1,487	150,222	2025/8/28			
UNIVERSITY OF WOLLONGONG	3.5	2,000	1,921	194,091	2027/12/8			
UNIVERSITY OF WOLLONGONG	1.746	1,000	880	88,915	2028/12/15			
VICINITY CENTRES	4.0	1,370	1,335	134,871	2027/4/26			
VICINITY CENTRES TRUST	4.927	1,400	1,392	140,606	2028/6/2			
VICINITY CENTRES TRUST	6.19	500	516	52,152	2034/4/24			
VICTORIA POWER NETWORKS	4.0	2,500	2,428	245,323	2027/8/18			
VICTORIA POWER NETWORKS	5.057	1,100	1,102	111,402	2029/3/14			
VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	5.55	800	804	81,270	2028/6/14			
VOLKSWAGEN FIN SERV AUST	5.65	800	805	81,351	2028/9/15			
WESFARMERS LTD	1.941	900	815	82,373	2028/6/23			
WESTERN SYDNEY UNI	1.606	700	635	64,219	2027/12/8			
WESTPAC BANKING	3.8	500	497	50,233	2025/5/20			
WESTPAC BANKING	2.4	1,500	1,432	144,638	2027/1/25			
WESTPAC BANKING	4.8	500	503	50,866	2028/2/16			
WESTPAC BANKING CORP	5.0	1,000	1,013	102,367	2028/9/19			
WESTPAC BANKING CORP FRN	5.4185	1,500	1,515	153,111	2027/5/20			
WESTPAC BANKING CORP FRN	5.972	500	511	51,661	2034/7/10			
WSO FINANCE PTY LTD	4.5	1,500	1,489	150,470	2027/3/31			
WSO FINANCE PTY LTD	4.5	2,000	1,983	200,302	2027/9/30			
WSO FINANCE PTY LTD	2.7	1,500	1,308	132,183	2030/6/28			
合 計				40,538,808				

(注)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買取場の仲値により邦貨換算したものです。

## 組入投資信託証券の内容

### ■ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)

#### ●ファンドの概要

運用会社	ピクテ・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	エマージング・カントリーのドル建てのソブリン債券及び準ソブリン債券
運用の基本方針	ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンドを通じて、主としてエマージング・カントリーのドル建てのソブリン債券及び準ソブリン債券に投資し、利子等収益の確保と売買益の獲得を目指します。

#### ●損益の状況

項目	第222期	第223期	第224期	第225期	第226期	第227期
	自 2024年4月9日 至 2024年5月7日	自 2024年5月8日 至 2024年6月7日	自 2024年6月8日 至 2024年7月8日	自 2024年7月9日 至 2024年8月7日	自 2024年8月8日 至 2024年9月9日	自 2024年9月10日 至 2024年10月7日
(A) 配当等収益	21円	9円	31円	92円	341円	316円
受取利息	21	9	31	92	341	316
(B) 有価証券売買損益	8,380,482	38,006,673	58,052,363	△133,705,691	5,636,371	83,861,459
売買益	8,856,954	38,006,673	58,052,363	—	5,636,371	83,924,638
売買損	△476,472	—	—	△133,705,691	—	△63,179
(C) 信託報酬等	△1,094,137	△1,185,880	△1,209,352	△1,155,554	△1,215,824	△1,025,067
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,286,366	36,820,802	56,843,042	△134,861,153	4,420,888	82,836,708
(E) 前期繰越損益金	294,777,092	298,978,863	332,715,070	386,473,517	248,527,769	246,882,827
(F) 追加信託差損益金	△147,883,454	△147,883,454	△147,883,454	△147,883,454	△147,883,454	△146,084,572
(配当等相当額)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,548,793)
(売買損益相当額)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△158,633,365)
(G) 計(D+E+F)	154,180,004	187,916,211	241,674,658	103,728,910	105,065,203	183,634,963
(H) 収益分配金	△3,084,595	△3,084,595	△3,084,595	△3,084,595	△3,084,595	△3,047,075
次期繰越損益金(G+H)	151,095,409	184,831,616	238,590,063	100,644,315	101,980,608	180,587,888
追加信託差損益金	△147,883,454	△147,883,454	△147,883,454	△147,883,454	△147,883,454	△146,084,572
(配当等相当額)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,703,319)	(12,548,793)
(売買損益相当額)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△160,586,773)	(△158,633,365)
分配準備積立金	383,942,513	388,635,848	393,683,829	397,325,939	402,511,710	401,582,747
繰越損益金	△84,963,650	△55,920,778	△7,210,312	△148,798,170	△152,647,648	△74,910,287

#### ●組入資産の明細

##### <親投資信託残高>

種類	第221期末	第227期末
	口数	口数 評価額
ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド	千口 403,125	千口 374,575 千円 1,700,122

下記は、ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

第 銘	227 柄	期 末			債 還 年 月 日	
		利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千ドル	千ドル		
国債証券						
0% UKRAINE GOVT	—	123	54	8,067	2030/2/1	
0% UKRAINE GOVT	—	463	158	23,588	2034/2/1	
0% UKRAINE GOVT	—	391	174	25,929	2035/2/1	
0% UKRAINE GOVT	—	326	143	21,375	2036/2/1	
0.25% SALVADOR GOVT	0.25	163	3	484	2030/4/17	
0.5% REPUBLIC OF ZAMBIA	0.5	769	392	58,231	2053/12/31	
0.75% REP OF ARGENTINA	0.75	1,298	788	117,080	2030/7/9	
1% REP OF ARGENTINA	1.0	97	63	9,440	2029/7/9	
1.75% UKRAINE GOVT	1.75	332	194	28,878	2029/2/1	
1.75% UKRAINE GOVT	1.75	821	364	54,184	2034/2/1	
1.75% UKRAINE GOVT	1.75	656	286	42,502	2035/2/1	
1.75% UKRAINE GOVT	1.75	458	197	29,373	2036/2/1	
1.862% PERU GOVT	1.862	797	632	93,895	2032/12/1	
10.75% REPUBLIC OF GHANA	10.75	200	137	20,340	2030/10/14	
11.75% VENEZUELA GOVT	—	439	63	9,435	2026/10/21	
11.95% VENEZUELA GOVT	—	351	49	7,310	2031/8/5	
12.75% VENEZUELA GOVT	—	200	32	4,795	—	
2.125% HUNGARY GOVT	2.125	600	492	73,189	2031/9/22	
2.25% SAUDI INTERNATIONAL	2.25	300	246	36,661	2032/2/2	
2.252% REP OF PANAMA	2.252	600	456	67,809	2032/9/29	
2.457% REPUBLIC OF PHILI	2.457	700	634	94,159	2030/5/5	
2.739% REPUBLIC OF PARAG	2.739	400	339	50,396	2033/1/29	
2.75% CHINA GOVT INTL BO	2.75	300	251	37,405	2039/12/3	
2.78% PERU GOVT	2.78	83	49	7,284	2060/12/1	
2.783% PERU GOVT	2.783	815	719	106,760	2031/1/23	
2.85% INDONESIA GOVT	2.85	1,000	928	137,809	2030/2/14	
3% PERU GOVT	3.0	176	149	22,140	2034/1/15	
3% ROMANIA	3.0	140	121	17,979	2031/2/14	
3.125% ABU DHABI GOVT IN	3.125	200	143	21,296	2049/9/30	
3.125% COLOMBIA GOVT	3.125	200	165	24,500	2031/4/15	
3.16% REP OF PANAMA	3.16	1,023	905	134,372	2030/1/23	
3.25% COLOMBIA GOVT	3.25	1,000	803	119,295	2032/4/22	
3.298% REP OF PANAMA	3.298	200	164	24,408	2033/1/19	
3.3% PERU GOVT	3.3	477	371	55,140	2041/3/11	
3.45% SAUDI INTERNATIONAL	3.45	582	384	57,064	2061/2/2	
3.5% AZERBAIJAN GOVT	3.5	300	268	39,801	2032/9/1	
3.5% REP OF ARGENTINA	3.5	1,191	546	81,108	2041/7/9	
3.6% PERU GOVT	3.6	110	74	11,022	2072/1/15	
3.625% FIN DEPT GOVT SHA	3.625	300	260	38,670	2033/3/10	
3.625% ROMANIA	3.625	380	334	49,665	2032/3/27	
3.7% GUATEMALA GOVT	3.7	400	340	50,485	2033/10/7	
3.7% REPUBLIC OF UZBEKIS	3.7	316	271	40,356	2030/11/25	
3.75% FED REPUBLIC OF BR	3.75	400	359	53,407	2031/9/12	
3.75% STATE OF QATAR	3.75	400	392	58,200	2030/4/16	
3.849% REPUBLIC OF PARAG	3.849	200	181	27,012	2033/6/28	
3.87% REP OF PANAMA	3.87	400	246	36,660	2060/7/23	
3.9% DUBAI GOVT INT'L BO	3.9	200	152	22,600	2050/9/9	

第 銘	227 柄	期 末			債 還 年 月 日	
		利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
4% ROMANIA	4.0	224	160	23,852	2051/2/14	
4.125% COLOMBIA GOVT	4.125	400	274	40,740	2042/2/22	
4.125% COLOMBIA GOVT	4.125	547	343	50,985	2051/5/15	
4.125% REP OF ARGENTINA	4.125	1,864	904	134,350	2035/7/9	
4.125% REP OF ARGENTINA	4.125	342	174	25,909	2046/7/9	
4.2% REPUBLIC OF PHILIPP	4.2	1,350	1,194	177,304	2047/3/29	
4.25% KINGDOM OF BAHRAIN	4.25	1,000	958	142,323	2028/1/25	
4.28% MEXICAN GOVT	4.28	800	649	96,422	2041/8/14	
4.3% REP OF PANAMA	4.3	400	278	41,387	2053/4/29	
4.3% SOUTH AFRICA	4.3	200	192	28,544	2028/10/12	
4.375% FIN DEPT GOVT SHA	4.375	400	292	43,430	2051/3/10	
4.375% REP OF URUGUAY	4.375	369	369	54,838	2031/1/23	
4.375% SAUDI INTERNATION	4.375	400	399	59,239	2029/4/7	
4.5% BOLIVIA GOVT	4.5	200	112	16,637	2028/3/20	
4.5% DOMINICAN GOVT	4.5	419	398	59,185	2030/1/30	
4.5% FED REPUBLIC OF BRA	4.5	600	587	87,282	2029/5/30	
4.5% REP OF PANAMA	4.5	400	299	44,511	2047/5/15	
4.5% REP OF PANAMA	4.5	400	290	43,074	2050/4/16	
4.5% REP OF PANAMA	4.5	226	155	23,031	2063/1/19	
4.5% TRINIDAD AND TOBAGO	4.5	200	190	28,320	2030/6/26	
4.6% MEXICAN GOVT	4.6	400	323	47,991	2046/1/23	
4.625% INDONESIA GOVT	4.625	350	337	50,130	2043/4/15	
4.625% SAUDI INTERNATION	4.625	200	175	26,095	2047/10/4	
4.65% GUATEMALA GOVT	4.65	200	164	24,369	2041/10/7	
4.75% OMAN GOVT INTERNL	4.75	400	397	59,001	2026/6/15	
4.75% REPUBLIC OF PHILIP	4.75	700	703	104,521	2035/3/5	
4.817% STATE OF QATAR	4.817	830	805	119,631	2049/3/14	
4.85% SOUTH AFRICA	4.85	200	192	28,583	2029/9/30	
4.875% DOMINICAN GOVT	4.875	450	425	63,170	2032/9/23	
4.875% REPUBLIC OF POLAN	4.875	498	501	74,485	2033/10/4	
4.875% TURKEY GOVT	4.875	200	146	21,756	2043/4/16	
4.95% CHILE GOVT	4.95	200	200	29,735	2036/1/5	
4.95% REPUBLIC OF PARAGU	4.95	200	198	29,468	2031/4/28	
4.975% REP OF URUGUAY	4.975	150	143	21,261	2055/4/20	
5% BULGARIA	5.0	402	398	59,201	2037/3/5	
5% ECUADOR GOVT	5.0	787	424	63,019	2040/7/31	
5% FED REPUBLIC OF BRAZI	5.0	450	371	55,152	2051/1/27	
5% REP OF ARGENTINA	5.0	862	456	67,787	2038/1/9	
5% REP OF COLOMBIA	5.0	238	174	25,932	2045/6/15	
5% SAUDI INTERNATIONAL B	5.0	400	403	59,880	2034/1/16	
5% SAUDI INTERNATIONAL B	5.0	400	361	53,657	2053/1/18	
5.1% REP OF URUGUAY	5.1	209	205	30,531	2050/6/18	
5.125% REPUBLIC OF LATVI	5.125	200	204	30,317	2034/7/30	
5.125% REPUBLIC OF POLAN	5.125	905	920	136,622	2034/9/18	
5.125% ROMANIA	5.125	164	141	21,010	2048/6/15	
5.125% TURKEY GOVT	5.125	600	590	87,621	2028/2/17	
5.25% KINGDOM OF BAHRAIN	5.25	200	186	27,659	2033/1/25	
5.25% REP OF URUGUAY	5.25	222	219	32,557	2060/9/10	
5.3% DOMINICAN GOVT	5.3	518	473	70,262	2041/1/21	

第 期 末	227				
	銘 柄	利 率 (%)	評 估 額		
			額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
5.375% PERU GOVT	5.375	400	404	60,124	2035/2/8
5.4% PERUSAHAAN PENERBIT	5.4	1,198	1,248	185,426	2028/11/15
5.45% KINGDOM OF BAHRAIN	5.45	200	190	28,256	2032/9/16
5.5% ABU DHABI GOVT INT	5.5	520	543	80,724	2054/4/30
5.5% DOMINICAN GOVT	5.5	450	450	66,858	2029/2/22
5.5% ECUADOR GOVT	5.5	1,141	670	99,582	2035/7/31
5.5% HUNGARY GOVT	5.5	200	201	29,901	2034/6/16
5.5% REPUBLIC OF POLAND	5.5	116	116	17,312	2053/4/4
5.5% REPUBLIC OF POLAND	5.5	423	425	63,123	2054/3/18
5.6% REPUBLIC OF PARAGUA	5.6	357	340	50,528	2048/3/13
5.609% REPUBLIC OF PHILI	5.609	450	480	71,394	2033/4/13
5.625% FED REPUBLIC OF B	5.625	161	150	22,309	2041/1/7
5.625% FED REPUBLIC OF B	5.625	200	176	26,222	2047/2/21
5.625% KINGDOM OF BHRAI	5.625	500	488	72,549	2031/9/30
5.625% PERU GOVT	5.625	7	7	1,057	2050/11/18
5.65% SOUTH AFRICA	5.65	532	437	64,958	2047/9/27
5.75% IVORY COAST	5.75	258	245	36,420	2032/12/31
5.75% MEXICAN GOVT	5.75	44	37	5,623	2110/10/12
5.75% REP OF URUGUAY	5.75	783	844	125,316	2034/10/28
5.75% REPUBLIC OF POLAND	5.75	755	804	119,437	2032/11/16
5.75% REPUBLIC OF ZAMBIA	5.75	212	190	28,228	2033/6/30
5.75% ROMANIA	5.75	854	838	124,523	2035/3/24
5.75% SAUDI INTERNATIONAL	5.75	352	351	52,130	2054/1/16
5.75% SOUTH AFRICA	5.75	406	332	49,416	2049/9/30
5.75% TUNISIAN REPUBLIC	5.75	200	192	28,550	2025/1/30
5.75% TURKEY GOVT	5.75	600	473	70,285	2047/5/11
5.85% JORDAN GOVT	5.85	200	184	27,333	2030/7/7
5.875% DOMINICAN GOVT	5.875	150	139	20,760	2060/1/30
5.875% EGYPT GOVT	5.875	200	164	24,399	2031/2/16
5.875% PERU GOVT	5.875	468	483	71,825	2054/8/8
5.875% SOUTH AFRICA	5.875	1,000	987	146,539	2032/4/20
5.875% TURKEY GOVT	5.875	200	191	28,455	2031/6/26
5.95% REPUBLIC OF PHILIP	5.95	200	223	33,153	2047/10/13
6% DOMINICAN GOVT	6.0	630	639	94,920	2033/2/22
6% FED REPUBLIC OF BRAZI	6.0	200	202	30,029	2033/10/20
6% ISLAMIC REP OF PAKIST	6.0	450	417	61,940	2026/4/8
6% LEBANESE GOVT	—	114	8	1,311	2024/12/31
6% REPUBLIC OF SERBIA	6.0	531	543	80,658	2034/6/12
6% TURKEY GOVT	6.0	200	172	25,569	2041/1/14
6.05% GUATEMALA GOVT	6.05	380	387	57,558	2031/8/6
6.1% LEBANESE GOVT	—	553	42	6,363	2024/12/31
6.1% REPUBLIC OF PARAGUA	6.1	200	204	30,353	2044/8/11
6.125% COLOMBIA GOVT	6.125	344	301	44,776	2041/1/18
6.125% FED REPUBLIC OF B	6.125	800	812	120,581	2034/3/15
6.125% GUATEMALA GOVT	6.125	503	477	70,961	2050/6/1
6.125% HUNGARY GOVT	6.125	300	311	46,295	2028/5/22
6.125% IVORY COAST	6.125	400	369	54,874	2033/6/15
6.125% JORDAN GOVT	6.125	400	390	58,045	2026/1/29
6.125% ROMANIA	6.125	294	289	43,052	2044/1/22
6.2% LEBANESE GOVT	—	150	10	1,592	2025/2/26
6.25% FED REPUBLIC OF BR	6.25	562	584	86,761	2031/3/18
6.25% HUNGARY GOVT	6.25	250	266	39,522	2032/9/22

第 期 末	227				
	銘 柄	利 率 (%)	評 估 額		
			額面金額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
6.25% KINGDOM OF BAHRAIN	6.25	400	347	51,584	2051/1/25
6.25% LEBANESE GOVT	—	133	10	1,599	2024/11/4
6.25% OMAN GOV INTERNL	6.25	1,200	1,271	188,746	2031/1/25
6.25% REPUBLIC OF SENEGA	6.25	200	169	25,174	2033/5/23
6.25% REPUBLIC OF SERBIA	6.25	200	207	30,777	2028/5/26
6.25% SOUTH AFRICA	6.25	600	560	83,220	2041/3/8
6.3% REPUBLIC OF KENYA	6.3	400	318	47,290	2034/1/23
6.375% LEBANESE GOVT	—	333	19	2,862	2024/12/31
6.375% ROMANIA	6.375	538	552	82,073	2034/1/30
6.375% SALVADOR GOVT	6.375	267	256	38,079	2027/1/18
6.4% STATE OF QATAR	6.4	900	1,059	157,234	2040/1/20
6.4% TRINIDAD AND TOBAGO	6.4	1,390	1,429	212,178	2034/6/26
6.5% BARBADOS GOVT OF	6.5	65	56	8,445	2029/10/1
6.5% OMAN GOV INTERNL B	6.5	400	417	61,923	2047/3/8
6.5% REPUBLIC OF NIGERIA	6.5	200	187	27,894	2027/11/28
6.5% REPUBLIC OF SERBIA	6.5	400	425	63,171	2033/9/26
6.5% TURKEY GOVT	6.5	300	293	43,503	2033/9/20
6.5% TURKEY GOVT	6.5	200	193	28,681	2035/1/3
6.55% COSTA RICA GOVT	6.55	400	425	63,135	2034/4/3
6.55% PERU GOVT	6.55	7	7	1,151	2037/3/14
6.6% DOMINICAN GOVT	6.6	450	474	70,506	2036/6/1
6.625% ROMANIA	6.625	200	208	30,896	2028/2/17
6.65% LEBANESE GOVT	—	611	47	7,030	2024/12/31
6.65% LEBANESE GOVT	—	800	63	9,359	2028/11/3
6.65% LEBANESE REP	—	918	67	9,963	2030/2/26
6.75% HUNGARY GOVT	6.75	200	221	32,912	2052/9/25
6.75% INDONESIA GOVT	6.75	200	241	35,914	2044/1/15
6.75% LEBANESE GOVT	—	148	11	1,731	2027/11/29
6.75% OMAN GOV INTERNL	6.75	200	215	31,980	2048/1/17
6.75% REPUBLIC OF SENEGA	6.75	200	145	21,566	2048/3/13
6.75% REPUBLIC OF SRI LA	—	950	547	81,270	2028/4/18
6.85% DOMINICAN GOVT	6.85	300	321	47,663	2025/1/27
6.85% LEBANESE GOVT	—	142	11	1,678	2027/3/23
6.875% ISLAMIC REP OF PA	6.875	200	179	26,596	2027/12/5
6.875% TURKEY GOVT	6.875	62	60	9,033	2036/3/17
6.9% ECUADOR GOVT	6.9	265	196	29,145	2030/7/31
6.95% REPUBLIC OF GABON	6.95	200	189	28,176	2025/6/16
7% LEBANESE GOVT	—	280	21	3,209	2032/3/23
7% REPUBLIC OF KENYA	7.0	200	194	28,850	2027/5/22
7% VENEZUELA GOVT	—	438	51	7,614	2038/3/31
7.05% LEBANESE GOVT	—	75	5	877	2035/11/2
7.0529% EGYPT GOVT	7.0529	400	339	50,473	2032/1/15
7.1246% SALVADOR GOVT	7.1246	350	267	39,768	2050/1/20
7.125% ROMANIA	7.125	40	43	6,445	2033/1/17
7.125% TAJIKISTAN INT BO	7.125	200	194	28,844	2027/9/14
7.25% LEBANESE GOVT	—	230	17	2,602	2037/3/23
7.25% REPUBLIC OF MONTEN	7.25	200	208	31,012	2031/3/12
7.25% TURKEY GOVT	7.25	88	89	13,292	2038/3/5
7.3% COSTA RICA GOVT	7.3	200	219	32,601	2054/11/13
7.3% SOUTH AFRICA	7.3	327	320	47,612	2052/4/20
7.375% COLOMBIA GOVT	7.375	100	101	15,035	2037/9/18
7.375% ISLAMIC REP OF PA	7.375	200	166	24,681	2031/4/8

第 期 末	第 期 末	第 期 末	第 期 末					
			銘 柄	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 (千 円)	
7.375% REPUBLIC OF NIGER	7.375	550	466	69,197	2033/9/28			
7.45% DOMINICAN GOVT	7.45	370	418	62,069	2044/4/30			
7.5% COLOMBIA GOVT	7.5	200	207	30,751	2034/2/2			
7.5% JORDAN GOVT	7.5	200	198	29,527	2029/1/13			
7.625% EGYPT GOVT	7.625	1,904	1,662	246,842	2032/5/29			
7.625% HUNGARY GOVT	7.625	134	158	23,484	2041/3/29			
7.625% IVORY COAST	7.625	227	228	33,958	2033/1/30			
7.625% REPUBLIC OF NIGER	7.625	1,000	764	113,505	2047/11/28			
7.625% ROMANIA	7.625	208	236	35,075	2053/1/17			
7.625% SALVADOR GOVT	7.625	150	122	18,235	2041/2/1			
7.625% TURKEY GOVT	7.625	446	466	69,276	2034/5/15			
7.65% SALVADOR GOVT	7.65	462	400	59,401	2035/6/15			
7.75% REPUBLIC OF GHANA	—	403	211	31,442	2029/4/7			
7.75% VENEZUELA GOVT	—	250	31	4,663	—			
7.85% REPUBLIC OF SRI LA	—	708	395	58,707	2029/3/14			
7.875% MONGOLIA GOVT	7.875	200	213	31,689	2029/6/5			
7.875% REPUBLIC OF NIGER	7.875	200	180	26,789	2032/2/16			
7.95% REPUBLIC OF SURINA	7.95	100	96	14,299	2033/7/15			
7.96% BENIN INTL GOV BON	7.96	200	196	29,123	2038/2/13			
8% COLOMBIA GOVT	8.0	200	212	31,585	2035/11/14			
8% JAMAICA GOVT	8.0	609	749	111,322	2039/3/15			
8% REP OF PANAMA	8.0	326	364	54,054	2038/3/1			
8% REPUBLIC OF ANGOLA	8.0	200	181	26,959	2029/11/26			
8.125% REPUBLIC OF GHANA	—	400	210	31,285	2026/1/18			
8.25% FED REPUBLIC OF BR	8.25	118	139	20,637	2034/1/20			
8.25% IVORY COAST	8.25	600	603	89,554	2037/1/30			
8.25% REPUBLIC OF ANGOLA	8.25	200	189	28,132	2028/5/9			
8.25% SALVADOR GOVT	8.25	135	126	18,760	2032/4/10			
8.25% VENEZUELA GOVT	—	578	66	9,922	2024/10/13			
8.375% REPUBLIC OF NIGER	8.375	500	484	71,866	2029/3/24			
8.5% EGYPT GOVT	8.5	800	630	93,642	2047/1/31			
8.5091% HAZINE MUSTESARL	8.5091	218	237	35,263	2029/1/14			
8.7002% EGYPT GOVT	8.7002	200	159	23,734	2049/3/1			
8.747% REPUBLIC OF NIGER	8.747	550	526	78,147	2031/1/21			
8.75% PERU GOVT	8.75	182	226	33,682	2033/11/21			
8.75% REPUBLIC OF ANGOLA	8.75	400	360	53,472	2032/4/14			
8.75% REPUBLIC OF GHANA	—	1,002	534	79,307	2061/3/11			
8.875% EGYPT GOVT	8.875	900	733	108,956	2050/5/29			
8.95% REPUBLIC OF GHANA	—	200	105	15,728	2051/3/26			
9% VENEZUELA GOVT	—	166	23	3,475	2024/12/31			
9.125% REPUBLIC OF ANGOL	9.125	300	248	36,871	2049/11/26			
9.248% REPUBLIC OF NIGER	9.248	200	180	26,864	2049/1/21			
9.25% VENEZUELA GOVT	—	490	73	10,901	2027/9/15			
9.25% VENEZUELA GOVT	—	541	71	10,670	2028/5/7			
9.5% SALVADOR GOVT	9.5	150	142	21,121	2052/7/15			
UKRAINE GOVT	—	236	164	24,471	2041/8/1			
特殊債券(除く金融債)								
2.25% EXPORT-IMPORT BK I	2.25	200	172	25,551	2031/1/13			
3.875% EXPORT-IMPORT BK	3.875	400	390	57,956	2028/2/1			
5.75% BANK GOSPODARSTVA	5.75	200	207	30,872	2034/7/9			
5.95% CORP FINANCIERA DE	5.95	400	416	61,854	2029/4/30			
6.5% FIN DEPT GOVT SHARJ	6.5	450	480	71,294	2032/11/23			
7.5% PAKISTAN WATER & PO	7.5	200	153	22,799	2031/6/4			
8.5% NATIONAL BANK OF UZ	8.5	200	203	30,267	2029/7/5			

第 期 末	第 期 末	第 期 末	第 期 末					
			銘 柄	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 (千 円)	
9.625% NATIONAL POWER CO	9.625	1,240	1,441	214,035	2028/5/15			
普通社債券(含む投資法人債券)								
2.25% QATAR ENERGY	2.25	257	224	33,276	2031/7/12			
2.25% SINOCHEN OFFSHORE	2.25	850	805	119,536	2026/11/24			
3.15% CODELCO INC	3.15	450	300	44,656	2051/1/15			
3.25% STATE GRID EUROPE	3.25	200	195	28,999	2027/4/7			
3.75% CODELCO INC	3.75	700	647	96,155	2031/1/15			
4.236% MALAYSIA SOVEREIG	4.236	200	187	27,823	2045/4/22			
4.25% CODELCO INC	4.25	200	166	24,669	2042/7/17			
4.25% SINOPEC CAPITAL 20	4.25	400	366	54,435	2043/4/24			
4.375% ABU DHABI DEVELOP	4.375	756	744	110,492	2031/10/2			
4.5% CODELCO INC	4.5	200	168	25,002	2047/8/1			
4.5% PETRONAS CAPITAL LI	4.5	200	181	26,941	2045/3/18			
4.75% GACI FIRST INVESTM	4.75	400	397	59,001	2030/2/14			
4.75% PETROLEOS DEL PERU	4.75	600	459	68,218	2032/6/19			
4.875% GACI FIRST INVEST	4.875	200	194	28,803	2035/2/14			
4.876% KHAZANAH CAPITAL	4.876	1,600	1,609	238,953	2033/6/1			
5.125% AEROPUERTO INTL I	5.125	200	158	23,594	2061/8/11			
5.125% CODELCO INC	5.125	500	494	73,470	2033/2/2			
5.125% GACI FIRST INVEST	5.125	200	176	26,196	2053/2/14			
5.25% ABU DHABI DEVELOPM	5.25	696	675	100,359	2054/10/2			
5.375% GACI FIRST INVEST	5.375	400	364	54,108	2054/1/29			
5.375% PETROLEOS DE VENE	—	1,100	87	12,918	2027/4/12			
5.625% CODELCO INC	5.625	100	102	15,207	2035/9/21			
5.625% DP WORLD PLC	5.625	200	198	29,483	2048/9/25			
5.625% PETROLEOS DEL PER	5.625	468	307	45,609	2047/6/19			
5.875% EDO SUKUK LTD	5.875	355	372	55,368	2033/9/21			
5.95% CODELCO INC	5.95	1,000	1,042	154,824	2034/1/8			
6.15% CODELCO INC	6.15	348	367	54,628	2036/10/24			
6.3% CODELCO INC	6.3	200	209	31,163	2053/9/8			
6.35% PETROLEOS MEXICANO	6.35	450	316	47,001	2048/2/12			
6.375% PETROLEOS MEXICAN	6.375	210	149	22,236	2045/1/23			
6.45% PERTAMINA	6.45	1,100	1,199	178,080	2044/5/30			
6.5% MW ENERGETIKA ZRT	6.5	833	859	127,645	2031/3/13			
6.7% PETROLEOS MEXICANOS	6.7	600	542	80,530	2032/2/16			
6.84% PETROLEOS MEXICANO	6.84	400	372	55,296	2030/1/23			
6.875% NPC UKRENERGO	—	200	125	18,698	2028/11/9			
7.69% PETROLEOS MEXICANO	7.69	1,000	793	117,751	2050/1/23			
8% TC ZIRAAT BANKASI AS	8.0	200	210	31,181	2029/1/16			
8.25% UKRAINE RAIL (RAIL	—	200	166	24,770	2026/7/9			
合 計				14,829,514				

(注) 邦貨換算金額は、当該日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。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

第 期 末	第 期 末	第 期 末	
		銘 柄 別	買 建 額 (百万円)
外 国	US ULTRA BND	19	—

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

## 組入投資信託証券の内容

■ピクテ・グローバル・セクション・ファンド・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券

### ●ファンドの概要

管 理 会 社	ピクテ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)エス・エイ
主な投資対象・投資地域	新興国の企業を含む世界の公益企業の発行する高配当利回りの株式
運 用 の 基 本 方 針	主に新興国の企業を含む世界の公益企業の発行する高配当利回りの株式への投資を通じて安定的な収益分配を行うこと、また、長期的な元本の成長を目指すことを目的として運用を行います。

●損益計算書および株主資本等変動計算書(2023年1月1日～2023年12月31日)

日本円

期首純資産	1, 160, 394, 072, 306. 00
<b>収益</b>	
配当金(純額)	33, 029, 942, 370. 28
社債利息(純額)	0. 00
預金利息	14, 205, 799. 70
	<b>33, 044, 148, 169. 98</b>
<b>費用</b>	
投資運用報酬	3, 992, 863, 722. 00
預託手数料、銀行手数料、および金利	1, 723, 472, 468. 04
管理費、サービス費、監査費およびその他の費用	1, 257, 155, 684. 40
未払年次税	111, 597, 397. 46
取引手数料	374, 122, 418. 54
	<b>7, 459, 211, 690. 44</b>
<b>投資純利益</b>	<b>25, 584, 936, 479. 54</b>
正味実現利益/(損失)	
－ 投資売却益	50, 370, 340, 653. 94
－ 外国為替	(133, 172, 225. 74)
－ オプション契約	0. 00
－ 先物為替予約	308, 832. 40
－ 為替予約	0. 00
	<b>75, 822, 413, 740. 14</b>
正味未実現増価/(減価)の変化:	
－ 投資関連	(34, 432, 680, 057. 00)
－ オプション契約	0. 00
－ 先物為替予約	34, 151. 17
<b>営業活動による純資産の増減</b>	<b>41, 389, 767, 834. 31</b>
受益証券発行手取額	76, 126, 050, 458. 63
受益証券買戻費用	(112, 777, 304, 662. 00)
配当金	(125, 151, 091, 014. 69)
再評価差額*	284, 039. 36
<b>期末純資産</b>	<b>1, 039, 981, 778, 961. 61</b>

\*上記の差額は、2022年12月31日から2023年12月31日までの間に、サブ・ファンドの通貨以外の通貨建ての株式クラスに関連する各種項目に関連するサブ・ファンドの通貨に換算するために使用された為替レートの変動によるものです。

●投資有価証券およびその他純資産明細表(2023年12月31日現在)

銘柄	通貨	数量(株)	時価(円)	純資産に対する比率%
証券取引所に上場、または他の規制市場で取引されている譲渡可能証券				
株式				
<b>カナダ</b>				
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	カナダドル	726,125.00	8,120,938,348.00	0.78
EMERA	カナダドル	2,216,028.00	11,860,911,750.00	1.14
GFL ENVIRONMENTAL -SUB. VTG. -	米ドル	2,011,275.00	9,893,058,879.00	0.95
			<b>29,874,908,977.00</b>	<b>2.87</b>
<b>中国</b>				
CHINA LONGYUAN POWER GROUP 'H'	香港ドル	45,180,000.00	4,842,998,704.00	0.47
CHINA YANGTZE POWER 'A'	オフショア人民元	3,251,059.00	1,506,825,719.00	0.14
			<b>6,349,824,423.00</b>	<b>0.61</b>
<b>デンマーク</b>				
ORSTED	デンマーククローネ	754,649.00	5,933,445,296.00	0.57
			<b>5,933,445,296.00</b>	<b>0.57</b>
<b>ドイツ</b>				
E.ON	ユーロ	12,795,901.00	24,352,066,475.00	2.34
R.W.E.	ユーロ	8,006,701.00	51,645,040,726.00	4.97
			<b>75,997,107,201.00</b>	<b>7.31</b>
<b>ギリシャ</b>				
HELLENIC TELECOMMUNICATION ORGANIZATIONS	ユーロ	282,075.00	567,749,023.00	0.05
			<b>567,749,023.00</b>	<b>0.05</b>
<b>イタリア</b>				
ENEL	ユーロ	22,720,144.00	23,982,541,646.00	2.31
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE	ユーロ	11,008,094.00	13,028,449,981.00	1.25
			<b>37,010,991,627.00</b>	<b>3.56</b>
<b>ポルトガル</b>				
EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL	ユーロ	7,089,740.00	5,068,326,868.00	0.49
			<b>5,068,326,868.00</b>	<b>0.49</b>
<b>サウジアラビア</b>				
SAUDI ELECTRICITY	サウジアラビアリヤル	8,765,458.00	6,270,794,690.00	0.60
			<b>6,270,794,690.00</b>	<b>0.60</b>
<b>スペイン</b>				
AENA	ユーロ	81,513.00	2,102,854,130.00	0.20
EDP RENOVAVEIS	ユーロ	1,780,791.00	5,164,465,016.00	0.50
IBERDROLA	ユーロ	19,726,393.00	36,753,677,380.00	3.53
			<b>44,020,996,526.00</b>	<b>4.23</b>

銘柄	通貨	数量(株)	時価(円)	純資産に対する比率%
<b>アラブ首長国連邦</b>				
DUBAI ELECTRICITY & WATER	アラブ首長国連邦 ディルハム	40,554,875.00	3,843,455,103.00	0.37
EMIRATES CENT COOLING SYSTEMS	アラブ首長国連邦 ディルハム	31,791,377.00	2,033,110,884.00	0.20
SALIK COMPANY REG. S	アラブ首長国連邦 ディルハム	34,569,893.00	4,141,923,395.00	0.40
			<b>10,018,489,382.00</b>	<b>0.97</b>
<b>イギリス</b>				
NATIONAL GRID	英ポンド	22,949,665.00	43,748,982,911.00	4.21
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	英ポンド	13,238,384.00	44,270,954,834.00	4.26
SEVERN TRENT	英ポンド	330,077.00	1,533,813,473.00	0.15
UNITED UTILITIES GROUP	英ポンド	919,847.00	1,755,991,868.00	0.17
			<b>91,309,743,086.00</b>	<b>8.79</b>
<b>米国</b>				
AES	米ドル	4,418,228.00	12,096,786,145.00	1.16
ALLIANT ENERGY	米ドル	3,817,035.00	27,560,850,830.00	2.65
AMEREN CORPORATION	米ドル	3,675,775.00	37,478,662,813.00	3.60
AMERICAN ELECTRIC POWER	米ドル	1,368,331.00	15,659,331,527.00	1.51
AMERICAN WATER WORKS	米ドル	834,747.00	15,695,967,050.00	1.51
ATMOS ENERGY CORP	米ドル	1,576,128.00	25,764,823,263.00	2.48
CENTERPOINT ENERGY	米ドル	8,803,359.00	35,413,282,377.00	3.41
CME GROUP 'A'	米ドル	143,845.00	4,286,820,402.00	0.41
CMS ENERGY	米ドル	4,134,925.00	33,881,459,623.00	3.26
CROWN CASTLE INTERNATIONAL	米ドル	935,986.00	15,303,128,064.00	1.47
DOMINION ENERGY	米ドル	2,637,042.00	17,467,992,008.00	1.68
DTE ENERGY	米ドル	2,793,365.00	43,477,171,505.00	4.18
DUKE ENERGY	米ドル	150,225.00	2,052,274,272.00	0.20
EDISON INTERNATIONAL	米ドル	1,202,050.00	12,115,082,813.00	1.16
ENTERGY	米ドル	1,559,937.00	22,200,338,708.00	2.13
EVERSOURCE ENERGY	米ドル	1,378,963.00	12,007,456,317.00	1.15
EXELON	米ドル	8,642,771.00	43,676,172,291.00	4.20
NEXTERA ENERGY	米ドル	5,446,914.00	46,720,486,926.00	4.49
NISOURCE	米ドル	7,724,503.00	28,843,691,800.00	2.77
PG & E	米ドル	20,315,717.00	51,857,263,770.00	5.00
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP	米ドル	3,361,501.00	28,847,285,981.00	2.77
REPUBLIC SERVICES	米ドル	717,356.00	16,656,518,295.00	1.60
SEMPRA ENERGY	米ドル	4,747,280.00	49,955,526,342.00	4.80
SOUTHERN COMPANY	米ドル	4,772,973.00	47,092,262,138.00	4.53
UNION PACIFIC	米ドル	453,370.00	15,770,528,088.00	1.52
VISTRA	米ドル	972,496.00	5,334,878,521.00	0.51
WEC ENERGY GROUP	米ドル	3,250,783.00	38,499,434,281.00	3.70
XCEL ENERGY	米ドル	2,277,178.00	19,851,306,654.00	1.91
			<b>725,566,782,804.00</b>	<b>69.76</b>
<b>投資総額</b>			<b>1,037,989,159,903.00</b>	<b>99.81</b>
預金			2,564,000,000.00	0.25
当座借越			(1,784,756.28)	0.00
その他の負債			(569,596,185.11)	(0.06)
<b>純資産合計</b>			<b>1,039,981,778,961.61</b>	<b>100.00</b>

## 組入投資信託証券の内容

### ■FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)

#### ●ファンドの概要

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の取引所に上場されている株式
運用の基本方針	この投資信託は、TOPIX(東証株価指数)(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ●損益の状況

項目	第222期 自 2024年4月9日 至 2024年5月7日	第223期 自 2024年5月8日 至 2024年6月7日	第224期 自 2024年6月8日 至 2024年7月8日	第225期 自 2024年7月9日 至 2024年8月7日	第226期 自 2024年8月8日 至 2024年9月9日	第227期 自 2024年 9月 7日 至 2024年10月 7日
(A)配当等収益	24円	26円	29円	48円	104円	81円
受取利息	24	26	29	48	104	81
(B)有価証券売買損益	7,066,266	3,933,885	43,151,646	△142,578,330	34,284,386	69,652,603
売買益	7,140,844	4,006,492	43,188,229	719	34,320,149	69,688,764
売買損	△74,578	△72,607	△36,583	△142,579,049	△35,763	△36,161
(C)信託報酬等	△210,163	△226,074	△227,881	△220,086	△230,661	△197,176
(D)当期損益金(A+B+C)	6,856,127	3,707,837	42,923,794	△142,798,368	34,053,829	69,455,508
(E)前期繰越損益金	4,149,400	1,438,625	941	241,630	△142,556,738	△108,502,909
(F)追加信託差損益金	△444,295,545	△444,295,545	△444,301,433	△465,213,361	△465,213,361	△465,213,361
(配当等相当額)	(6,610)	(6,610)	(722)	(12,399)	(12,399)	(12,399)
(売買損益相当額)	(△444,302,155)	(△444,302,155)	(△444,302,155)	(△465,225,760)	(△465,225,760)	(△465,225,760)
(G)計(D+E+F)	△433,290,018	△439,149,083	△401,376,698	△607,770,099	△573,716,270	△504,260,762
(H)収益分配金	△9,566,902	△5,151,409	△42,683,105	0	0	△9,256,458
次期繰越損益金(G+H)	△442,856,920	△444,300,492	△444,059,803	△607,770,099	△573,716,270	△513,517,220
追加信託差損益金	△444,295,545	△444,301,433	△444,301,433	△465,213,361	△465,213,361	△465,213,361
(配当等相当額)	(6,610)	(722)	(722)	(12,399)	(12,399)	(12,399)
(売買損益相当額)	(△444,302,155)	(△444,302,155)	(△444,302,155)	(△465,225,760)	(△465,225,760)	(△465,225,760)
分配準備積立金	1,438,625	941	241,630	241,630	500,827	750,674
繰越損益金	—	—	—	△142,798,368	△109,003,736	△49,054,533

#### ●組入資産の明細

##### <親投資信託残高>

種 類	第 221 期 末		第 227 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
国内株式インデックス マザーファンド	千口 369,310	千口 361,046	千円 1,037,971	

下記は、国内株式インデックス マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第221期末	第227期末	評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	9.3	10.3	45,268
ニッスイ	237.4	249.1	232,211
マルハニチロ	35.2	37	120,398
雪国まいたけ	20.2	21.2	21,793
カネコ種苗	6.7	7	9,856
サカタのタネ	27	28.3	103,719
ホクト	19	19.9	36,874
ホクリョウ	1.7	0.9	901
<b>鉱業(0.3%)</b>			
住石ホールディングス	26.8	35.2	31,363
日鉄鉱業	9.5	10	44,750
三井松島ホールディングス	14.1	—	—
I N P E X	797.3	752.9	1,630,404
石油資源開発	27.5	144.5	174,556
K&Oエナジーグループ	10.8	11.3	39,663
<b>建設業(2.2%)</b>			
ショーボンドホールディングス	32.3	33.9	193,094
ミライト・ワン	71.8	75.2	162,093
タマホーム	14.9	15.7	62,250
サンヨーホームズ	1.3	0.6	430
日本アクア	4.4	2.7	2,367
ファーストコーポレーション	3	1.5	1,212
ベステラ	2.5	1.3	1,235
キャンディル	1.9	1	556
ダイセキ環境ソリューション	2.1	1.1	1,271
第一カッター興業	6.8	7.2	10,742
安藤・間	137.5	144.3	163,347
東急建設	74.4	78	55,848
コムシスホールディングス	75.8	79.5	250,186
ビーアールホールディングス	34.8	36.5	13,067
高松コンストラクショングループ	17.6	18.5	55,333
東建コーポレーション	6	6.3	70,371
ソネック	1.1	0.6	549
ヤマウラ	12	12.6	15,674
オリエンタル白石	87.9	92.2	35,404
大成建設	155.4	159.6	1,009,470
大林組	593.9	623.2	1,144,818
清水建設	470.9	494.1	482,636
飛鳥建設	17.1	—	—
長谷工コーポレーション	152.4	159.9	306,128
松井建設	15.5	16.3	13,561
銭高組	1.1	0.6	2,121

銘柄	第221期末	第227期末	評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
鹿島建設	368.2	386.4	1,060,281
不動産トラ	11.5	12.1	27,793
大末建設	3	1.5	2,433
鉄建建設	11.9	12.5	30,525
西松建設	31.7	33.2	171,179
三井住友建設	123.6	129.7	54,474
大豊建設	5.7	6	21,030
佐田建設	4.7	2.4	2,023
ナカノフドー建設	5.2	2.7	1,339
奥村組	26.9	28.3	124,803
東鉄工業	20.6	21.6	74,520
イチケン	1.8	0.9	2,245
富士ビー・エス	3.3	1.7	734
浅沼組	12.3	64.4	44,114
戸田建設	224.7	235.8	227,429
熊谷組	27.4	28.8	104,832
北野建設	1.4	0.7	2,768
植木組	2.1	1.1	1,746
矢作建設工業	22.6	23.7	37,327
ピーエス・コンストラクション	21	22.1	23,624
日本ハウスホールディングス	35.5	37.2	12,834
新日本建設	23.3	24.5	39,322
東亜道路工業	33	33.5	47,168
日本道路	19.5	20.4	34,476
東亜建設工業	51.2	52.6	53,494
日本国土開発	47.2	49.6	25,048
若築建設	5.7	6	21,690
東洋建設	41.8	43.9	59,835
五洋建設	235.4	247	162,847
世紀東急工業	21.3	22.4	34,697
福田組	6.3	6.6	36,300
住友林業	143.5	150.6	967,002
日本基礎技術	4.5	2.3	1,633
巴コーポレーション	9.3	4.7	4,366
大和ハウス工業	459.2	481.9	2,228,305
ライト工業	34.2	32.1	73,316
積水ハウス	503.7	528.5	2,079,119
日特建設	15.9	16.6	17,247
北陸電気工事	11.4	11.9	14,553
ユアテック	36.6	38.4	59,059
日本リーテック	13	13.6	15,286
四電工	6.9	21.9	28,689
中電工	25.8	27	90,990

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
関電工	104	109.1	237,074	
きんでん	116.9	121.2	387,840	
東京エネシス	16.5	16.3	18,663	
トーエネック	5.5	29	26,593	
住友電設	15.8	16.6	76,111	
日本電設工業	31.2	32.7	62,653	
エクシオグループ	162.4	170.3	272,054	
新日本空調	10.8	11.3	40,736	
九電工	35.9	37.7	245,992	
三機工業	35.9	37.6	91,894	
日揮ホールディングス	164.3	172.4	227,481	
中外炉工業	5.4	5.7	15,509	
ヤマト	6.1	3.1	3,010	
太平電業	10.3	11	57,090	
高砂熱学工業	44.5	46.7	237,703	
三晃金属工業	1	0.5	2,022	
朝日工業社	15.6	16.3	21,842	
明星工業	32.1	33.7	41,720	
大気社	19.1	20.1	99,193	
ダイダシ	21.8	22.9	69,387	
日比谷総合設備	12	12.6	46,053	
飛鳥ホールディングス	—	18	27,972	
フィル・カンパニー	2.6	3.4	2,128	
テスホールディングス	35.8	37.5	11,550	
インフロンア・ホールディングス	191.4	200.9	238,769	
東洋エンジニアリング	24.4	25.6	19,891	
レイズネクスト	24	25.2	42,714	
<b>食料品(3.2%)</b>				
ニッポン	49.9	52.4	117,376	
日清製粉グループ本社	154.2	161.8	295,932	
日東富士製粉	3	3.1	21,793	
昭和産業	16.1	16.4	48,658	
鳥越製粉	6.6	3.3	2,270	
中部飼料	23.1	24.2	36,566	
フィード・ワン	24.4	25.6	22,502	
東洋精糖	1.4	0.7	1,025	
日本甜菜製糖	9.7	10.2	27,805	
DM三井製糖ホールディングス	16.5	17.3	58,474	
塩水港精糖	9.8	4.9	1,372	
ウェルネオシュガー	8.3	8.7	19,140	
森永製菓	71.4	73.2	212,097	
中村屋	4.2	4.4	14,432	
江崎グリコ	47.7	50	221,450	
名糖産業	6.6	6.9	12,758	
井村屋グループ	9.9	10.4	26,540	
不二家	11.4	12	32,640	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
山崎製パン	111.6	117.1	339,648	
第一屋製パン	1.4	0.8	504	
モロゾフ	5.4	5.7	26,448	
亀田製菓	9.5	10	44,100	
寿スピリッツ	78.8	82.7	152,374	
カルビー	76.3	80.1	273,060	
森永乳業	58.2	61.1	219,776	
六甲バター	12.2	12.8	20,620	
ヤクルト本社	238.3	250	860,250	
明治ホールディングス	204.4	214.5	778,206	
雪印メグミルク	40.3	42.3	114,844	
プリマハム	22.4	23.5	56,259	
日本ハム	71.7	75.2	400,064	
林兼産業	2.5	1.3	627	
丸大食品	16.8	17.6	31,204	
S Foods	18.4	19.3	53,866	
柿安本店	6.5	6.8	18,026	
伊藤ハム米久ホールディングス	25.5	26.7	105,198	
サッポロホールディングス	54.9	57.6	449,625	
アサヒグループホールディングス	385.2	1,313.7	2,442,168	
キリンホールディングス	694.5	728.7	1,608,969	
シマダヤ	—	5.7	9,040	
宝ホールディングス	113.8	118	148,208	
オエノンホールディングス	49.8	56.6	24,677	
養命酒製造	5.5	5.8	14,123	
コカ・コーラ ボトラーズ	130.6	123.3	249,004	
ジャパンホールディングス	—	—	—	
ライフドリンク カンパニー	2.5	14	24,052	
サントリー食品インターナショナル	117.4	123.2	684,376	
ダイドーグループホールディングス	18.9	19.8	59,598	
伊藤園	56.5	59.1	200,171	
キーコーヒー	18.7	19.6	39,474	
ユニカフェ	2.5	1.2	1,132	
ジャパンフーズ	1.2	—	—	
日清オイリオグループ	23.5	24.6	131,118	
不二製油グループ本社	38.8	40.7	128,693	
かどや製油	0.9	0.5	1,850	
J-オイルミルズ	19.1	20	42,420	
キッコーマン	552.5	579.7	982,011	
味の素	396.2	411.2	2,418,267	
ブルドックソース	8.8	9.3	16,358	
キュービー	89.6	94	335,298	
ハウス食品グループ本社	57.4	60.1	184,927	
カゴメ	71.7	75	242,025	
アリアケジャパン	16.6	17.4	95,700	
ピエトロ	1.1	0.5	885	

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
エバラ食品工業	4	4.2	11,949			
やまみ	0.9	0.5	2,217			
ニチレイ	76.4	80.2	353,120			
東洋水産	84.3	88.4	859,248			
イトアンドホールディングス	7.9	8.3	17,596			
大冷	1.1	0.5	953			
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7.6	8	12,920			
日清食品ホールディングス	175.9	184.5	754,420			
永谷園ホールディングス	8.2	—	—			
一正蒲鉾	3.2	1.6	1,201			
フジッコ	17.1	18	31,068			
ロック・フィールド	20.4	21.4	31,928			
日本たばこ産業	1,013.1	1,063.1	4,606,412			
ケンコーマヨネーズ	11.5	12	27,468			
わらべや日洋ホールディングス	11.2	11.7	27,834			
なとり	10.5	11	23,914			
イフジ産業	1.4	0.7	1,031			
ファーマフーズ	23.9	23.2	20,671			
ユウグレナ	103.8	108.7	50,436			
紀文食品	14.5	15.2	17,510			
ピックルスホールディングス	9.8	10.3	10,979			
ミヨシ油脂	2.9	1.5	2,427			
理研ビタミン	14.4	15.1	40,664			
<b>繊維製品(0.4%)</b>						
片倉工業	16	16.6	34,743			
グンゼ	12.2	12.7	70,485			
東洋紡	73.9	77.3	77,686			
ユニチカ	59	58.9	18,965			
富士紡ホールディングス	7.6	7.9	38,315			
倉敷紡績	12.2	12.7	65,659			
シキボウ	9	12.8	13,312			
日本毛織	44	45.9	60,450			
トーア紡コーポレーション	2.9	1.6	640			
帝国繊維	19.4	20.3	58,930			
帝人	163.4	171.3	251,982			
東レ	1,137.3	1,192.9	1,022,911			
住江織物	1.6	0.8	1,686			
日本フェルト	5.5	2.9	1,415			
イチカワ	1.3	0.7	1,153			
日東製網	0.8	0.4	582			
アツギ	5.4	2.7	2,300			
ダイニック	2.4	1.2	908			
セーレン	33	34.5	91,390			
ソトー	2.5	1.3	899			
東海染工	0.8	0.4	279			
小松マテーレ	24.7	25.9	20,875			

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ワコールホールディングス	34.8	33.2	150,329			
ホギメディカル	22.4	23.4	110,331			
T S Iホールディングス	55.3	53.4	47,632			
マツオカコーポレーション	2.4	1.2	2,238			
ワールド	24	25.2	52,491			
三陽商会	6.4	8.4	23,074			
ナイガイ	2.9	1.5	361			
オンワードホールディングス	100.2	105	57,120			
ルックホールディングス	4.8	5.7	15,133			
ゴールドウイン	30.1	31.5	273,294			
デサント	29.3	30.7	133,698			
キング	3	1.5	1,131			
ヤマトインターナショナル	6.2	3.1	1,019			
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>						
特種東海製紙	9.3	9.5	36,195			
王子ホールディングス	706.5	741.4	432,162			
日本製紙	95.7	100.4	98,392			
三菱製紙	10.2	5.2	2,880			
北越コーポレーション	83.4	87.5	135,712			
中越パルプ工業	3	1.5	1,942			
大王製紙	74.9	78.6	71,298			
阿波製紙	2.1	1	455			
レンゴー	154.5	162.1	161,694			
トーモク	9.8	10.3	25,235			
ザ・バック	12.6	13.2	50,028			
<b>化学(5.7%)</b>						
北の達人コーポレーション	71.5	75	12,300			
クラレ	247.2	259.4	558,358			
旭化成	1,147.4	1,204	1,305,136			
共和レザー	4.3	2.2	1,469			
巴川コーポレーション	2.1	1.1	808			
レゾナック・ホールディングス	163.9	159.7	611,331			
住友化学	1,258.6	1,320.6	559,934			
住友精化	8	8.4	44,604			
日産化学	79.7	83	431,185			
ラサ工業	6.5	6.9	18,981			
クレハ	37.1	36.8	108,008			
多木化学	6.6	6.9	26,461			
テイカ	14.7	14.6	26,134			
石原産業	28.1	29.5	45,253			
片倉コープアグリ	1.8	0.9	895			
日本曹達	20	41.6	105,164			
東ソー	226.4	237.6	458,924			
トクヤマ	54.8	57.5	165,887			
セントラル硝子	18.1	19	66,690			
東亜合成	81.6	85.6	142,352			

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
大阪ソーダ	11.8	62	118,420	
関東電化工業	32.8	34.4	32,886	
デンカ	61.7	64.7	146,189	
信越化学工業	1,521	1,596	9,802,632	
日本カーバイド工業	7.2	9.4	16,186	
堺化学工業	12.9	13.6	35,836	
第一稀元素化学工業	18.5	19.5	16,477	
エア・ウォーター	160	167.9	343,775	
日本酸素ホールディングス	164.5	172.7	929,644	
日本化学工業	6.2	6.5	18,479	
東邦アセチレン	8	4	1,380	
日本パーカライジング	75.6	79.3	106,341	
高压ガス工業	24.6	25.8	23,013	
チタン工業	1	0.5	495	
四国化成ホールディングス	21.7	20.1	43,275	
戸田工業	3.9	4.1	7,330	
ステラ ケミファ	9.2	9.7	42,340	
保土谷化学工業	5.3	5.6	25,592	
日本触媒	98.8	103.6	185,910	
大日精化工業	11.8	12.4	38,006	
カネカ	43.1	43.9	170,551	
三菱瓦斯化学	123.8	129.9	368,396	
三井化学	139.9	146.8	559,014	
J S R	184.7	—	—	
東京応化工業	80.9	84.9	313,450	
大阪有機化学工業	14.2	14.9	47,978	
三菱ケミカルグループ	1,239.9	1,301.1	1,184,261	
KHネオケム	25.9	32.1	68,726	
ダイセル	218	220.8	302,496	
住友ベークライト	47.4	49.8	208,512	
積水化学工業	340.8	354.4	808,209	
日本ゼオン	116.3	122	169,153	
アイカ工業	42.8	44.9	149,202	
U B E	80.7	84.7	225,005	
積水樹脂	25.3	26.6	62,776	
タキロンシーアイ	43.3	—	—	
旭有機材	11.3	11.8	49,796	
ニチバン	9.2	9.6	18,432	
リケンテクノス	36.5	33.4	35,804	
大倉工業	7.9	8.2	22,615	
積水化成成品工業	23.8	25	10,025	
群栄化学工業	4	4.2	11,928	
タイガースポリマー	3.4	1.7	1,278	
ミライアル	2.6	1.3	1,930	
ダイキアクシス	3.1	1.6	1,180	
ダイキョーニシカワ	37.4	39.3	25,505	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
竹本容器	2.9	1.4	1,202	
森六ホールディングス	8.8	9.2	21,454	
恵和	12.2	11.5	12,546	
日本化薬	129.6	135.9	173,476	
カーリット	18.3	19.2	24,979	
日本精化	11.2	11.8	28,249	
扶桑化学工業	18	18.9	75,222	
トリケミカル研究所	20.6	21.6	73,656	
A D E K A	59.1	62.1	183,691	
日油	153.6	161.1	416,846	
新日本理化	10.4	5.3	1,017	
ハリマ化成グループ	10.6	13.9	11,940	
花王	383.5	433.4	3,084,074	
第一工業製薬	6.8	7.1	22,862	
石原ケミカル	7.6	8	19,480	
日華化学	3	1.5	1,887	
ニイタカ	1.5	0.8	1,550	
三洋化成工業	10.4	10.9	45,889	
有機合成薬品工業	6.1	3.1	843	
大日本塗料	18.8	19.7	21,630	
日本ペイントホールディングス	900.6	787.5	906,018	
関西ペイント	166.2	153.8	395,112	
神東塗料	6.3	3.2	428	
中国塗料	34.8	36.5	75,883	
日本特殊塗料	5.4	2.7	3,288	
藤倉化成	19.5	20.5	9,778	
太陽ホールディングス	29.5	31	119,660	
D I C	66.3	63.2	214,184	
サカタインクス	37.7	39.6	65,656	
a r t i e n c e	36.9	31.9	125,048	
富士フイルムホールディングス	945	991.7	3,738,709	
資生堂	354.6	372.1	1,427,375	
ライオン	222.3	226.8	357,323	
高砂香料工業	12.8	13.4	75,308	
マンダム	36.7	38.5	48,933	
ミルボン	23.1	28.6	90,175	
ファンケル	74.3	—	—	
コーセー	34.5	36.2	337,854	
コタ	17.16	18.1	30,516	
シーボン	1.1	0.5	642	
ポーラ・オルビスホールディングス	87.1	91.3	142,428	
ノエビアホールディングス	15.1	15.9	82,362	
アジュバンホールディングス	1.8	0.9	743	
新日本製薬	9.7	10.2	17,635	
I - n e	3.4	5.9	10,938	
アクシージア	8.4	11.7	7,406	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
エステー	13.1	13.8	20,534	
アグロ カネショウ	6.8	6.2	8,692	
コニシ	49	51.5	65,765	
長谷川香料	32.5	34.1	118,497	
小林製薬	49.6	46.7	271,560	
荒川化学工業	14.4	15.1	19,101	
メック	14	14.7	56,668	
日本高純度化学	3.8	4	13,100	
タカラバイオ	45.7	48	50,976	
JCU	19	19.7	71,609	
新田ゼラチン	5.1	2.6	2,295	
OATアグリオ	5.6	7.4	15,473	
デクセリアルズ	42.6	132	297,924	
アース製薬	15.4	16.2	86,670	
北興化学工業	17.1	15.9	21,369	
大成ラミック	4.9	5.2	13,587	
クミアイ化学工業	67.5	70.8	59,188	
日本農薬	31.1	32.7	20,306	
アキレス	10.7	11.2	17,416	
有沢製作所	29.7	31.2	45,864	
日東電工	109.1	563.5	1,386,491	
レック	21.7	22.8	30,346	
三光合成	21.4	22.4	13,148	
きもと	12.5	6.3	1,587	
ZACROS	13.4	14.1	62,674	
前澤化成工業	11	11.5	21,022	
未来工業	6.1	6.4	22,272	
ウェーブロックホールディングス	2.8	1.4	851	
JSP	11.9	12.5	24,437	
エフピコ	32.1	33.7	93,719	
天馬	12.3	11.9	32,498	
信越ポリマー	36.6	38.4	60,019	
東リ	16.8	8.5	3,306	
ニフコ	50.8	53.3	193,265	
バルカー	14.2	14.9	50,213	
ユニ・チャーム	353.8	371.2	1,870,476	
ショーエイコーポレーション	2.4	1.2	696	
<b>医薬品 (4.7%)</b>				
協和キリン	205.2	215.3	563,440	
武田薬品工業	1,503	1,577.1	6,731,062	
アステラス製薬	1,489.6	1,563.1	2,749,492	
住友ファーマ	126	132.2	86,062	
塩野義製薬	214.1	650.1	1,360,334	
わかもと製薬	7.9	4	1,036	
日本新薬	44.5	46.7	191,470	
中外製薬	531.6	557.8	3,853,282	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
科研製薬	29.1	30.5	118,309	
エーザイ	206.6	216.7	1,200,084	
ロート製薬	164.5	172.6	619,979	
小野薬品工業	360.4	364.5	735,743	
久光製薬	37.7	39.6	158,439	
持田製薬	19.5	19.9	68,854	
参天製薬	309.5	314.4	568,278	
扶桑薬品工業	6	6.3	14,697	
日本ケミファ	0.9	0.4	645	
ツムラ	53.5	56.1	281,004	
キッセイ薬品工業	28.1	29.5	111,510	
生化学工業	28.8	30.2	26,092	
栄研化学	31.2	30.7	75,522	
鳥居薬品	9.1	9.6	37,776	
JCRファーマ	57.5	60.3	41,607	
東和薬品	26.1	27.4	86,995	
富士製薬工業	12.5	13.2	17,622	
ゼリア新薬工業	23.5	24.7	57,748	
ネクセラファーマ	55.7	83.6	104,583	
第一三共	1,479.4	1,552.4	7,602,102	
杏林製薬	36.8	38.6	59,096	
大幸薬品	35.3	40.4	16,240	
ダイト	12.9	13.5	31,509	
大塚ホールディングス	353.2	444.8	3,780,355	
ペプチドリーム	82.3	86.4	246,974	
セルソース	4.7	11.8	15,399	
あすか製薬ホールディングス	17.4	18.3	41,156	
サワイグループホールディングス	38.8	122.4	262,731	
<b>石油・石炭製品 (0.6%)</b>				
日本コークス工業	172.3	180.8	18,441	
ニチレキグループ	22.1	23.2	60,180	
ユシロ化学工業	8.8	9.2	15,180	
ビービー・カストロール	2.9	1.8	1,647	
富士石油	49.5	51.9	19,773	
MORESCO	2.7	1.4	1,765	
出光興産	943	925.3	1,038,186	
ENEOSホールディングス	2,688.5	2,821.1	2,366,620	
コスモエネルギーホールディングス	50.4	52.8	444,576	
<b>ゴム製品 (0.6%)</b>				
横浜ゴム	85.9	90.1	294,356	
TOYO TIRE	97.6	102.4	222,208	
ブリヂストン	497.1	521.6	2,981,987	
住友ゴム工業	166.6	174.8	277,932	
藤倉コンポジット	13.1	17.1	20,879	
オカモト	8	8.3	43,741	
フコク	8.9	9.4	17,051	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
ニッタ	17.3	18.1	70,047	
住友理工	26.4	27.7	42,491	
三ツ星ベルト	20.6	20.7	83,524	
バンドー化学	25.2	26.4	47,757	
<b>ガラス・土石製品(0.7%)</b>				
日東紡績	21.5	22.6	139,216	
A G C	151.5	173.4	833,187	
日本板硝子	81	85	32,300	
石塚硝子	1.3	0.7	1,722	
日本山村硝子	2.9	1.4	2,142	
日本電気硝子	69.4	66.1	232,870	
オハラ	8.2	8.5	12,214	
住友大阪セメント	28.3	29.7	120,611	
太平洋セメント	100.5	102.1	344,587	
日本ヒューム	15.1	15.6	21,294	
日本コンクリート工業	33.4	34.6	12,040	
三谷セキサン	7.2	7.5	44,400	
アジアパイルホールディングス	24.3	25.3	21,201	
東海カーボン	156.9	164.4	149,784	
日本カーボン	9	10.2	47,073	
東洋炭素	12	12.6	72,576	
ノリタケ	18.8	19.7	79,588	
T O T O	112.1	117.6	640,214	
日本碍子	197.6	207.3	398,845	
日本特殊陶業	142.2	145.6	609,336	
MARUWA	6.3	6.6	277,200	
品川リフラクトリーズ	21	21.9	38,719	
黒崎播磨	14	14.5	34,858	
ヨータイ	10.6	10.4	18,012	
東京窯業	8.4	4.1	1,672	
ニッカトー	3.7	1.7	904	
フジミンコーポレートッド	45.7	47.9	117,163	
クニミネ工業	2.4	1.1	1,193	
エーアンドエーマテリアル	1.7	0.8	949	
ニチアス	43	45.1	259,325	
ニチハ	21.3	22.3	79,611	
<b>鉄鋼(0.8%)</b>				
日本製鉄	782.3	869.3	2,808,708	
神戸製鋼所	351.4	368.7	638,957	
中山製鋼所	40	41.9	33,520	
合同製鐵	9.8	10.3	43,157	
J F Eホールディングス	485.9	509.8	987,992	
東京製鐵	49.1	51.5	101,712	
共英製鐵	19.9	20.9	37,494	
大和工業	32.9	34.6	254,102	
東京鐵鋼	7.7	8.1	43,254	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
大阪製鐵	8	8.4	29,190	
淀川製鋼所	19.9	19	110,770	
中部鋼鉄	11.5	12	31,884	
丸一鋼管	53.2	55.8	191,338	
モリ工業	3.5	4.6	25,438	
大同特殊鋼	110.1	115.5	164,991	
日本高周波鋼業	3	1.6	624	
日本冶金工業	12.8	13.4	61,238	
山陽特殊製鋼	17.3	18.1	35,566	
愛知製鋼	10.1	10.6	42,135	
日本金属	2	1	705	
大平洋金属	14.9	15.6	22,479	
新日本電工	87	109.5	33,507	
栗本鐵工所	8.1	8.5	35,190	
虹技	1	0.5	537	
三菱製鋼	13	13.6	19,080	
日亜鋼業	8	4.1	1,271	
日本精線	14	14.6	19,213	
エンビプロ・ホールディングス	13.8	18.1	9,502	
シンニッタン	9.9	5	1,065	
新家工業	1.7	0.9	4,360	
<b>非鉄金属(0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	22.1	23.7	26,544	
日本軽金属ホールディングス	51.1	53.9	88,935	
三井金属鋁業	50.9	53.5	271,191	
東邦亜鉛	11.2	—	—	
三菱マテリアル	124.9	131.3	346,828	
住友金属鋁山	202.6	212.7	985,226	
DOWAホールディングス	43.2	45.4	246,068	
古河機械金属	23.1	24.5	41,650	
大阪チタニウムテクノロジーズ	30.3	32	86,432	
東邦チタニウム	36.1	38.4	46,118	
U A C J	24.5	25.8	129,000	
C Kサンエツ	4.2	4.6	16,997	
古河電気工業	58.2	61.2	221,727	
住友電気工業	653.6	686	1,662,864	
フジクラ	206.1	216.4	1,079,186	
S W C C	19.5	20.6	119,274	
タツタ電線	31.9	—	—	
カナレ電気	1.4	1	1,469	
平河ヒューテック	11.2	12.1	18,936	
リョービ	18.6	19.8	39,283	
アールスティ	8.7	4.9	2,915	
A R Eホールディングス	65.6	69.1	125,692	
<b>金属製品(0.5%)</b>				
稲葉製作所	8.6	10.2	18,043	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
宮地エンジニアリンググループ	8.8	18.4	38,345	
トーカロ	50.4	52.9	101,779	
アルファC o	2.8	1.4	1,698	
SUMCO	310.4	349	582,481	
川田テクノロジーズ	12.3	13	32,682	
RS Technologies	11.7	14	54,110	
ジェイテックコーポレーション	1.3	0.7	1,118	
信和	5	2.5	1,880	
東洋製織グループホールディングス	100.2	105.2	242,906	
ホッカンホールディングス	8.5	8.9	16,242	
コロナ	9.8	10.2	9,894	
横河ブリッジホールディングス	27.3	28.7	76,973	
駒井ハルテック	1.4	0.7	1,168	
高田機工	0.6	0.9	1,057	
三和ホールディングス	175.5	182.6	703,557	
文化シャッター	45.7	48	91,488	
三協立山	22	23.1	17,232	
アルインコ	13.3	14	13,832	
東洋シャッター	1.8	0.9	728	
L I X I L	272.8	286.3	498,018	
日本フィルコン	5.1	2.6	1,404	
ノーリツ	28.9	25.8	47,807	
長府製作所	17.3	20.5	41,184	
リンナイ	83.6	87.7	311,247	
ダイニチ工業	3.9	2	1,256	
日東精工	25.3	26.6	15,481	
三洋工業	0.9	0.5	1,595	
岡部	31.2	32.7	26,061	
ジーテクト	22.3	23.4	37,837	
東プレ	30.8	32.3	60,401	
高周波熱錬	26.9	27.1	27,208	
東京製網	11.3	11.9	13,387	
サンコール	15.5	20.4	7,813	
モリテック スチール	6.9	3.5	665	
パイオラックス	21.7	22.2	54,057	
エイチワン	18	18.9	18,314	
日本発條	154.5	162.2	306,152	
中央発條	12.9	13.6	16,728	
アドバネクス	0.9	0.5	449	
立川ブラインド工業	7.9	8.3	11,130	
三益半導体工業	15.7	—	—	
<b>機械(5.5%)</b>				
日本ドライケミカル	1.8	0.9	3,132	
日本製鋼所	47.1	49.4	281,481	
三浦工業	71.4	74.9	268,366	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
タクマ	57.9	60.7	99,062	
ツガミ	38.1	38.3	59,326	
オークマ	15	31.4	101,045	
芝浦機械	17.1	16.9	65,994	
アマダ	272.9	272	413,168	
アイダエンジニアリング	39.7	41.5	32,287	
F U J I	80.5	84.5	200,476	
牧野フライス製作所	18.9	19.9	125,569	
オーエスジー	75.4	79.1	159,307	
ダイジェット工業	0.9	0.4	302	
旭ダイヤモンド工業	39.5	41.4	35,852	
DMG森精機	103.7	113.2	336,996	
ソディック	41.7	47.4	38,062	
デイスコ	82.3	86.4	3,215,808	
日東工器	8.3	8.3	20,716	
日進工具	15.9	16.7	12,992	
パンチ工業	7.6	3.9	1,653	
富士ダイス	10.2	13.3	10,746	
豊和工業	4.2	2.1	1,913	
リケンNPR	18.6	19.5	46,176	
東洋機械金属	6.4	3.2	2,054	
エンシュウ	1.9	1	632	
島精機製作所	27.3	28.6	33,662	
オプトラン	28.1	29.5	56,581	
NCホールディングス	1.8	—	—	
イワキポンプ	11.4	12	36,600	
フリュー	16.2	16.9	18,032	
ヤマシンフィルタ	41.2	42.7	21,648	
日阪製作所	18.7	19.6	20,482	
やまびこ	28	29.3	77,000	
野村マイクロ・サイエンス	23.2	24.3	58,101	
平田機工	8.2	8.6	43,258	
P E G A S U S	19	19.8	9,761	
マルマエ	7.5	7.8	12,269	
タツモ	10.3	12.8	41,600	
ナブテスコ	107.4	112.6	288,312	
三井海洋開発	21.7	22.7	78,655	
レオン自動機	19.8	20.8	29,411	
SMC	51.2	53.7	3,587,697	
ホソカワミクロン	11	12.5	52,500	
ユニオンツール	7.5	7.9	50,007	
瑞光	12.3	12.9	17,337	
オイレス工業	23.2	24.3	50,544	
日精エー・エス・ビー機械	6.8	6.1	28,914	
サトーホールディングス	24.3	24.6	52,840	

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
技研製作所	16.1	16.9	32,583			
日本エアータック	8	8.4	10,231			
カワタ	2.4	1.2	991			
日精樹脂工業	12.8	13.4	13,051			
オカダアイヨン	2.6	1.3	2,736			
ワイエイシイホールディングス	6.4	8.4	19,068			
小松製作所	801.6	841.1	3,512,433			
住友重機械工業	101.2	106.2	383,913			
日立建機	68.1	71.5	258,973			
日工	25.4	26.6	18,753			
巴工業	6.7	7	29,085			
井関農機	16.1	16.8	17,035			
TOWA	19	60	126,360			
丸山製作所	1.3	0.7	1,722			
北川鉄工所	6.8	7.1	8,839			
ローツェ	8.9	93.8	190,414			
タカキタ	2.6	1.3	552			
クボタ	894.1	938.2	1,965,998			
荏原実業	9	8.6	36,163			
三菱化工機	6	6.3	22,774			
月島ホールディングス	23.2	24.3	33,485			
帝国電機製作所	12	12.3	35,030			
新東工業	34.6	36.3	36,154			
澁谷工業	16.1	16.8	64,764			
アイチ コーポレーション	23.9	24.8	30,504			
小森コーポレーション	42.2	44.2	50,785			
鶴見製作所	13.1	13.7	60,759			
日本ギア工業	3	1.5	721			
酒井重工業	2.7	7	17,878			
荏原製作所	70.2	368.4	894,843			
石井鐵工所	0.9	—	—			
西島製作所	14.7	15.5	41,307			
北越工業	17.2	18.1	36,887			
ダイキン工業	204.2	214.2	4,369,680			
オルガノ	20.6	21.6	155,952			
トーヨーカネツ	5.8	6.1	25,864			
栗田工業	95.7	100.4	634,226			
椿本チエイン	24.3	73.8	142,286			
大同工業	3.4	1.7	1,470			
木村化工機	13.2	13.7	10,165			
アネスト岩田	26.5	27.8	38,920			
ダイフク	288.6	302.9	869,020			
サムコ	4.6	4.3	15,157			
加藤製作所	3.9	2	2,496			
油研工業	1.3	0.7	1,554			

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
タダノ	98.5	103.3	103,155			
フジテック	40	41.9	217,963			
CKD	47.3	49.6	151,032			
平和	50.6	53.1	112,731			
理想科学工業	13.7	14.4	48,456			
SANKYO	164.8	172.8	364,953			
日本金銭機械	20.7	21.7	20,463			
マースグループホールディングス	8.6	9.1	30,439			
フクシマガリレイ	11.2	11.7	63,882			
オーイズミ	3	1.5	540			
ダイコク電機	8.4	8.8	31,020			
竹内製作所	31	32.6	148,493			
アマノ	48.6	50.9	225,996			
JUKI	26.6	27.9	11,745			
ジャノメ	17.4	18.2	15,797			
マックス	24.1	25.3	92,471			
グローリー	41.1	43.1	113,115			
新晃工業	17.2	18.1	87,151			
大和冷機工業	26.2	27.5	41,277			
セガサミーホールディングス	152.8	160.3	479,297			
TPR	21.7	22.8	54,241			
ツバキ・ナカシマ	34.3	44.3	31,807			
ホシザキ	100.9	115.5	592,399			
大豊工業	14.8	15.5	10,214			
日本精工	316.7	332.2	244,831			
NTN	371	389.3	103,631			
ジェイテクト	152.2	159.7	170,399			
不二越	12.6	13.3	43,624			
日本トムソン	46.6	48.9	24,596			
THK	98.7	103.5	272,463			
ユースン精機	13.6	14.2	9,443			
前澤給装工業	12.3	12.9	17,169			
イーグル工業	18.9	19.8	42,649			
前澤工業	4.8	2.4	2,978			
PILLAR	15.9	16.6	76,775			
キッツ	57.3	60.1	65,989			
マキタ	195	204.7	1,030,459			
三井E&S	84.9	89.1	107,811			
カナデビア	151	158.4	159,033			
三菱重工業	2,991	3,138.2	6,998,186			
IHI	127.3	133.6	1,046,756			
スター精密	31.5	30.3	61,751			
電気機器(17.7%)						
日清紡ホールディングス	128.6	134.9	134,832			
イビデン	89.2	93.6	449,467			

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
コニカミノルタ	382.4	401.3	185,400	
ブラザー工業	228.6	239.8	718,800	
ミネベアミツミ	297.5	312.2	937,848	
日立製作所	821.9	4,312.3	16,835,219	
三菱電機	1,903.4	1,965.7	4,837,587	
富士電機	104	109.1	919,058	
東洋電機製造	2.7	1.4	1,688	
安川電機	185.8	194.9	973,135	
シンフォニアテクノロジー	18.9	19.8	104,544	
明電舎	31.7	33.3	118,548	
オリジン	1.7	0.9	1,086	
山洋電気	7.4	7.8	73,944	
デンヨー	13	13.7	35,962	
PHCホールディングス	32.1	33.8	35,794	
KOKUSAI ELECTRIC	66.2	93.9	307,992	
ソシオネクスト	124.2	131	375,708	
東芝テック	21.9	23	83,260	
芝浦メカトロニクス	9.8	10.2	97,002	
マブチモーター	84.2	78.9	180,562	
ニデック	377.6	792.4	2,454,855	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11.4	11.9	4,676	
トレックス・セミコンダクター	8.9	9.4	15,199	
東光高岳	10.4	10.9	20,611	
ダブル・スコープ	49	51.4	19,326	
ダイヘン	17.2	17	119,170	
ヤーマン	33.5	35.2	29,708	
JVCケンウッド	135.2	141.8	184,056	
ミマキエンジニアリング	16.4	17.2	23,581	
I-PEX	12	10.1	16,665	
大崎電気工業	37.4	38.5	30,145	
オムロン	130.6	137	911,050	
日東工業	23.1	24.2	74,536	
I D E C	25.2	26.5	68,820	
正興電機製作所	2.7	1.4	1,806	
不二電機工業	1.7	0.9	976	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	66.8	70.1	204,306	
サクサ	1.7	0.9	2,170	
メルコホールディングス	5.4	5.7	14,061	
テクノメディカ	4.3	4.5	8,523	
日本電気	224.6	235.7	3,282,122	
富士通	1,574	1,651.3	4,995,182	
沖電気工業	77.3	81.1	83,533	
岩崎通信機	3.6	—	—	
電気興業	7.7	7.2	14,824	
サンケン電気	15.9	16.7	115,513	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ナカヨ	1.2	0.6	703	
アイホン	9.2	9.7	28,469	
ルネサスエレクトロニクス	1,067.3	1,367.3	2,966,357	
セイコーエプソン	219.4	230.2	650,084	
ワコム	130.4	126.5	86,526	
アルバック	37.5	39.4	307,241	
アクセル	6.9	9.1	12,485	
E I Z O	12.5	26.2	59,369	
日本信号	38.9	40.9	39,918	
京三製作所	35.8	37.6	20,266	
能美防災	23.2	24.3	69,036	
ホーチキ	12.9	13.5	28,849	
星和電機	3.8	2	1,086	
エレコム	41	43.1	63,313	
パナソニック ホールディングス	2,020.2	2,120	2,793,100	
シャープ	288.3	302.5	308,398	
アンリツ	120.4	126.4	146,055	
富士通ゼネラル	48.5	50.9	108,060	
ソニーグループ	1,197.8	6,221	17,919,590	
T D K	270.8	1,421	2,788,712	
帝国通信工業	7.6	8	19,928	
タムラ製作所	68.1	71.5	44,044	
アルプスアルパイン	152.9	160.4	255,998	
池上通信機	2.4	1.2	824	
日本電波工業	20.7	21.7	24,325	
鈴木	9.3	9.7	16,684	
メイコー	17	17.9	112,233	
日本トリム	3.9	4.1	14,924	
ローランド ディー・ジー	9.5	—	—	
フォスター電機	12.7	13.3	25,163	
SMK	4.6	4.8	11,596	
ヨコオ	15.3	16	24,080	
ホシデン	39	40.9	90,511	
ヒロセ電機	25.2	26.1	509,994	
日本航空電子工業	40.9	42.9	114,543	
T O A	19.5	20.4	20,481	
マクセル	37.9	39.8	76,734	
古野電気	22.3	23.5	40,255	
スミダコーポレーション	23.1	24.4	23,546	
アイコム	6.6	6.9	20,465	
リオン	7.1	7.5	16,567	
横河電機	187.1	196.3	740,836	
新電元工業	6.5	6.9	16,987	
アズビル	116.5	488.8	600,735	
東亜ディーケーケー	3.8	2	1,642	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
日本光電工業	72.7	152.1		319,410
チノー	7	7.4		17,604
共和電業	7	3.9		1,665
日本電子材料	10.4	10.9		27,904
堀場製作所	32.3	33.7		331,843
アドバンテクト	485.1	509	3,660,219	
小野測器	3.4	2.1		1,247
エスベック	13.6	14.3		37,880
キーエンス	169.4	177.8	12,339,320	
日置電機	8	9.3		77,097
シスメックス	438.3	460.1	1,358,675	
日本マイクロニクス	30.4	29.3		113,684
メガチップス	13.4	13.8		73,002
OBARA GROUP	9.3	11.2		47,432
澤藤電機	1.1	0.6		648
原田工業	3.6	2		1,092
コーセル	18.2	19.2		22,252
イリゾ電子工業	15.6	16.4		41,967
オブテックスグループ	31.2	32.7		51,993
千代田インテグレ	6.7	6.2		22,165
レーザーテック	77.6	81.5	1,968,225	
スタンレー電気	108.5	113.8		313,632
ウシオ電機	86.1	78.7		167,749
岡谷電機産業	6.7	3.7		880
ヘリオス テクノ ホールディング	7.9	4.1		3,940
エノモト	2.2	1.2		1,692
日本セラミック	13.9	16.4		42,525
遠藤照明	3.5	1.8		2,392
古河電池	12.7	13.2		18,189
双信電機	3.8	—		—
山一電機	15.3	16.1		42,214
図研	14.8	14.9		55,577
日本電子	42.5	44.6		254,353
カシオ計算機	122.3	128.4		154,336
ファナック	825.7	859.8	3,667,047	
日本シイエムケイ	37.4	42.3		17,808
エンプラス	5	5.2		35,152
大真空	25.5	26.9		16,704
ローム	313.1	322.1		596,046
浜松ホトニクス	135.9	285.4		589,493
三井ハイテック	15	78.9		73,613
新光電気工業	60	62.9		349,283
京セラ	1,052.2	1,104.1	1,900,708	
太陽誘電	82.5	86.6		259,496
村田製作所	1,540.6	1,587.2	4,525,107	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
双葉電子工業	32.7	34.3		18,041
北陸電気工業	3	1.6		2,144
ニチコン	44.6	46.9		46,477
日本ケミコン	18.2	19.1		20,475
KOA	25.8	27.1		31,490
市光工業	30.9	32.6		14,670
小糸製作所	175.5	184.2		392,530
ミツバ	31.7	33.3		30,502
SCREENホールディングス	57.9	60.7		647,972
キャノン電子	18.8	16.9		39,731
キャノン	844.5	886.2	4,343,266	
リコー	424.5	445.5		747,994
象印マホービン	46.1	53.2		89,748
MUTOHホールディングス	1.1	0.6		1,469
東京エレクトロン	358.4	376	9,644,400	
イノテック	11.4	12		17,604
<b>輸送用機器(7.2%)</b>				
トヨタ紡織	71.3	74.8	142,381	
芦森工業	1.6	0.8		1,948
ユニプレス	30.5	31.9		37,450
豊田自動織機	144.4	151.5	1,769,520	
モリタホールディングス	29.8	31.2		66,955
三櫻工業	25.9	27.2		20,726
デンソー	1,397	1,465.9	3,195,662	
東海理化電機製作所	47.8	50.1		100,901
川崎重工業	138.2	145		922,925
名村造船所	42.2	55.3		86,102
日本車輛製造	5.6	5.9		12,897
三菱ロジスネクスト	27	28.4		38,056
近畿車輛	1	0.5		758
日産自動車	2,285	2,337.8	983,980	
いすゞ自動車	492.3	498.9	989,318	
トヨタ自動車	9,297.5	9,445.1	24,987,012	
日野自動車	254.7	267.2		128,256
三菱自動車工業	660.5	693.1		292,141
エフテック	5.3	2.7		1,471
レンシップホールディングス	3.2	1.8		975
GMB	1.5	0.8		951
ファルテック	1.6	0.8		376
武蔵精密工業	41.4	43.4		86,496
日産車体	17.2	18		19,116
新明和工業	48.8	51.2		72,806
極東開発工業	28	29.3		76,853
トビー工業	13.7	14.4		29,534
ティアラド	3.8	3.9		13,455

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
曙ブレーキ工業	103.3	108.4	13,875			
タチエス	31.3	32.8	61,500			
NOK	65.8	69	160,770			
フタバ産業	45.4	47.7	34,105			
カヤバ	16.3	16.8	82,908			
大同メタル工業	33.2	34.8	17,782			
プレス工業	67.8	71	41,606			
ミクニ	9.6	4.9	1,705			
太平洋工業	38.9	40.8	58,466			
アイシン	130.6	376.2	613,394			
マツダ	560.1	587.7	672,034			
今仙電機製作所	4.9	2.5	1,395			
本田技研工業	4,016.5	4,209.8	6,744,099			
スズキ	1,244	1,305.3	2,086,522			
SUBARU	525.1	551	1,448,854			
安永	3.4	1.7	965			
ヤマハ発動機	731.8	749.9	1,038,611			
TBK	8.4	4.3	1,259			
エクセディ	27.7	29.1	101,413			
豊田合成	48.5	50.9	128,471			
愛三工業	28.1	29.5	42,568			
盟和産業	1.1	0.6	712			
日本プラスト	6.5	3.3	1,224			
ヨロズ	15.9	16.7	18,670			
エフ・シー・シー	30	31.4	75,203			
シマノ	68.4	77.6	1,968,324			
テイ・エス テック	60.3	63.3	113,813			
ジャムコ	8.2	10.7	14,252			
<b>精密機器(2.4%)</b>						
テルモ	946.8	990.5	2,816,486			
クリエートメディック	2.5	1.2	1,150			
日機装	39.4	46	48,208			
日本エム・ディ・エム	13.4	14.1	10,349			
島津製作所	225	236.1	1,155,709			
JMS	15.7	16.4	8,232			
長野計器	12.3	12.9	33,269			
ブイ・テクノロジー	8.9	9.4	24,139			
東京計器	13	13.6	44,812			
愛知時計電機	7.3	7.7	16,170			
インターアクション	10.2	10.7	13,492			
オーバル	6.7	3.4	1,332			
東京精密	34.6	36.4	290,180			
マニー	67.7	71.1	129,615			
ニコン	244.8	256.9	429,408			
トプコン	82.3	86.4	142,171			

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
オリンパス	1,001.4	1,017.2	2,849,177			
理研計器	24	25.2	101,304			
タムロン	10.4	24.5	111,107			
HOYA	333.3	349.8	7,239,111			
シード	3.9	2.3	1,170			
ノーリツ鋼機	16	16.8	72,828			
A&Dホロンホールディングス	24.7	25.9	58,404			
朝日インテック	206.4	216.6	543,666			
シチズン時計	155.8	163.5	154,998			
リズム	1.7	0.9	3,676			
大研医器	6.5	3.3	1,722			
メニコン	58.2	61.1	97,973			
シンシア	0.9	0.4	184			
松風	7.7	16	36,896			
セイコーグループ	23.6	24.8	101,308			
ニプロ	141.2	148.1	217,707			
<b>その他製品(2.5%)</b>						
三井松島ホールディングス	—	14.8	75,776			
KYORITSU	11.2	5.7	889			
中本ボックス	2.5	1.3	2,087			
スノーピーク	24.5	—	—			
バラムウントベッドホールディングス	35.2	36.9	96,013			
トランザクション	11.2	11.7	26,079			
粧美堂	2	1	540			
ニホンフラッシュ	15.9	16.7	15,497			
前田工織	14.3	31.7	59,627			
永大産業	8.9	4.5	1,008			
アートネイチャー	15.2	16	13,760			
フルヤ金属	4	16.9	70,135			
パンダイナムホールディングス	463.9	482.4	1,639,195			
アイフィスジャパン	2.1	1.1	636			
SHOEI	38.3	50	114,200			
フランスベッドホールディングス	21.9	23	28,727			
パイロットコーポレーション	23.8	27.8	126,823			
萩原工業	11.3	11.9	19,040			
フジシルインターナショナル	34.3	36	92,736			
タカラトミー	77.1	80.9	326,674			
広済堂ホールディングス	43.6	57.5	28,865			
エステールホールディングス	1.7	0.9	560			
タカノ	2.8	1.4	1,082			
プロネクサス	17.6	18.4	24,214			
ホクシン	5.7	2.9	310			
ウッドワン	2.7	1.4	1,148			
TOPPANホールディングス	208.1	211.8	951,829			
大日本印刷	185	368.4	1,007,389			

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
共同印刷	4.8	5	17,400	
NISSHA	29	30.4	59,796	
光村印刷	0.6	0.3	459	
TAKARA & COMPANY	10	10.5	28,087	
アシックス	144.3	656	1,949,304	
ツツミ	4	4.2	8,979	
ローランド	12.5	13.1	50,566	
小松ウオール工業	6.9	14.4	22,449	
ヤマハ	106.7	324.6	418,084	
河合楽器製作所	5.1	5.4	15,741	
クリナップ	16.6	17.4	12,423	
ビジョン	107.8	113.2	197,194	
キングジム	14.9	15.7	13,580	
リンテック	34	35.7	122,808	
イトーキ	34.7	35.5	54,883	
任天堂	1,069	1,121.7	9,071,187	
三菱鉛筆	24	24.6	61,672	
タカラスタンダード	35.6	36.3	59,205	
コクヨ	69.3	88.8	231,190	
ナカバヤシ	18.2	19.1	10,199	
グローブライド	15.2	15.9	30,528	
オカムラ	51	53.5	107,428	
美津濃	16.8	17.7	151,866	
<b>電気・ガス業(1.4%)</b>				
グリムス	—	7.9	22,483	
東京電力ホールディングス	1,526.3	1,601.6	1,097,736	
中部電力	624	654.7	1,129,357	
関西電力	653.8	686.1	1,734,460	
中国電力	294.2	308.7	307,835	
北陸電力	173.1	181.7	179,228	
東北電力	445.8	467.8	683,923	
四国電力	157.7	165.5	214,239	
九州電力	390.3	409.6	680,345	
北海道電力	163.6	171.7	179,426	
沖縄電力	43.3	45.4	48,487	
電源開発	139.1	145.9	359,059	
エフオン	12.3	12.9	4,953	
イーレックス	30.1	31.6	21,930	
レノバ	45.2	47.4	45,267	
東京瓦斯	330	345.9	1,181,594	
大阪瓦斯	343	354.1	1,185,880	
東邦瓦斯	73.3	76.9	310,214	
北海道瓦斯	10.1	53	33,549	
広島ガス	35.8	37.5	14,775	
西部ガスホールディングス	17.7	18.5	33,984	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
静岡ガス	33.8	40.5	43,092	
メタウォーター	20.3	21.3	39,277	
<b>陸運業(2.3%)</b>				
SBSホールディングス	15.1	15.8	42,186	
東武鉄道	186	195.2	496,198	
相鉄ホールディングス	60.6	63.6	152,640	
東急	474.8	498.2	937,612	
京浜急行電鉄	209.5	219.9	261,241	
小田急電鉄	280	293.8	475,809	
京王電鉄	81.4	85.4	299,327	
京成電鉄	109.2	114.6	469,860	
富士急行	20.9	21.9	58,494	
東日本旅客鉄道	933.3	979.2	2,856,326	
西日本旅客鉄道	401.8	421.5	1,188,630	
東海旅客鉄道	652.2	684.4	2,281,105	
西武ホールディングス	204.8	214.9	730,445	
鴻池運輸	28.8	30.3	79,749	
西日本鉄道	45.2	47.5	109,867	
ハマキョウレックス	14.4	60.8	77,094	
サカイ引越センター	18.8	19.7	49,565	
近鉄グループホールディングス	169	177.4	658,331	
阪急阪神ホールディングス	225.4	236.5	1,042,965	
南海電気鉄道	75.4	79.1	186,873	
京阪ホールディングス	93.2	97.8	295,453	
神戸電鉄	4.6	4.8	12,120	
名古屋鉄道	174.4	183	321,073	
山陽電気鉄道	12.7	13.4	27,617	
アルプス物流	13.5	14.2	81,792	
ヤマトホールディングス	216.5	215.6	356,171	
山九	43	42.8	214,642	
丸運	4.4	2.2	1,073	
丸全昭和運輸	10.4	11	62,150	
センコーグループホールディングス	89.5	93.9	122,257	
トナミホールディングス	3.7	3.9	24,297	
ニッコンホールディングス	54.1	109.2	209,008	
日本石油輸送	0.8	0.4	1,149	
福山通運	19.3	16.3	62,021	
セイノーホールディングス	95.1	99.8	242,015	
エスライングループ本社	2.1	—	—	
神奈川中央交通	4.8	5	16,900	
AZ-COM丸和ホールディングス	43.2	45.3	50,917	
C&Fロジホールディングス	16.3	—	—	
九州旅客鉄道	119.5	125.4	530,065	
S Gホールディングス	283.8	297.8	471,268	
NIPPON EXPRESSホールディングス	57.4	66.2	509,475	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
<b>海運業(0.8%)</b>				
日本郵船	484.8	459.5	2,285,553	
商船三井	367.1	385.4	1,860,325	
川崎汽船	407.7	403.8	827,991	
NSユニテッド海運	9.3	9.7	45,299	
飯野海運	62.8	65.5	82,923	
共栄タンカー	2.2	1	1,179	
乾汽船	20.7	21.2	25,100	
<b>空運業(0.4%)</b>				
日本航空	415.2	435.7	1,078,139	
ANAホールディングス	460	482.7	1,413,345	
パスコ	1.5	0.7	1,495	
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>				
トランコム	4.9	5.1	54,264	
日新	12.8	13.5	59,535	
三菱倉庫	41.5	42.3	226,601	
三井倉庫ホールディングス	15.8	16.6	108,730	
住友倉庫	45.6	47.4	131,535	
澁澤倉庫	7.7	8.1	25,029	
東陽倉庫	2	1	1,324	
日本トランスシティ	34	35.7	34,557	
ケイヒン	1.3	0.7	1,407	
中央倉庫	9.1	9.5	13,775	
川西倉庫	1.4	0.7	788	
安田倉庫	11.5	12.1	20,582	
ファイズホールディングス	1.1	0.6	507	
東洋埠頭	2.2	1.1	1,419	
上組	78.1	81.9	267,157	
サンリツ	1.8	0.9	710	
キムラユニティー	3.6	1.8	2,718	
キューソー流通システム	7.7	11.8	23,423	
東海運	4.4	2.2	712	
エーアイテイ	10.6	11.1	19,358	
内外トランスライン	6.8	7.1	21,037	
日本コンセプト	6.1	6.5	11,407	
<b>情報・通信業(7.4%)</b>				
NECネットエスアイ	66.2	69.5	187,233	
クロスキャット	10.8	11.3	13,921	
システナ	257	269.6	101,639	
デジタルアーツ	10.7	11.3	57,630	
日鉄ソリューションズ	29	60.8	229,824	
キューブシステム	9	9.4	9,494	
コア	7.5	7.9	15,357	
手間いらず	2.9	3	10,230	
ラクーンホールディングス	12.7	13.3	9,988	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ソリトンシステムズ	8.8	9.2	12,392	
ソフトクリエイトホールディングス	14	14.7	30,855	
T I S	185.7	188.4	698,398	
テクミラホールディングス	3.5	1.8	612	
グリー	57	59.7	29,073	
GMOベバボ	2.1	2.2	3,014	
コーエーテクモホールディングス	106.4	111.7	187,376	
三菱総合研究所	8.3	8.7	37,149	
電算	0.9	0.5	707	
AGS	3.1	1.6	1,403	
ファインデックス	13.5	14.2	12,283	
ブレインパッド	14.1	14.8	12,328	
KL a b	31.2	43.3	8,183	
ポールトゥワインホールディングス	29	30.4	13,619	
ネクソン	372.9	391.2	1,117,854	
アイスタイル	55.5	59.6	30,455	
エムアップホールディングス	20.8	21.8	27,686	
エイチーム	10.1	11.9	7,354	
エニグモ	21.7	22.7	7,354	
テクノスジャパン	6.8	3.4	2,386	
コロブラ	65.9	60.5	32,972	
ブロードリーフ	80.6	71.6	44,463	
クロス・マーケティンググループ	3.6	1.8	1,216	
デジタルハーツホールディングス	10.6	11.1	9,568	
メディアドゥ	7.7	8.1	11,113	
じげん	49.5	52	31,356	
ブイキューブ	20.5	24.6	5,535	
エンカレッジ・テクノロジー	1.8	0.9	552	
サイバーリンクス	2.9	1.5	1,114	
フィックスターズ	19.2	17.9	27,566	
CARTA HOLDINGS	8	10.1	14,614	
オブティム	17.5	18.4	11,205	
セレス	6.8	8	11,464	
SHIFT	11.3	11.8	170,215	
ティーガイア	17.8	18.6	49,569	
セック	2.1	2.7	11,556	
テクマトリックス	31	32.5	74,457	
プロシップ	8.2	8.6	14,336	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	44.2	44.2	135,119	
GMOペイメントゲートウェイ	33.9	40.7	379,731	
ザッパラス	1.8	0.9	340	
システムリサーチ	11.6	12.2	17,946	
インターネットイニシアティブ	81.2	85.2	252,192	
さくらインターネット	19.1	22.3	91,430	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5.2	5.4	16,200	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
SRAホールディングス	8.7	9.1	39,175	
システムインテグレータ	2.3	1.2	392	
朝日ネット	18.3	19.2	12,460	
eBASE	23.9	25.1	16,264	
アバントグループ	21.5	22.5	50,107	
アドソル日進	7.2	7.5	13,297	
ODKソリューションズ	1.5	0.8	464	
フリービット	7.4	7.8	9,360	
コムチエ	24.5	25.7	48,033	
アステリア	13.3	14	7,392	
アイル	7.9	10	32,200	
マークライズ	9.2	10.5	30,859	
メディカル・データ・ビジョン	20.3	21.3	11,480	
gumi	27.6	29	9,425	
ショーケース	1.8	0.9	270	
モバイルファクトリー	1.6	0.8	692	
テラスカイ	7.3	7.7	17,309	
デジタル・インフォメーションテクノロジー	8.8	9.3	19,185	
PCIホールディングス	2.8	0.1	100	
アイピーシー	1.2	0.6	339	
ネオジャパン	5.7	5.9	11,440	
PR TIMES	3.4	3.6	6,051	
ラクス	80.3	84.3	182,762	
ランドコンピュータ	3.7	1.9	1,470	
ダブルスタンダード	5.2	5.4	8,883	
オープンドア	9.9	10.4	7,061	
アカツキ	8.1	8.7	18,200	
ベネフィットジャパン	0.5	0.2	239	
Ubicomホールディングス	5.3	5.7	7,871	
カナミックネットワーク	18.3	22.4	12,140	
ノムラシステムコーポレーション	8.4	4.3	507	
チェンジホールディングス	37	39.3	51,954	
シンクロ・フード	4.8	2.5	1,282	
オークネット	6.3	8.2	21,385	
キャピタル・アセット・プランニング	1.5	0.8	601	
セグエグループ	7.2	3.5	2,009	
エイトレッド	1.2	0.6	991	
マクロミル	33.4	35	29,050	
ビーグリー	1.6	0.7	1,008	
オロ	6.1	7.5	17,580	
ユーザーローカル	7.2	7.5	13,950	
テモナ	1.8	0.9	199	
ニーズウェル	4.1	4.2	1,264	
マネーフォワード	37.9	43.6	254,100	
サインボスター	2.9	1.5	778	
Sun Asterisk	12.1	12.7	6,908	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
プラスアルファ・コンサルティング	10	22.5	48,915	
電算システムホールディングス	7.5	7.9	21,543	
Appier Group	58.1	54.3	93,830	
ビジョナル	13	21.1	169,855	
ソルクシーズ	6.2	3.1	923	
フェイス	2.2	1.1	447	
プロトコーポレーション	18.6	—	—	
ハイマックス	5.3	5.6	7,728	
野村総合研究所	376.2	385.9	1,976,193	
CEホールディングス	3.9	1.8	829	
日本システム技術	12.6	16.5	31,251	
インテージホールディングス	19.2	20.2	32,804	
東邦システムサイエンス	6.3	8.3	11,902	
ソースネクスト	77.8	81.6	16,564	
インフォコム	21.9	—	—	
シンプレクス・ホールディングス	25.7	27.1	65,229	
HEROZ	6.7	7	7,861	
ラクスル	40.9	43.1	55,426	
メルカリ	82.7	87	230,811	
IPS	4.9	5.1	11,347	
FIG	8.8	4.5	1,435	
システムサポート	6.6	6.9	14,317	
イソル	12.3	12	9,180	
東海ソフト	1.3	0.6	777	
ウイングアーク1st	17.6	18.5	58,552	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4.6	6	5,244	
サーバーワークス	3.5	3.7	10,582	
東名	0.6	0.8	1,400	
ヴィッツ	0.8	0.4	327	
トビラシステムズ	2.2	1.1	851	
Sansan	55.7	58.6	126,107	
Link-Uグループ	1.8	0.8	384	
ギフトィ	14.9	15.7	15,809	
メドレー	22.8	19.6	78,596	
ペース	5.9	8.7	26,622	
JMDC	29	30.4	142,424	
フォーカスシステムズ	11.4	11.9	13,447	
クレスコ	13.9	29.2	38,923	
フジ・メディア・ホールディングス	163.1	171.2	299,771	
オービック	56.8	298	1,500,132	
ジャストシステム	24.4	25.6	91,648	
TDCソフト	31.8	33.4	41,649	
LINEXヤフー	2,417.7	2,537.3	1,093,322	
トレンドマイクロ	80.3	93.6	785,023	
IDホールディングス	11.5	12	17,700	

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
日本オラクル	32.5	34.1	515,421			
アルファシステムズ	4.5	4.7	14,570			
フューチャー	36.2	44.3	78,898			
CAC Holdings	9.1	10.9	19,685			
SBテクノロジー	7.2	—	—			
トーセ	2.2	1.1	691			
オービックビジネスコンサルティング	23.9	25.1	182,778			
アイティフォー	21.8	22.8	32,125			
東計電算	4.7	5	24,750			
エクスネット	1.1	0.5	748			
大塚商会	168.4	202	706,596			
サイボウズ	23.4	24.5	51,131			
電通総研	20.6	17.3	95,150			
ACCESS	17.7	18.5	23,994			
デジタルガレージ	27.1	28.5	86,497			
EMシステムズ	28.3	29.7	16,542			
ウェザーニューズ	5.3	5.5	34,485			
C I J	42.3	44.4	19,092			
ビジネスエンジニアリング	3.2	4.2	17,976			
日本エンタープライズ	8	4.1	467			
WOWOW	12.8	13.4	13,989			
スカラ	15.8	16.5	7,854			
インテリジェント ウェイブ	4	2	1,806			
ANYCOLOR	18	25.4	61,468			
IMAGICA GROUP	17	17.9	8,950			
ネットワンシステムズ	68.6	69.4	248,868			
システムソフト	59.5	62.2	3,918			
アルゴグラフィックス	15.6	16.3	84,923			
マーベラス	27.6	29	16,936			
エイベックス	28.9	30.3	46,480			
B I P R O G Y	55.6	53.5	260,277			
都築電気	9	9.4	21,422			
TBSホールディングス	85.4	89.6	362,790			
日本テレビホールディングス	150.4	157.8	369,252			
朝日放送グループホールディングス	15.9	16.7	10,721			
テレビ朝日ホールディングス	41.2	43.3	88,981			
スカパーJ SATホールディングス	131.9	138.4	128,712			
テレビ東京ホールディングス	12.2	12.8	47,808			
日本BS放送	2.7	1.4	1,247			
ビジョン	25.6	26.7	32,413			
スマートパリュウ	2.2	1.1	349			
U-NEXT HOLDINGS	19	20	105,600			
ワイヤレスゲート	3.4	1.9	461			
日本通信	167.3	175.5	28,782			
クロップス	1	0.5	497			

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
日本電信電話	50,514.6	53,005.5	7,929,622			
KDD I	1,312.3	1,310.7	6,212,718			
ソフトバンク	2,733.5	28,482	5,497,026			
光通信	17.1	17.6	552,640			
エムティーアイ	11.7	12.2	15,481			
GMOインターネットグループ	62.8	58	147,204			
ファイバーゲート	9.1	9.6	9,715			
アイドママーケティングコミュニケーション	2.2	1.1	246			
KADOKAWA	89.8	94.2	312,273			
学研ホールディングス	28.3	32.6	33,349			
ゼンリン	29.1	30.5	26,992			
昭文社ホールディングス	3.3	1.7	676			
インプレスホールディングス	7.7	3.9	588			
アイネット	10.3	10.8	17,258			
松竹	8.8	9.3	96,766			
東宝	94.5	99.1	576,563			
東映	28	29.4	136,122			
NTTデータグループ	444	465.9	1,196,897			
ピー・シー・エー	9.8	10.2	21,409			
ビジネスブレイン太田昭和	6.7	7	12,999			
DTS	35.8	35.2	143,616			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77.6	81.4	480,992			
シーイーシー	21.4	22.5	42,367			
カプコン	303.8	318.7	1,067,645			
アイ・エス・ビー	8.7	8.4	12,717			
ジャステック	10.4	—	—			
S C S K	118.8	124.7	374,598			
NSW	7.6	7.9	24,490			
アイネス	13.2	13.9	22,573			
TKC	26.9	31.8	123,861			
富士ソフト	34.1	49.3	441,235			
NSD	60.6	62.9	202,538			
コナミグループ	63.6	66.7	986,493			
福井コンピュータホールディングス	10.5	11	29,260			
J B C Cホールディングス	11.3	11.8	48,557			
ミロク情報サービス	15.4	16.2	30,780			
ソフトバンクグループ	837.7	879	7,686,855			
<b>卸売業(7.5%)</b>						
リョーサン菱洋ホールディングス	33.764	35.4	94,128			
高千穂交易	5.7	7.4	30,266			
オルパヘルスケアホールディングス	1.3	0.7	1,392			
伊藤忠食品	4	4.2	29,736			
エレマテック	16.1	16.9	29,913			
あらた	27.4	28.8	105,840			
トーマンデバイス	2.6	2.7	16,389			

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
東京エレクトロン デバイス	17.9	18.7	68,909	
円谷フィールズホールディングス	30.8	30.4	71,622	
双日	199.5	209.3	728,364	
アルフレッサ ホールディングス	179.8	188.7	445,615	
横浜冷凍	48.8	47.3	46,495	
ラサ商事	7.3	9.6	14,121	
アルコニックス	23.6	24.8	34,992	
神戸物産	138.6	145.4	624,493	
ハイバー	1.8	0.9	284	
あい ホールディングス	28.7	31.1	74,919	
ディーブイエックス	2.2	1.1	1,028	
ダイワボウホールディングス	79.3	83.2	229,049	
マクニカホールディングス	42.4	133.5	272,540	
ラクト・ジャパン	7	8	23,712	
グリムス	7.6	—	—	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	27.1	28.5	38,133	
八洲電機	14.5	15.2	29,032	
メディアスホールディングス	10.4	10.9	9,483	
レスタ-	15.2	16	44,000	
ジオリーブグループ	1.8	0.9	1,035	
大光	4.2	2.1	1,304	
OCHIホールディングス	1.8	0.9	1,260	
TOKAIホールディングス	97.3	102.1	98,424	
黒谷	2.2	1.1	674	
C o m i n i x	1.6	0.8	716	
三洋貿易	20.2	19.3	30,030	
ビューティガレージ	5.7	5.9	9,404	
ウイン・パートナーズ	11.6	12.2	15,103	
ミタチ産業	2.2	1.1	1,331	
シップヘルスケアホールディングス	64.4	67.6	161,766	
明治電機工業	6.7	7	10,437	
デリカフーズホールディングス	3.5	1.8	973	
スターティアホールディングス	2.1	1.1	2,178	
コメダホールディングス	43.9	46.1	124,931	
ピーバンドットコム	1.1	0.5	188	
アセンテック	6.9	7.2	4,557	
富士興産	2.2	1.1	1,709	
協栄産業	0.8	0.4	929	
フルサト・マルカホールディングス	16	15.1	34,669	
ヤマエグループホールディングス	11.8	16.6	34,162	
小野建	17.6	18.9	29,030	
南陽	3.2	1.7	1,825	
佐鳥電機	10	13.1	25,872	
エコートレーディング	1.6	0.8	736	
伯東	10.3	10.8	51,084	
コンドーテック	13.8	14.5	18,139	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
中山福	4.3	2.2	825	
ナガイレーベン	22.6	23.7	58,918	
三菱食品	16.5	17.4	92,742	
松田産業	13.6	14.3	46,689	
第一興商	69.3	72.7	135,367	
メディバルホールディングス	182.2	191.1	494,949	
S P K	8	8.3	16,741	
萩原電気ホールディングス	7.7	8.1	28,309	
アズワン	56.2	58.3	176,765	
スズデン	6.3	6.6	12,038	
尾家産業	1.9	1	2,054	
シモジマ	12	12.6	17,488	
ドウシシャ	16.6	17.4	38,558	
小津産業	1.8	0.9	1,496	
高速	10.6	11.2	29,881	
たけびし	6.8	7.2	16,041	
リックス	3.6	4.7	13,973	
丸文	16	16.8	18,345	
ハビネット	15.2	16	68,240	
橋本総業ホールディングス	7.1	7.4	9,346	
日本ライフライン	52.5	50.3	62,070	
タカショー	15.6	16.4	8,036	
I D O M	47.4	49.7	54,371	
進和	11	11.5	30,716	
エスケイジャパン	2	1	739	
ダイトロン	7.1	8.2	23,640	
シークス	25.5	26.8	30,096	
田中商事	2.3	1.2	847	
オーハシテクニカ	9.4	9.9	18,067	
白銅	5	5.3	12,624	
ダイコー通産	0.8	0.4	473	
伊藤忠商事	1,204.3	1,263.6	10,097,427	
丸紅	1,487.7	1,559.3	3,927,876	
高島	5.5	2.7	3,445	
長瀬産業	82.1	84	276,528	
蝶理	11.2	11.8	48,970	
豊田通商	156.9	494	1,363,934	
三共生興	24.9	26.1	15,790	
兼松	74.9	78.6	188,954	
ツカモトコーポレーション	1.1	0.6	726	
三井物産	1,343.3	2,816	9,692,672	
日本紙パルプ商事	8.6	90	64,620	
カメイ	19.1	20	43,000	
東都水産	0.5	0.4	2,616	
O U Gホールディングス	1.2	0.6	1,539	
スターゼン	12.4	13	38,792	

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
山善	54.3	57	78,717			
椿本興業	11.1	11.7	21,399			
住友商事	1,084.2	1,125.9	3,855,081			
内田洋行	7.3	7.6	51,604			
三菱商事	3,440	3,609.6	11,139,225			
第一実業	16.9	17.7	43,382			
キャノンマーケティングジャパン	41.5	43.5	204,754			
西華産業	7	7.4	30,007			
佐藤商事	12.4	13	18,785			
東京産業	16.4	17.2	12,126			
ユアサ商事	14	14.7	73,059			
神鋼商事	4.5	4.7	31,725			
トルク	4.4	2.9	701			
阪和興業	32.2	33.8	177,450			
正栄食品工業	11.9	12.5	58,312			
カナデン	13.5	14.1	21,742			
RYODEN	14.5	15.2	39,185			
岩谷産業	40.8	171.2	362,259			
ナイス	2.5	1.3	2,419			
ニチモウ	2.5	1.3	2,464			
極東貿易	10.7	11.2	17,001			
アステナホールディングス	33.7	35.4	18,514			
三愛オプリー	43.1	43.9	87,712			
稲畑産業	35.4	37	122,655			
G S I クレオス	9.6	10.1	20,765			
明和産業	21.2	22.2	14,541			
クワザワホールディングス	2.9	1.5	975			
ワキタ	29.7	31.1	53,896			
東邦ホールディングス	49.6	50.8	246,634			
サンゲツ	41.2	43.3	124,141			
ミツウロコグループホールディングス	22.9	24	43,560			
シナネンホールディングス	5	5.2	33,384			
伊藤忠エネクス	44.4	46.6	74,839			
サンリオ	145.8	152.7	647,448			
サンワテクノス	9.2	9.6	19,152			
新光商事	24.1	25.3	23,782			
トーヨー	7	7.3	20,775			
三信電気	7.2	7.6	15,648			
東陽テクニカ	18.2	17.3	28,545			
モスフードサービス	26.4	27.7	101,659			
加賀電子	16.4	34.4	98,280			
ソーダニッカ	15.1	19.9	24,178			
立花エレテック	11.9	12.5	32,987			
フォーバル	7	7.4	10,419			
PAL TAC	24.2	25.1	112,774			
三谷産業	31.4	32.9	10,889			

銘柄	第221期末			第227期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
西本Wismettacホールディングス	4.5	11.5	16,284			
ヤマシタヘルスケアホールディングス	0.7	0.3	842			
コーア商事ホールディングス	12.6	13.9	8,965			
K P Pグループホールディングス	46.4	48.7	34,528			
ヤマタネ	7.9	8.3	26,767			
丸紅建材リース	0.6	0.3	875			
泉州電業	8.3	13	65,000			
トラスコ中山	37.6	39.5	97,486			
オートボックスセブン	62.4	65.4	96,759			
モリト	12.8	15	21,360			
加藤産業	22.2	23.3	101,355			
北恵	2.1	1	949			
イエローハット	28.5	29.9	77,740			
J Kホールディングス	13.8	14.5	15,239			
日伝	12.1	12.3	43,296			
北沢産業	4.9	2.5	872			
杉本商事	8.7	18.2	28,574			
因幡電機産業	46.4	48.7	188,225			
東テック	18	18.8	52,395			
ミスミグループ本社	270.5	284	755,440			
アルテック	4.3	2.2	499			
タキヒヨー	1.9	0.9	1,152			
蔵王産業	1.4	0.7	1,765			
スズケン	68.2	67.2	352,598			
ジェコス	10.7	11.2	10,214			
<b>小売業(4.5%)</b>						
ローソン	38.1	—	—			
サンエー	13.8	28.8	81,216			
カワチ薬品	14.2	14.8	39,397			
エービーシー・マート	78.5	82.4	250,578			
ハードオフコーポレーション	6.6	8.5	17,552			
アスクル	43.4	45.6	91,701			
ゲオホールディングス	20.3	21.3	34,676			
アダストリア	21.7	22.8	87,210			
くら寿司	21.1	22.1	85,748			
キャンドゥ	6.5	6.8	23,766			
I Kホールディングス	3.8	2.2	831			
バルグループホールディングス	35.3	37	90,539			
エディオン	71.2	74.6	136,368			
サーラコーポレーション	38.1	39.9	34,353			
ワッツ	4.4	2.2	1,694			
ハローズ	8.2	8.6	38,399			
あみやき亭	4.4	13.8	24,991			
大黒天物産	5.5	5.8	61,944			
ハニーズホールディングス	16.1	16.9	29,777			
ファーマライズホールディングス	2.4	1.5	955			

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アルペン	15	15.7	33,519	
ハブ	3.1	1.7	1,309	
クオールホールディングス	24.9	26.1	38,471	
ジンズホールディングス	10.7	14.4	74,592	
ビックカメラ	95.6	112.7	179,418	
DCMホールディングス	94.9	97.6	150,401	
Monotaro	254.2	266.6	632,375	
東京一番フーズ	2.6	1.8	909	
きちりホールディングス	2.2	1.1	985	
J. フロント リテイリング	205.8	216	358,776	
ドール・日レスホールディングス	32	33.5	76,916	
マツキヨココカラ&カンパニー	326.1	342.1	801,882	
ブロンコビルー	10.6	11.1	43,068	
ZOZO	114.3	119.9	627,436	
トレジャー・ファクトリー	10.1	13.2	21,753	
物語コーポレーション	30	31.5	123,637	
三越伊勢丹ホールディングス	301.9	311.4	771,026	
Hamee	7.5	7.9	8,468	
マーケットエンタープライズ	1.1	0.7	676	
ウエルシアホールディングス	93.1	97.7	202,092	
クリエイトSDホールディングス	25.5	26.8	86,832	
丸善CHIホールディングス	10.6	5.8	1,919	
ミサワ	2.3	1.4	928	
ティーライフ	1.4	0.8	930	
チムニー	2.4	1.2	1,569	
シュッピン	16.5	17.3	21,503	
オイシックス・ラ・大地	24.4	25.5	35,139	
ネクステージ	41.1	43.2	76,852	
ジョイフル本田	52.3	52.3	107,581	
エターナルホスピタリティグループ	6.7	7.1	28,790	
ホットランド	13.9	14.6	34,295	
すかいらーくホールディングス	245.1	257.1	598,014	
SFPホールディングス	9.8	9.1	17,981	
綿半ホールディングス	14.1	14.8	26,077	
ヨシックスホールディングス	3.8	4.9	17,346	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	50.4	52.9	45,705	
ゴルフダイジェスト・オンライン	8.7	—	—	
BEENOS	7.5	11.3	33,515	
あさひ	16.9	17.7	29,966	
日本調剤	12.4	12.7	19,113	
コスモス薬品	15.2	31.9	238,293	
トーエル	4	2.2	1,823	
セブン&アイ・ホールディングス	1,836.2	1,903.6	4,229,799	
クリエイトレストランツホールディングス	121.3	127.3	143,339	
ツルハホールディングス	37.7	39.5	364,190	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
サンマルクホールディングス	14.6	15.3	34,654	
フェリシモ	2.2	1.3	1,175	
トリドールホールディングス	50.3	52.8	205,128	
TOKYO BASE	21.6	21.6	5,097	
ウイールプラスホールディングス	2	1.1	1,251	
JMホールディングス	13.7	14.3	45,331	
サツドラホールディングス	3.7	2	1,596	
アレンザホールディングス	13.8	14.4	16,171	
串カツ田中ホールディングス	5	5.9	9,339	
パロックジャパンリミテッド	14.5	15.1	11,596	
クスリのアオキホールディングス	54	63	218,736	
力の源ホールディングス	9.2	12.1	14,725	
FOOD & LIFE COMPANIES	95.7	100.4	296,531	
メディカルシステムネットワーク	20	21.2	9,752	
はるやまホールディングス	4.4	2.5	1,425	
ノジマ	52.2	54.7	109,400	
カッパ・クリエイト	28.2	29.5	49,796	
ライトオン	6	3	933	
良品計画	195.7	224	624,512	
バリミキホールディングス	10.9	5.9	2,035	
アドヴァングループ	17.4	16.5	15,361	
アルビス	6	6.3	17,621	
コナカ	8.7	4.8	1,147	
ハウス オブ ローゼ	1.2	0.7	1,051	
G-7ホールディングス	19.8	20.7	35,252	
イオン北海道	53.1	55.7	50,464	
コジマ	30.1	36.6	36,014	
ヒマラヤ	2.9	1.8	1,584	
コーナン商事	22.1	23.1	86,509	
エコス	6.8	7.1	15,328	
ワタミ	18.9	19.9	17,810	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	361.8	379.8	1,461,470	
西松屋チェーン	35.4	37.1	91,340	
ゼンショーホールディングス	91.3	95.8	758,161	
幸楽苑	13.3	13.9	17,680	
ハークスレイ	3.2	1.7	1,324	
サイゼリヤ	26.6	27.9	165,447	
VTホールディングス	68.8	74.1	34,604	
魚力	6.4	6.7	16,535	
フジ・コーポレーション	8.7	9.1	19,082	
ユナイテッドアローズ	21.2	22.2	51,970	
ハイデイ日高	26.7	28	74,788	
京都きもの友禅ホールディングス	6.7	4.9	392	
コロワイド	77	96.6	164,413	
壺番屋	71.1	74.6	78,479	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
PLANT	2	1.1	1,640	
スギホールディングス	108.4	113.8	313,575	
薬王堂ホールディングス	8.9	9.3	22,878	
スクロール	27.1	28.4	28,314	
ヨンドシーホールディングス	17.2	18	33,714	
木曽路	27.3	28.6	68,325	
SRSホールディングス	29.9	31.3	38,029	
千趣会	33	38	11,856	
リテールパートナーズ	26.8	28.2	37,957	
上新電機	17.9	18.7	50,003	
日本瓦斯	95.1	99.5	231,387	
ロイヤルホールディングス	31.6	33.1	83,445	
いなげや	17.5	18.3	22,197	
チョダ	17.6	18.4	19,651	
ライフコーポレーション	18.8	19.7	73,087	
リンガーハット	23.1	24.2	53,433	
MrMaxHD	23.2	24.2	17,641	
AOKIホールディングス	38.7	40.6	50,100	
オークワ	25.9	27.1	24,390	
コメリ	27.7	29	106,430	
青山商事	38.5	40.5	56,295	
しまむら	42.1	44.2	367,434	
はせがわ	4.9	2.9	948	
高島屋	123.9	239.5	295,064	
松屋	30.5	31.9	28,295	
エイ・ツー・オー リテイリング	79.3	95.9	212,130	
近鉄百貨店	7.8	8.2	17,236	
丸井グループ	119	124.8	300,768	
アクシアル リテイリング	49.2	51.7	48,442	
イオン	607.3	637.3	2,510,962	
イズミ	31.8	33.3	117,948	
平和堂	30	31.4	73,256	
フジ	27.6	28.9	59,302	
ヤオコー	20.9	22.3	219,833	
ゼビオホールディングス	24.7	25.8	31,630	
ケーズホールディングス	120.6	126.5	193,418	
Olympicグループ	4.3	2.4	1,188	
日産東京販売ホールディングス	12.5	6.7	2,988	
シルバーライフ	3.9	5.5	4,411	
Genky DrugStores	7.9	16.6	58,598	
ナルミヤ・インターナショナル	1.6	0.9	1,149	
ブックオフグループホールディングス	10.7	13.9	19,362	
ギフトホールディングス	7.7	9.4	27,579	
アインホールディングス	24.7	26	141,674	
Genki Global Dining	10.2	10.7	48,203	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
ヤマダホールディングス	551.9	579	259,565	
アークランズ	53.5	56.1	97,445	
ニトリホールディングス	65.2	68.5	1,397,057	
グルメ杵屋	14.9	15.6	16,692	
愛眼	5.9	3	483	
ケーユーホールディングス	8.7	9.1	9,800	
吉野家ホールディングス	66.1	69.4	215,001	
松屋フーズホールディングス	8.5	8.9	58,117	
サガミホールディングス	27.1	28.4	47,797	
関西フードマーケット	12.4	—	—	
王将フードサービス	13.3	42	126,630	
ミニストップ	13.1	13.7	21,988	
アークス	33	34.6	89,579	
パローホールディングス	34.3	36	80,172	
ベルク	9	9.4	61,664	
大庄	8.9	11.6	12,377	
ファーストリテイリング	80.6	105.7	5,332,565	
サンドラッグ	60.5	63.5	267,843	
サックスパー ホールディングス	15.6	16.3	14,050	
ヤマザワ	2	1.1	1,320	
やまや	1.8	0.9	2,700	
ペルーナ	43.7	45.7	34,549	
<b>銀行業(7.5%)</b>				
いよぎんホールディングス	198.4	208.2	305,949	
しずおかフィナンシャルグループ	370.5	385.4	497,551	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	140.4	147.3	220,434	
楽天銀行	58	81.2	271,208	
京都フィナンシャルグループ	211.3	220.3	514,290	
島根銀行	2.1	1.1	556	
じもとホールディングス	6.5	3.3	963	
めぶきフィナンシャルグループ	773.7	810.9	476,728	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21.3	22.4	97,552	
九州フィナンシャルグループ	322.7	338.7	249,079	
ゆうちょ銀行	1,832.5	1,922.9	2,693,982	
富山第一銀行	52.9	55.5	61,494	
コンコディア・フィナンシャルグループ	894.8	930.9	754,308	
西日本フィナンシャルホールディングス	94.1	97.9	168,094	
三十三フィナンシャルグループ	14.9	15.6	26,988	
第四北越フィナンシャルグループ	26.2	55	137,885	
ひろぎんホールディングス	237.4	249.1	291,945	
おきなわフィナンシャルグループ	14.2	14.9	35,223	
十六フィナンシャルグループ	21.6	22.7	94,091	
北國フィナンシャルホールディングス	17.6	17.1	79,515	
プロクレアホールディングス	19.1	20	36,260	
あいちフィナンシャルグループ	25.7	35.9	87,237	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
あおぞら銀行	119.8	125.8	340,351	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,155.9	10,656.7	16,315,407	
りそなホールディングス	1,928.6	2,006.8	2,094,095	
三井住友トラストグループ	599	623.1	2,177,111	
三井住友フィナンシャルグループ	1,185.7	3,648.6	11,701,060	
千葉銀行	464.7	487.7	577,436	
群馬銀行	323.6	339.6	312,330	
武蔵野銀行	23.3	24.4	68,490	
千葉興業銀行	31.5	41.3	45,553	
筑波銀行	73.2	76.8	18,739	
七十七銀行	48.5	50.9	206,145	
秋田銀行	11.2	11.7	26,371	
山形銀行	18.5	19.4	19,943	
岩手銀行	10.5	11.1	26,318	
東邦銀行	131.9	138.4	37,644	
東北銀行	3.6	1.8	2,037	
ふくおかフィナンシャルグループ	145.2	152.4	569,214	
スルガ銀行	147	131	149,602	
八十二銀行	357.8	375.5	327,398	
山梨中央銀行	18.7	19.6	33,320	
大垣共立銀行	31.8	33.4	63,259	
福井銀行	14.9	15.6	30,326	
清水銀行	6.6	7	10,710	
富山銀行	1.2	0.6	979	
滋賀銀行	27.7	29.1	101,268	
南都銀行	25.1	26.3	82,845	
百五銀行	156.9	164.6	94,974	
紀陽銀行	59.7	62.6	113,306	
ほくほくフィナンシャルグループ	103.2	108.3	180,806	
山陰合同銀行	104.4	109.5	138,955	
鳥取銀行	2.6	1.3	1,684	
百十四銀行	16.4	17.2	44,823	
四国銀行	24.4	25.7	25,186	
阿波銀行	23.4	24.5	62,034	
大分銀行	10	10.5	34,492	
宮崎銀行	10	10.5	29,662	
佐賀銀行	9.8	10.2	22,236	
琉球銀行	35.5	37.2	37,944	
セブン銀行	522.7	548.5	164,824	
みずほフィナンシャルグループ	2,251	2,362	7,357,630	
高知銀行	2.5	1.3	1,059	
山口フィナンシャルグループ	163.5	171.6	274,817	
名古屋銀行	10.8	11.1	70,929	
北洋銀行	252.7	265.1	110,016	
大光銀行	2.4	1.2	1,639	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
愛媛銀行	22.5	23.6	26,078	
トマト銀行	2.7	1.3	1,484	
京葉銀行	68.7	72	51,336	
栃木銀行	83.3	87.4	24,472	
北日本銀行	5.4	5.7	14,250	
東和銀行	30.6	32.1	19,548	
福島銀行	7.8	3.9	971	
大東銀行	3.2	1.6	1,136	
トモニホールディングス	157.8	165.6	65,577	
フィデアホールディングス	17.2	18.1	26,552	
池田泉州ホールディングス	231.3	242.7	84,702	
<b>証券・商品先物取引業(0.8%)</b>				
F P G	56.5	62.4	147,888	
ジャパンインベストメントアドバイザー	27.2	28.4	30,700	
マーキュリアホールディングス	3.9	1.7	1,531	
S B I ホールディングス	244.4	281.1	953,772	
ジャフコ グループ	49.8	52.2	106,853	
大和証券グループ本社	1,291.9	1,355.6	1,437,613	
野村ホールディングス	2,804.5	2,942.8	2,422,807	
岡三証券グループ	146.5	153.7	101,288	
丸三証券	55.6	58.3	56,434	
東洋証券	44.5	46.6	22,041	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	198.2	207.9	104,573	
光世証券	1.8	1	442	
水戸証券	49.5	48.1	24,194	
いちよし証券	31.4	32.8	23,156	
松井証券	82.2	86.2	68,960	
マネックスグループ	163.5	171.5	108,388	
極東証券	22.9	24	35,616	
岩井コスモホールディングス	19.1	20	41,900	
アイザワ証券グループ	24.2	25.3	47,412	
マネーパートナーズグループ	8.1	4.1	906	
スパークス・グループ	18.6	19.5	26,734	
<b>保険業(3.2%)</b>				
かんぽ生命保険	169.8	178.2	483,011	
F P パートナー	3.3	7.7	21,652	
S O M P O ホールディングス	752.7	789.7	2,647,074	
アニコム ホールディングス	56.6	59.4	40,213	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1,120.2	1,175.3	4,139,406	
第一生命ホールディングス	814.8	822.8	3,268,984	
東京海上ホールディングス	1,648.4	1,708.5	9,904,174	
T & D ホールディングス	447.8	469.9	1,239,596	
アドバンスクリエイト	9.6	13.6	11,818	
<b>その他金融業(1.2%)</b>				
N E X Y Z . G r o u p	2.8	2	1,752	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
全国保証	43.7	45.9	261,079	
あんしん保証	5.1	4.3	778	
イントラスト	3.4	2.2	1,658	
日本モーゲージサービス	5	3.4	1,465	
C a s a	3.5	2.1	1,793	
S B I アルヒ	16.5	17.5	14,420	
プレミアグループ	28.4	29.9	64,285	
ネットプロテクションズホールディングス	57.6	60.4	23,495	
クレディセゾン	105.8	111.1	410,958	
芙蓉総合リース	15.4	16.2	182,169	
みずほリース	140	147.2	148,819	
東京センチュリー	124.9	131.1	218,674	
日本証券金融	61.6	64.7	139,169	
アイフル	246.7	259.5	85,375	
リコーリース	15.9	16.7	84,168	
イオンフィナンシャルサービス	96.1	101	129,936	
アコム	298.8	314	120,419	
ジャックス	17.9	18.8	73,978	
オリエントコーポレーション	54.9	57.8	55,199	
オリックス	1,000.2	1,049.6	3,568,640	
三菱HCキャピタル	743.5	780.3	802,538	
九州リースサービス	3.3	2.1	2,160	
日本取引所グループ	430.5	902.6	1,719,453	
イー・ギャランティ	27.4	29	42,688	
アサックス	3.9	2.4	1,780	
NECキャピタルソリューション	8.3	8.8	34,320	
<b>不動産業(1.9%)</b>				
r o b o t h o m e	50.1	52.6	7,469	
大東建託	61.1	64.1	1,102,840	
サムティホールディングス	—	34.3	97,755	
いちご	193.5	179.4	66,916	
日本駐車場開発	179.7	211.1	50,875	
スター・マイカ・ホールディングス	20.5	19.1	12,033	
S R E ホールディングス	7.3	7.7	31,108	
A D ワークスグループ	18.8	9.5	2,042	
ヒューリック	389.4	408.6	605,749	
野村不動産ホールディングス	93	97.6	386,593	
三重交通グループホールディングス	36.7	38.7	19,737	
サムティ	26.8	—	—	
ディア・ライフ	29.1	30.5	25,955	
地主	13	15.8	34,096	
プレサンスコーポレーション	26.8	23.5	46,929	
ハウスコム	1.8	1.2	1,312	
J P M C	10.2	10.6	12,264	
サンセイランディック	2.8	1.8	1,765	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
フージャースホールディングス	25.7	27	29,025	
オープンハウスグループ	61.2	64.2	363,564	
東急不動産ホールディングス	501.9	526.7	532,493	
飯田グループホールディングス	160.1	167.9	385,666	
イギリスランド	1.5	1	1,435	
ムゲンエステート	5.3	3.3	5,755	
A n d D o ホールディングス	10.1	10.6	11,299	
シーアールイー	9.7	8.2	10,725	
ケイアイスター不動産	8.2	8.6	35,432	
グッドコムアセット	16.3	15	13,770	
ジェイ・エス・ビー	8.5	7.5	21,795	
ロードスターキャピタル	11.1	10.2	24,612	
イノベーションホールディングス	2.9	1.8	1,729	
フェイスネットワーク	2.4	1.4	2,382	
霞ヶ関キャピタル	4.6	7.2	127,584	
パーク24	108.7	136.7	252,143	
パラカ	6.2	5.8	10,411	
三井不動産	2,313.9	2,427.9	3,411,199	
三菱地所	1,090.3	1,098.3	2,572,767	
平和不動産	27.2	28.6	120,978	
東京建物	146	153.1	377,544	
京阪神ビルディング	31.6	33.1	55,475	
住友不動産	241.3	253.2	1,233,337	
テーオーシー	30.7	32.2	20,479	
レオパレス21	166.9	175.1	101,733	
スターツコーポレーション	24.1	25.3	89,562	
フジ住宅	21.9	22.9	16,648	
空港施設	24.5	25.7	15,163	
明和地所	10.1	13.1	13,165	
ゴールドクレスト	13.9	14.5	49,010	
エスリード	8	8.4	41,790	
日神グループホールディングス	28	29.3	14,796	
日本エスコン	31.2	32.7	33,648	
M I R A R T H ホールディングス	76.6	91	47,229	
A V A N T I A	4.9	2.8	2,181	
イオンモール	86.8	91	194,649	
毎日コムネット	3.6	2.1	1,566	
ファースト住建	3.6	2.1	2,394	
カチタス	45.2	47.4	95,653	
トーセイ	28	29.4	72,382	
穴吹興産	2.1	1.2	2,439	
サンフロンティア不動産	25.1	26.3	48,260	
F J ネクストホールディングス	18	18.9	22,585	
インテリックス	1.8	0.9	688	
ランドビジネス	2.7	1.4	281	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
サンネクスタグループ	3.1	1.8		1,819
グランディハウス	13.5	17.5		10,167
日本空港ビルデング	59.1	62		336,474
<b>サービス業(4.8%)</b>				
明豊ファシリティワークス	4.2	2.2		1,958
L I F U L L	61.2	45.9		6,701
M I X I	37.5	39.3		110,668
ジェイエイシーリクルートメント	63.3	66.2		51,503
日本M&Aセンターホールディングス	277.6	291.3		188,675
メンバーズ	6.3	6.4		6,131
中広	1.9	0.9		453
UTグループ	22.5	23.9		65,008
アイティメディア	6.8	7.1		11,743
ケアネット	27.1	37.7		25,183
E・Jホールディングス	10.4	10.8		19,483
オープンアップグループ	52.4	55		110,385
コシダカホールディングス	52.4	54.9		54,021
アルトナー	3.4	1.7		3,087
パソナグループ	21.2	22.2		47,596
C D S	2.1	1.3		2,405
リンクアンドモチベーション	50.1	45.1		28,773
エス・エム・エス	61.1	64.1		141,853
サニーサイドアップグループ	3.1	1.6		915
パーソルホールディングス	1,773.2	1,860		490,482
リニカル	5.7	3		1,179
クックパッド	49.9	50.9		9,212
アイ・ケイ・ケイホールディングス	4.2	2.9		2,322
学情	9	9.4		16,544
スタジオアリス	8.8	9.2		18,869
エプコ	2.5	1.3		1,062
N J S	3.9	4.6		18,285
総合警備保障	291.1	305.3		314,153
カカクコム	115.1	118.6		296,855
アイロムグループ	7.2	7.4		20,616
セントケア・ホールディング	13	13.5		10,503
サイネックス	1.7	0.9		764
ルネサンス	13.8	14.4		15,897
ディップ	26.8	28		81,536
デジタルホールディングス	9.3	9.5		9,101
新日本科学	16	16.8		21,403
キャリアデザインセンター	1.8	0.8		1,392
エムスリー	344.1	361.1		610,981
ツカダ・グローバルホールディング	5	3.1		1,283
ウェルネット	7.4	3.7		2,771
ワールドホールディングス	8	7.3		14,760

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ディー・エヌ・エー	62.1	65		113,457
博報堂DYホールディングス	222.2	233.1		279,020
ぐるなび	33.4	34.5		11,178
タカミヤ	24.1	25.2		11,239
ファンコミュニケーションズ	25.1	26		10,738
ライク	6.7	6.9		10,101
A o b a - B B T	3.6	2		682
エスプール	50.9	58.3		19,297
WDBホールディングス	9	9.4		16,656
ティア	5.2	3		1,347
C D G	1.1	—		—
アドウェイズ	24.6	22.8		7,706
パリュウコマース	15.5	16.2		18,808
インフォマート	181.4	172.9		58,613
J Pホールディングス	45.1	47		33,323
エコナックホールディングス	8.7	4.8		552
C Lホールディングス	4.3	4.5		4,419
プレステージ・インターナショナル	81.9	85.7		60,675
プロトコーポレーション	—	19.5		30,673
アミューズ	10.8	11.3		15,966
ドリームインキュベータ	6.1	5.8		13,224
クイック	12.2	12.8		26,624
T A C	5.2	2.9		475
電通グループ	171.1	197.5		906,920
テイクアンドギヴ・ニーズ	—	9		8,451
イオンファンタジー	6.4	6.7		15,443
シーティーエス	22.4	22.8		19,790
H. U. グループホールディングス	51.1	53.5		146,188
アルプス技研	16.6	16		45,712
日本空調サービス	19	19.8		20,869
オリエンタルランド	921.2	966.6		3,659,547
ダスキン	38.8	39.9		161,874
明光ネットワークジャパン	21.5	22.4		15,456
ファルコホールディングス	8	8.2		20,229
ラウンドワン	164.2	172.5		191,820
リゾートトラスト	75.7	79.4		228,275
ビー・エム・エル	21.5	22.5		61,717
リソー教育	90.3	94.1		24,654
早稲田アカデミー	9.8	10.2		17,095
ユニー・エス・エス	390.8	409.9		569,761
東京個別指導学院	21.3	22.1		8,994
サイバーエージェント	384.9	403.8		409,049
楽天グループ	1,492.6	1,285.6		1,187,251
クリーグ・アンド・リバー社	8.9	9.3		13,382
SBIグローバルアセットマネジメント	34.4	36.1		21,696

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
テー・オー・ダブリュー	34.9	36.4	12,230	
山田コンサルティンググループ	7.7	8	17,792	
セントラルスポーツ	6.6	6.9	16,946	
フルキャストホールディングス	16.8	15.1	24,401	
エン・ジャパン	28.4	29.8	72,712	
リソルホールディングス	0.8	0.4	1,890	
テクノプロ・ホールディングス	102	106.1	309,016	
アトラグループ	2.3	1.5	204	
アイ・アールジャパンホールディングス	9.2	9.7	8,526	
KeepPer 技研	10.8	11.3	50,002	
ファーストロジック	2.3	1.5	1,194	
三機サービス	1.5	0.8	800	
Gunosy	14.1	14.7	11,774	
デザインワン・ジャパン	4	2.5	307	
イー・ガーディアン	6.8	8.8	15,919	
リブセンス	4.8	3	498	
ジャパンマテリアル	53.4	56	108,360	
ベクトル	21.6	22	20,614	
ウチヤマホールディングス	4	2.2	723	
チャーム・ケア・コーポレーション	14.7	15.3	20,624	
キャリアリンク	6.5	6.8	16,904	
I B J	13.8	14.2	10,082	
アサンテ	8.8	9.1	15,087	
バリューHR	15.4	16.5	29,172	
M&Aキャピタルパートナーズ	14.2	14.9	35,253	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7.2	7.4	7,451	
ERIホールディングス	2.3	1.2	2,365	
アピスト	1.3	0.7	2,205	
シグマクシス・ホールディングス	23.6	24	41,184	
ウィルグループ	14.8	15.5	15,469	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	11.3	6	888	
メドピア	15.7	14.9	8,940	
レアジョブ	1.8	1.2	483	
リクルートホールディングス	1,288.7	1,315.4	12,416,060	
エラン	23.3	24.4	24,229	
土木管理総合試験所	4.5	2.4	758	
日本郵政	2,045.6	1,909.4	2,703,710	
ベルシステム24ホールディングス	18.9	19.7	30,062	
鎌倉新書	15.2	16	8,800	
SMN	2.2	1.4	396	
グローバルキッズCOMPANY	1.9	1	673	
エアトリ	12.9	13.5	15,930	
アトラエ	10.9	13.5	11,353	
ストライク	7.4	9	40,050	
ソラスト	48.5	50.7	27,682	

銘柄	第221期末		第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
セラク		5.6	5.7	8,219
インソース		38.1	39.8	41,750
ベイカレント		128	134.3	722,265
Orchestra Holdings		4	4.2	3,641
アイモバイル		22.8	23.6	13,216
ディ斯拉ブターズ		4	2.3	423
MS-Japan		6.6	8.5	8,704
船場		1.8	1	1,288
ジャパンエレベーター サービスホールディングス		56.5	59.2	183,520
フルテック		1.4	0.7	826
GameWith		3.9	2.4	648
MS&Consulting		1.5	0.8	404
エル・ティー・エス		2.1	2.5	4,930
ミダックホールディングス		10.7	11.2	20,160
キュービネットホールディングス		10.2	10.6	11,660
オーブングループ		24.6	25.7	5,294
スプリックス		2.6	1.4	1,129
マネジメントソリューションズ		7.6	9.1	16,598
プロレド・パートナーズ		4.9	4.8	2,438
テノ・ホールディングス		1.5	0.9	442
フロンティア・マネジメント		4.5	5.6	7,179
コプロ・ホールディングス		2.7	1.4	2,062
ギークス		1.6	0.9	375
アンビスホールディングス		18.7	39.2	79,693
カープスホールディングス		47.9	50.1	39,428
フォーラムエンジニアリング		24	25	22,850
Fast Fitness Japan		6.2	6.4	9,081
Macbee Planet		—	5.2	14,367
ダイレクトマーケティングミックス		18.8	22.9	5,702
ポピンズ		2.8	3.5	4,900
LITALICO		13.7	14.4	18,115
コンフィデンス・インターワークス		0.8	0.4	688
アドバンテッジリスクマネジメント		4.6	2.3	1,237
リロググループ		87.4	91.6	180,726
東祥		12.5	13	9,269
ID&Eホールディングス		10.6	11.1	48,562
ビーウィズ		3.7	3.8	7,166
サンウェルズ		—	7.1	10,934
TREホールディングス		33.5	35.1	58,441
人・夢・技術グループ		6.7	7.6	13,224
NISSOホールディングス		15.4	16.1	12,896
大栄環境		31.7	33.2	102,090
日本管財ホールディングス		18.4	19.2	52,454
M&A総研ホールディングス		8.4	19.8	56,905
エイチ・アイ・エス		50.7	58.5	100,737

銘柄	第221期末	第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ラックランド	8	8.3	17,147
共立メンテナンス	54.8	57.4	145,422
イチネンホールディングス	18.6	19.5	37,147
建設技術研究所	9	9.4	44,650
スペース	11.6	13.4	16,240
燦ホールディングス	16.6	17	20,502
スバル興業	5.5	7.1	22,755
東京テアトル	2.8	1.4	1,523
タナベコンサルティンググループ	6.3	8	10,216
ナガワ	5.5	5.7	42,465
東京都競馬	14.6	13.4	60,166
カナモト	27.1	28.4	84,461
ニシオホールディングス	16.3	15.1	61,608
トランス・コスモス	21.7	20.5	72,775
乃村工藝社	76.2	79.9	66,317
藤田観光	7	8.1	73,791
KNT-CTホールディングス	10.4	10.9	14,660
トーカイ	15.5	16.2	35,461
セコム	177.3	372	1,985,364
セントラル警備保障	9.5	9.9	28,710
丹青社	34.1	35.6	29,761
メイテックグループホールディングス	62.8	62.2	199,848
応用地質	16.4	17.1	46,939

銘柄	第221期末	第227期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
船井総研ホールディングス	36.3	36.6	90,951
進学会ホールディングス	3.1	1.8	406
オオバ	5.5	2.8	2,940
いであ	2.2	1.1	2,726
学究社	7.1	7.4	14,356
イオンディライト	18.8	19.6	78,694
ナック	15.3	15.8	8,832
ダイセキ	35.6	37.3	134,093
ステップ	6.5	6.7	13,802
合計	株数・金額 272,477	329,583	684,807,270
	銘柄数<比率>	2,070	2,051 <98.3%>

(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です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	第227期末	
	買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
国内 T O P I X	11,779	—