

## 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2008年1月9日から無期限です。	
運用方針	主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、安定したインカムゲインの確保と投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。	
主要運用対象	SBI資産設計オープン(分配型)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式インデックスマザーファンド	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	J-REITインデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	グローバルREITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	SBI資産設計オープン(分配型)	株式への直接投資は行いません。外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の65%以下とします。
	国内債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
	国内株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	J-REITインデックスマザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	グローバルREITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	原則として、年6回(1月、3月、5月、7月、9月、11月の10日(休業日の場合は翌営業日))決算を行い、安定した分配を目指します。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。	
	年2回(1月、7月)の決算時には、売買益を配当等収益に加算して分配(ボーナス分配)することを目指します。	
	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。	
	売買益が確保できた場合でも、基準価額水準、市況動向等を勘案して、ボーナス分配を行わないことがあります。	

# SBI資産設計オープン (分配型) (愛称:スゴ6)

## 運用報告書(全体版)

第89期(決算日 2023年1月10日)  
第90期(決算日 2023年3月10日)  
第91期(決算日 2023年5月10日)

## 受益者のみなさまへ

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

## 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

**【本運用報告書の記載について】**

- ・ 基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 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	基準価額			参考指数		株式組比	株式先物比率	債券組比	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率						
第27	第77期(2021年 1月12日)	円 10,597	円 25	% 4.4	16,232	4.2	% 42.8	% 0.9	% 35.5	% 0.3	% 18.1	百万円 111
	第78期(2021年 3月10日)	10,966	25	3.7	16,847	3.8	42.9	0.9	34.6	0.2	19.3	115
	第79期(2021年 5月10日)	11,443	25	4.6	17,544	4.1	42.3	1.0	33.9	0.2	20.6	118
	第80期(2021年 7月12日)	11,214	525	2.6	18,005	2.6	40.5	1.0	34.9	0.2	21.4	116
第28	第81期(2021年 9月10日)	11,395	25	1.8	18,348	1.9	41.5	0.9	34.5	0.2	21.1	123
	第82期(2021年11月10日)	11,514	25	1.3	18,552	1.1	41.2	1.0	34.7	0.2	21.1	153
第29	第83期(2022年 1月11日)	10,967	525	△0.2	18,478	△0.4	40.3	1.0	36.1	0.3	19.9	146
	第84期(2022年 3月10日)	10,389	25	△5.0	17,580	△4.9	39.2	1.0	37.3	0.2	20.5	139
	第85期(2022年 5月10日)	10,607	25	2.3	17,999	2.4	39.5	1.2	36.0	0.2	20.4	128
第30	第86期(2022年 7月11日)	10,587	175	1.5	18,218	1.2	40.2	1.2	36.2	0.1	20.4	130
	第87期(2022年 9月12日)	10,989	25	4.0	18,930	3.9	40.9	1.1	35.2	0.2	20.9	137
	第88期(2022年11月10日)	10,619	25	△3.1	18,363	△3.0	40.8	1.1	35.9	0.2	20.1	133
	第89期(2023年 1月10日)	10,200	25	△3.7	17,708	△3.6	40.5	0.9	36.1	0.2	20.0	127
第31	第90期(2023年 3月10日)	10,483	25	3.0	18,247	3.0	41.9	0.9	35.5	0.1	19.7	131
	第91期(2023年 5月10日)	10,756	25	2.8	18,699	2.5	42.0	1.2	34.9	0.1	19.5	134

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」には「REIT先物比率」を含みます。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率-売建比率」で算出しております。

## 当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	年 月 日	基準価額		参考指数		株式組比	株式先物比率	債券組比	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率					
第89期	(期首)2022年11月10日	円 10,619	% -	18,363	% -	% 40.8	% 1.1	% 35.9	% 0.2	% 20.1
	11月末	10,673	0.5	18,434	0.4	41.2	1.2	35.4	0.2	20.2
	12月末	10,196	△4.0	17,673	△3.8	41.0	1.1	35.8	0.3	20.1
	(期末)2023年 1月10日	10,225	△3.7	17,708	△3.6	40.5	0.9	36.1	0.2	20.0
第90期	(期首)2023年 1月10日	10,200	-	17,708	-	40.5	0.9	36.1	0.2	20.0
	1月末	10,391	1.9	18,027	1.8	41.8	0.9	35.3	0.3	20.1
	2月末	10,553	3.5	18,298	3.3	41.9	1.0	35.2	0.3	20.1
	(期末)2023年 3月10日	10,508	3.0	18,247	3.0	41.9	0.9	35.5	0.1	19.7
第91期	(期首)2023年 3月10日	10,483	-	18,247	-	41.9	0.9	35.5	0.1	19.7
	3月末	10,497	0.1	18,177	△0.4	41.6	1.4	35.9	0.1	19.1
	4月末	10,708	2.1	18,578	1.8	42.1	1.2	35.4	0.1	19.5
	(期末)2023年 5月10日	10,781	2.8	18,699	2.5	42.0	1.2	34.9	0.1	19.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」には「REIT先物比率」を含みます。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率-売建比率」で算出しております。

参考指数は、NOMURA-BPI総合20%、TOPIX(東証株価指数)20%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)20%、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)20%、東証REIT指数(配当込み)10%およびS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)10%を当社で独自に合成した指数で、設定日を10,000として指数化しております。

#### **NOMURA-BPI総合**

NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

#### **TOPIX(東証株価指数)**

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

#### **FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)**

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

#### **MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)**

MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。

#### **東証REIT指数(配当込み)**

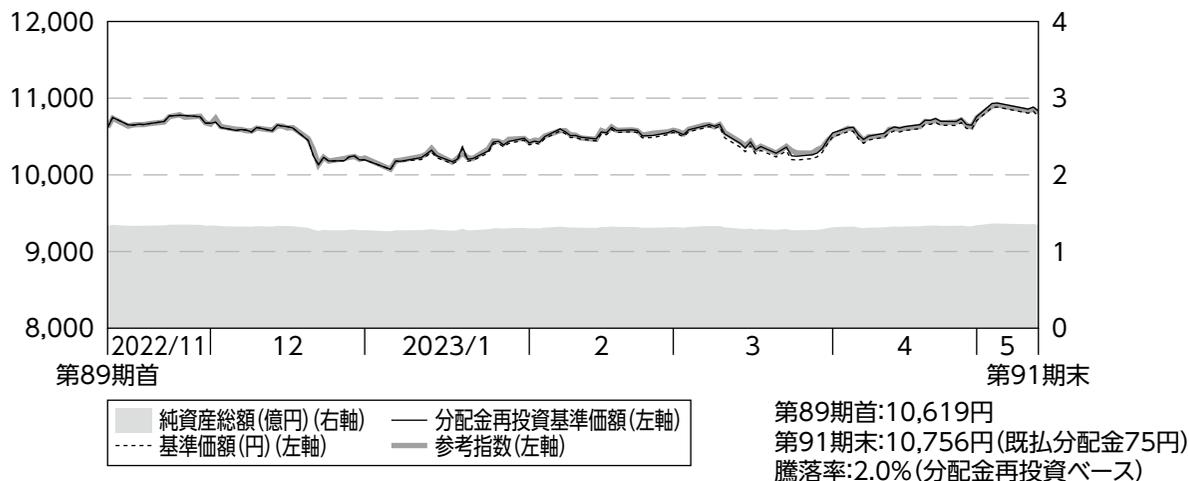
「東証REIT指数」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

#### S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」)とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。当インデックスは、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's<sup>®</sup>及びS&P<sup>®</sup>は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones<sup>®</sup>はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。

## 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及び参考指数は、2022年11月10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は上昇しました。

日銀の金融政策修正の動きなどを受けて円高が進行したことがマイナスに影響しました。一方で、米国を中心にインフレ指標の伸びが鈍化傾向となり、先進国の利上げペースの減速が意識されたことや、国内では植田新総裁が就任した日銀が緩和的な姿勢を示したことから、国内と先進国の株式が上昇し、基準価額にプラスに寄与しました。

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
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	20.0%	16.2%	0.8%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	20.0%	22.0%	9.3%
外国債券インデックス マザーファンド	外国債券	20.0%	19.6%	△1.2%
外国株式インデックス マザーファンド	外国株式	20.0%	21.3%	4.5%
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT	10.0%	9.9%	△2.2%
グローバルREITインデックス マザーファンド	海外REIT	10.0%	9.5%	△1.5%

※REITとは、不動産投資信託証券のことをいいます。本報告書では、同様の記載をすることがあります。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## 投資環境

### 国内債券市場

国内債券市場は上昇しました。日銀の長期金利の変動許容幅の拡大により利回りが上昇(価格は下落)しましたが、その後は追加的な変動許容幅の見直しが行われなかったことから、利回りが低下しました。

### 国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。当作成期前半は比較的狭いレンジでの推移が続いたものの、植田日銀総裁の就任会見で早期の金融政策の変更が否定されたことや、国内の経済再開やインバウンド需要の回復期待などを背景に上昇しました。

### 外国債券市場

外国債券市場は下落しました。主要国の国債利回りは低下(価格は上昇)しましたが、米ドルを中心に投資対象通貨が総じて円に対して下落したことから、円ベースでは下落しました。

### 外国株式市場

外国株式市場は上昇しました。米国を中心に物価上昇懸念が後退したことや、欧米の利上げペースの減速観測を背景に上昇しました。

### J-REIT市場

J-REIT市場は下落しました。米銀行の経営破綻や欧州金融機関の信用不安が報じられ、世界的なリスクオフの流れがJ-REIT市場にも波及したことで下落しました。ただし、当作成期後半は、日銀が緩和的な姿勢を示したことなどから反発し、下げ幅を縮小しました。

### 海外REIT市場

海外REIT市場は下落しました。各国利上げペースの減速観測や欧米の金融不安の後退を背景に上昇しましたが、米ドルや豪ドルが円に対して下落したことから、円ベースでは下落しました。

### ○当ファンド

国内外の株式・公社債・REITへ実質的に分散投資することにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行いました。各資産への配分は、概ね基本組入比率を維持する運用を行いました。

#### ・国内債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として、ベンチマークに合わせてデュレーション、債券種別や残存期間を調整しました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む国内債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ・国内株式インデックス マザーファンド

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

#### ・外国債券インデックス マザーファンド

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させた運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む外国債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ・外国株式インデックス マザーファンド

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(円ベース)に連動する投資成果を目標として、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけたポートフォリオを組成して運用を行いました。また、資金の流出入等に対応するため株価指数先物取引を利用し、先物を含む外国株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ・J-REITインデックス マザーファンド

主としてわが国の取引所に上場している不動産投資信託証券(J-REIT)に投資し、ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。また、取引コストに留意しながらベンチマークの構成比率に合わせたポートフォリオを組成し、先物を含めたREIT組入比率は期を通じて高位を維持しました。

#### ・グローバルREITインデックス マザーファンド

ベンチマークであるS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として、取引コストに留意しながらリバランスを実施し、REITを高位に組み入れ運用を行いました。ポートフォリオの構築に際しては、個別銘柄の構成比を極力ベンチマークに近づけることで連動を目指しました。

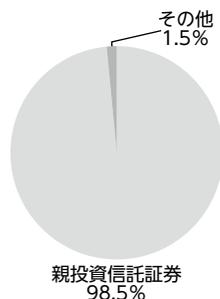
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

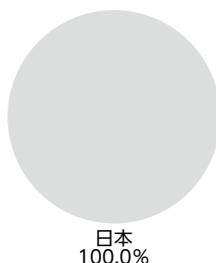
	当作成期末
	2023年5月10日
国内株式インデックス マザーファンド	22.0%
外国株式インデックス マザーファンド	21.3%
外国債券インデックス マザーファンド	19.6%
国内債券インデックス マザーファンド	16.2%
J-REITインデックス マザーファンド	9.9%
グローバルREITインデックス マザーファンド	9.5%
その他	1.5%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

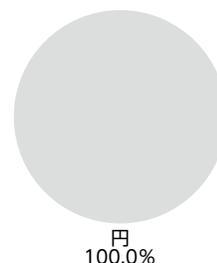
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

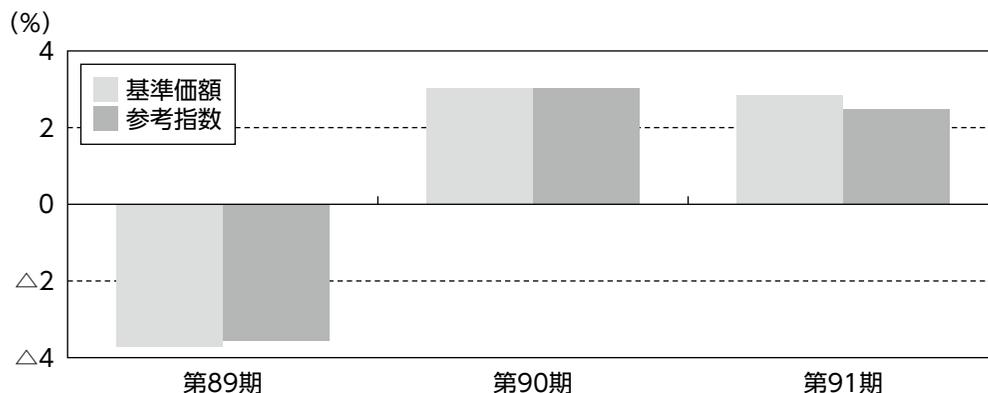


(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。  
 その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)と参考指数の騰落率の対比です。



## 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89期	第90期	第91期
	2022年11月11日～ 2023年1月10日	2023年1月11日～ 2023年3月10日	2023年3月11日～ 2023年5月10日
当期分配金 (円)	25	25	25
(対基準価額比率) (%)	(0.244)	(0.238)	(0.232)
当期の収益 (円)	20	25	25
当期の収益以外 (円)	4	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	2,144	2,151	2,180

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

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

(注3) —印は該当がないことを示します。

### ○当ファンド

主として、下記のマザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式および不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券への基本組入比率は国内債券インデックス マザーファンド受益証券20%、国内株式インデックス マザーファンド受益証券20%、外国債券インデックス マザーファンド受益証券20%、外国株式インデックス マザーファンド受益証券20%、J-REITインデックス マザーファンド受益証券10%、グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券10%とします。

#### ・国内債券インデックス マザーファンド

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・国内株式インデックス マザーファンド

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・外国債券インデックス マザーファンド

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・外国株式インデックス マザーファンド

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・J-REITインデックス マザーファンド

わが国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### ・グローバルREITインデックス マザーファンド

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

項目	当作成期		項目の概要
	(2022年11月11日~2023年5月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	39円	0.371%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,503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)	(22)	(0.207)	
(販売会社)	(15)	(0.142)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(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)	(0)	(0.000)	
(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)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(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)	(0)	(0.000)	
(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)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.010	(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)	(1)	(0.007)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	40	0.383	

(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

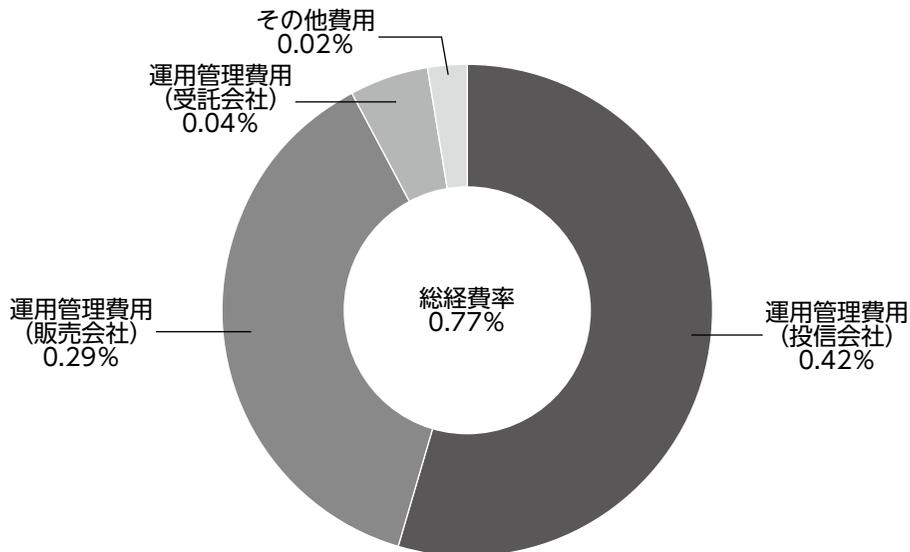
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## <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0.77%です。



(注1)各費用は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)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

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
J-REITインデックス マザーファンド	千口 29	千円 60	千口 34	千円 70
グローバルREITインデックス マザーファンド	24	60	28	70
国内株式インデックス マザーファンド	59	120	552	1,100
外国株式インデックス マザーファンド	27	120	117	530
国内債券インデックス マザーファンド	81	110	89	120
外国債券インデックス マザーファンド	39	120	46	140

## 株式売買比率

### ■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

#### <国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 作 成 期
(a) 当 作 成 期 中 の 株 式 売 買 金 額	29,144,859千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	512,210,148千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.05

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

#### <外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 作 成 期
(a) 当 作 成 期 中 の 株 式 売 買 金 額	38,474,352千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	513,343,855千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.07

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<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			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
コール・ローン	百万円 238	百万円 23	% 9.7	百万円 238	百万円 23	% 9.7

(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。

### <J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コール・ローン	百万円 332,070	百万円 30,204	% 9.1	百万円 332,063	百万円 29,954	% 9.0

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <グローバルREITインデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為替直物取引	百万円 7,803	百万円 —	% —	百万円 2,996	百万円 5	% 0.2
コール・ローン	10,296	879	8.5	10,402	892	8.6

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コール・ローン	百万円 278,436	百万円 24,777	% 8.9	百万円 278,436	百万円 24,656	% 8.9

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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。

## <外国株式インデックス マザーファンド>

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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 116,757	百万円 11,573	% 9.9	百万円 116,923	百万円 11,568	% 9.9

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <国内債券インデックス マザーファンド>

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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 103,634	百万円 10,235	% 9.9	百万円 104,543	百万円 10,322	% 9.9

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <外国債券インデックス マザーファンド>

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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 18,030	百万円 41	% 0.2	百万円 38,239	百万円 218	% 0.6
コール・ローン	362,875	30,228	8.3	364,505	30,278	8.3

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## ■利害関係人の発行する有価証券等

### <国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当 作 成 期		
	買 付 額	売 付 額	当 作 成 期 末 保 有 額
株 式	39百万円	53百万円	1,614百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当作成期末保有額は評価額です。

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

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

	前 作 成 期 末	当 作 成 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	6,348	6,343	13,319
グローバルREITインデックス マザーファンド	5,334	5,330	12,814
国内株式インデックス マザーファンド	14,524	14,031	29,685
外国株式インデックス マザーファンド	6,408	6,317	28,775
国内債券インデックス マザーファンド	15,985	15,977	21,828
外国債券インデックス マザーファンド	8,444	8,437	26,410

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

J-REITインデックス マザーファンド	64,158,978千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	36,588,385千口
国内株式インデックス マザーファンド	257,573,311千口
外国株式インデックス マザーファンド	122,146,081千口
国内債券インデックス マザーファンド	463,380,243千口
外国債券インデックス マザーファンド	91,294,971千口

### 投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
J-REITインデックス マザーファンド	13,319	9.8
グローバルREITインデックス マザーファンド	12,814	9.5
国内株式インデックス マザーファンド	29,685	21.9
外国株式インデックス マザーファンド	28,775	21.3
国内債券インデックス マザーファンド	21,828	16.1
外国債券インデックス マザーファンド	26,410	19.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,538	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	135,369	100.0

(注1)グローバルREITインデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(87,951,287千円)の投資信託財産総額(88,439,822千円)に対する比率は99.4%です。

(注2)外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(556,334,164千円)の投資信託財産総額(556,634,664千円)に対する比率は99.9%です。

(注3)外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(284,068,012千円)の投資信託財産総額(286,354,677千円)に対する比率は99.2%です。

(注4)外貨建資産は、当作成期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=135.15円

1ユーロ=148.23円

1スウェーデンクローナ=13.26円

1ポランドズロチ=32.566円

1香港ドル=17.24円

1韓国ウォン=0.1021円

1カナダドル=100.99円

1イギリスポンド=170.65円

1ノルウェークローネ=12.79円

1オーストラリアドル=91.40円

1シンガポールドル=101.88円

1オフショア人民元=19.5221円

1メキシコペソ=7.6142円

1スイスフラン=151.87円

1デンマーククローネ=19.91円

1ニュージーランドドル=85.63円

1マレーシアリンギット=30.3853円

1イスラエルシェケル=36.8581円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	第 89 期 末 2023年1月10日現在	第 90 期 末 2023年3月10日現在	第 91 期 末 2023年5月10日現在
(A) 資 産	128,427,033円	132,005,352円	135,369,687円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,032,305	1,961,364	2,035,034
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	13,107,034	12,968,196	13,319,766
グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	12,382,608	12,851,285	12,814,097
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	27,035,666	28,695,706	29,685,966
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	26,789,151	27,916,108	28,775,692
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	21,295,907	21,537,145	21,828,709
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	25,444,362	25,565,548	26,410,423
未 収 入	340,000	510,000	500,000
(B) 負 債	479,298	472,790	479,296
未 払 収 益 分 配 金	313,600	313,675	313,525
未 払 信 託 報 酬	164,501	157,976	164,576
未 払 利 息	2	2	4
そ の 他 未 払 費 用	1,195	1,137	1,191
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	127,947,735	131,532,562	134,890,391
元 本	125,440,000	125,470,000	125,410,000
次 期 繰 越 損 益 金	2,507,735	6,062,562	9,480,391
(D) 受 益 権 総 口 数	125,440,000口	125,470,000口	125,410,000口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	10,200円	10,483円	10,756円

### ■損益の状況

項 目	第 89 期 自 2022年11月11日 至 2023年 1月10日	第 90 期 自 2023年1月11日 至 2023年3月10日	第 91 期 自 2023年3月11日 至 2023年5月10日
(A) 配 当 等 収 益	△236円	△38円	△88円
受 取 利 息	1	1	1
支 払 利 息	△237	△39	△89
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,767,625	4,006,594	3,900,667
売 買 益	717	4,158,384	3,927,855
売 買 損	△4,768,342	△151,790	△27,188
(C) 信 託 報 酬 等	△165,696	△159,113	△165,767
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△4,933,557	3,847,443	3,734,812
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△412,767	△5,634,604	△2,099,012
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,167,659	8,163,398	8,158,116
(配 当 等 相 当 額)	(22,620,711)	(22,646,090)	(22,636,875)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△14,453,052)	(△14,482,692)	(△14,478,759)
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金 (D+E+F)	2,821,335	6,376,237	9,793,916
(H) 収 益 分 配 金	△313,600	△313,675	△313,525
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	2,507,735	6,062,562	9,480,391
追 加 信 託 差 損 益 金	8,167,659	8,163,398	8,158,116
(配 当 等 相 当 額)	(22,620,886)	(22,646,320)	(22,636,942)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△14,453,227)	(△14,482,922)	(△14,478,826)
分 配 準 備 積 立 金	4,281,841	4,342,700	4,708,005
繰 越 損 益 金	△9,941,765	△6,443,536	△3,385,730

(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89期首元本額は125,350,000円、第89～91期中追加設定元本額は770,000円、第89～91期中一部解約元本額は710,000円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 89 期	第 90 期	第 91 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	257,695円	392,790円	682,141円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	22,620,886円	22,646,320円	22,636,942円
(D) 分配準備積立金額	4,337,746円	4,263,585円	4,339,389円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	27,216,327円	27,302,695円	27,658,472円
(F) 期末残存口数	125,440,000口	125,470,000口	125,410,000口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	2,169円	2,176円	2,205円
(H) 分配金額(1万口当たり)	25円	25円	25円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	313,600円	313,675円	313,525円

## 分配金のお知らせ

	第89期	第90期	第91期
1万口当たり分配金	25円	25円	25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

該当事項はありません。

# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は、行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382.463	0.8	99.9	—	379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390.052	2.0	99.7	0.0	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388.127	△0.5	100.5	—	540,159
第21期(2021年5月31日)	14,082	△0.4	386.621	△0.4	99.8	—	628,366
第22期(2022年5月30日)	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8	0.1	624,929

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2021年 5月31日	14,082	—	386.621	—	99.8	—
6月末	14,091	0.1	386.903	0.1	100.0	—
7月末	14,160	0.6	388.809	0.6	99.8	—
8月末	14,149	0.5	388.461	0.5	99.7	—
9月末	14,101	0.1	387.116	0.1	99.9	—
10月末	14,086	0.0	386.721	0.0	99.8	—
11月末	14,120	0.3	387.655	0.3	99.9	—
12月末	14,088	0.0	386.841	0.1	99.8	—
2022年 1月末	13,989	△0.7	384.056	△0.7	99.8	—
2月末	13,919	△1.2	382.128	△1.2	99.7	—
3月末	13,880	△1.4	381.037	△1.4	99.9	—
4月末	13,845	△1.7	380.119	△1.7	99.9	—
(当期末) 2022年 5月30日	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8	0.1

(注1) 騰落率は期首比です。

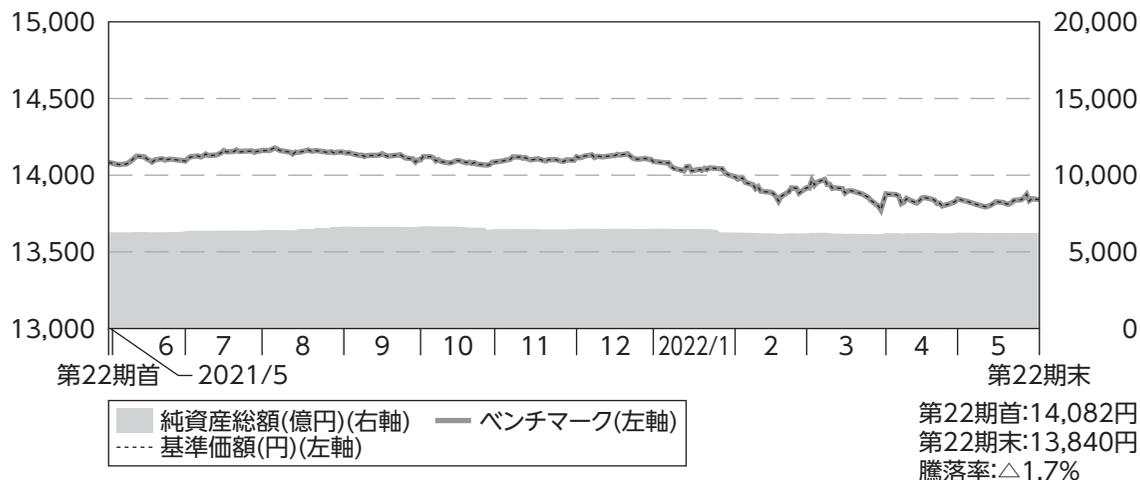
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

## 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2021年5月31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

2021年8月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に緊急事態宣言が発出されたことなどから国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬以降10月下旬にかけては、岸田新政権の経済対策による先行きの国債増発に対する警戒感が高まったことなどにより国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。11月以降12月中旬にかけては、主要国の中央銀行が利上げに慎重な姿勢を示した影響から国内金利が低下しましたが、米国で早期の利上げ観測が強まった影響から再び上昇し、基準価額はレンジ内推移となりました。12月下旬以降2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から国内金利が上昇し、基準価額は下落しました。2月下旬から3月上旬にかけて、ウクライナ情勢の深刻化によるリスク回避の動きから国内金利が低下し、基準価額は上昇しましたが、3月中旬以降は、インフレ指標の上昇を背景に欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて国内金利が上昇推移となったことから、再び下落しました。

## 投資環境



国内金利は、2021年8月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に低下しました。8月中旬以降10月下旬にかけては、先行きの国債増発に対する警戒感が高まったことなどにより、上昇しました。11月以降12月中旬にかけては、主要国の中央銀行が利上げに慎重な姿勢を示した影響から低下しましたが、米国で早期の利上げ観測が強まった影響から再び上昇しました。12月下旬以降2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から、上昇しました。2月下旬から3月上旬にかけてはリスク回避の動きから低下しましたが、3月中旬以降は、欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて上昇推移となりました。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、公社債の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

## 当ファンドの組入資産の内容

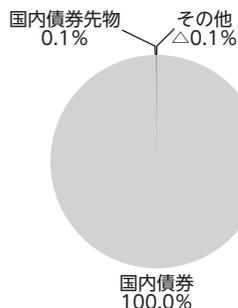
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第141回利付国債(5年)	日本	1.2%
2	第148回利付国債(5年)	日本	1.1%
3	第138回利付国債(5年)	日本	1.1%
4	第137回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第365回利付国債(10年)	日本	1.1%
6	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%

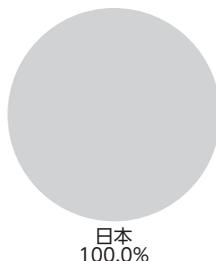
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%
9	第150回利付国債(5年)	日本	0.9%
10	第145回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数		992	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

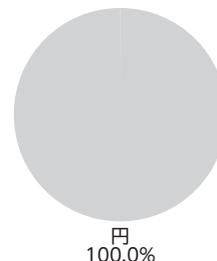
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

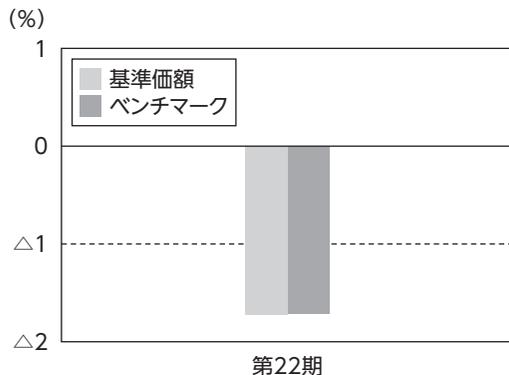


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.1%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

## 今後の運用方針

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	-  (-)  (-) (-)	-  (-)  (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(14,042円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	国 債 証 券	135,414,533	123,527,580
	地 方 債 証 券	5,665,813	5,654,159
	特 殊 債 券	9,608,254	10,670,914 (800,945)
	社債券(投資法人債券を含む)	5,921,474	3,618,993

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

### <先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	債券先物取引	百万円 21,148	百万円 20,546	百万円 -	百万円 -

(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			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
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 296,828	百万円 6,676	% 2.2	百万円 296,847	百万円 6,445	% 2.2

(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

## &lt;国内(邦貨建)公社債&gt;

## (A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	503,715,000 (-)	523,319,672 (-)	83.7 (-)	- (-)	54.5 (-)	20.2 (-)	9.0 (-)
地 方 債 証 券	32,361,680 (32,361,680)	33,511,126 (33,511,126)	5.4 (5.4)	- (-)	3.3 (3.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	33,652,796 (33,652,796)	34,709,232 (34,709,232)	5.6 (5.6)	- (-)	3.3 (3.3)	1.2 (1.2)	1.1 (1.1)
金 融 債 証 券	2,200,000 (2,200,000)	2,200,178 (2,200,178)	0.4 (0.4)	- (-)	- (-)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	30,126,000 (30,126,000)	30,041,507 (30,041,507)	4.8 (4.8)	- (-)	2.2 (2.2)	1.8 (1.8)	0.8 (0.8)
合 計	602,055,476 (98,340,476)	623,781,716 (100,462,043)	99.8 (16.1)	- (-)	63.3 (8.8)	24.8 (4.6)	11.7 (2.7)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ( )内は非上場債で内書きです。

(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

## (B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期			末
	利率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>				
第425回利付国債(2年)	0.005	2,750,000	2,752,750	2023/6/1
第426回利付国債(2年)	0.005	620,000	620,638	2023/7/1
第427回利付国債(2年)	0.005	3,260,000	3,263,618	2023/8/1
第428回利付国債(2年)	0.005	230,000	230,273	2023/9/1
第429回利付国債(2年)	0.005	950,000	951,140	2023/10/1
第430回利付国債(2年)	0.005	2,010,000	2,012,572	2023/11/1
第434回利付国債(2年)	0.005	1,915,000	1,917,681	2024/3/1
第435回利付国債(2年)	0.005	780,000	781,146	2024/4/1
第436回利付国債(2年)	0.005	720,000	721,036	2024/5/1
第136回利付国債(5年)	0.1	4,330,000	4,338,660	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	6,760,000	6,776,359	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	6,890,000	6,909,292	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	5,590,000	5,607,105	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	4,660,000	4,675,797	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	7,750,000	7,778,597	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	4,370,000	4,387,873	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	4,910,000	4,931,358	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	6,310,000	6,338,899	2025/6/20

銘 柄 名	当 期			末
	利率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
第145回利付国債(5年)	0.1	5,750,000	5,777,600	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	3,150,000	3,165,687	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	4,170,000	4,175,546	2026/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	6,950,000	6,958,409	2026/6/20
第149回利付国債(5年)	0.005	5,130,000	5,135,489	2026/9/20
第150回利付国債(5年)	0.005	5,880,000	5,883,998	2026/12/20
第151回利付国債(5年)	0.005	1,620,000	1,620,388	2027/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	535,164	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,459,813	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	715,363	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	950,000	1,239,569	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,070,000	1,345,500	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,558,229	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,240,000	1,472,524	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,230,000	1,361,610	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	2,050,000	1,688,072	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,100,000	2,024,862	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,635,000	1,524,670	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,290,000	1,081,561	2059/3/20

当 期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第13回利付国債(40年)	0.5	2,140,000	1,785,252	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	2,130,000	1,898,277	2061/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	4,410,000	4,451,409	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	3,910,000	3,955,238	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	908,064	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	4,800,000	4,850,832	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	3,030,000	3,066,632	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	4,260,000	4,318,276	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,310,000	2,339,868	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	1,110,000	1,125,906	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,800,000	2,825,788	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	4,560,000	4,618,231	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	4,750,000	4,815,360	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	4,830,000	4,901,145	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	5,340,000	5,404,614	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	4,760,000	4,783,514	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,683,536	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	5,900,000	5,930,503	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	3,780,000	3,798,937	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	5,750,000	5,777,600	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,850,000	3,867,479	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,340,000	4,359,530	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	5,000,000	5,020,800	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	6,630,000	6,653,006	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	4,940,000	4,953,387	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	4,510,000	4,518,478	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,915,000	4,921,389	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	4,790,000	4,793,209	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	3,710,000	3,708,664	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	4,080,000	4,074,084	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,770,000	2,763,767	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	3,560,000	3,548,999	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	3,420,000	3,406,388	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	4,890,000	4,863,936	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	3,940,000	3,915,059	2030/12/20
第362回利付国債(10年)	0.1	3,790,000	3,762,067	2031/3/20
第363回利付国債(10年)	0.1	5,460,000	5,411,406	2031/6/20
第364回利付国債(10年)	0.1	5,110,000	5,058,644	2031/9/20
第365回利付国債(10年)	0.1	6,770,000	6,693,905	2031/12/20
第366回利付国債(10年)	0.2	810,000	807,667	2032/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	131,447	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	187,852	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	140,485	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	135,254	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	58,915	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	350,000	421,592	2031/11/20

当 期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	216,419	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	350,000	404,985	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	267,832	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	173,665	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	260,000	299,267	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	227,525	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	400,000	475,416	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	800,000	989,248	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	425,537	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	200,000	250,882	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	1,150,000	1,432,681	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	345,000	426,651	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	530,000	656,972	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	608,505	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	622,155	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	540,000	687,879	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	548,697	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	780,000	998,283	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	439,054	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	1,140,000	1,448,506	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	1,920,000	2,476,550	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	2,090,000	2,704,146	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	2,141,942	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,770,000	2,248,147	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,382,447	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,360,000	1,733,265	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,820,000	2,231,083	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,795,000	2,264,948	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,300,000	2,825,343	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	2,130,000	2,620,688	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,225,000	2,699,703	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,410,000	1,685,514	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,480,000	1,799,295	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,380,000	1,650,742	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	1,150,000	1,353,975	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,120,000	1,319,371	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,340,000	1,579,404	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,210,000	1,426,928	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,410,000	1,638,864	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,650,000	1,878,162	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,560,000	1,808,196	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,710,000	1,909,659	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,700,000	1,898,407	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	1,590,000	1,569,584	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,710,000	1,499,704	2046/6/20
第52回利付国債(30年)	0.5	1,680,000	1,541,349	2046/9/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第53回利付国債(30年)	0.6	1,320,000	1,237,856	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	1,680,000	1,645,929	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,440,000	1,409,112	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,480,000	1,445,012	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,410,000	1,373,565	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	2,350,000	2,284,035	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	1,410,000	1,334,973	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	1,530,000	1,515,480	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,460,000	1,373,845	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	480,000	427,910	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,260,000	1,089,736	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	1,830,000	1,579,235	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	1,555,000	1,343,271	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	1,030,000	888,787	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,865,000	1,692,282	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,490,000	1,351,057	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	1,340,000	1,247,928	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	1,740,000	1,617,834	2051/3/20
第71回利付国債(30年)	0.7	1,430,000	1,327,426	2051/6/20
第72回利付国債(30年)	0.7	1,070,000	991,622	2051/9/20
第73回利付国債(30年)	0.7	1,870,000	1,732,124	2051/12/20
第74回利付国債(30年)	1.0	720,000	720,000	2052/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	323,004	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	203,990	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	328,307	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	226,787	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	339,665	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	134,621	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	197,784	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	405,272	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	420,284	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	209,320	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	661,430	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	378,936	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	211,032	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	137,863	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	284,814	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	306,727	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	180,140	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	286,931	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	234,469	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	416,410	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	642,618	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	312,100	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	504,140	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	313,516	2026/3/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第86回利付国債(20年)	2.3	510,000	555,237	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,830,000	1,985,348	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	459,631	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	381,608	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	690,284	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	495,000	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	964,629	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	449,380	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	671,518	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	680,570	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,757,888	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	446,344	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	488,642	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,290,000	1,438,517	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	540,019	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	812,683	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,438,731	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	454,328	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	179,798	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,330,827	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	430,958	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	294,348	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	738,579	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	583,830	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,249,908	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,112,696	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	900,679	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	2,020,000	2,311,364	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,675,445	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	809,025	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,728,236	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,244,343	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	757,772	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	600,071	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,752,559	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,714,665	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,066,815	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,870,000	2,175,277	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	704,434	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,770,000	2,081,626	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	845,858	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,173,040	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,118,148	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	740,000	846,426	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,285,000	1,473,522	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,137,570	2031/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第132回利付国債(20年)	1.7	1,160,000	1,321,912	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,230,000	1,413,208	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	830,000	955,836	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	1,030,000	1,176,270	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,450,000	1,642,009	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,060,000	1,212,534	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	620,000	697,035	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	830,000	941,278	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	2,420,000	2,772,569	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	1,600,000	1,835,760	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	980,000	1,134,467	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,920,000	2,185,728	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,150,000	1,297,108	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	2,675,000	3,079,005	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,700,000	3,113,370	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,380,000	2,721,006	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,000,000	2,265,820	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	2,600,000	2,947,542	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	2,730,000	3,064,588	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	2,255,000	2,478,087	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	2,860,000	3,144,398	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,440,000	2,714,134	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,790,000	3,068,107	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,800,000	3,006,360	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,620,000	2,601,267	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,950,000	2,843,092	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,530,000	2,538,450	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,400,000	2,437,512	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	1,890,000	1,943,430	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,990,000	2,015,034	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	630,000	636,690	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	1,980,000	1,997,047	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,320,000	1,309,440	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	2,150,000	2,127,855	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	1,620,000	1,650,180	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,150,000	2,119,212	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	1,410,000	1,363,822	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	1,990,000	1,887,395	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,390,000	2,259,864	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,670,000	1,574,158	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	2,470,000	2,362,036	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	2,350,000	2,240,584	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	2,480,000	2,359,248	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	1,960,000	1,892,497	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	2,850,000	2,743,866	2041/3/20
第177回利付国債(20年)	0.4	2,390,000	2,254,271	2041/6/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第178回利付国債(20年)	0.5	1,690,000	1,620,101	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	3,015,000	2,886,440	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	800,000	808,288	2042/3/20
小計		503,715,000	523,319,672	
<b>地方債証券</b>				
第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	0.1	100,000	100,182	2026/12/18
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	104,057	2024/3/19
第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	0.74	100,000	91,912	2051/9/20
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	105,531	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	126,922	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	124,591	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	120,579	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	118,811	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	200,000	223,872	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	112,455	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	113,512	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	92,016	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	228,092	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	227,310	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	199,786	2025/12/19
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	100,908	2023/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	200,000	202,240	2023/12/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	100,995	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,171	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,674	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,452	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	300,270	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	197,918	2029/12/20
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,635	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,136	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	100,806	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	200,194	2028/12/28
第29回1号宮城県公募公債(10年)	0.68	100,000	100,941	2023/10/25
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	260,052	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	113,275	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	227,894	2030/11/12
第17回神奈川県公募公債(20年)	1.975	100,000	115,116	2031/7/11
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	113,715	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	111,318	2034/9/20
第78回神奈川県公募公債(5年)	0.005	200,000	199,958	2024/6/20
第201回神奈川県公募公債	0.704	200,250	202,068	2023/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	202,204	2024/12/20
第215回神奈川県公募公債	0.494	100,000	101,420	2025/6/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,550	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,603	2027/3/19

銘柄名	期			末
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第227回神奈川県公債	0.18	100,000	100,452	2027/6/18
第243回神奈川県公債	0.075	200,000	197,842	2029/12/20
第6回大阪府公債(20年)	1.98	200,000	228,020	2030/9/13
第7回大阪府公債(20年)	1.84	200,000	228,038	2031/9/26
第10回大阪府公債(20年)	1.72	100,000	113,808	2032/9/24
第375回大阪府公債(10年)	0.835	100,000	101,030	2023/8/29
第377回大阪府公債(10年)	0.729	100,000	101,019	2023/10/30
第389回大阪府公債(10年)	0.53	100,000	101,233	2024/10/30
第395回大阪府公債(10年)	0.435	151,000	152,780	2025/4/28
第399回大阪府公債(10年)	0.529	100,000	101,605	2025/8/28
第402回大阪府公債(10年)	0.493	100,000	101,582	2025/11/27
第407回大阪府公債(10年)	0.09	156,000	156,243	2026/4/27
第410回大阪府公債(10年)	0.001	200,000	199,550	2026/7/28
第439回大阪府公債(10年)	0.193	200,000	200,168	2028/12/27
第440回大阪府公債(10年)	0.2	100,000	100,098	2029/1/30
第465回大阪府公債(10年)	0.12	160,000	157,729	2031/2/25
第468回大阪府公債(10年)	0.129	182,000	179,351	2031/5/28
第469回大阪府公債(10年)	0.128	200,000	196,960	2031/6/27
平成21年度第3回京都府公債(20年)	2.19	100,000	114,297	2029/9/20
平成23年度第5回京都府公債(20年)	1.79	100,000	113,739	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公債	0.8	100,000	101,032	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公債	0.553	100,000	101,599	2025/6/19
平成28年度第5回京都府公債(20年)	0.327	100,000	97,121	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公債(20年)	0.63	100,000	100,696	2037/8/14
令和2年度第12回京都府公債	0.12	140,500	138,795	2030/12/16
第2回兵庫県公債(20年)	2.37	100,000	111,940	2027/9/17
第3回兵庫県公債(12年)	0.56	100,000	101,525	2025/4/16
第6回兵庫県公債(15年)	1.35	100,000	107,272	2028/7/14
第7回兵庫県公債(15年)	1.12	100,000	106,141	2028/12/25
第8回兵庫県公債(15年)	1.09	100,000	106,112	2029/4/16
第9回兵庫県公債(20年)	2.25	400,000	459,988	2029/11/19
平成25年度第7回兵庫県公債	0.7	100,000	100,978	2023/10/30
平成26年度第17回兵庫県公債	0.46	100,000	101,193	2025/2/26
第35回兵庫県公債(20年)	0.578	100,000	99,316	2038/5/28
令和元年度第17回兵庫県公債	0.15	300,000	298,416	2030/1/28
第9回静岡県公債(30年)	1.539	100,000	112,734	2045/6/20
第12回静岡県公債(30年)	0.822	100,000	95,853	2048/3/19
第15回静岡県公債(20年)	1.701	100,000	113,750	2032/10/15
第18回静岡県公債(20年)	1.473	100,000	112,138	2034/7/10
平成26年度第3回静岡県公債	0.679	100,000	101,322	2024/5/27
平成29年度第5回静岡県公債	0.19	100,000	100,503	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公債	0.21	100,000	100,603	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公債	0.215	100,000	100,605	2027/9/17
令和2年度第11回静岡県公債	0.204	310,000	308,412	2030/12/20
平成21年度第5回愛知県公債(20年)	2.28	100,000	114,557	2029/6/20
第18回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	101,246	2024/4/30

銘柄名	期			末
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
平成26年度第5回愛知県公債(10年)	0.66	200,000	202,572	2024/5/28
平成27年度第17回愛知県公債(10年)	0.38	100,000	101,225	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公債(10年)	0.07	100,000	100,061	2026/6/29
平成29年度第6回愛知県公債(10年)	0.22	200,000	201,252	2027/7/28
平成29年度第12回愛知県公債(20年)	0.606	300,000	300,456	2037/11/20
平成30年度第1回愛知県公債(10年)	0.185	100,000	100,322	2028/4/27
平成30年度第6回愛知県公債(30年)	0.777	100,000	94,602	2048/6/19
令和元年度第16回愛知県公債(10年)	0.09	200,000	197,952	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公債(10年)	0.145	100,000	99,181	2030/7/31
令和3年度第6回愛知県公債(30年)	0.718	200,000	183,164	2051/6/20
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	113,625	2028/9/21
平成21年度第1回広島県公債(20年)	2.21	200,000	227,890	2029/5/28
平成25年度第4回広島県公債	0.67	100,000	100,986	2023/11/27
平成27年度第4回広島県公債	0.476	125,230	127,133	2025/11/25
平成29年度第1回広島県公債	0.175	100,000	100,423	2027/5/25
令和2年度第7回広島県公債	0.214	390,000	388,116	2031/3/19
第3回埼玉県公債(20年)	2.42	100,000	111,719	2027/6/18
第6回埼玉県公債(20年)	2.26	100,000	113,125	2028/9/21
第6回埼玉県公債(30年)	0.957	100,000	99,942	2046/12/20
第7回埼玉県公債(20年)	2.29	200,000	229,276	2029/6/22
第8回埼玉県公債(15年)	0.367	200,000	195,778	2036/4/18
第10回埼玉県公債(20年)	1.94	200,000	227,894	2030/11/12
第18回埼玉県公債(20年)	0.323	200,000	194,480	2036/5/20
平成25年度第11回埼玉県公債	0.655	100,000	101,165	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公債	0.469	100,000	101,512	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公債	0.085	100,000	100,127	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公債	0.249	100,000	100,849	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公債	0.19	100,000	100,479	2027/6/22
令和2年度第7回埼玉県公債	0.125	100,000	98,932	2030/10/16
令和2年度第8回埼玉県公債	0.12	100,000	98,786	2030/12/17
令和3年度第8回埼玉県公債	0.125	150,000	147,568	2031/10/27
平成19年度第1回福岡県公債(20年)	2.38	100,000	111,841	2027/8/20
平成20年度第2回福岡県公債(20年)	2.05	100,000	112,196	2028/12/20
平成22年度第1回福岡県公債(15年)	1.67	100,000	105,664	2025/11/21
平成23年度第1回福岡県公債(20年)	2.008	100,000	115,188	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債(15年)	1.491	100,000	106,422	2026/11/27
平成24年度第1回福岡県公債(30年)	2.12	100,000	124,151	2042/9/19
平成26年度第4回福岡県公債(20年)	1.249	100,000	109,626	2035/2/23
平成27年度第7回福岡県公債	0.464	100,000	101,494	2025/12/25
平成30年度第1回福岡県公債(30年)	0.777	100,000	94,602	2048/6/19
平成30年度第1回福岡県公債(20年)	0.639	100,000	100,055	2038/8/20
令和2年度第1回福岡県公債	0.155	300,000	297,975	2030/6/24
令和3年度第2回福岡県公債	0.155	100,000	98,859	2031/5/30
令和3年度第1回福岡県公債(15年)	0.299	100,000	96,770	2036/7/14
第5回千葉県公債(20年)	2.26	200,000	226,250	2028/9/21

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第6回千葉県公債(20年)	2.26	100,000	114,119	2029/4/20		
第13回千葉県公債(20年)	1.701	100,000	113,750	2032/10/15		
平成25年度第5回千葉県公債	0.84	100,000	101,026	2023/8/25		
平成25年度第8回千葉県公債	0.67	300,000	302,940	2023/11/24		
平成25年度第9回千葉県公債	0.7	100,000	101,083	2023/12/25		
平成26年度第7回千葉県公債	0.429	100,000	101,107	2025/2/25		
平成27年度第1回千葉県公債	0.549	100,000	101,547	2025/5/23		
平成28年度第4回千葉県公債	0.085	100,000	100,128	2026/9/25		
平成28年度第6回千葉県公債	0.18	120,000	120,642	2027/1/25		
令和元年度第7回千葉県公債	0.08	300,000	296,688	2030/2/25		
令和2年度第7回千葉県公債	0.15	100,000	99,143	2030/9/25		
令和3年度第1回長野県公債(10年)	0.19	300,000	297,789	2031/4/16		
平成30年度第3回茨城県公債	0.03	350,000	350,080	2023/8/25		
第1回群馬県公債(20年)	1.841	200,000	226,140	2030/10/18		
平成29年度第1回岐阜県公債(10年)	0.205	100,000	100,538	2027/10/29		
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	202,004	2023/8/25		
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	100,941	2023/10/25		
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	100,965	2023/11/24		
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	202,482	2024/1/25		
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,128	2024/2/23		
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	303,546	2024/3/25		
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	112,000	113,462	2024/5/24		
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,333	2024/6/25		
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	101,272	2024/7/25		
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,218	2024/8/23		
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	202,388	2024/11/25		
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	202,184	2025/4/25		
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	203,118	2025/5/23		
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	127,449	2025/7/25		
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	101,590	2025/11/25		
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,190	2026/3/25		
第157回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,116	2026/4/24		
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	200,120	2026/6/25		
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	199,958	2026/7/24		
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	400,084	2026/8/25		
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	99,961	2026/11/25		
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,535	2027/1/25		
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	100,830	2027/2/25		
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	200,910	2027/6/25		
第174回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	194,709	2027/9/24		
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	100,591	2027/10/25		
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	300,876	2028/4/25		
第219回共同発行市場公募地方債	0.145	100,000	98,718	2031/6/25		
平成29年度第1回静岡市公債	0.22	100,000	100,600	2027/11/24		
第13回大阪市公債(20年)	2.08	200,000	229,210	2030/6/14		
第15回大阪市公債(30年)	0.704	100,000	91,172	2051/6/20		

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第2回大阪府公債(20年)	0.347	300,000	292,452	2036/5/30		
第24回大阪府公債(20年)	0.655	100,000	101,234	2037/4/21		
平成25年度第8回大阪府公債	0.767	100,000	101,266	2024/1/31		
令和3年度第2回大阪府公債	0.16	200,000	197,810	2031/5/21		
第1回名古屋市長官公債(30年)	2.53	100,000	125,341	2035/3/20		
第5回名古屋市長官公債(30年)	2.49	100,000	128,851	2039/3/18		
第9回名古屋市長官公債(20年)	2.07	100,000	112,326	2028/12/20		
第11回名古屋市長官公債(30年)	1.774	100,000	117,637	2044/9/20		
第499回名古屋市長官公債(10年)	0.225	100,000	100,725	2027/3/26		
第512回名古屋市長官公債(10年)	0.15	300,000	297,864	2030/6/20		
平成28年度第6回京都市公債	0.18	200,000	201,072	2027/1/27		
平成18年度第3回神戸市公債(20年)	2.54	120,000	132,091	2026/6/19		
平成20年度第1回神戸市公債(20年)	2.38	200,000	226,606	2028/5/26		
平成21年度第11回神戸市公債(20年)	2.233	100,000	115,180	2030/1/29		
平成24年度第12回神戸市公債(20年)	1.711	100,000	113,960	2032/12/17		
令和2年度第9回神戸市公債(30年)	0.674	100,000	90,854	2050/6/20		
令和3年度第6回神戸市公債(30年)	0.713	100,000	91,370	2051/6/20		
第5回横浜市長官公債(20年)	2.17	100,000	106,540	2025/6/20		
第20回横浜市長官公債(20年)	2.1	300,000	341,298	2029/10/19		
平成28年度第4回横浜市長官公債	0.175	100,000	100,511	2027/1/22		
平成29年度第2回横浜市長官公債	0.24	100,000	100,747	2027/7/16		
平成30年度第1回横浜市長官公債	0.195	100,000	100,379	2028/4/17		
平成30年度第4回横浜市長官公債	0.289	100,000	100,815	2028/10/17		
第30回横浜市長官公債(20年)	1.376	200,000	222,130	2034/10/20		
令和2年度第1回横浜市長官公債	0.15	300,000	297,987	2030/6/12		
令和3年度第2回横浜市長官公債	0.16	100,000	98,905	2031/5/23		
平成23年度第9回札幌市長官公債(15年)	1.493	100,000	106,679	2027/2/12		
平成26年度第9回札幌市長官公債(10年)	0.43	100,000	101,048	2024/12/20		
第11回川崎市公債(20年)	1.84	100,000	113,062	2030/10/18		
第89回川崎市公債	0.16	100,000	100,454	2026/12/18		
第93回川崎市公債	0.105	100,000	98,778	2030/9/20		
平成26年度第2回北九州市公債	0.451	100,000	101,107	2024/12/24		
平成27年度第2回北九州市公債	0.484	100,000	101,575	2025/12/18		
平成28年度第1回北九州市公債	0.08	100,000	100,115	2026/4/15		
平成21年度第3回福岡市長官公債(20年)	2.14	100,000	113,927	2029/9/18		
平成25年度第6回福岡市長官公債(20年)	1.511	100,000	112,377	2034/2/17		
平成26年度第5回福岡市長官公債	0.539	200,000	202,504	2024/10/28		
平成30年度第5回福岡市長官公債(5年)	0.03	200,000	200,046	2023/8/17		
平成30年度第10回福岡市長官公債(5年)	0.02	100,000	100,014	2023/12/26		
平成25年度第3回広島市長官公債	0.67	150,000	151,719	2024/2/23		
平成26年度第2回広島市長官公債	0.456	100,000	101,121	2024/12/25		
平成28年度第4回広島市長官公債	0.165	105,000	105,478	2026/12/25		
平成29年度第6回広島市長官公債	0.23	170,000	171,016	2028/2/25		
令和元年度第6回広島市長官公債	0.115	550,000	545,391	2030/2/25		
令和2年度第3回広島市長官公債(5年)	0.02	200,000	199,868	2025/10/24		

当		期		末		
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
令和元年度第5回千葉市公債券			0.08	200,000	197,792	2030/2/25
平成25年度第4回福井県公債券			0.7	100,000	101,303	2024/4/25
平成26年度第1回岡山県公債券(10年)			0.33	200,000	201,628	2025/1/30
第113回福岡北九州高速道路債券			2.41	100,000	111,567	2027/12/20
小 計				32,361,680	33,511,126	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>						
第40回政府保証日本政策金融公庫債券			0.02	126,000	126,000	2026/3/13
第46回政府保証日本政策金融公庫債券			0.16	100,000	100,443	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公庫債券			0.09	210,000	210,109	2027/9/24
第53回政府保証日本政策金融公庫債券			0.209	187,000	187,983	2028/9/15
第54回政府保証日本政策金融公庫債券			0.001	220,000	220,083	2024/10/24
第2回政府保証新関西国際空港債券			0.882	202,000	203,959	2023/6/27
第2回政府保証日本政策投資銀行債券			2.2	300,000	307,020	2023/6/19
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債			0.085	100,000	100,205	2026/12/14
第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債			0.001	100,000	100,029	2025/1/24
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			2.4	100,000	132,298	2049/6/30
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			2.1	200,000	227,796	2029/9/28
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			2.2	200,000	229,808	2029/11/30
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			2.2	100,000	124,889	2040/5/31
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			2.1	100,000	115,736	2030/12/27
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			1.66	100,000	113,652	2032/12/28
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.882	200,000	201,954	2023/6/30
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.801	148,000	149,619	2023/9/29
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.699	100,000	101,021	2023/10/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.669	265,800	268,548	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.693	200,000	202,250	2023/12/28
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.747	533,000	539,838	2024/1/31
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.645	100,000	101,217	2024/3/29
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			1.475	200,000	224,426	2034/3/31
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.669	102,000	103,347	2024/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.644	100,000	101,370	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.601	100,000	101,336	2024/7/31
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			1.396	200,000	223,024	2034/9/29

当		期		末		
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.539	100,000	101,329	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.466	100,000	101,227	2024/12/27
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.32	300,000	302,646	2025/1/31
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			1.16	100,000	108,693	2035/2/28
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			1.216	200,000	218,720	2035/3/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.32	200,000	202,238	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.145	100,000	100,468	2026/2/27
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.394	100,000	88,275	2046/5/31
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.005	107,000	106,836	2026/11/30
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.115	205,000	205,672	2027/1/29
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.145	100,000	100,438	2027/3/31
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.14	200,000	200,838	2027/4/30
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.155	100,000	100,413	2027/8/31
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.195	120,000	120,651	2028/2/29
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.145	200,000	200,416	2028/5/31
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.625	300,000	299,550	2038/9/30
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.219	214,000	215,211	2028/10/31
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.005	100,000	98,844	2029/6/29
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券			0.001	100,000	98,632	2029/10/31
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)			0.311	100,000	100,383	2023/7/28
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)			0.001	600,000	600,210	2024/8/28
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.835	100,000	101,032	2023/8/14
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.669	105,000	106,060	2023/11/17
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.66	200,000	202,334	2024/2/16
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.645	100,000	101,191	2024/3/15
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.379	100,000	101,305	2025/12/12
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.02	100,000	100,000	2026/3/13
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.085	100,000	100,205	2026/12/14
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.14	251,000	252,046	2027/4/16
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.16	100,000	100,441	2027/7/16
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.155	100,000	100,404	2027/8/13
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券			0.195	110,000	110,624	2028/2/15

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第111	回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	156,825	2028/8/15
第113	回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	100,563	2028/10/16
第120	回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.001	100,000	98,810	2029/7/13
第16	回	政府保証民間都市開発債券	0.699	180,000	181,798	2023/10/20
第129	回	株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	83,736	2070/7/16
第21	回	道路債券	2.75	100,000	125,088	2033/6/20
第27	回	道路債券	2.42	400,000	417,252	2024/3/20
第28	回	道路債券	2.83	200,000	253,424	2033/12/20
第33	回	道路債券	2.91	200,000	256,576	2034/6/20
第34	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	112,841	2028/3/17
第36	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	139,939	2048/3/20
第37	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	113,490	2028/6/20
第42	回	道路債券	2.22	100,000	106,115	2025/3/21
第47	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	114,905	2029/4/20
第95	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	114,027	2032/9/17
第112	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.85	300,000	302,661	2023/6/20
第115	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	100,945	2023/9/20
第118	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,167	2023/12/20
第131	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	111,190	2034/6/20
第134	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	101,026	2024/6/20
第144	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,114	2024/12/20
第153	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	121,966	2055/3/19
第158	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	218,082	2035/6/20
第188	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	599,058	2037/9/18
第208	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	100,172	2058/3/19
第2	回	公営企業債券(30年)	2.39	300,000	365,766	2033/12/20
第3	回	地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	106,415	2029/1/26
第5	回	公営企業債券(30年)	2.72	300,000	380,145	2034/9/22
第7	回	公営企業債券(20年)	2.2	100,000	103,937	2024/3/22
第7	回	公営企業債券(30年)	2.67	200,000	254,298	2035/6/20
第8	回	公営企業債券(20年)	2.25	40,000	41,611	2024/3/22
第8	回	公営企業債券(30年)	2.5	100,000	125,281	2035/9/21
第8	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	2.043	200,000	228,210	2030/6/28
第10	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.752	200,000	223,934	2030/8/28
第11	回	地方公共団体金融機構債券(30年)	0.633	200,000	178,532	2050/8/26
第18	回	公営企業債券(20年)	2.58	100,000	110,171	2026/6/19
第19	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	200,000	228,566	2031/12/26
第24	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	113,472	2032/9/28
第34	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	500,000	566,625	2034/1/27

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第58	回	地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	101,295	2024/3/28
第65	回	地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	303,651	2024/10/28
第67	回	地方公共団体金融機構債券	0.501	100,000	101,213	2024/12/27
第69	回	地方公共団体金融機構債券	0.478	100,000	101,217	2025/2/28
第76	回	地方公共団体金融機構債券	0.505	200,000	202,994	2025/9/26
F77	回	地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	106,336	2026/10/20
第83	回	地方公共団体金融機構債券	0.09	200,000	200,194	2026/4/28
第88	回	地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,998	2026/9/28
F95	回	地方公共団体金融機構債券	1.336	100,000	103,497	2025/2/6
F107	回	地方公共団体金融機構債券	1.388	100,000	103,788	2025/3/19
第116	回	地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	99,703	2029/1/26
F132	回	地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	103,291	2025/7/30
F146	回	地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	207,356	2025/10/28
F202	回	地方公共団体金融機構債券	0.929	200,000	207,020	2026/6/26
F208	回	地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	102,930	2026/2/4
F214	回	地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	104,084	2027/4/28
第29	回	首都高速道路株式会社債	0.125	100,000	100,045	2026/12/18
第7	回	阪神高速道路債券	2.18	100,000	105,928	2025/3/21
第19	回	水資源債券(サステナビリティボンド)	0.001	200,000	199,824	2024/12/20
第4	回	株式会社日本政策金融公社債	2.2	100,000	114,081	2029/9/20
第18	回	株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	116,222	2031/5/9
第87	回	株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,914	2024/3/11
第88	回	株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,956	2023/11/10
第89	回	株式会社日本政策金融公社債	0.03	100,000	99,972	2025/3/12
第117	回	回都市再生債券	0.804	200,000	208,504	2030/11/20
第159	回	回都市再生債券	0.43	200,000	154,990	2059/3/19
第161	回	回都市再生債券	0.687	100,000	85,103	2059/3/19
第171	回	回都市再生債券	0.886	200,000	181,582	2061/3/18
第5	回	本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	105,544	2024/12/20
第346	回	東京交通債券	1.13	20,000	20,229	2023/6/20
第62	回	独立行政法人福祉医療機構債券	0.18	100,000	99,211	2030/6/20
第1	回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	10,245	10,310	2042/5/10
第1	回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	10,648	10,770	2037/11/10
第2	回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	10,742	10,893	2037/11/10
第2	回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	134,739	134,270	2032/5/10
第3	回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	95,042	94,770	2033/1/10
第4	回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,839	2042/8/10
第4	回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.03	11,619	11,841	2038/5/10
第4	回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	169,236	168,381	2033/4/10
第6	回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	11,501	11,714	2038/11/10
第6	回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.06	192,255	191,018	2034/2/10
第7	回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.14	68,772	68,503	2034/2/10
第8	回	貸付債権担保S種住宅金融公社債券	2.15	9,987	10,047	2037/5/10
第8	回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	11,929	12,252	2039/5/10
第8	回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	230,094	228,943	2034/6/10
第9	回	貸付債権担保S種住宅金融公社債券	2.19	10,194	10,256	2037/5/10

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	158,322	157,661	2034/8/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	12,070	12,380	2039/11/10
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	111,982	2027/12/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	15,938	16,727	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	16,069	16,910	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	17,978	19,049	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	19,816	20,900	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	21,714	23,035	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	22,275	23,608	2044/12/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	46,492	49,148	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	10,407	10,468	2040/11/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	20,992	22,078	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	10,670	10,786	2041/2/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	10,307	10,378	2041/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	21,375	22,465	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	21,015	22,119	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	19,831	20,814	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	11,492	11,757	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	42,464	44,341	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	22,311	23,325	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	11,196	11,406	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	29,588	30,941	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	28,330	29,606	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	28,630	29,936	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	64,376	67,144	2047/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	76,318	79,171	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	39,271	40,694	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	39,842	41,622	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	40,092	41,932	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	35,047	36,538	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	34,329	35,533	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	39,865	41,737	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	173,310	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	104,565	108,240	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	142,232	147,197	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	40,575	41,903	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	41,885	43,280	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	42,880	44,183	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	114,204	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	134,922	138,949	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	46,395	47,591	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	97,682	99,514	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	54,295	55,483	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	58,033	59,122	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	57,478	58,841	2050/6/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	178,620	183,530	2050/7/10

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	120,492	123,648	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	58,204	59,614	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	63,181	64,725	2051/1/10
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	69,494	69,011	2051/5/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	75,109	74,755	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	74,747	74,223	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	75,046	74,841	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	75,502	75,619	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	76,026	76,016	2052/2/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	77,872	77,801	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	78,273	78,282	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,125	77,917	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,131	77,919	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	78,840	78,655	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	159,830	159,096	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	79,103	78,864	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	161,548	161,405	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	80,142	79,893	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	160,908	160,116	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	81,458	81,186	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	163,600	162,762	2053/7/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	164,636	163,763	2053/8/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	122,408	2043/3/20
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	83,408	83,375	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	82,925	83,070	2053/11/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	83,194	82,653	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	171,234	169,358	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	85,907	84,871	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	85,264	84,357	2054/5/10
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	172,908	170,793	2054/6/10
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	87,589	85,895	2054/7/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	264,483	258,011	2054/9/10
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	177,290	172,912	2054/10/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	90,165	89,166	2055/2/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	90,795	89,540	2055/3/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	186,272	184,498	2055/9/10
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	94,267	93,245	2055/11/10
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	188,800	186,696	2055/12/10
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	190,028	187,550	2056/1/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,657	93,664	2056/2/10
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	190,498	189,250	2056/3/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,824	190,625	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	96,517	95,813	2056/6/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,503	96,258	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	292,386	288,614	2056/9/10
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	97,777	96,638	2056/10/10

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	99,349	99,609	2057/3/10	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	100,000	100,247	2057/6/10	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	94,708	2036/7/18	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	0.753	100,000	91,495	2051/3/20	
第64回日本学生支援債券	0.001	300,000	299,940	2023/9/20	
第65回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,940	2023/11/20	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	106,094	2025/6/20	
第24回沖繩振興開発金融公庫債券	0.09	600,000	600,738	2024/6/20	
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	114,251	2033/9/20	
第53回東日本高速道路株式会社債	0.07	200,000	200,120	2023/12/20	
第64回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	99,108	2029/11/29	
第67回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	199,322	2030/1/31	
第73回東日本高速道路株式会社債	0.21	500,000	496,960	2030/7/17	
第86回東日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	99,638	2026/12/18	
第60回西日本高速道路株式会社債	0.001	300,000	299,925	2023/9/4	
第63回西日本高速道路株式会社債	0.001	200,000	199,922	2023/12/11	
第66回西日本高速道路株式会社債	0.08	800,000	800,312	2024/5/20	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	100,876	2023/9/20	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	99,936	2026/8/19	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	195,618	2034/5/30	
小計		33,652,796	34,709,232		
<b>金融債券</b>					
い第823号商工債	0.17	200,000	200,342	2023/12/27	
い第829号商工債	0.13	200,000	200,206	2024/6/27	
い第832号商工債	0.06	200,000	199,906	2024/9/27	
い第833号商工債	0.05	100,000	99,903	2024/10/25	
い第843号商工債	0.12	200,000	200,038	2025/8/27	
い第847号商工債	0.1	100,000	99,910	2025/12/26	
い第850号商工債	0.1	200,000	199,656	2026/3/27	
第350回信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,057	2024/1/26	
第360回信金中金債(5年)	0.01	200,000	199,750	2024/11/27	
第376回信金中金債(5年)	0.05	100,000	99,790	2026/3/27	
第379回信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,716	2026/6/26	
第385回信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,613	2026/12/25	
第254号商工債(3年)	0.05	300,000	299,862	2024/3/27	
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	101,429	2025/9/26	
小計		2,200,000	2,200,178		
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
第507回中部電力株式会社債	0.605	100,000	101,229	2026/1/23	
第511回中部電力株式会社債	0.21	100,000	99,590	2026/7/24	
第519回中部電力株式会社債	0.84	100,000	100,192	2037/1/23	
第540回中部電力株式会社債	0.53	100,000	93,202	2040/2/24	
第508回関西電力株式会社債	0.455	100,000	100,194	2027/4/23	
第510回関西電力株式会社債	0.49	200,000	200,570	2027/7/23	
第511回関西電力株式会社債	0.41	100,000	99,843	2027/9/17	
第524回関西電力株式会社債	0.514	100,000	100,148	2028/10/25	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第536回関西電力株式会社債	0.44	100,000	98,696	2030/12/20	
第538回関西電力株式会社債	0.39	100,000	98,206	2031/1/24	
第550回関西電力株式会社債	0.39	100,000	99,854	2027/5/25	
第385回中国電力株式会社債	0.728	100,000	101,594	2025/7/25	
第398回中国電力株式会社債	0.425	100,000	100,210	2027/7/23	
第400回中国電力株式会社債	0.34	100,000	99,739	2027/9/24	
第416回中国電力株式会社債	0.355	200,000	198,374	2029/5/25	
第425回中国電力株式会社債	0.37	100,000	98,797	2030/6/25	
第307回北陸電力株式会社債	1.055	100,000	103,036	2026/6/25	
第322回北陸電力株式会社債	0.38	100,000	99,976	2027/6/25	
第330回北陸電力株式会社債	0.34	200,000	198,172	2029/5/25	
第471回東北電力株式会社債	1.168	126,000	127,969	2023/12/25	
第481回東北電力株式会社債	0.803	100,000	101,749	2025/7/25	
第496回東北電力株式会社債	0.355	100,000	99,661	2027/9/24	
第508回東北電力株式会社債	0.465	100,000	99,765	2029/4/25	
第521回東北電力株式会社債	0.45	200,000	198,470	2030/5/24	
第527回東北電力株式会社債	0.32	100,000	97,744	2032/2/25	
第535回東北電力株式会社債	0.2	100,000	98,432	2028/7/25	
第309回四国電力株式会社債	0.4	100,000	99,080	2030/5/24	
第314回四国電力株式会社債	0.29	100,000	97,566	2031/5/23	
第449回九州電力株式会社債	0.43	200,000	200,244	2027/4/23	
第465回九州電力株式会社債	0.38	100,000	99,450	2028/7/25	
第468回九州電力株式会社債	0.435	100,000	99,765	2028/8/25	
第484回九州電力株式会社債	0.375	200,000	197,604	2029/11/22	
第489回九州電力株式会社債	0.44	100,000	99,082	2030/5/24	
第494回九州電力株式会社債	0.31	100,000	97,404	2031/5/23	
第326回北海道電力株式会社債	0.789	100,000	101,764	2025/12/25	
第340回北海道電力株式会社債	0.48	100,000	100,363	2027/4/23	
第350回北海道電力株式会社債	0.754	100,000	97,514	2038/3/25	
第39回大成建設株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,154	2030/6/14	
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,929	2027/11/30	
第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.03	200,000	199,610	2023/11/27	
第11回西松建設株式会社無担保社債	0.42	100,000	100,147	2027/3/1	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	300,000	298,950	2026/6/3	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,738	2031/6/3	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,203	2024/9/13	
第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,718	2023/11/27	
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,222	2024/6/13	
第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,768	2023/10/13	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	100,000	101,209	2025/2/28	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.09	200,000	198,864	2026/6/3	
第24回株式会社エチレイン無担保社債	0.25	100,000	100,090	2025/8/29	

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	99,974	2028/10/20
第10回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.47	100,000	99,433	2028/5/26
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,942	2023/8/30
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	100,000	100,309	2030/4/22
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.19	200,000	199,948	2025/12/19
第13回旭化成株式会社無担保社債	0.12	100,000	99,820	2025/6/19
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.45	100,000	100,296	2028/11/29
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,148	2027/3/1
第4回ア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	99,890	2028/8/31
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	100,265	2028/2/25
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	200,000	199,546	2027/2/26
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.19	200,000	200,170	2025/6/11
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.09	100,000	99,610	2026/6/3
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.74	100,000	95,248	2041/6/3
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	100,068	2028/3/23
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.01	200,000	199,730	2023/11/27
第4回株式会社電通グループ無担保社債	0.22	100,000	100,009	2025/7/8
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	200,000	200,010	2030/7/8
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	300,000	294,528	2031/10/14
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	100,102	2026/3/6
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	97,603	2029/7/31
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	0.5	100,000	99,614	2024/12/2
第9回楽天グループ株式会社無担保社債	1.3	100,000	95,441	2033/12/2
第7回東豊ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	101,753	2024/10/23
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	101,293	2024/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	100,007	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	100,000	100,009	2026/4/17
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	99,910	2029/4/19
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,968	2026/6/19
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	300,120	2025/7/14
第8回株式会社タダノ無担保社債	0.28	100,000	99,731	2025/7/17
第17回株式会社日立製作所無担保社債	1.371	100,000	106,562	2028/12/13
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	99,207	2030/3/12
第1回株式会社安川電機無担保社債	0.13	100,000	99,752	2026/5/20
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,009	2025/7/16
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	100,000	99,304	2030/7/16
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,214	2023/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	200,000	201,848	2026/9/18
第20回パナソニック株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,898	2023/12/22
第21回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,903	2025/12/24
第23回パナソニック株式会社無担保社債	0.39	100,000	98,610	2030/12/24
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	99,914	2028/3/17
第19回株式会社デンソー無担保社債	0.001	300,000	299,556	2023/11/20
第29回三菱重工業株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,086	2024/9/3
第35回三菱重工業株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,915	2027/8/27
第11回J A三リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,050	2023/9/7
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,771	2026/2/4
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.219	200,000	198,268	2031/3/18
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	100,000	99,992	2023/9/25
第8回楽天カード株式会社無担保社債	1.07	100,000	96,968	2031/12/17
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,840	2026/3/11
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	93,606	2040/3/9
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	101,285	2024/5/30
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	100,184	2027/7/12
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	114,476	2033/3/4
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	198,544	2029/7/11
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,008	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	100,288	2028/9/14
第60回住友商事株式会社無担保社債	0.574	100,000	100,032	2032/5/24
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債 (劣後特)	0.61	100,000	99,613	2029/12/12
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.91	100,000	116,216	2029/10/16
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	110,341	2027/4/20
第1回三井住友FG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	101,062	2024/9/12
第11回株式会社セブ銀行無担保社債	0.536	100,000	101,032	2024/12/20
第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	300,000	303,126	2024/7/16
第3回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,901	2025/7/15
第4回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,826	2025/10/7
第9回みずほリース株式会社無担保社債	0.23	100,000	98,254	2028/9/1
第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,054	2025/12/19
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.38	200,000	199,846	2030/9/20
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.22	100,000	98,372	2028/7/21
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,888	2026/6/19
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	200,000	199,726	2023/9/19
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.16	100,000	99,976	2025/9/19
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.14	100,000	99,885	2025/12/19

期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.11	100,000	99,968	2025/10/21
第41回リコーリース株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,318	2026/4/17
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,570	2025/6/24
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.34	100,000	99,395	2026/7/31
第30回株式会社ジャックス無担保社債	0.28	100,000	99,683	2026/1/27
第32回株式会社ジャックス無担保社債	0.23	100,000	99,315	2026/6/8
第35回株式会社ジャックス無担保社債	0.25	100,000	99,164	2026/12/9
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	102,717	2026/9/18
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,123	2023/12/20
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,091	2029/10/19
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,736	2024/1/19
第21回三井住友フィナンサーズ株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,132	2023/11/27
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,034	2023/10/25
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	199,866	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,148	2028/1/18
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.474	100,000	100,005	2028/10/18
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	99,855	2027/8/27
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	800,000	800,240	2023/9/4
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.28	100,000	99,505	2026/9/4
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	200,000	199,618	2026/11/13
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	200,656	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,916	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	95,337	2039/8/5
第135回三菱地所株式会社無担保社債	0.26	100,000	98,514	2031/6/20
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	101,365	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	101,403	2024/9/9
第109回住友不動産株式会社無担保社債	0.31	100,000	98,497	2031/5/9
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	101,025	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	103,154	2026/6/17
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,762	2023/11/27
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	0.624	100,000	100,183	2032/6/2
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	93,363	2046/9/26
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	96,334	2040/6/11
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,672	2023/11/27
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	102,485	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	95,704	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	89,112	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	96,862	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,165	2028/9/7

期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	109,784	2026/9/18
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	227,058	2028/12/12
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.06	100,000	99,524	2026/7/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	100,949	2047/7/26
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	98,024	2058/9/27
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.265	100,000	99,346	2030/4/22
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.836	100,000	92,052	2050/12/16
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.596	100,000	94,640	2041/4/15
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.002	100,000	88,422	2061/7/15
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	112,569	2028/3/17
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	92,058	2056/12/13
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.042	100,000	98,852	2047/8/30
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.13	500,000	499,935	2025/5/21
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.582	100,000	94,409	2041/4/22
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	124,817	2039/12/16
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	117,746	2044/10/28
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	100,000	109,113	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	96,811	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	83,483	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	78,464	2070/1/31
第54回東京地下鉄株式会社社債	1.055	100,000	90,609	2061/10/14
第56回東京地下鉄株式会社社債	1.066	100,000	97,903	2052/2/28
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.878	200,000	179,040	2049/11/19
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,494	2025/9/4
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,093	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,328	2028/11/22
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.3	400,000	397,356	2026/6/3
第31回株式会社光通信無担保社債	1.38	200,000	196,328	2036/2/1
第33回株式会社光通信無担保社債	0.85	100,000	97,857	2031/6/16
第36回株式会社光通信無担保社債	0.8	100,000	97,098	2031/11/4
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	105,474	2025/6/20
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	97,893	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,008	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,385	2028/7/20
第77回電源開発株式会社無担保社債	0.4	100,000	100,007	2027/5/20
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	200,000	201,958	2029/10/9
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	300,000	300,675	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	101,445	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.64	300,000	300,660	2026/10/8

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	101,069	2032/10/8
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.4	100,000	99,436	2026/4/22
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	100,000	98,847	2031/4/22
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	300,000	287,877	2036/8/29
第9回株式会社JERA無担保社債	0.664	100,000	100,032	2032/5/25
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.805	100,000	91,377	2050/9/9
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.225	200,000	197,676	2030/9/10
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	200,000	197,040	2031/6/3
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	94,199	2041/6/3
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	100,865	2023/6/20
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	200,000	200,910	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債	0.384	100,000	99,918	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債	0.25	300,000	298,806	2024/10/10
第2回B・P・C・E・S・A円貨社債 (ソーシャルボンド)	0.367	100,000	99,766	2024/6/28
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	400,000	400,916	2023/7/12
第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.499	100,000	99,752	2024/12/12

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,223	2026/6/17
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,948	2024/1/26
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	99,626	2024/6/7
第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	0.463	400,000	399,172	2024/12/5
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	400,204	2023/7/6
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,636	2023/6/2
小 計		30,126,000	30,041,507	
合 計		602,055,476	623,781,716	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 10年国債標準物	599	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 623,781,716	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,677,629	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	627,459,345	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年5月30日現在
(A)資 産	627,559,392,248円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,426,453,894
公 社 債(評価額)	623,781,716,178
未 収 利 息	1,232,469,294
前 払 費 用	18,705,882
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B)負 債	2,629,926,841
未 払 金	2,500,958,920
未 払 解 約 金	28,918,799
未 払 利 息	2,122
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純 資 産 総 額(A-B)	624,929,465,407
元 本	451,551,932,225
次 期 繰 越 損 益 金	173,377,533,182
(D)受 益 権 総 口 数	451,551,932,225口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,840円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	4,488,808,714円
受 取 利 息	4,489,369,711
支 払 利 息	△560,997
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△15,524,030,963
売 買 益	70,367,063
売 買 損	△15,594,398,026
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,391,080
取 引 益	4,305,780
取 引 損	△6,696,860
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△11,037,613,329
(E)前 期 繰 越 損 益 金	182,160,310,920
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	24,805,234,643
(G)解 約 差 損 益 金	△22,550,399,052
(H) 計 (D+E+F+G)	173,377,533,182
次 期 繰 越 損 益 金(H)	173,377,533,182

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

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

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

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は446,205,859,601円、期中追加設定元本額は61,228,635,499円、期中一部解約元本額は55,882,562,875円です。

※担保に供している資産

先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。

国債証券 100,347,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	92,541,310,930円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	80,859,739,502円
DC日本債券インデックス・オープンP	66,912,531,360円
DCマイセクション50	29,416,463,980円
DCマイセクション25	25,809,895,198円
分散投資コア戦略ファンドS	25,440,115,400円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,733,806,056円
分散投資コア戦略ファンドA	19,869,312,536円
日本債券ファンド・シリーズ1	15,920,823,109円
DCマイセクションS50	14,198,988,240円
DCマイセクションS25	12,760,944,723円
DCマイセクション75	8,599,031,500円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,042,755,457円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,042,619,488円

世界経済インデックスファンド	3,710,871,247円
DC世界経済インデックスファンド	3,341,731,761円
DCマイセクションS75	3,211,693,140円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,196,257,589円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,939,383,962円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,202,205,181円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,435,781,360円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,356,312,332円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,149,756,134円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,003,105,420円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	821,333,270円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	795,519,625円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	763,422,315円
DC日本債券インデックス・オープン ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	440,199,184円 418,803,647円
グローバル経済コア	229,985,351円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	160,194,027円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	139,022,548円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	128,536,453円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	114,549,770円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	92,634,852円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	88,838,138円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	85,353,934円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	76,010,188円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	71,893,746円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	66,236,571円
SMT インデックスバランス・オープン	61,223,294円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,666,819円
SMT 世界経済インデックス・オープン	36,559,382円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	33,130,779円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	30,283,266円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	28,573,508円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	27,610,659円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	19,753,874円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,614,917円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,462,539円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	12,384,315円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	11,059,138円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,712,858円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,959,214円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,855,640円
エマージング株式オープン	2,227,240円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2,115,332円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	1,435,383円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	972,063円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	362,781円

## お知らせ

該当事項はありません。

# 国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	98.3	497,213

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2021年 5月31日	18,550	—	1,922.98	—	1.5
6月末	18,770	1.2	1,943.57	1.1	0.9
7月末	18,361	△1.0	1,901.08	△1.1	0.8
8月末	18,942	2.1	1,960.70	2.0	0.7
9月末	19,766	6.6	2,030.16	5.6	1.4
10月末	19,486	5.0	2,001.18	4.1	1.4
11月末	18,779	1.2	1,928.35	0.3	1.3
12月末	19,433	4.8	1,992.33	3.6	1.1
2022年 1月末	18,495	△0.3	1,895.93	△1.4	0.8
2月末	18,414	△0.7	1,886.93	△1.9	0.6
3月末	19,205	3.5	1,946.40	1.2	1.6
4月末	18,745	1.1	1,899.62	△1.2	1.8
(当期末) 2022年 5月30日	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	1.9

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社 J P X 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境



国内株式市場は下落しました。

期初は、堅調な米国株式市場が下支えとなった一方で、国内での新型コロナウイルス新規感染拡大に歯止めがかからず、緊急事態宣言が発出されたことなどから上値の重い展開となりました。9月に入ると、新政権による国内経済対策への期待感から大幅に上昇した後、中国大手不動産開発会社の債務問題やインフレ懸念の高まりなどから下落しました。期末にかけては、国内での新型コロナウイルス変異株の感染拡大や米国の金融引き締めへの警戒感、ウクライナを巡る地政学リスクが高まった一方で、円安・米ドル高の進行による輸出関連企業の業績改善が期待されたこと、米国のインフレ加速への警戒感が後退したことなどを受けて、国内株式市場はやや値を戻しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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

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

## 当ファンドの組入資産の内容

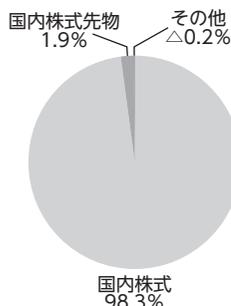
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.9%
2	ソニーグループ	日本	2.9%
3	東証株価指数先物 2206	日本	1.9%
4	キーエンス	日本	1.8%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.7%
6	日本電信電話	日本	1.7%

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	東京エレクトロン	日本	1.5%
8	リクルートホールディングス	日本	1.3%
9	任天堂	日本	1.3%
10	日立製作所	日本	1.3%
組入銘柄数			2,103

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

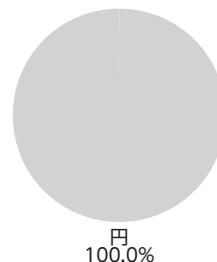
## ○資産別配分



## ○国別配分



## ○通貨別配分

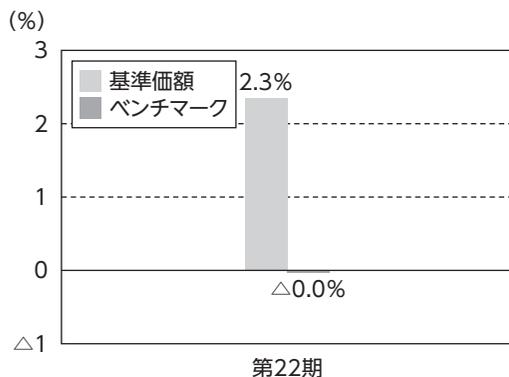


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.9%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

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

## 今後の運用方針

原則としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	-  (-)  (-) (-)	-  (-)  (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(18,912円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 29,302 (7,372)	千円 71,828,645 (-)	千株 16,256	千円 39,141,522

(注1)金額は受渡代金です。

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

### <新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	内	証券 — (5,300)	千円 — (-)	証券 — (5,300)	千円 — (-)

(注1)金額は受渡代金です。

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

### <先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 59,969	百万円 56,982	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

## 株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	110,970,168千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	475,292,667千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.23

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 809,836	百万円 20,042	% 2.5	百万円 811,443	百万円 19,690	% 2.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### ■ 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	136百万円	106百万円	1,292百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

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

## 組入資産の明細

## &lt;国内株式(上場株式)&gt;

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
<b>水産・農林業(0.1%)</b>			
極洋	7.6	8.8	29,524
日本水産	217.9	250.3	131,407
マルハニチロ	36.7	36.9	83,430
雪国まいたけ	19.3	19.2	16,204
カネコ種苗	7.1	7.4	13,238
サカタのタネ	28	29.4	129,507
ホクト	19.7	20.7	39,764
ホクリヨウ	3.6	3.6	2,289
<b>鉱業(0.4%)</b>			
住石ホールディングス	41.1	46	9,660
日鉄鉱業	5.4	5.4	32,022
三井松島ホールディングス	9.8	11	33,275
I N P E X	862.8	944.2	1,492,780
石油資源開発	30.7	30.9	90,258
K&Oエナジーグループ	11.4	10.8	16,621
<b>建設業(2.1%)</b>			
ヒノキヤグループ	5.8	—	—
ショーボンドホールディングス	33.5	33	189,750
ミライト・ホールディングス	81.3	84.6	138,151
タマホーム	14.2	15.9	39,765
サンヨーホームズ	2.7	3	2,232
日本アクア	9.3	10.4	6,520
ファーストコーポレーション	7.2	6.4	4,736
ベストテラ	4.5	5.3	6,487
Robot Home	44	43.8	8,497
キャンディル	4	4.1	2,189
スペースバリューホールディングス	28.6	—	—
ダイセキ環境ソリューション	4.5	5.1	4,962
第一カッター興業	5.8	6	7,926
安藤・間	150.4	123.3	97,776
東急建設	68.7	72.7	43,256
コムシスホールディングス	83.2	84.7	208,023
ピーアールホールディングス	31.4	33.9	10,915
高松コンストラクショングループ	14.6	16	32,848
東建コーポレーション	7.2	7.3	64,605
ソネック	2.4	2.7	2,721
ヤマウラ	10.2	11.8	11,021
オリエンタル白石	78.9	88.3	20,838
大成建設	168.6	164.9	653,004
大林組	541.8	578	531,760

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
清水建設	507.5	536.9	367,776
飛鳥建設	15.5	16.2	16,459
長谷工コーポレーション	177.5	168.7	260,978
松井建設	21.3	21.4	14,402
銭高組	2.4	2.4	8,556
鹿島建設	397	423.5	590,359
不動テトラ	13.3	12.9	20,549
大末建設	6.8	6.4	10,195
鉄建建設	10.9	12.6	22,541
西松建設	38.8	36.7	153,039
三井住友建設	130.9	136.8	60,328
大豊建設	11.9	8.9	39,471
前田建設工業	135.7	—	—
佐田建設	12.5	13.1	6,288
ナカノフドー建設	13	14.5	4,611
奥村組	29.8	31.7	90,535
東鉄工業	23.2	25.3	55,204
イチケン	3.9	4.4	8,179
富士ビー・エス	7	7.8	4,001
浅沼組	6.5	6.8	35,768
戸田建設	225	239.1	162,109
熊谷組	25.1	30	80,400
北野建設	3.3	3.7	8,269
植木組	4.8	5.1	7,481
矢作建設工業	23.9	25	19,850
ピーエス三菱	17.8	20	12,060
日本ハウスホールディングス	37	41	17,630
大東建託	59.1	62.1	693,657
新日本建設	23	25.8	19,117
N I P P O	44.8	—	—
東亜道路工業	3.4	3.1	16,554
前田道路	33.5	—	—
日本道路	5.2	5.3	34,609
東亜建設工業	14.5	14	33,194
日本国土開発	52.7	51.2	26,316
若築建設	9.7	9.6	19,017
東洋建設	60.7	68	58,412
五洋建設	230.1	229.1	145,478
世紀東急工業	26	29.1	23,774
福田組	6.3	6.5	30,127
住友林業	127.4	140.4	278,132

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
日本基礎技術	16.5	15.4		8,978
バコーポレーション	24.1	23.7		10,072
大和ハウス工業	500.3	507	1,621,893	
ライト工業	31	34.5		57,787
積水ハウス	587.6	603.3	1,393,321	
日特建設	14.1	12.5		9,650
北陸電気工事	9.4	11.4		8,675
ユアテック	31	34.7		24,255
日本リーテック	11.3	11.9		12,709
四電工	2.9	6.1		10,321
中電工	24.9	25.6		53,248
関電工	88.1	98.7		80,243
きんでん	110	127.4		190,080
東京エネシス	18	18.7		17,578
トーエネック	5.4	6.1		19,520
住友電設	15.3	15		35,115
日本電設工業	29.7	28.3		45,053
エクシオグループ	82.1	86.6		180,820
新日本空調	14.3	14.1		25,563
九電工	38	41.2		110,251
三機工業	38.4	39.4		56,381
日揮ホールディングス	180.7	176.6		315,584
中外炉工業	5.9	5.8		9,784
ヤマト	17.3	15.6		11,466
太平電業	12	11.8		31,600
高砂熱学工業	49	49.2		77,637
三晃金属工業	2.1	2.4		6,700
朝日工業社	4	7.6		11,985
明星工業	35	32.7		24,067
大気社	26.3	26.7		81,969
ダイダン	12	12.1		24,405
日比谷総合設備	17.4	17.5		32,970
フィル・カンパニー	3.1	3.2		3,891
テスホールディングス	9.9	16.9		23,254
インフロア・ホールディングス	—	235.4		222,453
東洋エンジニアリング	22.8	25.5		16,218
レイズネクスト	29.1	27.1		31,246
<b>食料品(3.2%)</b>				
ニッポン	50.7	50.5		81,002
日清製粉グループ本社	195.9	195.1		297,137
日東富士製粉	1.3	2.8		11,704
昭和産業	14.6	16.3		39,869
鳥越製粉	15.4	15.1		9,648
中部飼料	21.2	20.7		21,072
フィード・ワン	23.3	23.9		15,750

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
東洋精糖	2.9	3.3		3,144
日本甜菜製糖	9	10.1		17,069
DM三井製糖ホールディングス	13.7	16.3		30,578
塩水港精糖	20.7	23.1		4,943
日新製糖	8.2	9.2		16,385
森永製菓	40.7	41.2		162,946
中村屋	4.2	4.2		12,936
江崎グリコ	47.7	48		182,880
名糖産業	7.6	7.5		11,880
井村屋グループ	9.8	10		23,320
不二家	11.1	10.8		26,103
山崎製パン	130	127.9		193,512
第一屋製パン	3.3	3.7		1,916
モロゾフ	2.8	5.9		19,411
亀田製菓	9.9	10.4		44,512
寿スピリッツ	16.7	17.5		127,750
カルビー	79	88.5		213,639
森永乳業	32.1	33.9		157,974
六甲バター	11.5	13.3		19,298
ヤクルト本社	119.3	130.2		910,098
明治ホールディングス	114.7	112.9		728,205
雪印メグミルク	41.7	43.9		76,693
プリマハム	24.4	24.3		51,831
日本ハム	66.3	70.1		277,946
林兼産業	5.7	5.9		2,967
丸大食品	17.1	18		26,568
S F o o d s	15.6	17.4		52,809
柿安本店	6	6.7		16,260
伊藤ハム米久ホールディングス	111.6	125		82,750
サッポロホールディングス	59.2	60		168,060
アサヒグループホールディングス	378.8	416.3		1,813,819
キリンホールディングス	735.4	713.8		1,424,744
宝ホールディングス	128.5	116		111,128
オエノンホールディングス	49.3	52.5		15,592
養命酒製造	5.3	5.5		9,537
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	132.8	128.1		179,596
サントリー食品インターナショナル	116	129.9		633,262
ダイドーグループホールディングス	9.8	10		49,000
伊藤園	52.6	59		323,320
キーコーヒー	17	18.2		37,692
ユニカフェ	5.2	5.8		5,469
ジャパンフーズ	2.5	2.8		3,298
日清オイリオグループ	22.2	23		69,460
不二製油グループ本社	42.3	42.1		74,938

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
かどや製油	1.9	1.8	6,120
Jーオイルミルズ	16.2	18.1	27,837
キッコーマン	124.8	124.3	856,427
味の素	412.4	397.9	1,254,180
ブルドックソース	7.9	7.3	13,183
キュービー	96.5	90.7	195,549
ハウス食品グループ本社	64.8	64.6	175,776
カゴメ	70.9	73.7	245,789
焼津水産化学工業	8.4	8.4	7,921
アリアケジャパン	15.8	17.7	86,287
ビエトロ	2.3	2.5	4,500
エバラ食品工業	3.8	4.2	12,747
やまみ	1.9	1.7	2,701
ニチレイ	82.6	77.8	177,150
東洋水産	89.2	88.8	426,240
イートアンドホールディングス	6	7.3	16,979
大冷	1.9	2.2	4,180
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9.7	10	5,470
日清食品ホールディングス	68	66.8	565,796
永谷園ホールディングス	8.5	8.6	17,621
一正蒲鉾	6.7	7.8	6,427
フジッコ	18.8	18.1	34,752
ロック・フィールド	18.7	19.8	27,937
日本たばこ産業	929.7	1,041.3	2,457,468
ケンコーマヨネーズ	10.6	10.2	13,800
わらべや日洋ホールディングス	11.3	12	19,836
なとり	9.7	10.8	22,140
イフジ産業	2.7	3.4	3,423
ビックスコーポレーション	4.1	9.3	12,657
ファーマフーズ	16.4	24.5	39,322
北の達人コーポレーション	60.5	—	—
ユウグレナ	88.3	99.8	86,526
紀文食品	10.1	15.1	14,994
ミヨシ油脂	6.1	7	7,252
理研ビタミン	16.4	17.7	29,151
<b>繊維製品(0.4%)</b>			
片倉工業	23	18.6	39,134
グンゼ	12.5	11.5	42,147
東洋紡	67.2	75.4	78,114
ユニチカ	50.9	54.1	13,038
富士紡ホールディングス	8.3	8.1	27,499
倉敷紡績	15.9	14.8	28,401
シキボウ	9.5	9.9	8,959
日本毛織	56.2	50.8	47,498
トーア紡コーポレーション	6.7	7	2,681

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
帝国繊維	19.3	20.6	30,405
帝人	159.5	170.8	230,409
東レ	1,225.8	1,242.3	833,831
サカイオーベックス	4.6	—	—
住江織物	3.7	3.4	5,895
日本フェルト	10.7	11.9	5,140
イチカワ	2.6	2.7	3,720
日東製網	1.8	2	2,754
アツギ	13.3	14.3	7,607
ダイニック	6.4	6.5	4,537
セーレン	41.8	36.5	74,715
ソトー	7	7.2	6,307
東海染工	2.3	2.4	2,822
小松マテーレ	28	29.5	40,120
ワコールホールディングス	42.3	42.1	85,673
ホギメディカル	22.9	24.3	75,330
T S I ホールディングス	52.1	60.1	19,833
マツオカコーポレーション	5.5	5.9	5,941
ワールド	22.3	24.9	35,905
三陽商会	8.8	8.6	7,748
ナイガイ	6.8	7.1	2,172
オンワードホールディングス	102.4	108.4	28,292
ルックホールディングス	5.9	6.2	10,223
ゴールドウイン	28	32.3	254,201
デサント	29	34	83,164
キング	9.4	9.3	5,022
ヤマトインターナショナル	15.5	15.7	4,474
<b>パルプ・紙(0.2%)</b>			
特種東海製紙	10.4	10.4	33,176
王子ホールディングス	761.7	751.6	426,908
日本製紙	74.8	81.5	77,914
三菱製紙	24	25.1	7,555
北越コーポレーション	121	116.7	70,953
中越パルプ工業	6.4	7.2	6,595
巴川製紙所	5.6	5.6	3,550
大王製紙	81.6	84.6	119,962
阿波製紙	4.4	4.5	1,426
レンゴー	174.5	157.4	110,967
トーモク	10.4	10.1	14,756
ザ・バック	12.8	12.8	28,633
<b>化学(6.4%)</b>			
北の達人コーポレーション	—	67.8	12,543
クラレ	266.5	262.9	287,875
旭化成	1,121.5	1,200.3	1,263,915
共和レザー	9.2	10.8	6,177

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
昭和電工	128.5	165.9	415,745	
住友化学	1,331.9	1,326.1	701,506	
住友精化	8.2	7.8	22,573	
日産化学	93.3	91.6	676,008	
ラサ工業	5.5	6.7	12,864	
クレハ	14.5	14.2	144,982	
多木化学	6.6	6.6	29,304	
テイカ	12.4	11.8	14,136	
石原産業	30.3	33.2	34,561	
片倉コープアグリ	4.4	4.3	5,878	
日本曹達	23.6	21.9	87,928	
東ソー	261.5	247.4	466,349	
トクヤマ	50.3	57.7	98,436	
セントラル硝子	32.3	29.3	82,245	
東亜合成	103.2	95.3	98,444	
大阪ソーダ	17.2	15.5	47,507	
関東電化工業	40.1	36.9	34,501	
デンカ	61.7	65.6	213,528	
信越化学工業	312.9	308.7	5,633,775	
日本カーバイド工業	6.2	6.8	9,805	
堺化学工業	11.9	12.6	23,990	
第一稀元素化学工業	17	16.6	17,546	
エア・ウォーター	172.5	161	280,623	
日本酸素ホールディングス	139.4	164.8	408,704	
日本化学工業	4.8	5.5	11,451	
東邦アセチレン	2.5	3.9	4,430	
日本パーカライジング	85.4	85	78,200	
高圧ガス工業	26.8	27.8	17,958	
チタン工業	2.1	2.2	3,960	
四国化成工業	22.5	22.7	28,375	
戸田工業	3.6	4	10,544	
ステラ ケミファ	9.2	9.5	24,576	
保土谷化学工業	5	5.4	19,440	
日本触媒	30.6	28.6	149,578	
大日精化工業	14	14.2	26,255	
カネカ	43.8	43.6	145,842	
三菱瓦斯化学	169.5	158.2	329,214	
三井化学	146.1	155.7	489,676	
J S R	169.8	176.6	712,581	
東京応化工業	29	29	216,630	
大阪有機化学工業	15.6	14.4	40,046	
三菱ケミカルホールディングス	1,131.1	1,206.6	934,391	
KHネオケム	27.9	29.8	74,827	
ダイセル	227.5	260.9	214,981	
住友ベークライト	26.6	27.8	122,181	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
積水化学工業	357.8	377.7	693,079	
日本ゼオン	152.6	151.9	207,039	
アイカ工業	47.1	47.4	135,801	
UBE	85.4	89.3	178,957	
積水樹脂	27.9	26.9	44,546	
タキロンシーアイ	36.6	41	21,853	
旭有機材	9.6	10.7	21,838	
ニチバン	8.9	10.4	16,764	
リケンテクノス	41.3	41.1	17,590	
大倉工業	8	8.7	14,607	
積水化成工業	22.7	23.5	9,470	
群栄化学工業	3.9	4	10,480	
タイガースポリマー	8.9	9.4	3,985	
ミライアル	5.4	6.1	10,949	
ダイキアクシス	6.5	7.4	5,698	
ダイキョーニシカワ	35.7	40	19,480	
竹本容器	6	6.8	5,548	
森六ホールディングス	9.1	9.5	17,746	
恵和	3.3	5.2	24,622	
日本化薬	104.7	136.6	149,713	
カーリットホールディングス	16.8	16.9	10,883	
日本精化	12.2	13.2	27,218	
扶桑化学工業	13.3	15.6	61,074	
トリケミカル研究所	15.7	19.5	50,329	
ADEKA	77.9	79	198,922	
日油	63.7	58.1	280,623	
新日本理化学	28	28.4	7,213	
ハリマ化成グループ	12.6	13.1	9,890	
花王	413.7	409	2,149,704	
第一工業製薬	5.7	6.6	14,902	
石原ケミカル	4.3	9.1	11,547	
日華化学	5.7	6.4	5,222	
ニイタカ	3.5	3.7	8,010	
三洋化成工業	10.1	11.3	52,149	
有機合成薬品工業	13	13.2	3,735	
大日本塗料	19.1	22	16,500	
日本ペイントホールディングス	698	712	694,912	
関西ペイント	190.1	174.7	280,393	
神東塗料	13.3	14.9	2,324	
中国塗料	40.8	42.2	36,629	
日本特殊塗料	12.7	12.3	11,168	
藤倉化成	22.8	23.6	11,328	
太陽ホールディングス	12.4	27.9	91,233	
D I C	71.5	72.4	181,072	
サカタインクス	36.9	37.6	35,607	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
東洋インキSCホールディングス	35.8	37.6		73,207
T&K TOKA	11.8	15.3		13,050
富士フイルムホールディングス	303.6	340.1		2,370,156
資生堂	343.3	360.4		1,979,677
ライオン	224.6	205.1		288,370
高砂香料工業	10.8	11.7		27,261
マンダム	36.2	38.7		55,263
ミルボン	23.1	23.9		124,041
ファンケル	62.9	78.3		169,362
コーセー	32.5	36.4		435,344
コタ	10.9	13.5		19,615
シーボン	2.2	2.5		4,422
ポーラ・オルビスホールディングス	73.7	82.6		131,416
ノエビアホールディングス	14.7	15		83,700
アジュバンホールディングス	3.9	4.3		4,420
新日本製薬	4.7	7.9		10,404
エステー	11.1	12.4		18,141
アグロ カネショウ	6.5	6.4		8,236
コニシ	28.4	30.2		47,776
長谷川香料	29.8	33.4		83,032
星光PMC	9.9	10.9		6,223
小林製薬	48.4	54.2		476,960
荒川化学工業	14.4	14.5		14,166
メック	11.8	13.7		39,976
日本高純度化学	4.7	4.8		11,049
タカラバイオ	45.2	50.6		92,092
JCU	19.4	20.4		75,174
新田ゼラチン	10.8	11.4		7,102
OATアグリオ	3.3	8		13,096
デクセリアルズ	48.3	50.4		209,916
アース製薬	13	15.9		82,362
北興化学工業	16.1	16.8		17,068
大成ラミック	5.3	5.4		14,250
クミアイ化学工業	71.4	72		72,648
日本農薬	30.8	34.5		24,736
アキレス	11.9	12.4		17,000
有沢製作所	24	26.9		29,321
日東電工	104.4	117		1,086,930
レック	20.5	23.7		16,945
三光合成	18.1	22.1		7,646
きもと	26.4	29.6		6,926
藤森工業	15.5	15.8		55,695
前澤化成工業	11	11.7		14,917
未来工業	6.2	6.9		10,908
ウェーブロックホールディングス	6	7.3		5,037

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
JSP	10.1	11.3		15,921
エフビコ	31.8	35.6		97,650
天馬	12.9	15.2		34,032
信越ポリマー	26.6	34.7		38,100
東リ	43	45.5		9,373
ニフコ	63.4	64.6		196,707
バルカー	14	15.7		43,175
ユニ・チャーム	366.3	373		1,678,127
ショーエイコーボレーション	3.8	5.2		3,120
<b>医薬品(5.2%)</b>				
協和キリン	173.8	205.5		574,783
武田薬品工業	1,437.4	1,520.9		5,694,249
アステラス製薬	1,497.9	1,654.3		3,377,253
住友ファーマ	128.1	119.5		130,374
塩野義製薬	217.3	230.9		1,573,814
わかもと製薬	20.6	20.2		5,393
日本新薬	49	45		362,700
ビオフェルミン製薬	2.9	—		—
中外製薬	540.4	605.2		2,126,672
科研製薬	29.6	28.5		103,740
ユーザイ	190.9	219.7		1,185,720
ロート製薬	82.3	94.6		324,005
小野薬品工業	396.7	393.8		1,362,941
久光製薬	50.2	44.3		152,613
持田製薬	24	22.5		70,087
参天製薬	300.6	345.1		362,009
扶桑薬品工業	5.6	6.4		14,444
日本ケミファ	2.1	2.1		4,032
ツムラ	57.6	56.9		168,367
日医工	48.9	57.2		20,763
キッセイ薬品工業	30.6	30.1		77,838
生化学工業	30.5	34.1		25,984
栄研化学	30.4	30.5		51,972
日水製薬	6.3	7.1		7,029
鳥居薬品	10.8	10.4		31,408
JCRファーマ	48.7	54.5		131,835
東和薬品	24.9	27.9		69,108
富士製薬工業	10.6	10.9		10,060
ゼリア新薬工業	31.3	30.9		62,912
第一三共	1,357.7	1,442.7		4,997,512
キョーリン製薬ホールディングス	38.1	36.2		61,431
大幸薬品	21.2	29.2		18,279
ダイト	11	12.2		32,195
大塚ホールディングス	359.1	379.8		1,662,384
大正製薬ホールディングス	41.1	39.2		193,452

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ペプチドリーム	89.1	101.5	166,764	
あすか製薬ホールディングス	19.7	19.6	19,560	
サワイグループホールディングス	37.8	38.9	150,932	
<b>石油・石炭製品(0.5%)</b>				
日本コークス工業	146	163.5	20,764	
ニチレキ	20.4	22.2	28,926	
ユシロ化学工業	9.7	9.5	9,367	
ビービー・カストロール	6.2	6.9	8,500	
富士石油	41.9	45.4	14,119	
MORESCO	6.2	6.4	7,808	
出光興産	191.7	202.8	707,772	
ENEOSホールディングス	2,599	2,910.9	1,506,099	
コスモエネルギーホールディングス	54.6	69.6	241,860	
<b>ゴム製品(0.7%)</b>				
横浜ゴム	100	98.5	163,805	
TOYO TIRE	90.9	95.7	165,178	
ブリヂストン	459.4	528.8	2,679,958	
住友ゴム工業	155.2	163.3	191,387	
藤倉コンポジット	15.1	15.5	13,671	
オカモト	10.5	9.9	38,362	
フコク	7.6	8.5	8,440	
ニッタ	17.9	18.8	52,489	
住友理工	33.5	37.5	21,112	
三ツ星ベルト	21	23.5	66,716	
バンドー化学	30.4	31.2	28,735	
<b>ガラス・土石製品(0.7%)</b>				
日東紡績	25.7	25.6	67,302	
AGC	158.6	168.6	832,041	
日本板硝子	87.7	89.3	34,469	
石塚硝子	2.9	3.1	5,359	
日本山村硝子	7.3	7.1	5,474	
日本電気硝子	64.1	73.8	202,581	
オハラ	6.9	7.8	9,539	
住友大阪セメント	31.1	32.9	109,557	
太平洋セメント	102.3	110	214,500	
日本ヒューム	15.9	17.2	11,902	
日本コンクリート工業	37.6	36.3	10,055	
三谷セキサン	8.1	8.3	42,911	
アジアパイルホールディングス	26.8	28.5	13,110	
東海カーボン	169	153.3	164,337	
日本カーボン	9.6	10	42,500	
東洋炭素	10.2	11.8	33,972	
ノリタケカンパニーリミテド	9.6	10.1	42,319	
TOTO	123.4	124.1	541,076	
日本碍子	190.2	197	372,330	
日本特殊陶業	131.5	139.1	340,099	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
MARUWA		6	6.7	105,458
品川リフラクトリイズ	4.1	4.6	16,767	
黒崎播磨	3	3.3	14,107	
ヨータイ	12.5	12.4	19,753	
イソライト工業	7.8	—	—	
東京窯業	22.4	21.4	5,970	
ニッカトー	8	8.5	4,080	
フジミインコーポレーテッド	13.9	15.5	88,815	
クニミネ工業	5.5	6.2	6,144	
エーアンドエーマテリアル	3.3	3.3	2,894	
ニチアス	43.7	42.2	94,950	
ニチハ	24.1	25.5	60,537	
<b>鉄鋼(0.8%)</b>				
日本製鉄	815.6	818.4	1,815,211	
神戸製鋼所	312.8	341.4	231,469	
中山製鋼所	23.9	28	12,096	
合同製鐵	9.3	9.7	12,367	
ジェイ エフ イー ホールディングス	494.4	467.6	743,016	
東京製鐵	66.6	59.1	91,605	
共英製鋼	19.3	19.8	25,898	
大和工業	36.3	32.6	141,321	
東京製鋼	6.6	8.1	9,825	
大阪製鐵	9.1	10.2	14,371	
淀川製鋼所	22.5	22.4	51,318	
丸一鋼管	55.5	57.2	169,197	
モリ工業	5.1	5	12,010	
大同特殊鋼	28	27.9	102,672	
日本高周波鋼業	6.5	7.3	2,489	
日本冶金工業	13.3	13.4	30,016	
山陽特殊製鋼	20.5	17.5	36,680	
愛知製鋼	9.6	10.8	21,729	
日立金属	161.1	206.2	425,390	
日本金属	4.3	4.8	5,654	
大平洋金属	11.6	11.8	34,314	
新日本電工	110.5	112	40,096	
栗本鐵工所	7.8	8.2	13,185	
虹技	2.4	2.6	2,545	
三菱製鋼	12.7	12.3	11,758	
日亜鋼業	25.3	23.1	5,913	
日本精線	2.5	3	12,495	
エンビプロ・ホールディングス	7.4	12.7	11,887	
シンニッタン	21	23.4	5,194	
新家工業	4.3	4.3	6,282	
<b>非鉄金属(0.8%)</b>				
大紀アルミニウム工業所	25.9	25.4	34,544	
日本軽金属ホールディングス	46.6	48.5	76,533	

銘柄	当期首(前期末)			当 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)
三井金属鉱業	46.1	51.7	176,555			
東邦亜鉛	9.5	10.1	24,108			
三菱マテリアル	112.9	115.9	230,525			
住友金属鉱山	218.4	221.3	1,196,569			
DOWAホールディングス	43.3	47.2	222,548			
古河機械金属	28.3	30.1	37,173			
大阪チタニウムテクノロジーズ	17.9	22.2	41,913			
東邦チタニウム	30.7	34.3	72,270			
UACJ	26	27.2	59,051			
CKサンエツ	3.6	3.8	15,656			
古河電気工業	53.1	56.7	123,039			
住友電気工業	596.3	683.7	997,176			
フジクラ	206.3	213.4	162,824			
昭和電線ホールディングス	16.6	16.7	29,475			
東京特殊電線	2.2	2.6	6,032			
タツタ電線	30.4	34	16,218			
カナレ電気	2.9	2.9	4,903			
平河ヒューテック	9.6	10.7	11,834			
リョービ	21.1	21	22,869			
アーレスティ	21.3	20.7	7,659			
アサヒホールディングス	64.2	76.7	160,379			
<b>金属製品(0.6%)</b>						
稲葉製作所	9.6	10	13,000			
官地エンジニアリンググループ	5.6	5.5	18,590			
トーカロ	44.1	49.4	67,134			
アルファC o	6	6.9	6,713			
SUMCO	217.9	308.5	636,127			
川田テクノロジーズ	3.5	3.7	12,617			
RS Technologies	5.5	6.2	37,634			
ジェイテックコーポレーション	1.9	2.5	5,692			
信和	9.1	11.9	9,436			
東洋製罐グループホールディングス	108.8	105.6	144,144			
ホッカンホールディングス	8.7	9.4	11,486			
コロナ	9.4	9.7	7,954			
横河ブリッジホールディングス	29.3	29.2	56,472			
駒井ハルテック	3.5	3.2	5,465			
高田機工	1.6	1.7	4,318			
三和ホールディングス	161.1	180.4	227,664			
文化シャッター	50.3	57.8	55,488			
三協立山	22	23.4	13,618			
アルインコ	11.3	13.1	11,095			
東洋シャッター	3.8	4.2	2,700			
L I X I L	235.3	301.2	768,060			
日本ファイルコン	11.9	12.4	6,212			
ノーリツ	35.4	32.6	49,943			

銘柄	当期首(前期末)			当 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)
長府製作所	17.4	19.5	35,100			
リンナイ	33.2	34.1	298,034			
ダイニチ工業	8.2	9.2	5,934			
日東精工	21.4	22.4	11,222			
三洋工業	2.1	2.3	4,146			
岡部	34.6	31.6	20,066			
ジーテクト	21.2	22	28,028			
東ブレ	31.9	31.4	31,902			
高周波熱錬	32.9	30.3	19,604			
東京製網	12.2	11.7	10,904			
サンコール	14.6	16.4	10,496			
モリテック スチール	13.3	14.9	4,619			
パイオラックス	25.3	25.9	43,512			
エイチワン	16.8	17.6	10,331			
日本発條	170.2	166.2	155,729			
中央発條	8.2	9.2	6,504			
アドバネクス	2.5	2.5	4,090			
立川ブラインド工業	7.5	7.8	8,494			
三益半導体工業	13.3	14.9	36,311			
<b>機械(5.4%)</b>						
日本ドライケミカル	4.3	4.5	6,889			
日本製鋼所	51.9	52.2	169,911			
三浦工業	74	77.9	227,779			
タクマ	58	58.4	84,154			
ツガミ	35.5	40.3	49,286			
オークマ	20	19.7	105,592			
芝浦機械	17.8	21.7	68,355			
アマダ	250.6	302.3	315,903			
アイダエンジニアリング	45	44.8	41,619			
滝澤鉄工所	5	5.6	7,442			
F U J I	68.3	80.4	180,980			
牧野フライス製作所	20.1	20	85,800			
オーエスジー	84.4	85.6	146,033			
ダイジェット工業	2.1	2.4	2,172			
旭ダイヤモンド工業	45.3	48.4	29,136			
DMG森精機	108.2	108.6	214,919			
ソディック	41.1	41.8	31,893			
ディスコ	23.2	28.2	992,640			
日東工器	8.2	9.7	14,433			
日進工具	13.5	15.1	20,490			
パンチ工業	14.4	16.4	7,691			
富士ダイス	8.7	9.8	6,566			
豊和工業	9.7	10.2	8,302			
OKK	6.6	7.1	7,753			
東洋機械金属	12.4	12.6	7,686			

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
津田駒工業	3.3	3.4		1,876
エンシュウ	4.4	4.6		3,496
島精機製作所	25.1	28.1		56,762
オプトラン	21.5	24		48,528
N Cホールディングス	5.3	4.9		8,962
イワキポンプ	11	12.3		12,140
フリュー	16.8	17.1		17,801
ヤマシンフィルタ	34.6	33.2		10,159
日阪製作所	21.2	21.1		17,470
やまびこ	33.2	33.7		40,507
野村マイクロ・サイエンス	—	6.3		26,964
平田機工	8.1	8.6		36,163
ペガサスミシン製造	17.5	19.6		11,191
マルマエ	7.1	7.9		16,724
タツモ	7.3	9		10,800
ナブテスコ	100.7	104.3		329,588
三井海洋開発	18.2	20.4		25,663
レオン自動車	16.8	20.5		27,654
SMC	50.6	56.7	3,766,014	
ホソカワミクロン	6	12.8		32,460
ユニオンツール	6.4	7.2		26,460
オイレス工業	24	25.5		39,856
日精エー・エス・ピー機械	5.8	7.1		22,400
サトーホールディングス	22.5	25.2		48,031
技研製作所	15.1	17		61,880
日本エアータック	5.7	8.9		9,763
カワタ	4.8	5.9		6,035
日精樹脂工業	13.3	12.8		11,622
オカダアイヨン	5.5	6.1		9,351
ワイエイシイホールディングス	6.8	7.6		13,976
小松製作所	782.8	877	2,816,924	
住友重機械工業	99	105.9		326,172
日立建機	80.8	77.6		234,352
日工	26.1	25.3		15,508
巴工業	6.8	7.2		17,496
井関農機	17.4	16.3		20,179
TOWA	16.2	16.6		30,643
丸山製作所	3.6	3.5		5,439
北川鉄工所	7.9	8.1		11,542
ローツェ	7.6	9.5		104,690
タカキタ	6.2	6.3		3,641
クボタ	907.6	937.5	2,253,281	
荏原実業	4.4	9		21,816
三菱化工機	5.6	6		12,510
月島機械	32	32.3		28,811

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
帝国電機製作所	12.1	12.8		20,531
新東工業	41.3	38.7		26,470
澁谷工業	15.2	15.9		36,824
アイチ コーポレーション	29.6	27.9		25,249
小森コーポレーション	44.1	47.1		35,984
鶴見製作所	13.4	14.2		25,616
住友精密工業	2.6	2.9		7,943
日本ギア工業	7.2	7.2		1,951
酒井重工業	3.1	3.3		9,781
荏原製作所	71.7	77.5		427,800
石井鐵工所	2.5	2.5		7,162
西島製作所	17.7	16.5		21,466
北越工業	17.9	17		13,906
ダイキン工業	220.1	223.1	4,604,784	
オルガノ	5.6	5.6		55,664
トーヨーカネツ	6.6	7		19,586
栗田工業	93.5	100.1		496,496
椿本チエイン	24.7	25.4		79,121
大同工業	8.4	8.4		7,005
木村化工機	14.6	15.7		10,424
アネスト岩田	29.2	30.2		26,032
ダイフク	95.1	96.4		795,300
サムコ	4.3	5.2		13,972
加藤製作所	9.7	9.5		7,647
油研工業	3	3.2		5,664
タダノ	83.6	96.3		92,448
フジテック	59.5	62.7		164,838
CKD	40.1	51.7		98,281
キトー	14.6	15.6		41,277
平和	48.2	54		104,544
理想科学工業	12.7	15.7		33,990
SANKYO	41.1	41.8		178,277
日本金銭機械	19.3	19.8		13,642
マースグループホールディングス	11	12.3		21,008
フクシマガリレイ	11.9	12.4		42,222
オーイズミ	7.5	7		3,010
ダイコク電機	8	9		10,548
竹内製作所	28.9	29.5		68,646
アマノ	45.3	50.7		125,533
JUKI	24	26.9		18,776
ジャノメ	15.8	16.6		11,586
マックス	23.2	23.9		37,546
グローリー	44.4	47.2		94,872
新晃工業	16.1	18.1		27,475
大和冷機工業	27.8	28.1		29,027

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
セガサミーホールディングス	157.2	192	459,456			
日本ビストンリング	6.4	7.1	9,222			
リケン	8	7.5	17,437			
T P R	23.3	23.2	28,628			
ツバキ・ナカシマ	33.3	42.6	41,322			
ホシザキ	54.4	56.6	438,084			
大豊工業	14.2	15.9	11,257			
日本精工	354.9	342.4	256,800			
NTN	399.8	373.2	97,778			
ジェイテクト	165.8	172	169,076			
不二越	16.1	14.5	53,940			
日本トムソン	47.5	47.3	26,629			
THK	107.7	109.3	302,542			
ユーシン精機	11.6	15.1	10,464			
前澤給装工業	12.1	13.3	10,932			
イーグル工業	21.4	22	21,450			
前澤工業	10.5	12.2	7,259			
日本ビラー工業	17.5	17.6	50,723			
キッツ	53.5	58.1	39,682			
マキタ	225.3	224.3	798,059			
三井E&Sホールディングス	—	70.2	25,342			
日立造船	137.3	157.2	125,288			
三菱重工業	271.5	290.6	1,446,316			
I H I	116.2	120.9	447,330			
スター精密	26.7	27	45,468			
<b>電気機器 (18.3%)</b>						
日清紡ホールディングス	105.7	111.7	115,386			
イビデン	83.3	96.2	459,355			
コニカミノルタ	352.2	405.5	175,987			
ブラザー工業	211.4	226.3	540,178			
ミネベアミツミ	298.2	317	745,584			
日立製作所	830.7	930.7	6,310,146			
東芝	341.9	338.2	1,971,029			
三菱電機	1,727.6	1,849	2,622,806			
富士電機	104.1	110.6	668,024			
東洋電機製造	7	6.6	5,979			
安川電機	186	197.6	883,272			
シンフォニアテクノロジー	22.5	20.9	28,424			
明電舎	29.4	29.2	60,502			
オリジン	4.9	4.6	5,915			
山洋電気	8.5	7.8	42,978			
デンヨー	14.8	14.7	23,475			
P H Cホールディングス	—	30.7	44,607			
東芝テック	18.6	20.8	84,136			
芝浦メカトロニクス	3.2	3.5	37,520			

銘柄	当期首(前期末)			当 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)
マブチモーター	48.1	44.7	159,355			
日本電産	415.9	453.9	3,922,603			
トレックス・セミコンダクター	9.8	9.2	27,176			
東光高岳	9.5	11.4	20,303			
ダイヘン	18.9	19	78,375			
ヤーマン	28.9	32.6	39,315			
J V Cケンウッド	154.1	164	31,160			
ミマキエン지니어リング	17	19.5	11,173			
I - P E X	8.5	9.9	13,761			
日新電機	40.6	45.3	67,995			
大崎電気工業	34.6	33.5	16,616			
オムロン	143.8	161.1	1,196,167			
日東工業	25.4	24.3	53,217			
I D E C	23.2	24	63,408			
正興電機製作所	6.1	6.7	7,316			
不二電機工業	3.7	4.6	5,451			
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62.4	60.3	125,544			
サクサホールディングス	4.2	4.5	6,817			
メルコホールディングス	6.2	5.4	19,764			
テクノメディカ	4.5	5.1	8,246			
日本電気	219.5	235	1,236,100			
富士通	155.5	174.1	3,394,950			
沖電気工業	70.3	75.1	56,700			
岩崎通信機	7.6	7.9	6,912			
電気興業	8.4	9.6	24,480			
サンケン電気	20.2	17.1	93,879			
ナカヨ	3.5	3.3	3,709			
アイホン	9.9	9.5	16,150			
ルネサスエレクトロニクス	744.7	1,052.4	1,610,172			
セイコーエプソン	214.4	224.1	482,935			
ワコム	126.6	151.3	146,761			
アルバック	31.8	38.5	213,290			
アクセル	8.3	9.1	7,689			
E I Z O	14.7	14.1	49,279			
日本信号	40.4	43.8	39,901			
京三製作所	37.5	39	16,965			
能美防災	23.4	23.9	40,653			
ホーチキ	13.4	13.7	16,714			
星和電機	10.4	10.8	5,000			
エレコム	40.1	45.1	70,401			
パナソニック ホールディングス	1,842.6	2,063.8	2,473,464			
シャープ	229.8	196.1	209,238			
アンリツ	103.9	124.6	179,922			
富士通ゼネラル	52.8	52.5	132,877			
ソニーグループ	1,082.3	1,212.1	14,539,139			

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
TDK	83.5	280.5	1,238,407
帝国通信工業	8.6	9.4	13,667
タムラ製作所	62.4	71.3	39,286
アルプスアルパイン	142	163.3	227,803
池上通信機	5.5	5.7	3,448
日本電波工業	—	20.4	23,276
鈴木	8.8	11	9,394
メイコー	—	21.2	96,248
日本トリム	4	4.2	10,134
ローランド ディー、ジー、	10.7	11.8	37,347
フォスター電機	17.6	18.5	13,042
SMK	4.5	4.5	9,792
ヨコオ	13.9	13.9	33,554
ホシデン	48.2	45	56,115
ヒロセ電機	26.6	28.3	502,608
日本航空電子工業	39.7	40.7	80,626
TOA	20.6	20.7	16,767
マクセル	35.2	37.3	46,028
古野電気	23.2	24.2	24,514
ユニデンホールディングス	4.5	4.2	14,196
スミダコーポレーション	15.7	19.6	16,444
アイコム	7.2	6.5	15,710
リオン	7.7	7.4	19,173
本多通信工業	15.6	17.5	9,030
横河電機	173	182.9	421,767
新電元工業	6.7	7	22,750
アズビル	116.9	113.4	425,250
東亜ディーケーケー	9.8	10.8	10,497
日本光電工業	71.7	76.8	233,472
チノー	5.6	6.1	10,351
共和電業	18.7	18.5	6,382
日本電子材料	7.2	9.3	17,577
堀場製作所	34.2	34.1	226,083
アドバンテスト	128.5	143.8	1,264,002
小野測器	9.2	10.3	4,532
エスベック	15.8	15.4	27,612
キーエンス	169.6	175.3	9,052,492
日置電機	8.5	9.4	67,586
シスメックス	134.9	147.1	1,237,699
日本マイクロニクス	30.7	31.3	46,167
メガチップス	17.6	17.5	63,175
OBARA GROUP	8.1	8.4	24,628
澤藤電機	2.3	3.2	4,883
原田工業	8.2	10.5	10,174
コーセル	22	23	17,986

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
イリソ電子工業	14.7	16.6	55,444
オブテックグループ	28.9	32.4	64,249
千代田インテグレ	7.8	8.2	16,072
アイ・オー・データ機器	7.3	—	—
レーザーテック	75.9	81.3	1,514,212
スタンレー電気	121.2	128.7	300,643
岩崎電気	7	6.9	17,201
ウシオ電機	89.2	94.8	166,089
岡谷電機産業	15.3	18.2	5,296
ヘリオス テクノ ホールディング	18.9	20.6	6,056
エノモト	5.4	6.1	10,138
日本セラミック	17.9	18.6	39,357
遠藤照明	10.1	10.4	8,392
古河電池	13	14.8	17,819
双信電機	10.5	11.3	6,723
山一電機	11.9	13.7	25,687
図研	11.6	13	37,011
日本電子	31.6	38.4	240,768
カシオ計算機	139	124.7	147,146
ファナック	151.6	169.8	3,619,287
日本シイエムケイ	39.4	38.1	17,792
エンプラス	8.1	5.1	17,161
大真空	6.2	25.8	26,445
ローム	71.9	82.6	883,820
浜松ホトニクス	124.1	132.4	801,020
三井ハイテック	17.2	17.5	191,800
新光電気工業	58.3	57.1	277,220
京セラ	263.5	272.4	2,001,867
太陽誘電	77	88.9	464,947
村田製作所	507.6	541.5	4,465,750
双葉電子工業	30.8	34.9	24,011
北陸電気工業	7.6	8.2	9,987
ニチコン	55.3	55.6	73,670
日本ケミコン	17.4	19	34,637
KOA	24.6	28.3	48,251
市光工業	27.3	26.6	9,496
小糸製作所	103.6	100.1	472,972
ミツバ	31.8	32	12,832
SCREENホールディングス	30	31.5	374,850
キヤノン電子	16.5	18.5	28,656
キヤノン	858.5	961.5	3,141,220
リコー	439.6	486	517,590
象印マホービン	47.4	50.3	69,665
MUTOHホールディングス	2.9	3	6,492
東京エレクトロン	101.2	122.8	7,337,300

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
<b>輸送用機器 (7.9%)</b>			
トヨタ紡織	50.4	71.4	149,368
芦森工業	3.3	3.6	3,880
ユニプレス	28.4	30.8	26,549
豊田自動織機	139.8	143.6	1,191,880
モリタホールディングス	27.7	31	40,858
三櫻工業	24	26.8	17,312
デンソー	380.4	394.5	3,105,109
東海理化電機製作所	45.5	50.9	71,412
三井E&Sホールディングス	66.9	—	—
川崎重工業	134.4	134.5	338,536
名村造船所	51.9	52.6	21,355
日本車輛製造	6.3	6.5	13,273
三菱ロジスネクスト	22.9	25.6	22,220
近畿車輛	3	2.9	3,543
日産自動車	2,037.5	2,282	1,146,248
いすゞ自動車	458.7	576.1	863,573
トヨタ自動車	1,750.2	9,148.4	19,454,072
日野自動車	215.7	241.6	171,536
三菱自動車工業	639.5	716.2	275,020
エフテック	12.2	12.7	7,226
レシップホールディングス	6.8	7.7	4,481
GMB	3.2	3.5	2,495
ファルテック	3.1	3.4	2,097
武蔵精密工業	38.5	43.1	59,995
日産車体	25.3	28.3	16,753
新明和工業	48.8	51.9	50,550
極東開発工業	29.8	32.5	45,175
トビー工業	14.3	14.9	19,295
ティラド	5.4	5	14,185
曙ブレーキ工業	94.8	106.2	15,611
タチエス	26.5	32.5	36,985
NOK	83.6	79.8	93,605
フタバ産業	43.4	44.8	17,113
KYB	19.3	18	53,154
大同メタル工業	35.8	37.1	19,477
プレス工業	85.9	88.9	36,715
ミクニ	22.2	23.2	8,328
太平洋工業	36.3	38.1	39,928
河西工業	23.5	23.7	6,825
アイシン	126.5	141.6	584,100
マツダ	542.2	582	636,708
今仙電機製作所	15.2	12.7	7,442
本田技研工業	1,360.3	1,451	4,619,984
スズキ	342.4	403.3	1,544,639

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
SUBARU	495.1	523.7	1,116,790
安永	8.4	8.3	5,810
ヤマハ発動機	244.1	252.5	659,782
TBK	20.7	20	6,820
エクセディ	23.5	29.2	48,851
豊田合成	55.8	57.3	117,006
愛三工業	27.2	30.3	22,361
盟和産業	2.7	2.7	2,835
日本プラス	14.7	14.4	6,465
ヨロズ	14.9	16.1	13,057
エフ・シー・シー	28.3	31.6	42,028
シマノ	64.7	73.7	1,692,520
テイ・エス テック	80.3	81.7	107,108
ジャムコ	10.1	11.3	10,633
<b>精密機器 (2.8%)</b>			
テルモ	529.6	547.5	2,310,997
クリエートメディック	5.7	5.8	5,846
日機装	55.8	52.1	42,878
日本エム・ディ・エム	10	11.2	17,281
島津製作所	222.3	237.2	1,114,840
JMS	14.6	15.4	8,824
長野計器	12.5	13.3	15,348
プイ・テクノロジー	8.1	8.5	24,777
東京計器	11	12.3	16,568
愛知時計電機	2.3	7.4	11,181
インターアクション	8.7	9.7	20,680
オーバル	15.6	17.4	5,689
東京精密	29.1	31	153,450
マニー	68.8	72.8	106,724
ニコン	263.9	280.4	448,920
トプコン	87	91	168,350
オリンパス	955.9	962.7	2,619,506
理研計器	15.2	13.8	59,823
タムロン	13.9	14	34,384
HOYA	340	373.6	5,239,740
シード	6.8	9.1	4,550
ノーリツ鋼機	15.5	17.4	40,890
A&Dホロンホールディングス	14.6	21.8	22,192
朝日インテック	181.9	212.2	414,638
シチズン時計	219.3	201.5	111,832
リズム	5.5	6.1	10,967
大研医器	13.7	15.4	8,115
メニコン	26.6	61.2	168,116
シンシア	1.9	2.1	963
松風	7.9	7	10,514

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
セイコーホールディングス	24.5	27.4	72,116	
ニプロ	128.8	137.4	142,346	
<b>その他製品(2.4%)</b>				
中本パックス	4.4	5.4	8,758	
スノーピーク	10.2	25.2	67,611	
パラムウントベッドホールディングス	33.1	37.1	75,498	
トランザクション	9.5	11.8	12,567	
粧美堂	5	5.1	2,121	
ニホンフラッシュ	14.8	15.6	13,930	
前田工織	19	18.7	49,742	
永大産業	22.6	22.5	6,052	
アートネイチャー	16.6	16.5	12,540	
バンダイナムコホールディングス	142.9	164.5	1,600,091	
アイフィスジャパン	4.4	4.9	3,449	
共立印刷	28.9	28.5	4,360	
SHOE I	16.2	17.3	83,991	
フランスベッドホールディングス	22.2	24.9	22,559	
パイロットコーポレーション	29.2	29.3	147,086	
萩原工業	9.6	11.9	13,566	
トッパン・フォームズ	30.8	—	—	
フジシールインターナショナル	35.5	42.2	66,211	
タカラトミー	77.5	79.9	103,230	
広済堂ホールディングス	12	12	12,168	
エステールホールディングス	4.6	4.3	2,734	
タカノ	5.9	6.6	5,643	
プロネクサス	13.9	15	16,785	
ホクシン	10.7	13.6	1,985	
ウッドワン	5.8	5.9	7,203	
大建工業	11.6	10.3	19,147	
凸版印刷	262.6	266.1	648,485	
大日本印刷	208.7	216	641,952	
共同印刷	5.3	5.2	13,520	
N I S S H A	35.5	35.6	53,649	
光村印刷	1.5	1.6	2,040	
TAKARA & COMPANY	8.5	11.3	20,419	
アシックス	152.8	155.9	356,075	
ツツミ	4.3	4.8	9,408	
ローランド	13.4	13.5	63,112	
小松ウオール工業	5.3	5.9	11,381	
ヤマハ	102.7	112.5	606,375	
河合楽器製作所	4.8	5.1	14,703	
クリナップ	16.1	18	9,990	
ビジョン	110.9	116.9	219,772	
オリバー	3.7	—	—	
兼松サステック	1.1	1.2	1,930	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
キングジム	14.3	15.1	13,816	
リントック	37	38.4	91,660	
イトーキ	34.3	35.7	14,601	
任天堂	98.9	109.2	6,369,636	
三菱鉛筆	28.4	28	37,744	
タカラスタンダード	35.7	34.1	42,284	
コクヨ	82.9	87.7	147,248	
ナカバヤシ	17	16.1	7,937	
グローブライド	8.4	15.4	34,865	
オカムラ	59.4	58.4	65,875	
美津濃	17.1	17	37,961	
<b>電気・ガス業(1.3%)</b>				
東京電力ホールディングス	1,465.4	1,448.1	703,776	
中部電力	528.5	561.6	736,819	
関西電力	654.6	695.6	882,716	
中国電力	249.2	286.9	249,889	
北陸電力	157.9	168.5	88,462	
東北電力	404.6	433	312,193	
四国電力	143.6	165.3	127,611	
九州電力	381.5	379.8	321,690	
北海道電力	161.7	168.1	83,881	
沖縄電力	33.6	41	49,405	
電源開発	137.5	150.3	309,016	
エフオン	10.4	11.7	6,388	
イーレックス	25.4	26.1	54,575	
レノバ	29.3	37.9	73,563	
東京瓦斯	332.2	353.3	907,627	
大阪瓦斯	312.9	333.8	813,136	
東邦瓦斯	85	80.1	227,083	
北海道瓦斯	9.3	9.6	15,993	
広島ガス	35.6	34.8	11,170	
西部ガスホールディングス	19.4	19.5	38,317	
静岡ガス	49	47.3	39,306	
メタウォーター	19.4	20.1	42,109	
<b>陸運業(3.0%)</b>				
SBSホールディングス	12.8	14.3	42,256	
東武鉄道	180.1	180.7	524,572	
相鉄ホールディングス	59.2	59	132,750	
東急	435.7	463	691,259	
京浜急行電鉄	221.9	226.4	306,772	
小田急電鉄	276.7	258.3	443,501	
京王電鉄	96.5	90.1	387,880	
京成電鉄	129.5	120.9	418,918	
富士急行	23.6	20.9	86,108	
新京成電鉄	4.4	4.5	12,915	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
東日本旅客鉄道	304.1	310.3	2,076,527
西日本旅客鉄道	153.9	215	1,033,075
東海旅客鉄道	143.6	144.4	2,358,052
西武ホールディングス	208.2	239.7	325,992
鴻池運輸	27.5	28.5	32,205
西日本鉄道	47.9	48.9	135,697
ハマキョウレックス	13.3	12.9	37,126
サカイ引越センター	7.9	8.9	39,471
近鉄グループホールディングス	163.6	175.6	663,768
阪急阪神ホールディングス	218.2	219	754,455
南海電気鉄道	77.6	78.3	192,226
京阪ホールディングス	72.9	74.8	225,522
神戸電鉄	3.9	4.4	15,004
名古屋鉄道	134.5	185.1	402,037
山陽電気鉄道	11.7	13.4	28,649
アルプス物流	11.4	12.8	15,065
日本通運	56.6	—	—
ヤマトホールディングス	229.3	256.8	574,975
山九	42	45.8	177,933
丸運	9.3	9.3	2,185
丸全昭和運輸	13.3	13.2	40,590
センコーグループホールディングス	90.2	88.1	75,237
トナミホールディングス	3.9	3.8	12,996
ニッコンホールディングス	54.9	58.8	119,540
日本石油輸送	1.8	2	5,158
福山通運	20.9	25.7	84,553
セイノーホールディングス	122.5	108.1	110,586
エスライン	4.5	5.2	4,456
神奈川中央交通	4.1	4.5	15,952
日立物流	36	35.4	300,192
丸和運輸機関	34.5	33.5	52,762
C&Fロジホールディングス	16.5	16.5	17,539
九州旅客鉄道	126.6	129.2	336,824
S Gホールディングス	309.1	320.6	722,311
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	57.4	428,204
<b>海運業(0.7%)</b>			
日本郵船	137.2	153.6	1,678,848
商船三井	97.4	291	1,037,415
川崎汽船	50.4	56.4	598,404
N Sユナイテッド海運	8.4	10	43,150
飯野海運	79.4	82.2	55,074
共栄タンカー	4.7	6.8	7,568
乾汽船	11.2	11.5	21,033
<b>空運業(0.4%)</b>			
日本航空	398.6	402.7	961,647

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ANAホールディングス	441.6	446.1	1,160,529
パスコ	3.2	3.5	4,655
<b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b>			
トランコム	5	5.1	32,895
日新	13	13.8	23,253
三菱倉庫	56.6	51.1	156,877
三井倉庫ホールディングス	17.4	18.4	54,519
住友倉庫	57.8	57.1	125,848
澁澤倉庫	9	9.8	23,030
東陽倉庫	27.4	27.6	8,390
日本トランスシティ	36	35	18,585
ケイヒン	3.2	3.1	4,268
中央倉庫	10	10	9,960
川西倉庫	3	3.3	3,795
安田倉庫	13.4	13.2	12,658
ファイズホールディングス	2.9	3.9	2,956
東洋埠頭	5	5.3	7,117
宇徳	11.7	—	—
上組	90	94.5	244,944
サンリツ	4.2	4.8	3,580
キムラユニティー	4.4	4.8	7,320
キューソー流通システム	4.1	9.1	9,873
近鉄エクスプレス	30.9	34.6	144,455
東海運	9.3	10.4	3,120
エーアイティー	10.3	11.5	18,929
内外トランスライン	5.7	7.1	14,427
日本コンセプト	5.2	5.8	8,717
<b>情報・通信業(9.0%)</b>			
NECネットエスアイ	56.3	62.9	117,685
クロスキャット	4.8	10.1	8,776
システナ	60.7	271.4	119,687
デジタルアーツ	9.9	10.2	73,440
日鉄ソリューションズ	24.7	31.2	118,404
キューブシステム	9.4	9.8	9,339
WOW WORLD	2.8	2.8	3,211
コア	7.4	8.2	12,234
手間いらず	—	2.8	16,072
ラクーンホールディングス	12.1	16.3	23,895
ソリトンシステムズ	8.7	9.7	12,590
ソフトクリエイトホールディングス	6.8	8.3	35,233
T I S	169.7	171.1	593,717
J N Sホールディングス	8.3	8.8	3,546
電算システム	6.5	—	—
グリー	104.6	86.6	77,766
GMOペパボ	1.5	2.1	4,630

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
コーエーテックホールディングス	45.1	60.6	276,336
三菱総合研究所	7.4	8.9	36,846
電算	2	2.2	5,011
AGS	9.1	8.5	6,324
ファインデックス	14.6	16.3	10,106
ブレインパッド	4.5	16.3	18,174
KL a b	31.1	33.3	16,283
ポルトゥウィンホールディングス	22.9	27.7	28,918
イーブックイニシアティブジャパン	2.9	—	—
ネクソン	429.1	431.4	1,393,422
アイスタイル	52.4	50	10,750
エムアップホールディングス	4.5	22.1	26,011
エイチーム	11.9	12.6	9,235
エニグモ	16.3	20.9	11,662
テクノスジャパン	13.8	15.1	7,852
コロブラ	56.2	62.8	40,254
ブロードリーフ	84.7	94.7	36,648
クロス・マーケティンググループ	8.2	7.5	6,022
デジタルハーツホールディングス	8	8.7	16,547
システム情報	13.1	14.4	14,832
メディアドゥ	6.7	6.8	12,763
じげん	42.9	54.3	19,548
ブイキューブ	9.4	19.5	18,057
エンカレッジ・テクノロジー	3.6	4.6	2,350
サイバーリンクス	5.8	6.5	6,903
フィックスターズ	18.5	19.1	15,509
CARTA HOLDINGS	7.1	7.8	15,334
オブティム	12	13.5	11,326
セレス	5.7	7.3	10,125
SHIFT	8.5	11.1	227,550
ティーガイア	18.2	17	28,203
セック	2.6	2.9	7,174
日本アジアグループ	16.4	—	—
テクマトリックス	26.5	32.2	53,967
プロシップ	5.2	6.4	9,139
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41	49.4	122,314
GMOペイメントゲートウェイ	32.5	36.8	396,704
ザッパラス	7.3	7.4	2,871
システムリサーチ	5.1	5.6	11,698
インターネットイニシアティブ	45.3	50.6	238,832
さくらインターネット	18.8	20.7	11,840
ヴィンクス	5.2	5.5	5,978
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.8	4.3	24,768
SRAホールディングス	9.1	9.2	26,137
システムインテグレータ	5.4	6.4	3,129

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
朝日ネット	14.3	17.7	10,974
eBASE	20.7	23.1	11,203
アバント	18.4	20.5	27,162
アドソル日進	6.2	6.9	11,136
ODKソリューションズ	4	4.3	2,506
フリービット	10.5	10.1	9,100
コムチュア	15.7	21.4	61,268
サイバーコム	3.3	3.1	3,565
アステリア	12.7	13.9	14,219
アイル	9.6	9.7	13,977
マークラインズ	7.2	9.6	23,510
メディカル・データ・ビジョン	19.5	24.3	23,133
gumi	23.8	26.7	14,017
ショーケース	4.2	4.6	2,116
モバイルファクトリー	4.1	4.5	4,653
テラスカイ	5.6	7.1	10,110
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7.7	8.5	12,393
PCIホールディングス	6.7	8	8,480
パイプドHD	3.7	3.5	9,593
アイビーシー	3.1	3.3	1,689
ネオジャパン	3.4	5.5	7,056
PR TIMES	3.7	4.1	8,810
ラクス	51.2	87.2	141,961
ランドコンピュータ	2.9	4.5	4,167
ダブルスタンダード	2.3	5.8	11,965
オープンドア	10.2	11.4	22,412
マイネット	5.5	6.8	3,495
アカツキ	6.9	8.5	25,041
ベネフィットジャパン	1.5	1.5	3,049
Ubicomホールディングス	4.6	5.1	13,790
カナミックネットワーク	18.7	22.6	11,413
ノムラシステムコーポレーション	8.7	10.7	2,450
チェンジ	31.3	38.1	66,675
シンクロ・フード	11.1	10.4	3,276
オークネット	9.2	10.2	18,207
キャピタル・アセット・プランニング	3.7	3.8	2,667
セグエグループ	4.7	5.3	2,909
エイトレッド	3.4	2.8	5,740
AOI TYO Holdings	17.6	—	—
マクロミル	35.1	38.3	38,874
ビーグリー	3.6	4.6	6,835
オロ	5.5	5.9	10,968
ユーザローカル	2.6	5.9	10,590
テモナ	4	4.2	1,625
ニーズウェル	4.1	5.4	3,736

銘柄	当期首(前期末)			当 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)
マナーフォワード	—	38.7	140,868			
サインポスト	4.1	6.1	5,490			
電算システムホールディングス	—	7.9	19,291			
ソルクシーズ	6.9	16.7	6,412			
フェイス	5.6	5.3	3,604			
プロトコーポレーション	20.6	20.4	20,134			
ハイマックス	5.2	5.2	6,760			
野村総合研究所	294.6	342.5	1,233,000			
サイバネットシステム	12.5	13.8	10,350			
CEホールディングス	9.7	9.9	4,752			
日本システム技術	3.3	3.6	8,542			
インテージホールディングス	21.4	22	31,680			
東邦システムサイエンス	4.9	5.2	4,747			
ソースネクスト	81.7	82.8	19,044			
インフォコム	15.6	20.9	45,541			
シンプレクス・ホールディングス	—	30.1	58,454			
HEROZ	5	5.7	5,244			
ラクスル	18.5	22.1	47,271			
I P S	4.1	5.3	11,925			
F I G	19.7	21.3	6,624			
システムサポート	5.3	7	8,253			
イーソル	9.5	12	7,104			
アルテリア・ネットワークス	19	20.2	25,209			
E d u L a b	1.7	—	—			
東海ソフト	2.9	3.2	3,404			
ウイングアーク1 s t	9	14.6	20,600			
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4	4.4	7,312			
サーバーワークス	1.7	3.3	7,144			
東名	1.9	1.7	1,601			
ヴィッツ	1.8	1.9	2,257			
トビラシステムズ	2.5	4.1	3,325			
S a n s a n	15.1	62.8	66,819			
L i n k - U	3.4	3.7	2,442			
ギフティ	10.3	16.4	18,515			
ベース	2	3.3	20,592			
J M D C	—	23.8	127,568			
フォーカスシステムズ	11.8	12.3	11,414			
クレスコ	11.3	13.9	30,441			
フジ・メディア・ホールディングス	176.2	173.7	191,591			
オービック	53.4	59.8	1,153,542			
ジャストシステム	24.2	27.1	130,757			
T D C ソフト	15.2	15.8	16,621			
Zホールディングス	2,329.7	2,738.5	1,156,468			
トレンドマイクロ	90.6	95.9	729,799			
I Dホールディングス	6.7	12.2	10,638			

銘柄	当期首(前期末)			当 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	34.4	30.8	244,552			
アルファシステムズ	4.6	5.1	21,777			
フューチャー	20.6	40.2	68,058			
C A C H o l d i n g s	11.3	10.4	14,705			
S B テクノロジー	6.2	8.3	19,256			
トーセ	5.1	5.1	3,728			
オービックビジネスコンサルタント	17.3	18.2	81,718			
伊藤忠テクノソリューションズ	77.3	86.6	278,419			
アイティフォー	22.6	23.3	18,360			
東計電算	2.6	2.3	13,777			
エックスネット	3	3.2	3,225			
大塚商会	91.8	102.8	426,620			
サイボウズ	20	25.6	27,059			
電通国際情報サービス	21.1	24.9	103,086			
A C C E S S	21.6	21.8	12,927			
デジタルガレージ	28.1	31.5	126,630			
EMシステムズ	28.4	31.6	30,146			
ウェザーニューズ	5.2	6	40,620			
C I J	12	15	12,210			
ビジネスエンジニアリング	1.8	4.4	9,086			
日本エンタープライズ	19	20.6	3,399			
WOWOW	8.3	8.4	12,549			
スカラ	15.6	16.2	12,781			
インテリジェント ウェイブ	10.5	9.8	6,399			
I M A G I C A G R O U P	15.2	14.6	10,468			
ネットワンシステムズ	69.3	70.1	195,929			
システムソフト	37.5	53	5,883			
アルゴグラフィックス	13.3	14.8	46,768			
マーベラス	27.2	30.2	21,713			
エイベックス	29.4	32.9	38,065			
B I P R O G Y	58.9	59.4	171,369			
兼松エレクトロニクス	9.3	10.4	40,872			
都築電気	7.8	9	12,276			
T B S ホールディングス	112.7	99.8	171,955			
日本テレビホールディングス	141.8	158.7	194,248			
朝日放送グループホールディングス	17.4	16.6	11,055			
テレビ朝日ホールディングス	52.6	45.8	67,142			
スカパーJ SATホールディングス	112.5	161.2	75,119			
テレビ東京ホールディングス	12.3	12.3	25,116			
日本BS放送	6.1	6.6	7,002			
ビジョン	21.4	31.4	42,390			
スマートバリュー	4.9	4.7	2,594			
USEN-NEXT HOLDINGS	—	15.7	32,043			
ワイヤレスゲート	7.8	8.5	2,643			
コネクション	9.9	13.6	18,346			

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
クロップス	3.5	3.7	3,866
日本電信電話	1,983	2,080.9	8,300,710
KDDI	1,359.6	1,384.3	6,298,565
ソフトバンク	1,540.9	2,876	4,289,554
光通信	20	21.9	319,521
エムティーアイ	17	16.4	7,429
GMOインターネット	60.1	66.6	172,494
ファイバーゲート	5.8	8.9	9,638
アイドママーケティングコミュニケーション	5.3	4.8	1,372
KADOKAWA	44	102.8	322,278
学研ホールディングス	24.2	27.1	22,926
ゼンリン	31.1	31.2	29,047
昭文社ホールディングス	7.6	8.2	3,476
インプレスホールディングス	14	15.7	3,485
アイネット	9	9.3	11,522
松竹	11.2	11.5	159,505
東宝	100.1	112.1	563,863
東映	5.6	5.6	100,912
エヌ・ティ・ティ・データ	451.6	505.6	1,029,907
ビー・シー・エー	2.6	11.3	14,147
ビジネスブレイン太田昭和	6	6.1	9,308
DTS	35.3	35.4	110,625
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72.4	88.4	562,224
シーイーシー	18.4	20.5	25,358
カブコン	145.4	179.1	651,924
アイ・エス・ビー	8.1	9.1	9,700
ジャステック	11.1	11.2	13,036
SCSK	39.2	131.5	285,486
日本システムウエア	5.8	7.2	17,913
アイネス	17	16	24,448
TKC	28.8	30	104,700
富士ソフト	18.1	18.9	138,537
NSD	54.7	59.6	138,689
コナミホールディングス	61.6	69	613,410
福井コンピュータホールディングス	7.9	8.8	30,052
JBCホールディングス	11.7	12.9	21,052
ミロク情報サービス	17	16.9	20,381
ソフトバンクグループ	1,345.2	1,138.6	6,100,618
<b>卸売業(5.7%)</b>			
ハウスイ	1.4	—	—
高千穂交易	6.6	6.9	12,468
オルパヘルスケアホールディングス	2.8	3.1	5,648
伊藤忠食品	4.1	4.1	19,844
エレマテック	13.6	15.3	19,706
JALUX	4.8	—	—

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
あらた	13.5	14.5	58,580
トーマンデバイス	2.2	2.9	17,777
東京エレクトロン デバイス	5.6	5.7	32,148
フィールズ	14.9	16.7	17,685
双日	939.8	200.5	417,842
アルフレッサ ホールディングス	176.5	202.4	343,270
横浜冷凍	47.7	48.7	41,492
ラサ商事	9	8.9	8,615
アルコニックス	18.1	24.1	31,619
神戸物産	117.4	137	432,235
ハイパー	3.5	4.8	2,265
あい ホールディングス	24.3	27.2	44,961
ディーブイエックス	5.2	6.5	7,111
ダイワボウホールディングス	77.5	84.9	146,282
マクニカ・富士エールホールディングス	40.6	45.5	129,038
ラクト・ジャパン	7.4	6.6	12,969
グリムス	5.1	8.5	13,013
バイタルケアエスケー・ホールディングス	29.6	31.3	21,628
八洲電機	13.2	13.8	13,758
メディアスホールディングス	9.7	10.9	11,957
レスターホールディングス	17.7	18.1	37,304
ジューテックホールディングス	3.9	4	3,992
大光	6.6	8.1	5,832
OCHIホールディングス	5	4.7	5,640
TOKAIホールディングス	82.5	92.4	80,665
黒谷	4.7	5.2	3,031
C o m i n i x	3	3.4	2,485
三洋貿易	17.2	18.1	17,267
ビューティガレージ	2.7	3.1	7,998
ウイン・パートナーズ	12.3	13.8	14,545
ミタチ産業	4.7	4.8	4,468
ジップヘルスケアホールディングス	60	57	132,297
明治電機工業	5.9	5.9	6,495
デリカフーズホールディングス	6.7	7.5	4,065
スターティアホールディングス	3.3	4.4	3,432
コメダホールディングス	37.1	41.6	92,643
ビーバンドットコム	2.4	2.7	1,474
アセンテック	4.4	6.6	5,035
富士興産	5.2	4.8	5,304
協栄産業	1.9	2	2,750
フルサト・マルカホールディングス	—	17.4	66,642
ヤマエグループホールディングス	—	11.4	13,053
小野建	15.3	17.5	24,395
南陽	3.5	3.7	6,793
佐鳥電機	10.6	11.9	13,649

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
エコートレーディング	3.6	4.1	2,337	
伯東	10.4	11.6	33,118	
コンドーテック	13.2	14.3	15,544	
中山福	9.9	10.1	3,353	
ナガイレーベン	22.6	23.8	45,672	
三菱食品	18.7	18.3	56,730	
松田産業	12.4	13.9	28,578	
第一興商	33.8	36.2	145,886	
メディパルホールディングス	170.5	186.1	335,166	
S P K	7.3	7.6	10,602	
萩原電気ホールディングス	6.3	6.7	13,601	
アズワン	12.2	27.3	178,815	
スズデン	5.9	6.2	12,592	
尾家産業	5	4.7	4,178	
シモジマ	10.4	11.7	11,395	
ドウシシャ	16.1	18	27,918	
小津産業	3.8	4.2	8,316	
高速	9	10.5	16,516	
たけびし	6	6.7	9,815	
リックス	3.9	4	7,520	
丸文	15.1	15.8	12,640	
ハビネット	14.2	15	23,685	
橋本総業ホールディングス	3.4	3.5	6,667	
日本ライフライン	55	56.5	52,658	
タカショー	11.1	14.7	11,142	
マルカ	5.5	—	—	
I D O M	57.4	57.9	39,082	
進和	10.1	11.3	24,939	
エスケイジャパン	4.2	4.7	2,124	
ダイترون	7.2	7.6	15,800	
シークス	21.7	25.3	27,172	
田中商事	5.3	5.9	3,687	
オーハシテクニカ	8.7	9.7	12,348	
白銅	6.1	6.2	15,493	
ダイコー通産	2	2.3	2,785	
伊藤忠商事	1,190.1	1,206.1	4,487,898	
丸紅	1,678	1,740.8	2,384,025	
高島	2.7	2.7	6,725	
長瀬産業	93.4	92	167,992	
蝶理	10.9	10.7	21,250	
豊田通商	170.9	177.3	888,273	
三共生興	25.8	24.5	13,646	
兼松	68	67.7	89,702	
ツカモトコーポレーション	2.8	3.2	4,147	
三井物産	1,357.4	1,414.2	4,508,469	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
日本紙パルプ商事	8.9	9.3	33,573	
カメイ	22.2	21.1	21,986	
東都水産	2	1	4,460	
O U Gホールディングス	2.7	2.8	7,736	
スターゼン	12.6	13.3	26,028	
山善	66.5	72.6	68,897	
椿本興業	3.1	3.4	12,002	
住友商事	1,073.8	1,152.8	2,164,958	
内田洋行	7.3	7.7	34,881	
三菱商事	1,036	1,309.2	5,890,090	
第一実業	7.7	7.8	24,726	
キャノンマーケティングジャパン	42.2	47.3	143,792	
西華産業	9	8.7	14,233	
佐藤商事	14.1	14	16,086	
菱洋エレクトロ	13	11.3	24,148	
東京産業	15.5	16.1	11,334	
ユアサ商事	17.4	16.2	52,326	
神鋼商事	3.8	4.3	16,641	
トルク	10.3	10.3	2,173	
阪和興業	34.1	34.8	106,662	
正栄食品工業	11	12.3	49,630	
カナデン	13.8	15.5	15,872	
菱電商事	12.3	15.1	25,232	
フルサト工業	8.6	—	—	
岩谷産業	40.8	43.4	234,794	
ナイス	6.7	6.1	10,126	
ニチモウ	2.7	2.4	5,964	
極東貿易	4.9	5.5	14,245	
アステナホールディングス	24.5	25.4	10,490	
三愛オプリー	41.9	44.1	42,115	
稲畑産業	40.9	38.2	85,568	
G S Iクレオス	8.4	9.1	11,711	
明和産業	15.8	17.6	12,584	
クワザワホールディングス	6.1	7.1	3,308	
ヤマエ久野	12.4	—	—	
ワキタ	33.5	36.5	40,953	
東邦ホールディングス	54.6	54.9	110,184	
サンゲツ	45.9	47.4	72,996	
ミツロコグループホールディングス	25.1	23.7	22,135	
シナネンホールディングス	6.3	6.5	21,775	
伊藤忠エネクス	37.7	42.2	43,845	
サンリオ	47.8	55.3	146,379	
サンワテクノス	11.2	10.3	14,358	
リョーサン	18.8	20	49,260	
新光商事	23	26.3	24,038	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
トーヨー	7.7	7.8	9,024	
三信電気	9.1	8.2	12,841	
東陽テクニカ	16.8	18.8	20,304	
モスフードサービス	24.1	25	77,250	
加賀電子	15.4	16.1	49,668	
ソーダニッカ	16.3	16.9	10,224	
立花エレテック	12.6	13.2	20,750	
フォーバル	6	7.3	6,599	
PALTAC	27.3	26.7	118,948	
三谷産業	22.5	29.8	9,387	
西本Wismettacホールディングス	3.9	4.3	15,243	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.5	1.7	3,298	
コア商事ホールディングス	12.8	12	10,164	
国際紙バルブ商事	36.4	36.8	14,131	
ヤマダネ	7.3	8.4	13,918	
丸紅建材リース	1.7	1.7	3,155	
日鉄物産	12.1	12.3	66,297	
泉州電業	4.8	4.9	25,921	
トラスコ中山	39	39.7	73,286	
オートバックスセブン	63.1	60.8	83,782	
モリト	12.5	13.9	10,160	
加藤産業	24.6	22.9	73,394	
北恵	4.3	4.9	4,410	
イノテック	9.6	11.6	15,694	
イエローハット	32.2	31	51,522	
JKホールディングス	15.4	14.1	12,986	
日伝	14.1	13.9	27,160	
北沢産業	11.7	11.2	2,363	
杉本商事	8.6	8.9	20,915	
因幡電機産業	45.4	48.6	127,526	
東テク	5.6	5.9	18,172	
ミスミグループ本社	213.5	239.3	689,662	
アルテック	12.6	12.2	2,903	
タキヒヨー	5.7	5.4	5,513	
蔵王産業	3.3	3.7	7,466	
スズケン	72.1	70.4	248,864	
ジェコス	11.8	13.2	11,008	
グローセル	18.5	21.3	8,775	
小売業(4.1%)				
ローソン	43.1	42.2	193,276	
サンエー	13	13.5	53,797	
カワチ薬品	12	14.9	30,694	
エービーシー・マート	26.6	29.8	163,304	
ハードオフコーポレーション	8	8.8	7,735	
アスクル	27.7	43.4	64,188	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ゲオホールディングス	23.1	24.1	28,703	
アダストリア	23.8	20.7	43,801	
くら寿司	20.1	20	60,000	
キャンドウ	8.3	7.2	17,964	
アイケイ	5.4	6.7	3,604	
バルグループホールディングス	15.1	16.9	26,533	
エディオン	72.5	87.8	106,852	
サーラコーポレーション	35.2	39.2	24,852	
ワッツ	8.7	9.7	7,323	
ハローズ	7	8.8	28,996	
フジオフードグループ本社	14.3	14.8	20,276	
あみやき亭	3.8	4.6	13,703	
大黒天物産	5.5	6.2	28,334	
ハニーズホールディングス	13.9	16	16,592	
ファーマライズホールディングス	4.6	4.8	3,384	
アルペン	13.2	14.3	27,556	
ハブ	6	6.9	3,567	
クオールホールディングス	23.2	23.7	29,056	
ジーンズホールディングス	11.6	11.1	46,287	
ビックカメラ	101.3	113.3	129,048	
DCMホールディングス	105.4	113.5	121,899	
MonotaRO	242.1	241.1	461,947	
東京一番フーズ	5	5.1	3,024	
きちりホールディングス	4.5	5.1	2,075	
アークランドサービスホールディングス	14.4	14.1	29,370	
J. フロント リテイリング	203.5	217.1	226,652	
ドール・日レスホールディングス	27.2	31.3	47,294	
マツキヨココカラ&カンパニー	70.4	113.6	571,408	
ブロンコビリー	9.1	10.4	25,282	
ZOZO	100.4	131.2	366,441	
トレジャー・ファクトリー	5.4	5.9	6,271	
物語コーポレーション	9.1	9.5	50,730	
ココカラファイン	15.2	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	298.2	302.2	327,584	
Hamee	4.6	7.1	8,754	
マーケットエンタープライズ	1.4	2.3	2,438	
ウエルシアホールディングス	90.1	100.9	261,633	
クリエイトSDホールディングス	25.2	28.2	82,597	
丸善CHIホールディングス	19.9	22.2	8,702	
ミサワ	4	4.4	2,772	
ティーライフ	2.6	2.8	4,113	
チムニー	5.2	5.8	7,128	
シュッピン	12	16.1	23,296	
オイシックス・ラ・大地	22.5	27.6	52,798	
ネクステージ	30.2	38.9	80,484	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ジョイフル本田	50.1	57.5	90,735
鳥貴族ホールディングス	6.5	6.7	12,709
ホットランド	13	14.5	19,792
すかいらくホールディングス	190.9	237.1	371,298
SFPホールディングス	8.3	9.3	14,284
綿半ホールディングス	13.1	13.8	18,547
ヨシックスホールディングス	3.5	3.9	8,287
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49.8	55.7	59,209
ゴルフダイジェスト・オンライン	9.1	10.2	12,291
BEENOS	8.7	9.8	17,718
あさひ	12.9	16	20,640
日本調剤	10.6	11.9	14,434
コスモス薬品	17.2	19.3	233,916
トーエル	8.8	9	7,848
オンリー	3.8	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	665.7	674.6	3,650,260
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	91.5	119.1	106,118
ツルハホールディングス	37.1	41.6	289,536
サンマルクホールディングス	13.7	15.3	23,577
フェリシモ	4.1	4.5	5,400
トリドールホールディングス	42.3	47.6	110,146
TOKYO BASE	15.9	18.5	6,142
ウイルプラスホールディングス	3	4	3,704
JMホールディングス	11.6	14.1	21,248
サツドラホールディングス	2.7	9.1	5,996
アレンザホールディングス	13.3	13.6	13,749
串カツ田中ホールディングス	4.7	5.3	9,757
パロックジャパンリミテッド	12.3	13.7	11,151
クスリのアオキホールディングス	17	17.7	97,350
力の源ホールディングス	7.7	9.7	6,576
FOOD & LIFE COMPANIES	99.7	102.4	291,532
メディカルシステムネットワーク	15.3	18	7,884
はるやまホールディングス	8.5	9.7	4,791
ノジマ	30.4	30.9	90,907
カッパ・クリエイト	23.9	26.7	38,047
ライトオン	12.7	14.2	10,550
良品計画	196	219.5	296,983
バリミキホールディングス	22.5	24.9	6,897
アドヴァングループ	17.7	17.7	13,558
アルビス	5.6	5.9	12,985
コナカ	20	21.2	7,123
ハウス オブ ローゼ	2.3	2.5	4,175
G-7ホールディングス	8.4	21.4	30,794
イオン北海道	22.6	28.1	29,982

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
コジマ	29.7	33.3	21,445
ヒマラヤ	6.3	6.5	6,142
コーナン商事	24.3	27.2	100,640
エコス	6.5	6.7	13,554
ワタミ	22.4	23.1	22,014
マルシェ	4.5	6.2	2,982
バン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	340.3	381.2	750,964
西松屋チェーン	37.6	39.3	57,810
ゼンショーホールディングス	91.5	93.1	281,162
幸楽苑ホールディングス	10.8	11.4	14,523
ハークスレイ	4	8.6	4,678
サイゼリヤ	25.4	28.4	68,756
VTホールディングス	64.9	72.5	33,712
魚力	5.5	5.4	12,717
フジ・コーポレーション	9.3	10.4	12,240
ユナイテッドアローズ	19.7	20.1	40,702
ハイデイ日高	24.8	27.7	55,039
YU-WA Creation Holdings	12.3	12.8	3,059
コロワイド	56.5	78.3	138,982
ピーシーデポコーポレーション	20.6	23.2	7,748
壺番屋	12.1	13.5	66,757
PLANT	4.9	5.1	3,294
スギホールディングス	34	38.1	203,835
薬王堂ホールディングス	7.6	9.7	19,215
スクロール	24.7	29.8	25,091
ヨンドシーホールディングス	15.9	16.8	29,064
木曽路	22.4	25.7	53,764
SRSホールディングス	22.4	27.5	23,870
千趣会	—	35.3	14,155
リテールパートナーズ	21	27.4	30,468
ケーヨー	31.7	35.4	34,479
上新電機	19.7	19.8	37,362
日本瓦斯	84.3	92.8	181,980
ロイヤルホールディングス	29.7	31.4	71,717
いなげや	19.1	20.6	25,296
チヨダ	18.2	17.5	12,512
ライフコーポレーション	17.1	15.9	42,453
リンガーハット	21	22.4	51,116
MrMaxHD	24	24.4	15,250
AOKIホールディングス	34.6	37.4	24,871
オークワ	26.9	28.3	24,507
コメリ	26.4	29.5	81,685
青山商事	38.3	37.7	32,459
しまむら	19.8	22.2	247,086

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
はせがわ	10.3	11.4		3,135
高島屋	124.1	131.9		170,282
松屋	37.4	34.4		27,726
エイチ・ツー・オー リテイリング	80.8	85.5		80,626
近鉄百貨店	6.6	6.2		15,543
丸井グループ	144	142.2		350,238
アクシアル リテイリング	14.2	13.5		41,580
イオン	654.8	663.6	1,582,686	
イズミ	34.6	31.6		88,416
平和堂	31.5	29.6		56,713
フジ	20.6	45.3		103,646
ヤオコー	19.3	21.7		142,352
ゼビオホールディングス	21	26.3		22,591
ケーズホールディングス	145.1	167		218,937
O l y m p i c グループ	9.3	9.4		5,959
日産東京販売ホールディングス	26.6	29.5		7,021
シルバーライフ	3.6	4.1		6,264
Genky DrugStores	7.6	8.5		28,687
ナルミヤ・インターナショナル ブックオフグループホールディングス	3.6	4.6		4,121
ブックオフグループホールディングス	9.9	11.1		10,989
ギフトホールディングス	2.3	3.2		6,966
アインホールディングス	24.8	24.2		139,634
元気寿司	4.9	5.5		14,025
ヤマダホールディングス	571	694.4		317,340
アークランドサカモト	26.9	30.1		45,089
ニトリホールディングス	67.5	75.7		971,609
グルメ杵屋	12.5	15.5		16,569
愛眼	13.6	13.9		2,641
ケーユーホールディングス	9.3	10.3		11,803
吉野家ホールディングス	56.1	66.7		161,480
松屋フーズホールディングス	8.3	9.3		35,898
サガミホールディングス	24.4	28.2		33,473
関西フードマーケット	13.2	16.9		21,378
王将フードサービス	11.3	12.6		80,388
プレナス	19.3	21.5		42,118
ミニストップ	12.7	14.3		20,234
アークス	32.6	34.8		68,625
パローホールディングス	34.9	40.2		76,259
ベルク	8.5	8.5		44,625
大庄	9.5	10.5		11,991
ファーストリテイリング	22.8	25.5	1,570,800	
サンドラッグ	64.1	71.8		202,260
サックスパー ホールディングス	15.1	18.5		10,952
ヤマザワ	4.2	4.3		6,462
やまや	3.5	3.9		9,792

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ベルーナ		36.9		27,613
銀行業(5.2%)				
島根銀行		5.9	6.1	3,251
じもとホールディングス		11.5	12.9	7,443
めぶきフィナンシャルグループ		885.4	828.8	205,542
東京さらぼしフィナンシャルグループ		21.4	22.7	43,720
九州フィナンシャルグループ		348	352.6	133,988
ゆうちょ銀行		482.7	450.5	447,346
富山第一銀行		40.6	43.5	17,226
コンコルディア・フィナンシャルグループ		1,038.1	993.2	436,014
西日本フィナンシャルホールディングス		111.3	106.3	80,256
三十三フィナンシャルグループ		14.7	16.1	22,137
第四北越フィナンシャルグループ		27.7	28.3	71,599
ひろぎんホールディングス		251.3	256.5	156,465
おきなわフィナンシャルグループ		—	16.5	34,963
十六フィナンシャルグループ		—	23.4	53,281
北國フィナンシャルホールディングス		—	16.8	70,476
プロクレアホールディングス		—	19.7	36,819
新生銀行		138.9	124.5	243,148
あおぞら銀行		101.5	106.6	286,114
三菱UFJフィナンシャル・グループ		11,656.2	11,437.2	8,444,084
りそなホールディングス		1,966.4	2,067.5	991,366
三井住友トラスト・ホールディングス		322.1	330.7	1,292,375
三井住友フィナンシャルグループ		1,179.2	1,266	5,039,946
千葉銀行		568.7	571.6	382,972
群馬銀行		350.7	324.1	114,731
武蔵野銀行		25.4	25.7	45,180
千葉興業銀行		43.4	42.4	11,066
筑波銀行		70.8	74.4	13,615
七十七銀行		53.5	53.7	91,128
青森銀行		13.2	—	—
秋田銀行		10.2	11.7	17,924
山形銀行		19.1	18.5	15,244
岩手銀行		11.2	11.9	23,800
東邦銀行		152.4	144.1	28,675
東北銀行		8.2	8.8	8,641
みちのく銀行		10.9	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ		153.8	145.5	325,920
静岡銀行		415	417.2	315,820
十六銀行		21.4	—	—
スルガ銀行		149.4	167.3	60,060
八十二銀行		383.8	389	176,217
山梨中央銀行		19.8	19.7	22,123
大垣共立銀行		33.7	34.3	59,819
福井銀行		14.6	15.6	20,576

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
北國銀行	15.8	—	—
清水銀行	7	7.2	10,677
富山銀行	3.3	3.1	5,890
滋賀銀行	34.2	32.7	86,949
南都銀行	24.8	27.1	53,739
百五銀行	153.3	167.9	54,567
京都銀行	61	62.3	350,126
紀陽銀行	60.3	59.3	83,553
ほくほくフィナンシャルグループ	113.4	110.9	88,387
山陰合同銀行	107.4	108.5	71,176
中国銀行	146.6	144.7	135,149
鳥取銀行	5.4	6.1	7,448
伊予銀行	225.8	227	143,237
百十四銀行	18.1	18.5	32,134
四国銀行	24.2	26.4	21,463
阿波銀行	26.1	26.6	54,210
大分銀行	9.8	10.5	18,322
宮崎銀行	10.6	10.9	22,039
佐賀銀行	9.7	10.3	14,595
沖縄銀行	15.6	—	—
琉球銀行	37	41.4	32,333
セブン銀行	569.3	566.8	138,299
みずほフィナンシャルグループ	2,315.4	2,339.1	3,581,162
高知銀行	6.2	6.3	4,693
山口フィナンシャルグループ	212.7	201.2	145,870
長野銀行	5.6	6	7,530
名古屋銀行	13.7	12.4	38,068
北洋銀行	256.9	255.7	56,765
愛知銀行	5.7	6.2	31,310
中京銀行	6.1	6.2	10,087
大光銀行	5.8	6	7,578
愛媛銀行	23.8	25.5	20,935
トマト銀行	6.6	6.1	6,106
京葉銀行	72.7	79.6	36,616
栃木銀行	82.3	87.8	23,267
北日本銀行	5.3	5.7	8,914
東和銀行	29.9	32	16,416
福島銀行	19.5	20.7	4,595
大東銀行	8.2	8.6	5,598
トモニホールディングス	131.7	141	43,569
フィデアホールディングス	165.4	17.4	22,080
池田泉州ホールディングス	195.9	208.2	38,517
証券、商品先物取引業(0.7%)			
F P G	57.6	64.5	62,758
ジャパンインベストメントアドバイザー	11.6	15	19,305

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
マーキュリアインベストメント	6.9	—	—
マーキュリアホールディングス	—	9.8	6,174
S B I ホールディングス	210	235.7	618,712
ジャフコ グループ	26.2	73.1	116,082
大和証券グループ本社	1,276.5	1,361.6	860,803
野村ホールディングス	2,602	2,914.3	1,477,550
岡三証券グループ	145.7	142.5	49,875
丸三証券	50.9	57.2	28,256
東洋証券	57.6	60.7	11,593
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	182.2	199	75,023
光世証券	4.4	4.5	2,052
水戸証券	46.2	49	13,132
いちよし証券	34.5	34.4	21,775
松井証券	83.7	93.7	77,958
マネックスグループ	153.1	159.5	80,069
極東証券	23.1	23.3	15,471
岩井コスモホールディングス	17.6	18.2	22,313
アイザワ証券グループ	30.8	28	19,572
マネーパートナーズグループ	19.1	21.4	5,029
スパークス・グループ	79.5	89.1	23,700
保険業(2.2%)			
かんぽ生命保険	211.2	192.1	413,591
SOMPOホールディングス	300.4	285.5	1,632,203
アニコム ホールディングス	47.9	58.6	40,023
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	413.8	404.2	1,622,054
第一生命ホールディングス	900.2	908.7	2,355,350
東京海上ホールディングス	561.2	558.3	4,112,437
T&Dホールディングス	509.3	448.2	660,198
アドバンスクリエイト	8.1	9.1	8,845
その他金融業(1.2%)			
全国保証	44.4	45.6	197,220
あんしん保証	—	9.2	2,511
イントラスト	5.2	8.9	4,975
日本モーゲージサービス	9	11.1	11,122
C a s a	5	7.3	6,241
アルヒ	25.3	28.7	27,810
プレミアグループ	8	9.8	40,180
ネットプロテクションズホールディングス	—	58.7	35,924
クレディセゾン	99.7	115.4	177,600
芙蓉総合リース	17.9	17.7	133,104
みずほリース	26.4	25.7	79,541
東京センチュリー	39.6	32.1	139,956
日本証券金融	72.4	75.5	66,440
アイフル	286.7	321.6	113,203

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
リコーリース	13.5	17	59,075
イオンフィナンシャルサービス	104.5	104.2	126,603
アコム	343	377.9	124,329
ジャックス	18.9	19.8	67,518
オリエントコーポレーション	462.7	519.9	66,547
オリックス	1,034.6	1,134	2,791,908
三菱HCキャピタル	589.8	647	405,669
九州リースサービス	8.8	9.4	5,358
日本取引所グループ	460.4	455.4	941,539
イー・ギャランティ	19.7	28.4	62,366
アサックス	9.2	10.7	6,708
NECキャピタルソリューション	7.1	8	15,808
<b>不動産業(2.0%)</b>			
いちご	194.1	218.4	68,577
日本駐車場開発	196.8	206.5	33,453
スター・マイカ・ホールディングス	10.2	11.6	17,690
SREホールディングス	2.8	5.9	11,180
ADワークスグループ	34.2	35.9	5,385
ヒューリック	362.7	430.5	465,801
三栄建築設計	7.6	8.8	14,660
野村不動産ホールディングス	104.1	99.3	325,704
三重交通グループホールディングス	37.6	42.4	20,691
サムティ	25	29.8	60,017
ディア・ライフ	25.2	27.2	14,552
地主	11.6	12.9	27,373
プレサンスコーポレーション	28.9	23.4	36,387
ハウスコム	4.2	4.8	5,212
日本管理センター	10.4	10.9	11,216
サンセイランディック	6.8	7.7	6,853
フージャースホールディングス	27.8	24.4	19,593
オープンハウスグループ	54.4	61	335,500
東急不動産ホールディングス	465.6	536	365,552
飯田グループホールディングス	142.6	160.1	326,604
イーグラント	4.3	4.1	5,965
ムゲンエステート	13.5	15.4	7,777
And Doホールディングス	8.4	9.4	8,497
シーアールイー	5.5	7.7	12,381
ケイアイスター不動産	—	8.9	44,678
グッドコムアセット	9.2	9.8	11,730
ジェイ・エス・ビー	3.6	4.4	15,576
ロードスターキャピタル	—	6.1	8,802
テンポイノベーション	6.6	7.4	6,586
フェイスネットワーク	2.5	3.8	5,065
パーク24	92.1	113.9	236,342
パラカ	5.3	6.4	11,808

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
三井不動産	777.2	788.5	2,254,715
三菱地所	1,120.2	1,143.5	2,253,838
平和不動産	29.5	31.6	121,344
東京建物	169.2	172.8	309,312
ダイビル	44.4	—	—
京阪神ビルディング	30.5	27.9	35,126
住友不動産	383.4	362.8	1,309,345
テーオーシー	35.5	33.5	20,904
東京楽天地	3.2	3.3	13,084
スターツコーポレーション	20.8	26.7	64,533
フジ住宅	22.2	24.9	16,434
空港施設	19.5	22.5	12,262
明和地所	10.5	12	7,320
ゴールドクレスト	16.2	16.1	27,337
エスリード	7.6	8.5	14,892
日神グループホールディングス	28.4	35	16,100
日本エスコン	30.9	35.5	27,477
タカラレーベン	71.4	80	26,800
AVANTIA	10.5	11.4	9,667
イオンモール	86.3	96.8	154,686
毎日コムネット	8	9.1	6,388
ファースト住建	8.5	8.7	9,778
カチタス	42.7	47.9	144,179
トーセイ	24.9	27.9	32,224
穴吹興産	4.4	5	11,750
サンフロンティア不動産	22.6	28.1	30,376
FJネクストホールディングス	18.2	20.4	21,930
インテリックス	3.8	4.3	2,653
ランドビジネス	7.2	7	1,659
サンネクスタグループ	6.9	7.6	8,892
グランディハウス	15.1	16.4	8,741
日本空港ビルディング	59.5	65.6	351,616
<b>サービス業(5.4%)</b>			
明豊ファシリティワークス	7.9	9	5,841
日本工営	10.4	11.9	37,068
LIFULL	51.2	58.5	10,354
ミクシィ	42.1	42.5	91,120
ジェイエイシーリクルートメント	11.5	15.1	27,844
日本M&Aセンターホールディングス	270.9	303.5	461,927
メンバーズ	5	5.2	15,990
中広	3	3.9	1,540
UTグループ	23.9	26.8	65,606
アイティメディア	5.7	9	16,407
タケエイ	18.6	—	—
E・Jホールディングス	8.9	10.9	12,589

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
夢真ビーネックスグループ	44.1	60.5	89,177	
コシダカホールディングス	44.6	49.9	38,672	
アルトナー	4.3	4.9	4,160	
パソナグループ	18	20.2	42,420	
CDS	4.3	4.8	10,464	
リンクアンドモチベーション	30.3	40.8	18,645	
GCA	21.9	—	—	
エス・エム・エス	56.2	63	186,102	
サニーサイドアップグループ	6.1	7	4,403	
パーソルホールディングス	165.2	185	467,495	
リニカル	9.7	10.8	9,450	
クックパッド	52.9	59.7	13,432	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8.4	9.6	5,827	
学情	6	7.9	7,552	
スタジオアリス	8.4	8.4	19,093	
シミックホールディングス	9.3	9.7	14,132	
エプコ	4.3	4.4	3,207	
NJS	4.2	4.3	9,030	
総合警備保障	65.7	69.6	248,820	
カカクコム	122	135.8	346,018	
アイロムグループ	5.9	6.7	13,078	
セントケア・ホールディング	12.3	12.5	10,287	
サイネックス	3.2	3.7	2,186	
ルネサンス	10.6	13.2	12,434	
ディップ	25.9	32.6	123,717	
デジタルホールディングス	11.6	13.2	17,595	
新日本科学	20.5	22.7	38,272	
キャリアデザインセンター	4.4	4.4	4,879	
ベネフィット・ワン	60.2	67.5	136,755	
エムスリー	291.3	326.4	1,219,756	
ツカダ・グローバルホールディング	13.1	11.8	4,023	
アウトソーシング	94.7	106.3	123,095	
ウェルネット	17.2	17.8	8,882	
ワールドホールディングス	5.8	7.6	17,882	
ディー・エヌ・エー	70	70.6	131,527	
博報堂DYホールディングス	229.9	242.1	316,666	
ぐるなび	29.2	28.9	12,455	
タカミヤ	20.5	23.4	8,845	
ジャパンベストレスキューシステム	11.2	11.1	9,024	
ファンコミュニケーションズ	46.1	44	18,040	
ライク	4.5	6.3	13,488	
ビジネス・ブレイクスルー	7.5	7.7	3,334	
エスプール	42.7	52.5	64,627	
WDBホールディングス	7.6	8.6	20,201	
手間いらず	2.1	—	—	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
ティア	10.2	11.6	5,370	
CDG	1.7	2.3	2,957	
アドウェイズ	27.1	28.2	20,134	
パリュエコマース	11.2	14.6	46,939	
インフォマート	167.3	203.4	103,327	
J Pホールディングス	48.1	49.2	11,168	
エコナックホールディングス	32.9	36.3	3,303	
E P Sホールディングス	25	—	—	
CLホールディングス	4.2	4.3	4,360	
プレステージ・インターナショナル	62.3	69.9	44,945	
アミューズ	9.1	10.2	22,236	
ドリームインキュベータ	5.3	5.6	13,423	
クイック	10.5	12.1	17,230	
TAC	10.1	11.6	2,726	
電通グループ	185.7	179.1	774,607	
イオンファンタジー	6.5	7.3	18,140	
シーティーエス	18.9	21.3	18,467	
ネクシィーズグループ	6.1	6.6	3,451	
H. U. グループホールディングス	46.3	48.5	127,943	
アルプス技研	14.7	15.4	28,844	
ダイオーズ	3.5	4	4,312	
日本空調サービス	17.7	19.8	15,998	
オリエンタルランド	175.6	204	4,019,820	
ダスキン	38.4	41	111,684	
明光ネットワークジャパン	19.9	22.3	13,469	
ファルコホールディングス	8	8.5	18,691	
ラウンドワン	56.5	51.8	80,134	
リゾートトラスト	75.8	80.6	172,242	
ビー・エム・エル	21.3	23.6	82,010	
りらいあコミュニケーションズ	25.3	27.6	31,105	
リソー教育	84.7	85.5	29,412	
早稲田アカデミー	7.3	10.6	12,667	
ユー・エス・エス	185	207.2	504,532	
東京個別指導学院	15	16.9	10,376	
サイバーエージェント	407	415.5	582,531	
楽天グループ	770.7	889.2	662,454	
クリーク・アンド・リバー社	8.8	9.9	21,027	
モーニングスター	24.7	33	17,919	
テー・オー・ダブリュー	29.7	36.4	12,558	
山田コンサルティンググループ	9.8	9.9	11,612	
セントラルスポーツ	6.3	7	17,500	
フルキャストホールディングス	14.2	15.9	36,554	
エン・ジャパン	29.4	32.1	63,172	
リソルホールディングス	1.9	2.1	9,702	
テクノプロ・ホールディングス	33	110.9	335,472	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アトラグループ	3.8	4.1	832
インターワークス	5.4	6.3	2,444
アイ・アールジャパンホールディングス	6.7	8.7	39,367
KeepEr 技研	10.7	12	38,760
ファーストロジック	3.6	3.6	2,718
三機サービス	3.4	3.5	3,885
Gunosy	10.6	10.6	9,253
デザインワン・ジャパン	5.3	7.2	1,332
イー・ガーディアン	6.8	6.8	20,230
リブセンス	10.3	12.4	2,021
ジャパンマテリアル	51	57.1	103,864
ベクトル	20.9	26.2	29,868
ウチヤマホールディングス	8.9	10.3	3,213
チャーム・ケア・コーポレーション	12.5	14.1	15,947
キャリアリンク	5.5	7	14,742
I B J	13.8	15.7	11,853
アサンテ	6.1	8.4	12,768
バリュエーHR	6.7	15.9	20,320
M&Aキャピタルパートナーズ	13.6	15.4	53,438
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.6	7.5	9,097
ERIホールディングス	5.1	5.4	7,263
アビスト	2.7	3	8,781
シグマクス・ホールディングス	9.2	22.6	27,097
ウィルグループ	12.4	14	16,758
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	25.6	23.2	3,781
メドピア	12.8	13.6	29,158
レアジョブ	3.2	4.2	2,343
リクルートホールディングス	1,182.6	1,358.6	6,377,268
エラン	23	25.8	28,018
土木管理総合試験所	8.8	9.7	3,220
ネットマーケティング	8.7	9.5	6,612
日本郵政	1,249.3	2,213.8	2,115,507
ベルシステム24ホールディングス	27.8	26.8	39,235
鎌倉新書	16.9	21.7	12,260
SMN	3.9	4.6	2,819
グローバルキッズCOMPANY	3.3	3.6	2,419
エアトリ	10.3	11.2	32,995
アトラエ	11.6	13.1	23,973
ストライク	6.3	7.9	30,059
ソラスト	40.7	46	33,028
セラク	5.3	6.2	7,154
インソース	16.1	19.8	45,124
ペイカレント・コンサルティング	10.8	13.1	550,855
Orchestra Holdings	3.8	3.7	9,982
アイモバイル	4.9	8.1	11,826

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
キャリアインデックス	7.2	7	3,689
MS-Japan	7	8	6,880
船場	3.6	4.2	2,889
グレイステクノロジー	16.9	—	—
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	47.7	58.9	92,296
フルテック	2.5	2.9	3,926
グリーンズ	6.2	—	—
GameWith	5.4	6.3	2,942
ソウルドアウト	4.1	—	—
MS&Consulting	3.1	3.2	2,393
ウエルビー	6.3	12.5	10,862
エル・ティー・エス	1.7	2.5	9,575
ミダックホールディングス	3.6	8.5	24,412
日総工産	13.3	15	9,300
キュービネットホールディングス	7.7	8.8	11,906
RPAホールディングス	19.6	27.1	10,704
スプリックス	4.9	6.3	6,520
マネジメントソリューションズ	8.2	9.2	45,862
プロレド・パートナーズ	3.1	4.7	2,641
テノ・ホールディングス	2	2.8	1,974
フロンティア・マネジメント	3.9	5.1	7,175
ピアラ	1.4	3.4	2,944
コプロ・ホールディングス	2.4	4	3,672
ギークス	3	3.6	3,128
カープスホールディングス	45.6	51.3	36,525
フォーラムエンジニアリング	11.7	12.2	11,797
Fast Fitness Japan	—	3.6	6,624
ダイレクトマーケティングミックス	8.9	19.9	36,038
ポピンズ	4.4	4.5	9,540
LITALICO	6.7	15.1	38,278
アドバンテッジリスクマネジメント	8.7	10.1	5,181
リロググループ	90.4	101.3	215,667
東祥	10.4	14.1	18,950
ビーウィズ	—	5.2	7,337
TREホールディングス	—	31.8	72,631
人・夢・技術グループ	—	7.5	18,525
エイチ・アイ・エス	25.8	39.4	93,062
ラックランド	4.8	5.7	17,356
共立メンテナンス	27.4	33.1	166,493
イチネンホールディングス	17.4	19.2	24,019
建設技術研究所	10.7	10.1	24,421
スペース	11	12.8	11,878
長大	6.7	—	—
燦ホールディングス	7.4	8.2	15,899

銘柄	当 期 首 (前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
スバル興業	1	1.1	9,493	
東京テアトル	6.4	6.9	8,576	
タナベ経営	3.4	7.6	5,327	
ナガワ	5.3	5.4	48,654	
東京都競馬	10.9	13.9	52,264	
カナモト	29.2	31.2	59,779	
西尾レントオール	15.3	16.1	44,516	
トランス・コスモス	15.8	23.6	82,128	
乃村工藝社	71.1	79.6	74,187	
藤田観光	6.5	8.1	20,565	
KN T-C Tホールディングス	8.8	11.5	20,665	
日本管財	17.8	19.9	52,635	
トーカイ	16.1	15.4	25,979	
セコム	162.7	182.2	1,538,861	
セントラル警備保障	8	9.1	20,839	
丹青社	31.5	36.3	30,274	
メイテック	20	22	154,660	
応用地質	18.8	18.9	33,358	
船井総研ホールディングス	33.9	35.9	76,143	
進学会ホールディングス	7.1	7	2,597	
オオバ	11.9	12.4	9,262	
いであ	4.2	4.9	8,820	
学究社	5	6.2	10,168	
ベネッセホールディングス	60.6	61.8	129,223	
イオンディライト	20.4	21.4	60,797	
ナック	8.1	9.1	8,836	
ダイセキ	27.7	33.8	154,635	
ステップ	6.2	7	12,754	
合 計	株 数 ・ 金 額	181,054	201,473	488,516,185
	銘柄数<比率>	2,114	2,102	<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	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	9,617	—

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	488,516,185	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,712,064	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	502,228,249	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年5月30日現在
(A)資 産	502,188,455,124円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,696,630,134
株 式(評価額)	488,516,185,770
未 収 入 金	4,153,568,703
未 収 配 当 金	5,495,605,067
差 入 委 託 証 拠 金	326,465,450
(B)負 債	4,974,551,491
未 払 金	4,956,801,164
未 払 解 約 金	17,747,094
未 払 利 息	3,233
(C)純 資 産 総 額(A-B)	497,213,903,633
元 本	261,899,870,077
次 期 繰 越 損 益 金	235,314,033,556
(D)受 益 権 総 口 数	261,899,870,077口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,985円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	11,577,303,389円
受 取 配 当 金	11,575,474,978
受 取 利 息	21,631
そ の 他 収 益 金	3,243,816
支 払 利 息	△1,437,036
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△135,113,539
売 買 益	41,187,525,426
売 買 損	△41,322,638,965
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△118,602,600
取 引 益	811,597,550
取 引 損	△930,200,150
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	11,323,587,250
(E)前 期 繰 越 損 益 金	213,332,602,374
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	31,763,096,628
(G)解 約 差 損 益 金	△21,105,252,696
(H)計 (D+E+F+G)	235,314,033,556
次 期 繰 越 損 益 金(H)	235,314,033,556

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

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

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

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は249,503,103,457円、期中追加設定元本額は35,776,873,459円、期中一部解約元本額は23,380,106,839円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,649,424,599円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	44,408,751,306円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,949,549,876円
DCマイセレクション50	18,942,593,551円
DCマイセレクション75	18,879,688,062円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,780,801,499円
DCマイセレクションS50	9,073,586,435円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,361,740,808円
DCマイセレクションS75	6,906,288,752円
DCマイセレクション25	6,244,084,567円
DC日本株式インデックス・オープン	6,208,866,136円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,319,372,568円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,987,438,501円
世界経済インデックスファンド	3,846,566,064円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,505,045円
DC世界経済インデックスファンド	3,590,618,326円
日本株式インデックス・オープン	3,329,539,157円
DCマイセレクションS25	3,101,188,895円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,827,592,622円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,062,924,464円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,560,290円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,794,542,708円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,762,760,621円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,141,170,962円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	939,963,074円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	914,590,374円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	703,995,649円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	586,687,036円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	558,843,487円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	515,581,834円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	485,200,127円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	477,819,397円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	436,434,928円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	419,000,801円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	402,198,610円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	351,054,666円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,996,082円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	278,407,466円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	263,400,284円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,603,259円
グローバル経済コア	218,176,100円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	197,036,199円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	192,767,573円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	186,418,998円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	175,219,707円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	113,885,822円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	104,463,510円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	74,211,525円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	58,692,527円
SMT インデックスバランス・オープン	57,855,547円

世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	55,807,407円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	51,288,288円
SMT 世界経済インデックス・オープン	46,605,223円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	35,139,857円
SMT 世界経済インデックス・オープン (債券シフト型)	31,659,093円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	31,325,672円
SBI資産設計オープン (つみたてNISA対応型)	27,485,982円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	26,007,286円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	25,967,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,626,792円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	21,158,127円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	19,058,334円
SBI資産設計オープン (分配型)	14,307,969円
私募世界経済バッシブファンド (適格機関投資家専用)	13,443,001円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2030	12,178,371円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	11,191,188円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2040	10,489,027円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,690,813円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2060	5,155,303円
DCターゲット・イヤーファンド (6資産・運用継続型) 2050	4,206,394円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	3,350,367円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	2,356,825円

## お知らせ

株式会社東京証券取引所の市場区分再編に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年4月4日)

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

**【本運用報告書の記載について】**

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441,246	0.2	98.0	0.8	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454,282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481,049	5.9	97.3	2.1	276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1	304,255
第22期(2022年5月30日)	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	1.9	306,130

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2021年 5月31日	30,717	－	510,445	－	98.1	1.1
6月末	30,662	△0.2	508,662	△0.3	96.8	2.3
7月末	30,869	0.5	513,081	0.5	98.8	0.5
8月末	30,875	0.5	512,289	0.4	97.2	1.9
9月末	30,660	△0.2	508,953	△0.3	97.7	1.6
10月末	31,292	1.9	518,317	1.5	98.3	1.0
11月末	30,970	0.8	512,768	0.5	96.9	2.3
12月末	31,153	1.4	516,730	1.2	97.5	2.1
2022年 1月末	30,627	△0.3	507,460	△0.6	97.1	2.0
2月末	30,088	△2.0	500,360	△2.0	97.7	1.4
3月末	31,088	1.2	514,015	0.7	97.5	1.6
4月末	31,147	1.4	514,167	0.7	97.9	0.8
(当期末) 2022年 5月30日	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	1.9

(注1)騰落率は期首比です。

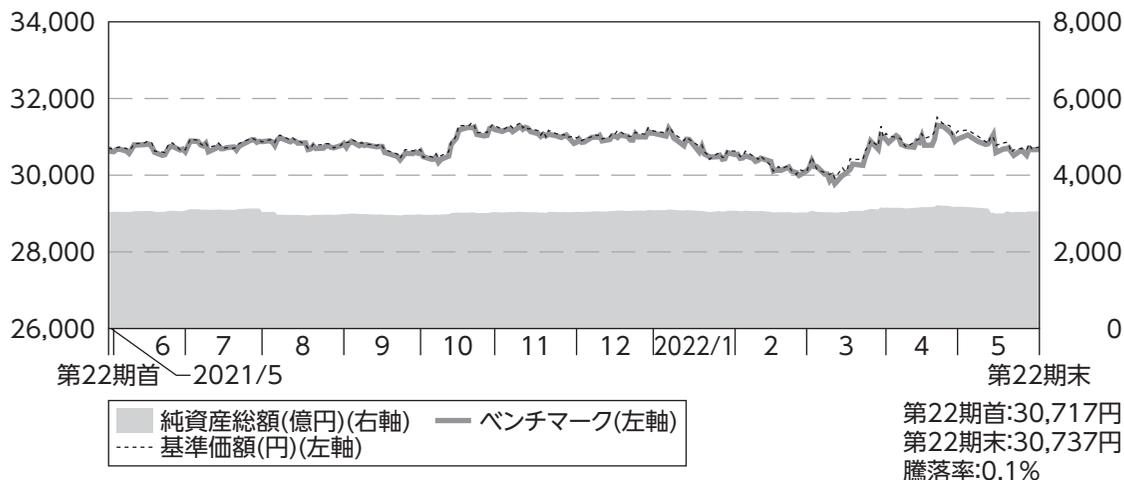
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又は遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2021年5月31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

2021年8月上旬にかけて、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬から10月上旬にかけては、FOMC(米連邦公開市場委員会)で量的金融緩和の縮小開始が示唆されたことなどから主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬には、日本の貿易収支悪化懸念から円安の動きが加速し、基準価額は上昇しました。10月下旬から12月上旬は、主要国の長期金利が低下したものの円高となり、12月中旬から2022年1月上旬は、主要国の長期金利が上昇したものの円安となったことから、基準価額はレンジ内推移となりました。1月中旬から3月中旬にかけては米国で大幅利上げへの警戒感が高まったことから主要国の長期金利が上昇して基準価額は下落しましたが、3月下旬には日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから円売りが加速し、上昇しました。4月から5月上旬にかけて基準価額はレンジ内推移となり、以降は長期金利上昇と円安が一服したことから、緩やかに下落しました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2021年12月上旬まで上下動しながらレンジ内での動きが続いていましたが、12月中旬以降は、米国で金融引き締めペースの加速見通しが強まったことや世界的にインフレ加速に対する警戒が続いたことから、概ね上昇推移となりました。

外国為替市場では、2022年3月上旬までは、円は主要通貨に対して円安傾向ながらレンジ内での展開が続いていましたが、3月中旬以降は、他の主要国の長期金利が大幅に上昇する中で日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことや資源価格高騰による日本の貿易収支悪化懸念から、主要通貨に対する円安が大幅に加速しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1) 債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

### (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

## 当ファンドの組入資産の内容

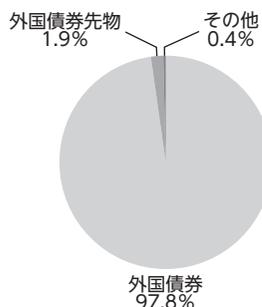
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.7%
2	T 1.25% 08/15/31	アメリカ	0.6%
3	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
4	T 1.25% 09/30/28	アメリカ	0.5%
5	T 1.125% 02/15/31	アメリカ	0.5%
6	EURO-BUND 2206	ドイツ	0.5%

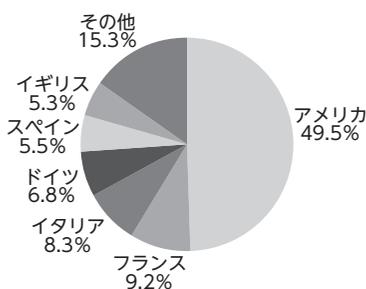
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
8	T 2% 08/15/51	アメリカ	0.5%
9	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
10	T 0.25% 09/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		826	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

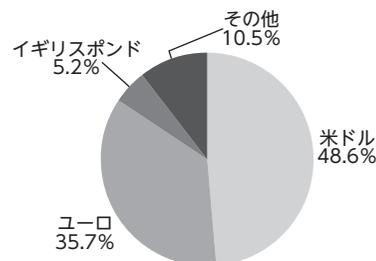
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

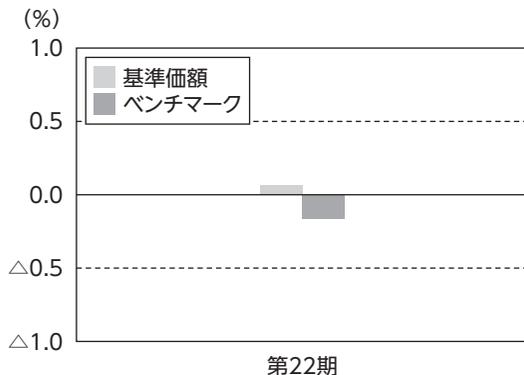


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.9%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

## 今後の運用方針

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(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)	(-)	(-)	
(c) その他費用	7	0.024	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(7)	(0.023)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	7	0.025	

(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(30,845円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 401,216	千米ドル 335,254
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 25,360	千カナダドル 26,202
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 60,029	千メキシコペソ 100,386
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 38,129	千ユーロ 42,369
	イ タ リ ア	国 債 証 券	34,105	39,020
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	33,494	38,246
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	8,355	8,221
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	22,711	24,064
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	5,598	7,602
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,311	7,046
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,437	2,880
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,390	3,773
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 13,005	千イギリスポンド 27,780
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,776	千スウェーデンクローナ 21,158
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 9,121	千ノルウェークローネ 6,550
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 8,764	千デンマーククローネ 20,425
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 10,602	千ポーランドズロチ 20,693
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 4,003	千オーストラリアドル 23,876
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,224	千シンガポールドル 4,350
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,698	千マレーシアリンギット 11,065
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 268,308	千オフショア人民元 -	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 16,105	千イスラエルシェケル 21,192	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 63,854	百万円 61,561	百万円 -	百万円 -

(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			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 35,250	百万円 131	% 0.4	百万円 35,483	百万円 351	% 1.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,117,914	30,860	2.8	1,116,764	30,326	2.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

### <外国(外貨建)公社債>

#### (A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル 1,234,970	千米ドル 1,161,808	千円 147,572,910	% 48.2	% —	% 21.4	% 17.1	% 9.7
カ ナ ダ	千カナダドル 64,950	千カナダドル 61,671	6,159,165	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 369,820	千メキシコペソ 355,118	2,306,634	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 142,510	千ユーロ 149,133	20,325,345	6.6	—	3.9	1.6	1.1
イ タ リ ア	180,290	181,990	24,803,426	8.1	—	4.7	2.2	1.2
フ ラ ン ス	195,640	201,735	27,494,486	9.0	—	5.4	2.5	1.1
オ ラ ン ダ	37,260	38,688	5,272,830	1.7	—	1.1	0.4	0.2
ス ペ イ ン	116,860	119,841	16,333,215	5.3	—	3.2	1.5	0.6
ベ ル ギ ー	43,490	45,243	6,166,301	2.0	—	1.5	0.5	0.1
オーストリア	28,260	28,531	3,888,520	1.3	—	0.8	0.4	0.1
フィンランド	12,390	11,847	1,614,662	0.5	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	15,570	15,302	2,085,579	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 93,140	千イギリスポンド 98,476	15,794,705	5.2	—	4.0	0.7	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 62,360	千スウェーデンクローナ 62,898	813,906	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 58,140	千ノルウェークローネ 56,123	752,049	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 62,040	千デンマーククローネ 65,222	1,194,873	0.4	—	0.3	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 51,380	千ポーランドズロチ 42,924	1,281,487	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 54,440	千オーストラリアドル 50,793	4,623,245	1.5	—	1.0	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 14,290	千シンガポールドル 14,083	1,307,226	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 50,920	千マレーシアリンギット 50,710	1,471,893	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中国オフショア	千オフショア人民元 266,140	千オフショア人民元 270,299	5,112,008	1.7	—	0.7	0.6	0.3
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,160	千イスラエルシェケル 31,896	1,209,741	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	297,584,217	97.2	—	51.4	29.9	15.9

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	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)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.125% 01/15/24	0.125	10,000	9,651	1,225,966	2024/1/15
T 0.125% 02/15/24	0.125	4,710	4,536	576,203	2024/2/15
T 0.125% 05/15/23	0.125	7,500	7,366	935,755	2023/5/15
T 0.125% 05/31/23	0.125	6,800	6,670	847,254	2023/5/31
T 0.125% 07/31/23	0.125	5,000	4,885	620,611	2023/7/31
T 0.125% 09/15/23	0.125	8,060	7,851	997,286	2023/9/15
T 0.125% 10/15/23	0.125	8,000	7,774	987,501	2023/10/15
T 0.125% 12/15/23	0.125	3,250	3,144	399,406	2023/12/15
T 0.25% 03/15/24	0.25	13,000	12,517	1,589,982	2024/3/15
T 0.25% 05/15/24	0.25	10,000	9,583	1,217,233	2024/5/15
T 0.25% 06/15/23	0.25	8,000	7,850	997,146	2023/6/15
T 0.25% 06/15/24	0.25	9,000	8,603	1,092,808	2024/6/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	1,000	928	117,969	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	5,200	4,818	612,024	2025/7/31
T 0.25% 09/30/23	0.25	12,000	11,697	1,485,836	2023/9/30
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,500	6,919	878,894	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,314	421,065	2025/10/31
T 0.25% 11/15/23	0.25	11,000	10,687	1,357,541	2023/11/15
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,349	933,557	2026/1/31
T 0.375% 04/15/24	0.375	7,000	6,736	855,693	2024/4/15
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,491	951,578	2025/4/30
T 0.375% 07/15/24	0.375	9,010	8,618	1,094,693	2024/7/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,878	619,607	2027/7/31
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,000	4,771	606,073	2024/8/15
T 0.375% 09/15/24	0.375	6,600	6,283	798,085	2024/9/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	8,000	7,059	896,721	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,767	351,557	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,683	467,830	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	11,500	10,593	1,345,640	2026/2/28
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	6,800	863,743	2025/3/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,639	335,278	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,135	398,254	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	3,100	2,771	352,001	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,148	526,987	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,646	844,286	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	4,500	4,072	517,288	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	14,100	11,988	1,522,754	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	8,000	7,338	932,168	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	10,105	1,283,564	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,227	282,991	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	10,000	8,891	1,129,386	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,599	965,292	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	11,000	10,214	1,297,395	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,000	2,781	353,343	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,700	470,093	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	11,830	10,891	1,383,432	2026/8/31
T 0.75% 11/15/24	0.75	10,860	10,388	1,319,517	2024/11/15
T 0.75% 12/31/23	0.75	3,370	3,288	417,732	2023/12/31
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,429	943,639	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	6,000	5,545	704,425	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,600	1,219,433	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,293	799,427	2028/7/31
T 1% 12/15/24	1.0	8,000	7,689	976,664	2024/12/15
T 1.125% 01/15/25	1.125	6,800	6,546	831,480	2025/1/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	15,050	13,192	1,675,681	2031/2/15

銘柄	利率 (%)	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 1.125% 02/28/25	1.125	8,500	8,165	1,037,157	2025/2/28
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,302	927,563	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,236	157,099	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	7,300	5,245	666,313	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	10,210	9,242	1,173,924	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,150	4,726	600,338	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,333	931,532	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	8,650	5,721	726,702	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	8,000	7,326	930,619	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,500	8,685	1,103,272	2028/6/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,504	572,218	2023/7/31
T 1.25% 08/15/31	1.25	16,120	14,179	1,801,055	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	14,500	13,212	1,678,259	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,563	833,638	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,675	847,881	2026/12/31
T 1.375% 01/31/25	1.375	4,000	3,872	491,884	2025/1/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,962	630,324	2023/6/30
T 1.375% 08/15/50	1.375	9,900	6,767	859,617	2050/8/15
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,475	314,442	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	3,957	502,691	2023/9/30
T 1.375% 11/15/31	1.375	18,030	15,983	2,030,200	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	4,496	571,113	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	4,900	4,491	570,563	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,676	720,977	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,922	752,221	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	7,500	7,131	905,836	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,299	1,054,238	2024/9/30
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,928	880,010	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,787	989,194	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,177	276,587	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	11,150	10,170	1,291,906	2031/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	995	126,481	2023/5/31
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,263	795,626	2029/8/15
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,479	314,883	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,671	339,276	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	5,042	640,484	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,558	578,979	2026/11/30
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,680	467,504	2023/5/15
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,364	300,394	2024/6/30
T 1.75% 08/15/41	1.75	14,500	11,494	1,460,050	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,805	356,291	2029/11/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	6,453	819,699	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	5,138	652,654	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	4,000	3,849	488,927	2027/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,019	637,576	2026/7/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	5,913	751,194	2024/8/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	9,300	7,243	920,111	2051/11/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,324	1,057,420	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,021	510,858	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,179	784,982	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,281	416,765	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,446	691,842	2024/6/30
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	6,747	857,014	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	15,150	12,151	1,543,541	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	9,897	1,257,171	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	5,700	4,717	599,234	2041/11/15
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,078	645,031	2024/2/29

外国債券インデックス マザーファンド ー第22期ー

銘柄	利率 (%)	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 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,363	935,321	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,364	300,370	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,519	447,108	2026/5/31
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,763	605,004	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	5,000	4,952	629,071	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,674	339,715	2023/11/30
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	3,993	507,216	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,753	1,111,916	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	2,300	1,965	249,670	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,375	936,834	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	6,976	886,153	2024/4/30
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	5,598	711,121	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	8,338	1,059,125	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	4,190	3,510	445,895	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	4,687	595,401	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,252	794,255	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,067	1,278,828	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,335	550,744	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,451	946,499	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,496	571,121	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	5,400	5,352	679,933	2024/12/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	5,761	731,778	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,568	326,291	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,690	2,643	335,757	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	7,812	992,312	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	5,050	4,429	562,672	2051/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	4,984	633,115	2024/8/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	6,100	5,345	678,998	2049/11/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	3,470	3,477	441,766	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,984	633,164	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	1,710	1,506	191,360	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,000	3,524	447,705	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	7,909	1,004,692	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	5,050	4,447	564,927	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,570	580,514	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,677	594,118	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	13,340	13,213	1,678,428	2029/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,251	921,038	2025/3/31
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	4,928	626,032	2023/6/30
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,518	446,905	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,807	737,610	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,019	383,493	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,544	831,298	2028/2/15
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	3,906	496,206	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,516	700,683	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,007	127,977	2023/7/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,300	1,211	153,876	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,754	476,893	2047/8/15
T 2.75% 08/31/23	2.75	1,500	1,511	191,947	2023/8/31
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,915	878,457	2025/8/31
T 2.75% 11/15/23	2.75	2,320	2,336	296,838	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	3,920	3,646	463,141	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,834	359,989	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,025	511,295	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	7,297	926,920	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	4,150	3,934	499,746	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	5,388	684,452	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,845	488,438	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,496	698,107	2025/7/31

銘柄	利率 (%)	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 2.875% 08/15/28	2.875	3,920	3,938	500,213	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	2,167	275,370	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	4,792	608,801	2023/9/30
T 2.875% 10/31/23	2.875	7,900	7,972	1,012,630	2023/10/31
T 2.875% 11/15/46	2.875	2,500	2,363	300,233	2046/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,056	515,277	2023/11/30
T 2.875% 11/30/25	2.875	7,500	7,544	958,306	2025/11/30
T 3% 02/15/47	3.0	800	774	98,376	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	4,346	552,035	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	5,000	4,942	627,855	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	1,576	200,226	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	2,500	2,406	305,666	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	3,108	394,865	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	5,346	679,116	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,243	538,985	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,050	641,475	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,694	342,463	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,043	1,043	132,295	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,000	1,974	250,824	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	5,948	755,641	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	4,140	4,071	517,153	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	8,564	1,087,890	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	1,741	221,190	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	3,083	391,649	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	5,587	709,758	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	826	104,949	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	2,555	324,544	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,130	270,631	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,172	275,990	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	3,256	413,688	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,611	204,683	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,055	134,118	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	2,731	346,979	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,191	151,391	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,254	286,306	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,298	291,905	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,960	3,516	446,622	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,312	166,715	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	664	84,378	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,053	260,807	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,689	214,576	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	928	117,949	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,390	176,271	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,489	189,230	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,345	297,923	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,897	240,977	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,694	215,259	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,313	166,828	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,732	220,021	2023/8/15
小 計				147,572,910	
(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	2,280	2,090	208,797	2026/3/1
CAN 0.25% 04/01/24	0.25	2,400	2,303	230,069	2024/4/1
CAN 0.25% 05/01/23	0.25	2,600	2,549	254,663	2023/5/1
CAN 0.25% 08/01/23	0.25	1,360	1,326	132,435	2023/8/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	2,480	2,320	231,717	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,590	2,145	214,263	2030/12/1
CAN 0.75% 02/01/24	0.75	1,300	1,262	126,121	2024/2/1

銘柄	利率 (%)	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)		
CAN 0.75% 10/01/24	0.75	700	671	67,069	2024/10/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	749	74,820	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,431	142,965	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	1,440	1,390	138,832	2025/3/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	2,980	2,797	279,362	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,230	322,599	2030/6/1
CAN 1.5% 05/01/24	1.5	490	480	47,982	2024/5/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,060	105,892	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,304	130,316	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,970	3,565	356,125	2031/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	1,200	1,172	117,143	2024/9/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	4,170	3,724	371,926	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,830	1,431	142,965	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,263	126,165	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,290	1,199	119,834	2032/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	3,460	3,441	343,694	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	4,710	3,959	395,436	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,290	228,798	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,784	178,225	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,260	1,224	122,302	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,330	1,329	132,777	2024/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,650	1,626	162,468	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	760	743	74,253	2064/12/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,300	1,438	143,629	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,216	121,477	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	420	526	52,539	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,396	139,447	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	960	1,222	122,042	2033/6/1
小 計				6,159,165	
<b>(メキシコ)</b>					
<b>国債証券</b>		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	9,578	62,216	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,560	31,259	203,043	2024/12/5
MBONO 5% 03/06/25	5.0	3,700	3,345	21,731	2025/3/6
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	12,500	10,952	71,137	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	47,710	43,077	279,804	2026/3/5
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	37,190	241,570	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	35,980	34,318	222,909	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,040	21,796	141,574	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	10,600	9,984	64,850	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	33,794	219,508	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	28,400	26,256	170,547	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	29,070	28,706	186,461	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	38,660	38,526	250,245	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	26,670	26,331	171,033	2038/11/18
小 計				2,306,634	
<b>(ドイツ)</b>					
<b>国債証券</b>		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0% 06/16/23	—	1,090	1,090	148,683	2023/6/16
BKO 0% 09/15/23	—	3,150	3,149	429,266	2023/9/15
BKO 0% 12/15/23	—	1,880	1,879	256,163	2023/12/15
DBR 0% 02/15/30	—	2,470	2,319	316,192	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	3,120	2,891	394,094	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	2,790	2,542	346,559	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,260	1,954	266,411	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	3,380	2,880	392,523	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,248	579,018	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,306	450,612	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	4,190	3,911	533,085	2030/8/15

銘柄	利率 (%)	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)		
DBR 0% 08/15/30	—	670	626	85,386	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	3,450	3,172	432,368	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	4,420	3,142	428,307	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	1,260	868	118,378	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,960	2,851	388,612	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	—	2,500	2,383	324,806	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	3,825	521,362	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,080	2,977	405,849	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,630	2,553	347,986	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,080	3,089	421,053	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,998	408,604	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	3,680	3,636	495,603	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	1,940	1,922	262,046	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,029	276,606	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,640	3,704	504,613	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	3,631	494,871	2048/8/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,065	417,794	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,345	319,728	2024/5/15
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,695	231,015	2024/2/15
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	2,931	399,530	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,360	4,226	575,994	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,810	4,894	667,058	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,230	3,048	415,504	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,060	553,415	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,150	3,170	432,153	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,167	431,633	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,990	4,258	580,374	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,480	3,913	533,305	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	3,933	536,102	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,001	409,109	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,551	484,000	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,751	238,735	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,266	172,548	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	3,330	3,316	452,039	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	3,007	409,924	2026/4/10
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,705	505,072	2025/4/11
OBL 0% 04/16/27	—	1,100	1,065	145,211	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	2,900	2,824	384,933	2026/10/9
OBL 0% 10/10/25	—	3,500	3,444	469,497	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,510	205,886	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,410	2,389	325,709	2024/10/18
<b>(イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	986	134,475	2024/1/15
BTPS 0% 01/30/24	—	940	927	126,384	2024/1/30
BTPS 0% 04/01/26	—	1,460	1,362	185,735	2026/4/1
BTPS 0% 04/15/24	—	3,000	2,944	401,338	2024/4/15
BTPS 0% 08/01/26	—	2,580	2,389	325,607	2026/8/1
BTPS 0% 08/15/24	—	1,500	1,461	199,225	2024/8/15
BTPS 0% 12/15/24	—	2,900	2,799	381,502	2024/12/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,503	204,934	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	2,900	2,896	394,822	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	564	76,983	2025/2/1
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	2,070	1,820	248,059	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,829	249,357	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	2,280	2,052	279,685	2028/7/15
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,114	151,838	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,599	354,231	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	670	671	91,483	2023/10/15

当		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)	
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,144	292,291	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,230	1,903	259,443	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	767	104,620	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,550	2,125	289,726	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,952	266,072	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,248	306,468	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,805	246,074	2031/12/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,898	258,799	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	1,773	241,708	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,700	1,400	190,940	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,296	312,937	2025/5/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,407	328,083	2024/11/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	913	124,460	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,412	328,751	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	2,812	383,301	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	2,713	369,837	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,337	318,565	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,680	1,190	162,262	2051/9/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,000	1,012	137,978	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	2,260	1,816	247,545	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,450	2,489	339,326	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,723	371,224	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,246	306,111	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,116	288,415	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	2,741	373,572	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,236	441,104	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	524	71,506	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	920	713	97,258	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,303	314,003	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	1,672	227,938	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	2,522	343,851	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,810	1,532	208,806	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,910	2,984	406,721	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,035	413,703	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,037	413,988	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,210	2,023	275,803	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,130	984	134,236	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	3,190	3,289	448,325	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,012	274,222	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,483	474,823	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,407	191,790	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	1,967	268,213	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,820	1,885	256,989	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,195	299,171	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,246	578,745	2030/3/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,274	309,942	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,860	2,046	278,917	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,550	3,947	537,945	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	2,926	398,863	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,297	313,172	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,720	507,068	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	3,838	523,087	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	3,011	410,499	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,100	2,607	355,411	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,660	4,022	548,219	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,970	3,600	490,764	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,240	2,811	383,187	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,000	3,739	509,627	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,262	580,896	2029/11/1

当		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)	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,881	392,692	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	2,940	3,714	506,243	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,600	4,432	604,159	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,726	235,326	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	895	122,005	2023/11/1
<b>(フランス)</b>					
<b>国債証券</b>					
FRTR 0% 02/25/24	—	4,850	4,832	658,613	2024/2/25
FRTR 0% 02/25/25	—	2,050	2,016	274,790	2025/2/25
FRTR 0% 02/25/26	—	5,210	5,067	690,629	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	—	3,560	3,413	465,192	2027/2/25
FRTR 0% 03/25/24	—	3,750	3,730	508,414	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	6,390	6,286	856,845	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/32	—	1,970	1,701	231,957	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	4,815	656,351	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	—	6,040	5,412	737,604	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	—	4,990	4,370	595,606	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,566	621,011	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,590	5,571	759,369	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	6,690	6,617	901,859	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,350	5,131	699,336	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	3,160	2,497	340,363	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	505	68,870	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,980	1,474	200,979	2044/6/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	6,290	6,194	844,233	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	3,350	2,387	325,235	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	2,060	1,438	196,047	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	5,850	5,738	782,068	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	4,671	636,676	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,330	5,335	727,231	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,090	3,919	534,147	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	5,130	4,819	656,812	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,770	6,880	937,769	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,590	3,202	436,497	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,380	5,470	745,536	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	1,614	220,066	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,320	3,314	451,277	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,289	584,633	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,560	3,571	486,706	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,253	579,648	2024/5/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	7,180	7,899	1,076,653	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,110	5,600	763,251	2027/10/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,400	4,221	575,340	2045/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	5,050	5,589	761,736	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,420	3,507	478,066	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	2,030	3,029	412,822	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	4,437	604,738	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,650	5,980	815,070	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,520	6,363	867,346	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,630	4,942	673,618	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	6,685	911,164	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	6,135	836,189	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,241	305,512	2025/10/25
<b>(オランダ)</b>					
<b>国債証券</b>					
NETHER 0% 01/15/24	—	2,230	2,224	303,109	2024/1/15
NETHER 0% 01/15/26	—	790	770	104,999	2026/1/15
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,774	241,871	2027/1/15
NETHER 0% 01/15/29	—	1,390	1,300	177,218	2029/1/15

当		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)	償還年月日	
NETHER 0% 01/15/38	—	960	759	103,546	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,490	970	132,283	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,500	1,374	187,376	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,820	1,643	224,026	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,310	2,287	311,794	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,570	1,488	202,810	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,040	877	119,628	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,320	2,302	313,783	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	700	650	88,655	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,560	1,554	211,919	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,700	1,683	229,482	2028/7/15	
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,540	1,571	214,222	2023/7/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,059	280,685	2024/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,020	2,263	308,452	2033/1/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,330	2,963	403,870	2047/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,250	3,096	422,045	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,180	2,900	395,254	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,730	2,170	295,792	2028/1/15	
<b>(スペイン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SPGB 0% 01/31/25	—	2,280	2,230	304,047	2025/1/31	
SPGB 0% 01/31/26	—	2,720	2,613	356,154	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	1,560	1,469	200,210	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	1,930	1,782	242,975	2028/1/31	
SPGB 0% 04/30/23	—	1,630	1,629	222,134	2023/4/30	
SPGB 0% 05/31/24	—	2,110	2,086	284,420	2024/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	3,180	2,721	370,974	2031/4/30	
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,271	309,541	2024/7/30	
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	3,590	3,599	490,607	2023/7/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,400	3,105	423,196	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,960	1,717	234,012	2031/10/31	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,950	2,743	373,891	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,939	264,304	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,374	323,635	2027/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,172	159,733	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	650	498	67,899	2042/7/30	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,470	1,665	227,027	2050/10/31	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,260	1,831	249,547	2040/10/31	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	2,927	398,928	2030/10/31	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,750	2,768	377,327	2026/10/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	3,070	3,067	418,033	2028/4/30	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,570	3,559	485,163	2028/7/30	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,672	364,295	2029/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	3,040	3,055	416,405	2027/10/31	
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	411	56,085	2071/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	2,650	2,677	364,946	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,113	424,401	2025/4/30	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,750	2,625	357,890	2035/7/30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	900	740	100,897	2052/10/31	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	2,899	395,210	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,990	2,024	275,852	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	2,922	398,309	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,501	340,954	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	1,886	257,131	2048/10/31	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,050	3,202	436,468	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,200	2,338	318,655	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,780	1,991	271,421	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,677	364,950	2024/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,135	427,272	2037/1/31	

当		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)	償還年月日	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	2,845	387,803	2023/10/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,169	431,986	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,240	3,023	412,400	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,574	350,934	2024/1/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,250	3,089	421,055	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,490	4,272	582,351	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,740	2,536	345,721	2044/10/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,860	3,862	526,379	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,060	2,462	335,566	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,353	184,487	2029/1/31	
<b>(ベルギー)</b>						
<b>国債証券</b>						
BGB 0% 10/22/27	—	430	409	55,791	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	1,680	1,466	199,874	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,248	170,202	2030/6/22	
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,030	1,032	140,714	2023/10/22	
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	480	426	58,155	2032/6/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	1,240	940	128,203	2040/6/22	
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,621	220,984	2024/10/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	342	46,726	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,680	2,694	367,273	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,682	229,337	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,260	1,245	169,796	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,560	1,535	209,208	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,301	313,277	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	2,770	2,680	365,374	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,465	199,771	2033/4/22	
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	610	502	68,507	2053/6/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	755	102,910	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,240	1,114	151,856	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,300	1,176	160,368	2050/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,048	142,941	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	780	767	104,661	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,180	1,208	164,661	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	784	106,922	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,239	305,170	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,180	160,866	2034/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,566	213,503	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,331	181,434	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,870	2,509	342,065	2041/3/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,305	177,978	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,290	3,149	429,296	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,507	478,014	2028/3/28	
<b>(オーストラリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,450	1,311	178,783	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	1,640	1,453	198,110	2031/2/20	
RAGB 0% 04/20/25	—	930	914	124,622	2025/4/20	
RAGB 0% 07/15/23	—	1,120	1,120	152,760	2023/7/15	
RAGB 0% 07/15/24	—	1,440	1,430	194,985	2024/7/15	
RAGB 0% 10/20/40	—	670	477	65,042	2040/10/20	
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	600	486	66,246	2036/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,693	230,836	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,090	1,071	146,024	2027/4/20	
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	440	266	36,307	2071/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,210	1,193	162,608	2028/2/20	
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	592	80,727	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,076	282,958	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	330	167	22,880	2120/6/30	

当		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)		
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	510	482	65,737	2032/2/20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,070	1,090	148,558	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,030	972	132,483	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	270	216	29,530	2086/11/2	
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,020	139,049	2024/10/21	
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,361	185,616	2023/10/20	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	810	780	106,397	2117/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,080	1,174	160,026	2034/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,044	142,336	2044/6/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	638	87,026	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,400	327,199	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,370	1,591	216,840	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,502	204,819	2027/7/15	
<b>(フィンランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
RFGB 0% 09/15/23	—	570	569	77,582	2023/9/15	
RFGB 0% 09/15/24	—	420	415	56,619	2024/9/15	
RFGB 0% 09/15/26	—	200	192	26,257	2026/9/15	
RFGB 0% 09/15/30	—	800	717	97,809	2030/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	330	265	36,172	2036/4/15	
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	285	38,851	2052/4/15	
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	540	480	65,442	2031/9/15	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	500	380	51,816	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	612	83,482	2026/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	380	290	39,601	2043/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	850	115,897	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	650	626	85,378	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	723	98,611	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	800	760	103,649	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	693	94,546	2025/9/15	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	560	529	72,134	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	455	62,015	2047/4/15	
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	752	102,588	2024/4/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	640	723	98,657	2042/7/4	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	606	82,648	2028/7/4	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	916	124,899	2025/7/4	
<b>(アイルランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
IRISH 0% 10/18/31	—	850	741	101,012	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	899	122,598	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,090	991	135,187	2030/10/18	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	470	416	56,710	2032/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	610	516	70,411	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	500	392	53,537	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	690	684	93,284	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,640	1,658	225,992	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,196	163,018	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	651	88,836	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	810	811	110,627	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	708	96,504	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	815	111,099	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,150	1,158	157,891	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,319	179,838	2030/5/15	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,024	139,621	2024/3/18	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,160	1,316	179,406	2025/3/13	
<b>ユーロ計</b>				107,984,367		
<b>(イギリス)</b>						
<b>国債証券</b>						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,520	1,446	232,005	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	3,300	3,227	517,637	2024/1/31	

当		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)		
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,077	333,232	2028/1/31	
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,110	1,072	172,015	2025/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	3,270	2,821	452,574	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,910	1,811	290,494	2026/10/22	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,157	345,999	2030/10/22	
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,020	940	150,856	2029/1/31	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	782	125,467	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,659	266,102	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,810	2,319	372,094	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	880	594	95,393	2050/10/22	
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,360	2,343	375,912	2023/7/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,170	881	141,444	2046/1/31	
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	510	452	72,628	2033/7/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,601	256,897	2029/10/22	
UKT 1% 01/31/32	1.0	400	366	58,847	2032/1/31	
UKT 1% 04/22/24	1.0	800	793	127,299	2024/4/22	
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	500	424	68,100	2039/1/31	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	520	381	61,202	2073/10/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	950	935	150,052	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	830	663	106,431	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,373	380,645	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,599	256,534	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,370	2,044	327,887	2047/7/22	
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	420	358	57,481	2053/7/31	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,620	1,621	260,081	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	1,633	261,968	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,480	1,313	210,615	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,183	189,749	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,210	2,003	322,159	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,630	2,478	397,600	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,809	290,170	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,524	404,952	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,510	1,710	274,281	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,690	1,736	278,580	2024/9/7	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,180	2,556	410,003	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,290	2,799	448,953	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	2,770	444,331	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,155	345,782	2052/7/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,306	370,019	2060/1/22	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,640	2,051	329,096	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,544	408,190	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,620	2,097	336,401	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,559	250,103	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,750	2,288	367,079	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,920	2,651	425,243	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,143	343,724	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,910	2,871	460,485	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,860	2,348	376,707	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,210	3,037	487,197	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,460	1,804	289,353	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,238	359,052	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,300	2,515	403,517	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,584	254,059	2028/12/7	
<b>小計</b>				15,794,705		
<b>(スウェーデン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	6,470	5,738	74,256	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,800	7,481	96,809	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,560	7,168	92,763	2029/11/12	

当		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)		
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,440	8,283	107,188	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	12,561	162,539	2023/11/13	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	4,980	5,328	68,955	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	9,300	9,582	124,002	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,310	6,753	87,389	2039/3/30	
小計				813,906		
<b>(ノルウェー)</b>		千ノルウェー	千ノルウェー			
<b>国債証券</b>		クローネ	クローネ			
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,590	3,176	42,568	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	6,480	5,878	78,770	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,670	4,501	60,319	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,680	4,512	60,461	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,720	5,612	75,204	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	6,340	5,972	80,036	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	5,020	4,855	65,064	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	10,660	10,679	143,105	2023/5/24	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,220	3,070	41,150	2032/5/18	
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,760	7,863	105,368	2024/3/14	
小計				752,049		
<b>(デンマーク)</b>		千デンマーク	千デンマーク			
<b>国債証券</b>		クローネ	クローネ			
DGB 0% 11/15/24	—	2,550	2,514	46,062	2024/11/15	
DGB 0% 11/15/31	—	5,830	5,165	94,629	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	6,050	4,231	77,524	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	8,850	8,612	157,790	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,410	11,853	217,149	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,550	7,699	141,057	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,510	5,697	104,381	2025/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	13,290	19,447	356,278	2039/11/15	
小計				1,194,873		
<b>(ポーランド)</b>		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
<b>国債証券</b>						
POLGB 0% 07/25/24	—	2,160	1,885	56,302	2024/7/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,850	2,165	64,655	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,039	90,752	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,150	2,759	82,368	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	650	423	12,645	2032/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	3,586	107,059	2024/10/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,550	3,309	98,809	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,860	5,830	174,057	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	3,088	92,207	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	5,750	4,663	139,231	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,220	4,815	143,768	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,910	4,449	132,840	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,410	2,334	69,697	2023/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	572	17,091	2029/4/25	
小計				1,281,487		
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリア	千オーストラリア			
<b>国債証券</b>		ドル	ドル			
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	3,430	3,234	294,440	2024/11/21	
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,138	194,682	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,040	1,838	167,315	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,250	2,659	242,112	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,360	1,969	179,243	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,272	206,870	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	2,756	250,935	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,760	1,176	107,084	2051/6/21	

当		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)		
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,910	2,516	229,039	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,140	1,088	99,065	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,520	3,348	304,761	2030/5/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,388	126,365	2024/4/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,439	131,056	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,050	978	89,060	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,930	1,901	173,056	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,624	147,849	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,410	1,370	124,753	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,508	137,324	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,000	970	88,342	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,560	2,593	236,058	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,200	2,215	201,615	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,120	1,077	98,062	2039/6/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,672	152,268	2037/4/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,890	1,982	180,422	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,310	2,565	233,478	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,504	227,979	2027/4/21	
小計				4,623,245		
<b>(シンガポール)</b>		千シンガポールドル	千シンガポールドル			
<b>国債証券</b>						
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	750	704	65,351	2025/11/1	
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	530	503	46,761	2026/11/1	
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	650	598	55,534	2031/7/1	
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	810	691	64,180	2050/3/1	
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	320	275	25,547	2051/10/1	
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	409	37,964	2024/2/1	
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	1,080	1,068	99,135	2026/6/1	
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	890	839	77,942	2036/8/1	
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	730	730	67,828	2025/6/1	
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	430	408	37,926	2039/7/1	
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	530	533	49,496	2028/5/1	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	760	760	70,558	2046/3/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	626	58,188	2042/4/1	
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	620	624	57,980	2023/7/1	
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	662	61,514	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	1,200	1,224	113,641	2030/9/1	
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,590	1,614	149,890	2024/9/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	886	82,296	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	920	85,487	2027/3/1	
小計				1,307,226		
<b>(マレーシア)</b>		千マレーシア	千マレーシア			
<b>国債証券</b>		リンギット	リンギット			
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,510	1,349	39,156	2031/4/15	
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	1,920	1,925	55,877	2024/6/14	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,490	43,267	2027/5/31	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,870	2,852	82,799	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,520	1,369	39,760	2040/5/22	
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	930	942	27,350	2023/8/17	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,180	1,119	32,496	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,670	1,601	46,485	2033/4/15	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,041	30,230	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,500	1,489	43,239	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,135	32,964	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,987	57,691	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,120	2,135	61,997	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	605	17,564	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	3,120	3,156	91,610	2025/9/15	

当		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)		償還年月日
MGS	4.059%	09/30/24	4,059	1,780	1,806	52,428	2024/9/30
MGS	4.065%	06/15/50	4,065	2,340	2,095	60,809	2050/6/15
MGS	4.181%	07/15/24	4,181	1,280	1,300	37,741	2024/7/15
MGS	4.232%	06/30/31	4,232	3,000	3,014	87,493	2031/6/30
MGS	4.254%	05/31/35	4,254	2,030	1,984	57,609	2035/5/31
MGS	4.392%	04/15/26	4,392	2,500	2,565	74,470	2026/4/15
MGS	4.498%	04/15/30	4,498	2,860	2,945	85,484	2030/4/15
MGS	4.642%	11/07/33	4,642	1,770	1,824	52,967	2033/11/7
MGS	4.736%	03/15/46	4,736	1,480	1,468	42,618	2046/3/15
MGS	4.762%	04/07/37	4,762	2,280	2,355	68,354	2037/4/7
MGS	4.893%	06/08/38	4,893	2,310	2,392	69,440	2038/6/8
MGS	4.921%	07/06/48	4,921	1,680	1,699	49,323	2048/7/6
MGS	4.935%	09/30/43	4,935	1,030	1,056	30,659	2043/9/30
小 計						1,471,893	
<b>(中国オフショア)</b>			千オフショア人民元	千オフショア人民元			
<b>国債証券</b>							
CGB	1.99%	04/09/25	1.99	29,520	29,240	553,007	2025/4/9
CGB	2.28%	03/17/24	2.28	9,700	9,720	183,830	2024/3/17
CGB	2.47%	09/02/24	2.47	18,980	19,083	360,906	2024/9/2
CGB	2.48%	04/15/27	2.48	9,000	9,001	170,240	2027/4/15
CGB	2.56%	10/21/23	2.56	30,440	30,628	579,262	2023/10/21
CGB	2.68%	05/21/30	2.68	22,480	22,308	421,898	2030/5/21
CGB	2.69%	08/12/26	2.69	17,240	17,391	328,905	2026/8/12
CGB	2.8%	03/24/29	2.8	7,900	7,946	150,287	2029/3/24
CGB	2.84%	04/08/24	2.84	11,650	11,793	223,043	2024/4/8
CGB	2.85%	06/04/27	2.85	12,330	12,512	236,648	2027/6/4
CGB	2.89%	11/18/31	2.89	5,510	5,562	105,208	2031/11/18
CGB	2.91%	10/14/28	2.91	10,280	10,419	197,053	2028/10/14
CGB	3.01%	05/13/28	3.01	7,230	7,378	139,539	2028/5/13
CGB	3.02%	05/27/31	3.02	6,850	6,971	131,841	2031/5/27
CGB	3.03%	03/11/26	3.03	26,760	27,345	517,164	2026/3/11
CGB	3.27%	11/19/30	3.27	6,850	7,120	134,656	2030/11/19
CGB	3.28%	12/03/27	3.28	5,410	5,614	106,182	2027/12/3
CGB	3.39%	03/16/50	3.39	5,520	5,614	106,179	2050/3/16
CGB	3.53%	10/18/51	3.53	2,950	3,092	58,487	2051/10/18
CGB	3.72%	04/12/51	3.72	2,390	2,577	48,753	2051/4/12
CGB	3.81%	09/14/50	3.81	7,460	8,164	154,413	2050/9/14
CGB	3.86%	07/22/49	3.86	5,580	6,141	116,143	2049/7/22
CGB	4.08%	10/22/48	4.08	4,110	4,671	88,351	2048/10/22
小 計						5,112,008	
<b>(イスラエル)</b>			千イスラエル シケル	千イスラエル シケル			
<b>国債証券</b>							
ILGOV	0.15%	07/31/23	0.15	840	829	31,474	2023/7/31
ILGOV	0.4%	10/31/24	0.4	1,210	1,166	44,236	2024/10/31
ILGOV	0.5%	02/27/26	0.5	860	809	30,692	2026/2/27
ILGOV	0.5%	04/30/25	0.5	2,420	2,316	87,848	2025/4/30
ILGOV	1%	03/31/30	1.0	2,830	2,549	96,708	2030/3/31
ILGOV	1.3%	04/30/32	1.3	280	250	9,482	2032/4/30
ILGOV	1.5%	05/31/37	1.5	2,190	1,807	68,565	2037/5/31
ILGOV	1.5%	11/30/23	1.5	2,230	2,241	85,009	2023/11/30
ILGOV	1.75%	08/31/25	1.75	1,240	1,236	46,902	2025/8/31
ILGOV	2%	03/31/27	2.0	2,750	2,725	103,382	2027/3/31
ILGOV	2.25%	09/28/28	2.25	2,010	2,004	76,018	2028/9/28
ILGOV	3.75%	03/31/24	3.75	4,080	4,231	160,473	2024/3/31
ILGOV	3.75%	03/31/47	3.75	3,130	3,391	128,622	2047/3/31
ILGOV	5.5%	01/31/42	5.5	2,030	2,755	104,494	2042/1/31
ILGOV	6.25%	10/30/26	6.25	3,060	3,581	135,829	2026/10/30
小 計						1,209,741	
合 計						297,584,217	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	EURO-SCHATZ	496	—
	US 5YR NOTE	1,065	—
	EURO-BOBL FU	781	—
	EURO-BUND	1,613	—
	US 10YR NOTE	869	—
	US LONG BOND	912	—

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 297,584,217	% 97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,619,511	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	306,203,728	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(300,593,413千円)の投資信託財産総額(306,203,728千円)に対する比率は98.2%です。

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

1米ドル=127.02円

1ユーロ=136.29円

1ノルウェークローネ=13.40円

1オーストラリアドル=91.02円

1オフショア人民元=18.9124円

1カナダドル=99.87円

1イギリスポンド=160.39円

1デンマーククローネ=18.32円

1シンガポールドル=92.82円

1イスラエルシェケル=37.927円

1メキシコペソ=6.4954円

1スウェーデンクローナ=12.94円

1ポーランドズロチ=29.8545円

1マレーシアリンギット=29.0252円

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年5月30日現在
(A)資 産	312,166,419,317円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,231,147,162
公 社 債(評価額)	297,584,217,256
未 収 入 金	5,975,913,184
未 収 利 息	1,602,999,713
前 払 費 用	68,788,346
差 入 委 託 証 拠 金	703,353,656
(B)負 債	6,035,903,620
未 払 金	6,013,434,102
未 払 解 約 金	22,464,619
未 払 利 息	4,899
(C)純 資 産 総 額(A-B)	306,130,515,697
元 本	99,597,188,643
次 期 繰 越 損 益 金	206,533,327,054
(D)受 益 権 総 口 数	99,597,188,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,737円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	5,588,602,464円
受 取 利 息	5,591,422,848
そ の 他 収 益 金	85,970
支 払 利 息	△2,906,354
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,919,550,310
売 買 益	28,346,868,449
売 買 損	△33,266,418,759
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△355,314,134
取 引 益	228,024,368
取 引 損	△583,338,502
(D)そ の 他 費 用	△78,636,127
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	235,101,893
(F)前 期 繰 越 損 益 金	205,204,029,702
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	37,399,000,336
(H)解 約 差 損 益 金	△36,304,804,877
(I) 計 (E+F+G+H)	206,533,327,054
次 期 繰 越 損 益 金(I)	206,533,327,054

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

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は99,051,563,319円、期中追加設定元本額は17,957,103,019円、期中一部解約元本額は17,411,477,695円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセクション(SMA専用)	15,588,874,755円
世界経済インデックスファンド	13,705,517,215円
DC世界経済インデックスファンド	12,670,772,916円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	11,035,294,676円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,187,835,347円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,001,557,866円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	2,526,946,203円
DC外国債券インデックス・オープン	2,299,774,574円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,173,342,834円
DCマイセクション25	1,953,384,106円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,763,244,024円
DCマイセクション50	1,676,561,671円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,411,756,777円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,322,110,043円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,316,783,744円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,312,521,937円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	1,174,457,124円
DCマイセクション75	1,141,290,393円
DCマイセクションS25	934,868,709円
グローバル経済コア	843,868,056円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,139,958円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	737,949,757円
DCマイセクションS50	736,631,684円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,286,117円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	600,790,052円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	569,673,405円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	545,698,435円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,035,373円
コア投資戦略ファンド(切替型)	537,685,860円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	501,882,298円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	449,635,006円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	445,614,258円
DCマイセクションS75	414,158,205円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	387,700,518円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	344,318,886円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,732,727円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	311,958,664円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	305,209,636円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	283,459,403円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン	250,909,160円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	250,415,573円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	211,302,672円
SMT インデックスバランス・オープン	196,612,068円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,614,783円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	169,275,387円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,549,248円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	102,644,337円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	92,308,746円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	82,452,091円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	75,911,463円

バランス25VA2(適格機関投資家専用)	73,784,318円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	71,940,031円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	70,266,398円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	53,860,232円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	47,930,499円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,411,067円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,403,026円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,394,173円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	23,157,130円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,454,941円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	13,381,571円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,541,025円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,653,367円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,114,094円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,968,437円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,146,398円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,811,153円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,650,011円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,324,475円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,718円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率						
第18期(2018年5月29日)	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
第19期(2019年5月29日)	24,481	10.2	644.41	8.0	92.8	4.9	2.2	2.2	336,874	
第20期(2020年5月29日)	25,011	2.2	644.69	0.0	95.0	2.5	2.7	2.7	345,116	
第21期(2021年5月31日)	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5	2.5	399,725	
第22期(2022年5月30日)	37,583	45.3	934.05	43.2	95.3	2.5	2.2	2.2	517,603	
第22期(2022年5月30日)	41,948	11.6	1,023.64	9.6	94.1	3.7	2.3	2.3	523,424	

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率					
(当期首) 2021年 5月31日	円	%		%	%	%	%	%	%
6月末	37,583	—	934.05	—	95.3	2.5	2.2	2.2	2.2
7月末	38,524	2.5	954.04	2.1	95.3	2.4	2.2	2.2	2.2
8月末	39,067	3.9	968.73	3.7	94.9	2.9	2.3	2.3	2.3
9月末	40,031	6.5	989.82	6.0	95.4	2.3	2.3	2.3	2.3
10月末	39,103	4.0	965.47	3.4	95.0	2.8	2.2	2.2	2.2
11月末	41,963	11.7	1,032.76	10.6	96.3	1.4	2.3	2.3	2.3
12月末	41,795	11.2	1,028.15	10.1	95.9	1.7	2.3	2.3	2.3
2022年 1月末	43,503	15.8	1,070.07	14.6	95.1	2.6	2.3	2.3	2.3
2月末	40,462	7.7	992.90	6.3	95.8	1.9	2.3	2.3	2.3
3月末	40,194	6.9	987.99	5.8	95.3	2.5	2.2	2.2	2.2
4月末	44,470	18.3	1,086.68	16.3	94.7	2.9	2.3	2.3	2.3
(当期末) 2022年 5月30日	42,568	13.3	1,036.73	11.0	95.5	2.1	2.5	2.5	2.5
(当期末) 2022年 5月30日	41,948	11.6	1,023.64	9.6	94.1	3.7	2.3	2.3	2.3

(注1) 騰落率は期首比です。

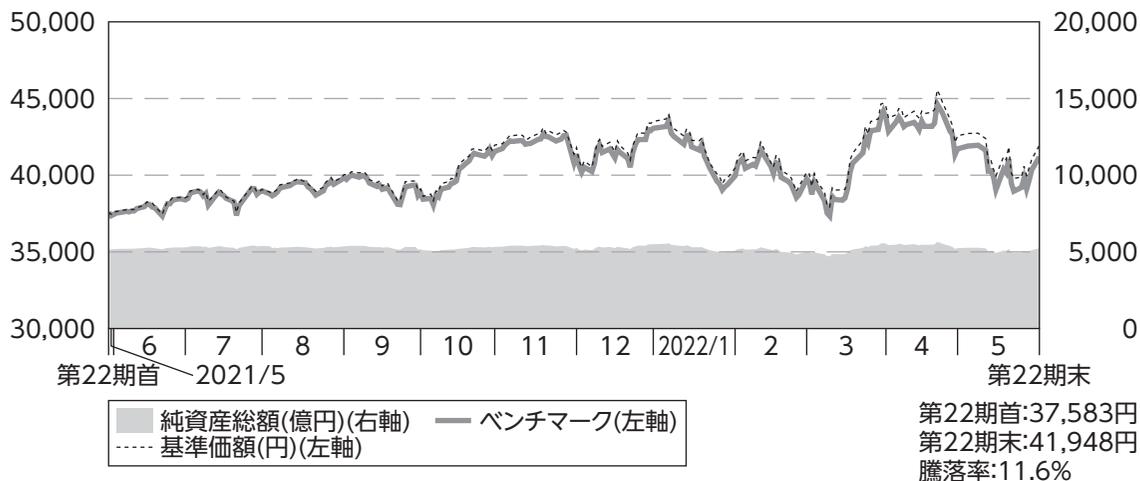
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

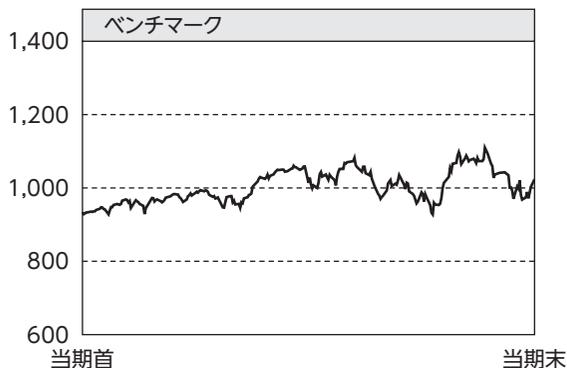


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境



先進国株式市場は、新型コロナウイルスのワクチン接種の進展を背景に経済正常化への期待が高まったことや、概ね良好な企業決算、米国で年末商戦期の小売売上高が好調であったと報じられたことなどが好感され、2021年末にかけて上昇しました。その後は、FRB（米連邦準備理事会）やECB（欧州中央銀行）などの先行きの金融政策に対するタカ派的な姿勢が警戒されたことや、ロシアのウクライナ侵攻開始を受けた欧米の対ロシア経済制裁による世界経済の減速が懸念されたことなどから下落しました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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

### (1) 組入比率

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

### (2) ポートフォリオ構成

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

## 当ファンドの組入資産の内容

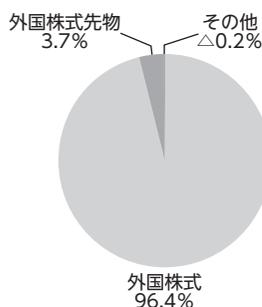
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	4.7%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.7%
3	S&P 500 EMIN 2206	アメリカ	2.7%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.0%
5	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
6	TESLA INC	アメリカ	1.2%

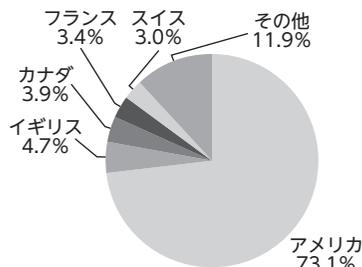
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
8	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
10	NVIDIA CORP	アメリカ	0.9%
組入銘柄数			1,286

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

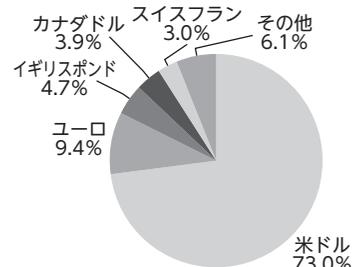
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

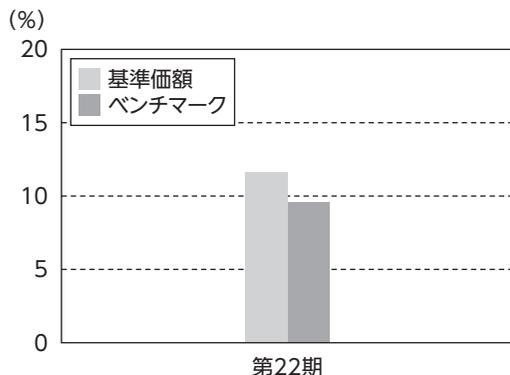


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.7%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

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

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

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

## 今後の運用方針

原則としてMSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.002%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(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)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	0	0.000	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(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)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	12	0.029	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(11)	(0.028)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	13	0.031	

(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(40,771円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 7,360 (757)	千米ドル 65,474 (5,594)	百株 30,095 (1,286)	千米ドル 358,515 (11,065)
	カ ナ ダ	571 (515)	千カナダドル 3,621 (1,892)	4,907 (-)	千カナダドル 21,189 (27)
	ド イ ツ	610 (1,125)	千ユーロ 1,282 (△77)	3,173	千ユーロ 12,402
	イ タ リ ア	- (-)	- (△3)	8,827	2,818
	フ ラ ン ス	76 (1,343)	216 (-)	4,251	14,251
	オ ラ ン ダ	543 (774)	4,552 (△10)	1,893	7,631
	ス ペ イ ン	- (19,703)	- (413)	4,139 (19,239)	3,400 (415)
	ベ ル ギ ー	86	474	172	1,190
	ル ク セ ン ブ ル ク	-	-	386	559
	フ ィ ン ラ ン ド	-	-	691	1,632
	ア イ ル ラ ン ド	-	-	122	832
	ポ ル ト ガ ル	-	-	212	212
	国	イ ギ リ ス	4,154 (3,740)	千イギリスポンド 820 (4,901)	36,870 (2,953)
ス イ ス		23 (125)	千スイスフラン 1,112 (203)	1,554 (33)	千スイスフラン 13,735 (441)
ス ウ ェ ー デ ン		1,011 (4,701)	千スウェーデンクローナ 27,797 (-)	4,964 (187)	千スウェーデンクローナ 48,121 (2,950)
ノ ル ウ ェ ー		61	千ノルウェークローネ 1,751	711	千ノルウェークローネ 10,486
デ ン マ ー ク		6	千デンマーククローネ 1,789	448	千デンマーククローネ 26,191
ロ シ ア		- (182)	千ロシアルーブル - (10,558)	- (182)	千ロシアルーブル - (10,558)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	2,065 (5,003)	千オーストラリアドル 10,031 (606)	10,531 (1,944)	千オーストラリアドル 14,752 (2,367)
	ニュージーランド	—	千ニュージーランドドル —	813	千ニュージーランドドル 875
	香 港	1,200 (430)	千香港ドル 4,073 (△79)	11,523	千香港ドル 31,025
	シンガポール	— (4,499)	千シンガポールドル — (548)	2,487 (4,499)	千シンガポールドル 1,553 (826)
	イスラエル	—	千イスラエルシェケル —	266	千イスラエルシェケル 1,602

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
BOSTON PROPERTIES	—	—	1	198
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	—	—	20	586
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	—	—	30	253
PROLOGIS INC	—	—	5	763
AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	0.693	153
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	—	1	152
DUKE REALTY CORP	—	—	4	215
CROWN CASTLE INTL CORP	—	—	3	630
ESSEX PROPERTY TRUST	—	—	0.74	257
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	—	—	4	420
WELLTOWER INC	—	—	2	246
KIMCO REALTY CORP	47	1,127	—	—
IRON MOUNTAIN INC	—	—	4	184
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	—	—	2	207
HOST HOTELS AND RESORTS INC	—	—	10	174
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	1	250
REALTY INCOME CORP	2 (12)	171 (851)	2	176
UDR INC	—	—	3	208
SIMON PROPERTY GROUP	—	—	2	398
PUBLIC STORAGE	—	—	1	449
VORNADO REALTY TRUST	—	—	4	176
DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	1	254
VEREIT INC	— (△17)	— (△851)	3	149
AMERICAN TOWER CORPORATION	1	350	4	1,180
WP CAREY INC	—	—	2	180
INVITATION HOMES INC	—	—	4	187
ORION OFFICE REIT INC	— (4)	— (—)	4	73
EQUINIX INC	—	—	0.584	465
VICI PROPERTIES INC	31	921	5	172
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	—	1	338
小 計	83 (△1)	2,570 (—)	137	9,108

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	—	—	4	233
小 計	—	—	4	233
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	(—)	(△46)	—	—
GECINA SA	—	—	1	156
小 計	(—)	(△46)	1	156
ユ ー ロ 計	(—)	(△46)	1	156
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
SEGRO PLC	—	—	13	166
LAND SECURITIES GROUP PLC	—	—	20	159
小 計	—	—	33	325
オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
MIRVAC GROUP	—	—	126	361
APA GROUP	—	—	31	277
SYDNEY AIRPORT	—	—	124	1,083
GOODMAN GROUP	8	199	15	367
SCENTRE GROUP	—	—	104	313
小 計	8	199	401	2,403
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
HKT TRUST AND HKT LTD	—	—	170	1,789
小 計	—	—	170	1,789
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	(34)	(57)	120	248
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	(—)	(△7)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	(10)	(12)	—	—
CDL HOSPITALITY TRUSTS	(6)	(8)	6	8
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(—)	(△1)	—	—
小 計	(51)	(69)	127	256

(注1)金額は受渡金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 109,011	百万円 104,690	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

<株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	66,758,835千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	504,242,652千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	0.13

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 36,693	百万円 -	% -	百万円 88,134	百万円 61	% 0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン	207,987	5,004	2.4	207,929	4,859	2.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
AMAZON.COM	369	357	82,290	10,452,551	小売
ABBOTT LABORATORIES	1,527	1,380	16,112	2,046,601	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	617	543	1,219	154,917	公益事業
ABIOMED INC	37	37	1,007	127,913	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	774	696	9,694	1,231,441	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,044	1,278	13,075	1,660,872	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	412	371	15,889	2,018,342	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	386	336	7,100	901,926	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	191	175	4,396	558,462	素材
ALLEGHANY CORP	12	9	755	95,976	保険
ALLSTATE CORP	264	230	3,161	401,570	保険
HONEYWELL INTL INC	599	536	10,533	1,337,951	資本財
AMGEN	497	440	11,242	1,428,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HESS CORP	248	227	2,808	356,728	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	594	514	8,731	1,109,077	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	441	381	3,946	501,275	公益事業
AFLAC	580	505	3,056	388,198	保険
AMERICAN INT'L GROUP	752	658	3,887	493,851	保険
AMERCO	10	7	368	46,799	運輸
ANALOG DEVICES	319	416	6,974	885,871	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	189	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VALERO ENERGY CORP	346	307	4,054	515,049	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	3,943	3,567	15,752	2,000,920	メディア・娯楽
ANSYS INC	74	67	1,797	228,360	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	14,508	12,844	192,207	24,414,252	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	794	713	8,527	1,083,105	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	101	94	2,557	324,851	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	483	429	3,821	485,350	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	107	—	—	—	公益事業
AMEREN CORPORATION	208	208	2,017	256,288	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	61	61	740	94,009	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	67	—	—	—	自動車・自動車部品
AUTODESK INC	189	174	3,692	468,979	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	367	327	7,364	935,477	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	19	16	3,368	427,902	小売
AVERY DENNISON CORP	74	66	1,152	146,380	素材
BALL CORP	279	256	1,887	239,795	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,183	1,019	32,544	4,133,793	各種金融
BANK NEW YORK CO	712	612	2,847	361,636	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	440	384	2,924	371,504	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	251	222	5,701	724,219	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
AMETEK INC	196	180	2,205	280,080	資本財	
VERIZON COMMUNICATIONS	3,569	3,224	16,574	2,105,233	電気通信サービス	
WR BERKLEY CORP	117	175	1,244	158,025	保険	
BEST BUY COMPANY INC	198	181	1,526	193,898	小売	
BIO-RAD LABORATORIES-A	18	18	1,014	128,805	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YUM BRANDS INC	258	226	2,711	344,380	消費者サービス	
FIRSTENERGY CORP	457	411	1,787	227,036	公益事業	
BOEING CO	476	432	5,718	726,353	資本財	
ROBERT HALF INTL INC	95	95	854	108,591	商業・専門サービス	
BORGWARNER INC	197	197	785	99,824	自動車・自動車部品	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	7	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,236	1,128	4,647	590,318	ヘルスケア機器・サービス	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	112	112	1,213	154,116	運輸	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	97	89	1,128	143,357	メディア・娯楽	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	20	18	2,398	304,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,930	1,727	13,156	1,671,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ONEOK INC	377	332	2,231	283,426	エネルギー	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	63	63	873	110,948	保険	
UNITED RENTALS INC	61	53	1,604	203,765	資本財	
SEMPRA ENERGY	270	245	4,088	519,354	公益事業	
FEDEX CORP	215	195	4,288	544,768	運輸	
VERISIGN INC	87	77	1,373	174,466	ソフトウェア・サービス	
AMPHENOL CORPORATION	514	459	3,280	416,666	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	262	240	1,597	202,957	食品・飲料・タバコ	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	995	604	385	49,002	メディア・娯楽	
CSX CORP	658	1,731	5,549	704,875	運輸	
COTERRA ENERGY INC	—	640	2,273	288,752	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO (US)	158	158	765	97,175	食品・飲料・タバコ	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	149	129	3,187	404,844	食品・飲料・タバコ	
CARDINAL HEALTH	246	219	1,263	160,520	ヘルスケア機器・サービス	
CATERPILLAR	472	424	9,228	1,172,170	資本財	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	104	81	1,025	130,206	ソフトウェア・サービス	
CITRIX SYSTEMS INC	104	104	1,054	133,919	ソフトウェア・サービス	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	861	737	922	117,126	電気通信サービス	
CERNER CORP	273	228	2,167	275,329	ヘルスケア機器・サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	2,635	2,312	30,353	3,855,442	銀行	
CHURCH & DWIGHT CO INC	210	179	1,625	206,469	家庭用品・パーソナル用品	
CIGNA CORP	302	263	7,171	910,920	ヘルスケア機器・サービス	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	127	127	1,642	208,645	保険	
CINTAS CORP	80	74	2,946	374,234	商業・専門サービス	
CISCO SYSTEMS	3,640	3,282	14,974	1,902,112	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CLOROX COMPANY	108	95	1,423	180,769	家庭用品・パーソナル用品	
COCA-COLA CO	3,556	3,197	20,681	2,626,979	食品・飲料・タバコ	
COPART INC	180	166	1,939	246,296	商業・専門サービス	
COGNEX CORP	162	143	707	89,873	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COLGATE-PALMOLIVE CO	704	637	5,030	638,951	家庭用品・パーソナル用品	
MARRIOTT INTL A	243	211	3,647	463,336	消費者サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MOLINA HEALTHCARE INC	49	45	1,386	176,124	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	230	190	885	112,502	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	411	359	1,191	151,337	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	287	275	2,766	351,420	公益事業
CMS ENERGY CORP	267	236	1,693	215,124	公益事業
THE COOPER COS INC	41	41	1,455	184,924	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	649	649	2,316	294,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	146	116	745	94,704	素材
HEICO CORP-CLASS A	64	64	764	97,069	資本財
CUMMINS INC	129	112	2,332	296,232	資本財
DR HORTON INC	296	277	2,076	263,717	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	556	505	13,458	1,709,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	147	133	4,109	522,001	各種金融
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	460	404	3,020	383,684	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	434	371	6,210	788,826	小売
DEERE&CO	258	232	8,387	1,065,404	資本財
MORGAN STANLEY	1,222	1,063	9,197	1,168,233	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	200	169	2,318	294,540	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	34	321	1,975	250,881	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,566	1,416	15,481	1,966,427	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	201	179	2,958	375,803	小売
DOVER CORP	122	106	1,435	182,390	資本財
OMNICOM GROUP	180	165	1,240	157,549	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	162	146	1,967	249,928	公益事業
DUKE ENERGY CORP	660	598	6,846	869,612	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	120	107	1,350	171,494	消費者サービス
EBAY	593	510	2,490	316,387	小売
BANK OF AMERICA CORP	6,705	5,762	21,333	2,709,740	銀行
CITIGROUP	1,811	1,551	8,319	1,056,779	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	126	110	1,214	154,221	素材
EATON CORP	344	316	4,421	561,640	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	247	219	3,425	435,055	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	201	201	448	57,024	メディア・娯楽
ECOLAB INC	221	198	3,303	419,568	素材
PERKINELMER INC	93	93	1,463	185,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	249	218	3,021	383,840	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	792	762	12,585	1,598,577	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	362	46,000	保険
EMERSON ELECTRIC CO	513	463	4,093	519,938	資本財
ATMOS ENERGY CORP	114	96	1,139	144,764	公益事業
ENERGY CORP	169	151	1,836	233,246	公益事業
EOG RESOURCES INC	513	461	6,311	801,672	エネルギー
EQUIFAX INC	104	95	1,961	249,163	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER CO-CL A	201	184	4,643	589,854	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	142	142	1,579	200,589	運輸
EXXON MOBIL	3,651	3,301	32,215	4,092,029	エネルギー
FMC CORP	121	105	1,323	168,172	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NEXTERA ENERGY INC	1,704	1,525	11,811	1,500,235	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	31	31	1,221	155,149	各種金融
FAIR ISAAC CORP	26	21	873	110,914	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	47	47	857	108,899	保険
FASTENAL CO	487	448	2,427	308,285	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	613	528	2,065	262,312	銀行
M & T BANK CORP	117	140	2,537	322,362	銀行
FISERV INC	516	464	4,705	597,717	ソフトウェア・サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	260	260	718	91,229	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	1,253	1,131	4,488	570,083	素材
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	—	9	659	83,723	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	163	163	2,709	344,186	保険
DENTSPLY SIRONA INC	201	177	705	89,673	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	212	189	4,296	545,791	資本財
GENERAL MILLS INC	532	465	3,252	413,164	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	121	101	1,408	178,890	小売
GILEAD SCIENCES INC	1,079	970	6,289	798,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	75	63	1,690	214,686	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	138	120	4,049	514,346	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	534	1,961	36,891	4,686,014	半導体・半導体製造装置
GENERAL ELECTRIC CO	7,612	851	6,709	852,218	資本財
GRAINGER (WW) INC	38	32	1,586	201,568	資本財
HALLIBURTON CO	775	682	2,823	358,654	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	297	266	8,752	1,111,686	各種金融
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	180	156	3,778	479,956	資本財
HASBRO INC	124	105	920	116,935	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	117	117	1,009	128,261	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	36	36	525	66,689	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	125	113	2,413	306,568	食品・飲料・タバコ
HP INC	1,063	923	3,578	454,529	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	53	41	694	88,184	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	112	99	1,062	135,007	素材
JUNIPER NETWORKS INC	313	253	790	100,412	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	216	190	1,473	187,117	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	929	815	25,154	3,195,137	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	171	147	1,196	152,040	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	271	233	1,134	144,158	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	481	481	1,561	198,330	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	30	25	534	67,863	資本財
HUMANA INC	110	99	4,590	583,075	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	70	70	1,233	156,629	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	854	1,141	1,589	201,908	銀行
BIOGEN INC	134	118	2,445	310,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	69	59	1,136	144,383	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	274	242	5,008	636,203	資本財
INTUIT INC	235	212	8,976	1,140,186	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	74	67	2,691	341,812	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
INTEL CORP	3,504	3,188	14,203	1,804,131	半導体・半導体製造装置	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	211	194	2,591	329,225	素材	
INT'L PAPER CO	338	308	1,518	192,911	素材	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	338	338	1,092	138,726	メディア・娯楽	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	120	106	1,493	189,663	商業・専門サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	62	62	1,183	150,299	ソフトウェア・サービス	
INCYTE CORP	175	152	1,174	149,148	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JOHNSON & JOHNSON	2,269	2,053	37,190	4,723,931	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	303	277	2,015	255,985	保険	
KLA CORP	136	121	4,499	571,516	半導体・半導体製造装置	
DEVON ENERGY CORPORATION	570	516	3,917	497,552	エネルギー	
KELLOGG CO	216	216	1,509	191,798	食品・飲料・タバコ	
KEY CORP	832	714	1,416	179,933	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	289	258	3,453	438,723	家庭用品・パーソナル用品	
BLACKROCK INC	132	118	7,878	1,000,712	各種金融	
KROGER CO	613	561	2,972	377,558	食品・生活必需品小売り	
LAM RESEARCH CORP	124	109	5,836	741,412	半導体・半導体製造装置	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	38	38	1,552	197,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PACKAGING CORP OF AMERICA	88	76	1,229	156,126	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	136	136	1,404	178,415	ソフトウェア・サービス	
PLUG POWER INC	418	418	798	101,401	資本財	
LENNAR CORP-CL A	249	208	1,691	214,906	耐久消費財・アパレル	
LILLY (ELI) & CO	701	632	20,474	2,600,733	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BATH & BODY WORKS INC	198	198	840	106,793	小売	
LINCOLN NATIONAL CORP	163	134	786	99,886	保険	
UNITED PARCEL SERVICE B	621	566	10,339	1,313,288	運輸	
AGILENT TECHNOLOGIES	260	237	3,105	394,413	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LOCKHEED MARTIN CORP	216	193	8,710	1,106,372	資本財	
LOEWS CORP	188	167	1,103	140,196	保険	
CARNIVAL CORPORATION	705	621	867	110,198	消費者サービス	
LOWES COMPANIES	637	521	10,418	1,323,407	小売	
DOMINION ENERGY INC	690	623	5,311	674,711	公益事業	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	330	288	1,007	127,961	消費者サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	210	189	1,757	223,225	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	648	581	14,642	1,859,853	消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	206	277	10,002	1,270,544	各種金融	
EVEREST RE GROUP LTD	32	32	936	118,940	保険	
MARKEL CORP	11	11	1,622	206,143	保険	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	535	483	4,887	620,840	ヘルスケア機器・サービス	
MARSH & MCLENNAN COS	446	392	6,321	802,922	保険	
MASCO CORP	234	194	1,125	142,984	資本財	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	53	46	1,618	205,556	素材	
METLIFE INC	642	571	3,868	491,394	保険	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	226	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,171	1,045	10,362	1,316,229	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	669	616	4,820	612,297	メディア・娯楽	
CVS HEALTH CORP	1,136	1,025	10,056	1,277,426	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
MERCK & CO	2,181	1,970	18,342	2,329,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ON SEMICONDUCTOR CORP	359	317	1,942	246,694	半導体・半導体製造装置	
LABORATORY CRP OF AMER	82	75	1,958	248,771	ヘルスケア機器・サービス	
MICROSOFT CORP	6,191	5,587	152,680	19,393,442	ソフトウェア・サービス	
MICRON TECHNOLOGY	966	873	6,403	813,369	半導体・半導体製造装置	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	224	420	3,059	388,609	半導体・半導体製造装置	
3 M COMPANY	501	448	6,707	851,925	資本財	
MOHAWK INDUSTRIES INC	50	50	717	91,154	耐久消費財・アパレル	
ENTEGRIS INC	—	104	1,184	150,393	半導体・半導体製造装置	
CHARLES RIVER LABORATORIES	42	42	1,027	130,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	149	129	2,890	367,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KANSAS CITY SOUTHERN	79	—	—	—	運輸	
ILLUMINA INC	125	112	2,905	369,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
XCEL ENERGY INC	464	437	3,339	424,143	公益事業	
FORD MOTOR COMPANY	3,344	3,052	4,159	528,403	自動車・自動車部品	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	84	84	788	100,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NETAPP INC	205	183	1,337	169,830	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NEWELL BRANDS INC	314	314	688	87,436	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT CORPORATION	685	615	4,229	537,223	素材	
NVR INC	2	2	1,103	140,171	耐久消費財・アパレル	
NIKE B	1,092	994	11,537	1,465,452	耐久消費財・アパレル	
NORDSON CORP	48	41	905	115,069	資本財	
NORFOLK SOUTHERN CORP	219	190	4,600	584,360	運輸	
EVERSOURCE ENERGY	293	267	2,496	317,048	公益事業	
NISOURCE INC	357	286	911	115,727	公益事業	
NORTHERN TRUST CORP	176	159	1,790	227,437	各種金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	135	117	5,525	701,824	資本財	
WELLS FARGO & CO	3,563	3,118	14,312	1,818,019	銀行	
NUCOR CORP	255	222	3,071	390,137	素材	
CHENIERE ENERGY INC	190	190	2,632	334,440	エネルギー	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	403	332	4,205	534,189	各種金融	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	791	699	4,957	629,738	エネルギー	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	80	80	2,113	268,509	運輸	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	60	54	3,500	444,591	小売	
ORACLE CORP	1,648	1,282	9,334	1,185,655	ソフトウェア・サービス	
PACCAR INC	301	281	2,407	305,843	資本財	
EXELON CORP	867	771	3,848	488,800	公益事業	
PARKER HANNIFIN CORP	112	99	2,699	342,944	資本財	
PAYCHEX INC	277	254	3,155	400,840	ソフトウェア・サービス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	66	59	1,691	214,816	ヘルスケア機器・サービス	
PPL CORPORATION	699	584	1,774	225,437	公益事業	
PEPSICO INC	1,189	1,076	18,493	2,349,059	食品・飲料・タバコ	
PENTAIR PLC	145	145	731	92,963	資本財	
PFIZER	4,841	4,370	23,558	2,992,422	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ESSENTIAL UTILITIES INC	208	170	789	100,226	公益事業	
CONOCOPHILLIPS	1,173	1,040	11,921	1,514,326	エネルギー	
PG&E CORP	1,353	1,181	1,458	185,313	公益事業	

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価	額	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PIONEER NATURAL RESOURCES	179	182	5,102	648,147	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,612	1,429	7,781	988,465	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	367	329	5,765	732,327	銀行
BROWN & BROWN INC	198	198	1,191	151,329	保険
GARMIN LTD	128	128	1,356	172,316	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	205	192	2,506	318,403	素材
IPG PHOTONICS CORP	32	32	328	41,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	384	344	16,209	2,058,953	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	200	179	2,325	295,440	各種金融
QUEST DIAGNOSTICS	113	100	1,454	184,766	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,125	1,893	28,166	3,577,674	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	505	451	5,428	689,532	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	432	394	2,724	346,113	公益事業
PULTE GROUP INC	248	216	987	125,408	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	252	225	2,984	379,089	ソフトウェア・サービス
QUALCOMM	984	878	12,270	1,558,653	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	103	154	1,536	195,109	各種金融
EXACT SCIENCES CORP	147	147	794	100,893	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	48	—	—	—	保険
REGENERON PHARMACEUTICALS	91	81	5,622	714,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	66	—	—	—	保険
RESMED INC	123	114	2,382	302,682	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,226	1,090	5,727	727,485	銀行
SEAGEN INC	114	100	1,423	180,868	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	340	297	1,410	179,199	保険
ROSS STORES INC	316	280	2,451	311,366	小売
ROLLINS INC	218	174	639	81,229	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	93	83	3,690	468,756	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	99	90	1,919	243,860	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	192	167	975	123,929	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	124	104	950	120,712	素材
ACCENTURE PLC-CL A	551	493	15,019	1,907,742	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,213	1,083	6,910	877,715	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	110	100	2,161	274,554	保険
TRAVELERS COS INC/THE	224	197	3,516	446,609	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	538	481	5,066	643,493	ソフトウェア・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	35	31	7,221	917,297	消費者サービス
SCHLUMBERGER	1,226	1,071	5,164	656,000	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,240	1,124	7,936	1,008,103	各種金融
POOL CORP	37	33	1,341	170,387	小売
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	182	162	1,950	247,809	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	116	116	1,331	169,090	食品・飲料・タバコ
SEI INVESTMENTS COMPANY	122	95	558	70,902	各種金融
ANTHEM INC	210	189	9,851	1,251,392	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	128	128	2,022	256,944	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	230	207	1,511	191,958	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	219	197	5,449	692,175	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
CENTENE CORP	513	445	3,760	477,654	ヘルスケア機器・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	43	45	2,236	284,046	銀行	
SMITH (A.O.) CORP	121	90	551	70,109	資本財	
SNAP-ON INC	49	40	891	113,251	資本財	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	348	295	3,136	398,351	保険	
ADVANCE AUTO PARTS	61	53	1,027	130,550	小売	
EDISON INTL	321	280	1,963	249,412	公益事業	
SOUTHERN CO	913	841	6,398	812,734	公益事業	
TRUIST FINANCIAL CORP	1,157	1,034	5,080	645,348	銀行	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	206	186	2,618	332,619	資本財	
SOUTHWEST AIRLINES CO	135	135	619	78,728	運輸	
AT&T INC	6,149	5,555	11,828	1,502,427	電気通信サービス	
CHEVRON CORP	1,660	1,507	26,868	3,412,869	エネルギー	
STANLEY BLACK&DECKER	137	125	1,507	191,511	資本財	
STATE STREET CORP	298	279	2,044	259,752	各種金融	
STARBUCKS CORP	1,020	915	7,021	891,850	消費者サービス	
STEEL DYNAMICS INC	182	155	1,365	173,421	素材	
STRYKER CORP	290	262	6,218	789,907	ヘルスケア機器・サービス	
NETFLIX INC	385	344	6,722	853,896	メディア・娯楽	
NORTONLIFELOCK INC	503	435	1,092	138,732	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSYS INC	134	120	3,887	493,827	ソフトウェア・サービス	
SYSCO CORP	435	402	3,403	432,316	食品・生活必需品小売り	
INTUITIVE SURGICAL INC	101	276	6,346	806,114	ヘルスケア機器・サービス	
TELEFLEX INC	39	39	1,141	144,957	ヘルスケア機器・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	804	804	726	92,321	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TERADYNE INC	143	123	1,347	171,170	半導体・半導体製造装置	
TEXAS INSTRUMENTS	799	717	12,777	1,623,002	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON	188	169	1,118	142,049	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	339	306	17,538	2,227,742	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBE LIFE INC	81	81	795	101,006	保険	
DAVITA INC	57	57	565	71,837	ヘルスケア機器・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	99	89	1,716	218,075	小売	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	211	211	1,466	186,213	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TYLER TECHNOLOGIES INC	37	33	1,210	153,734	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC	250	218	1,985	252,139	食品・飲料・タバコ	
UGI CORP	180	180	770	97,867	公益事業	
UNION PACIFIC CORP	577	507	11,285	1,433,474	運輸	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,319	1,172	11,337	1,440,102	資本財	
UNITEDHEALTH GROUP INC	819	735	37,304	4,738,421	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	72	61	762	96,853	ヘルスケア機器・サービス	
VF CORP	286	257	1,290	163,923	耐久消費財・アパレル	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	485	485	1,647	209,271	メディア・娯楽	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	224	200	5,482	696,426	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VULCAN MATERIALS CO	113	102	1,739	220,890	素材	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	633	597	2,612	331,829	食品・生活必需品小売り	
WALMART INC	1,341	1,200	15,419	1,958,539	食品・生活必需品小売り	
WASTE MANAGEMENT INC	362	327	5,275	670,153	商業・専門サービス	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WATERS CORP	52	47	1,591	202,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	142	695	88,399	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	63	57	1,852	235,294	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	91	91	1,148	145,838	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	35	30	762	96,835	消費者サービス
WESTERN DIGITAL CORP	257	257	1,605	203,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WABTEC CORP	150	150	1,426	181,159	資本財
WEYERHAEUSER CO	636	582	2,351	298,702	不動産
WHIRLPOOL CORP	52	52	954	121,211	耐久消費財・アパレル
SKYWORKS SOLUTIONS INC	143	133	1,453	184,645	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	93	93	607	77,107	消費者サービス
NASDAQ INC	96	96	1,503	190,913	各種金融
CME GROUP INC	310	278	5,563	706,695	各種金融
WILLIAMS COS	1,049	985	3,691	468,931	エネルギー
LKQ CORP	267	227	1,192	151,439	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION	207	207	1,325	168,329	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	268	245	2,616	332,345	公益事業
CARMAX INC	138	120	1,208	153,515	小売
XILINX INC	209	—	—	—	半導体・半導体製造装置
TJX COMPANIES INC	1,031	931	6,016	764,157	小売
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	46	41	1,429	181,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	987	987	458	58,296	不動産
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	201	177	1,022	129,859	資本財
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	106	96	1,232	156,499	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	—	46	991	125,882	銀行
CBRE GROUP INC-A	301	253	2,133	270,979	不動産
LIBERTY GLOBAL PLC-A	155	155	388	49,310	電気通信サービス
REGIONS FINL CORP	818	708	1,549	196,806	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	32	28	1,042	132,369	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	39	35	1,609	204,452	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	293	243	843	107,165	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	319	277	1,659	210,822	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32	32	923	117,272	各種金融
CELANESE CORP-SERIES A	98	85	1,366	173,552	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	182	146	808	102,758	食品・飲料・タバコ
DEXCOM INC	84	76	2,210	280,789	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY INC - A	128	—	—	—	メディア・娯楽
EXPEDIA GROUP INC	116	116	1,524	193,607	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	190	149	1,431	181,779	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	101	87	2,423	307,822	各種金融
LIBERTY GLOBAL PLC-C	336	274	716	91,055	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	485	447	4,590	583,148	各種金融
LIVE NATION ENTERTAINMENT	139	123	1,178	149,709	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	23	21	3,034	385,484	消費者サービス
TRANSIDGM GROUP INC	44	40	2,495	316,914	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	765	686	24,574	3,121,450	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	387	292	527	66,946	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
OWENS CORNING	86	86	841	106,905	資本財
LEIDOS HOLDINGS	112	112	1,182	150,155	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	110	539	68,494	資本財
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	176	176	93	11,890	消費者サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	97	97	1,430	181,654	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	146	146	616	78,363	運輸
INSULET CORP	59	53	1,249	158,673	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	261	234	2,625	333,531	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	293	260	3,375	428,761	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MASIMO CORP	48	41	595	75,588	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	107	93	2,732	347,071	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	78	167	2,160	274,469	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	38	35	2,894	367,647	小売
ULTA BEAUTY INC	45	39	1,696	215,434	小売
INVESCO LTD	357	264	516	65,573	各種金融
MSCI INC	72	65	2,921	371,047	各種金融
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,354	1,212	12,971	1,647,626	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,464	1,306	27,810	3,532,426	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	154	141	2,151	273,225	公益事業
DISCOVERY INC-C	281	—	—	—	メディア・娯楽
MARATHON PETROLEUM CORP	571	480	4,907	623,394	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	128	103	726	92,259	資本財
KINDER MORGAN INC	1,794	1,593	3,176	403,496	エネルギー
XYLEM INC	152	132	1,139	144,795	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	226	198	2,318	294,500	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	35	755	95,914	資本財
SPLUNK INC	147	133	1,449	184,054	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	47	44	1,498	190,347	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	232	194	4,190	532,250	ヘルスケア機器・サービス
VERISK ANALYTICS INC	133	125	2,233	283,719	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	750	95,287	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	71	60	1,497	190,197	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	148	137	2,170	275,660	銀行
NXP SEMICONDUCTORS NV	241	208	4,084	518,844	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	113	113	987	125,378	商業・専門サービス
LEAR CORP	52	52	721	91,707	自動車・自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	88	88	992	126,088	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	193	193	1,252	159,046	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	209	186	4,267	542,058	小売
FORTINET INC	122	106	3,170	402,758	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	661	667	50,739	6,444,929	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	58	52	1,334	169,559	資本財
ENPHASE ENERGY INC	110	101	1,910	242,716	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,140	1,037	4,003	508,513	自動車・自動車部品
XPO LOGISTICS INC	80	—	—	—	運輸
ALLY FINANCIAL INC	314	277	1,198	152,190	各種金融
APTIV PLC	235	207	2,161	274,554	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PHILLIPS 66	381	355	3,611	458,760	エネルギー	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	79	63	521	66,271	ソフトウェア・サービス	
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,077	1,851	36,127	4,588,920	メディア・娯楽	
IQVIA HOLDINGS INC	167	151	3,335	423,647	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	132	2,025	257,258	エネルギー	
SERVICENOW INC	169	153	7,326	930,646	ソフトウェア・サービス	
PALO ALTO NETWORKS INC	83	76	3,876	492,330	ソフトウェア・サービス	
WORKDAY INC-CLASS A	155	146	2,331	296,108	ソフトウェア・サービス	
ABBVIE INC	1,522	1,376	20,653	2,623,426	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
T-MOBILE US INC	533	496	6,659	845,889	電気通信サービス	
PTC INC	99	83	985	125,148	ソフトウェア・サービス	
ZOETIS INC	408	367	6,324	803,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NEWS CORP-CLASS A	334	334	591	75,184	メディア・娯楽	
CDW CORP/DE	119	108	1,861	236,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
IHS MARKIT LTD	326	—	—	—	商業・専門サービス	
HOWMET AEROSPACE INC	365	315	1,138	144,590	資本財	
KEURIG DR PEPPER INC	595	525	1,847	234,715	食品・飲料・タバコ	
TWILIO INC - A	136	128	1,391	176,772	ソフトウェア・サービス	
COUPA SOFTWARE INC	60	60	439	55,858	ソフトウェア・サービス	
SNAP INC - A	817	833	1,298	164,996	メディア・娯楽	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	35	330	1,736	220,620	ソフトウェア・サービス	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	186	153	975	123,887	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	63	265	33,741	メディア・娯楽	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	172	135	564	71,657	メディア・娯楽	
OKTA INC	102	115	990	125,765	ソフトウェア・サービス	
BLACK KNIGHT INC	144	115	792	100,698	ソフトウェア・サービス	
BAKER HUGHES CO	579	627	2,334	296,522	エネルギー	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	129	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ALTICE USA INC- A	225	—	—	—	メディア・娯楽	
BROADCOM INC	352	324	18,933	2,404,903	半導体・半導体製造装置	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	63	63	420	53,464	ソフトウェア・サービス	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	107	107	522	66,379	運輸	
MONGODB INC	46	46	1,156	146,838	ソフトウェア・サービス	
BURLINGTON STORES INC	58	51	876	111,356	小売	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	360	360	860	109,335	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	117	112	1,935	245,892	ヘルスケア機器・サービス	
TWITTER INC	701	630	2,533	321,787	メディア・娯楽	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	138	654	83,149	資本財	
EVERGY INC	213	184	1,303	165,606	公益事業	
ALLEGION PLC	76	76	863	109,620	資本財	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	122	106	617	78,484	ソフトウェア・サービス	
STERIS PLC	71	80	1,884	239,334	ヘルスケア機器・サービス	
DOCUSIGN INC	155	149	1,290	163,973	ソフトウェア・サービス	
WIX.COM LTD	50	50	334	42,515	ソフトウェア・サービス	
DROPBOX INC-CLASS A	288	288	609	77,418	ソフトウェア・サービス	
KKR & CO INC	436	399	2,236	284,108	各種金融	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	43	43	156	19,834	各種金融	

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価		額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	175	170	1,880	238,827	ソフトウェア・サービス	
MODERNA INC	270	273	4,032	512,201	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	237	218	3,112	395,304	消費者サービス	
ARAMARK	209	209	721	91,642	消費者サービス	
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	382	552	70,181	メディア・娯楽	
DELL TECHNOLOGIES -C	215	224	1,114	141,577	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DOW INC	636	573	3,960	503,039	素材	
AMCOR PLC	1,329	1,114	1,483	188,480	素材	
PINTEREST INC- CLASS A	457	457	935	118,882	メディア・娯楽	
PELTON INTERACTIVE INC-A	217	217	315	40,060	耐久消費財・アパレル	
NOVAVAX INC	57	57	318	40,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FOX CORP - CLASS A	276	276	980	124,575	メディア・娯楽	
FOX CORP- CLASS B	150	103	338	42,955	メディア・娯楽	
CLARIVATE PLC	273	273	407	51,775	商業・専門サービス	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	156	144	2,415	306,802	ソフトウェア・サービス	
CHEWY INC - CLASS A	68	68	186	23,684	小売	
AVANTOR INC	479	429	1,417	180,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LYFT INC-A	212	212	378	48,050	運輸	
DYNATRACE INC	178	147	564	71,744	ソフトウェア・サービス	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	177	202	1,194	151,772	ソフトウェア・サービス	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	90	90	624	79,298	各種金融	
CARRIER GLOBAL CORP	706	631	2,541	322,768	資本財	
OTIS WORLDWIDE CORP	350	306	2,338	297,077	資本財	
INMODE LTD	—	55	146	18,610	ヘルスケア機器・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	1,031	1,136	2,689	341,680	運輸	
CORTEVA INC	649	585	3,680	467,463	素材	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	410	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
BILL.COM HOLDINGS INC	—	57	725	92,215	ソフトウェア・サービス	
BLACKSTONE INC	587	545	6,597	838,017	各種金融	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	14	63	8,106	小売	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	151	—	—	—	各種金融	
CARLYLE GROUP INC/THE	125	125	498	63,352	各種金融	
10X GENOMICS INC-CLASS A	56	56	299	38,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DATADOG INC - CLASS A	158	170	1,672	212,501	ソフトウェア・サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	179	150	1,327	168,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
VOYA FINANCIAL INC	100	—	—	—	各種金融	
UPSTART HOLDINGS INC	—	31	158	20,124	各種金融	
INGERSOLL-RAND INC	315	315	1,530	194,396	資本財	
PAYCOM SOFTWARE INC	42	42	1,246	158,301	ソフトウェア・サービス	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	133	413	52,550	自動車・自動車部品	
PPD INC	110	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DRAFTKINGS INC	—	276	407	51,743	消費者サービス	
ASANA INC - CL A	—	49	113	14,439	ソフトウェア・サービス	
UNITY SOFTWARE INC	43	43	178	22,720	ソフトウェア・サービス	
AON PLC	193	175	4,931	626,418	保険	
SOFI TECHNOLOGIES INC	—	389	294	37,397	各種金融	
WARNER BROS DISCOVERY INC	—	1,753	3,290	417,955	メディア・娯楽	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	139	139	475	60,373	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	28	216	27,438	各種金融
AFFIRM HOLDINGS INC	—	128	388	49,406	ソフトウェア・サービス
IAC/INTERACTIVECORP	67	67	582	73,947	メディア・娯楽
AIRBNB INC-CLASS A	46	230	2,774	352,433	消費者サービス
ZENDESK INC	105	88	880	111,825	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION ENERGY	—	257	1,713	217,680	公益事業
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	155	261	1,078	136,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	—	219	901	114,456	メディア・娯楽
VIATRIS INC	1,035	907	1,111	141,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	175	175	906	115,092	消費者サービス
DRAFTKINGS INC - CL A	156	—	—	—	消費者サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	19	166	2,157	274,018	ソフトウェア・サービス
DOORDASH INC - A	—	83	650	82,664	小売
OAK STREET HEALTH INC	76	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	51	188	1,998	253,890	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	268	1,621	205,950	各種金融
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	432	1,252	1,108	140,790	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	249	204	865	109,909	保険
MARVELL TECHNOLOGY INC	704	633	3,853	489,478	半導体・半導体製造装置
ROBINHOOD MARKETS INC - A	—	130	135	17,206	各種金融
LUCID GROUP INC	—	312	619	78,672	自動車・自動車部品
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	—	830	200	25,411	運輸
CATALENT INC	152	137	1,447	183,884	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	495	453	1,639	208,266	各種金融
HORIZON THERAPEUTICS PLC	179	179	1,700	215,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	360	322	1,318	167,424	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	453	57,552	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	60	60	354	44,995	小売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	160	149	2,176	276,503	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	40	36	1,284	163,220	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	96	85	959	121,926	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-A	25	25	313	39,788	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	135	112	1,415	179,852	メディア・娯楽
BIO-TECHNE CORP	32	32	1,254	159,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZILLOW GROUP INC-A	54	54	225	28,655	不動産
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	46	37	1,051	133,542	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC - CLASS A	159	137	1,037	131,797	ソフトウェア・サービス
KORNIT DIGITAL LTD	—	27	120	15,278	資本財
ETSY INC	110	102	845	107,414	小売
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	633	566	3,101	393,946	資本財
TRANSUNION	170	157	1,388	176,428	商業・専門サービス
BLOCK INC	332	396	3,591	456,165	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	461	409	2,801	355,832	素材
CARVANA CO	57	57	192	24,507	小売
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	192	153	829	105,354	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	113	113	406	51,682	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
WESTROCK CO	247	213	1,047	133,027	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	573	521	1,974	250,772	食品・飲料・タバコ	
NOVOCURE LTD	79	79	666	84,622	ヘルスケア機器・サービス	
FORTIVE CORP	257	257	1,594	202,566	資本財	
MATCH GROUP INC	218	201	1,612	204,762	メディア・娯楽	
WASTE CONNECTIONS INC	224	212	2,733	347,225	商業・専門サービス	
ALPHABET INC-CL A	259	235	52,804	6,707,224	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,091	987	1,559	198,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	959	882	7,517	954,881	ソフトウェア・サービス	
SEA LTD-ADR	6	251	2,081	264,342	メディア・娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	328	273	844	107,331	各種金融	
SUNRUN INC	139	139	367	46,738	資本財	
ZILLOW GROUP INC-C	134	134	554	70,419	不動産	
ALPHABET INC-CL C	254	223	50,482	6,412,231	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	62	62	997	126,694	ソフトウェア・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	342	322	2,893	367,517	食品・飲料・タバコ	
CABLE ONE INC	4	4	571	72,635	メディア・娯楽	
LINDE PLC	450	401	13,238	1,681,525	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	102	—	—	—	保険	
ROKU INC	97	91	879	111,777	メディア・娯楽	
AVALARA INC	76	68	590	74,942	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	116	98	5,002	635,354	メディア・娯楽	
VISTRA CORP	377	377	994	126,313	公益事業	
小 計	273,341	250,077	2,826,337	359,001,333		
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	601	606	—	<68.6%>		
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES	202	363	2,499	249,608	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	741	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	1,535	1,390	3,639	363,452	素材	
ATCO LTD -CLASS I	52	—	—	—	公益事業	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	197	197	196	19,619	資本財	
BANK MONTREAL	558	513	7,015	700,650	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	1,047	965	8,231	822,074	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	272	272	2,649	264,631	銀行	
BCE INC	62	62	426	42,633	電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	1,108	1,105	7,104	709,513	各種金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	278	208	261	26,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAPUTO INC	244	208	530	52,991	食品・飲料・タバコ	
BLACKBERRY LIMITED	394	394	328	32,816	ソフトウェア・サービス	
CGI INC - CL A	184	161	1,755	175,367	ソフトウェア・サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	131	794	79,361	素材	
CAE INC	259	259	824	82,387	資本財	
CAMECO CORP	268	268	863	86,199	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	305	261	1,717	171,510	電気通信サービス	
CANADIAN IMPERIAL BANK	387	689	4,772	476,638	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,027	931	7,920	791,026	エネルギー	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	54	35	609	60,896	小売	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	411	41,097	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	608	554	8,052	804,154	運輸
YAMANA GOLD INC	816	—	—	—	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	170	170	671	67,033	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	246	204	1,032	103,081	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	152	152	624	62,410	食品・生活必需品小売り
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	102	102	781	78,077	商業・専門サービス
FORTIS INC	426	368	2,348	234,588	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	550	430	1,562	156,058	素材
TELUS CORP	329	329	1,036	103,492	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	237	237	819	81,890	保険
IMPERIAL OIL	247	165	1,177	117,598	エネルギー
ENBRIDGE	1,731	1,564	9,198	918,693	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	294	29,379	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,630	1,478	3,425	342,058	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	129	129	1,498	149,686	食品・生活必需品小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	674	3,847	384,264	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	232	232	1,894	189,222	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	507	457	2,896	289,282	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	21	21	1,484	148,263	保険
METRO INC	188	188	1,316	131,463	食品・生活必需品小売り
EMERA INC	237	187	1,185	118,399	公益事業
ONEX CORP	66	66	497	49,649	各種金融
TC ENERGY CORP	823	773	5,654	564,764	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	184	184	531	53,120	素材
POWER CORP OF CANADA	515	435	1,600	159,850	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	439	43,916	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA	1,228	1,106	14,493	1,447,431	銀行
CP RAILWAY LIMITED	575	737	6,682	667,409	運輸
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	354	354	1,274	127,282	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY	1,321	1,162	6,003	599,550	エネルギー
LUNDIN MINING CORP	622	622	687	68,689	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B	405	347	1,910	190,825	素材
THOMSON REUTERS CORP	150	132	1,669	166,729	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	77	55	617	61,645	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,563	1,414	13,581	1,356,368	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	78	78	901	90,066	素材
WESTON (GEORGE) LTD	68	52	807	80,688	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,084	1,084	627	62,711	素材
INTACT FINANCIAL CORP	130	133	2,399	239,596	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	395	342	1,847	184,542	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	15	3,006	300,286	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	169	153	2,783	277,954	素材
B2GOLD CORP	902	—	—	—	素材
TFI INTERNATIONAL INC	—	58	603	60,311	運輸
TOURMALINE OIL CORP	—	221	1,726	172,414	エネルギー
KEYERA CORP	186	186	627	62,661	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
PARKLAND CORP	140	140	515	51,447	エネルギー		
ALTAGAS INCOME LTD	243	243	743	74,234	公益事業		
PEMBINA PIPELINE CORP	456	456	2,341	233,825	エネルギー		
DOLLARAMA INC	267	220	1,571	156,897	小売		
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	518	518	957	95,583	公益事業		
CENOVUS ENERGY INC	966	966	2,783	278,036	エネルギー		
NORTHLAND POWER INC	178	178	693	69,236	公益事業		
TMX GROUP LTD	46	46	645	64,480	各種金融		
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	234	—	—	—	素材		
IVANHOE MINES LTD-CL A	518	518	515	51,520	素材		
INTER PIPELINE LTD	354	—	—	—	エネルギー		
NUTRIEN LTD	489	447	5,444	543,755	素材		
LIGHTSPEED COMMERCE INC	82	82	273	27,308	ソフトウェア・サービス		
WSP GLOBAL INC	106	86	1,189	118,811	資本財		
IA FINANCIAL CORP INC	100	100	654	65,346	保険		
FIRSTSERVICE CORP	36	26	430	42,992	不動産		
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	135	135	527	52,681	商業・専門サービス		
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	43	43	281	28,087	ソフトウェア・サービス		
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	112	112	541	54,122	公益事業		
AIR CANADA	138	138	307	30,676	運輸		
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	230	230	1,500	149,894	消費者サービス		
SHOPIFY INC - CLASS A	97	87	4,109	410,402	ソフトウェア・サービス		
CANOPY GROWTH CORP	209	209	129	12,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HYDRO ONE LTD	322	232	821	82,079	公益事業		
小 計	株 数 ・ 銘 柄 数	金 額 <比 率>	35,167	31,347	195,658	19,540,448	
			89	86	—	<3.7%>	
(ドイツ)					千ユーロ		
ADIDAS AG	162	147	2,645	360,616	耐久消費財・アパレル		
COMMERZBANK AG	943	818	661	90,178	銀行		
FRESENIUS SE&CO KGAA	336	336	1,095	149,268	ヘルスケア機器・サービス		
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	95	293	40,036	電気通信サービス		
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	57	163	22,224	素材		
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	57	43	623	84,920	保険		
GEA GROUP AG	133	133	505	68,886	資本財		
CONTINENTAL AG	99	81	575	78,370	自動車・自動車部品		
DEUTSCHE POST AG-REG	853	787	2,999	408,734	運輸		
MERCK KGAA	105	105	1,880	256,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
RWE STAMM	553	496	2,010	273,950	公益事業		
SAP SE	902	812	7,633	1,040,330	ソフトウェア・サービス		
E.ON SE	1,853	1,703	1,644	224,079	公益事業		
HENKEL AG & CO KGAA	87	87	532	72,635	家庭用品・パーソナル用品		
PUMA SE	92	92	613	83,638	耐久消費財・アパレル		
BAYER	838	760	5,060	689,656	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
HENKEL AG & CO KGAA -PPD	144	144	890	121,340	家庭用品・パーソナル用品		
BASF SE	787	711	3,637	495,740	素材		
BEIERSDORF AG	91	74	708	96,524	家庭用品・パーソナル用品		
HEIDELBERGCEMENT AG	130	130	706	96,332	素材		

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	174	144	818	111,597	ヘルスケア機器・サービス	
ALLIANZ SE-REG	355	320	6,413	874,137	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	232	453	312	42,523	運輸	
MUENCHENER RUECKVERSICH.	123	107	2,464	335,886	保険	
VOLKSWAGEN STAMM	24	24	489	66,780	自動車・自動車部品	
VOLKSWAGEN AG-PFD	163	142	2,174	296,334	自動車・自動車部品	
MERCEDES-BENZ GROUP AG	733	667	4,408	600,850	自動車・自動車部品	
NEMETSCHKE SE	54	54	369	50,302	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS	660	594	7,248	987,961	資本財	
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,772	1,606	1,669	227,480	各種金融	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	286	261	2,108	287,389	自動車・自動車部品	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	368	50,166	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE TELEKOM	2,850	2,581	4,924	671,200	電気通信サービス	
SARTORIUS AG-VORZUG	22	18	661	90,214	ヘルスケア機器・サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES	1,123	1,018	2,954	402,665	半導体・半導体製造装置	
RATIONAL AG	4	4	284	38,805	資本財	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	428	58,434	ヘルスケア機器・サービス	
BECHTLE AG	25	76	319	43,517	ソフトウェア・サービス	
DEUTSCHE BOERSE	165	149	2,456	334,739	各種金融	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	140	117	862	117,525	自動車・自動車部品	
LANXESS	72	72	278	37,979	素材	
MTU AERO ENGINES AG	47	39	748	102,056	資本財	
DEUTSCHE WOHNEN SE	280	—	—	—	不動産	
SYMRISE AG	114	97	1,019	138,899	素材	
BRENTNAG SE	125	125	915	124,810	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	197	160	400	54,576	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	987	987	286	39,002	電気通信サービス	
LEG IMMOBILIEN SE	69	52	497	67,751	不動産	
KION GROUP AG	58	58	266	36,378	資本財	
VONOVIA SE	450	590	2,101	286,410	不動産	
KNORR-BREMSE AG	68	50	322	44,010	資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	245	215	1,213	165,427	ヘルスケア機器・サービス	
TEAMVIEWER AG	141	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SIEMENS ENERGY AG	361	268	473	64,480	資本財	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	333	969	132,190	資本財	
ZALANDO SE	139	176	662	90,230	小売	
SCOUT24 SE	74	74	433	59,079	メディア・娯楽	
COVESTRO AG	172	144	609	83,091	素材	
HELLOFRESH SE	138	138	480	65,494	食品・生活必需品小売り	
UNIPER SE	73	73	177	24,212	公益事業	
DELIVERY HERO SE	134	134	457	62,396	小売	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	21,283 60	19,845 59	88,933 —	12,120,806 <2.3%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	975	856	1,462	199,348	保険	
INTESA SANPAOLO	14,414	12,510	2,560	349,026	銀行	
UNICREDIT SPA	1,890	1,683	1,821	248,215	銀行	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
MEDIOBANCA	539	539	514	70,109	銀行	
ENEL	6,929	6,179	3,822	520,957	公益事業	
ENI	2,185	1,976	2,805	382,336	エネルギー	
SNAM SPA	1,894	1,475	808	110,126	公益事業	
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	239	32,580	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA RNC	4,701	—	—	—	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	465	359	812	110,789	運輸	
TERNA SPA	1,302	1,028	824	112,404	公益事業	
RECORDATI SPA	98	98	414	56,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPLIFON SPA	116	116	377	51,396	ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	211	211	643	87,649	資本財	
DIASORIN SPA	20	20	251	34,263	ヘルスケア機器・サービス	
MONCLER SPA	182	143	618	84,338	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	413	314	305	41,587	ソフトウェア・サービス	
FINECOBANK SPA	531	531	694	94,587	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	460	460	457	62,314	保険	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	303	303	316	43,198	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	46,163	37,335	19,750	2,691,788
(フランス)			20	19	—	<0.5%>
BOUYGUES ORD	214	166	544	74,143	資本財	
AIR LIQUIDE	404	369	6,115	833,414	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	434	510	1,355	184,710	公益事業	
LOREAL	216	198	6,443	878,212	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH	240	215	12,807	1,745,594	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT AVIATION SA	2	21	336	45,867	資本財	
THALES SA	96	74	874	119,248	資本財	
CAPGEMINI SA	139	127	2,372	323,364	ソフトウェア・サービス	
PUBLICIS GROUPE	170	170	883	120,467	メディア・娯楽	
FAURECIA	109	109	277	37,854	自動車・自動車部品	
BOLLORE SE	836	836	418	57,057	メディア・娯楽	
MICHELIN	138	138	1,664	226,899	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	182	159	2,930	399,438	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	173	173	437	59,594	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	23	13	235	32,038	食品・飲料・タバコ	
SEB SA	22	22	230	31,381	耐久消費財・アパレル	
VINCI S. A.	459	410	3,809	519,226	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	465	417	5,332	726,777	資本財	
VIVENDI SE	612	612	675	92,065	メディア・娯楽	
TOTALENERGIES SE	2,170	1,945	10,677	1,455,259	エネルギー	
VALEO SA	215	215	428	58,341	自動車・自動車部品	
ORANGE	1,715	1,538	1,800	245,356	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	27	25	2,772	377,876	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	114	527	2,080	283,529	ソフトウェア・サービス	
KERING	64	58	2,863	390,211	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	162	162	340	46,437	保険	
CARREFOUR	525	525	1,003	136,815	食品・生活必需品小売り	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ATOS SE	97	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	975	880	9,014	1,228,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR	144	144	442	60,362	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	678	633	1,575	214,742	銀行	
TELEPERFORMANCE	47	47	1,473	200,785	商業・専門サービス	
EURAZEO SA	33	33	244	33,262	各種金融	
SODEXO	81	60	432	58,994	消費者サービス	
AXA SA	1,668	1,485	3,606	491,479	保険	
ESSILORLUXOTTICA	251	220	3,370	459,351	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE SA	1,074	895	1,007	137,298	銀行	
BNP PARIBAS	970	867	4,644	632,984	銀行	
ORPEA	43	43	115	15,766	ヘルスケア機器・サービス	
SAINT-GOBAIN	439	400	2,211	301,409	資本財	
WENDEL	20	20	193	26,330	各種金融	
ILIAD SA	12	—	—	—	電気通信サービス	
DANONE (GROUPE)	546	515	2,822	384,677	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	284	261	2,606	355,301	資本財	
ENGIE	1,582	1,415	1,797	245,030	公益事業	
ALSTOM	243	243	634	86,453	資本財	
ELECTRICITE DE FRANCE	395	395	333	45,492	公益事業	
IPSEN	35	35	336	45,923	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	59	43	495	67,464	素材	
LEGRAND SA	217	217	1,788	243,808	資本財	
EIFFAGE	79	59	560	76,394	資本財	
ADP	23	23	331	45,125	運輸	
NATIXIS	897	—	—	—	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	70	70	342	46,672	メディア・娯楽	
SCOR SE	133	—	—	—	保険	
BUREAU VERITAS SA	250	250	674	91,922	商業・専門サービス	
GETLINK	441	293	541	73,852	運輸	
SUEZ	325	—	—	—	公益事業	
EDENRED	227	186	861	117,468	ソフトウェア・サービス	
BIOMERIEUX	41	30	298	40,715	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	81	81	283	38,687	消費者サービス	
WORLDDLIN SA	203	203	810	110,426	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	24	19	623	84,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	62	46	247	33,730	各種金融	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	22,705 64	19,874 59	114,437 —	15,596,627 <3.0%>	
(オランダ)						
AIRBUS SE	501	458	5,131	699,336	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	42	34	998	136,143	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	112	75	397	54,140	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	874	791	2,038	277,790	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	153	153	1,261	171,959	素材	
WOLTERS KLUWER	229	208	1,941	264,588	商業・専門サービス	
QIAGEN N. V.	218	170	750	102,288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
KONINKLIJKE DSM NV	149	137	1,945	265,087	素材	
VOPAK	63	—	—	—	エネルギー	
AEGON	1,662	1,146	581	79,313	保険	
ASML HOLDING NV	361	322	17,455	2,379,056	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	2,829	2,829	955	130,256	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS	550	550	2,052	279,797	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	772	717	1,699	231,627	ヘルスケア機器・サービス	
ING GROEP NV-CVA	3,434	3,016	3,073	418,885	銀行	
HEINEKEN NV	224	201	1,868	254,610	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	107	92	673	91,787	食品・飲料・タバコ	
FERRARI NV	101	101	1,903	259,472	自動車・自動車部品	
CNH INDUSTRIAL NV	930	810	1,126	153,498	資本財	
PROSUS	430	724	3,325	453,223	小売	
JDE PEET'S BV	70	70	191	26,121	食品・飲料・タバコ	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	490	490	485	66,151	食品・飲料・タバコ	
EURONEXT NV	—	64	514	70,087	各種金融	
IMCD NV	—	46	650	88,679	資本財	
NN GROUP NV	226	226	1,061	144,652	保険	
ARGENX SE	41	34	1,029	140,300	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	612	1,277	174,114	メディア・娯楽	
STELLANTIS NV	1,701	1,597	2,196	299,314	自動車・自動車部品	
JUST EAT TAKEAWAY	113	155	313	42,722	小売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	399	399	428	58,461	銀行	
EXOR NV	103	78	547	74,652	各種金融	
ADYEN NV	16	15	2,375	323,816	ソフトウェア・サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	16,910 29	16,334 31	60,253 —	8,211,940 <1.6%>	
(スペイン)						
IBERDROLA SA	4,983	4,494	5,080	692,487	公益事業	
ENDESA	259	259	541	73,838	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA	5,769	5,348	2,696	367,473	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	233	100	284	38,717	公益事業	
REPSOL SA	1,273	1,111	1,665	227,000	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	14,703	13,394	4,072	554,980	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	396	306	595	81,197	公益事業	
TELEFONICA	4,346	4,179	2,067	281,785	電気通信サービス	
INDITEX	950	873	1,946	265,288	小売	
ENAGAS	252	156	340	46,445	公益事業	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	224	224	402	54,854	資本財	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	196	211	562	76,650	資本財	
GRIFOLS SA	276	276	549	74,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERROVIAL SA	410	339	821	111,901	資本財	
CAIXABANK	3,801	3,304	1,111	151,503	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	214	214	488	66,557	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	390	355	2,147	292,633	ソフトウェア・サービス	
FERROVIAL SA-RTS	471	—	—	—	資本財	
FERROVIAL SA-RTS	—	339	9	1,251	資本財	

銘柄	銘柄	当季首(前期末)	当 期 末			業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AENA SME SA		65	55	786	107,160	運輸
CELLNEX TELECOM SA		414	414	1,793	244,466	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	39,636	35,960	27,963	3,811,091	
(ベルギー)						
UMICORE		176	176	742	101,158	素材
KBC GROEP NV		210	186	1,084	147,802	銀行
SOFINA		12	12	274	37,356	各種金融
SOLVAY SA		69	53	489	66,777	素材
UCB (GROUPE)		118	93	777	105,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		54	54	164	22,472	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		106	85	740	100,871	各種金融
AGEAS		160	110	516	70,438	保険
PROXIMUS		131	131	216	29,461	電気通信サービス
ELIA GROUP SA/NV		29	29	448	61,152	公益事業
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		637	687	3,632	495,107	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,706	1,619	9,087	1,238,578	
(オーストリア)						
OMV AG		125	125	675	92,116	エネルギー
VERBUND AG		64	64	580	79,177	公益事業
VOESTALPINE AG		71	71	199	27,195	素材
ERSTE GROUP BANK AG		239	239	695	94,840	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		124	124	154	20,988	銀行
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	625	625	2,306	314,319	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		124	102	897	122,267	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		406	406	651	88,804	エネルギー
ARCELORMITTAL		616	552	1,681	229,172	素材
AROUNDTOWN SA		940	640	277	37,800	不動産
INPOST SA		124	124	79	10,797	運輸
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,212	1,826	3,586	488,842	
(フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		255	200	462	63,090	食品・生活必需品小売り
WARTSILA OYJ		419	419	331	45,143	資本財
UPM KYMMENE OYJ		456	423	1,420	193,643	素材
STORA ENSO OYJ R		547	421	792	107,961	素材
SAMPO OYJ-A SHS		430	386	1,665	226,957	保険
FORTUM OYJ		419	325	571	77,856	公益事業
ELISA A		133	102	552	75,322	電気通信サービス
NOKIA OYJ		4,506	4,276	2,059	280,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		372	321	1,398	190,594	エネルギー
KONE OYJ-B		290	263	1,261	171,981	資本財
ORION OYJ-CLASS B		98	98	372	50,711	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,930	7,238	10,888	1,483,926	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC	144	123	945	128,824	資本財	
CRH PLC	647	596	2,311	315,001	素材	
KERRY GROUP PLC-A	130	130	1,277	174,123	食品・飲料・タバコ	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	230	195	746	101,755	素材	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	145	130	1,469	200,326	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,298 5	1,176 5	6,750 —	920,031 <0.2%>	
(ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,257	2,257	1,065	145,162	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	491	279	339	46,312	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	249	249	481	65,601	食品・生活必需品小売り	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,998 3	2,785 3	1,886 —	257,077 <0.0%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	163,471 233	144,622 228	345,843 —	47,135,029 <9.0%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
ANTOFAGASTA PLC	358	358	527	84,538	素材	
ASHTAD GROUP PLC	370	341	1,405	225,361	資本財	
SEVERN TRENT PLC	224	224	660	105,911	公益事業	
BHP GROUP PLC	1,824	—	—	—	素材	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	964	732	368	59,127	耐久消費財・アパレル	
BUNZL PLC	248	248	711	114,048	資本財	
AVIVA PLC	3,327	2,253	993	159,378	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	131	109	751	120,579	素材	
DIAGEO	2,008	1,805	6,576	1,054,860	食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS PLC	117	117	346	55,538	各種金融	
DCC PLC	91	66	371	59,647	資本財	
BAE SYSTEMS PLC	2,601	2,601	1,994	319,894	資本財	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,882	1,682	5,974	958,278	食品・飲料・タバコ	
HALMA PLC	310	310	703	112,868	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD CHARTERED PLC	2,124	2,124	1,332	213,645	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	809	760	1,367	219,278	食品・飲料・タバコ	
JOHNSON MATTHEY PLC	168	168	355	57,098	素材	
ANGLO AMERICAN PLC	1,089	1,021	3,884	623,113	素材	
COMPASS GROUP PLC	1,556	1,424	2,562	411,075	消費者サービス	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	17,544	15,838	8,432	1,352,502	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP	5,145	4,607	1,208	193,768	保険	
UNILEVER PLC	2,270	2,019	7,017	1,125,545	家庭用品・パーソナル用品	
MORRISON SUPERMARKETS	2,093	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	585	585	611	98,090	公益事業	
RSA INSURANCE GROUP LTD	972	—	—	—	保険	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	334	257	446	71,669	食品・飲料・タバコ	
PEARSON	663	663	492	78,994	メディア・娯楽	
PERSIMMON PLC	256	256	574	92,159	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL	2,253	2,109	2,172	348,522	保険	
RIO TINTO PLC REG	960	871	4,966	796,567	素材	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
VODAFONE GROUP PLC	23,595	22,047	2,869	460,200	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	605	546	3,342	536,065	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,668	1,495	3,413	547,486	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,404	1,404	715	114,730	商業・専門サービス
NATWEST GROUP PLC	3,691	4,437	1,008	161,687	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	505	409	518	83,216	各種金融
SSE PLC	922	816	1,431	229,541	公益事業
BP PLC	17,576	15,556	6,699	1,074,488	エネルギー
SAGE GROUP PLC	952	766	515	82,748	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	371	264	411	66,011	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	61,902	54,438	2,462	394,961	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	3,559	2,641	343	55,173	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	6,660	6,010	1,553	249,200	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	881	747	958	153,775	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	685	685	888	142,585	ヘルスケア機器・サービス
GSK PLC	4,300	3,888	6,740	1,081,075	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WPP PLC	1,130	958	887	142,375	メディア・娯楽
ASTRAZENECA	1,131	1,202	12,720	2,040,282	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	7,694	7,167	1,320	211,809	電気通信サービス
NATIONAL GRID PLC	3,067	2,860	3,329	534,030	公益事業
BARCLAYS	15,162	13,395	2,282	366,060	銀行
INTERTEK GROUP PLC	138	138	649	104,150	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	297	297	497	79,779	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	114	114	750	120,293	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	7,861	6,359	552	88,642	資本財
KINGFISHER PLC	1,985	1,537	408	65,507	小売
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	275	247	1,869	299,808	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	1,483	1,483	342	54,982	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	363	58,347	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	118	76	325	52,220	耐久消費財・アパレル
SHELL PLC-A SHS	3,542	—	—	—	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,200	—	—	—	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	160	125	619	99,285	消費者サービス
WHITBREAD PLC	174	174	475	76,337	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	164	164	277	44,560	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABRDN PLC	2,109	1,534	300	48,269	各種金融
EXPERIAN PLC	791	741	1,997	320,362	商業・専門サービス
MONDI PLC	367	367	572	91,880	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	330	330	281	45,203	各種金融
OCADO GROUP PLC	446	358	323	51,847	食品・生活必需品小売り
GLENCORE PLC	8,756	7,673	4,037	647,606	素材
ENTAIN PLC	496	496	711	114,069	消費者サービス
EVRAZ PLC	430	—	—	—	素材
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,137	—	—	—	保険
COCA-COLA HBC AG-CDI	179	179	315	50,569	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	109	109	248	39,799	ソフトウェア・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	510	510	329	52,859	保険

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FERGUSON PLC	194	177	1,695	271,878	資本財
M&G PLC	2,291	2,291	499	80,070	各種金融
INFORMA PLC	1,411	1,105	606	97,208	メディア・娯楽
SHELL PLC-NEW	—	5,982	14,237	2,283,612	エネルギー
AUTO TRADER GROUP PLC	973	724	417	67,036	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55	55	582	93,435	資本財
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,566	3,197	412	66,162	資本財
JD SPORTS FASHION PLC	413	2,068	248	39,790	小売
小 計	256,015	224,085	146,175	23,445,152	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	84	78	—	<4.5%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SIKA AG-BR	125	109	2,917	386,797	素材
SGS SA	5	5	1,222	162,090	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	2	602	79,893	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM	21	21	1,256	166,561	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	29	29	1,574	208,759	資本財
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.82	0.82	782	103,722	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.1	0.08	799	105,965	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	7	7	2,669	353,963	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	127	116	5,150	682,867	保険
NOVARTIS	1,919	1,702	14,835	1,967,014	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	1,490	1,276	3,747	496,944	資本財
ROCHE HOLDING AG-BR	27	27	1,050	139,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING GENUSS	608	546	18,036	2,391,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	145	104	388	51,473	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	453	406	1,950	258,563	素材
CLARIANT AG-REG	173	173	321	42,675	素材
NESTLE SA - REGISTERED	2,487	2,193	25,572	3,390,629	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	43	31	528	70,069	保険
TEMENOS AG - REG	65	51	491	65,115	ソフトウェア・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	18	136	18,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONOVA HOLDING AG-REG	46	40	1,370	181,700	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	45	1,178	156,267	運輸
STRAUMANN HOLDING AG-REG	8	85	1,022	135,538	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,133	2,133	1,486	197,048	各種金融
SWATCH GROUP AG(BEARER)	24	24	583	77,399	耐久消費財・アパレル
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	175	23,266	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	65	58	3,376	447,710	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	28	24	1,343	178,200	保険
VIFOR PHARMA AG	44	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	462	61,265	素材
SWISS PRIME SITE-REG	74	56	568	75,373	不動産
PARTNERS GROUP HOLDING AG	19	18	1,920	254,703	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	37	30	608	80,681	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	21	13	266	35,368	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	146	146	837	111,108	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	459	413	4,293	569,243	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
JULIUS BAER GROUP LTD	188	188	930	123,423	各種金融	
SWISS RE LTD	246	228	1,835	243,316	保険	
ALCON INC	426	393	2,817	373,614	ヘルスケア機器・サービス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	28	—	—	—	銀行	
VIFOR PHARMA AG/NEW	—	33	558	74,042	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UBS GROUP AG	3,150	2,710	4,875	646,463	各種金融	
VAT GROUP AG	—	19	543	72,098	資本財	
小 計	14,980	13,540	115,089	15,259,717		
銘柄数 <比率>	40	41	—	<2.9%>		
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ATLAS COPCO A	583	2,052	21,997	284,651	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	3,544	45,867	各種金融	
SKF AB-B	354	248	4,340	56,162	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,384	1,207	13,468	174,282	銀行	
SWEDBANK AB-A	725	725	10,962	141,852	銀行	
SCA SV CELLULOZA B	569	438	7,941	102,761	素材	
VOLVO AB-A SHS	135	135	2,477	32,053	資本財	
VOLVO B	1,232	1,117	19,392	250,940	資本財	
SWEDISH MATCH AB	1,272	1,272	12,968	167,816	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	500	328	3,993	51,677	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	212	212	3,227	41,762	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	295	295	3,158	40,871	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	1,576	1,427	26,091	337,618	各種金融	
HENNES & MAURITZ B	659	552	7,317	94,692	小売	
ASSA ABLOY AB-B	865	781	18,882	244,345	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	1,311	1,107	10,903	141,085	銀行	
ERICSSON (LM) B	2,538	2,255	18,356	237,531	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	966	876	17,669	228,637	資本財	
TELIA CO AB	2,306	2,306	9,366	121,201	電気通信サービス	
SKANSKA B	320	255	4,345	56,225	資本財	
LUNDIN ENERGY AB	172	172	7,908	102,333	エネルギー	
BOLIDEN AB	239	184	7,533	97,488	素材	
ALFA LAVAL AB	272	272	6,904	89,341	資本財	
GETINGE AB-B SHS	—	177	4,982	64,478	ヘルスケア機器・サービス	
KINNEVIK AB - B	187	187	3,598	46,566	各種金融	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	94	567	4,174	54,022	不動産	
ICA GRUPPEN AB	94	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	3,454	44,703	資本財	
ATLAS COPCO B	319	1,276	11,913	154,160	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	101	118	3,057	39,561	各種金融	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	111	111	2,851	36,894	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	1,697	1,538	18,583	240,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAGAX AB-B	—	124	3,447	44,613	不動産	
EPIROC AB-A	580	469	9,021	116,737	資本財	
EPIROC AB-B	379	288	4,860	62,897	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	494	494	12,561	162,545	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	201	232	6,509	84,233	各種金融	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
EVOLUTION AB	140	140	14,341	185,576	消費者サービス	
EMBRACER GROUP AB	187	375	3,269	42,310	メディア・娯楽	
LIFCO AB-B SHS	—	179	3,565	46,134	資本財	
EPIROC AB-A RED SHS	580	—	—	—	資本財	
EPIROC AB-B RED SHS	379	—	—	—	資本財	
INVESTOR AB-A SHS	—	389	7,796	100,889	各種金融	
BOLIDEN AB-RED	239	—	—	—	素材	
KINNEVIK AB-B-RED	187	—	—	—	各種金融	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,076	1,076	9,507	123,027	資本財	
NORDEA BANK ABP	2,809	2,538	26,339	340,834	銀行	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	140	140	3,360	43,484	資本財	
SINCH AB	33	441	2,068	26,762	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	28,992 45	29,554 44	402,017 —	5,202,107 <1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	855	—	—	—	銀行	
NORSK HYDRO	1,268	968	7,221	96,765	素材	
TELENOR ASA	657	511	6,670	89,384	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	70	70	1,343	18,002	メディア・娯楽	
ORKLA	698	698	5,133	68,787	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	763	763	26,939	360,989	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	164	124	6,046	81,023	素材	
MOWI ASA	409	319	7,774	104,179	食品・飲料・タバコ	
AKER BP ASA	—	61	2,379	31,886	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,878	51,968	保険	
ADEVINTA ASA	191	191	1,377	18,456	メディア・娯楽	
DNB BANK ASA	—	717	13,917	186,493	銀行	
SCHIBSTED ASA-B SHS	92	92	1,543	20,678	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	5,356 11	4,705 12	84,225 —	1,128,616 <0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	86	70	6,148	112,640	食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	5	4	8,810	161,402	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	4,415	80,883	運輸	
GN STORE NORD A/S	119	92	2,362	43,286	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	648	561	6,255	114,608	銀行	
GENMAB A/S	51	52	11,082	203,035	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	191	171	7,287	133,508	素材	
ROCKWOOL A/S-B SHS	7	7	1,418	25,989	資本財	
DSV A/S	181	163	17,903	327,989	運輸	
DEMANT A/S	116	85	2,400	43,975	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSSEMS A/S	873	816	13,722	251,401	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,478	1,323	97,767	1,791,105	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	92	92	7,381	135,222	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	297	297	4,748	86,994	保険	
PANDORA A/S	94	81	4,127	75,610	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	103	84	4,356	79,817	素材	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMBU A/S-B	135	135	1,196	21,912	ヘルスケア機器・サービス
ORSTED A/S	154	154	12,152	222,625	公益事業
小 計	4,640	4,197	213,537	3,912,009	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	18	18	—	<0.7%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	162	162	1,274	115,959	ヘルスケア機器・サービス
AGL ENERGY LTD	642	—	—	—	公益事業
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,396	2,255	5,791	527,107	銀行
WESTPAC BANKING	3,189	2,837	6,836	622,264	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,384	1,273	2,495	227,103	素材
TELSTRA CORP	3,084	3,084	1,206	109,779	電気通信サービス
BRAMBLES LTD	1,378	1,080	1,184	107,843	商業・専門サービス
ASX LTD	181	145	1,186	108,005	各種金融
BHP GROUP LTD	2,523	3,972	17,349	1,579,157	素材
AMPOL LTD	206	206	701	63,840	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	1,013	92,253	ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	388	376	10,131	922,125	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	52	35	404	36,798	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	2,334	2,334	3,359	305,823	運輸
COCHLEAR LIMITED	62	47	1,045	95,123	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,655	1,190	814	74,137	公益事業
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,523	1,340	14,297	1,301,327	銀行
RIO TINTO LTD	320	288	3,267	297,423	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	527	462	1,600	145,654	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	2,294	1,687	754	68,647	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	369	369	1,328	120,900	素材
ORICA LTD	382	382	633	57,676	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	493	347	631	57,503	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED	298	270	4,954	450,962	各種金融
SUNCORP GROUP LIMITED	1,193	948	1,163	105,859	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,786	2,535	8,031	731,057	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	740	611	1,513	137,762	素材
OIL SEARCH LTD	1,861	—	—	—	エネルギー
QANTAS AIRWAYS LIMITED	850	850	464	42,242	運輸
QBE INSURANCE GROUP	1,380	1,115	1,383	125,946	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,016	1,016	886	80,661	素材
REECE LTD	168	168	256	23,308	資本財
SANTOS	1,564	2,361	1,945	177,120	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	400	372	1,360	123,790	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	128	128	328	29,937	エネルギー
TABCORP HOLDINGS LTD	1,820	—	—	—	消費者サービス
WESFARMERS LTD	1,005	871	4,071	370,553	小売
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	744	1,461	4,406	401,060	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,099	999	3,413	310,707	食品・生活必需品小売り
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	109	—	—	—	各種金融
SEEK LTD	315	280	690	62,824	メディア・娯楽
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	35	35	243	22,148	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AUSNET SERVICES	1,871	—	—	—	公益事業
MINERAL RESOURCES LTD	—	144	883	80,382	素材
CROWN RESORTS LTD	303	303	391	35,609	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	1,221	1,221	455	41,471	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	1,914	1,195	475	43,322	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	705	458	535	48,740	食品・飲料・タバコ
XERO LTD	113	113	991	90,283	ソフトウェア・サービス
IDP EDUCATION LTD	—	177	412	37,572	消費者サービス
AFTERPAY LTD	199	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LOTTERY CORP LTD/THE	—	1,820	873	79,520	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	—	1,099	796	72,523	食品・生活必需品小売り
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,698	2,321	740	67,415	保険
SOUTH32 LTD	3,411	3,411	1,606	146,245	素材
COLES GROUP LTD	1,154	1,084	1,898	172,801	食品・生活必需品小売り
WISETECH GLOBAL LTD	138	138	575	52,344	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	57,250 53	51,842 51	123,056 —	11,200,637 <2.1%>
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,178	1,178	855	71,112	運輸
RYMAN HEALTHCARE LTD	363	363	366	30,481	ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	668	—	—	—	食品・飲料・タバコ
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	545	399	779	64,785	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,731	1,731	812	67,542	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	646	646	361	30,068	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	488	40,603	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6,238 7	5,424 6	3,665 —	304,593 <0.1%>
(香港)				千香港ドル	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	2,539	41,091	不動産
BANK EAST ASIA	1,091	—	—	—	銀行
CLP HOLDINGS	1,375	1,375	10,931	176,867	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	675	675	3,547	57,392	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,041	958	31,690	512,754	各種金融
MTR CORP	1,510	1,250	5,375	86,967	運輸
HANG SENG BANK	594	594	8,250	133,495	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,252	1,252	4,145	67,066	不動産
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,375	1,120	5,863	94,866	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	8,615	9,046	7,924	128,223	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,740	1,740	7,116	115,146	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,815	2,815	8,684	140,511	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,363	1,363	4,070	65,865	不動産
SINO LAND CO	3,154	3,154	3,551	57,461	不動産
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,185	1,080	10,465	169,326	不動産
SWIRE PACIFIC A	405	405	1,883	30,470	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,175	1,070	10,710	173,299	資本財
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,720	1,720	3,343	54,100	資本財
SJM HOLDINGS LTD	1,320	—	—	—	消費者サービス
WYNN MACAU LTD	1,408	—	—	—	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,722	1,722	2,173	35,161	小売	
AIA GROUP LTD	10,452	9,338	74,003	1,197,379	保険	
SANDS CHINA LTD	1,980	1,980	2,811	45,491	消費者サービス	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	1,200	3,612	58,442	運輸	
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	1,843	29,822	不動産	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,570	1,190	4,516	73,069	不動産	
ESR CAYMAN LTD	1,570	1,570	3,587	58,044	不動産	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,459	1,459	2,894	46,835	食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	9,365	4,748	2,810	45,479	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,294	1,939	10,854	175,618	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,074	1,644	8,594	139,065	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	68,995 30	59,102 28	247,794 —	4,009,320 <0.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,474	1,474	596	55,410	資本財	
DBS GROUP	1,552	1,415	4,400	408,468	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	428	428	351	32,615	不動産	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	783	451	444	41,233	各種金融	
CAPITALAND LTD	2,235	—	—	—	不動産	
GENTING SINGAPORE LTD	6,150	6,150	482	44,811	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	1,373	1,373	933	86,660	資本財	
OCBC BANK	2,912	2,571	3,008	279,209	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	1,083	1,083	595	55,304	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	939	939	2,758	256,070	銀行	
UOL GROUP LIMITED	475	475	353	32,846	不動産	
VENTURE CORP LTD	257	257	448	41,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,522	5,845	1,578	146,494	電気通信サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	742	68,963	食品・飲料・タバコ	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	2,235	871	80,906	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	28,969 14	26,482 14	17,567 —	1,630,621 <0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシェゲル			
BANK HAPOLIM BM	983	983	3,096	117,451	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,088	1,088	3,619	137,285	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	21	21	1,383	52,456	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	995	995	1,890	71,700	銀行	
ICL LTD	677	420	1,568	59,507	素材	
NICE LTD	58	49	3,361	127,489	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	125	125	1,382	52,446	銀行	
AZRIELI GROUP	43	43	1,114	42,268	不動産	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,992 8	3,726 8	17,417 —	660,605 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	947,412 1,233	848,710 1,220	— —	492,430,194 <94.1%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当期		
	口数 (千口)	口数 (千口)	評価額		外貨換算金額 (千円)
			外貨建金額	評価額	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10	10	1,849		234,936
BOSTON PROPERTIES	13	11	1,268		161,145
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20	—	—		—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125	95	631		80,180
PROLOGIS INC	63	57	7,302		927,506
AVALONBAY COMMUNITIES INC	12	11	2,390		303,581
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	7	1,123		142,700
DUKE REALTY CORP	31	27	1,471		186,870
CROWN CASTLE INTL CORP	36	33	6,420		815,513
ESSEX PROPERTY TRUST	5	4	1,377		174,913
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	32	27	2,120		269,339
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45	45	1,361		172,946
WELLTOWER INC	35	32	2,952		374,972
KIMCO REALTY CORP	—	47	1,137		144,431
IRON MOUNTAIN INC	27	23	1,281		162,779
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16	14	1,089		138,416
HOST HOTELS AND RESORTS INC	67	56	1,175		149,274
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	8	1,544		196,200
REALTY INCOME CORP	31	44	3,062		389,015
REGENCY CENTERS CORP	12	12	864		109,810
UDR INC	28	24	1,179		149,761
SIMON PROPERTY GROUP	28	25	2,902		368,632
PUBLIC STORAGE	13	12	4,177		530,602
SUN COMMUNITIES INC	9	9	1,506		191,334
VENTAS INC	31	31	1,811		230,138
VORNADO REALTY TRUST	15	11	404		51,417
EXTRA SPACE STORAGE INC	10	10	1,956		248,523
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	22	3,137		398,568
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50	50	929		118,086
AGNC INVESTMENT CORP	46	46	564		71,745
VEREIT INC	21	—	—		—
AMERICAN TOWER CORPORATION	38	35	9,218		1,170,955
WP CAREY INC	16	14	1,214		154,211
INVITATION HOMES INC	51	46	1,805		229,298
EQUINIX INC	7	7	4,939		627,351

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
VICI PROPERTIES INC	49	75	2,325	295,341
SBA COMMUNICATIONS CORP	9	8	2,983	378,914
小 計	1,058	1,002	81,478	10,349,418
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	36	35	— <2.0%>
(カナダ)			千カナダドル	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	4	238	23,851
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	15	352	35,193
小 計	24	20	591	59,045
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2	2	— <0.0%>
(フランス)			千ユーロ	
KLEPIERRE	17	17	371	50,614
GECINA SA	4	3	340	46,460
COVIVIO (FP)	4	4	338	46,121
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	10	690	94,143
ユーロ計	37	35	1,741	237,340
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4	4	— <0.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド	
BRITISH LAND CO PLC	79	79	417	67,023
SEGRO PLC	106	93	1,044	167,525
LAND SECURITIES GROUP PLC	66	46	358	57,508
小 計	252	219	1,820	292,057
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3	3	— <0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP	392	266	594	54,129
APA GROUP	114	82	952	86,707
GPT GROUP	167	167	799	72,736
SYDNEY AIRPORT	124	—	—	—
STOCKLAND	207	207	810	73,815
DEXUS	94	94	987	89,922
GOODMAN GROUP	139	133	2,656	241,755
VICINITY CENTERS	365	365	684	62,317
LENDLEASE GROUP	64	64	698	63,567
SCENTRE GROUP	486	382	1,119	101,923
小 計	2,157	1,764	9,304	846,876
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	10	9	— <0.2%>
(香港)			千香港ドル	
LINK REIT	170	170	11,994	194,073
HKT TRUST AND HKT LTD	375	205	2,218	35,888

銘柄		当期首(前期末)		当 期 末	
		口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		220	220	1,697	27,471
小 計	口 数 ・ 金 額	766	596	15,910	257,433
	銘 柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		426	340	755	70,148
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		284	284	772	71,736
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		273	283	458	42,582
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		220	220	389	36,144
小 計	口 数 ・ 金 額	1,203	1,127	2,376	220,612
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	5,500	4,766	—	12,262,784
	銘 柄 数 <比 率>	62	60	—	<2.3%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

### <先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	S&P 500 EMIN	14,384	—
	S&P/TSE 60	1,277	—
	SWISS MKT IX	1,204	—
	DJ EURO STOXX	1,788	—
	SPI 200 FUTU	556	—
	FTSE 100	340	—

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	492,430,194	94.0
投 資 信 託 受 益 証 券	213,635	0.0
投 資 証 券	12,049,149	2.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,049,920	3.7
投 資 信 託 財 産 総 額	523,742,898	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(521,971,770千円)の投資信託財産総額(523,742,898千円)に対する比率は99.7%です。

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

1米ドル=127.02円	1カナダドル=99.87円	1ユーロ=136.29円
1イギリスポンド=160.39円	1スイスフラン=132.59円	1スウェーデンクローナ=12.94円
1ノルウェークローネ=13.40円	1デンマーククローネ=18.32円	1オーストラリアドル=91.02円
1ニュージーランドドル=83.10円	1香港ドル=16.18円	1シンガポールドル=92.82円
1イスラエルシェケル=37.927円		

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年5月30日現在
(A) 資 産	525,886,666,499円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	15,361,445,522
株 式(評価額)	492,430,194,549
投資信託受益証券(評価額)	213,635,587
投資証券(評価額)	12,049,149,251
未 収 入 金	2,520,238,732
未 収 配 当 金	778,482,292
差 入 委 託 証 拠	2,533,520,566
(B) 負 債	2,461,701,247
未 払 金	2,394,732,661
未 払 解 約 金	66,967,258
未 払 利 息	1,328
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	523,424,965,252
元 本	124,778,059,850
次 期 繰 越 損 益 金	398,646,905,402
(D) 受 益 権 総 口 数	124,778,059,850口
1万口当たり基準価額(C/D)	41,948円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	9,076,033,918円
受 取 配 当 金	9,069,884,084
受 取 利 息	160,716
そ の 他 収 益 金	19,562,796
支 払 利 息	△13,573,678
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	48,418,655,792
売 買 益	108,054,594,974
売 買 損	△59,635,939,182
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	737,388,472
取 引 益	2,635,676,118
取 引 損	△1,898,287,646
(D) そ の 他 費 用	△169,357,425
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	58,062,720,757
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	379,881,244,642
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	47,938,434,749
(H) 解 約 差 損 益 金	△87,235,494,746
(I) 計 (E+F+G+H)	398,646,905,402
次 期 繰 越 損 益 金(I)	398,646,905,402

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

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は137,722,653,603円、期中追加設定元本額は15,718,352,796円、期中一部解約元本額は28,662,946,549円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT グローバル株式インデックス・オープン	31,891,617,739円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	15,863,198,047円
DC外国株式インデックス・オープン	11,770,844,166円
世界経済インデックスファンド	10,429,835,021円
DC世界経済インデックスファンド	9,650,097,206円
分散投資コア戦略ファンドS	8,037,948,513円
DCマイセクション75	4,395,959,459円
DCマイセクション50	3,623,631,364円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,890,361,169円
DCマイセクションS50	1,817,107,210円
DCマイセクションS75	1,519,066,014円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,505,554,380円
分散投資コア戦略ファンドA	1,421,677,202円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,345,785,667円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,286,512,288円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,285,687,705円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,240,448,028円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,136,804,848円
FOFs用 外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,127,752,855円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,082,356,527円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,070,221,107円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,062,514,562円
外国株式インデックス・オープン	863,039,188円
DCマイセクション25	803,273,450円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	729,877,138円
グローバル経済コア	643,200,142円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	594,961,570円
コア投資戦略ファンド(安定型)	581,693,447円
コア投資戦略ファンド(切替型)	530,929,433円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	404,580,459円
DCマイセクションS25	397,007,177円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	383,790,568円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	282,297,126円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	265,963,687円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	241,405,184円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	240,174,152円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	232,787,423円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	225,480,922円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	221,972,924円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	206,181,058円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	195,495,469円
SMT 世界経済インデックス・オープン	191,550,308円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	175,323,922円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	168,188,946円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	164,818,430円

DCターゲット・イヤー ファンド2035	163,822,551円
SMT インデックスバランス・オープン	156,533,319円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	137,094,789円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	132,686,530円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	119,915,396円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	118,695,108円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	99,941,540円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	87,519,316円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	72,625,573円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	56,668,260円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	56,281,250円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	52,688,817円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	45,940,393円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	33,521,145円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	33,352,178円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	32,345,308円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,330,368円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	29,915,264円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	28,835,745円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	15,432,161円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	14,319,329円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,209,075円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	11,496,228円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	11,319,798円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,439,733円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,903,238円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	4,732,946円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	3,828,753円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,692,539円

## お知らせ

該当事項はありません。

# J-REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2022年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年1月9日から無期限です。
運用方針	わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場している不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

**【本運用報告書の記載について】**

- ・基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	投信証 託証券 組入比率	純資 産額
	円 騰落	% 中率	円 騰落	% 中率			
第11期(2018年11月12日)	16,899	16.0	16,737	15.9	2.5	97.5	103,475
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441
第13期(2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598
第14期(2021年11月10日)	21,895	24.8	21,683	24.7	3.8	96.1	111,120
第15期(2022年11月10日)	21,469	△1.9	21,266	△1.9	3.1	96.9	131,445

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	投信証 託証券 組入比率
	円 騰落	% 騰落率	円 騰落	% 騰落率		
(当期首) 2021年11月10日	21,895	—	21,683	—	3.8	96.1
11月末	21,342	△2.5	21,136	△2.5	3.8	96.2
12月末	22,081	0.8	21,868	0.9	3.7	96.2
2022年 1月末	20,875	△4.7	20,673	△4.7	3.7	96.3
2月末	20,262	△7.5	20,065	△7.5	3.6	96.4
3月末	21,659	△1.1	21,450	△1.1	3.5	96.4
4月末	21,403	△2.2	21,197	△2.2	3.6	96.4
5月末	21,786	△0.5	21,577	△0.5	3.5	96.5
6月末	21,423	△2.2	21,218	△2.1	3.5	96.5
7月末	22,096	0.9	21,886	0.9	3.5	96.5
8月末	22,358	2.1	22,145	2.1	3.4	96.5
9月末	21,427	△2.1	21,225	△2.1	3.4	96.6
10月末	21,790	△0.5	21,583	△0.5	3.3	96.6
(当期末) 2022年11月10日	21,469	△1.9	21,266	△1.9	3.1	96.9

(注1)騰落率は期首比です。

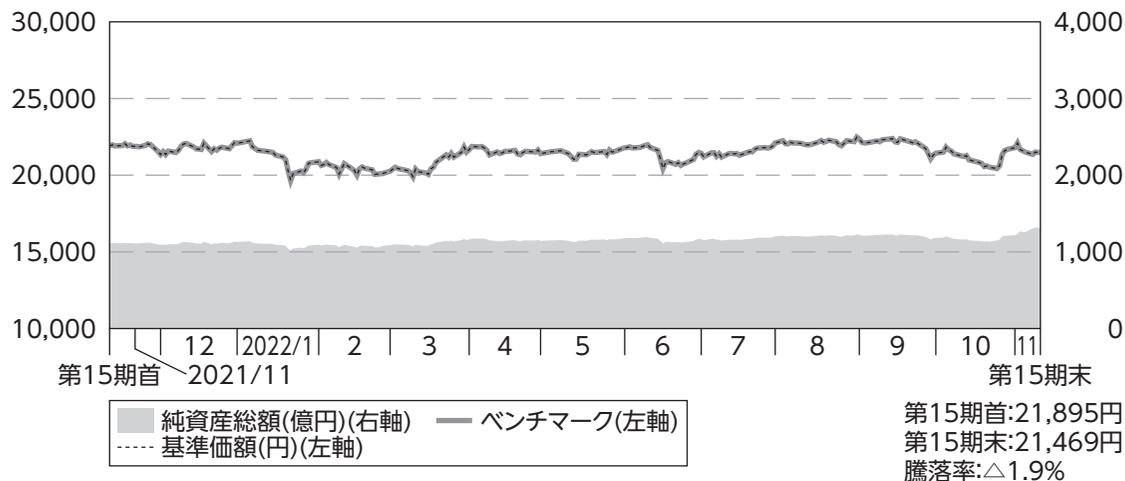
(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## ベンチマークは、東証REIT指数(配当込み)です。

「東証REIT指数」とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社J P X総研又は株式会社J P X総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2021年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。

## 投資環境



J-REIT市場は下落しました。

期初から2022年3月上旬にかけては、米長期金利の上昇やウクライナ情勢を巡る地政学リスクへの警戒感などから株式市場が急落したことで投資家心理が悪化し、J-REIT市場も大きく下落しました。その後は、日銀が指し値オペを実施し金利上昇を抑制する姿勢を示したことがJ-REIT市場にとっての安心感に繋がったことや、円建てで高利回りなJ-REITの特性に着目した個人や金融機関等による資金流入がみられたことなどから上昇しました。9月以降、世界的な金融引き締め継続への懸念や、公募増資の発表が相次ぎ短期的な投資口の供給増加による需給悪化が意識されたことなどから下落しましたが、期末にかけては株式市場のリスクオフの流れを受けてJ-REIT市場も反発しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。

主としてわが国の取引所に上場している不動産投資信託証券(J-REIT)に投資し、取引コストに留意しながらベンチマークの構成比率に合わせたポートフォリオを組成し、当期末時点では東証REIT指数を構成する全銘柄と東証REIT指数先物に投資しています。

## 当ファンドの組入資産の内容

### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.7%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.4%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.9%
4	日本都市ファンド投資法人	日本	4.8%
5	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.6%
6	GLP投資法人	日本	4.4%

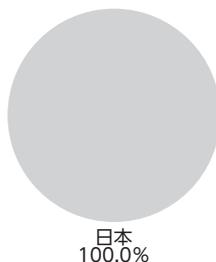
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	大和ハウスリート投資法人	日本	4.1%
8	オリックス不動産投資法人	日本	3.4%
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	3.1%
10	東証REIT指数先物 2212	日本	3.1%
組入銘柄数			62

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

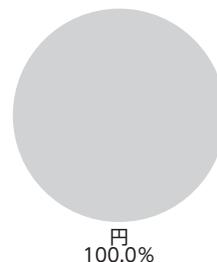
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

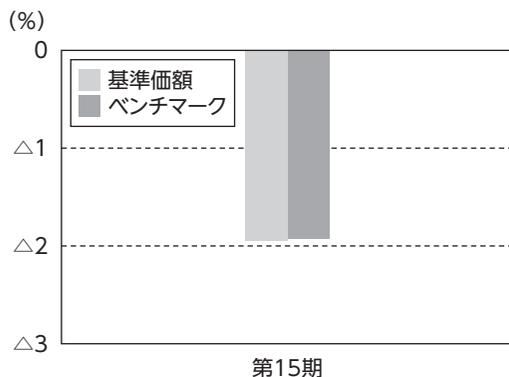


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスでJ-REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.1%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドの基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

## 今後の運用方針

わが国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月11日~2022年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (0) (-) (0)	0.001% (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	-  (-)  (-) (-)	-  (-)  (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(21,541円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

## ＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	エスコンジャパンリート投資法人	687	85,313	213	27,290
	サンケイリアルエステート投資法人	1,082	109,315	330	34,396
	SOS i LA物流リート投資法人	1,801 (180)	272,160 (28,675)	479	73,007
	SOS i LA物流リート投資法人	180 (△180)	28,675 (△28,675)	—	—
	東海道リート投資法人	791	96,735	96	11,064
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,150	730,868	377	242,488
	森ヒルズリート投資法人	3,893	596,290	1,259	189,367
	産業ファンド投資法人	5,560	969,089	1,504	272,451
	アドバンス・レジデンス投資法人	3,318	1,140,930	1,078	375,185
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,671	555,529	740	156,048
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,755	737,572	620	256,605
	GLP投資法人	12,212	1,992,242	5,087	880,713
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,634 (41)	519,265 (12,814)	491	158,578
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	41 (△41)	12,814 (△12,814)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	5,849	1,965,271	1,663	569,946
	星野リゾート・リート投資法人	764	510,819	177	117,038
	Oneリート投資法人	575	153,737	176	48,791
	イオンリート投資法人	3,776	580,338	1,951	296,657
	ヒューリックリート投資法人	3,097	516,158	975	160,651
	日本リート投資法人	1,209	449,398	328	123,334
	積水ハウス・リート投資法人	10,065	804,071	3,226	258,911
	トーセイ・リート投資法人	828	111,359	209	28,016
	ケネディクス商業リート投資法人	1,732	467,757	422	115,589
	ヘルスケア&メディカル投資法人	950 (161)	160,029 (20,087)	243	39,940
	ヘルスケア&メディカル投資法人	161 (△161)	20,087 (△20,087)	—	—
	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,075 (46)	132,015 (5,717)	223	27,738
	サムティ・レジデンシャル投資法人	46 (△46)	5,717 (△5,717)	—	—
内	野村不動産マスターファンド投資法人	10,710	1,754,847	3,466	560,292
	いちごホテルリート投資法人	553	52,228	182	16,399
	ラサールロジポート投資法人	4,060	688,151	1,317	228,360

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国	スターアジア不動産投資法人	5,973	346,558	1,137	67,463
	マリモ地方創生リート投資法人	694	91,381	119	15,701
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,454 (52)	773,071 (28,349)	400	216,696
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	52 (△52)	28,349 (△28,349)	—	—
	大江戸温泉リート投資法人	537	36,503	176	12,001
	投資法人みらい	4,672	227,690	1,240	61,635
	森トラスト・ホテルリート投資法人	773	101,241	248	31,604
	三菱地所物流リート投資法人	1,816 (95)	805,360 (38,661)	294	135,532
	三菱地所物流リート投資法人	95 (△95)	38,661 (△38,661)	—	—
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,277	258,007	410	82,900
	ザイマックス・リート投資法人	612 (77)	74,162 (8,702)	164	20,083
	ザイマックス・リート投資法人	77 (△77)	8,702 (△8,702)	—	—
	タカラレーベン不動産投資法人	1,604 (225)	173,482 (23,554)	434	48,899
	タカラレーベン不動産投資法人	225 (△225)	23,554 (△23,554)	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,835	271,474	422	65,149
	日本ビルファンド投資法人	4,153	2,749,799	1,224	818,152
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,315	2,054,938	1,075	670,220
	日本都市ファンド投資法人	16,723	1,738,629	5,421	557,045
	オリックス不動産投資法人	6,597	1,206,595	2,134	380,072
	日本プライムリアルティ投資法人	2,501	979,021	716	281,551
	N T T都市開発リート投資法人	3,183	471,535	1,003	150,383
	東急リアル・エステート投資法人	2,217	438,838	715	137,484
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,278	255,165	831	92,786
	ユナイテッド・アーバン投資法人	7,467	1,088,411	2,424	342,810
	森トラスト総合リート投資法人	2,364	337,385	763	107,355
	インヴィンシブル投資法人	14,586	621,954	4,727	196,403
	フロンティア不動産投資法人	1,394	717,434	369	187,430
平和不動産リート投資法人	2,428 (134)	360,353 (18,480)	694	102,225	
平和不動産リート投資法人	134 (△134)	18,480 (△18,480)	—	—	
内	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,417	767,007	709	226,015
	福岡リート投資法人	1,716	285,471	558	92,382

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	ケネディクス・オフィス投資法人	1,300 (3,131)	677,736 (-)	545	358,464
	いちごオフィスリート投資法人	2,717	228,488	882	74,519
	大和証券オフィス投資法人	678	470,175	234	163,225
	阪急阪神リート投資法人	1,497	226,555	485	73,138
	スターツプロシード投資法人	623 (98)	146,008 (20,672)	166	39,141
	スターツプロシード投資法人	98 (△98)	20,672 (△20,672)	-	-
	大和ハウスリート投資法人	4,995	1,557,584	1,563	492,747
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	11,991	819,440	3,239	210,843
	大和証券リビング投資法人	4,765 (92)	543,533 (10,523)	1,426	163,567
内	大和証券リビング投資法人	92 (△92)	10,523 (△10,523)	-	-
	ジャパンエクセレント投資法人	3,054	403,207	1,099	143,335

(注1)金額は受渡代金です。

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

(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

### <先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	R E I T 先 物 取 引	百万円 16,277	百万円 16,429	百万円 -	百万円 -

(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			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 0.209442	百万円 0.209442	% 100.0	百万円 0.209442	百万円 0.209442	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	810,761	53,691	6.6	811,335	53,342	6.6

(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

## ＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期		末	
	口	数 (口)	口	数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)
エスコンジャパンリート投資法人		1,908		2,382	274,644	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		3,002		3,754	346,869	0.3
S O S i L A物流リート投資法人		3,976		5,478	763,633	0.6
東海道リート投資法人		726		1,421	169,667	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		3,273		4,046	2,512,566	1.9
森ヒルズリート投資法人		11,145		13,779	2,200,506	1.7
産業ファンド投資法人		13,455		17,511	2,735,218	2.1
アドバンス・レジデンス投資法人		9,476		11,716	3,948,292	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6,473		8,404	1,765,680	1.3
アクティブピア・プロパティーズ投資法人		5,051		6,186	2,681,631	2.0
G L P投資法人		30,696		37,821	5,741,227	4.4
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		4,267		5,451	1,695,261	1.3
日本プロロジスリート投資法人		15,015		19,201	6,029,114	4.6
星野リゾート・リート投資法人		1,462		2,049	1,424,055	1.1
O n eリート投資法人		1,645		2,044	504,663	0.4
イオンリート投資法人		11,146		12,971	2,089,628	1.6
ヒューリックリート投資法人		8,841		10,963	1,881,250	1.4
日本リート投資法人		2,925		3,806	1,370,160	1.0
積水ハウス・リート投資法人		28,770		35,609	2,848,720	2.2
トーセイ・リート投資法人		1,980		2,599	347,746	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		3,784		5,094	1,364,682	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,021		2,889	548,043	0.4
サムティ・レジデンシャル投資法人		2,148		3,046	359,428	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		30,648		37,892	6,384,802	4.9
いちごホテルリート投資法人		1,570		1,941	199,728	0.2
ラサールロジポート投資法人		11,602		14,345	2,338,235	1.8
スターアジア不動産投資法人		9,794		14,630	814,891	0.6
マリモ地方創生リート投資法人		888		1,463	200,284	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		3,523		4,629	2,284,411	1.7
大江戸温泉リート投資法人		1,530		1,891	127,075	0.1
投資法人みらい		10,804		14,236	676,210	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		2,224		2,749	386,784	0.3
三菱地所物流リート投資法人		2,409		4,026	1,803,648	1.4
C R Eロジスティクスファンド投資法人		3,671		4,538	917,129	0.7
ザイマックス・リート投資法人		1,376		1,901	229,640	0.2
タカラレーベン不動産投資法人		3,737		5,132	516,792	0.4

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,695	5,108	733,508		0.6
日本ビルファンド投資法人	10,741	13,670	8,776,140		6.7
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,478	11,718	7,054,236		5.4
日本都市ファンド投資法人	47,820	59,122	6,373,351		4.8
オリックス不動産投資法人	18,884	23,347	4,426,591		3.4
日本プライムリアルティ投資法人	6,229	8,014	3,129,467		2.4
N T T都市開発リート投資法人	9,084	11,264	1,617,510		1.2
東急リアル・エステート投資法人	6,354	7,856	1,653,688		1.3
グローバル・ワン不動産投資法人	6,581	8,028	904,755		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	21,336	26,379	4,072,917		3.1
森トラスト総合リート投資法人	6,774	8,375	1,229,450		0.9
インヴィンシブル投資法人	41,715	51,574	2,341,459		1.8
フロンティア不動産投資法人	3,323	4,348	2,247,916		1.7
平和不動産リート投資法人	6,140	8,008	1,238,036		0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,193	7,901	2,536,221		1.9
福岡リート投資法人	4,902	6,060	1,029,594		0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	2,932	6,818	2,290,848		1.7
いちごオフィスリート投資法人	7,766	9,601	822,805		0.6
大和証券オフィス投資法人	2,005	2,449	1,648,177		1.3
阪急阪神リート投資法人	4,281	5,293	807,182		0.6
スターツプロシード投資法人	1,476	2,031	472,004		0.4
大和ハウスリート投資法人	14,231	17,663	5,343,057		4.1
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,035	37,787	2,811,352		2.1
大和証券リビング投資法人	12,806	16,237	1,888,363		1.4
ジャパンエクセレント投資法人	8,794	10,749	1,460,789		1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	549,536	696,993	127,391,746	
	銘 柄 数 <比 率>	61	61	<96.9%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(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。

(注3) 銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

※当期末現在の保有銘柄のうち、当社または当社の利害関係人が資産運用会社または一般事務受託会社である投資法人

①資産運用会社

日本ロジスティクスファンド投資法人については、当社の利害関係人である三井物産ロジスティクス・パートナーズ株式会社が資産運用会社となっております。

②一般事務受託会社

以下の投資法人については、当社の利害関係人である三井住友信託銀行株式会社が一般事務受託会社となっております。

投資法人名	
エスコンジャパンリート投資法人	タカラレーベン不動産投資法人
SOS i LA物流リート投資法人	アドバンス・ロジスティクス投資法人
日本アコモデーションファンド投資法人	日本ビルファンド投資法人
森ヒルズリート投資法人	オリックス不動産投資法人
産業ファンド投資法人	NTT都市開発リート投資法人
アドバンス・レジデンス投資法人	東急リアル・エステート投資法人
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	ユナイテッド・アーバン投資法人
アクティビア・プロパティーズ投資法人	森トラスト総合リート投資法人
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	インヴィンシブル投資法人
日本プロロジスリート投資法人	フロンティア不動産投資法人
イオンリート投資法人	日本ロジスティクスファンド投資法人
ケネディクス商業リート投資法人	福岡リート投資法人
ヘルスケア&メディカル投資法人	ケネディクス・オフィス投資法人
ラサールロジポート投資法人	いちごオフィスリート投資法人
スターアジア不動産投資法人	大和証券オフィス投資法人
マリモ地方創生リート投資法人	阪急阪神リート投資法人
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	スターツプロシード投資法人
大江戸温泉リート投資法人	大和ハウスリート投資法人
投資法人みらい	ジャパン・ホテル・リート投資法人
森トラスト・ホテルリート投資法人	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	期		末					
			買	建	額	売	建	額		
			(百万円)		(百万円)					
国内	東	証	R	E	I	T	指	数	4,012	—

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 127,391,746	% 96.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,290,134	3.3
投 資 信 託 財 産 総 額	131,681,880	100.0

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年11月10日現在
(A)資 産	131,681,880,177円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,736,946,174
投 資 証 券(評価額)	127,391,746,400
未 収 入 金	91,536,649
未 収 配 当 金	1,111,331,754
差 入 委 託 証 拠 金	350,319,200
(B)負 債	236,364,451
未 払 金	161,682,453
未 払 解 約 金	74,675,818
未 払 利 息	6,180
(C)純 資 産 総 額(A-B)	131,445,515,726
元 本	61,225,723,115
次 期 繰 越 損 益 金	70,219,792,611
(D)受 益 権 総 口 数	61,225,723,115口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,469円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年11月11日 至 2022年11月10日
(A)配 当 等 収 益	4,112,764,847円
受 取 配 当 金	4,114,117,113
受 取 利 息	14,680
そ の 他 収 益 金	206
支 払 利 息	△1,367,152
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△6,004,940,087
売 買 益	1,898,230,392
売 買 損	△7,903,170,479
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△83,330,720
取 引 益	296,344,400
取 引 損	△379,675,120
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,975,505,960
(E)前 期 繰 越 損 益 金	60,368,009,748
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	18,157,282,749
(G)解 約 差 損 益 金	△6,329,993,926
(H)計 (D+E+F+G)	70,219,792,611
次 期 繰 越 損 益 金(H)	70,219,792,611

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

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

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

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は50,752,359,768円、期中追加設定元本額は16,026,940,734円、期中一部解約元本額は5,553,577,387円です。  
 ※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	31,882,373,589円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,678,540,579円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,228,904,460円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,729,965,779円
分散投資コア戦略ファンドS	1,687,481,776円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,460,260,510円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,036,169,457円
分散投資コア戦略ファンドA	795,726,284円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	607,009,296円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	582,825,312円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	525,180,997円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	502,780,878円
J-REIT パッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	291,868,529円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-11(適各機関投資家専用)	255,963,362円
グローバル経済コア	246,084,185円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	229,316,589円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	214,944,241円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	112,071,896円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	84,403,221円
SMT インデックスバランス・オープン	26,406,174円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	19,640,628円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	13,004,824円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,445,182円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,348,365円
10資産分散投資ファンド	7,002円

## お知らせ

該当事項はありません。

# グローバルREITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2022年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年1月9日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。以下同じ。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界各国の取引所に上場している不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・ 基準価額は1万円当たりで表記しています。
- ・ 原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・ 一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・ 指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率		
第11期(2018年11月12日)	18,126	1.6	19,461	2.2	99.4	74,818
第12期(2019年11月11日)	19,790	9.2	21,365	9.8	99.4	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838	△14.9	18,254	△14.6	99.6	80,213
第14期(2021年11月10日)	24,699	46.7	26,879	47.2	99.5	102,118
第15期(2022年11月10日)	24,409	△1.2	26,667	△0.8	99.5	84,560

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2021年11月10日	24,699	—	26,879	—	99.5
11月末	24,668	△0.1	26,837	△0.2	99.6
12月末	26,284	6.4	28,634	6.5	99.2
2022年 1月末	24,428	△1.1	26,622	△1.0	99.6
2月末	24,435	△1.1	26,656	△0.8	99.5
3月末	27,464	11.2	29,949	11.4	99.4
4月末	27,912	13.0	30,422	13.2	99.6
5月末	25,788	4.4	28,131	4.7	99.6
6月末	25,158	1.9	27,451	2.1	99.3
7月末	26,508	7.3	28,918	7.6	99.4
8月末	25,935	5.0	28,316	5.3	99.6
9月末	23,076	△6.6	25,156	△6.4	99.2
10月末	25,123	1.7	27,436	2.1	99.4
(当期末) 2022年11月10日	24,409	△1.2	26,667	△0.8	99.5

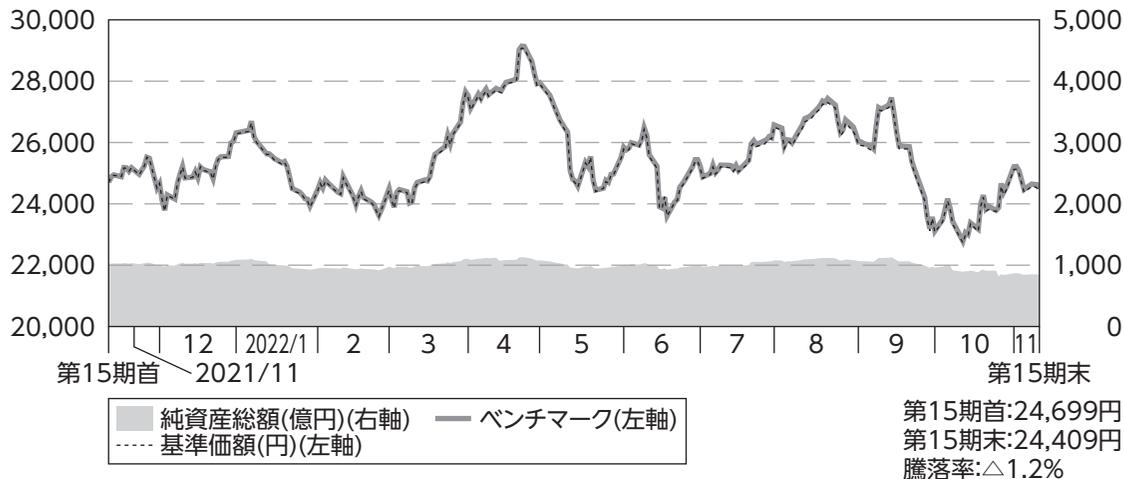
(注) 騰落率は期首比です。

ベンチマークは、S&amp;P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)です。

S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。当インデックスは、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

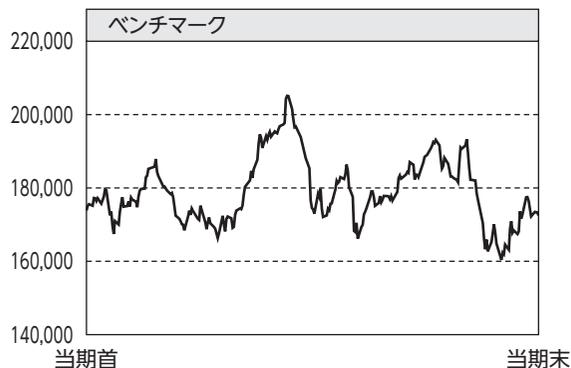


(注)ベンチマークは、2021年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

## 投資環境



海外REIT市場は、年末商戦期の米小売売上高の好調などが好感された一方、各国中央銀行のタカ派的な姿勢やウクライナ情勢の緊迫化などが意識され一進一退の展開となりましたが、2022年6月中旬にかけては各国の相次ぐ利上げを受けた景気減速懸念などから下落しました。その後は、米国のインフレ圧力緩和に伴う金融引き締めペース減速への期待などを背景に一時反発する場面もありましたが、期末にかけては、FOMC(米連邦公開市場委員会)参加者の政策金利見通しが積極的な利上げ継続を示唆する内容であったことなどから米長期金利が継続的に上昇したことが嫌気され、下落しました。

外国為替市場では、日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

### (1)組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、REITを高位に組み入れ運用を行いました。

### (2)ポートフォリオ構成

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

## 当ファンドの組入資産の内容

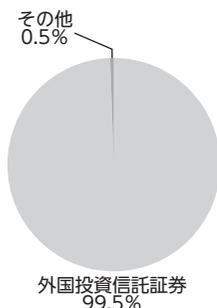
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.3%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.5%
3	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.7%
4	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.2%
5	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	3.1%
6	WELLTOWER INC	アメリカ	2.5%

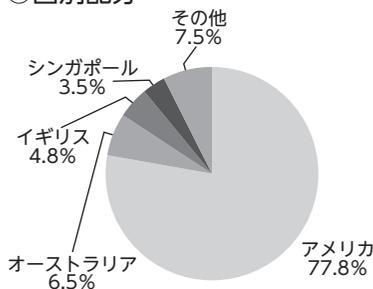
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.5%
8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.3%
9	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	1.8%
10	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	1.7%
組入銘柄数		324	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

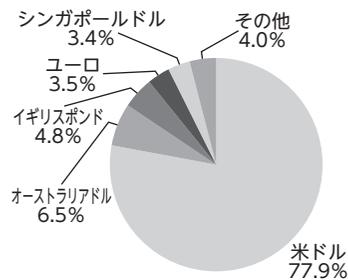
### ○資産別配分



### ○国別配分



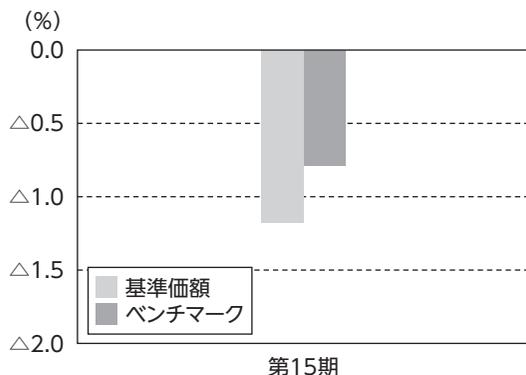
### ○通貨別配分



(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

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。差異の主な要因は、配当課税要因※(マイナス要因)です。

※ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異です。

## 今後の運用方針

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券に投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年11月11日~2022年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	2円	0.009%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(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)	(2)	(0.009)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(b) 有価証券取引税	3	0.011	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(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)	(3)	(0.011)	
(c) その他費用	10	0.038	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(10)	(0.038)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	15	0.058	

(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(25,564円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ア メ リ カ	百株 — (1,399)	千米ドル — (4,097)	百株 — (1,399)	千米ドル — (4,097)

(注1)金額は受渡代金です。

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

### <投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,983	3,511	26,383	4,349
	BOSTON PROPERTIES	18,702	1,927	30,320	2,911
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,456	902	55,086	1,650
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	13,600	130	21,327	182
	AGREE REALTY CORP	9,361	659	9,675	635
	SL GREEN REALTY CORP	9,576 (1,122)	654 (89)	17,066 (1,068)	1,092 (—)
	EPR PROPERTIES	7,003	356	13,404	588
	PROLOGIS INC	85,651 (103,749)	11,500 (12,363)	160,259	20,025
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	17,181	3,716	27,653	5,762
	LXP INDUSTRIAL TRUST	21,339	240	41,751	420
	CAMDEN PROPERTY TRUST	12,793	1,898	18,384	2,540
	VERIS RESIDENTIAL INC	—	—	4,726	72
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	15,531	679	29,308	1,232
	COUSINS PROPERTIES INC	13,979	414	24,920	717
	SITE CENTERS CORP	24,592	370	36,061	489
	ISTAR INC	47,982	609	7,566	69
	DUKE REALTY CORP	43,435 (△218,421)	2,455 (△12,363)	33,998	1,981
	ESSEX PROPERTY TRUST	6,035	1,777	11,368	3,175
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	40,950	3,222	70,990	5,383

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,537	1,003	13,617	1,519
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	9,691	499	19,025	957
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	57,235	1,658	101,704	2,834
EQUITY COMMONWEALTH	17,008	469	32,193	845
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	8,300 (△80,080)	228 (△2,524)	9,830	290
HIGHWOODS PROPERTIES INC	7,879	301	15,959	539
SERVICE PROPERTIES TRUST	16,167	121	32,163	237
WELLTOWER INC	68,013	5,519	80,793	5,858
EASTGROUP PROPERTIES, INC	4,455	756	6,130	1,028
KIMCO REALTY CORP	62,333	1,386	109,429	2,361
KILROY REALTY CORPORATION	12,830	786	21,987	1,238
LTC PROPERTIES INC	2,685	116	4,134	154
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	—	—	16,000	53
MONMOUTH REIT -CL A	—	—	54,952	1,153
BRANDYWINE REALTY TRUST	—	—	12,403	78
IRON MOUNTAIN INC	23,339	1,129	46,118	2,227
MACERICH CO/THE	23,663	296	40,535	487
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,519	1,098	25,874	1,755
ACADIA REALTY TRUST	8,960	150	8,030	104
HOST HOTELS AND RESORTS INC	84,082	1,475	147,014	2,560
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,894	2,462	22,750	4,086
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,900	48	8,000	74
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,650	109	5,541	317
CENTERSPACE	3,791	324	3,941	302
PENN REAL ESTATE INVEST TST	— (△32,667)	— (—)	2,333	10
GETTY REALTY CORP	4,700	138	5,995	168
PS BUSINESS PARKS INC	1,562	264	12,734	2,295
REALTY INCOME CORP	96,049	6,454	108,852	6,941
REGENCY CENTERS CORP	16,221	1,044	28,179	1,763
UDR INC	42,878	2,178	52,099	2,431
CORPORATE OFFICE PPTYS	19,512	497	29,452	757
SIMON PROPERTY GROUP	41,034	4,915	67,046	7,869
LIFE STORAGE INC	9,357	1,204	13,572	1,643

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
PUBLIC STORAGE	20,145	6,722	29,337	9,618
SUN COMMUNITIES INC	15,910	2,629	21,976	3,363
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,119	265	24,082	416
UMH PROPERTIES INC	5,309	113	5,500	88
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	—	—	2,180	96
VENTAS INC	46,929	2,462	76,470	3,549
VORNADO REALTY TRUST	14,733	464	28,684	891
ELME COMMUNITIES	5,500	122	9,696	169
GEO GROUP INC/THE	—	—	64,306	425
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	7,402	444	84,196	5,449
KITE REALTY GROUP TRUST	16,577	327	31,440	608
EXTRA SPACE STORAGE INC	17,348	3,271	27,441	5,108
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	—	—	12,000	73
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,246	414	60,788	660
CUBESMART	27,856	1,365	33,595	1,481
DIGITAL REALTY TRUST INC	32,681	4,298	52,060	6,346
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	10,100	88	24,494	206
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	68,586	1,281	119,880	1,937
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	17,764	516	31,749	803
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	20,023	361	30,327	521
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	—	—	9,512	94
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,000	106	23,500	198
TERRENO REALTY CORP	9,847	648	17,025	1,040
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,974	269	11,700	377
RLJ LODGING TRUST	15,420	197	30,669	368
AMERICOLD REALTY TRUST	22,901 (139,990)	698 (4,097)	39,230 (139,990)	1,005 (4,097)
CORESITE REALTY CORP	1,000	171	25,830	4,392
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	6,552	147	15,939	294
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	—	—	4,892	69
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	—	—	29,639	737
SABRA HEALTH CARE REIT INC	31,663	450	50,072	683
WHITESTONE REIT	11,384	150	7,400	96
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	6,400	157	30,107	491
STAG INDUSTRIAL INC	21,364	823	28,505	994

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
CYRUSONE INC	4,431	398	72,527	6,559
WP CAREY INC	27,457	2,235	32,652	2,446
ALEXANDER & BALDWIN INC	11,272	242	16,130	335
GLADSTONE LAND CORP	3,000	69	3,439	66
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	25,823 (80,080)	703 (2,524)	47,364	1,072
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	3,363	283	7,950	676
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	8,100	119	6,549	73
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,904	901	22,745	929
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,180	152	20,607	296
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	29,605	1,993	25,221	1,500
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	44,055	1,666	52,997	1,878
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	73,369	1,827	26,694	518
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	4,627	853	4,783	760
JBG SMITH PROPERTIES	14,920	394	33,752	840
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	12,000	109	8,504	53
RETAIL VALUE	—	—	9,529	28
INVITATION HOMES INC	82,794	3,176	128,801	4,789
COREPOINT LODGING INC	—	—	22,000	351
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	— (—)	— (△6)	—	—
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	—	—	13,000	87
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	13,451	323	12,065	265
SAFEHOLD INC	2,000	143	2,005	143
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	29,554	711	31,023	739
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	6,500	149	12,256	300
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	—	—	66,258	1,134
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	39,937	1,900	43,302	2,022
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	21,288	485	44,417	948
PRIME US REIT	— (—)	— (△8)	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	39,823	1,145	7,904	180
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	—	—	13,000	96
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	—	—	— (14,850)	— (207)
FARMLAND PARTNERS INC	14,928	208	4,277	57

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ORION OFFICE REIT INC	— (30,374)	— (—)	—	—
	NETSTREIT CORP	7,645	141	4,806	85
	CARETRUST REIT INC	4,980	104	11,525	204
	INDUS REALTY TRUST INC	1,500	121	1,500	74
	PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	67,067	2,159	11,824	341
	BLUEROCK HOMES TRUST INC	— (1,856)	— (—)	—	—
	APARTMENT INCOME REIT CO	13,475	581	27,625	1,174
	BROADSTONE NET LEASE INC-A	11,280	230	16,297	262
	CTO REALTY GROWTH INC	— (5,600)	— (—)	—	—
	CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	6,800	64
	CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	13,620	387	2,023	51
	DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800 (—)	154 (△1)	—	—
	STORE CAPITAL CORP	29,242	845	38,730	1,225
	PARAMOUNT GROUP INC	—	—	9,718	64
	URBAN EDGE PROPERTIES	5,290	84	9,545	129
	EQUINIX INC	10,764	7,334	17,358	11,196
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	5,639	113	10,316	165
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	6,867	132	15,765	270
	NEXPOINT RESIDENTIAL	—	—	1,583	64
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,319	582	15,231	798
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	—	—	1,493	47
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,591	233	29,221	476
	GLOBAL NET LEASE INC	—	—	7,928	86
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	221,400 (—)	144 (△6)	122,800	39
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	20,494	361	45,472	689
	VICI PROPERTIES INC	260,614	7,792	139,949	4,220
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	—	19,900	161
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,481	280	15,963	417
	DIGITALBRIDGE GROUP INC	63,237	446	344,130	2,160
	小 計	3,149,812 (31,603)	143,076 (4,163)	4,612,103 (155,908)	214,517 (4,305)

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,314	404	24,127	713
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,654	510	16,399	781
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9,000	124	28,398	330
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,373	577	45,127	968
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	3,300	128	7,563	252
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	—	—	47,120	553
PRIMARIS REIT	8,000 (20,309)	123 (—)	—	—
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	6,400	333	8,713	454
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	10,000	120
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,900	105	8,200	97
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	7,500	94	19,871	203
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	22,000	319	21,101	278
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,000	101	13,272	232
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	5,700	516	9,071	775
CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	95	17,145	217
PLAZA RETAIL REIT	—	—	25,000	103
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	102	—	—
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	214	—	—
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	7,810	116
SLATE GROCERY REIT	7,000	117	—	—
NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,015	72	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	—	—	7,950	120
小 計	171,656 (20,309)	3,942 (—)	316,867	6,319
ドイツ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	— (—)	— (△30)	92,500	1,752
小 計	— (—)	— (△30)	92,500	1,752
イタリア				
COIMA RES SPA	—	—	11,900	118
小 計	—	—	11,900	118
フランス				
ICADE	2,960 (—)	160 (△15)	5,530	264

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ALTAREA	600 (-)	95 (△15)	-	-
	KLEPIERRE	20,829 (-)	470 (△172)	35,340	711
	GECINA SA	5,880	581	10,436	1,003
	COVIVIO(FP)	4,658	311	9,439	574
	MERCIALYS	15,384	128	7,000	58
	CARMILA	7,392 (-)	106 (△25)	6,000	81
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,285	808	30,078	1,602
	ALTAREA-RTS	- (1,880)	- (-)	1,880	4
	小 計	71,988 (1,880)	2,664 (△228)	105,703	4,300
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	4,300 (277)	79 (2)	7,867	160
	小 計	4,300 (277)	79 (2)	7,867	160
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	65,084 (-)	444 (△25)	67,274	422
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	- (-)	- (△5)	-	-
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	37,281 (-)	368 (△39)	66,879	604
	小 計	102,365 (-)	812 (△70)	134,153	1,027
	ベルギー				
	BEFIMMO S. C. A.	1,800	85	15,810	724
	COFINIMMO	3,670	452	5,238	574
	RETAIL ESTATES	-	-	1,065	61
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	18,800	642	30,658	957
	MONTEA NV	1,630	146	1,960	128
	AEDIFICA	5,100	465	6,152	534
	XIOR STUDENT HOUSING NV	1,730	73	2,357	63
	小 計	32,730	1,865	63,240	3,043

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アイルランド				
HIBERNIA REIT PLC	—	—	365,550	584
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	—	—	50,000	85
小 計	—	—	415,550	670
その他				
CROMWELL REIT EUR	43,300 (—)	86 (△8)	32,900	49
小 計	43,300 (—)	86 (△8)	32,900	49
ユ ー ロ 計	254,683 (2,157)	5,509 (△334)	863,813	11,122
イギリス	口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	130,425	592	213,051	903
DERWENT LONDON PLC	10,500	322	20,126	531
BIG YELLOW GROUP PLC	16,822	252	31,095	405
HAMMERSON PLC	413,000	116	1,030,354	278
WORKSPACE GROUP PLC	11,000	64	16,031	61
UNITE GROUP PLC	52,356	537	82,534	771
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	220,000	304	317,933	402
SHAFTESBURY PLC	23,000	123	40,370	170
SEGRO PLC	163,782	1,859	260,792	2,655
LAND SECURITIES GROUP PLC	71,242	521	127,045	789
ASSURA PLC	477,000	318	543,231	320
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	30,500	199	62,680	360
PICTON PROPERTY INCOME LTD	—	—	62,000	63
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	—	—	84,028	50
SAFESTORE HOLDINGS PLC	15,300	178	32,441	338
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	159,220	409	192,644	424
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	—	—	56,600	46
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	98,011	162	214,151	266
GCP STUDENT LIVING PLC	—	—	258,000	549
WAREHOUSE REIT PLC	230,000	335	—	—
NEWRIVER REIT PL	—	—	60,000	56
PRS REIT PLC/THE	130,000	142	124,998	122
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	342,099	423	218,910	226

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	299,167	607	352,163	587
	HOME REIT PLC	287,000	344	45,698	39
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	80	—	—
	AEW UK REIT PLC	—	—	50,000	63
	LXI REIT PLC	726,409	1,020	305,829	392
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	260,000	437	36,579	45
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	52,000	61	—	—
	小 計	4,328,833	9,417	4,839,283	10,925
	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
	BWP TRUST	—	—	34,094	126
	MIRVAC GROUP	441,626	1,033	764,484	1,730
	CROMWELL PROPERTY GROUP	150,000	126	343,193	268
	CHARTER HALL RETAIL REIT	64,500	261	115,786	473
	GPT GROUP	186,173	871	360,843	1,647
	CENTURIA CAPITAL GROUP	40,000	115	121,372	244
	ABACUS PROPERTY GROUP	42,000	118	80,387	234
	STOCKLAND	356,553	1,398	552,903	2,075
	DEXUS	91,730	927	179,013	1,643
	GOODMAN GROUP	209,755	4,398	344,622	6,763
	VICINITY CENTERS	391,404	743	716,047	1,277
	CHARTER HALL GROUP	50,166	732	85,630	1,229
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	—	—	27,950	86
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	— (36,978)	— (226)	20,120	73
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	210,679	608	267,318	725
	ARENA REIT	50,500	240	90,275	386
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	40,000	120	86,130	271
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	75,980	371	109,328	484
	NATIONAL STORAGE REIT	166,000	389	293,750	703
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	35,000	130	—	—
	RURAL FUNDS GROUP	40,000	109	49,764	122
	IRONGATE GROUP	—	—	272,000	516
	SCENTRE GROUP	540,874	1,571	967,874	2,741
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	178	—	—
	HOME CONSORTIUM LTD	21,000	107	36,309	208

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	—	—	31,566	98
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	119,920 (513,700)	136 (743)	168,159	196
	HEALTHCO REIT	137,130	280	—	—
	AVENTUS GROUP	—	—	(233,500)	(810)
	WAYPOINT REIT LTD	—	—	53,143	133
	小 計	3,651,630 (550,678)	14,974 (970)	6,172,060 (233,500)	24,463 (810)
	ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
	AMP NZ OFFICE LTD	80,000	114	206,599	239
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	— (26,153)	— (77)	68,115	157
	GOODMAN PROPERTY TRUST	130,000	287	232,101	514
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	—	—	114,737	98
	ARGOSY PROPERTY LTD	—	—	85,000	132
	STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	543	—	—
	小 計	510,000 (26,153)	945 (77)	706,552	1,143
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	234,200	15,121	399,800	23,446
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	195,000 (302,660)	673 (976)	—	—
	CHAMPION REIT	170,000	574	563,000	1,745
	FORTUNE REIT	80,000	548	231,000	1,265
	YUEXIU REAL ESTATE IN-RIGHTS	— (302,660)	— (—)	— (302,660)	— (8)
	小 計	679,200 (605,320)	16,917 (976)	1,193,800 (302,660)	26,457 (8)
	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	596,800 (—)	1,267 (△0.84949)	1,018,300	2,012
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	307,700 (—)	878 (△65)	573,200	1,544
	SUNTEC REIT	332,500 (—)	539 (△6)	452,300	704
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	753,700 (58,485)	1,298 (57)	869,600	1,431

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	STARHILL GLOBAL REIT	190,000	111	200,000	126
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	365,700 (-)	401 (△15)	509,600	495
	KEPPEL REIT	100,000	107	215,100	205
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	45,000	102	209,400	446
	ESR-LOGOS REIT	350,000 (1,320,769)	141 (591)	701,200	229
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	56,400 (-)	70 (△5)	75,700	77
	CAPITALAND CHINA TRUST	260,000 (-)	309 (△20)	213,800	229
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	- (-)	- (△7)	-	-
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	- (-)	- (△7)	-	-
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	50,000 (-)	242 (△5)	112,300	488
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	284,400 (-)	728 (△1)	431,500	1,063
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	188,800 (-)	345 (△7)	340,200	603
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	- (-)	- (△0.34268)	- (744,977)	- (666)
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	240,000 (-)	274 (△21)	1,462,100	1,727
	SPH REIT	577,800	545	745,000	677
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△4)	-	-
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	570,000 (160,950)	446 (115)	402,000	297
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400 (-)	218 (△5)	-	-
	IREIT GLOBAL	-	-	405,985	217
	KEPPEL DC REIT	50,000 (-)	98 (△14)	133,600	226
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	295,000 (-)	415 (△24)	540,300	701
	小 計	5,942,200 (1,540,204)	8,546 (551)	9,611,185 (744,977)	13,509 (666)

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	76,363	—	—
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10,000 (7,287)	79,288 (53,458)	—	—
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	— (—)	— (△402)	—	—
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	— (5,433)	— (34,731)	—	—
ESR KENDALL SQUARE REIT CO LTD RIGHT	— (26,655)	— (—)	— (26,655)	— (2,324)
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	74,038	—	—
JR REIT XXVII	— (12,345)	— (54,005)	— (—)	— (490)
SK REITS CO LTD	30,940 (8,289)	197,336 (42,381)	— (—)	— (439)
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD RIGHT	— (7,287)	— (—)	— (7,287)	— (409)
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	— (26,655)	— (167,260)	—	—
D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240 (—)	152,362 (△306)	—	—
SK REITS CO LTD-RIGHTS	— (8,289)	— (439)	— (8,289)	— (439)
KORAMCO ENERGY PLUS REIT-RTS	— (5,433)	— (—)	— (5,433)	— (775)
JR REIT XXVII-RIGHTS	— (12,345)	— (490)	— (12,345)	— (490)
NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	78,164	—	—
小 計	111,530 (120,018)	657,553 (352,058)	— (60,009)	— (5,368)
イスラエル	口	千イスラエルシェケル	口	千イスラエルシェケル
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	1,157	—	—
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	722	—	—
小 計	475,000	1,880	—	—

(注1) 金額は受渡代金です。

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

## 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			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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	18,398	73	0.4	34,706	—	—
金 銭 信 託	0.001857	0.001857	100.0	0.001857	0.001857	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	54,550	4,030	7.4	54,662	4,016	7.3

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)		当 期		末	比 率 (%)
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)			千米ドル			
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	76,688	70,288	10,032	1,468,918	1.7	
ALEXANDER'S INC	1,190	1,190	281	41,166	0.0	
BOSTON PROPERTIES	79,135	67,517	4,776	699,375	0.8	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	135,453	110,823	3,434	502,831	0.6	
APARTMENT INVNT & MGMT CO -A	79,751	72,024	517	75,818	0.1	
AGREE REALTY CORP	38,105	37,791	2,592	379,617	0.4	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	102	15,007	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	37,875	30,439	1,128	165,294	0.2	
EPR PROPERTIES	41,912	35,511	1,356	198,556	0.2	
PROLOGIS INC	410,213	439,354	47,797	6,998,005	8.3	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	77,265	66,793	10,618	1,554,691	1.8	
LXP INDUSTRIAL TRUST	152,908	132,496	1,328	194,569	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	56,019	50,428	5,515	807,496	1.0	
VERIS RESIDENTIAL INC	42,236	37,510	555	81,279	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	97,618	83,841	3,679	538,756	0.6	
COUSINS PROPERTIES INC	82,626	71,685	1,696	248,321	0.3	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	15,050	273	40,081	0.0	
SITE CENTERS CORP	99,620	88,151	1,081	158,358	0.2	
ISTAR INC	—	40,416	398	58,285	0.1	
DUKE REALTY CORP	208,984	—	—	—	—	
ESSEX PROPERTY TRUST	36,162	30,829	6,392	935,865	1.1	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	190,281	160,241	9,563	1,400,145	1.7	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	39,550	34,470	3,479	509,469	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	71,853	62,519	2,938	430,210	0.5	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	299,893	255,424	6,104	893,779	1.1	
EQUITY COMMONWEALTH	67,845	52,660	1,363	199,687	0.2	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,610	—	—	—	—	

\* 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。

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	57,872	49,792	1,386	202,954	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	94,169	78,173	558	81,719	0.1
WELLTOWER INC	233,908	221,128	14,705	2,152,960	2.5
EASTGROUP PROPERTIES, INC	22,299	20,624	3,105	454,655	0.5
KIMCO REALTY CORP	339,870	292,774	6,080	890,306	1.1
KILROY REALTY CORPORATION	58,949	49,792	2,036	298,162	0.4
LTC PROPERTIES INC	20,624	19,175	735	107,720	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	132,800	116,800	136	20,007	0.0
MONMOUTH REIT -CL A	54,952	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	93,620	81,217	511	74,913	0.1
IRON MOUNTAIN INC	160,382	137,603	6,765	990,601	1.2
MACERICH CO/THE	118,542	101,670	1,175	172,076	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	94,155	82,800	5,116	749,064	0.9
ACADIA REALTY TRUST	46,940	47,870	674	98,681	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	401,344	338,412	5,685	832,387	1.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	64,502	54,646	8,320	1,218,189	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	18,550	165	24,253	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	25,030	21,139	1,153	168,953	0.2
CENTERSPACE	7,499	7,349	448	65,720	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	8,599	196	28,792	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	21,985	20,690	658	96,389	0.1
PS BUSINESS PARKS INC	11,172	—	—	—	—
RPT REALTY	43,950	43,950	443	64,861	0.1
REALTY INCOME CORP	307,228	294,425	18,622	2,726,502	3.2
REGENCY CENTERS CORP	84,860	72,902	4,535	664,003	0.8
UDR INC	153,803	144,582	5,430	795,079	0.9
CORPORATE OFFICE PPTYS	63,159	53,219	1,393	204,067	0.2
SAUL CENTERS INC	6,800	6,800	267	39,146	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	182,102	156,090	17,625	2,580,576	3.1
LIFE STORAGE INC	44,161	39,946	4,057	594,031	0.7
PUBLIC STORAGE	84,460	75,268	21,429	3,137,500	3.7
SUN COMMUNITIES INC	64,445	58,379	7,788	1,140,376	1.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	57,370	49,407	890	130,423	0.2
UMH PROPERTIES INC	25,320	25,129	422	61,809	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	20,150	356	52,158	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	6,973	4,793	230	33,676	0.0
VENTAS INC	218,755	189,214	7,899	1,156,592	1.4
VORNADO REALTY TRUST	90,208	76,257	1,715	251,207	0.3
ELME COMMUNITIES	45,570	41,374	749	109,763	0.1
GEO GROUP INC/THE	64,306	—	—	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	76,794	—	—	—	—
KITE REALTY GROUP TRUST	118,586	103,723	2,130	311,922	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	73,984	63,891	9,687	1,418,389	1.7
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	57,973	45,973	128	18,779	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	124,047	100,505	1,002	146,707	0.2
CUBESMART	111,990	106,251	4,125	604,047	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	156,521	137,142	13,315	1,949,466	2.3

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	114,240	99,846	834	122,210	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	334,846	283,552	3,187	466,626	0.6
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	97,197	83,212	1,332	195,050	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	69,259	58,955	844	123,690	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	67,924	58,412	585	85,777	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	63,470	52,970	405	59,328	0.1
TERRENO REALTY CORP	38,649	31,471	1,752	256,555	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,057	26,331	716	104,936	0.1
RLJ LODGING TRUST	92,291	77,042	852	124,753	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	143,840	127,511	3,586	525,155	0.6
CORESITE REALTY CORP	24,830	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	71,613	62,226	915	134,106	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	27,830	22,938	340	49,837	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	—	—	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,360	305	44,778	0.1
SABRA HEALTH CARE REIT INC	127,744	109,335	1,334	195,374	0.2
WHITESTONE REIT	19,090	23,074	207	30,404	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	84,730	61,023	646	94,615	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	91,978	84,837	2,631	385,298	0.5
CYRUSONE INC	68,096	—	—	—	—
WP CAREY INC	103,444	98,249	7,706	1,128,330	1.3
ALEXANDER & BALDWIN INC	41,570	36,712	703	103,038	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15,500	15,061	304	44,652	0.1
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	121,604	180,143	3,462	506,922	0.6
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	30,696	26,109	2,198	321,864	0.4
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	30,500	32,051	361	52,932	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	66,382	64,541	2,479	362,953	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	118,562	107,135	1,511	221,324	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	76,595	80,979	4,340	635,488	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	152,152	143,210	4,273	625,666	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	58,331	105,006	1,717	251,517	0.3
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,398	13,242	1,373	201,165	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	65,943	47,111	871	127,604	0.2
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	59,590	63,086	393	57,635	0.1
RETAIL VALUE	9,529	—	—	—	—
INVITATION HOMES INC	320,490	274,483	8,182	1,197,976	1.4
COREPOINT LODGING INC	22,000	—	—	—	—
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	470,000	249	36,470	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	81,118	68,118	485	71,008	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	17,286	335	49,123	0.1
SAFEHOLD INC	8,340	8,335	230	33,766	0.0
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	68,320	66,851	1,409	206,421	0.2
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	38,922	33,166	129	18,986	0.0
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	66,258	—	—	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	124,303	120,938	6,052	886,211	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	164,985	141,856	3,007	440,305	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	28,700	103	15,085	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	0.00002	0.002	0.0

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
PRIME US REIT	295,000	295,000	141	20,731	0.0	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	7,000	106	15,639	0.0	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	5,700	103	15,121	0.0	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	—	31,919	791	115,896	0.1	
CREATIVE MEDIA & COMMUNITY T	13,000	—	—	—	—	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	—	—	—	—	
FARMLAND PARTNERS INC	12,200	22,851	313	45,834	0.1	
CITY OFFICE REIT INC	25,050	25,050	231	33,888	0.0	
ORION OFFICE REIT INC	—	30,374	281	41,268	0.0	
NETSTREIT CORP	20,992	23,831	434	63,676	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	17,000	105	15,506	0.0	
CARETRUST REIT INC	52,477	45,932	863	126,495	0.1	
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	2,340	124	18,226	0.0	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	—	55,243	1,653	242,077	0.3	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	1,856	40	5,951	0.0	
APARTMENT INCOME REIT CO	87,139	72,989	2,616	383,104	0.5	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	81,949	1,371	200,729	0.2	
CTO REALTY GROWTH INC	2,800	8,400	165	24,191	0.0	
CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	—	—	—	—	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	—	11,597	328	48,051	0.1	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	—	178,800	107	15,706	0.0	
STORE CAPITAL CORP	135,277	125,789	3,968	581,049	0.7	
PARAMOUNT GROUP INC	89,726	80,008	504	73,915	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	33,930	304	44,510	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	59,850	55,595	791	115,908	0.1	
EQUINIX INC	49,977	43,383	25,940	3,798,002	4.5	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	47,668	42,991	664	97,310	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	63,030	54,132	758	111,035	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	12,389	10,806	480	70,277	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	45,310	40,398	1,511	221,326	0.3	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	12,543	11,050	377	55,248	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	115,391	100,761	1,561	228,662	0.3	
GLOBAL NET LEASE INC	57,012	49,084	613	89,829	0.1	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	46	6,872	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	736,564	835,164	296	43,408	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	131,413	106,435	1,227	179,673	0.2	
VICI PROPERTIES INC	338,799	459,464	14,486	2,121,027	2.5	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	19,900	—	—	—	—	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,044	38,562	1,016	148,881	0.2	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	280,893	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,155,365	12,568,769	447,573	65,529,185	
	銘柄 数<比 率>	156	145	—	<77.5%>	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	41,476	30,663	842	91,138	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	45,920	39,175	1,613	174,593	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	81,239	61,841	721	78,019	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	89,131	70,377	1,433	155,113	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	33,942	29,679	743	80,410	0.1	

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)		
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	47,120	—	—	—	—	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	13,820	212	22,998	0.0	
PRIMARIS REIT	—	28,309	423	45,853	0.1	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	11,360	9,047	444	48,122	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	40,330	30,330	277	29,994	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	26,577	407	44,112	0.1	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,090	33,790	387	41,971	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	60,470	48,099	527	57,039	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	12,890	199	21,589	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	8,700	29	3,181	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	58,250	59,149	682	73,855	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	20,000	69	7,530	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	39,728	887	96,073	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,705	15,334	1,141	123,522	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	25,800	154	16,721	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	86,170	76,025	1,037	112,283	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	11,100	147	16,009	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	27,730	430	46,535	0.1	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	—	—	—	—	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	23,900	71	7,757	0.0	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	—	16,000	93	10,162	0.0	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	—	9,500	175	18,985	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	57,505	49,695	826	89,419	0.1	
SLATE GROCERY REIT	10,300	17,300	261	28,265	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	9,000	16,015	154	16,704	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	17,000	78	8,461	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	12,000	139	15,100	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	29,850	21,900	355	38,481	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,026,375	901,473	14,972	1,620,008	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 1.9% >	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	37,000	37,000	271	39,775	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	99,700	7,200	59	8,732	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	136,700	44,200	330	48,508	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	104	15,288	0.0	
COIMA RES SPA	11,900	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	45,690	33,790	104	15,288	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	18,140	15,570	599	87,868	0.1	
ALTAREA	1,880	2,480	320	46,992	0.1	
KLEPIERRE	107,485	92,974	1,914	280,756	0.3	
GECINA SA	30,292	25,736	2,380	349,135	0.4	
COVIVIO(FP)	26,753	21,972	1,238	181,583	0.2	
MERCIALYS	28,000	36,384	330	48,531	0.1	
CARMILA	25,000	26,392	359	52,795	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当期			比率 (%)
	口数 (口)	口数 (口)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	65,171	49,378	2,391	350,791	0.4	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	302,721 8	270,886 8	9,535 -	1,398,455 <1.7%>	
(オランダ)			千ユーロ			
VASTNED RETAIL	10,650	10,650	222	32,566	0.0	
WERELDHAVE NV	22,670	22,670	294	43,188	0.1	
NSI NV	10,050	10,050	253	37,143	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	20,783	17,493	392	57,570	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	64,153 4	60,863 4	1,162 -	170,468 <0.2%>	
(スペイン)			千ユーロ			
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	143,462	141,272	774	113,539	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI	34,000	34,000	133	19,646	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	187,486	157,888	1,375	201,687	0.2	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	364,948 3	333,160 3	2,283 -	334,873 <0.4%>	
(ベルギー)			千ユーロ			
BEFIMMO S. C. A.	14,010	-	-	-	-	
COFINIMMO	15,767	14,199	1,243	182,316	0.2	
RETAIL ESTATES	6,400	5,335	322	47,337	0.1	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	12,100	258	37,887	0.0	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	77,922	66,064	1,758	257,919	0.3	
MONTEA NV	5,300	4,970	330	48,471	0.1	
AEDIFICA	19,919	18,867	1,502	220,394	0.3	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	15,000	241	35,374	0.0	
XIOR STUDENT HOUSING NV	10,440	9,813	292	42,959	0.1	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	176,858 9	146,348 8	5,950 -	872,660 <1.0%>	
(アイルランド)			千ユーロ			
HIBERNIA REIT PLC	365,550	-	-	-	-	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	210,000	234	34,371	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	625,550 2	210,000 1	234 -	34,371 <0.0%>	
(その他)			千ユーロ			
CROMWELL REIT EUR	160,000	170,400	260	38,236	0.0	
小計	口数・金額 銘柄数<比率>	160,000 1	170,400 1	260 -	38,236 <0.0%>	
ユーロ計	口数・金額 銘柄数<比率>	1,876,620 31	1,269,647 28	19,861 -	2,912,862 <3.4%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	528,668	446,042	1,703	283,644	0.3	
DERWENT LONDON PLC	62,782	53,156	1,232	205,117	0.2	
BIG YELLOW GROUP PLC	97,046	82,773	922	153,638	0.2	
HAMMERSON PLC	2,291,000	1,673,646	379	63,161	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	70,347	65,316	284	47,428	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,543	0.0	
UNITE GROUP PLC	220,572	190,394	1,724	287,155	0.3	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	728,888	630,955	721	120,055	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SHAFTESBURY PLC	157,193	139,823	525	87,519	0.1	
SEGR0 PLC	669,364	572,354	4,527	753,662	0.9	
LAND SECURITIES GROUP PLC	411,457	355,654	2,126	354,050	0.4	
ASSURA PLC	1,467,040	1,400,809	776	129,305	0.2	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	260,756	137	22,919	0.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	141,780	109,600	577	96,060	0.1	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	350,000	161	26,801	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	268,000	231	38,591	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	490,000	405,972	254	42,374	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	116,037	98,896	893	148,745	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	497,660	464,236	851	141,734	0.2	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	435,000	378,400	347	57,826	0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	470,297	354,157	386	64,262	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	258,000	—	—	—	—	
WAREHOUSE REIT PLC	—	230,000	277	46,252	0.1	
NEWRIVER REIT PL	186,000	126,000	88	14,766	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	330,067	204	34,121	0.0	
PRS REIT PLC/THE	255,000	260,002	223	37,222	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	203,286	138	23,011	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	466,000	589,189	606	101,024	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	941,704	888,708	1,245	207,416	0.2	
CUSTODIAN REIT PLC	234,276	234,276	204	34,046	0.0	
HOME REIT PLC	132,934	374,236	309	51,521	0.1	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	306,000	269	44,877	0.1	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	—	110,000	69	11,572	0.0	
AEW UK REIT PLC	118,000	68,000	60	10,154	0.0	
LXI REIT PLC	391,008	811,588	983	163,747	0.2	
REGIONAL REIT LTD	222,000	222,000	139	23,171	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	—	223,421	320	53,371	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	177,355	229,355	238	39,631	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,539,477	14,029,027	24,157	4,021,509	
	銘 柄 数 < 比 率 >	35	37	—	< 4.8% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST	262,160	228,066	909	85,656	0.1	
MIRVAC GROUP	2,190,726	1,867,868	3,922	369,227	0.4	
CROMWELL PROPERTY GROUP	862,633	669,440	468	44,110	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	296,160	244,874	981	92,430	0.1	
GPT GROUP	1,081,455	906,785	3,899	367,029	0.4	
CENTURIA CAPITAL GROUP	356,300	274,928	467	43,994	0.1	
ABACUS PROPERTY GROUP	232,716	194,329	522	49,205	0.1	
STOCKLAND	1,326,376	1,130,026	4,034	379,738	0.4	
DEXUS	596,428	509,145	3,956	372,383	0.4	
GOODMAN GROUP	939,643	804,776	13,785	1,297,658	1.5	
VICINITY CENTERS	2,156,333	1,831,690	3,562	335,351	0.4	
CHARTER HALL GROUP	259,369	223,905	2,944	277,151	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	166,760	138,810	445	41,942	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	156,788	173,646	694	65,381	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	585,060	528,421	1,395	131,314	0.2	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
ARENA REIT	201,053	161,278	624	58,750	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	301,606	255,476	745	70,220	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	320,312	286,964	1,228	115,611	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	113,000	301	28,399	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	601,340	473,590	1,155	108,772	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	82,885	117,885	365	34,399	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	324,500	324,500	251	23,672	0.0	
HOME CONSORTIUM	107,500	—	—	—	—	
RURAL FUNDS GROUP	191,095	181,331	444	41,818	0.0	
IRONGATE GROUP	272,000	—	—	—	—	
SCENTRE GROUP	2,883,991	2,456,991	7,125	670,702	0.8	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	190,640	140	13,189	0.0	
HOME CONSORTIUM LTD	—	92,191	433	40,786	0.0	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	189,350	157,784	525	49,457	0.1	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	268,642	734,103	924	87,067	0.1	
HEALTHCO REIT	—	137,130	193	18,200	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	240,945	240,945	371	34,927	0.0	
AVENTUS GROUP	233,500	—	—	—	—	
WAYPOINT REIT LTD	390,099	336,956	923	86,906	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	18,190,725	15,987,473	57,744	5,435,457	
	銘 柄 数<比 率>	31	31	—	<6.4%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AMP NZ OFFICE LTD	682,894	556,295	667	57,529	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	223,349	181,387	426	36,735	0.0	
GOODMAN PROPERTY TRUST	600,300	498,199	1,021	88,016	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	858,490	743,753	639	55,123	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	502,278	417,278	488	42,074	0.0	
STRIDE PROPERTY GROUP	—	300,000	465	40,073	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,867,311	2,696,912	3,707	319,552	
	銘 柄 数<比 率>	5	6	—	<0.4%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT	1,163,400	997,800	49,690	926,726	1.1	
PROSPERITY REIT	752,000	752,000	1,210	22,579	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	818,000	1,315,660	2,039	38,032	0.0	
CHAMPION REIT	1,138,000	745,000	1,840	34,318	0.0	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	561,000	1,525	28,458	0.0	
FORTUNE REIT	756,000	605,000	3,121	58,221	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,188,400	4,976,460	59,428	1,108,337	
	銘 柄 数<比 率>	6	6	—	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,805,044	2,383,544	4,528	473,071	0.6	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,847,318	1,581,818	4,096	427,963	0.5	
SUNTEC REIT	1,180,700	1,060,900	1,410	147,392	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,580,700	1,523,285	2,284	238,683	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	859,400	849,400	437	45,695	0.1	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	991,877	847,977	809	84,593	0.1	
KEPPEL REIT	1,051,400	936,300	833	87,047	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	634,262	469,862	916	95,709	0.1	

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
ESR-LOGOS REIT	1,448,995	2,418,564	846	88,425	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	397,900	485	50,708	0.1	
CAPITALAND CHINA TRUST	507,721	553,921	545	56,994	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	538,100	137	14,333	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	275,000	335	35,046	0.0	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	225,500	163,200	660	69,043	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,088,963	941,863	2,053	214,483	0.3	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,241,473	1,090,073	1,722	179,913	0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	744,977	—	—	—	—	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,222,100	—	—	—	—	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	540,000	326	34,127	0.0	
SPH REIT	576,800	409,600	352	36,796	0.0	
EC WORLD REIT	180,000	180,000	79	8,273	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	295,800	211	22,092	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	1,273,644	407	42,574	0.1	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	883,950	592	61,866	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	—	328,400	188	19,725	0.0	
IREIT GLOBAL	405,985	—	—	—	—	
KEPPEL DC REIT	709,903	626,303	1,102	115,145	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,610,096	1,364,796	1,514	158,248	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	24,807,958	21,934,200	26,880	2,807,955	
	銘 柄 数<比 率>	27	25	—	<3.3%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	42,950	172,659	18,543	0.0	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	—	13,200	68,508	7,357	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	36,380	251,022	26,959	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	11,253	49,794	5,347	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	72,480	72,480	256,216	27,517	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	25,433	119,153	12,797	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	—	14,201	52,543	5,643	0.0	
JR REIT XXVII	64,338	76,683	313,633	33,684	0.0	
SK REITS CO LTD	—	39,229	177,707	19,085	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	81,340	299,737	32,191	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	—	28,240	90,509	9,720	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	—	14,949	46,117	4,953	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	284,799	456,338	1,897,603	203,802	
	銘 柄 数<比 率>	7	12	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD	103,500	103,500	1,857	76,520	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	—	115,000	1,003	41,336	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	—	360,000	617	25,444	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	103,500	578,500	3,479	143,301	
	銘 柄 数<比 率>	1	3	—	<0.2%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	83,040,530	75,398,799	—	84,101,972	
	銘 柄 数<比 率>	329	324	—	<99.5%>	

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

(注2) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) < >内は、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 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 84,101,972	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	582,428	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	84,684,400	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(84,571,382千円)の投資信託財産総額(84,684,400千円)に対する比率は99.9%です。

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

1米ドル=146.41円	1カナダドル=108.20円	1ユーロ=146.66円
1イギリスポンド=166.47円	1オーストラリアドル=94.13円	1ニュージーランドドル=86.18円
1香港ドル=18.65円	1シンガポールドル=104.46円	1韓国ウォン=0.1074円
1イスラエルシェケル=41.1882円		

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年11月10日現在
(A)資 産	84,722,360,456円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	477,664,615
投 資 証 券(評価額)	84,101,972,004
未 収 入 金	40,041,724
未 収 配 当 金	102,682,113
(B)負 債	161,738,022
未 払 金	38,047,396
未 払 解 約 金	123,690,371
未 払 利 息	255
(C)純 資 産 総 額(A-B)	84,560,622,434
元 本	34,643,734,497
次 期 繰 越 損 益 金	49,916,887,937
(D)受 益 権 総 口 数	34,643,734,497口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,409円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年11月11日 至 2022年11月10日
(A)配 当 等 収 益	3,906,329,222円
受 取 配 当 金	3,905,347,679
受 取 利 息	1,076,690
そ の 他 収 益 金	103,158
支 払 利 息	△198,305
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,952,673,169
売 買 益	27,077,667,393
売 買 損	△32,030,340,562
(C)そ の 他 費 用	△43,448,050
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,089,791,997
(E)前 期 繰 越 損 益 金	60,773,417,444
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	12,865,843,146
(G)解 約 差 損 益 金	△22,632,580,656
(H)計 (D+E+F+G)	49,916,887,937
次 期 繰 越 損 益 金(H)	49,916,887,937

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は41,344,855,558円、期中追加設定元本額は8,500,047,775円、期中一部解約元本額は15,201,168,836円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	12,962,660,028円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,484,411,624円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,690,527,564円
分散投資コア戦略ファンドS	1,470,010,390円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,166,221,268円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,112,545,906円
分散投資コア戦略ファンドA	663,634,730円
コア投資戦略ファンド(切替型)	489,201,341円
コア投資戦略ファンド(安定型)	387,769,767円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	345,064,516円
グローバル経済コア	237,997,812円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	207,210,041円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	192,567,868円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	149,051,071円
SMT インデックスバランス・オープン	132,826,142円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	100,614,514円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	97,458,043円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	96,415,726円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	94,091,235円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	92,238,456円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	91,762,324円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	78,211,546円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	63,337,930円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	60,705,130円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	59,528,635円
グローバル3資産バランスオープン	58,177,468円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	34,531,715円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	12,431,078円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	7,192,112円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,334,542円
10資産分散投資ファンド	3,975円

## お知らせ

該当事項はありません。