

## 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2014年11月28日から無期限です。	
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	SMT インデックス バランス・オープン 国内株式インデックス マザーファンド	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。 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。
	外国株式インデックス マザーファンド	原則として、MSCIロコサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）を構成している国の株式を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックス マザーファンド	取引所に上場されている新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
	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。
	外国債券インデックス マザーファンド	日本を除く世界的主要国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックス マザーファンド	新興国の債券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。
	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。
	新興国REITインデックス マザーファンド	新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）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	SMT インデックス バランス・オープン
国内株式インデックス マザーファンド		株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
外国株式インデックス マザーファンド		株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
新興国株式インデックス マザーファンド		株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
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。
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。
新興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。
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。
新興国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。
分配方針	年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。	

# SMT インデックスバランス・オープン

## 運用報告書（全体版）

第20期（決算日 2024年10月21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期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	円	%										
第16期(2022年10月20日)	13,327	0	△4.5	38.3	1.5	37.3	0.3	20.9	百万円	2,684			
第17期(2023年4月20日)	13,549	0	1.7	39.0	0.9	38.7	0.1	19.4	2,616				
第18期(2023年10月20日)	14,410	0	6.4	39.4	1.6	38.3	0.1	18.7	2,682				
第19期(2024年4月22日)	16,189	0	12.3	40.3	1.3	37.3	0.1	18.9	2,859				
第20期(2024年10月21日)	17,450	0	7.8	40.9	1.4	35.7	0.1	20.1	2,931				

(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」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」です。

## 当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	%									
(当期首) 2024年4月22日	16,189	—	40.3	1.3	37.3	0.1	18.9				
4月末	16,719	3.3	40.8	1.4	36.7	0.2	18.9				
5月末	16,866	4.2	40.6	1.7	36.6	0.2	18.7				
6月末	17,498	8.1	41.0	1.7	36.4	0.2	18.9				
7月末	16,904	4.4	40.1	1.7	36.6	0.2	19.5				
8月末	16,603	2.6	40.0	1.8	36.4	0.2	19.7				
9月末	16,920	4.5	40.7	1.3	35.9	0.2	20.1				
(当期末) 2024年10月21日	17,450	7.8	40.9	1.4	35.7	0.1	20.1				

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

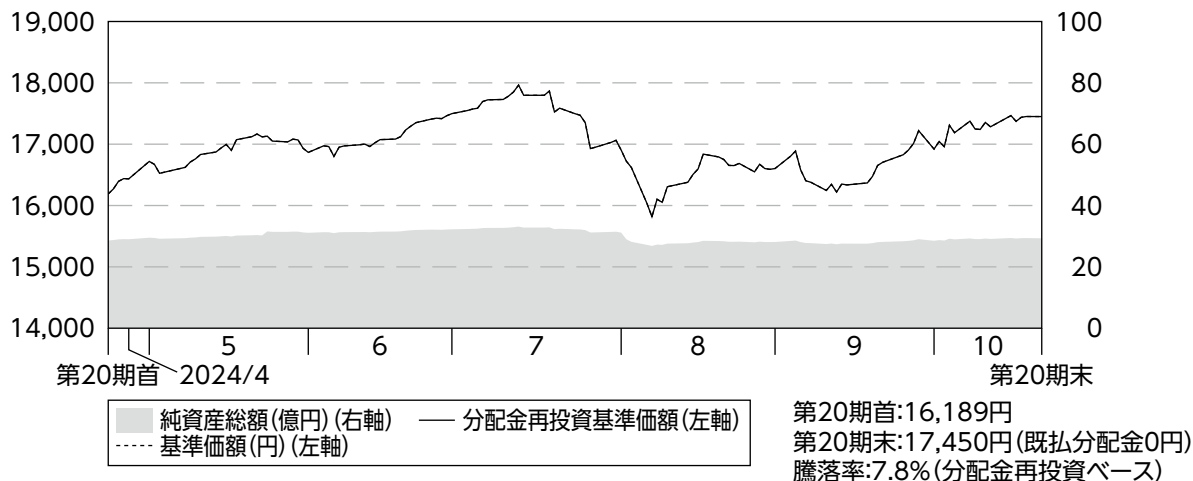
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

(注3) 株式先物比率、債券先物比率は「買建比率－売建比率」です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2024年4月22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

当期の基準価額は上昇しました。懸念されていた物価指標の伸びが鈍化する中、多くの国がインフレ抑制を目的とした金融引き締めから利下げ方針へ転じたこと、米国経済の軟着陸やAI(人工知能)市場の成長に対する期待がそれぞれプラスに寄与しました。特に、海外の株式やREITの上昇幅が顕著でした。

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
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	4.0%	4.4%	1.8%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	22.0%	24.0%	12.9%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	14.0%	14.3%	12.7%
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	4.0%	2.9%	△0.5%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	22.0%	20.1%	2.1%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	14.0%	13.4%	2.4%
J-REITインデックス マザーファンド	国内REIT	2.0%	1.5%	△3.7%
グローバルREITインデックス マザーファンド	先進国REIT	11.0%	11.7%	20.0%
新興国REITインデックス マザーファンド	新興国REIT	7.0%	6.6%	6.7%

※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

### 国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。

期を通じて、国内企業の好調な業績やさらなる資本効率の改善期待が下支え要因となりました。2024年8月上旬には、日銀の利上げや円高・米ドル安の進行、米国景気の先行き不安から大きく下落する場面もありましたが、速やかに持ち直しました。

### 先進国株式市場

先進国株式市場は上昇しました。

前半は、主要国の大半で利下げが実施されたことや、生成AI市場の成長期待などを背景に上昇しました。後半は、2024年8月上旬に、米国景気の先行き不安や投資対象通貨の下落から大きく下落しましたが、その後は速やかに持ち直しました。

### 新興国株式市場

新興国株式市場は上昇しました。

大規模な金融緩和策や株式支援策が公表された中国、AI市場の成長の恩恵を受ける台湾を中心に、多数の国の株式が上昇しました。

### 国内債券市場

国内債券市場は下落しました。

前半は、日銀の利上げなど金融正常化の動きにより、利回りが上昇(価格は下落)しました。後半は、国内株式の急落で今後の利上げが難しいとの見方が広がり、利回りが低下(価格は上昇)したものの、通期では利回り上昇となりました。

### 先進国債券市場

先進国債券市場は上昇しました。

物価指標の伸びの鈍化傾向を背景に、主要国の中央銀行による利下げが実施されたことなどから、主要国の国債利回りは低下しました。

## 投資環境

---

### 新興国債券市場

新興国債券市場は上昇しました。

相対的に高い利回りを享受したことや、インフレの鈍化を背景に南アフリカをはじめとする多くの国で利下げが実施されたことがプラスに寄与しました。

### 国内REIT市場

国内REIT市場は下落しました。

インカム収益を着実に積み上げましたが、複数銘柄の公募増資を受けて需給悪化懸念が高まったことに加え、日銀が利上げを実施し、今後も利上げを続ける方針を示したことがマイナスに影響しました。

### 先進国REIT市場

先進国REIT市場は上昇しました。

各国で利下げが行われたことや堅調な需給環境により、上昇基調となりました。2024年8月上旬はリスク許容度の低下により下落しましたが、その後は速やかに反発しました。

### 新興国REIT市場

新興国REIT市場は上昇しました。

総じてリスクオンの展開となったこと、南アフリカをはじめ多くの国で利下げが実施され、長期金利が低下したこと、新首相が選定されたタイなどで政治的不透明感が和らいだことがプラスに寄与しました。

### ○当ファンド

国内および先進国ならびに新興国の株式・公社債・REITへ実質的に分散投資することにより、投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行いました。各資産への配分は、概ね基本組入比率を維持する運用を行いました。

#### ・国内株式インデックス マザーファンド

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

#### ・新興国株式インデックス マザーファンド

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

#### ・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。

### ・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。

### ・新興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JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの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。

### ・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。組み入れ等に際しては、取引コストに留意しながらリバランスを実施し、REITを高位に組み入れた運用を行いました。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。

### ・新興国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新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行いました。組み入れ等に際しては、取引コストに留意しながらリバランスを実施し、REITを高位に組み入れた運用を行いました。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。



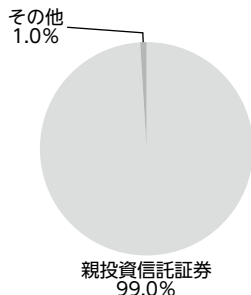
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

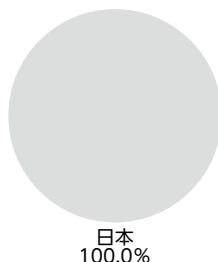
	当期末
	2024年10月21日
外国株式インデックス マザーファンド	24.0%
外国債券インデックス マザーファンド	20.1%
新興国株式インデックス マザーファンド	14.3%
新興国債券インデックス マザーファンド	13.4%
グローバルREITインデックス マザーファンド	11.7%
新興国REITインデックス マザーファンド	6.6%
国内株式インデックス マザーファンド	4.4%
国内債券インデックス マザーファンド	2.9%
J-REITインデックス マザーファンド	1.5%
その他	1.0%
組入ファンド数	9

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

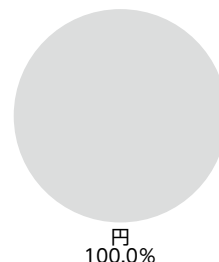
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

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

## 分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第20期	
	2024年4月23日~2024年10月21日	
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	8,315

(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への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券及びREITに実質的に分散投資することでリスクの低減をはかります。

株式、債券及びREITの基本資産配分比率は、原則として株式40%、債券40%、REIT20%とします。

#### ・国内株式インデックス マザーファンド

原則として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)(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。

#### ・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(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。

#### ・新興国株式インデックス マザーファンド

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

#### ・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。

#### ・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。

#### ・新興国債券インデックス マザーファンド

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 今後の運用方針

---

- ・ 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。)J-REIT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REITに投資し、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ベース)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

- ・ 新興国REITインデックス マザーファンド

主として、新興国のREITに投資し、S&P新興国REIT指数(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
	(2024年4月23日~2024年10月21日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	46円	0.274%	(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16,918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)	(19)	(0.110)	
(販売会社)	(23)	(0.137)	
(受託会社)	(5)	(0.027)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(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)	(0.001)	
(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)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(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)	(0.001)	
(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))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	8	0.044	(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)	(7)	(0.041)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	54	0.323	

(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。

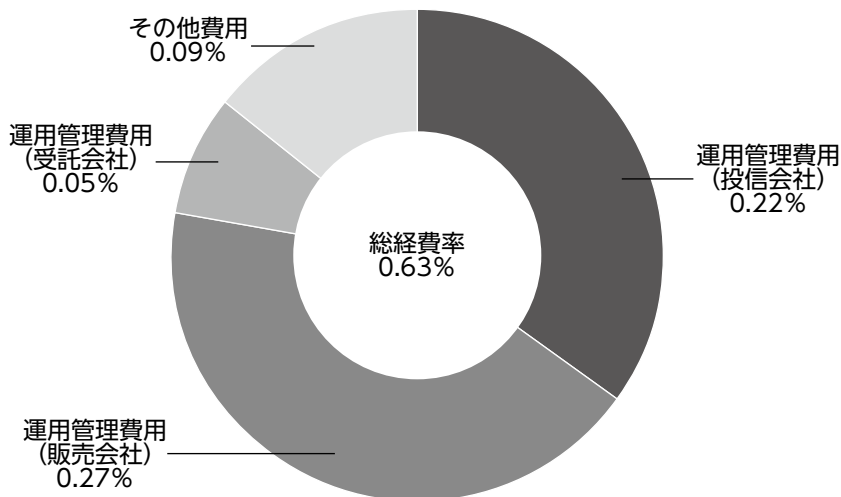
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.63%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		期	
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	1,761	3,670	2,950	6,050
グローバルREITインデックス マザーファンド	6,742	20,250	10,744	33,240
新興国株式インデックス マザーファンド	5,523	25,790	9,424	42,340
国内株式インデックス マザーファンド	2,585	7,340	4,218	12,050
外国株式インデックス マザーファンド	4,857	32,220	13,980	92,630
国内債券インデックス マザーファンド	5,477	7,160	9,033	11,780
外国債券インデックス マザーファンド	10,843	39,510	18,046	64,890
新興国債券インデックス マザーファンド	10,684	25,140	18,202	41,300
新興国REITインデックス マザーファンド	14,307	12,890	24,205	21,180

## 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

#### <新興国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	19,897,570千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	199,709,371千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.09

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

#### <国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	64,939,404千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	665,661,797千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.09

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

#### <外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	28,658,041千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	726,347,139千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.03

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注2) (c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

## 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 3,860	百万円 824	% 21.3	百万円 3,857	百万円 823	% 21.3

(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。

### <J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 541,455	百万円 115,269	% 21.3	百万円 543,272	百万円 115,609	% 21.3

<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。

### <グローバルREITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 14,328	百万円 12,055	% 84.1	百万円 8,606	百万円 7,965	% 92.6
コール・ローン	20,736	4,387	21.2	20,588	4,356	21.2

<平均保有割合 0.3%>

(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。

### <新興国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 32,869	百万円 12,062	% 36.7	百万円 18,996	百万円 2,656	% 14.0
コール・ローン	31,290	6,656	21.3	31,282	6,653	21.3

<平均保有割合 0.2%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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



### <国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 700,305	百万円 148,587	% 21.2	百万円 700,339	百万円 148,532	% 21.2

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <外国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 33,526	百万円 26,677	% 79.6	百万円 19,775	百万円 15,954	% 80.7
コール・ローン	113,213	23,969	21.2	113,113	23,945	21.2

<平均保有割合 0.1%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 182,988	百万円 38,212	% 20.9	百万円 182,750	百万円 38,157	% 20.9

<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			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	38,447	22,774	59.2	39,404	20,736	52.6
為替直物取引	36,458	19,279	52.9	8,776	7,374	84.0
コール・ローン	407,740	86,933	21.3	408,623	87,082	21.3

<平均保有割合 0.2%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <新興国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	18,949	7,540	39.8	19,193	6,450	33.6
為替直物取引	39,277	7,755	19.7	26,001	2,118	8.1
コール・ローン	226,129	48,045	21.2	226,432	48,089	21.2

<平均保有割合 0.3%>

(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。

## <新興国REITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	61	12	19.7	77	40	51.9
コール・ローン	229	48	21.0	230	48	20.9

<平均保有割合 35.6%>

(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		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	149百万円	49百万円	2,117百万円

(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、三井住友トラストグループ株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
J-REITインデックス マザーファンド	23,028千口	21,839千口	44,429千円
グローバルREITインデックス マザーファンド	107,058	103,056	342,188
新興国株式インデックス マザーファンド	91,477	87,576	420,429
国内株式インデックス マザーファンド	47,941	46,307	130,239
外国株式インデックス マザーファンド	110,578	101,455	703,463
国内債券インデックス マザーファンド	69,136	65,579	86,099
外国債券インデックス マザーファンド	170,004	162,801	589,065
新興国債券インデックス マザーファンド	176,629	169,111	392,592
新興国REITインデックス マザーファンド	219,164	209,265	194,512

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

J-REITインデックス マザーファンド	47,285,381千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	41,782,888千口
新興国株式インデックス マザーファンド	47,658,760千口
国内株式インデックス マザーファンド	242,539,964千口
外国株式インデックス マザーファンド	117,351,481千口
国内債券インデックス マザーファンド	511,412,171千口
外国債券インデックス マザーファンド	101,775,665千口
新興国債券インデックス マザーファンド	67,413,337千口
新興国REITインデックス マザーファンド	601,420千口

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J-REITインデックス マザーファンド	44,429	1.5
グローバルREITインデックス マザーファンド	342,188	11.6
新興国株式インデックス マザーファンド	420,429	14.3
国内株式インデックス マザーファンド	130,239	4.4
外国株式インデックス マザーファンド	703,463	23.9
国内債券インデックス マザーファンド	86,099	2.9
外国債券インデックス マザーファンド	589,065	20.0
新興国債券インデックス マザーファンド	392,592	13.3
新興国REITインデックス マザーファンド	194,512	6.6
コール・ローン等、その他	45,048	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,948,064	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、当期末における外貨建純資産(138,746,507千円)の投資信託財産総額(138,911,071千円)に対する比率は99.9%です。

(注2) 新興国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(228,755,014千円)の投資信託財産総額(228,865,142千円)に対する比率は100.0%です。

(注3) 外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(813,659,707千円)の投資信託財産総額(814,079,355千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(366,130,577千円)の投資信託財産総額(368,348,587千円)に対する比率は99.4%です。

(注5) 新興国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(155,211,536千円)の投資信託財産総額(156,549,011千円)に対する比率は99.1%です。

(注6) 新興国REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(559,896千円)の投資信託財産総額(560,361千円)に対する比率は99.9%です。

(注7) 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=149.43円	1カナダドル=108.21円	1メキシコペソ=7.5159円
1ブラジルリアル=26.2383円	1チリペソ=0.156623円	1コロンビアペソ=0.034994円
1ペルー・ソル=39.788円	1ウルグアイペソ=3.5933円	1ドミニカペソ=2.4823円
1ユーロ=162.36円	1イギリスポンド=194.96円	1スイスフラン=172.67円
1スウェーデンクローナ=14.19円	1ノルウェークローネ=13.68円	1デンマーククローネ=21.77円
1トルコリラ=4.3742円	1チェココルナ=6.4325円	1ハンガリーフォリント=0.405531円
1ポーランドズロチ=37.6967円	1ロシアルーブル=1.54円	1ルーマニア・レイ=32.6491円
1オーストラリアドル=100.19円	1ニュージーランドドル=90.78円	1香港ドル=19.23円
1シンガポールドル=114.03円	1マレーシアリングギット=34.6944円	1タイバーツ=4.51円
1フィリピンペソ=2.5983円	1インドネシアルピア=0.0097円	1韓国ウォン=0.1092円
1新台湾ドル=4.6605円	1オフショア人民元=20.9894円	1インドルピー=1.79円
1イスラエルシェケル=40.2109円	1カタールリアル=41.06円	1南アフリカランド=8.48円
1アラブ首長国連邦ディルハム=40.75円	1サウジアラビアリアル=39.85円	1クウェート・ディナール=488.49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 2024年10月21日現在
(A) 資産	2,948,064,817円
コール・ローン等	33,523,831
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	44,429,519
グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	342,188,487
新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	420,429,108
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	130,239,711
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	703,463,775
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	86,099,116
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	589,065,836
新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	392,592,637
新興国REITインデックス マザーファンド(評価額)	194,512,599
未収入金	11,520,000
未収利息	198
(B) 負債	16,511,326
未払解約金	8,233,088
未払信託報酬	8,196,340
その他未払費用	81,898
(C) 純資産総額(A-B)	2,931,553,491
元本	1,679,956,899
次期繰越損益金	1,251,596,592
(D) 受益権総口数	1,679,956,899口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,450円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2024年 4月23日 至 2024年10月21日
(A) 配当等収益	21,559円
受取利息	21,559
(B) 有価証券売買損益	209,739,888
売買益	226,409,238
売買損	△16,669,350
(C) 信託報酬等	△8,278,238
(D) 当期損益金(A+B+C)	201,483,209
(E) 前期繰越損益金	825,674,568
(F) 追加信託差損益金	224,438,815
(配当等相当額)	(369,574,826)
(売買損益相当額)	(△145,136,011)
(G) 計(D+E+F)	1,251,596,592
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,251,596,592
追加信託差損益金	224,438,815
(配当等相当額)	(369,870,174)
(売買損益相当額)	(△145,431,359)
分配準備積立金	1,027,157,777

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,766,633,466円、期中追加設定元本額は128,917,345円、期中一部解約元本額は215,593,912円です。

※分配金の計算過程

項	目	当	期
(A)	配当等収益額(費用控除後)		43,179,989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)		158,303,220円
(C)	収益調整金額		369,870,174円
(D)	分配準備積立金額		825,674,568円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		1,397,027,951円
(F)	期末残存口数		1,679,956,899口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		8,315円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

## お知らせ

品貸料の一部を信託報酬として収受可能とするため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2024年7月23日)

組入れマザーファンドにおいて有価証券の貸付の指図(レンディング取引)を行った場合、実質的に収益として計上される品貸料の一部を信託報酬として委託会社及び受託会社が収受させていただきます。

# 国内株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第24期（決算日 2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
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		株式先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	14,548	4.5	97.0	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	18,273	25.6	98.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	18,688	2.3	98.3	497,213
第23期(2023年5月29日)	21,924	15.5	21,591	15.5	98.5	560,044
第24期(2024年5月29日)	28,463	29.8	28,021	29.8	98.2	664,653

(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		株式先物比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2023年5月29日	21,924	—	21,591	—	98.5
5月末	21,620	△1.4	21,303	△1.3	98.6
6月末	23,253	6.1	22,911	6.1	98.7
7月末	23,600	7.6	23,253	7.7	99.2
8月末	23,701	8.1	23,354	8.2	99.5
9月末	23,825	8.7	23,473	8.7	98.6
10月末	23,113	5.4	22,770	5.5	98.6
11月末	24,363	11.1	24,005	11.2	98.7
12月末	24,310	10.9	23,951	10.9	98.8
2024年1月末	26,208	19.5	25,822	19.6	99.3
2月末	27,498	25.4	27,094	25.5	99.2
3月末	28,717	31.0	28,295	31.1	98.2
4月末	28,461	29.8	28,037	29.9	98.0
(当期末) 2024年5月29日	28,463	29.8	28,021	29.8	98.2

(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）（配当込み）です。

TOPIX（東証株価指数）とは、株式会社JPX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。

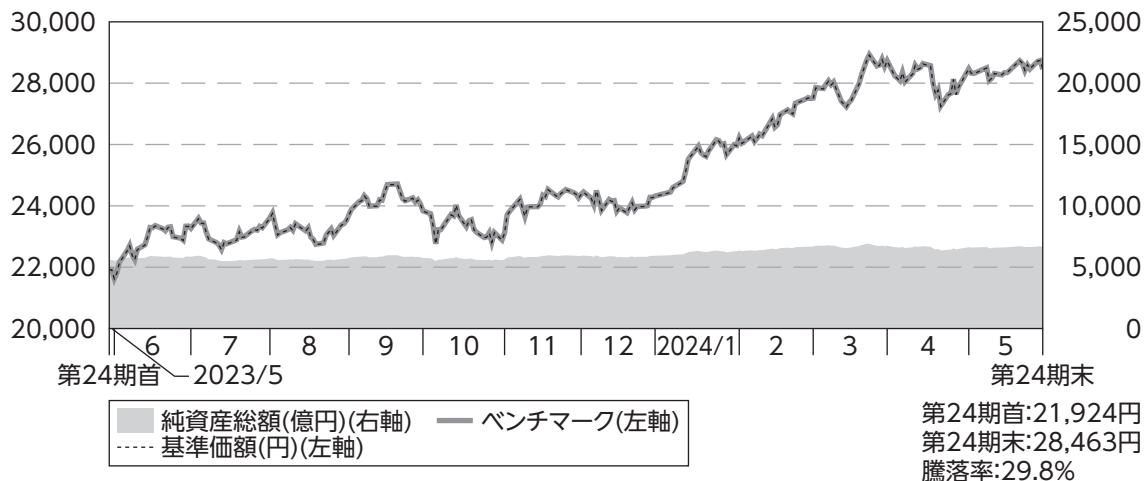
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、配当込みTOPIX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、JPX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JPX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

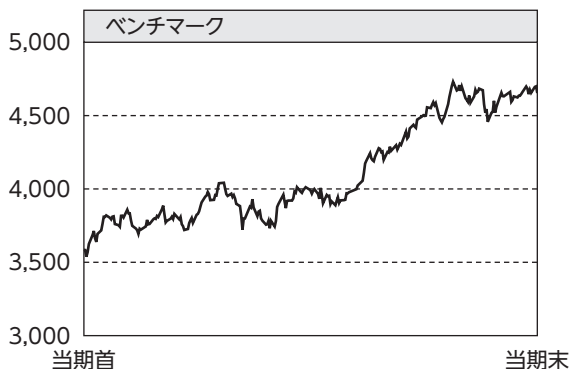


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で上昇しました。

## 投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

期初は、FRB(米連邦準備理事会)が利上げを見送るといった観測や円安・米ドル高が好感されたことを背景に国内株式市場は上昇しましたが、米長期金利上昇や中東情勢の緊迫化による原油高から下落するなど一進一退の展開となりました。その後は、金融緩和の維持により円安・米ドル高が進み、海外からの資金流入が続いたことなどから大幅な上昇となりました。日銀がマイナス金利を解除したものの、緩和的な金融環境を維持するとの見方から国内株式市場は一段高となり、日経平均株価は過去最高値を更新しましたが、高値警戒感が強まる中、米長期金利の上昇を受けてハイテク株を中心に下落したことや中東情勢に対する警戒感などから、期末にかけては上値の重い展開となりました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、ヘッジ目的で、株価指数先物取引を適宜活用しています。

(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、ベンチマークの個別銘柄構成比率に極力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

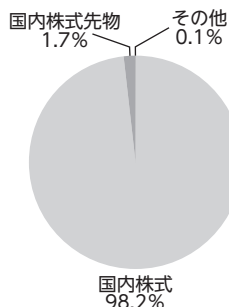
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	4.7%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.5%
3	ソニーグループ	日本	2.2%
4	日立製作所	日本	2.0%
5	東京エレクトロン	日本	1.9%
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.8%

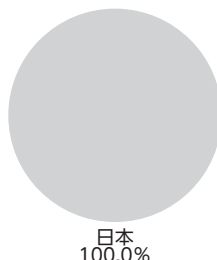
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	キーエンス	日本	1.8%
8	東証株価指数先物 2406	日本	1.7%
9	三菱商事	日本	1.7%
10	三井物産	日本	1.6%
組入銘柄数		2,066	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

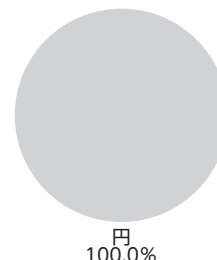
## ○資産別配分



## ○国別配分



## ○通貨別配分

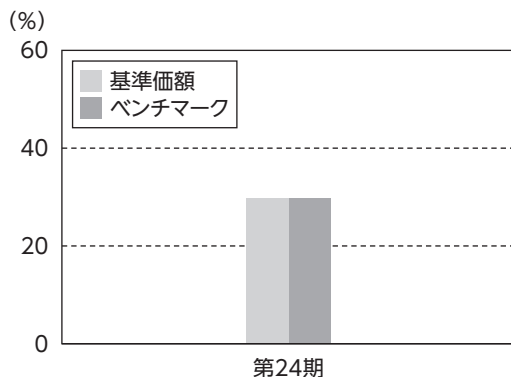


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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1.7%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。

## 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）（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
	(2023年5月30日~2024年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	0  (-)  (-) (0)	0.000  (-)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
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(24,889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 16,352 (82,719)	千円 35,599,639 (12,513)	千株 37,136	千円 79,516,813

(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		証券 — (32,800)	千円 — (—)	証券 — (32,800)	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 83,811	百万円 81,904	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	115,116,452千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	596,954,255千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.19

(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	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 87	百万円 87	100.0	百万円 87	百万円 87	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,043,710	93,646	9.0	1,041,040	93,040	8.9

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## ■利害関係人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	69百万円	195百万円	2,119百万円

(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	当期中(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	9.5	9.8	36,309
ニッスイ	250.3	236.4	205,762
マルハニチロ	37.1	35.1	111,407
雪国まいたけ	21.3	20.1	19,396
カネコ種苗	7.7	6.7	9,500
サカタのタネ	28.5	26.9	89,980
ホクト	22.3	18.9	34,435
ホクリヨウ	2.8	1.3	1,289
<b>鉱業(0.4%)</b>			
住石ホールディングス	30.3	30.1	41,538
日鉄鉱業	10	9.5	49,020
三井松島ホールディングス	11.3	14	64,400
I N P E X	925.6	794	1,932,199
石油資源開発	29	27.4	183,032
K&Oエナジーグループ	11.3	10.7	40,285
<b>建設業(2.0%)</b>			
ショーボンドホールディングス	34.1	32.2	192,266
ミライト・ワン	82.8	71.4	133,196
タマホーム	15.7	14.9	67,348
サンヨーホームズ	2.4	0.9	654
日本アクア	8.1	3.3	2,861
ファーストコーポレーション	5	2.3	1,796
ベステラ	4.2	1.9	1,797
r o b o t h o m e	42.6	—	—
キャンディル	3.5	1.4	837
ダイセキ環境ソリューション	3.9	1.6	1,585
第一カッター興業	6.4	6.8	9,853
安藤・間	145	137	154,262
東急建設	71.3	74.1	56,390
コムシスホールディングス	84.7	75.5	235,258
ビーアールホールディングス	39.7	34.7	12,249
高松コンストラクショングループ	16.3	17.6	49,878
東建コーポレーション	7.2	5.9	62,835
ソネック	2.1	0.8	740
ヤマウラ	12.7	12	15,456
オリエンタル白石	89.9	87.5	31,062
大成建設	163.8	151.5	918,696
大林組	626.1	591.4	1,086,697
清水建設	526.3	468.9	409,302
飛鳥建設	19.3	17	25,109

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
長谷工コーポレーション	180.7	151.7	266,461
松井建設	16.3	15.4	12,073
銭高組	1.7	0.8	3,496
鹿島建設	388.2	366.7	964,237
不動テトラ	12.1	11.4	28,944
大末建設	5	2.2	3,817
鉄建建設	12.6	11.9	30,940
西松建設	29.7	31.5	137,340
三井住友建設	141.2	123.1	47,393
大豊建設	7.2	5.7	19,380
佐田建設	8.7	3.5	2,625
ナカノフドー建設	9.7	3.9	1,969
奥村組	28.4	26.8	130,248
東鉄工業	24.1	20.5	62,320
イチケン	3.1	1.4	3,570
富士ビー・エス	6.1	2.4	1,058
浅沼組	14	12.2	43,920
戸田建設	215.4	223.8	241,144
熊谷組	29.3	27.3	98,553
北野建設	2.6	1	3,600
植木組	3.9	1.6	2,620
矢作建設工業	23.8	22.5	34,290
ピーエス三菱	22.2	21	21,273
日本ハウスホールディングス	34.7	35.3	10,872
新日本建設	24.6	23.2	35,124
東亜道路工業	7	32.9	39,348
日本道路	3.5	19.4	33,853
東亜建設工業	15	51.1	47,625
日本国土開発	52.5	47	22,607
若築建設	7.8	5.7	19,579
東洋建設	56.7	41.7	57,796
五洋建設	248.2	234.5	148,461
世紀東急工業	22.5	21.2	35,340
福田組	6.6	6.2	32,984
住友林業	134.3	142.9	764,086
日本基礎技術	8.2	3.3	1,844
巴コーポレーション	15.2	6.9	5,520
大和ハウス工業	489.2	457.3	1,858,467
ライト工業	32.4	32.9	65,207
積水ハウス	548.4	501.6	1,755,600
日特建設	16.7	15.8	17,079

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)	
北陸電気工事	12	11.3	13,311	
ユアテック	38.6	36.4	58,713	
日本リーテック	15.4	12.9	14,577	
四電工	7.3	6.9	24,460	
中電工	27.2	25.7	82,368	
関電工	95.9	103.6	182,336	
きんでん	123.2	115	372,025	
東京エネシス	17.4	15.4	20,682	
トーエネック	5.8	5.5	27,995	
住友電設	16.7	15.7	54,793	
日本電設工業	28.8	31	60,016	
エクシオグループ	80.6	161.6	257,105	
新日本空調	9.7	10.7	47,026	
九電工	42.6	35.7	232,764	
三機工業	38.8	35.7	76,933	
日揮ホールディングス	173.2	163.6	206,381	
中外炉工業	5.7	5.4	16,983	
ヤマト	11.3	4.6	5,106	
太平電業	10.9	10.3	51,448	
高砂熱学工業	42.2	44.3	286,178	
三晃金属工業	1.7	0.7	3,136	
朝日工業社	7.3	15.4	21,128	
明星工業	30.1	32	40,992	
大気社	20.2	19.1	98,747	
ダイダン	11.5	21.7	71,176	
日比谷総合設備	15	12	36,540	
フィル・カンパニー	3.1	2.6	1,591	
テスホールディングス	18.9	35.6	14,240	
インフロンア・ホールディングス	183.5	190.6	258,548	
東洋エンジニアリング	23.2	24.3	23,157	
レイズネクスト	25.3	23.9	42,064	
<b>食料品(3.1%)</b>				
ニッポン	47.4	49.7	111,974	
日清製粉グループ本社	162.5	153.5	266,015	
日東富士製粉	3.1	3	18,660	
昭和産業	15.3	16.1	50,151	
鳥越製粉	10.9	4.9	3,283	
中部飼料	24.3	23	34,408	
フィード・ワン	25.7	24.3	21,748	
東洋精糖	2.5	1	1,666	
日本甜菜製糖	10.2	9.7	18,837	
DM三井製糖ホールディングス	17.4	16.5	51,810	
塩水港精糖	16.4	7.2	1,987	
ウェルネオシュガー	9.1	8.3	19,173	
森永製菓	32.1	70.7	172,790	

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)	
中村屋	4.4	4.1	13,222	
江崎グリコ	50.3	47.5	187,102	
名糖産業	6.9	6.5	11,700	
井村屋グループ	9.6	9.9	25,066	
不二家	12	11.4	28,283	
山崎製パン	117.6	111.1	371,518	
第一屋製パン	2.6	1	583	
モロゾフ	5.7	5.4	22,653	
亀田製菓	11.2	9.5	37,240	
寿スピリッツ	18.7	78.5	133,293	
カルビー	80.5	76	231,040	
森永乳業	31.9	58	181,308	
六甲バター	12.9	12.2	17,116	
ヤクルト本社	125.6	237.3	672,270	
明治ホールディングス	217.9	203.5	701,871	
雪印メグミルク	42.5	40.2	100,379	
プリマハム	23.6	22.3	51,914	
日本ハム	68.7	71.4	341,720	
林兼産業	4.2	1.8	919	
丸大食品	17.7	16.7	27,404	
S F o o d s	19.4	18.3	51,880	
柿安本店	6.9	6.5	16,438	
伊藤ハム米久ホールディングス	134.3	25.4	104,521	
サッポロホールディングス	57.9	54.7	282,908	
アサヒグループホールディングス	406.1	383.6	2,183,834	
キリンホールディングス	793.1	691.6	1,481,753	
宝ホールディングス	120	111.9	117,439	
オエノンホールディングス	52.5	49.6	17,608	
養命酒製造	5.8	5.5	12,331	
コカ・コーラ ボトラーズ				
ジャパンホールディングス	137.7	130.1	231,187	
ライフドリンク カンパニー	—	3.3	17,490	
サントリー食品インターナショナル	123.8	116.9	664,576	
ダイドーグループホールディングス	10	18.8	47,752	
伊藤園	59.6	56.3	204,763	
キーコーヒー	19.7	18.6	37,665	
ユニカフェ	4.5	1.8	1,639	
ジャパンフーズ	2.1	0.9	1,790	
日清オイリオグループ	24.8	23.4	111,969	
不二製油グループ本社	40.9	38.7	93,905	
かどや製油	1.6	0.7	2,537	
J-オイルミルズ	17.9	19	36,157	
キッコーマン	116.5	550.1	981,653	
味の素	424.4	394.5	2,284,155	
ブルドックソース	9.3	8.8	17,001	



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)
キューピー	94.5	89.2	271,614	
ハウス食品グループ本社	53.8	57.2	164,049	
カゴメ	81.9	71.4	254,255	
焼津水産化学工業	5.4	—	—	
アリアケジャパン	15.3	16.6	84,826	
ピエトロ	2	0.8	1,428	
エバラ食品工業	4.7	4	11,320	
やまみ	1.3	0.8	2,404	
ニチレイ	80.5	76.1	267,034	
東洋水産	88.8	83.9	932,548	
イトアンドホールディングス	7.5	7.9	15,958	
大冷	1.7	0.8	1,528	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11.1	7.6	11,248	
日清食品ホールディングス	61.8	175.1	692,520	
永谷園ホールディングス	8.6	8.1	17,739	
一正蒲鉾	5.9	2.4	1,826	
フジッコ	18.1	17.1	31,327	
ロック・フィールド	19.7	20.3	29,658	
日本たばこ産業	1,157	1,008.9	4,450,257	
ケンコーマヨネーズ	12.1	11.4	20,873	
わらべや日洋ホールディングス	12.9	11.1	25,585	
なとり	11	10.4	21,860	
イフジ産業	2.3	1.1	1,467	
ファーマフーズ	25.2	23.7	20,026	
ユーグレナ	113.6	103.3	56,298	
紀文食品	13.7	14.4	16,718	
ピクルスホールディングス	10.3	9.7	11,242	
ミヨシ油脂	4.8	2.1	2,793	
理研ビタミン	15.2	14.3	36,193	
<b>繊維製品(0.4%)</b>				
片倉工業	16.8	15.8	31,236	
グンゼ	12.8	12.1	62,678	
東洋紡	77.8	73.3	80,043	
ユニチカ	56.5	57.2	12,927	
富士紡ホールディングス	7.2	7.5	34,237	
倉敷紡績	13.6	12.1	54,692	
シキボウ	7.7	10.1	10,867	
日本毛織	47.7	43.6	56,810	
トーア紡コーポレーション	5.4	2.2	952	
帝国繊維	20.5	19.2	44,620	
帝人	172.2	162.5	246,837	
東レ	1,198.7	1,132.2	889,909	
住江織物	3	1.2	3,010	
日本フェルト	9	4	1,848	
イチカワ	2.2	0.9	1,529	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日東製網	1.5	0.6	855	
アツギ	8.6	4	2,532	
ダイニック	3.6	1.8	1,468	
セーレン	34.8	32.8	79,113	
ソトー	4.6	1.9	1,364	
東海染工	1.5	0.6	501	
小松マテーレ	26.2	24.6	17,884	
ワコールホールディングス	34.5	34.6	129,646	
ホギメディカル	24.1	22.3	87,639	
T S I ホールディングス	60.5	55	46,915	
マツオカコーポレーション	3.9	1.8	2,808	
ワールド	23.1	23.9	48,779	
三陽商会	5.3	7.2	17,935	
ナイガイ	5.3	2.1	543	
オンワードホールディングス	116.5	99.7	61,116	
ルックホールディングス	4.1	5	13,425	
ゴールドウイン	31.7	29.9	238,063	
デサント	30.9	29.1	95,593	
キング	6.4	2.2	1,467	
ヤマトインターナショナル	11.7	4.6	1,554	
<b>パルプ・紙(0.1%)</b>				
特種東海製紙	8	9.2	32,660	
王子ホールディングス	744.8	703.6	442,142	
日本製紙	93.1	95.3	89,772	
三菱製紙	16.7	7.6	5,578	
北越コーポレーション	113	83	92,711	
中越パルプ工業	5.6	2.3	3,569	
巴川コーポレーション	4.4	—	—	
大玉製紙	79	74.6	66,259	
阿波製紙	3.3	1.5	726	
レンゴー	162.8	153.8	165,181	
トーモク	10.3	9.8	27,126	
ザ・バック	13.3	12.5	47,500	
<b>化学(5.6%)</b>				
北の達人コーポレーション	75.3	71.2	11,961	
クラレ	284.2	246.1	466,359	
旭化成	1,116.6	1,142.6	1,174,592	
共和レザー	8	3.2	2,480	
巴川コーポレーション	—	1.6	1,548	
レゾナック・ホールディングス	172.8	163.2	565,488	
住友化学	1,326.4	1,253.4	398,455	
住友精化	7.5	7.9	39,579	
日産化学	84.9	78.9	357,732	
ラサ工業	6.9	6.5	19,409	
クレハ	15.3	36.9	106,567	

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)
多木化学	6.9	6.6	25,971	
テイカ	12	14.4	22,809	
石原産業	32.3	28	44,940	
片倉コープアグリ	2.8	1.3	1,487	
日本曹達	19.2	19.9	100,495	
東ソー	238.7	225.5	443,220	
トクヤマ	57.7	54.5	165,680	
セントラル硝子	28.7	18	62,460	
東亜合成	89.7	81.2	123,180	
大阪ソーダ	10.7	11.8	101,244	
関東電化工業	34.6	32.7	28,972	
デンカ	65	61.4	134,865	
信越化学工業	1,486.2	1,514.6	8,919,479	
日本カーバイド工業	5.3	8	14,384	
堺化学工業	13.6	12.9	35,900	
第一稀元素化学工業	16.3	18.5	15,577	
エア・ウォーター	168.7	159.4	357,295	
日本酸素ホールディングス	173.5	163.9	737,550	
日本化学工業	6	6.2	14,570	
東邦アセチレン	2.9	5.9	2,124	
日本バーカライジング	88.5	75.3	89,456	
高压ガス工業	26	24.5	21,805	
チタン工業	1.7	0.7	710	
四国化成ホールディングス	21.2	21.5	42,978	
戸田工業	4.1	3.8	6,916	
ステラ ケミファ	10.6	9.2	39,974	
保土谷化学工業	5.1	5.3	26,500	
日本触媒	27.2	98.4	158,079	
大日精化工業	12.4	11.7	35,919	
カネカ	40.9	42.7	175,667	
三菱瓦斯化学	133.5	123.3	363,796	
三井化学	147.4	139.3	648,998	
J S R	166.9	—	—	
東京応化工業	31.3	80.6	338,842	
大阪有機化学工業	13.5	14.1	49,068	
三菱ケミカルグループ	1,206.6	1,234.7	1,005,416	
KHネオケム	29.8	25.8	57,998	
ダイセル	262.9	217.1	338,133	
住友ベークライト	26.5	47.3	197,714	
積水化学工業	365.7	339.4	760,256	
日本ゼオン	107.2	115.8	165,072	
アイカ工業	45.1	42.6	145,095	
UBE	92.2	80.4	232,637	
積水樹脂	26	25.2	59,824	
タキロンシーアイ	39.1	43.1	30,816	

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)
旭有機材	11.9	11.2	52,304	
ニチバン	11.1	9.2	16,136	
リケンテクノス	38.5	31.7	32,143	
大倉工業	8.3	7.8	22,971	
積水化成成品工業	25.1	23.7	10,546	
群栄化学工業	4.2	4	12,560	
タイガースポリマー	6.3	2.6	2,142	
ミライアル	4.3	1.9	2,922	
ダイキアクシス	5.1	2.3	1,669	
ダイキョーニシカワ	39.5	37.3	25,737	
竹本容器	4.7	2.1	1,776	
森六ホールディングス	9.1	8.8	23,795	
恵和	11.6	12.2	18,043	
日本化薬	136.6	129	160,863	
カーリットホールディングス	16.1	18.2	21,712	
日本精化	10.2	11.2	29,265	
扶桑化学工業	16.6	17.9	70,078	
トリケミカル研究所	23.9	20.5	89,277	
ADEKA	62.3	58.9	188,480	
日油	55.3	152.9	312,068	
新日本理化	19.2	7.7	1,386	
ハリマ化成グループ	9.7	11.8	10,266	
花王	435.4	381.9	2,631,672	
第一工業製薬	6.4	6.7	25,359	
石原ケミカル	8.2	7.6	13,877	
日華化学	5.6	2.2	2,387	
ニイタカ	2.5	1.1	2,060	
三洋化成工業	11	10.4	41,444	
有機合成薬品工業	10.3	4.5	1,381	
大日本塗料	21.8	18.7	22,440	
日本ペイントホールディングス	791.2	896.8	930,878	
関西ペイント	163.8	146	331,712	
神東塗料	11.6	4.7	587	
中国塗料	29.4	34.7	71,169	
日本特殊塗料	8.8	4	5,132	
藤倉化成	24	19.5	10,218	
太陽ホールディングス	27.2	29.4	91,581	
D I C	69.9	66	212,586	
サカタインクス	39.8	37.6	68,319	
artience	35	36.8	123,280	
T&K TOKA	15.9	—	—	
富士フイルムホールディングス	343.5	941.2	3,349,730	
資生堂	373.8	353.1	1,761,615	
ライオン	214.8	215.2	269,645	
高砂香料工業	12.1	12.7	45,783	

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)	
マンダム	38.7	36.5	43,362	
ミルボン	26.5	23	76,475	
ファンケル	78.3	74	143,412	
コーセー	36.4	34.4	334,230	
コタ	16.5	17.1	24,333	
シーボン	1.8	0.8	1,113	
ポーラ・オルビスホールディングス	91.8	86.7	113,663	
ノエビアホールディングス	16	15.1	80,030	
アジュバンホールディングス	3.4	1.4	1,184	
新日本製薬	10.2	9.6	15,840	
I n e	—	4.5	6,579	
アクシージア	9.1	11.1	10,656	
エステー	13.8	13.1	19,938	
アグロ カネショウ	7.2	6.8	7,527	
コニシ	29.9	48.8	59,243	
長谷川香料	34.2	32.3	96,447	
星光PMC	7.1	—	—	
小林製薬	52.1	49.2	265,729	
荒川化学工業	15.2	14.3	15,658	
メック	14.7	13.9	60,117	
日本高純度化学	4.5	3.8	12,445	
タカラバイオ	48.2	45.6	45,736	
J C U	20	18.7	68,068	
新田ゼラチン	8.6	3.8	2,994	
O A Tアグリオ	5.7	6.3	9,387	
デクセリアルズ	51.7	42.2	276,916	
アース製薬	16.2	15.4	71,302	
北興化学工業	18	17	25,721	
大成ラミック	5.6	4.9	13,695	
クミアイ化学工業	71.1	67.2	51,206	
日本農薬	32.8	31	22,382	
アキレス	11.3	10.7	16,980	
有沢製作所	29.1	29.6	44,577	
日東電工	130	108.6	1,316,775	
レック	25.5	21.7	25,714	
三光合成	22.5	21.3	14,398	
きもと	20.5	9.3	1,962	
藤森工業	14.1	13.4	56,682	
前澤化成工業	11.6	10.9	19,707	
未来工業	6.4	6.1	24,217	
ウェーブブロックホールディングス	4.2	2.1	1,325	
J S P	12.6	11.9	25,501	
エフピコ	33.9	32	77,184	
天馬	15.2	12.3	30,085	
信越ポリマー	33.1	36.5	54,458	

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)	
東リ	31.2	12.4	4,873	
ニフコ	64.6	50.6	178,365	
バルカー	15	14.1	51,324	
ユニ・チャーム	373	352.3	1,734,020	
ショーエイコーポレーション	4	1.8	1,054	
<b>医薬品(4.3%)</b>				
協和キリン	216.3	204.3	522,803	
武田薬品工業	1,584.3	1,496.7	6,155,927	
アステラス製薬	1,691.2	1,483.4	2,277,760	
住友ファーマ	132.8	125.4	35,739	
塩野義製薬	225.7	213.2	1,490,268	
わかもと製薬	13	5.9	1,492	
日本新薬	42.2	44.3	123,552	
中外製薬	560.4	529.4	2,479,709	
科研製薬	30.7	29	104,951	
エーザイ	217.8	205.7	1,371,196	
ロート製薬	173.4	163.8	438,410	
小野薬品工業	345.4	345.9	762,363	
久光製薬	39.8	37.6	138,067	
持田製薬	20.6	19.3	56,452	
参天製薬	326.2	298.4	481,766	
扶桑薬品工業	5.7	6	13,452	
日本ケミファ	1.4	0.6	937	
ツムラ	56.4	53.2	200,510	
キッセイ薬品工業	27.7	28	84,980	
生化学工業	34.1	28.7	22,242	
栄研化学	29.1	30.3	62,448	
鳥居薬品	9.6	9.1	33,351	
J C Rファーマ	60.6	57.2	30,659	
東和薬品	27.5	26	74,412	
富士製薬工業	13.2	12.5	18,212	
ゼリア新薬工業	24.8	23.4	45,372	
ネクスセラファーマ	61.5	74	103,082	
第一三共	1,559.6	1,473.3	8,032,431	
杏林製薬	38.8	36.7	62,500	
大幸薬品	32.5	35.1	12,706	
ダイト	12.5	12.9	28,457	
大塚ホールディングス	409.6	351.7	2,146,073	
大正製薬ホールディングス	39.8	—	—	
ペプチドリーム	86.8	82	161,499	
セルソース	—	6.2	8,035	
あすか製薬ホールディングス	18.4	17.3	40,187	
サワイグループホールディングス	40.9	38.7	224,073	
<b>石油・石炭製品(0.5%)</b>				
日本コークス工業	161.5	171.6	22,651	

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)
ニチレキ	21.2	22	53,658			
ユシロ化学工業	9.3	8.8	14,625			
ビービー・カストロール	5.4	2.2	2,145			
富士石油	36.5	49.3	24,699			
MORESCO	4.5	2	2,742			
出光興産	198.8	878.1	910,589			
ENEOSホールディングス	3,036.7	2,677.3	2,142,375			
コスモエネルギーホールディングス	70.8	50.1	381,812			
<b>ゴム製品(0.7%)</b>						
横浜ゴム	101.9	85.5	335,331			
TOYO TIRE	102.9	97.2	259,815			
ブリヂストン	571.7	495	3,369,960			
住友ゴム工業	175.6	165.9	286,343			
藤倉コンポジット	9.9	14.6	19,578			
オカモト	9.9	8	37,520			
フコク	9.4	8.9	18,351			
ニッタ	18.2	17.2	69,574			
住友理工	34.7	26.2	32,592			
三ツ星ベルト	26.1	19.6	85,064			
バンドー化学	28.4	25.1	45,029			
<b>ガラス・土石製品(0.7%)</b>						
日東紡績	20.3	21.4	154,722			
AGC	182.2	150.8	818,391			
日本板硝子	91.3	80.7	36,879			
石塚硝子	2.3	1	2,860			
日本山村硝子	5.4	2.2	3,764			
日本電気硝子	73.2	69.1	248,967			
オハラ	8.7	8.1	10,635			
住友大阪セメント	25.3	28.2	108,823			
太平洋セメント	114.1	100	392,700			
日本ヒューム	16	14.9	15,823			
日本コンクリート工業	35.4	33	11,715			
三谷セキサン	7.5	7.1	36,423			
アジアパイルホールディングス	28.3	24.1	23,401			
東海カーボン	150.3	156.1	153,571			
日本カーボン	10.3	9	49,230			
東洋炭素	11.3	11.9	81,872			
ノリタケカンパニーリミテド	9	18.7	73,023			
TOTO	118.2	111.6	429,771			
日本碍子	208.3	196.7	409,824			
日本特殊陶業	136.4	141.6	656,316			
MARUWA	6.6	6.2	223,200			
品川リフラクトリーズ	5.1	20.9	40,566			
黒崎播磨	3.7	13.8	41,303			
ヨータイ	12.1	10.5	18,532			

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)
東京窯業	13.4	6.2	2,672			
ニッカトー	6.6	2.7	1,514			
フジミネコーポレーテッド	14.3	45.5	136,500			
クミニネ工業	4.3	1.7	1,929			
エーアンドエーマテリアル	2.7	1.2	1,693			
ニチアス	45.3	42.8	199,662			
ニチハ	22.5	21.2	73,988			
<b>鉄鋼(0.9%)</b>						
日本製鉄	824.7	779.2	2,609,540			
神戸製鋼所	370.4	349.9	696,825			
中山製鋼所	38	39.8	37,690			
合同製鐵	9.2	9.7	50,537			
JFEホールディングス	492.2	483.9	1,114,179			
東京製鐵	51.8	48.9	77,115			
共英製鋼	21	19.8	41,778			
大和工業	30.4	32.8	270,403			
東京製鋼	8.8	7.7	38,346			
大阪製鐵	8.5	8	18,680			
淀川製鋼所	20.9	19.8	109,890			
中部鋼板	15.1	11.4	31,042			
丸一鋼管	56.1	53	197,425			
モリ工業	3.3	3.8	19,684			
大同特殊鋼	23.2	109.6	172,291			
日本高周波鋼業	5	2.3	1,014			
日本冶金工業	13.5	12.7	61,277			
山陽特殊製鋼	18.2	17.2	37,186			
愛知製鋼	10.6	10	36,450			
日本金属	3.1	1.5	1,143			
大平洋金属	13.1	14.8	18,840			
新日本電工	117.9	86.6	24,334			
栗本鐵工所	8.8	8.1	38,961			
虹技	1.8	0.8	932			
三菱製鋼	11.6	12.9	19,195			
日亜鋼業	14.7	5.9	1,805			
日本精線	2.5	13.8	17,553			
エンビプロ・ホールディングス	9.9	15	7,485			
シンニッタン	15.6	7.3	1,686			
新家工業	3.1	1.3	6,422			
<b>非鉄金属(0.8%)</b>						
大紀アルミニウム工業所	26.3	22	28,490			
日本軽金属ホールディングス	49.7	50.8	96,012			
三井金属鉱業	53.6	50.6	259,578			
東邦亜鉛	10.9	—	—			
三菱マテリアル	122.9	124.4	382,903			
住友金属鉱山	213.6	201.7	1,042,183			

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
DOWAホールディングス	41.4	43	250,475
古河機械金属	27.1	23	44,160
大阪チタニウムテクノロジーズ	27.1	30.2	83,110
東邦チタニウム	33.4	36	44,172
UACJ	25.8	24.4	107,970
CKサンエツ	4.5	4.2	15,477
古河電気工業	61.4	57.9	247,175
住友電気工業	636	650.8	1,665,397
フジクラ	197.6	205.2	672,645
SWCC	20.6	19.4	92,053
タツタ電線	37.6	31.9	22,808
カナレ電気	2.3	1	1,555
平河ヒューテック	10.7	11.1	14,940
リョービ	19.7	18.5	45,750
アーレスティ	16	6.3	4,328
AREホールディングス	74.5	65.4	132,042
<b>金属製品(0.5%)</b>			
稲葉製作所	9.6	9.7	18,032
宮地エンジニアリンググループ	5.1	8.7	38,584
トーカロ	50.6	50.2	97,588
アルファコ	5.2	2.1	2,851
SUMCO	350.6	309.1	729,476
川田テクノロジーズ	4.3	12.3	33,173
RS Technologies	12.3	11.6	35,728
ジェイテックコーポレーション	1.9	1	1,727
信和	7.9	3.7	2,723
東洋製罐グループホールディングス	121.9	99.8	257,583
ホッカンホールディングス	9.9	8.5	13,846
コロナ	10.3	9.7	8,836
横河ブリッジホールディングス	23.1	27.2	73,440
駒井ハルテック	2.3	1	1,789
高田機工	1.2	0.4	1,428
三和ホールディングス	169.6	174.8	501,763
文化シャッター	53	45.5	79,261
三協立山	21.1	21.9	18,417
アルインコ	14	13.3	14,364
東洋シャッター	3.3	1.3	1,151
LIXIL	268.3	271.7	461,890
日本フィルコン	9.3	3.8	2,059
ノーリツ	27.1	27.6	47,941
長府製作所	18.6	17.3	37,748
リンナイ	100.2	83.2	308,921
ダイニチ工業	7.1	2.9	1,945
日東精工	26.7	25.2	14,641
三洋工業	1.6	0.7	2,138

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
岡部	29.6	31.1	23,915
ジーテクト	20.5	22.2	42,468
東ブレ	32.5	30.7	68,092
高周波熱錬	28.4	25.8	27,864
東京製網	10.9	11.3	14,690
サンコール	12.7	17.1	7,524
モリテック スチール	10.5	5.1	1,183
パイオラックス	25.4	21.6	47,757
エイチワン	19	17.9	15,197
日本発條	162.9	153.9	267,093
中央発條	13.6	12.9	12,912
アドバネクス	1.7	0.7	756
立川ブラインド工業	8.3	7.9	10,625
三益半導体工業	14.2	15.7	58,011
<b>機械(5.6%)</b>			
日本ドライケミカル	3.4	1.4	3,642
日本製鋼所	49.7	46.9	222,446
三浦工業	75.3	71.1	214,295
タクマ	55.5	57.6	95,961
ツガミ	40.2	37.9	54,765
オークマ	18	14.9	100,694
芝浦機械	18	17	57,800
アマダ	287.8	258.1	456,191
アイダエンジニアリング	37.2	39.5	34,997
TAKISAWA	3.8	—	—
FUJI	78.4	80.2	199,938
牧野フライス製作所	20	18.8	123,328
オーエスジー	86.1	75.1	145,956
ダイジェット工業	1.6	0.6	501
旭ダイヤモンド工業	50.5	39.3	34,308
DMG森精機	109.4	105.7	475,544
ソディック	49.8	41.5	29,548
ディスコ	86.8	82	5,143,860
日東工器	8.8	8.3	19,065
日進工具	15.1	15.8	14,994
パンチ工業	12.8	5.6	2,587
富士ダイス	6.7	11.1	8,569
豊和工業	7.8	3.1	2,495
リケンNPR	—	18.5	49,580
東洋機械金属	9.8	4.7	3,384
エンシュウ	3.2	1.4	950
島精機製作所	28.8	27.1	39,972
オプトラン	26.7	28	58,408
NCホールディングス	2.9	1.3	1,922
イワキポンプ	12.1	11.4	27,474

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)
フリュー	19	16.1	16,067	
ヤマシンフィルタ	43.2	40.6	14,331	
日阪製作所	17.6	18.6	18,786	
やまびこ	29.5	27.8	59,797	
野村マイクロ・サイエンス	6.1	23.1	107,530	
平田機工	8.6	8.1	55,728	
PEGASUS	20	18.9	9,544	
マルマエ	7.9	7.4	15,503	
タツモ	9.9	10.3	35,792	
ナブテスコ	113.2	106.9	274,198	
三井海洋開発	22.6	21.6	58,212	
レオン自動車	19	19.7	30,672	
SMC	58.5	51	4,027,470	
ホソカワミクロン	12.7	11.9	50,991	
ユニオンツール	7.9	7.5	41,175	
瑞光	—	12.3	12,890	
オイレス工業	25.2	23.1	49,988	
日精エー・エス・ピー機械	7.2	6.8	34,476	
サトーホールディングス	25.7	24.2	50,892	
技研製作所	17	16	29,408	
日本エアータック	9.2	8	9,256	
カワタ	4.1	1.8	1,578	
日精樹脂工業	13.5	12.7	12,788	
オカダアイオン	4.3	1.9	4,731	
ワイエイシイホールディングス	6	7.2	16,358	
小松製作所	844.8	798.3	3,620,290	
住友重機械工業	106.7	100.8	420,840	
日立建機	71.8	67.8	286,522	
日工	26.9	25.3	17,963	
巴工業	7.8	6.7	27,537	
井関農機	17	16	16,048	
TOWA	18.4	19	238,640	
丸山製作所	2.4	1	2,310	
北川鉄工所	7.2	6.7	9,125	
ローツェ	9.4	8.9	267,445	
タカキタ	4.1	1.9	864	
クボタ	954.1	890.4	1,967,338	
荏原実業	8.7	9	30,555	
三菱化工機	5.9	6	24,390	
月島ホールディングス	24.5	23.1	31,739	
帝国電機製作所	12.7	11.7	26,722	
新東工業	36.6	34.5	36,880	
澁谷工業	17	16	60,400	
アイチ コーポレーション	25.3	23.7	26,378	
小森コーポレーション	41.9	42	52,374	

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)
鶴見製作所	13.8	13	52,455	
日本ギア工業	4.9	2.2	1,185	
酒井重工業	2.3	3	16,980	
荏原製作所	73.8	69.9	822,373	
石井鐵工所	1.6	0.7	1,933	
西島製作所	15.6	14.7	47,554	
北越工業	18.2	17.1	36,594	
ダイキン工業	215.2	203.3	4,664,718	
オルガノ	24.8	20.5	173,430	
トーヨーカネツ	6.9	5.8	22,127	
栗田工業	100.9	95.3	626,788	
椿本チエイン	25.6	24	140,160	
大同工業	5.8	2.5	2,027	
木村化工機	14	13.1	8,999	
アネスト岩田	30.7	26.3	34,952	
ダイフク	278.9	287.4	799,977	
サムコ	4.8	4.6	20,516	
加藤製作所	6.7	2.9	3,784	
油研工業	2.2	1	2,340	
タダノ	95.2	98	105,448	
フジテック	63.2	39.8	165,767	
CKD	49.9	47.1	142,006	
平和	60	50.4	100,598	
理想科学工業	16.1	13.6	41,820	
SANKYO	35.4	164	244,770	
日本金銭機械	19.9	20.6	24,781	
マースグループホールディングス	10.6	8.6	28,595	
フクシマガリレイ	13.3	11.1	65,934	
オーイズミ	5.4	2.2	765	
ダイコク電機	9.9	8.4	29,820	
竹内製作所	32.7	30.9	186,636	
アマノ	51.2	48.3	179,434	
JUKI	28.1	26.4	13,041	
ジャノメ	18.4	17.3	11,625	
マックス	22.2	24	86,160	
グローリー	43.3	40.9	107,996	
新晃工業	18.2	17.2	68,800	
大和冷機工業	27.7	26.1	37,218	
セガサミーホールディングス	144.9	152.1	321,539	
日本ビストンリング	4.8	—	—	
リケン	7.1	—	—	
T P R	20.7	21.6	49,053	
ツバキ・ナカシマ	44.5	34.1	26,359	
ホシザキ	116.1	100.5	553,554	
大豊工業	15.7	14.8	11,840	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本精工	331.3	315.3	239,123	
NTN	355.4	369.4	111,484	
ジェイテクト	160.5	151.6	174,870	
不二越	13.3	12.6	42,966	
日本トムソン	44.3	46.4	27,608	
THK	104	98.3	295,686	
ユーション精機	14.4	13.5	9,504	
前澤給装工業	12.7	12.2	16,287	
イーグル工業	20	18.8	33,952	
前澤工業	8.1	3.6	4,906	
日本ビラー工業	16.7	15.8	80,264	
キッツ	66.5	57	62,016	
マキタ	224.3	194.2	901,670	
三井E&S	83.9	84.5	117,032	
日立造船	147.9	150.3	164,728	
三菱重工業	315.3	2,978.2	3,895,485	
I H I	113.6	126.8	485,770	
スター精密	34.1	31.3	64,665	
<b>電気機器 (17.5%)</b>				
日清紡ホールディングス	146.8	128	137,024	
イビデン	103.5	88.9	558,558	
コニカミノルタ	403.5	380.7	173,104	
ブラザー工業	241.1	227.6	661,974	
ミネベアミツミ	313.7	296.3	956,752	
日立製作所	876.7	818.5	12,977,317	
東芝	346.9	—	—	
三菱電機	1,863.3	1,895.5	5,115,006	
富士電機	109.6	103.6	980,159	
東洋電機製造	4.5	2	2,164	
安川電機	213.6	185	1,106,670	
シンフォニアテクノロジー	19.9	18.8	67,868	
明電舎	27.4	31.6	130,666	
オリジン	3.1	1.3	1,690	
山洋電気	7.8	7.4	52,614	
デンヨー	13.7	13	33,488	
PHCホールディングス	25.4	32	35,136	
KOKUSAI ELECTRIC	—	88.1	366,936	
ソシオネクスト	24.7	124	554,652	
東芝テック	26.9	21.8	68,125	
芝浦メカトロニクス	3.5	9.7	67,512	
マブチモーター	44.9	83.8	200,784	
ニデック	438.7	376	2,947,840	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14	11.3	4,327	
トレックス・セミコンダクター	8.7	8.9	15,601	
東光高岳	11.1	10.4	21,777	

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)
ダブル・スコープ	58.9	48.8	21,862	
ダイヘン	16.3	16.1	137,977	
ヤーマン	31.5	33.3	30,769	
JVCケンウッド	165	134.7	113,282	
ミマキエンジニアリング	17.6	16.3	27,742	
I-PEX	10.3	11.9	23,466	
大崎電気工業	42.8	37.3	24,729	
オムロン	165.2	130	682,500	
日東工業	24.3	23	82,340	
I D E C	26.6	25.1	66,991	
正興電機製作所	5.7	2.1	3,183	
不二電機工業	3.2	1.3	1,452	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	59.3	66.5	205,485	
サクサホールディングス	2.9	1.3	3,519	
メルコホールディングス	4.6	5.4	18,495	
テクノメディカ	4.6	4.3	7,559	
日本電気	255	223.7	2,592,683	
富士通	179.6	1,567.1	3,526,758	
沖電気工業	81.5	77	79,618	
岩崎通信機	6.1	2.7	1,803	
電気興業	7.3	6.9	14,317	
サンケン電気	16.8	15.8	83,187	
ナカヨ	2.2	0.9	1,033	
アイホン	10.9	9.2	26,716	
ルネサスエレクトロニクス	1,176.5	1,061.7	3,112,904	
セイコーエプソン	231.3	218.5	541,115	
ワコム	137.6	124.4	86,706	
アルバック	42.8	37.3	414,962	
アクセル	5.5	7.8	9,820	
E I Z O	13.2	12.5	60,625	
日本信号	41.1	38.8	38,062	
京三製作所	37.8	35.7	20,777	
能美防災	24.6	23.1	51,489	
ホーチキ	13.7	12.8	27,520	
星和電機	6.4	2.9	1,624	
エレコム	43.4	40.8	62,628	
パナソニック ホールディングス	2,129.5	2,011.8	2,698,829	
シャープ	217.1	287.1	268,610	
アンリツ	127	119.9	140,223	
富士通ゼネラル	51.1	48.3	104,376	
ソニーグループ	1,262.7	1,192.8	14,904,036	
T D K	285.5	269.7	2,076,959	
帝国通信工業	8.4	7.6	14,789	
タムラ製作所	77.4	67.8	46,239	
アルプスアルパイン	161.3	152.2	222,440	

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)	
池上通信機	4.4	1.8		1,351
日本電波工業	21.9	20.6		22,248
鈴木	10.1	9.2		13,027
メイコー	19.8	16.9		119,821
日本トリム	4.2	3.9		12,499
ローランド ディー. ジー.	10	9.5		50,730
フォスター電機	16.7	12.6		20,172
SMK	4.3	4.5		10,764
ヨコオ	14.6	15.2		30,476
ホシデン	42.3	38.8		75,660
ヒロセ電機	29.8	25.1		435,234
日本航空電子工業	37	40.7		98,046
TOA	20.5	19.4		20,467
マクセル	36.8	37.7		61,375
古野電気	23.8	22.2		44,955
スミダコーポレーション	16.8	23		26,243
アイコム	6.9	6.6		19,747
リオン	7.6	7.1		20,959
横河電機	197.2	186.3		754,142
新電元工業	6.9	6.5		19,149
アズビル	124.7	116		506,920
東亜ディーケーケー	7	2.9		2,447
日本光電工業	82.6	72.4		329,130
チノー	7.4	7		18,165
共和電業	13	5.2		2,303
日本電子材料	11.8	10.4		38,376
堀場製作所	39.7	32.2		400,890
アドバンテスト	140.6	483.1		2,736,761
小野測器	6	2.6		1,739
エスベック	14.5	13.6		43,248
キーエンス	178.6	168.7		11,810,687
日置電機	9.4	8		56,080
シスメックス	154	436.6		1,135,814
日本マイクロニクス	29.6	30.3		185,133
メガチップス	14.8	13.4		54,873
OBARA GROUP	9.8	10.6		44,202
澤藤電機	2	0.8		975
原田工業	6.6	2.8		1,618
コーセル	21.8	18.2		25,006
イリゾ電子工業	16.5	15.6		47,112
オプテックスグループ	32.9	31		52,111
千代田インテグレ	6.4	6.7		18,632
レーザーテック	81.8	77.3		3,223,410
スタンレー電気	127.2	108		304,236
ウシオ電機	90.9	74.7		153,695

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)	
岡谷電機産業	12.1	5.1		1,224
ヘリオス テクノ ホールディング	13.3	6		2,910
エノモト	3.8	1.7		2,499
日本セラミック	18.3	13.8		34,651
遠藤照明	6.5	2.7		4,268
古河電池	13.5	12.6		14,830
双信電機	6.6	3.5		1,676
山一電機	15.8	15.2		53,808
図研	15.6	14.7		55,566
日本電子	44.8	42.3		276,642
カシオ計算機	133	121.8		141,897
ファナック	876	822.2		3,713,055
日本シイエムケイ	38.7	39.9		22,423
エンプラス	5.3	4.9		34,398
大真空	22.3	25.4		17,475
ローム	82.5	311.9		630,038
浜松ホトニクス	143.3	135.4		629,339
三井ハイテック	18.5	15		105,390
新光電気工業	63.2	59.7		333,902
京セラ	277.3	1,047.8		1,876,085
太陽誘電	87	82.2		266,081
村田製作所	541.4	1,534.2		4,518,219
双葉電子工業	34.8	32.6		16,626
北陸電気工業	5.5	2.2		3,020
ニチコン	36.7	44.4		50,660
日本ケミコン	17.9	18.1		28,073
KOA	27.2	25.7		37,599
市光工業	26.5	30.8		16,693
小糸製作所	214.8	174.8		375,732
ミツバ	33.5	31.6		32,958
SCREENホールディングス	30.5	57.7		873,578
キャノン電子	19.9	18.7		41,831
キャノン	979.3	841		3,780,295
リコー	447.5	422.8		582,618
象印マホービン	53.5	45.9		67,197
MUTOHホールディングス	2.1	0.9		2,208
東京エレクトロン	377.8	356.9		12,627,122
イノテック	12.1	11.3		19,074
<b>輸送用機器(8.9%)</b>				
トヨタ紡織	75.2	71		160,815
芦森工業	2.6	1.2		2,904
ユニプレス	32.1	30.3		44,450
豊田自動織機	130.5	143.8		2,129,678
モリタホールディングス	31.4	29.6		51,800
三櫻工業	27.4	25.8		25,774



銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
デンソー	368.2	1,391.2	3,542,690
東海理化電機製作所	50.4	47.6	104,244
川崎重工業	134.5	137.6	824,636
名村造船所	35.6	47.2	91,709
日本車輛製造	6.9	5.6	12,493
三菱ロジスネクスト	28.5	26.9	43,120
近畿車輛	1.9	0.8	1,527
日産自動車	2,535.6	2,275.5	1,261,309
いすゞ自動車	518.9	490.2	1,013,733
トヨタ自動車	9,801.4	9,258.7	31,386,993
日野自動車	230.1	253.6	112,091
三菱自動車工業	696.3	657.8	282,327
エフテック	9.7	4	2,564
レシップホールディングス	5.5	2.4	1,344
GMB	2.8	1.1	1,513
ファルテック	2.3	1.2	663
武蔵精密工業	43.7	41.3	69,962
日産車体	31.5	17.1	15,629
新明和工業	56.1	48.6	67,262
極東開発工業	29.5	27.8	67,998
トビー工業	14.5	13.7	33,181
ティラド	4.5	3.8	13,490
曙ブレーキ工業	108.9	102.9	14,097
タチエス	28.3	31.1	59,867
NOK	69.4	65.5	138,106
フタバ産業	48	45.3	40,905
カヤバ	17.2	15.9	83,952
大同メタル工業	35.1	33.1	19,429
プレス工業	79.9	67.4	45,023
ミクニ	16.1	7.2	2,880
太平洋工業	41	38.7	59,636
アイシン	137.7	130.1	747,554
マツダ	590.4	557.7	893,993
今仙電機製作所	8.9	3.6	2,221
本田技研工業	1,451	3,995.2	6,951,648
スズキ	327.8	1,238.8	2,302,929
SUBARU	564.8	522.9	1,785,703
安永	6.1	2.5	1,522
ヤマハ発動機	280.5	728.7	1,093,778
TBK	14	6.2	1,860
エクセディ	29.2	27.6	70,600
豊田合成	52.1	48.3	144,513
愛三工業	29.6	28	38,976
盟和産業	2.1	0.8	803
日本ブラスト	11.1	4.9	2,151

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ヨロズ	16.8	15.9	16,822
エフ・シー・シー	31.7	29.9	64,763
シマノ	73	68	1,729,920
テイ・エス テック	81.7	60.1	112,507
ジャムコ	7.6	9.2	12,852
<b>精密機器(2.2%)</b>			
テルモ	549	940	2,532,360
クリエートメディック	4.5	1.8	1,758
日機装	41.6	39.3	47,985
日本エム・ディ・エム	10.6	13.4	8,187
島津製作所	217.4	224	923,776
JMS	16.5	15.6	8,127
長野計器	13	12.3	38,068
ブイ・テクノロジー	8.7	8.9	26,878
東京計器	13.7	12.9	40,957
愛知時計電機	7	7.3	15,410
インターアクション	8.5	10.2	15,106
オーバル	12.3	4.9	2,209
東京精密	39.2	34.5	387,090
マニー	71.4	67.5	124,706
ニコン	258.1	243.8	396,540
トプコン	94	82	139,195
オリンパス	1,098.8	996.1	2,451,900
理研計器	11.1	23.9	93,329
タムロン	13.4	10.3	87,550
HOYA	381.2	331.9	6,184,956
シード	7.1	3.4	1,887
ノーリツ鋼機	16.9	16	64,400
A&Dホロンホールディングス	26	24.6	72,594
朝日インテック	199.5	205.5	439,359
シチズン時計	196.3	155.1	156,030
リズム	4.3	1.3	4,862
大研医器	10.5	4.8	2,592
メニコン	61.3	58	75,168
シンシア	1.3	0.7	320
松風	8.1	7.6	27,474
セイコーグループ	27.6	23.5	104,457
ニプロ	148.8	140.6	167,384
<b>その他製品(2.4%)</b>			
KYORITSU	20.6	8.3	1,369
中本ボックス	4.2	1.8	2,952
スノーピーク	30.6	—	—
バラムウントベッドホールディングス	41.2	35	91,245
トランザクション	11.8	11.1	20,246
粧美堂	3.8	1.5	798

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)	
ニホンフラッシュ	16.7	15.8	14,220	
前田工織	15.1	14.6	45,552	
永大産業	14.8	6.6	1,584	
アートネイチャー	18.4	15.2	12,160	
フルヤ金属	—	5.3	68,423	
バンダイナムコホールディングス	489	461.9	1,335,583	
アイフィスジャパン	3.8	1.5	862	
SHOEI	40.3	47.4	95,084	
フランスベッドホールディングス	22.1	21.8	25,026	
パイロットコーポレーション	27.9	23.7	101,554	
萩原工業	11.9	11.3	16,916	
フジシールインターナショナル	36.1	34.1	79,316	
タカラトミー	82.4	76.7	213,149	
広済堂ホールディングス	9.3	49	28,469	
エステールホールディングス	3.2	1.3	833	
タカノ	5.1	2.1	1,944	
プロネクサス	14.8	17.5	21,192	
ホクシン	10.6	4.3	498	
ウッドワン	4.6	2	1,852	
大建工業	10.8	—	—	
TOPPANホールディングス	233.4	207.3	819,871	
大日本印刷	195.1	174.8	833,271	
共同印刷	5	4.7	16,450	
NISSHA	33.9	28.9	54,592	
光村印刷	1.2	0.5	779	
TAKARA & COMPANY	11.4	10	26,140	
アシックス	164.8	143.7	1,243,723	
ツツミ	3.1	3.9	8,595	
ローランド	13.1	12.4	49,600	
小松ウオール工業	6.6	6.9	22,080	
ヤマハ	112.5	106.3	366,735	
河合楽器製作所	4.8	5.1	15,784	
クリナップ	20	16.5	11,484	
ビジョン	113.7	107.4	160,777	
キングジム	15.7	14.9	13,261	
リンテック	35.8	33.8	110,019	
イトーキ	36.6	34.4	52,494	
任天堂	1,127	1,064.6	8,803,177	
三菱鉛筆	25.3	23.9	54,037	
タカラスタンダード	32.9	35.3	58,951	
コクヨ	85.9	69	179,986	
ナカバヤシ	19.2	18.2	9,518	
グローブライド	14.4	15.1	30,366	
オカムラ	53.7	50.8	112,166	
美津濃	17.7	16.8	131,880	

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)	
<b>電気・ガス業(1.6%)</b>				
東京電力ホールディングス	1,609	1,520	1,407,976	
中部電力	657.8	621.3	1,311,253	
関西電力	689.3	651.1	1,833,172	
中国電力	284.3	292.9	329,805	
北陸電力	168.5	172.4	200,070	
東北電力	436.4	443.9	686,935	
四国電力	152.4	157	233,616	
九州電力	411.5	388.7	730,950	
北海道電力	172.5	162.9	272,857	
沖縄電力	41.8	43.1	48,315	
電源開発	134.4	138.5	360,792	
エフオン	11.6	12.3	4,846	
イーレックス	31.7	30	20,220	
レノバ	47.5	45	45,720	
東京瓦斯	377.4	328.3	1,119,831	
大阪瓦斯	361.6	336	1,135,680	
東邦瓦斯	70.3	73	281,415	
北海道瓦斯	10.7	10.1	35,097	
広島ガス	37.7	35.6	13,314	
西部ガスホールディングス	16.8	17.6	33,387	
静岡ガス	40.7	33.6	31,718	
メタウォーター	22.3	20.2	39,349	
<b>陸運業(2.3%)</b>				
SBSホールディングス	15.9	15	37,620	
東武鉄道	196.1	185.2	502,632	
相鉄ホールディングス	59	60.3	147,282	
東急	500.5	472.8	862,150	
京浜急行電鉄	202.5	208.7	240,005	
小田急電鉄	270.6	278.8	451,795	
京王電鉄	94.4	81.1	303,395	
京成電鉄	115.1	108.7	591,762	
富士急行	22	20.8	62,608	
東日本旅客鉄道	302.7	929.3	2,598,787	
西日本旅客鉄道	228	400	1,241,600	
東海旅客鉄道	137.5	649.5	2,237,527	
西武ホールディングス	215.9	204	479,910	
鴻池運輸	30.4	28.7	62,996	
西日本鉄道	47.7	45	109,530	
ハマキョウレックス	14	14.4	56,664	
サカイ引越センター	8.5	18.7	42,748	
近鉄グループホールディングス	178.2	168.3	552,865	
阪急阪神ホールディングス	237.6	224.5	909,225	
南海電気鉄道	85.2	75.1	195,973	
京阪ホールディングス	98.2	92.8	269,398	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
神戸電鉄	4.8	4.6	12,847
名古屋鉄道	196.9	173.6	347,373
山陽電気鉄道	13.4	12.7	26,250
アルプス物流	14.2	13.4	75,710
ヤマトホールディングス	228.2	204.6	355,492
山九	45.3	42.8	235,057
丸運	6.8	3.3	1,155
丸全昭和運輸	11	10.4	50,856
センコーグループホールディングス	94.4	89.1	100,861
トナミホールディングス	3.9	3.7	17,815
ニッコンホールディングス	57	53.6	155,306
日本石油輸送	1.4	0.6	1,720
福山通運	13.6	19.2	71,232
セイノーホールディングス	110.9	94.7	190,820
エスライングループ本社	3.9	1.6	2,384
神奈川中央交通	5	4.8	14,424
AZ-COM丸和ホールディングス	43	43	49,966
C&Fロジホールディングス	17.1	16.2	80,919
九州旅客鉄道	126	119	400,435
S Gホールディングス	342	282.7	440,729
NIPPON EXPRESSホールディングス	66.5	57.1	434,531
<b>海運業(0.8%)</b>			
日本郵船	477.1	482.7	2,454,046
商船三井	314.5	365.7	1,885,549
川崎汽船	134.2	405.9	970,912
NSユニテッド海運	9.9	9.2	46,092
飯野海運	66.7	62.3	85,039
共栄タンカー	3.7	1.7	2,011
乾汽船	23.4	20.4	22,032
<b>空運業(0.4%)</b>			
日本航空	437.7	413.5	1,085,024
ANAホールディングス	484.9	458.1	1,365,138
バスコ	2.7	1.1	2,002
<b>倉庫・運輸関連業(0.1%)</b>			
トランコム	5.2	4.9	29,400
日新	13.5	12.8	56,128
三菱倉庫	38.3	41.3	213,025
三井倉庫ホールディングス	16.6	15.7	65,704
住友倉庫	48.1	45.2	113,135
澁澤倉庫	7.1	7.7	23,100
東陽倉庫	18.4	1.5	2,227
日本トランスシティ	35.9	33.9	28,916
ケイヒン	2.4	1	2,015
中央倉庫	8.6	9	10,359
川西倉庫	2.3	1	1,141

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
安田倉庫	12.2	11.5	16,399
ファイブホールディングス	2.5	0.8	793
東洋埠頭	4	1.6	2,150
上組	85.5	77.7	240,714
サンリツ	3.1	1.4	1,201
キムラユニティ	6.6	2.7	4,579
キューソー流通システム	8.3	8.6	10,001
東海運	8.1	3.3	957
エーアイティ	11.2	10.6	18,836
内外トランスライン	6.4	6.7	16,850
日本コンCEPT	5.6	6.1	11,193
<b>情報・通信業(6.8%)</b>			
NECネットエスアイ	59.9	65.9	143,991
クロスキャット	10.4	10.7	13,428
システナ	301.8	255.9	69,348
デジタルアーツ	11.4	10.7	38,092
日鉄ソリューションズ	30.6	28.9	142,188
キューブシステム	10.9	9	9,720
コア	8.1	7.5	13,792
手間いらす	3.1	2.9	8,244
ラークンホールディングス	15.2	12.6	8,215
ソリトンシステムズ	9.4	8.7	9,909
ソフトクリエイトホールディングス	14.9	13.9	26,952
T I S	195.9	178.8	503,143
テクミラホールディングス	7	2.6	1,011
グリー	48.4	56.7	28,520
GMOペパボ	2.7	2.1	2,906
コーエーテクモホールディングス	112.3	106	131,175
三菱総合研究所	8.8	8.3	37,972
電算	1.8	0.7	1,036
AGS	6.2	2.3	2,162
ファインデックス	14.6	13.4	12,287
ブレインパッド	13.7	14.1	15,115
KL a b	35.7	31.1	6,748
ポルトゥウィンホールディングス	30.8	28.9	13,062
ネクソン	463.7	371	972,205
アイスタイル	52.5	56.5	24,916
エムアップホールディングス	22.1	20.7	24,260
エイチーム	10.9	11.3	7,322
エニグモ	23.4	21.6	6,955
テクノスジャパン	11.9	5	3,045
コロブラ	69.8	65.3	36,698
ブロードリーフ	105.1	80.3	38,704
クロス・マーケティンググループ	8.8	2.7	1,544
デジタルハーツホールディングス	11.4	10.6	9,720

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
システム情報	14.6	—	—	—
メディアドウ	7.4	7.6	10,465	
じげん	52.6	49.3	29,629	
ブイキューブ	22	20.3	4,790	
エンカレッジ・テクノロジー	3.7	1.3	802	
サイバーリンクス	4.8	2.2	1,568	
フィックスターズ	20.4	19	33,345	
CARTA HOLDINGS	8.6	8	12,672	
オブティム	15	17.4	11,988	
セレス	7.4	6.8	13,375	
SHIFT	11.9	11.2	179,816	
ティーガイア	18.9	17.7	33,559	
セック	2	2.3	9,671	
テクマトリックス	32.8	30.9	55,372	
プロシップ	8	8.1	11,267	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	52.5	44	113,146	
GMOペイメントゲートウェイ	35.8	38.6	275,333	
ザッパラス	4.5	1.3	540	
システムリサーチ	5.7	11.6	17,632	
インターネットイニシアティブ	100	80.8	176,628	
さくらインターネット	20.5	19	97,470	
ヴィンクス	4.3	—	—	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	5.5	5.2	14,409	
SRAホールディングス	9.2	8.7	34,278	
システムインテグレータ	4.7	1.7	610	
朝日ネット	19.6	18.2	11,684	
eBASE	25.5	23.8	15,779	
アバントグループ	22.8	21.4	27,413	
アドソル日進	7.7	7.1	11,289	
ODKソリューションズ	3.5	1.1	647	
フリービット	9.5	7.4	10,219	
コムチュア	23.8	24.4	43,773	
サイバーコム	2.4	—	—	
アステリア	14.4	13.3	7,115	
アイル	8.4	9.5	24,519	
マークラインズ	9.8	9.2	27,554	
メディカル・データ・ビジョン	27.1	20.2	9,837	
gumi	26.6	27.5	9,845	
ショーケース	4	1.3	370	
モバイルファクトリー	3.2	1.2	788	
テラスカイ	7.8	7.3	13,417	
デジタル・インフォメーションテクノロジー	10.5	8.8	14,476	
PCIホールディングス	5.6	2.3	2,141	
アイピーシー	2.5	0.9	405	
ネオジャパン	6.2	5.7	7,632	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
PR TIMES	4.7	3.4	5,695	
ラクス	84.8	80	135,440	
ランドコンピュータ	3.6	2.7	2,230	
ダブルスタンダード	7.4	5.1	8,389	
オーブンドア	12.7	9.9	5,722	
アカツキ	8.6	8.2	16,539	
ベネフィットジャパン	1	0.4	461	
Ubicomホールディングス	5.7	5.3	5,861	
カナミックネットワーク	19.8	21.3	10,543	
ノムラシステムコーポレーション	15.1	6.2	806	
チェンジホールディングス	44	36.8	42,062	
シンクロ・フード	9.2	3.6	2,026	
オークネット	9	6.3	14,275	
キャピタル・アセット・プランニング	3	1.1	856	
セグエグループ	4.1	5.2	2,953	
エイトレッド	2.3	0.9	1,369	
マクロミル	35.4	33.2	28,684	
ビーグリー	2.5	1.2	1,304	
オロ	5.5	6.1	16,372	
ユーザーローカル	6.6	7.1	14,320	
テモナ	4.1	1.4	301	
ニーズウェル	4	3.1	2,368	
マネーフォワード	43.2	37.8	199,508	
サインポスト	5.4	2.2	1,410	
Sun Asterisk	12.9	12	9,912	
プラスアルファ・コンサルティング	—	21.3	38,787	
電算システムホールディングス	8.7	7.5	18,712	
Appier Group	68	57.9	71,506	
ビジョナル	—	19.8	145,926	
ソルクシーズ	11.9	4.6	1,430	
フェイス	4.4	1.6	672	
プロトコーポレーション	22.6	18.5	24,383	
ハイマックス	5.8	5.3	7,054	
野村総合研究所	356.7	366.2	1,495,927	
サイバネットシステム	15.3	—	—	
CEホールディングス	7.6	2.7	1,463	
日本システム技術	5.9	14.1	21,897	
インテージホールディングス	20.4	19.1	26,205	
東邦システムサイエンス	4.1	6.9	9,252	
ソースネクスト	92.3	77.5	14,725	
インフォコム	23.2	21.7	98,735	
シンプレクス・ホールディングス	30.7	25.7	67,848	
HEROZ	6.2	6.7	8,442	
ラクスル	43.1	40.8	34,190	
メルカリ	107.9	82.5	146,767	

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)
I P S	5.9	4.9	10,255	
F I G	17	6.5	2,119	
システムサポート	7.1	6.6	12,309	
イーソル	11.7	12.2	11,016	
アルテリア・ネットワークス	16.8	—	—	
東海ソフト	2.3	0.9	1,215	
ウイングアーク1st	18.6	17.6	48,998	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4.9	5.7	5,187	
サーバーワークス	3.7	3.5	10,262	
東名	1.2	0.6	1,401	
ヴィッツ	1.6	0.6	468	
トピラスシステムズ	3.7	1.6	1,236	
S a n s a n	58.7	55.5	88,966	
L i n k-Uグループ	3.5	1.1	694	
ギフティ	19.6	14.8	15,554	
メドレー	24.1	22.7	69,916	
ベース	6.1	5.9	16,974	
JMDC	29.4	28.8	74,217	
フォーカスシステムズ	13.3	11.3	12,113	
クレスコ	13.9	13.9	31,997	
フジ・メディア・ホールディングス	172.1	162.4	269,665	
オービック	59.8	56.5	1,144,972	
ジャストシステム	25.8	24.3	61,649	
TDCソフト	15.3	31.7	32,777	
L I N Eヤフー	2,548.4	2,407.8	863,918	
トレンドマイクロ	103.4	80	570,640	
IDホールディングス	12.3	11.4	15,732	
日本オラクル	34.3	32.4	387,018	
アルファシステムズ	5.7	4.4	11,932	
フューチャー	44.7	36.1	53,644	
CAC Holdings	11.1	9.1	17,089	
SBテクノロジー	7.7	7.1	20,909	
トーセ	4.3	1.6	1,099	
オービックビジネスコンサルティング	35.3	23.8	151,320	
伊藤忠テクノソリューションズ	96.2	—	—	
アイティフォー	23.8	21.7	28,253	
東計電算	2.5	4.7	16,873	
エクスネット	2.2	0.8	1,182	
大塚商会	101.5	167.7	486,497	
サイボウズ	24.8	23.3	35,579	
電通総研	21.8	20.6	104,854	
A C C E S S	21.5	17.6	24,816	
デジタルガレージ	31.8	27	63,045	
EMシステムズ	30.2	28.2	17,653	
ウェザーニューズ	5.6	5.2	23,478	

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)
C I J	30.2	42.2	18,399	
ビジネスエンジニアリング	3	3.5	11,532	
日本エンタープライズ	16.2	5.9	772	
WOWOW	13.7	12.7	13,106	
スカラ	16.9	15.7	11,068	
インテリジェント ウェイブ	7.7	3	3,129	
ANYCOLOR	—	23.9	50,859	
IMAGICA GROUP	15.4	17	8,789	
ネットワンシステムズ	66.8	67.9	196,910	
システムソフト	65.7	59.1	3,605	
アルゴグラフィックス	16.5	15.5	60,527	
マーベラス	29.4	27.5	16,225	
エイベックス	30.6	28.8	34,070	
B I P R O G Y	66	55.3	225,347	
都築電気	9.6	8.9	19,580	
TBSホールディングス	91.7	85	287,895	
日本テレビホールディングス	158.7	149.7	308,831	
朝日放送グループホールディングス	17.1	15.9	10,287	
テレビ朝日ホールディングス	43.6	41.1	78,007	
スカパーJ SATホールディングス	159.3	131.4	114,975	
テレビ東京ホールディングス	13	12.2	36,356	
日本BS放送	5.3	2	1,770	
ビジョン	23.7	25.5	29,503	
スマートバリュー	4	1.6	640	
U-NEXT HOLDINGS	20.1	19	82,555	
ワイヤレスゲート	7.2	2.5	562	
日本通信	—	166.6	29,821	
クロップス	2.5	0.7	747	
日本電信電話	2,294	50,303.7	7,646,162	
KDDI	1,383.4	1,306.8	5,587,876	
ソフトバンク	2,876.1	2,699.1	5,059,462	
光通信	21.1	17	420,580	
エムティーアイ	12.7	11.6	9,883	
GMOインターネットグループ	66.2	62.2	152,980	
ファイバーゲート	9.8	9.1	11,274	
アイドマークetingコミュニケーション	4	1.6	368	
KADOKAWA	94.7	89.4	284,023	
学研ホールディングス	30.1	30.4	29,305	
ゼンリン	30.9	28.9	24,189	
昭文社ホールディングス	6.8	2.4	849	
インプレスホールディングス	13.4	5.7	900	
アイネット	11	10.2	22,868	
松竹	10.3	8.8	80,792	
東宝	112.1	94.1	455,444	
東映	4.9	27.9	94,860	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
NTTデータグループ	561.8	442.2	1,041,823
ピー・シー・エー	10.5	9.7	18,721
ビジネスブレイン太田昭和	7.8	6.6	13,767
DTS	38.2	35.5	144,485
スタウェア・エニックス・ホールディングス	90	77.3	348,545
シーイーシー	25.3	21.3	35,784
カブコン	177.9	302.5	825,825
アイ・エス・ピー	9.3	8.7	11,953
ジャステック	11.2	—	—
SCSK	146.2	118.3	348,156
NSW	7.1	7.5	22,207
アイネス	12.7	13.2	21,700
TKC	28.6	29.4	95,991
富士ソフト	20.3	34	213,180
NSD	64	60	165,660
コナミグループ	76.7	63.3	690,286
福井コンピュータホールディングス	12.5	10.4	22,630
JBCCHホールディングス	13.2	11.2	33,600
ミロク情報サービス	16.4	15.4	28,105
ソフトバンクグループ	883.2	834.2	7,477,768
<b>卸売業(7.9%)</b>			
リョーサン菱洋ホールディングス	—	33.6	107,688
高千穂交易	5.2	6.3	22,522
オルパヘルスケアホールディングス	2.2	1	2,138
伊藤忠食品	4.3	4	27,680
エレマテック	17	16	31,808
あらた	14.4	27.3	85,585
トーメンデバイス	2.7	2.6	18,616
東京エレクトロン デバイス	7	17.8	80,011
円谷フィिल्ズホールディングス	32.4	30.6	44,982
双日	200.5	198.6	808,302
アルフレッサ ホールディングス	189.6	179.1	380,050
横浜冷凍	51.5	48.4	47,528
ラサ商事	6.7	7.9	13,667
アルコニックス	24.9	23.5	34,216
神戸物産	146.1	138	466,440
ハイバー	2.8	1.4	415
あい ホールディングス	30.2	28.6	69,869
ディーブイエックス	4.1	1.6	1,600
ダイワボウホールディングス	77.2	79	214,564
マクニカホールディングス	44.7	42.2	269,742
ラクト・ジャパン	7.3	7	19,201
グリムス	7.9	7.5	15,172
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	27.6	27	34,830
八洲電機	15.3	14.4	20,678

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
メディアスホールディングス	12.1	10.4	8,923
レスター	18.1	15.2	44,247
ジオリーブグループ	3.4	1.4	1,677
大光	6.2	3.1	1,984
OCHIホールディングス	3.4	1.4	2,028
TOKAIホールディングス	93.3	96.9	91,861
黒谷	4.1	1.6	1,153
Cominix	2.9	1.2	1,020
三洋貿易	21.3	20	31,580
ビューティガレージ	3	5.6	11,340
ウイン・パートナーズ	13.8	11.6	13,096
ミタチ産業	3.7	1.7	1,909
シップヘルスケアホールディングス	67.9	64.1	142,943
明治電機工業	7	6.6	10,810
デリカフーズホールディングス	5.8	2.6	1,492
スターティアホールディングス	2.9	1.6	3,259
コメダホールディングス	46.3	43.7	114,231
ビーバンドットコム	2.1	0.8	298
アセンテック	6.4	6.9	3,801
富士興産	3.3	1.7	2,799
協栄産業	1.4	0.6	1,644
フルサト・マルカホールディングス	18.8	15.9	34,153
ヤマエグループホールディングス	10.7	15.7	35,654
小野建	18.6	17.8	28,213
南陽	2.8	2.4	2,642
佐鳥電機	9.2	11.2	23,475
エコートレーディング	2.9	1.2	1,465
伯東	10.8	10.2	51,510
コンドーテック	14.5	13.7	17,536
中山福	7.9	3.2	1,158
ナガイレーベン	23.9	22.5	51,120
三菱食品	17.4	16.5	83,985
松田産業	14.4	13.6	37,930
第一興商	73.1	69	111,435
メディバルホールディングス	180.6	181.4	406,336
S P K	8.4	7.9	16,092
萩原電気ホールディングス	7.2	7.7	30,376
アズワン	26.9	55.6	130,104
スズデン	6.6	6.2	11,259
尾家産業	3.5	1.4	2,690
シモジマ	13	11.9	14,970
ドウシシャ	20	16.5	35,970
小津産業	3.3	1.3	2,364
高速	9.8	10.6	22,387
たけびし	7.2	6.8	14,218

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)	
リックス	3	3.9	11,836	
丸文	16.9	15.9	19,286	
ハビネット	16.1	15.2	52,212	
橋本総業ホールディングス	7.5	7.1	9,116	
日本ライフライン	55.4	52	58,240	
タカショー	16.5	15.6	7,612	
I DOM	57.1	47.2	61,029	
進和	11.6	10.9	29,669	
エスケイジャパン	3.6	1.5	1,267	
ダイトロン	7.5	7	21,630	
シークス	26.9	25.4	32,715	
田中商事	4.2	1.7	1,309	
オーハシテクニカ	9.2	9.4	15,472	
白銅	6.8	5	14,800	
ダイコー通産	1.5	0.6	780	
伊藤忠商事	1,163.7	1,199.2	8,739,769	
丸紅	1,473.8	1,479.8	4,578,501	
高島	2.3	4	4,180	
長瀬産業	86.6	81.8	249,162	
蝶理	10.1	11.2	39,592	
豊田通商	165.4	156.3	1,497,822	
三共生興	27.2	24.7	17,981	
兼松	73.3	74.6	193,139	
ツカモトコーポレーション	2.1	0.8	936	
三井物産	1,340.3	1,336.3	10,777,259	
日本紙パルプ商事	10	8.5	50,235	
カメイ	20.1	19	38,380	
東都水産	0.8	0.5	3,215	
OUGホールディングス	2.2	0.9	2,374	
スターゼン	14.4	12.3	33,689	
山善	50.9	54.1	72,115	
椿本興業	3	11.1	23,509	
住友商事	1,169.6	1,079.7	4,370,625	
内田洋行	7.7	7.2	49,680	
三菱商事	1,168.1	3,425.6	11,499,739	
第一実業	6.7	16.8	38,690	
キャンマーケティングジャパン	43.8	41.3	180,068	
西華産業	7.4	7	27,055	
佐藤商事	13.1	12.4	20,249	
菱洋エレクトロ	16.1	—	—	
東京産業	17.3	16.3	10,366	
ユアサ商事	17	13.9	74,643	
神鋼商事	4.7	4.5	31,275	
トルク	8	4.3	1,014	
阪和興業	33.9	32	212,480	

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)	
正栄食品工業	12.6	11.9	52,419	
カナデン	12.6	13.4	21,252	
RYODEN	15.3	14.4	36,172	
岩谷産業	43	40.6	365,481	
ナイス	4	1.8	3,245	
ニチモウ	1.8	1.9	3,872	
極東貿易	11.3	10.7	18,147	
アステナホールディングス	32.7	33.6	16,228	
三愛オブリ	50	41.6	85,072	
稲畑産業	38.1	35.3	116,666	
G S I クレオス	11	9.6	20,592	
明和産業	25.2	21.1	15,213	
クワザワホールディングス	4.8	2.1	1,915	
ワキタ	34.8	29.5	46,197	
東邦ホールディングス	47	49.1	187,954	
サンゲツ	47.4	41.1	120,505	
ミツウロコグループホールディングス	24.1	22.8	28,773	
シナネンホールディングス	6.1	4.9	22,760	
伊藤忠エネクス	46.8	44.2	67,184	
サンリオ	53.5	144.9	339,210	
サンワテクノス	9.7	9.1	20,384	
リョーサン	20	—	—	
新光商事	25.4	24	22,416	
トーホー	8.1	7	21,105	
三信電気	7.6	7.2	15,120	
東陽テクニカ	19.2	18	26,910	
モスフードサービス	27.8	26.2	89,080	
加賀電子	15.3	16.3	93,562	
ソーダニッカ	10.8	15.8	16,384	
立花エレテック	13.8	11.8	34,680	
フォーバル	7.4	7	8,897	
PAL TAC	29.7	24	99,048	
三谷産業	33.1	31.2	11,013	
西本Wismettacホールディングス	4.8	4.5	18,292	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.2	0.5	1,346	
コア商事ホールディングス	10.6	12.5	9,087	
KPPグループホールディングス	44.1	46.2	37,422	
ヤマタネ	8.4	7.9	21,416	
丸紅建材リース	1.3	0.5	1,530	
泉州電業	9.5	11.1	63,270	
トラスコ中山	39.7	37.5	91,087	
オートバックスセブン	65.7	62.1	94,112	
モリト	13.6	12.8	18,688	
加藤産業	23.4	22.1	89,505	
北恵	3.3	1.5	1,282	

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)	
イエローハット	33.3	28.3	56,996	
J Kホールディングス	14.5	13.7	13,987	
日伝	11.2	12	37,620	
北沢産業	7.9	3.6	1,263	
杉本商事	8.4	8.6	20,261	
因幡電機産業	49	46.3	172,004	
東テック	6.3	17.9	46,092	
ミスミグループ本社	285	269.4	744,891	
アルテック	8.3	3.2	864	
タキヒヨー	3.6	1.4	1,562	
蔵王産業	2.4	1.1	2,776	
スズケン	55.3	63.7	293,147	
ジェコス	11.3	10.7	10,507	
グローセル	17.8	—	—	
小売業(4.0%)				
ローソン	46.9	—	—	
サンエー	14.5	13.7	64,253	
カワチ薬品	15	14.1	39,804	
エービーシー・マート	27.6	78.2	227,601	
ハードオフコーポレーション	6.3	7.3	14,709	
アスクル	39.3	43.2	93,873	
ゲオホールディングス	18.8	20.2	34,218	
アダストリア	23	21.6	74,412	
くら寿司	22.3	21	98,700	
キャンドウ	6.9	6.5	18,726	
I Kホールディングス	6	3	1,257	
パルグループホールディングス	18.7	35.2	62,409	
エディオン	75.1	70.9	108,760	
サーラコーポレーション	40.3	37.9	30,395	
ワッツ	7.9	3	1,932	
ハローズ	8.7	8.2	34,358	
あみやき亭	4.7	4.4	26,312	
大黒天物産	5.9	5.5	43,120	
ハニーズホールディングス	15.2	16	26,224	
ファーマライズホールディングス	4	1.9	1,216	
アルベン	15.8	14.9	29,427	
ハブ	5.5	2.4	1,984	
クオールホールディングス	26.3	24.7	35,642	
ジンズホールディングス	11.4	13.7	50,142	
ビックカメラ	101	107	163,603	
DCMホールディングス	115.7	94.5	141,277	
M o n o t a R O	268	253.1	397,367	
東京一番フーズ	4.4	2.4	1,233	
きちりホールディングス	3.5	1.7	1,564	
アークランドサービスホールディングス	15.6	—	—	

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)	
J. フロント リテイリング	235.2	205	301,965	
ドトール・日レスホールディングス	33.7	31.8	67,320	
マツキヨココカラ&カンパニー	114.6	324.7	697,617	
ブロンコピリー	10.3	10.6	41,446	
Z O Z O	125	113.8	401,486	
トレジャー・ファクトリー	9.4	11.3	17,142	
物語コーポレーション	31.7	29.9	101,660	
三越伊勢丹ホールディングス	318.3	300.8	958,950	
H a m e e	7.1	7.5	9,600	
マーケットエンタープライズ	1.9	1	741	
ウエルシアホールディングス	98.1	92.7	196,941	
クリエイティブSDホールディングス	31.4	25.4	83,185	
丸善CH Iホールディングス	18.8	8	2,664	
ミサワ	3.5	1.8	1,112	
ティーライフ	2.4	1.1	1,527	
チムニー	4.5	1.8	2,322	
シュッピン	14.6	16.4	20,647	
オイシックス・ラ・大地	25.6	24.3	26,875	
ネクステージ	43.3	40.9	101,636	
ジョイフル本田	56.4	52.1	108,211	
エターナルホスピタリティグループ	7.2	6.7	25,326	
ホットランド	14.8	13.8	35,148	
すかいらくホールディングス	258.4	244	517,280	
S F Pホールディングス	10.3	8.6	17,372	
綿半ホールディングス	15	14.1	22,151	
ヨシックスホールディングス	3.1	4.2	11,491	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62	50.2	43,322	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9.2	8.7	4,454	
B E E N O S	8.3	10.8	22,215	
あさひ	16.2	16.8	23,671	
日本調剤	13.3	12	16,632	
コスモス薬品	18.7	15.2	195,472	
トーエル	7.2	3.1	2,418	
セブン&アイ・ホールディングス	650.9	1,826.5	3,698,662	
クリエイティブ・レストラン・ホールディングス	142.1	120.8	125,752	
ツルハホールディングス	39.7	37.5	339,750	
サンマルクホールディングス	15.5	14.5	30,450	
フェリシモ	3.8	1.7	1,555	
トリドールホールディングス	47.1	50.1	185,720	
T O K Y O B A S E	20.5	21.5	6,407	
ウイブルラスホールディングス	2.8	1.5	1,566	
J Mホールディングス	14.5	13.6	37,726	
サツドラホールディングス	7.3	2.8	2,402	
アレンザホールディングス	14.6	13.7	15,015	



銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
串カツ田中ホールディングス	5.4	5	7,905
パロックジャパンリミテッド	12.9	14.3	11,096
クスリのアオキホールディングス	16.9	53.8	164,628
力の源ホールディングス	8.4	10.3	14,172
FOOD & LIFE COMPANIES	100.9	95.3	269,127
メディカルシステムネットワーク	17.7	19.9	12,079
はるやまホールディングス	7.2	3.4	1,975
ノジマ	62	52	86,892
カップ・クリエイト	29.7	28	45,276
ライトオン	11.1	4.5	1,710
良品計画	206.5	212.6	535,433
パリティホールディングス	19.9	8.3	2,938
アドヴァングループ	18.5	16.9	17,001
アルビス	6.4	6	15,630
コナカ	16	7	2,072
ハウス オブ ローゼ	2.1	1	1,587
G-7ホールディングス	23.9	19.7	29,766
イオン北海道	28.1	52.9	48,297
コジマ	32.1	34.8	29,719
ヒマラヤ	5.2	2.5	2,275
コーナン商事	25.6	21.9	90,994
エコス	7.3	6.8	15,007
ワタミ	22.8	18.8	16,581
パン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	381.3	360.3	1,433,273
西松屋チェーン	42.1	35.3	77,342
ゼンショーホールディングス	103.5	90.9	555,944
幸楽苑ホールディングス	12.3	13.2	16,249
ハークスレイ	5.9	2.2	1,702
サイゼリヤ	28.1	26.4	132,264
V Tホールディングス	72.7	69.7	33,595
魚力	6.1	6.4	15,104
フジ・コーポレーション	11	8.7	15,251
ユナイテッドアローズ	20.4	21.2	36,146
ハイデイ日高	28.2	26.6	76,076
YU-WA Creation Holdings	11.4	5.7	729
コロワイド	87	76.7	150,830
ピーシーデポコーポレーション	22.2	—	—
荅番屋	15	70.8	78,092
P L A N T	4.1	1.5	2,329
スギホールディングス	38.1	108	246,834
薬王堂ホールディングス	10.7	8.8	24,068
スクロール	28.6	26.9	27,814
ヨンドシーホールディングス	16.5	17.1	31,977
木曽路	28.8	27.1	66,611

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
S R Sホールディングス	31.7	29.7	34,749
千趣会	36	32.8	10,463
リテールパートナーズ	28.4	26.7	43,067
ケーヨー	30.6	—	—
上新電機	17.1	17.8	45,212
日本瓦斯	101.4	94.7	221,503
ロイヤルホールディングス	36.6	31.4	81,388
いなげや	18.5	17.4	21,245
チヨダ	18.7	17.4	15,486
ライフコーポレーション	16.6	18.7	76,015
リンガーハット	24.4	23	52,325
M r M a x HD	27.3	23	15,042
AOKIホールディングス	35.7	38.5	47,509
オークワ	30.4	25.8	23,271
コメリ	29.2	27.5	99,962
青山商事	40.8	38.4	56,832
しまむら	22.2	41.9	313,202
はせがわ	8.4	3.8	1,288
高島屋	142.5	123.3	301,776
松屋	32.2	30.4	29,184
エイチ・ツー・オー リテイリング	92	79	188,336
近鉄百貨店	8.3	7.8	16,426
丸井グループ	139.4	118.5	268,698
アクシアル リテイリング	13	49	47,579
イオン	640.3	604.8	1,987,977
イズミ	28.8	31.7	105,180
平和堂	31.6	29.9	69,368
フジ	29.1	27.4	51,512
ヤオコー	21.4	21.1	189,773
ゼビオホールディングス	26	24.5	27,636
ケーズホールディングス	133.9	120.1	170,421
O l y m p i c グループ	6.4	3.3	1,679
日産東京販売ホールディングス	20.2	9.4	4,765
シルバーライフ	4	5.2	4,576
Genky DrugStores	8.4	7.9	44,161
ナルミヤ・インターナショナル	2.9	1.2	1,568
ブックオフグループホールディングス	10	11.9	17,885
ギフトホールディングス	4.1	7.7	22,314
アインホールディングス	26.1	24.6	141,400
元気寿司	5.5	10.2	31,875
ヤマダホールディングス	775.6	549.5	237,823
アークランズ	28	53.3	102,016
ニトリホールディングス	76.4	65	1,119,950
グルメ杵屋	15.8	14.8	16,058
愛眼	10.8	4.4	800

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)
ケーユーホールディングス	11.4	8.7	10,135			
吉野家ホールディングス	74.1	65.8	187,859			
松屋フーズホールディングス	9	8.5	44,965			
サガミホールディングス	30.7	27	40,716			
関西フードマーケット	17.4	12.3	30,381			
王将フードサービス	12.5	13.3	112,917			
ミニストップ	13.8	13	20,215			
アークス	34.8	32.8	94,857			
パローホールディングス	36.3	34.2	80,951			
ベルク	9.5	8.9	63,635			
大庄	8.4	9.8	11,760			
ファーストリテイリング	85	100.3	4,054,126			
サンドラッグ	71.8	60.3	233,964			
サックスパー ホールディングス	18.5	15.5	11,671			
ヤマザワ	3.1	1.5	1,902			
やまや	3.2	1.3	3,919			
ペルーナ	46.2	43.5	30,711			
<b>銀行業(8.0%)</b>						
いよぎんホールディングス	209.2	197.6	282,074			
しずおかフィナンシャルグループ	397.3	369	571,765			
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	148	139.8	229,551			
楽天銀行	—	77	218,603			
京都フィナンシャルグループ	—	210.4	567,448			
島根銀行	4.7	1.6	897			
じもとホールディングス	12.1	4.9	1,803			
めづきフィナンシャルグループ	872.3	769.6	469,994			
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22.5	21.3	99,790			
九州フィナンシャルグループ	309.3	321.4	326,863			
ゆうちょ銀行	492.6	1,824.9	2,789,359			
富山第一銀行	58.4	52.7	58,338			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	968.9	891.1	834,871			
西日本フィナンシャルホールディングス	109.1	93.2	193,390			
三十三フィナンシャルグループ	15.7	14.9	30,857			
第四北越フィナンシャルグループ	27.6	26.1	127,368			
ひろぎんホールディングス	229.4	236.4	291,717			
おきなわフィナンシャルグループ	16.7	14.2	36,877			
十六フィナンシャルグループ	22.8	21.5	99,007			
北國フィナンシャルホールディングス	19.8	17.5	90,825			
プロクレアホールディングス	21.5	19	34,200			
あいちフィナンシャルグループ	24.6	34.1	88,012			
SBI新生銀行	41.1	—	—			
あおぞら銀行	110.5	119.3	281,488			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,009.9	10,113.5	16,555,799			
りそなホールディングス	2,222	1,920.6	1,966,694			
三井住友トラスト・ホールディングス	319.5	596.3	2,119,250			

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)
三井住友フィナンシャルグループ	1,284.7	1,180.7	11,854,228			
千葉銀行	489.9	462.8	662,729			
群馬銀行	341.1	322.3	336,320			
武蔵野銀行	22.6	23.2	73,080			
千葉興業銀行	32	35.3	34,099			
筑波銀行	77.1	72.9	23,036			
七十七銀行	56.3	48.3	222,904			
秋田銀行	11.8	11.1	27,128			
山形銀行	19.5	18.4	20,497			
岩手銀行	12	10.5	28,087			
東邦銀行	139.1	131.4	44,281			
東北銀行	6.7	2.7	3,272			
ふくおかフィナンシャルグループ	140.3	144.6	638,119			
スルガ銀行	155	146.4	151,670			
八十二銀行	360.6	356.4	379,744			
山梨中央銀行	18.1	18.6	36,009			
大垣共立銀行	33.5	31.7	70,183			
福井銀行	15.7	14.8	28,682			
清水銀行	7	6.6	10,513			
富山銀行	2.1	0.9	1,634			
滋賀銀行	29.2	27.6	117,162			
南都銀行	26.5	25	87,875			
百五銀行	165.4	156.2	104,341			
京都銀行	55.7	—	—			
紀陽銀行	62.9	59.4	110,305			
ほくほくフィナンシャルグループ	111.7	102.8	223,692			
山陰合同銀行	110	103.9	148,577			
鳥取銀行	4.4	1.9	2,593			
百十四銀行	16	16.3	53,708			
四国銀行	27.9	24.3	27,191			
阿波銀行	24.7	23.3	65,076			
大分銀行	10.6	10	33,950			
宮崎銀行	11.5	10	33,700			
佐賀銀行	10.3	9.7	25,520			
琉球銀行	40.3	35.3	42,889			
セブン銀行	629.8	520.5	136,683			
みずほフィナンシャルグループ	2,542.5	2,241.6	7,020,691			
高知銀行	4.7	1.9	1,683			
山口フィナンシャルグループ	194.1	162.8	298,086			
長野銀行	4.2	—	—			
名古屋銀行	11.6	10.6	77,592			
北洋銀行	266.4	251.6	137,625			
大光銀行	4.1	1.8	3,110			
愛媛銀行	23.7	22.4	27,036			
トマト銀行	4.5	2	2,400			

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)	
京葉銀行	80.5	68.4	56,703	
栃木銀行	80.5	82.9	31,336	
北日本銀行	6.2	5.4	13,581	
東和銀行	32.3	30.5	20,923	
福島銀行	14.4	5.8	1,560	
大東銀行	5.3	2.4	1,723	
トモニホールディングス	142.1	157.2	62,880	
フィデアホールディングス	18.2	17.2	27,709	
池田泉州ホールディングス	225.1	230.3	93,962	
<b>証券、商品先物取引業(0.9%)</b>				
F P G	59.6	61.8	124,712	
ジャパンインベストメントアドバイザー	14.5	27	35,127	
マーキュリアホールディングス	8.3	2.9	2,404	
S B I ホールディングス	254.6	266.5	1,039,350	
ジャフコ グループ	58.8	49.5	91,253	
大和証券グループ本社	1,257.4	1,286.5	1,521,286	
野村ホールディングス	3,238	2,792.8	2,592,276	
岡三証券グループ	154.7	145.9	111,029	
丸三証券	58.9	55.3	55,853	
東洋証券	59	44.3	16,125	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	191.9	197.3	115,223	
光世証券	3.5	1.4	834	
水戸証券	47.8	49.2	26,125	
いちよし証券	32.7	31.2	25,178	
松井証券	104.1	81.8	65,440	
マネックスグループ	189.8	162.8	127,146	
極東証券	22.2	22.8	32,467	
岩井コスモホールディングス	20.2	19	41,800	
アイザワ証券グループ	25.6	24	47,544	
マネーパートナーズグループ	14.9	6	1,506	
スパークス・グループ	19.7	18.5	31,857	
<b>保険業(3.0%)</b>				
かんぽ生命保険	213.4	169.1	484,556	
F P パートナー	—	4.4	17,886	
SOMPOホールディングス	301.7	749.5	2,477,847	
アニコム ホールディングス	59.7	56.4	33,558	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	357.8	1,115.5	3,698,998	
第一生命ホールディングス	858.9	780.8	3,245,785	
東京海上ホールディングス	1,737.7	1,621.4	8,692,325	
T&Dホールディングス	471.8	445.9	1,223,772	
アドバンスクリエイト	10.2	10.6	10,525	
<b>その他金融業(1.2%)</b>				
NEXYZ. G r o u p	—	2.6	1,560	
全国保証	46	43.5	243,469	

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)	
あんしん保証	7.9	4.6	1,002	
イントラスト	5.6	2.7	2,141	
日本モーゲージサービス	8.2	4.1	1,644	
C a s a	5.7	2.7	2,286	
S B I アルヒ	22	16.6	13,827	
プレミアムグループ	29.8	28.3	58,637	
ネットプロテクションズホールディングス	59.1	57.7	9,405	
クレディセゾン	111.6	105.4	351,087	
芙蓉総合リース	16.2	15.3	189,796	
みずほリース	26.3	139.5	144,801	
東京センチュリー	32.9	124.5	177,288	
日本証券金融	70.8	61.4	97,933	
アイフル	292.2	245.7	98,280	
リコーリース	16.8	15.9	79,818	
イオンフィナンシャルサービス	101.2	95.8	125,450	
アコム	314.8	297.7	118,008	
ジャックス	18.8	17.8	85,796	
オリエン트コーポレーション	46.2	54.7	56,669	
オリックス	1,154.1	996.1	3,330,958	
三菱HCキャピタル	685.9	740.5	750,126	
九州リースサービス	6.8	2.6	2,886	
日本取引所グループ	494.1	428.3	1,574,002	
イー・ギャランティ	28.7	27.4	36,524	
アサックス	6.7	3.1	2,610	
NECキャピタルソリューション	8.7	8.3	31,706	
<b>不動産業(1.9%)</b>				
r o b o t h o m e	—	49.8	8,067	
大東建託	64.5	60.9	995,715	
いちご	209.6	192.5	72,957	
日本駐車場開発	193.5	200.5	38,095	
スター・マイカ・ホールディングス	18.6	20.2	11,998	
S R E ホールディングス	9.1	7.3	26,280	
ADワークスグループ	34.4	14	3,150	
ヒューリック	411.5	387.7	558,481	
三栄建築設計	9.7	—	—	
野村不動産ホールディングス	110.4	92.6	356,407	
三重交通グループホールディングス	40.8	36.5	20,184	
サムティ	28.8	26.6	68,441	
ディア・ライフ	32.4	28.8	24,336	
地主	14.3	12.9	29,799	
プレサンスコーポレーション	28.7	26.6	45,778	
ハウスコム	3.9	1.5	1,452	
J P M C	10.4	10	11,850	
サンセイランディック	6	2.1	2,091	
フージャースホールディングス	27.1	25.6	27,494	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
オープンハウスグループ	64.7	61	265,472
東急不動産ホールディングス	530.9	499.8	512,794
飯田グループホールディングス	154.7	159.4	329,001
イーグラント	3.3	1.2	1,844
ムゲンエステート	11.8	4.1	4,583
And Doホールディングス	10.4	10	11,400
シーアールイー	11.1	9.7	12,532
ケイアイスター不動産	8.9	8.1	27,013
グッドコムアセット	18.4	16.1	10,416
ジェイ・エス・ビー	4.8	8.5	22,975
ロードスターキャピタル	11.2	11	31,471
テンポイノベーション	5.8	2.3	1,932
フェイスネットワーク	5.1	1.9	3,121
霞ヶ関キャピタル	—	6.8	110,908
パーク24	137.8	108.2	173,065
パラカ	7.1	6.2	12,232
三井不動産	760.4	2,304.3	3,206,433
三菱地所	1,061.9	1,085.7	2,775,049
平和不動産	29	27.1	102,844
東京建物	168.6	145.3	351,626
京阪神ビルディング	31.1	31.4	47,288
住友不動産	318.4	240.3	1,147,432
テーオーシー	34.6	30.3	20,543
東京楽天地	3.3	—	—
レオパレス21	—	166.2	86,756
スターツコーポレーション	25.9	24	77,040
フジ住宅	27.2	21.7	15,906
空港施設	24.4	24.3	14,482
明和地所	8.6	11.2	10,304
ゴールドクレスト	17.8	13.7	32,099
エスリード	9	8	31,640
日神グループホールディングス	32	27.7	14,043
日本エスコン	39.5	31.1	31,846
MIRARTHホールディングス	88.8	76.3	36,089
AVANTIA	9.8	3.7	3,041
イオンモール	92.1	86.4	160,531
毎日コムネット	7.3	2.7	2,079
ファースト住建	7.2	2.7	2,802
カチタス	47.9	44.9	71,166
トーセイ	30.3	27.9	60,431
穴吹興産	3.5	1.6	3,515
サンフロンティア不動産	30.6	24.9	48,057
FJネクストホールディングス	20.3	17.9	21,587
インテリックス	3.3	1.3	705
ランドビジネス	5	2	484

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
サンネクスタグループ	5.8	2.3	2,341
グランディハウス	14.7	14.9	8,493
日本空港ビルデング	62.4	58.8	322,165
<b>サービス業(4.4%)</b>			
明豊ファシリティアワークス	7.6	3.2	2,822
日本工営	11.1	—	—
LIFULL	64.1	60.6	9,514
MIXI	41.9	37.3	104,328
ジェイエイシーリクルートメント	16.7	63	41,643
日本M&Aセンターホールディングス	315.2	276.5	202,121
メンバーズ	5.6	6.2	4,929
中広	2.8	1.5	829
UTグループ	27.1	22.6	66,082
アイティメディア	7.2	6.8	11,934
ケアネット	—	35.9	17,914
E・Jホールディングス	10.9	10.3	18,467
オープンアップグループ	55.2	52.2	104,086
コシダカホールディングス	55.2	52.2	42,804
アルトナー	3.7	2.5	5,090
パソナグループ	22.4	21.1	44,710
CDS	3.7	1.6	2,800
リンクアンドモチベーション	52.8	49.9	20,958
エス・エム・エス	69.9	60.9	110,959
サニーサイドアップグループ	4.7	2.4	1,598
パーソルホールディングス	205.5	1,765.7	388,454
リニカル	8.5	4.3	1,659
クックパッド	52	49	8,477
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7.5	3.1	2,309
学情	8.5	9	15,453
スタジオアリス	9.3	8.8	17,626
シミックホールディングス	9	—	—
エプコ	3.5	1.9	1,539
NJS	4.2	3.9	13,318
総合警備保障	68.2	289.8	271,542
カカクコム	134.8	112.6	209,604
アイロムグループ	6.8	7.1	19,766
セントケア・ホールディング	12.1	12.9	10,461
サイネックス	3	1.3	923
ルネサンス	13.2	13.7	12,645
ディップ	32.2	26.6	68,867
デジタルホールディングス	14.6	9.2	9,227
新日本科学	19.6	15.9	21,003
キャリアデザインセンター	3.2	1.2	1,988
ベネフィット・ワン	85.2	—	—
エムスリー	362.7	342.7	512,850

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
ツカダ・グローバルホールディング	9.2	3.7	1,764
アウトソーシング	109.5	—	—
ウェルネット	11.4	5.6	3,477
ワールドホールディングス	8.4	7.9	17,024
ディー・エヌ・エー	73.5	61.8	85,562
博報堂DYホールディングス	234.2	221.2	283,578
ぐるなび	34.6	33.1	9,764
タカミヤ	25.5	24	11,400
ジャパンベストレスキューシステム	9.1	—	—
ファンコミュニケーションズ	36.7	24.9	10,184
ライク	7	6.6	10,434
A o b a - B B T	6.1	2.8	982
エスプール	53.3	50.6	16,343
WDBホールディングス	9.5	9	15,462
ティア	9.1	4.4	2,019
CDG	1.8	0.8	1,039
アドウェイズ	25.7	24.5	9,261
バリューコマース	14	15.4	17,710
インフォマート	191.6	180.7	52,764
J Pホールディングス	53.7	44.9	22,405
エコナックホールディングス	27.9	6.9	869
CLホールディングス	5.4	4.3	5,658
プレステージ・インターナショナル	77.7	81.5	52,730
アミューズ	10.1	10.7	16,863
ドリームインキュベータ	5.7	6	12,798
クイック	14.2	12.2	26,108
T A C	8.5	4.1	733
電通グループ	180.4	170.4	698,810
イオンファンタジー	8	6.3	13,494
シーティーエス	20.7	22.2	16,627
NEXYZ. G r o u p	4.9	—	—
H. U. グループホールディングス	53.8	50.9	126,104
アルプス技研	16.1	16.5	41,893
日本空調サービス	20.1	18.9	18,389
オリエンタルランド	971.1	917.4	4,007,203
ダスキン	40.9	38.5	137,637
明光ネットワークジャパン	22.8	21.4	15,215
ファルコホールディングス	8.5	7.8	17,784
ラウンドワン	154	163.7	109,024
リゾートトラスト	72.6	75.4	182,430
ビー・エム・エル	22.9	21.4	57,994
りらいあコミュニケーションズ	30.5	—	—
リソー教育	84.5	89.5	23,270
早稲田アカデミー	10.4	9.8	15,003
ユー・エス・エス	188.8	389.1	483,651

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
東京個別指導学院	22.3	21.2	8,670
サイバーエージェント	405.7	383.3	360,148
楽天グループ	958.6	1,487.6	1,191,121
クリーク・アンド・リバー社	10.9	8.9	14,845
SBIグローバルアセットマネジメント	30.6	34.3	22,157
テー・オー・ダブリュー	36.9	34.6	12,179
山田コンサルティンググループ	9.5	7.7	14,560
セントラルスポーツ	7	6.6	16,275
フルキャストホールディングス	17.6	16.7	23,229
エン・ジャパン	33.3	28.3	72,815
リソルホールディングス	1.4	0.6	2,898
テクノプロ・ホールディングス	108.7	101.6	264,261
アトラグループ	3.2	1.7	272
インターワークス	4.6	—	—
アイ・アルジャパンホールディングス	9.7	9.2	11,242
Keep er 技研	11.4	10.8	39,960
ファーストロジック	2	2.3	1,145
三機サービス	2.4	1.2	1,482
G u n o s y	15.1	14.1	9,813
デザインワン・ジャパン	5.3	3.6	500
イー・ガーディアン	7.1	8.4	15,472
リブセンス	7.7	3.7	817
ジャパンマテリアル	56.3	53.2	103,686
ベクトル	29	21.4	27,584
ウチヤマホールディングス	7.1	3.2	1,084
チャーム・ケア・コーポレーション	15.6	14.6	21,067
キャリアリンク	6.8	6.5	15,463
I B J	11.7	13.7	7,946
アサンテ	9.3	8.7	14,668
バリューHR	16.2	15.3	21,114
M&Aキャピタルパートナーズ	14.9	14.1	29,046
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.8	7.1	7,447
ERIホールディングス	3.9	1.7	3,921
アピスト	2.3	1	3,305
シグマクス・ホールディングス	28.1	22.9	30,731
ウィルグループ	15.6	14.7	13,744
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	17.2	8.6	1,195
メドピア	16.4	15.5	8,866
レアジョブ	3	1.5	637
リクルートホールディングス	1,358.6	1,248.4	9,692,577
エラン	24.6	23.2	19,186
土木管理総合試験所	6.9	3.4	1,094
日本郵政	2,405.2	2,037.1	2,954,813
ベルシステム24ホールディングス	24.8	18.8	29,497
鎌倉新書	21.2	15.2	8,040

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
SMN	4.1	1.8	523
グローバルキッズCOMPANY	3.1	1.5	964
エアトリ	13.5	12.9	16,163
アトラエ	11.2	13.7	8,548
ストライク	7.8	8.6	34,314
ソラスト	51.1	48.3	22,073
セラク	5.8	5.5	5,835
インソース	40.1	37.9	35,095
ベイクレント・コンサルティン	145.3	127.5	410,677
Orchestra Holdings	4.2	4	5,172
アイモバイル	8.4	22.6	10,328
キャリアインデックス	5.9	3.4	564
MS-Japan	5	7.3	7,300
船場	2.9	1.4	1,736
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	65.6	56.3	156,119
フルテック	2.3	1	1,111
GameWith	5.1	3.4	958
MS&Consulting	2.2	1.2	715
ウェルビー	14	—	—
エル・ティール・エス	2.5	2.1	4,338
ミダックホールディングス	11.3	10.7	15,290
日総工産	14.1	—	—
キュービネットホールディングス	8.9	10.2	11,332
RPAホールディングス	25.7	24.5	5,929
スプリックス	4.5	2	1,554
マネジメントソリューションズ	10.2	7.6	12,783
プロレド・パートナーズ	5.1	4.8	3,129
テノ. ホールディングス	2.2	1.3	542
フロンティア・マネジメント	6.4	4.5	5,584
ピアラ	2.9	—	—
コプロ・ホールディングス	2.5	2	2,834
ギークス	2.3	1.3	583
アンビスホールディングス	19.7	37.2	74,176
カープスホールディングス	50.6	47.7	34,153
フォーラムエンジニアリング	11	23.9	19,837
Fast Fitness Japan	6.5	6.1	7,496
ダイレクトマーケティングミックス	22.2	18.9	4,384
ポピンズ	2.9	2.8	3,438
LITALICO	14.4	13.6	23,024
コンフィデンス・インターワークス	—	0.7	1,248
アドバンテッジリスクマネジメント	7	3.6	1,674
リログループ	102.3	87	133,980

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
東祥	13	12.4	8,580
ID&Eホールディングス	—	10.5	43,155
ビーウィズ	4.8	3.7	7,096
TREホールディングス	38.9	33.4	37,374
人・夢・技術グループ	7.1	7.1	12,041
NISSOホールディングス	—	15.3	12,500
大栄環境	46.8	31.6	77,325
日本管財ホールディングス	19.4	18.3	45,859
M&A総研ホールディングス	—	18.5	73,445
エイチ・アイ・エス	48.1	50.5	84,385
ラックランド	7.7	8	13,896
共立メンテナンス	31.5	54.5	163,936
イチネンホールディングス	19.7	18.5	29,877
建設技術研究所	9.5	9	44,055
スペース	13.6	11.6	12,203
燦ホールディングス	8	16.5	19,107
スバル興業	0.9	5.8	15,271
東京テアトル	5.2	2.1	2,314
タナベコンサルティン	5.9	6.5	6,506
ナガワ	5	5.4	39,582
東京都競馬	15.4	14.6	59,641
カナモト	33.8	27	70,092
ニシオホールディングス	17.2	16.1	61,824
トランス・コスモス	22.9	21.6	71,064
乃村工藝社	80.4	75.9	61,554
藤田観光	8.1	6.9	41,400
KNT-CTホールディングス	10.9	10.3	13,513
トーカイ	16.4	15.5	31,527
セコム	186.9	176.6	1,746,044
セントラル警備保障	10	9.4	26,865
丹青社	35.9	33.9	27,391
メイテックグループホールディングス	71.7	62.2	188,590
応用地質	17.3	16.3	41,646
船井総研ホールディングス	38.3	34.8	74,506
進学会ホールディングス	5.7	2.5	595
オオバ	9.3	4.1	4,423
いであ	3.3	1.7	3,962
学究社	7.5	7	14,525
ベネッセホールディングス	68.7	—	—
イオンディライト	20.4	18.7	71,901
ナック	8.4	15.2	7,980

銘柄	当 期 末	当 期	
		株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ダイセキ	37.5	35.5	110,227
ステップ	6.8	6.4	12,179
合 計	株数・金額 208,833	270,769	652,736,925
	銘柄数<比率>	2,065	<98.2%>

(注1) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(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	11,560	—

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	652,736,925	98.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	12,061,145	1.8
投 資 信 託 財 産 総 額	664,798,070	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 2024年5月29日現在
(A)資 産	664,759,117,889円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,461,229,728
株 式(評価額)	652,736,925,880
未 収 入 金	59,807,700
未 収 配 当 金	6,150,757,503
未 収 利 息	10,175
差 入 委 託 証 拠 金	350,386,903
(B)負 債	105,648,420
未 払 解 約 金	105,648,420
(C)純 資 産 総 額(A-B)	664,653,469,469
元 本	233,518,775,755
次 期 繰 越 損 益 金	431,134,693,714
(D)受 益 権 総 口 数	233,518,775,755口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,463円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A)配 当 等 収 益	14,199,685,901円
受 取 配 当 金	14,193,776,372
受 取 利 息	750,267
そ の 他 収 益 金	6,283,209
支 払 利 息	△1,123,947
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	144,928,997,467
売 買 益	165,351,440,867
売 買 損	△20,422,443,400
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,526,466,050
取 引 益	1,985,653,300
取 引 損	△459,187,250
(D)そ の 他 費 用	△176
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	160,655,149,242
(F)前 期 繰 越 損 益 金	304,596,966,996
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	37,563,748,978
(H)解 約 差 損 益 金	△71,681,171,502
(I)計 (E+F+G+H)	431,134,693,714
次 期 繰 越 損 益 金(I)	431,134,693,714

(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255,447,146,244円、期中追加設定元本額は24,993,586,662円、期中一部解約元本額は46,921,957,151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)	49,018,325,430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)	41,389,074,744円
DCマイセレーション75	17,871,476,401円
国内株式SMTBセレーション(SMA専用)	15,602,036,566円
DCマイセレーション50	15,537,273,602円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,481,131,615円
DC日本株式インデックス・オープンS	9,561,540,230円
DCマイセレーションS50	9,178,172,690円
DCマイセレーションS75	8,607,822,388円
DC日本株式インデックス・オープン	6,012,945,920円
世界経済インデックスファンド	6,005,092,869円
分散投資コア戦略ファンドS	5,988,441,971円
DCマイセレーション25	4,666,264,841円
DC世界経済インデックスファンド	3,958,052,517円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,258,378,877円
DCマイセレーションS25	2,895,825,312円
日本株式インデックス・オープン	2,825,985,903円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,364,121,693円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	2,192,493,248円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,956,879,985円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,895,661,012円
分散投資コア戦略ファンドA	1,695,277,593円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,284,647,733円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	676,053,958円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	656,565,023円
コア投資戦略ファンド(切替型)	573,424,327円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	552,947,571円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,366,846円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	492,281,238円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	451,060,171円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	415,092,606円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	402,936,024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)	360,881,340円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	289,307,233円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	288,418,440円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	288,030,221円
グローバル経済コア	273,202,612円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	268,612,952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)	243,803,589円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	241,467,366円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	215,804,436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)	204,191,612円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	194,507,065円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	185,954,933円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	162,430,682円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	156,681,751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)	135,837,809円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	125,410,997円
10資産分散投資ファンド	113,723,354円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	63,722,735円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	62,430,230円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	60,324,905円

DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,974,905円
SMT 世界経済インデックス・オープン	52,564,168円
SMT インデックスバランス・オープン	49,936,007円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	40,514,138円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	39,448,594円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	33,957,540円
グローバル10資産バランスファンド	33,224,772円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	33,052,735円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	30,441,480円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	27,133,166円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	25,771,657円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	25,271,837円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	15,960,135円
私募世界経済バシンプファンド(適格機関投資家専用)	15,833,273円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	13,949,675円
SBI資産設計オープン(分配型)	12,767,408円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	12,459,639円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	12,243,691円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	12,108,987円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	9,552,242円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,551,680円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	9,300,182円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	3,269,905円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,841,719円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	38,209円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	38,209円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	35,914円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	32,814円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	32,694円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	20,588円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	20,340円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	18,210円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	14,076円

## お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)

# 外国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第24期（決算日 2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	原則として、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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	騰落率	ベンチマーク		株組 比率	式入 率	株先 比率	式物 率	投資信託 証券組 入比率	純資産 総額
			期中 騰落率	期中 騰落率						
第20期(2020年5月29日)	円 25,857	% 3.4		% 3.6	% 92.9	% 4.2	% 2.5	% 2.5	百万円 399,725	
第21期(2021年5月31日)	37,583	45.3	40,792	45.8	95.3	2.5	2.2	517,603		
第22期(2022年5月30日)	41,948	11.6	45,606	11.8	94.1	3.7	2.3	523,424		
第23期(2023年5月29日)	47,791	13.9	52,071	14.2	95.6	2.5	2.0	581,354		
第24期(2024年5月29日)	66,749	39.7	72,993	40.2	95.4	2.9	1.7	770,315		

(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	騰落率	ベンチマーク		株組 比率	式入 率	株先 比率	式物 率	投資信託 証券組 入比率
			騰落率	騰落率					
(当期首) 2023年 5月29日	円 47,791	% -		% -	% 95.6	% 2.5	% 2.0	% 2.0	
5月末	47,366	△0.9	51,624	△0.9	95.4	2.7	2.0		
6月末	51,092	6.9	55,723	7.0	96.4	1.6	2.0		
7月末	51,873	8.5	56,582	8.7	95.9	2.2	2.0		
8月末	52,777	10.4	57,565	10.6	95.7	2.3	2.0		
9月末	51,507	7.8	56,180	7.9	95.1	3.0	1.9		
10月末	49,769	4.1	54,309	4.3	96.0	2.2	1.9		
11月末	53,682	12.3	58,567	12.5	95.4	2.7	1.9		
12月末	54,634	14.3	59,682	14.6	96.2	1.7	2.0		
2024年 1月末	57,975	21.3	63,266	21.5	96.9	1.1	1.9		
2月末	60,773	27.2	66,346	27.4	96.8	1.4	1.9		
3月末	63,305	32.5	69,156	32.8	95.8	2.3	1.9		
4月末	64,150	34.2	70,086	34.6	95.7	2.5	1.8		
(当期末) 2024年 5月29日	66,749	39.7	72,993	40.2	95.4	2.9	1.7		

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）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。

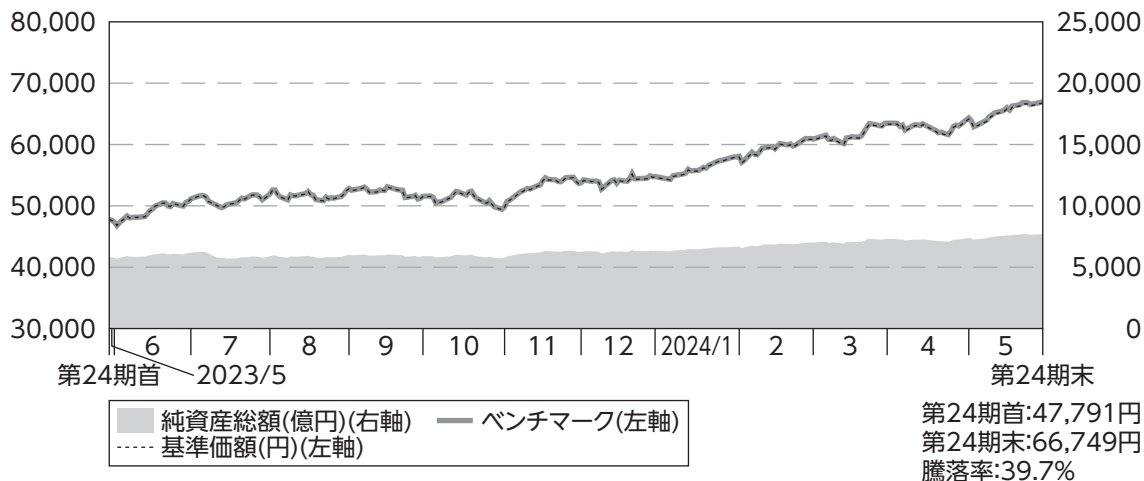
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIコクサイ・インデックス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MSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

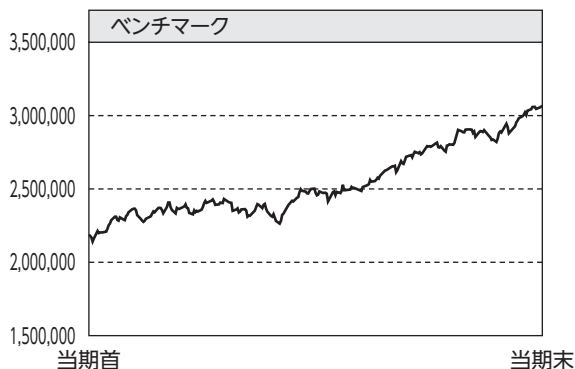


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

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

## 投資環境



先進国株式市場は、大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、各国中央銀行が政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから2023年10月にかけて下落しました。11月以降は、物価指標の伸びが鈍化したことで主要国で早期の利下げ転換期待が高まったことや、生成AI(人工知能)市場の成長期待を背景に半導体関連株が買われたことなどから上昇しました。4月は中東情勢の緊迫化が嫌気される場面もありましたが、期末にかけては米国で雇用指標の鈍化を受けて利下げ観測が強まったことなどから高値圏で終了しました。

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MSCIコクサイ・インデックス(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、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。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

### (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、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

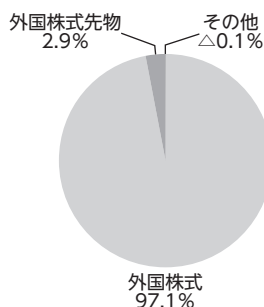
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.8%
2	NVIDIA CORP	アメリカ	4.4%
3	APPLE INC	アメリカ	4.4%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.7%
5	S&P 500 EMIN 2406	アメリカ	2.2%
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	1.7%

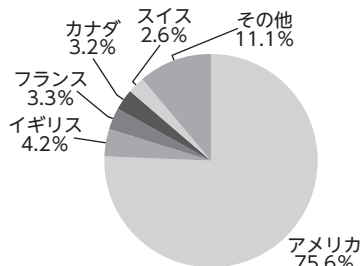
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
9	ELI LILLY & CO	アメリカ	1.0%
10	BROADCOM INC	アメリカ	1.0%
組入銘柄数			1,257

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

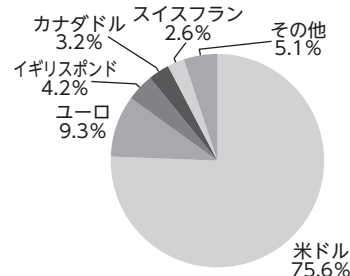
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

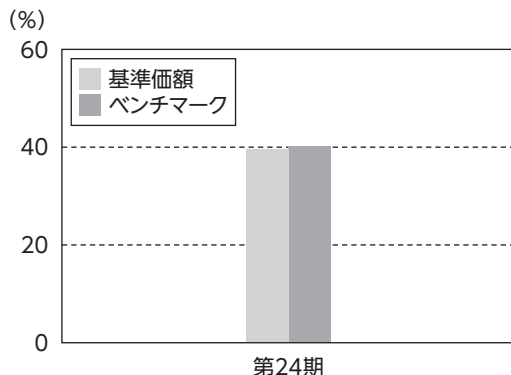


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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2.9%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、配当課税要因\*1および為替評価差要因\*2(いずれもマイナス要因)です。

\*1 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(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
	(2023年5月30日~2024年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	2円 (1) (-) (-) (-) (0) (-) (0)	0.003% (0.002) (-) (-) (-) (0.000) (-) (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
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	1 (1) (-) (-) (-) (-) (0)	0.002 (0.002) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	15  (15)  (-) (0)	0.027  (0.027)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	18	0.032	

(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(54,908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 17,741 (5,692)	千米ドル 158,820 (4,161)	百株 28,694 (238)	千米ドル 289,535 (3,463)
	カ ナ ダ	2,743 (330)	千カナダドル 13,593 (2,166)	3,897 (132)	千カナダドル 18,413 (2,248)
	ド イ ツ	1,263 (-)	千ユーロ 6,511 (△291)	3,022	千ユーロ 9,776
	イ タ リ ア	2,496 (-)	2,438 (△3)	3,414	3,485
	フ ラ ン ス	1,456 (305)	6,293 (△139)	3,259 (-)	13,369 (0.00001)
	オ ラ ン ダ	1,919 (1,002)	6,054 (1,063)	2,669 (810)	7,687 (1,026)
	ス ペ イ ン	696 (9,392)	1,015 (△822)	3,967 (9,549)	3,314 (252)
	ベ ル ギ ー	60 (53)	1,006 (-)	194	1,389
	ル ク セ ン ブ ル ク	103	255	728	267
	フ ィ ン ラ ン ド	70 (2,697)	255 (2,299)	1,011	797
	ア イ ル ラ ン ド	633	938	123 (686)	1,003 (4,928)
	ポ ル ト ガ ル	1,529	1,144	1,461	1,099
	そ の 他	- (-)	- (△43)	468	260
	国	イ ギ リ ス	17,864 (1,480)	千イギリスポンド 8,494 (4,235)	26,792
ス イ ス		706 (304)	千スイスフラン 6,893 (△265)	4,094	千スイスフラン 10,997
ス ウ ェ ー デ ン		1,969 (833)	千スウェーデンクローナ 33,715 (-)	5,362 (2,366)	千スウェーデンクローナ 56,592 (26,001)
ノ ル ウ ェ ー		508	千ノルウェークローネ 6,103	869	千ノルウェークローネ 10,138
デ ン マ ー ク		363 (1,286)	千デンマーククローネ 16,493 (-)	485	千デンマーククローネ 27,320

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	2,972 (△298)	千オーストラリアドル 8,414 (-)	4,805 (243)	千オーストラリアドル 11,312 (1,579)
	ニュージーランド	1,216	千ニュージーランドドル 627	1,617	千ニュージーランドドル 817
	香 港	3,151	千香港ドル 11,978	7,224	千香港ドル 24,556
	シンガポール	7,810 (△20,309)	千シンガポールドル 2,394 (-)	8,132 (-)	千シンガポールドル 2,557 (17)
	イスラエル	-	千イスラエルシェケル -	1,920	千イスラエルシェケル 2,654

(注1)金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	カ ナ ダ	証券 - (1,490)	千カナダドル - (-)	証券 -	千カナダドル -

(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。

<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
PROLOGIS INC	2	263	4	588
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	266	1	240
CROWN CASTLE INC	2	244	3	376
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	—	—	3	239
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9	160	—	—
WELLTOWER INC	11	995	2	234
REALTY INCOME CORP	19	1,061	4	289
SIMON PROPERTY GROUP	2	270	2	242
PUBLIC STORAGE	0.856	242	1	299
SUN COMMUNITIES INC	2	330	1	238
EXTRA SPACE STORAGE INC	6	941	1	234
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	551	4	528
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	50	409
AMERICAN TOWER CORPORATION	1	288	2	549
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	—	—	30	463
NET LEASE OFFICE PROPERTY	— (1)	— (—)	1	11
EQUINIX INC	0.382	274	0.448	349
VICI PROPERTIES INC	16	511	8	254
SBA COMMUNICATIONS CORP	1	281	1	242
小 計	83 (1)	6,685 (—)	125	5,794
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	— (—)	— (△14)	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	— (—)	— (△26)	—	—
小 計	— (—)	— (△40)	—	—
ユ ー ロ 計	— (—)	— (△40)	—	—
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	—	—	79	257

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	SEGRO PLC	—	—	25	180
	小計	—	—	104	438
	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
	GOODMAN GROUP	18	440	17	356
	LENLEASE GROUP	—	—	64	428
	小計	18	440	82	784
	香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
	LINK REIT	38	1,749	42	1,813
	小計	38	1,749	42	1,813
	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	— (—)	— (△1)	—	—
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	— (—)	— (△3)	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	— (—)	— (△9)	—	—
	KEPPEL REIT	— (22)	— (17)	22	17
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	— (—)	— (△2)	—	—
	小計	— (22)	— (0.64863)	22	17

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	120,506	115,879	—	—

(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	91,620,186千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	611,615,494千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.14

(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 40,245	百万円 —	% —	百万円 71,737	百万円 139	% 0.2
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	197,704	22,429	11.3	197,491	22,380	11.3

(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	7,270	7,175	130,700	20,572,194	一般消費財・サービス流通・小売り
ABBOTT LABORATORIES	1,372	1,332	13,589	2,139,023	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	543	543	1,148	180,843	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	716	710	12,059	1,898,208	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,277	1,247	21,401	3,368,620	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	366	348	16,693	2,627,613	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	332	309	8,138	1,280,988	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	174	174	4,625	728,048	素材
ALLSTATE CORP	207	207	3,412	537,094	保険
HONEYWELL INTL INC	526	510	10,163	1,599,744	資本財
AMGEN	424	409	12,295	1,935,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HESS CORP	215	216	3,284	516,993	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	503	450	10,677	1,680,665	金融サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	399	407	3,608	567,994	公益事業
AFLAC	468	431	3,769	593,285	保険
AMERICAN INT'L GROUP	595	545	4,218	664,031	保険
ANALOG DEVICES	400	377	8,822	1,388,608	半導体・半導体製造装置
VALERO ENERGY CORP	307	262	4,298	676,654	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	3,448	3,099	11,947	1,880,478	メディア・娯楽
ANSYS INC	67	67	2,228	350,840	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	12,628	11,339	215,434	33,909,346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	680	648	14,344	2,257,845	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	94	84	1,073	168,979	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	438	406	2,473	389,286	食品・飲料・タバコ
AMEREN CORPORATION	208	208	1,488	234,300	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	43	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTODESK INC	174	170	3,583	564,115	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	328	319	7,765	1,222,351	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	14	13	3,830	602,904	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	66	66	1,492	234,980	素材
BALL CORP	256	258	1,746	274,969	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,033	1,012	40,913	6,439,841	金融サービス
BANK NEW YORK CO	612	563	3,280	516,366	金融サービス
BAXTER INTERNATIONAL	400	415	1,407	221,516	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	224	221	5,021	790,432	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	177	177	2,988	470,312	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	3,314	3,222	12,683	1,996,454	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	175	143	1,128	177,588	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)	
BEST BUY COMPANY INC	152	152	1,108	174,545	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	18	18	530	83,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	217	221	3,010	473,920	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	455	394	1,529	240,711	公益事業
BOEING CO	446	438	7,670	1,207,270	資本財
ROBERT HALF INC	71	71	470	74,097	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	197	197	710	111,900	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,150	1,121	8,428	1,326,588	ヘルスケア機器・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	83	83	719	113,298	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	128	128	2,017	317,541	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	18	16	2,366	372,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,696	1,552	6,287	989,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	355	435	3,524	554,771	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	63	63	799	125,808	保険
UNITED RENTALS INC	53	53	3,565	561,244	資本財
SEMPRA	245	497	3,748	590,046	公益事業
FEDEX CORP	192	188	4,678	736,439	運輸
VERISIGN INC	77	67	1,149	181,005	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	472	458	6,144	967,116	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	240	240	1,077	169,581	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	114	115	3,236	509,389	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	604	604	166	26,268	メディア・娯楽
CSX CORP	1,692	1,525	5,107	803,905	運輸
COTERRA ENERGY INC	640	545	1,503	236,617	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	158	158	701	110,451	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	129	131	3,222	507,190	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	219	191	1,814	285,611	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	43	34	1,456	229,241	資本財
CATERPILLAR	413	395	13,686	2,154,326	資本財
CHECK POINT SOFTWARE TECH	81	70	1,056	166,317	ソフトウェア・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,328	2,225	44,392	6,987,354	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	193	193	2,015	317,173	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	246	229	7,651	1,204,346	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	112	111	1,285	202,396	保険
CINTAS CORP	74	70	4,721	743,106	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	3,261	3,123	14,456	2,275,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	430	430	728	114,653	素材
CLOROX COMPANY	95	95	1,233	194,119	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,269	3,168	19,589	3,083,371	食品・飲料・タバコ
COPART INC	351	691	3,643	573,509	商業・専門サービス
COGNEX CORP	143	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	622	619	5,694	896,326	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	213	195	4,569	719,235	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)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MOLINA HEALTHCARE INC	45	45	1,472	231,848	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	190	190	1,598	251,659	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	403	333	990	155,939	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	271	276	2,579	406,026	公益事業
CMS ENERGY CORP	236	236	1,451	228,419	公益事業
COOPER COS INC/THE	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	649	666	2,387	375,832	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	116	—	—	—	素材
HEICO CORP-CLASS A	63	57	972	153,112	資本財
MANHATTAN ASSOCIATES INC	—	46	1,059	166,821	ソフトウェア・サービス
CUMMINS INC	113	114	3,186	501,576	資本財
DARLING INGREDIENTS INC	132	132	553	87,144	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	254	229	3,281	516,538	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	548	547	14,173	2,230,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	130	125	5,103	803,329	金融サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	399	370	2,474	389,442	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	362	352	5,187	816,486	生活必需品流通・小売り
DEERE&CO	226	205	7,582	1,193,499	資本財
MORGAN STANLEY	1,008	938	9,257	1,457,195	金融サービス
REPUBLIC SERVICES INC	183	164	3,019	475,294	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	321	330	2,749	432,822	不動産管理・開発
DECKERS OUTDOOR CORP	—	21	2,269	357,208	耐久消費財・アパレル
THE WALT DISNEY CO	1,448	1,426	14,609	2,299,532	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	179	163	1,844	290,286	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	106	106	1,955	307,771	資本財
OMNICOM GROUP	165	140	1,309	206,101	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	158	158	1,791	281,929	公益事業
DUKE ENERGY CORP	607	603	6,106	961,133	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	92	92	1,365	214,942	消費者サービス
EBAY	419	419	2,219	349,311	一般消費財・サービス流通・小売り
BANK OF AMERICA CORP	5,744	5,497	21,617	3,402,601	銀行
CITIGROUP	1,530	1,466	9,161	1,441,987	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	88	88	889	140,030	素材
EATON CORP	313	309	10,435	1,642,503	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	213	205	6,084	957,645	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	201	—	—	—	メディア・娯楽
ECOLAB INC	199	203	4,656	733,007	素材
REVVITY INC	105	85	953	150,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	215	197	2,605	410,143	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	793	746	20,146	3,170,987	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	818	128,833	保険
EMERSON ELECTRIC CO	463	440	4,931	776,189	資本財
ATMOS ENERGY CORP	113	113	1,266	199,311	公益事業



銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ENERGY CORP	161	161	1,739	273,867	公益事業
EOG RESOURCES INC	461	457	5,759	906,509	エネルギー
EQUIFAX INC	92	91	2,166	340,996	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	270	270	1,114	175,430	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	181	188	2,369	373,026	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	122	122	1,462	230,185	運輸
EXXON MOBIL	3,274	3,502	40,230	6,332,283	エネルギー
FMC CORP	105	82	519	81,804	素材
NEXTERA ENERGY INC	1,556	1,568	12,163	1,914,600	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	31	31	1,344	211,601	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	21	18	2,515	395,923	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	47	47	796	125,394	保険
FASTENAL CO	440	440	2,850	448,613	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	544	544	1,996	314,190	銀行
M & T BANK CORP	136	137	2,052	323,044	銀行
FIRST HORIZON CORP	443	—	—	—	銀行
FISERV INC	477	463	6,874	1,082,072	金融サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	260	260	601	94,665	金融サービス
FREEPORT-MCMORAN INC	1,116	1,106	5,936	934,441	素材
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	9	7	1,362	214,388	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	164	162	4,046	636,885	保険
DENTSPLY SIRONA INC	177	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	181	181	5,399	849,865	資本財
GENERAL MILLS INC	466	435	2,902	456,876	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	113	99	1,403	220,981	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	999	962	6,155	968,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	63	58	2,546	400,883	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	114	101	5,590	880,010	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	1,960	1,905	217,070	34,166,857	半導体・半導体製造装置
GRACO INC	133	133	1,064	167,487	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	871	834	14,070	2,214,677	資本財
GRAINGER (WW) INC	36	33	3,158	497,110	資本財
HALLIBURTON CO	703	703	2,567	404,113	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	267	250	11,500	1,810,220	金融サービス
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	146	146	3,213	505,796	資本財
HASBRO INC	105	105	652	102,754	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	117	87	622	98,047	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	36	36	771	121,491	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	120	109	2,162	340,337	食品・飲料・タバコ
HP INC	773	683	2,264	356,420	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	48	48	816	128,535	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	99	99	820	129,154	素材
UNITED THERAPEUTICS CORP	36	36	973	153,273	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)		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)	
JUNIPER NETWORKS INC	253	253	871	137,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	188	188	1,384	217,947	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	808	770	25,331	3,987,244	一般消費財・サービス流通・小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	147	147	1,100	173,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	233	233	809	127,467	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	474	474	1,402	220,697	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	25	25	1,270	199,961	資本財
HUMANA INC	99	98	3,428	539,652	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	70	57	910	143,301	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,141	1,141	1,558	245,350	銀行
BIOGEN INC	110	107	2,349	369,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	59	59	1,249	196,702	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	243	228	5,415	852,446	資本財
INTUIT INC	212	214	12,881	2,027,505	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	67	66	3,357	528,529	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	3,252	3,282	10,196	1,604,895	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	193	193	1,836	289,092	素材
INT'L PAPER CO	251	251	1,137	179,022	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	285	285	889	139,969	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	52	52	847	133,392	金融サービス
JABIL INC	—	93	1,109	174,605	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	152	152	870	137,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON & JOHNSON	2,079	1,853	26,759	4,211,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	247	218	2,194	345,417	保険
KLA CORP	114	102	8,092	1,273,763	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORPORATION	502	502	2,458	386,892	エネルギー
KELLANOVA	187	188	1,119	176,245	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	712	712	1,010	159,076	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	263	268	3,471	546,361	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	119	115	8,935	1,406,407	金融サービス
KROGER CO	517	506	2,650	417,146	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	107	102	9,942	1,564,994	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	38	33	1,311	206,388	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	62	1,125	177,154	素材
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	—	109	850	133,897	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	114	114	1,063	167,363	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	418	—	—	—	資本財
LENNAR CORP-CL A	208	188	2,922	460,076	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	633	622	50,268	7,912,227	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	193	938	147,730	一般消費財・サービス流通・小売り
UNITED PARCEL SERVICE B	583	555	7,644	1,203,308	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	237	217	3,229	508,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	189	175	8,047	1,266,707	資本財

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)	
LOEWS CORP	167	164	1,214	191,095	保険
CARNIVAL CORPORATION	843	718	1,123	176,890	消費者サービス
LOWES COMPANIES	478	443	9,546	1,502,685	一般消費財・サービス流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	661	628	3,324	523,327	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	227	227	886	139,606	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	207	180	1,290	203,068	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	580	559	14,189	2,233,406	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	267	251	10,840	1,706,228	金融サービス
EVEREST GROUP LTD	32	32	1,277	201,040	保険
MARKEL GROUP INC	10	10	1,614	254,181	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	484	481	4,193	660,002	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	393	382	7,796	1,227,176	保険
MASCO CORP	194	189	1,277	201,104	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	48	50	2,861	450,367	素材
METLIFE INC	541	489	3,472	546,602	保険
MEDTRONIC PLC	1,052	1,026	8,415	1,324,650	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	614	—	—	—	メディア・娯楽
CVS HEALTH CORP	1,046	990	5,311	835,981	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	2,012	1,956	24,665	3,882,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR CORP	344	320	2,357	371,087	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER	65	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	5,621	5,450	234,549	36,918,069	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	866	853	11,317	1,781,298	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	442	407	4,023	633,338	半導体・半導体製造装置
3 M COMPANY	430	436	4,308	678,183	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ENTEGRIS INC	124	123	1,628	256,253	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES	42	42	901	141,943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	130	131	4,735	745,413	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	126	114	1,199	188,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	437	415	2,233	351,559	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	3,064	3,144	3,672	578,061	自動車・自動車部品
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	67	67	947	149,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	183	151	1,792	282,169	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	314	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	618	861	3,654	575,238	素材
NVR INC	2	2	1,816	285,990	耐久消費財・アパレル
NIKE B	993	944	8,688	1,367,639	耐久消費財・アパレル
NORDSON CORP	41	41	962	151,510	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	190	179	4,006	630,634	運輸
EVERSOURCE ENERGY	274	274	1,559	245,411	公益事業
NISOURCE INC	323	323	902	142,068	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	159	159	1,305	205,444	金融サービス

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)		
NORTHROP GRUMMAN CORP	115	113	5,148	810,376	資本財	
WELLS FARGO & CO	3,049	2,811	16,722	2,632,131	銀行	
NUCOR CORP	209	187	3,153	496,351	素材	
CHENIERE ENERGY INC	182	180	2,826	444,922	エネルギー	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	295	300	4,111	647,205	金融サービス	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	578	494	3,073	483,776	エネルギー	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	73	147	2,549	401,328	運輸	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	51	45	4,382	689,809	一般消費財・サービス流通・小売り	
ORACLE CORP	1,284	1,265	15,755	2,479,986	ソフトウェア・サービス	
PACCAR INC	421	403	4,359	686,109	資本財	
EXELON CORP	813	739	2,718	427,860	公益事業	
PARKER HANNIFIN CORP	103	98	5,202	818,911	資本財	
PAYCHEX INC	264	241	2,900	456,565	商業・専門サービス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	59	52	1,333	209,822	ヘルスケア機器・サービス	
PPL CORPORATION	584	584	1,670	262,885	公益事業	
PEPSICO INC	1,086	1,055	18,295	2,879,669	食品・飲料・タバコ	
PENTAIR PLC	145	143	1,135	178,733	資本財	
PFIZER	4,455	4,327	12,246	1,927,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ESSENTIAL UTILITIES INC	203	203	745	117,290	公益事業	
CONOCOPHILLIPS	984	927	11,034	1,736,810	エネルギー	
PG&E CORP	1,181	1,487	2,710	426,566	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES	174	—	—	—	エネルギー	
ALTRIA GROUP INC	1,421	1,390	6,325	995,704	食品・飲料・タバコ	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	320	315	4,803	756,108	銀行	
BROWN & BROWN INC	198	201	1,765	277,838	保険	
GARMIN LTD	128	111	1,814	285,524	耐久消費財・アパレル	
PPG INDUSTRIES INC	193	174	2,267	356,881	素材	
COSTCO WHOLESALE CORP	352	342	27,840	4,382,094	生活必需品流通・小売り	
PRICE T ROWE GROUP INC	179	182	2,125	334,621	金融サービス	
QUEST DIAGNOSTICS	86	86	1,205	189,761	ヘルスケア機器・サービス	
PROCTER & GAMBLE CO	1,878	1,814	29,598	4,658,869	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	470	452	9,281	1,460,911	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	394	402	3,001	472,424	公益事業	
PULTE GROUP INC	167	167	1,896	298,550	耐久消費財・アパレル	
GLOBAL PAYMENTS INC	208	207	2,105	331,390	金融サービス	
QUALCOMM	893	871	18,572	2,923,308	半導体・半導体製造装置	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	154	154	1,913	301,128	金融サービス	
EXACT SCIENCES CORP	147	122	574	90,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RELIANCE INC	50	41	1,246	196,213	素材	
REGENERON PHARMACEUTICALS	86	83	8,103	1,275,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REPLIGEN CORP	43	43	682	107,399	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RESMED INC	111	109	2,262	356,085	ヘルスケア機器・サービス	
US BANCORP	1,110	1,173	4,665	734,380	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)	
SEAGEN INC	109	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	297	297	3,040	478,591	保険
ROSS STORES INC	280	254	3,499	550,820	一般消費財・サービス流通・小売り
ROLLINS INC	174	254	1,175	185,025	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	81	84	4,507	709,435	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	91	84	2,189	344,597	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	171	184	2,766	435,485	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	104	104	1,149	180,919	素材
ACCENTURE PLC-CL A	498	483	14,396	2,265,952	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,083	1,054	7,123	1,121,313	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	84	77	1,939	305,218	保険
TRAVELERS COS INC/THE	185	171	3,607	567,775	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	469	454	3,416	537,703	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	30	26	10,210	1,607,145	消費者サービス
SCHLUMBERGER	1,117	1,102	5,131	807,722	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,163	1,170	8,289	1,304,713	金融サービス
POOL CORP	33	26	952	149,967	一般消費財・サービス流通・小売り
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	169	152	1,774	279,305	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	116	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SEI INVESTMENTS COMPANY	95	95	639	100,592	金融サービス
ELEVANCE HEALTH INC	190	182	9,465	1,489,928	ヘルスケア機器・サービス
CENCORA INC	117	131	2,847	448,228	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	185	185	1,503	236,672	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	193	184	5,559	875,093	素材
CENTENE CORP	453	409	2,976	468,535	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A. O.) CORP	90	90	744	117,134	資本財
SNAP-ON INC	40	40	1,077	169,626	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	291	290	3,420	538,446	保険
ADVANCE AUTO PARTS	46	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
EDISON INTL	303	309	2,290	360,591	公益事業
SOUTHERN CO	858	824	6,391	1,006,041	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	1,041	1,063	4,014	631,868	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	186	180	5,909	930,167	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	135	135	358	56,490	運輸
AT&T INC	5,695	5,480	9,464	1,489,638	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,461	1,380	21,951	3,455,140	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	125	125	1,069	168,390	資本財
STATE STREET CORP	290	223	1,650	259,832	金融サービス
STARBUCKS CORP	909	882	6,839	1,076,520	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	137	116	1,560	245,554	素材
STRYKER CORP	268	263	8,950	1,408,833	ヘルスケア機器・サービス
NETFLIX INC	350	336	21,810	3,433,042	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	435	435	1,080	170,086	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)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SYNOPLYS INC	120	118	6,994	1,100,876	ソフトウェア・サービス	
SYSCO CORP	393	400	2,905	457,297	生活必需品流通・小売り	
INTUITIVE SURGICAL INC	282	270	10,829	1,704,612	ヘルスケア機器・サービス	
TELEFLEX INC	39	39	805	126,715	ヘルスケア機器・サービス	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	921	921	1,544	243,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TERADYNE INC	123	123	1,788	281,579	半導体・半導体製造装置	
TEXAS INSTRUMENTS	725	695	13,887	2,185,871	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON	169	138	1,213	191,041	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	311	300	17,210	2,708,992	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBE LIFE INC	81	69	580	91,304	保険	
TORO CO	88	88	699	110,114	資本財	
DAVITA INC	46	46	664	104,633	ヘルスケア機器・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	89	78	2,211	348,085	一般消費財・サービス流通・小売り	
TRIMBLE IMS HOLDINGS	177	177	989	155,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TYLER TECHNOLOGIES INC	33	33	1,599	251,810	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC	233	233	1,346	211,958	食品・飲料・タバコ	
UGI CORP	180	—	—	—	公益事業	
MARATHON OIL CORP	503	503	1,332	209,660	エネルギー	
UNION PACIFIC CORP	488	467	10,703	1,684,653	運輸	
RTX CORP	1,174	1,121	11,838	1,863,446	資本財	
UNITEDHEALTH GROUP INC	741	714	35,963	5,660,616	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	46	46	818	128,822	ヘルスケア機器・サービス	
VF CORP	257	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	485	325	390	61,452	メディア・娯楽	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	206	198	8,882	1,398,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VULCAN MATERIALS CO	101	101	2,578	405,880	素材	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	597	515	793	124,834	生活必需品流通・小売り	
WALMART INC	1,179	3,477	22,619	3,560,244	生活必需品流通・小売り	
WASTE MANAGEMENT INC	325	306	6,330	996,352	商業・専門サービス	
WATERS CORP	47	47	1,575	248,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WATSCO INC	—	26	1,281	201,748	資本財	
WEBSTER FINANCIAL CORP	142	—	—	—	銀行	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	57	57	1,888	297,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JM SMUCKER CO	78	78	851	134,036	食品・飲料・タバコ	
VAIL RESORTS INC	30	30	574	90,407	消費者サービス	
WESTERN DIGITAL CORP	257	257	1,963	309,078	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WABTEC CORP	129	133	2,244	353,308	資本財	
WEYERHAEUSER CO	597	526	1,565	246,460	エクイティ不動産投資信託(REIT)	
WHIRLPOOL CORP	37	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	133	112	1,026	161,642	半導体・半導体製造装置	
WYNN RESORTS LTD	93	67	626	98,643	消費者サービス	
NASDAQ INC	289	290	1,747	274,978	金融サービス	
CME GROUP INC	282	279	5,837	918,802	金融サービス	

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)	
WILLIAMS COS	985	905	3,683	579,824	エネルギー
WILLIAMS-SONOMA INC	—	44	1,268	199,593	一般消費財・サービス流通・小売り
DICK'S SPORTING GOODS INC	—	49	965	151,930	一般消費財・サービス流通・小売り
LKQ CORP	192	192	828	130,470	一般消費財・サービス流通・小売り
ALLIANT ENERGY CORPORATION	207	207	1,036	163,097	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	261	234	1,869	294,211	公益事業
CARMAX INC	135	106	739	116,406	一般消費財・サービス流通・小売り
TJX COMPANIES INC	917	886	8,993	1,415,643	一般消費財・サービス流通・小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	41	41	1,357	213,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	987	987	330	52,043	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	127	127	485	76,440	資本財
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	96	96	1,447	227,762	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CBRE GROUP INC-A	259	229	1,995	314,020	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC-A	155	—	—	—	電気通信サービス
REGIONS FINL CORP	708	708	1,349	212,433	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	28	28	1,449	228,207	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	35	35	2,682	422,158	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	22	22	353	55,595	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	255	305	1,367	215,192	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	277	277	863	135,882	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32	32	661	104,161	金融サービス
CELANESE CORP-SERIES A	85	85	1,298	204,323	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	146	146	776	122,279	食品・飲料・タバコ
DEXCOM INC	306	287	3,664	576,867	ヘルスケア機器・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	95	1,549	243,833	資本財
EXPEDIA GROUP INC	116	96	1,060	166,865	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	165	164	1,298	204,405	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	87	78	3,399	535,116	金融サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	188	—	—	—	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	438	441	5,898	928,381	金融サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT	144	116	1,101	173,448	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	21	20	6,588	1,037,009	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	39	42	5,588	879,561	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	679	648	28,872	4,544,506	金融サービス
CELSIUS HOLDINGS INC	—	99	826	130,163	食品・飲料・タバコ
OWENS CORNING	64	64	1,148	180,838	資本財
LEIDOS HOLDINGS	112	93	1,374	216,355	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	110	146	1,347	212,101	資本財
FIRST SOLAR INC	79	79	2,219	349,293	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	97	82	1,615	254,258	商業・専門サービス
SUPER MICRO COMPUTER INC	—	38	3,394	534,339	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AECOM	104	104	904	142,310	資本財
DELTA AIR LINES INC	146	96	485	76,354	運輸

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
INSULET CORP	52	52	932	146,829	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	210	189	2,312	364,065	金融サービス
TE CONNECTIVITY LTD	244	231	3,483	548,289	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MASIMO CORP	41	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	93	86	2,544	400,545	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	167	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	35	35	6,102	960,562	一般消費財・サービス流通・小売り
ULTA BEAUTY INC	39	39	1,494	235,160	一般消費財・サービス流通・小売り
INVESCO LTD	264	—	—	—	金融サービス
MSCI INC	65	59	2,950	464,393	金融サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,240	1,189	11,904	1,873,728	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,288	1,221	33,110	5,211,593	金融サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	138	144	1,826	287,481	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	375	291	5,230	823,292	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	103	103	706	111,274	資本財
KINDER MORGAN INC	1,578	1,600	3,051	480,372	エネルギー
XYLEM INC	189	176	2,483	390,885	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	197	197	1,949	306,777	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	34	867	136,574	資本財
SPLUNK INC	133	—	—	—	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	47	47	845	133,038	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	165	154	4,925	775,278	ヘルスケア機器・サービス
VERISK ANALYTICS INC	120	107	2,672	420,630	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	522	82,202	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CORPAY INC	60	60	1,589	250,143	金融サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	204	193	5,399	849,905	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	113	92	1,428	224,846	商業・専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	172	172	1,998	314,499	エネルギー
LEAR CORP	52	36	460	72,532	自動車・自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	88	88	1,574	247,813	金融サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	193	154	937	147,589	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	176	162	2,317	364,719	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	518	492	2,929	461,040	ソフトウェア・サービス
HYATT HOTELS CORP - CL A	—	37	560	88,177	消費者サービス
TESLA INC	2,130	2,212	39,099	6,154,300	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	52	—	—	—	資本財
ENPHASE ENERGY INC	110	96	1,244	195,844	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,127	1,036	4,466	703,087	自動車・自動車部品
ALLY FINANCIAL INC	215	215	820	129,175	金融サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	63	54	1,552	244,418	金融サービス
APTIV PLC	213	218	1,820	286,501	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	376	342	4,890	769,836	エネルギー
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,796	1,713	82,232	12,943,375	メディア・娯楽



銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
IQVIA HOLDINGS INC	151	138	3,136	493,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIAMONDBACK ENERGY INC	132	132	2,623	412,967	エネルギー
SERVICENOW INC	162	159	11,651	1,833,954	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	240	245	7,556	1,189,330	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	154	164	3,540	557,213	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,403	1,362	21,171	3,332,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	497	401	6,721	1,057,992	電気通信サービス
PTC INC	82	97	1,749	275,307	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	368	359	6,165	970,492	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	891	140,329	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	108	98	2,212	348,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOWMET AEROSPACE INC	315	282	2,405	378,584	資本財
KEURIG DR PEPPER INC	621	811	2,735	430,594	食品・飲料・タバコ
TWILIO INC - A	128	128	757	119,197	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	833	913	1,398	220,165	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	366	335	3,193	502,642	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	153	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	-	-	-	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	135	-	-	-	メディア・娯楽
HUBBELL INC	44	44	1,772	279,033	資本財
OKTA INC	115	115	1,106	174,116	ソフトウェア・サービス
BLACK KNIGHT INC	115	-	-	-	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	773	773	2,506	394,496	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	118	118	1,049	165,244	食品・飲料・タバコ
AXON ENTERPRISE INC	53	53	1,546	243,461	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	-	810	861	135,569	資本財
BROADCOM INC	331	343	48,541	7,640,458	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	136	136	648	102,152	運輸
ARES MANAGEMENT CORP - A	127	127	1,844	290,350	金融サービス
MONGODB INC	53	53	1,788	281,502	ソフトウェア・サービス
BURLINGTON STORES INC	51	51	1,016	160,036	一般消費財・サービス流通・小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	360	-	-	-	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	112	124	2,536	399,291	ヘルスケア機器・サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	-	-	-	資本財
EVERGY INC	184	184	983	154,878	公益事業
ALLEGION PLC	76	77	929	146,344	資本財
DAYFORCE INC	106	106	577	90,975	商業・専門サービス
STERIS PLC	80	81	1,825	287,340	ヘルスケア機器・サービス
DOCUSIGN INC	149	149	863	135,971	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	50	50	826	130,162	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	230	230	526	82,893	ソフトウェア・サービス
KKR & CO INC	442	448	4,724	743,595	金融サービス
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	43	43	331	52,247	金融サービス

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)	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	165	208	1,295	203,853	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	261	241	3,700	582,417	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN ARAMARK	208 166	196 —	3,927 —	618,109 —	消費者サービス 消費者サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	224	181	3,010	473,779	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOW INC	557	519	3,016	474,863	素材
OVINTIV INC	209	203	1,003	157,963	エネルギー
AMCOR PLC	1,102	1,102	1,084	170,648	素材
PINTEREST INC- CLASS A	457	457	1,899	298,954	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS A	215	215	721	113,599	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	103	103	321	50,623	メディア・娯楽
CLARIVATE PLC	273	—	—	—	商業・専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	166	174	6,061	954,114	ソフトウェア・サービス
CHEWY INC - CLASS A	68	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
AVANTOR INC	496	496	1,177	185,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DYNATRACE INC	147	220	1,014	159,664	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	202	230	1,703	268,203	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	90	90	1,001	157,709	金融サービス
CARRIER GLOBAL CORP	681	620	4,013	631,742	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	338	307	2,925	460,520	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	1,195	1,443	9,167	1,442,908	運輸
CORTEVA INC	554	568	3,165	498,187	素材
FERGUSON PLC	160	162	3,339	525,659	資本財
BILL HOLDINGS, INC.	74	74	386	60,802	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	569	553	6,707	1,055,687	金融サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	34	34	519	81,776	商業・専門サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	156	156	675	106,272	金融サービス
DATADOG INC - CLASS A	201	207	2,537	399,393	ソフトウェア・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	165	145	1,408	221,749	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTIV HOLDINGS CO-A	—	262	2,755	433,683	資本財
INGERSOLL-RAND INC	315	315	2,949	464,296	資本財
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	299	329	2,598	409,018	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	42	42	706	111,180	商業・専門サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	269	513	534	84,196	自動車・自動車部品
DRAFTKINGS INC	—	326	1,195	188,165	消費者サービス
UNITY SOFTWARE INC	219	164	313	49,363	ソフトウェア・サービス
AON PLC	166	152	4,258	670,277	保険
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,774	1,774	1,396	219,768	メディア・娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	5	15	986	155,320	エネルギー
WOLFSPEED INC	102	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	139	148	780	122,920	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	95	125	3,085	485,700	金融サービス
UIPATH INC - CLASS A	—	284	532	83,871	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)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AIRBNB INC-CLASS A	299	328	4,823	759,295	消費者サービス
CONSTELLATION ENERGY	251	251	5,808	914,197	公益事業
MONDAY.COM LTD	—	16	392	61,751	ソフトウェア・サービス
SOLVENTUM CORP	—	109	653	102,840	ヘルスケア機器・サービス
COREBRIDGE FINANCIAL INC	—	192	574	90,469	金融サービス
APPROVIN CORP-CLASS A	—	122	1,020	160,610	ソフトウェア・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	300	300	801	126,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROBLOX CORP -CLASS A	280	351	1,157	182,162	メディア・娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	219	—	—	—	メディア・娯楽
VIATRIS INC	897	897	932	146,726	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	584	91,928	消費者サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	84	84	767	120,810	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	134	134	750	118,157	エネルギー
SNOWFLAKE INC-CLASS A	176	217	3,271	514,911	ソフトウェア・サービス
DOORDASH INC - A	192	192	2,160	340,015	消費者サービス
ARISTA NETWORKS INC	186	207	6,365	1,001,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	318	295	3,412	537,074	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	—	70	214	33,693	一般消費財・サービス流通・小売り
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,252	1,469	3,092	486,782	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	204	204	1,029	161,994	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	106	88	1,215	191,247	商業・専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	655	677	5,306	835,287	半導体・半導体製造装置
APA CORP	233	233	697	109,831	エネルギー
CONFLUENT INC-CLASS A	—	123	366	57,751	ソフトウェア・サービス
LINDE PLC	392	374	16,092	2,533,001	素材
ROBINHOOD MARKETS INC - A	—	319	653	102,822	金融サービス
LUCID GROUP INC	312	—	—	—	自動車・自動車部品
U-HAUL HOLDING CO	66	66	406	64,019	運輸
ASPEN TECHNOLOGY INC	23	23	522	82,168	ソフトウェア・サービス
TOAST INC-CLASS A	203	203	517	81,418	金融サービス
GE VERNOVA INC	—	208	3,716	584,958	資本財
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,130	1,130	412	64,925	運輸
CATALENT INC	137	137	741	116,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	361	291	1,261	198,615	金融サービス
VERALTO CORP	—	176	1,780	280,321	商業・専門サービス
SAMSARA INC-CL A	—	132	502	79,071	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	—	135	305	48,064	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	—	153	1,112	175,037	メディア・娯楽
ATLASSIAN CORP-CL A	118	114	1,884	296,680	ソフトウェア・サービス
BUNGE GLOBAL SA	—	116	1,234	194,372	食品・飲料・タバコ
KENVUE INC	—	1,334	2,569	404,380	家庭用品・パーソナル用品
COOPER COS INC/THE	—	168	1,544	243,123	ヘルスケア機器・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	179	—	—	—	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)		
CITIZENS FINANCIAL GROUP	395	395	1,369	215,611	銀行	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	736	115,949	ソフトウェア・サービス	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	138	138	1,971	310,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUBSPOT INC	36	36	2,327	366,359	ソフトウェア・サービス	
QORVO INC	85	86	852	134,105	半導体・半導体製造装置	
LIBERTY BROADBAND-C	91	91	471	74,166	メディア・娯楽	
LIBERTY GLOBAL LTD-C	—	188	314	49,509	電気通信サービス	
LABCORP HOLDINGS INC	—	65	1,284	202,204	ヘルスケア機器・サービス	
BIO-TECHNE CORP	129	129	1,030	162,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	41	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
GODADDY INC - CLASS A	113	113	1,577	248,239	ソフトウェア・サービス	
ETSY INC	102	102	628	98,950	一般消費財・サービス流通・小売り	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	537	502	3,653	575,034	資本財	
TRANSUNION	157	157	1,180	185,872	商業・専門サービス	
ALCOA CORP	155	—	—	—	素材	
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	—	250	509	80,116	生活必需品流通・小売り	
BLOCK INC	430	423	2,798	440,502	金融サービス	
DUPONT DE NEMOURS INC	383	341	2,800	440,850	素材	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	153	153	1,113	175,208	食品・飲料・タバコ	
WESTROCK CO	213	213	1,138	179,231	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	567	689	2,417	380,465	食品・飲料・タバコ	
NOVOCURE LTD	79	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
FORTIVE CORP	254	258	1,930	303,885	資本財	
MATCH GROUP INC	227	227	667	105,005	メディア・娯楽	
WASTE CONNECTIONS INC	197	197	3,220	506,915	商業・専門サービス	
ALPHABET INC-CL A	4,742	4,568	80,588	12,684,576	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	974	974	1,793	282,332	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	867	792	4,929	775,857	金融サービス	
SEA LTD-ADR	283	283	1,973	310,577	メディア・娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	279	279	1,131	178,030	金融サービス	
ZILLOW GROUP INC-C	134	118	469	73,903	不動産管理・開発	
ALPHABET INC-CL C	4,339	3,977	70,808	11,145,233	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	72	72	1,182	186,142	ソフトウェア・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	606	583	3,013	474,352	食品・飲料・タバコ	
ROKU INC	91	91	514	81,051	メディア・娯楽	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	87	71	1,952	307,253	メディア・娯楽	
VISTRA CORP	317	286	3,042	478,943	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	269,138	263,639	3,524,697	554,787,367	
	銘柄 数 <比率>	601	591	—	<72.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES		363	361	3,395	391,414	素材
BARRICK GOLD CORP		1,337	1,337	3,182	366,838	素材
BANK MONTREAL		544	562	7,378	850,393	銀行

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BANK NOVA SCOTIA	933	912	5,933	683,921	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	272	276	3,124	360,103	銀行
BCE INC	62	62	284	32,773	電気通信サービス
BROOKFIELD CORP	1,144	1,047	6,226	717,657	金融サービス
SAPUTO INC	208	208	573	66,142	食品・飲料・タバコ
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	69	69	944	108,889	ソフトウェア・サービス
CGI INC - CL A	160	160	2,260	260,520	ソフトウェア・サービス
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	93	653	75,319	素材
CAE INC	259	259	658	75,875	資本財
CAMECO CORP	317	317	2,347	270,620	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	303	278	1,499	172,825	電気通信サービス
CANADIAN IMPERIAL BANK	739	710	4,705	542,399	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	879	826	8,728	1,006,053	エネルギー
CANADIAN TIRE CORP -CL A	45	45	607	70,051	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	320	36,923	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	460	422	7,152	824,435	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	170	98	498	57,464	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	204	204	833	96,111	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	152	69	226	26,135	生活必需品流通・小売り
RB GLOBAL INC	102	144	1,489	171,687	商業・専門サービス
FORTIS INC	355	355	1,905	219,648	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	433	433	802	92,456	素材
TELUS CORP	329	329	731	84,355	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	237	237	1,003	115,649	保険
IMPERIAL OIL	164	120	1,162	134,032	エネルギー
ENBRIDGE	1,590	1,669	8,237	949,444	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	280	32,277	金融サービス
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,433	1,350	4,831	556,924	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	129	129	1,988	229,206	生活必需品流通・小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	654	578	4,649	535,895	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	202	202	1,252	144,363	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	484	436	3,007	346,658	保険
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	17	17	2,741	315,985	保険
METRO INC	188	188	1,375	158,519	生活必需品流通・小売り
EMERA INC	232	254	1,215	140,108	公益事業
ONEX CORP	66	66	637	73,480	金融サービス
TC ENERGY CORP	784	825	4,315	497,388	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	184	224	692	79,861	素材
POWER CORP OF CANADA	435	435	1,734	199,953	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	445	51,314	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,095	1,091	15,641	1,802,814	銀行
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	728	731	7,760	894,504	運輸
STANTEC INC	—	90	992	114,389	資本財

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)		
SUNCOR ENERGY	1,092	989	5,496	633,579	エネルギー	
LUNDIN MINING CORP	622	658	1,116	128,702	素材	
TECK RESOURCES LTD-CL B	353	353	2,548	293,699	素材	
THOMSON REUTERS CORP	132	—	—	—	商業・専門サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	52	52	626	72,210	資本財	
TORONTO-DOMINION BANK	1,425	1,363	10,335	1,191,311	銀行	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	35	35	384	44,293	素材	
WESTON (GEORGE) LTD	52	52	989	114,060	生活必需品流通・小売り	
KINROSS GOLD CORP	1,084	1,084	1,211	139,625	素材	
INTACT FINANCIAL CORP	132	132	2,983	343,931	保険	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	372	319	2,501	288,278	素材	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	16	15	5,870	676,617	ソフトウェア・サービス	
FRANCO-NEVADA CORP	153	156	2,664	307,157	素材	
TFI INTERNATIONAL INC	58	58	1,060	122,262	運輸	
TOURMALINE OIL CORP	250	250	1,686	194,427	エネルギー	
KEYERA CORP	186	186	667	76,949	エネルギー	
PARKLAND CORP	140	71	283	32,729	エネルギー	
ALTAGAS INCOME LTD	243	243	746	86,011	公益事業	
PEMBINA PIPELINE CORP	456	381	1,913	220,540	エネルギー	
DOLLARAMA INC	220	220	2,701	311,386	一般消費財・サービス流通・小売り	
MEG ENERGY CORP	—	272	827	95,324	エネルギー	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	518	—	—	—	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	1,112	1,112	3,185	367,126	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	548	380	971	111,945	エネルギー	
NORTHLAND POWER INC	178	178	425	48,997	公益事業	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	325	325	787	90,797	商業・専門サービス	
TMX GROUP LTD	46	234	860	99,142	金融サービス	
BRP INC/CA- SUB VOTING	30	30	281	32,398	耐久消費財・アパレル	
IVANHOE MINES LTD-CL A	518	518	1,067	123,043	素材	
NUTRIEN LTD	415	371	3,007	346,596	素材	
WSP GLOBAL INC	99	99	2,050	236,306	資本財	
IA FINANCIAL CORP INC	69	69	633	72,994	保険	
FIRSTSERVICE CORP	26	26	530	61,104	不動産管理・開発	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	135	216	923	106,421	商業・専門サービス	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	43	—	—	—	金融サービス	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	112	112	491	56,617	公益事業	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	290	290	1,568	180,770	金融サービス	
THOMSON REUTERS CORP	—	114	2,705	311,818	商業・専門サービス	
AIR CANADA	138	138	250	28,863	運輸	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	230	230	2,116	243,999	消費者サービス	
SHOPIFY INC - CLASS A	956	941	7,474	861,552	ソフトウェア・サービス	
HYDRO ONE LTD	288	295	1,164	134,257	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	32,113	31,156	207,545	23,921,646	
	銘柄 数 < 比 率 >	85	85	—	< 3.1% >	

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)	
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	126	127	2,841	485,327	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	818	818	1,288	220,136	銀行
FRESENIUS SE&CO KGAA	336	336	984	168,181	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	—	—	—	電気通信サービス
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	44	44	993	169,673	保険
GEA GROUP AG	133	133	517	88,357	資本財
CONTINENTAL AG	81	81	506	86,434	自動車・自動車部品
DHL GROUP	812	748	2,932	500,850	運輸
MERCK KGAA	105	91	1,534	262,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM	503	449	1,573	268,800	公益事業
SAP SE	825	811	14,377	2,455,564	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,866	1,668	2,069	353,419	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	87	87	641	109,616	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	92	92	435	74,340	耐久消費財・アパレル
BAYER	766	784	2,181	372,534	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	144	150	1,238	211,606	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	738	704	3,394	579,768	素材
BEIERSDORF AG	74	74	1,069	182,604	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERG MATERIALS AG	100	107	1,061	181,281	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	169	169	667	114,062	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	318	301	8,007	1,367,659	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	453	453	293	50,166	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.	111	104	4,782	816,736	保険
RHEINMETALL AG	36	32	1,677	286,430	資本財
VOLKSWAGEN STAMM	24	24	355	60,715	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD	152	153	1,889	322,783	自動車・自動車部品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	625	634	4,210	719,176	自動車・自動車部品
NEMETSCHKE SE	54	54	482	82,451	ソフトウェア・サービス
SIEMENS	607	584	10,367	1,770,588	資本財
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,571	1,407	2,204	376,563	金融サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	267	246	2,309	394,366	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	446	76,290	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM	2,566	2,534	5,505	940,317	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	18	18	454	77,662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFINEON TECHNOLOGIES	1,053	1,047	4,009	684,738	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4	4	385	65,910	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	306	52,371	ヘルスケア機器・サービス
BECHTLE AG	76	76	356	60,851	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE	156	141	2,516	429,830	金融サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	117	117	591	100,978	自動車・自動車部品
MTU AERO ENGINES AG	39	39	910	155,498	資本財
SYMRISE AG	100	100	1,073	183,330	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)		
BRENTAG SE	125	95	622	106,241	資本財	
EVONIK INDUSTRIES AG	160	160	325	55,628	素材	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	987	—	—	—	電気通信サービス	
TALANX AG	—	50	367	62,740	保険	
LEG IMMOBILIIEN SE	52	52	433	73,983	不動産管理・開発	
VONOVIA SE	525	525	1,500	256,203	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	50	50	362	61,883	資本財	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	215	215	1,160	198,242	ヘルスケア機器・サービス	
DR ING HC F PORSCHE AG	94	102	773	132,081	自動車・自動車部品	
SIEMENS ENERGY AG	368	368	988	168,816	資本財	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	334	392	1,552	265,111	資本財	
ZALANDO SE	176	176	424	72,494	一般消費財・サービス流通・小売り	
SCOUT24 SE	74	75	527	90,159	メディア・娯楽	
COVESTRO AG	144	144	715	122,195	素材	
HELLOFRESH SE	138	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
DELIVERY HERO SE	134	134	396	67,652	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	19,947 57	18,188 55	103,597 —	17,693,465 <2.3%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	826	841	1,979	338,159	保険	
INTESA SANPAOLO	12,475	11,450	4,129	705,327	銀行	
UNICREDIT SPA	1,498	1,162	4,240	724,192	銀行	
MEDIOBANCA	539	338	492	84,141	銀行	
LEONARDO SPA	—	313	737	125,945	資本財	
ENEL	6,308	6,403	4,264	728,400	公益事業	
ENI	1,982	1,746	2,543	434,334	エネルギー	
SNAM SPA	1,475	1,475	641	109,500	公益事業	
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	213	36,474	電気通信サービス	
TERNA SPA	1,238	958	736	125,780	公益事業	
RECORDATI SPA	101	60	293	50,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPLIFON SPA	116	116	393	67,192	ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	211	211	1,262	215,699	資本財	
DIASORIN ITALIA SPA	20	20	204	34,865	ヘルスケア機器・サービス	
MONCLER SPA	145	146	891	152,207	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	484	484	295	50,467	金融サービス	
FINECOBANK SPA	415	415	621	106,072	銀行	
BANCO BPM SPA	—	777	507	86,651	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	460	460	579	98,986	保険	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	303	303	301	51,566	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	37,131 18	36,213 20	25,329 —	4,326,072 <0.6%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD	166	166	597	102,015	資本財	



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)	
AIR LIQUIDE	412	405	7,365	1,257,912	素材
VEOLIA ENVIRONNEMENT	492	497	1,544	263,735	公益事業
LOREAL	191	185	8,265	1,411,583	家庭用品・パーソナル用品
LVMH	220	214	15,973	2,728,058	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	21	21	422	72,138	資本財
THALES SA	85	66	1,091	186,459	資本財
CAPGEMINI SA	134	122	2,570	439,028	ソフトウェア・サービス
PUBLICIS GROUPE	172	172	1,837	313,897	メディア・娯楽
BOLLORE SE	836	317	195	33,468	メディア・娯楽
MICHELIN	553	490	1,800	307,512	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD	166	153	2,136	364,930	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	173	115	599	102,399	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	25	10	89	15,369	食品・飲料・タバコ
SEB SA	22	22	259	44,274	耐久消費財・アパレル
VINCI S. A.	413	393	4,502	769,057	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	426	421	9,808	1,675,160	資本財
VIVENDI SE	612	612	618	105,642	メディア・娯楽
TOTALENERGIES SE	1,959	1,675	11,084	1,893,172	エネルギー
VALEO SA	165	—	—	—	自動車・自動車部品
ORANGE	1,490	1,532	1,627	277,888	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	25	24	5,275	901,019	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	527	495	1,898	324,268	ソフトウェア・サービス
KERING	59	55	1,832	312,987	耐久消費財・アパレル
CARREFOUR	525	397	603	103,079	生活必需品流通・小売り
SANOFI	900	870	7,714	1,317,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR	144	144	586	100,198	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	633	530	1,444	246,751	銀行
TELEPERFORMANCE	47	47	493	84,328	商業・専門サービス
EURAZEO SA	33	33	264	45,236	金融サービス
SODEXO	61	61	528	90,194	消費者サービス
AXA SA	1,456	1,442	4,812	821,856	保険
ESSILORLUXOTTICA	226	229	4,731	808,066	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	994	871	1,387	236,991	銀行
BNP PARIBAS	899	777	5,267	899,680	銀行
SAINT-GOBAIN	400	361	2,954	504,550	資本財
WENDEL	20	—	—	—	金融サービス
DANONE (GROUPE)	515	518	3,045	520,122	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	264	266	5,717	976,536	資本財
ENGIE	1,456	1,463	2,265	386,913	公益事業
ALSTOM	243	243	457	78,181	資本財
IPSEN	35	35	421	72,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	43	43	411	70,215	素材
LEGRAND SA	217	193	1,995	340,877	資本財

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)		
EIFPAGE	59	59	603	103,047	資本財	
ADP	23	23	299	51,096	運輸	
REXEL SA	—	174	493	84,272	資本財	
BUREAU VERITAS SA	250	250	701	119,816	商業・専門サービス	
GETLINK	352	211	342	58,547	運輸	
EDENRED	201	201	909	155,405	金融サービス	
BIOMERIEUX	30	30	286	48,947	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	81	81	270	46,140	消費者サービス	
WORLDLINE SA	203	203	247	42,329	金融サービス	
ALSTOM SA-RTS	—	243	29	5,081	資本財	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	25	25	481	82,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	46	46	331	56,648	金融サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	19,752	18,255	131,500	22,458,929	
(オランダ)		54	54	—	<2.9%>	
AIRBUS SE	465	460	7,303	1,247,405	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	39	38	2,568	438,736	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	105	106	530	90,672	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	861	709	2,044	349,102	生活必需品流通・小売り	
AKZO NOBEL	153	123	792	135,364	素材	
WOLTERS KLUWER	206	191	2,865	489,413	商業・専門サービス	
QIAGEN N. V.	170	165	654	111,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AEGON	1,487	—	—	—	保険	
ASML HOLDING NV	318	310	27,858	4,757,941	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	2,829	2,908	993	169,706	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	550	502	1,937	330,908	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	718	560	1,413	241,435	ヘルスケア機器・サービス	
ING GROEP NV-CVA	2,938	2,565	4,196	716,733	銀行	
HEINEKEN NV	201	231	2,162	369,364	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	68	95	726	124,034	食品・飲料・タバコ	
OCI NV	72	72	185	31,627	素材	
FERRARI NV	101	100	3,799	648,977	自動車・自動車部品	
ASR NEDERLAND NV	—	119	557	95,220	保険	
CNH INDUSTRIAL NV	810	—	—	—	資本財	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	—	63	901	153,899	半導体・半導体製造装置	
PROSUS	648	1,125	3,892	664,755	一般消費財・サービス流通・小売り	
JDE PEET'S BV	70	70	150	25,727	食品・飲料・タバコ	
EXOR NV	78	78	820	140,058	金融サービス	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	512	338	319	54,561	食品・飲料・タバコ	
EURONEXT NV	64	64	569	97,335	金融サービス	
IMCD NV	46	46	649	110,969	資本財	
NN GROUP NV	226	229	984	168,164	保険	
ARGENX SE	41	49	1,666	284,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
			株 数 (百株)	評 価 額		業 種
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	536	658	1,865	318,610	メディア・娯楽	
STELLANTIS NV	1,757	1,664	3,444	588,307	自動車・自動車部品	
FERROVIAL SE	—	370	1,351	230,813	資本財	
JUST EAT TAKEAWAY	155	—	—	—	消費者サービス	
ABN AMRO BANK NV-CVA	276	448	702	119,962	銀行	
ADYEN NV	17	16	1,949	332,949	金融サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	16,532	14,486	79,858	13,639,090	
	銘柄数 <比率>	31	31	—	<1.8%>	
(スペイン)						
IBERDROLA SA	4,864	4,768	5,794	989,564	公益事業	
ENDESA	259	259	475	81,263	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA	4,724	4,488	4,460	761,767	銀行	
ACCIONA SA	21	21	259	44,252	公益事業	
NATURGY ENERGY GROUP SA	100	—	—	—	公益事業	
REPSOL SA	1,111	895	1,356	231,671	エネルギー	
BANCO SANTANDER SA	13,066	12,230	5,823	994,589	銀行	
REDEIA CORP SA	306	306	503	85,927	公益事業	
TELEFONICA	4,314	3,732	1,571	268,446	電気通信サービス	
INDITEX	873	872	3,821	652,734	一般消費財・サービス流通・小売り	
ENAGAS	216	216	302	51,649	公益事業	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	156	165	685	117,040	資本財	
GRIFOLS SA	276	276	258	44,181	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FERROVIAL SA	370	—	—	—	資本財	
CAIXABANK	3,367	2,750	1,425	243,459	銀行	
EDP RENOVAVEIS SA	214	217	316	54,053	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	353	367	2,340	399,803	消費者サービス	
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	54	—	—	—	公益事業	
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	214	—	—	—	公益事業	
AENA SME SA	55	55	976	166,788	運輸	
CELLNEX TELECOM SA	477	344	1,163	198,719	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	35,400	31,972	31,535	5,385,913	
	銘柄数 <比率>	21	17	—	<0.7%>	
(ベルギー)						
UMICORE	176	176	329	56,196	素材	
LOTUS BAKERIES	—	0.38	373	63,861	食品・飲料・タバコ	
D' IETEREN GROUP	22	22	451	77,167	一般消費財・サービス流通・小売り	
KBC GROEP NV	214	180	1,207	206,193	銀行	
SOFINA	12	12	273	46,770	金融サービス	
SOLVAY SA	53	—	—	—	素材	
UCB (GROUPE)	93	93	1,194	204,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	85	85	599	102,381	金融サービス	
AGEAS	110	110	527	90,049	保険	
ELIA GROUP SA/NV	31	9	95	16,292	公益事業	

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)	
SYENQO SA	—	53	497	84,934	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	676	650	3,818	652,176	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,475	1,395	9,368	1,600,073 <0.2%>
(オーストリア)					
OMV AG	125	125	583	99,703	エネルギー
VERBUND AG	64	64	481	82,198	公益事業
VOESTALPINE AG	71	71	192	32,931	素材
ERSTE GROUP BANK AG	253	253	1,142	195,071	銀行
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	515	515	2,400	409,905 <0.1%>
(ルクセンブルク)					
EUROFINS SCIENTIFIC	102	102	574	98,060	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA	406	406	640	109,340	エネルギー
ARCELORMITTAL	410	427	1,022	174,604	素材
AROUNDTOWN SA	640	—	—	—	不動産管理・開発
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,560	935	2,236	382,005 <0.0%>
(フィンランド)					
KESKO OYJ-B SHS	200	200	340	58,223	生活必需品流通・小売り
WARTSILA OYJ	419	419	804	137,417	資本財
UPM KYMMENE OYJ	423	423	1,486	253,865	素材
STORA ENSO OYJ R	421	421	578	98,812	素材
SAMPO OYJ-A SHS	386	331	1,342	229,343	保険
FORTUM OYJ	325	325	458	78,384	公益事業
ELISA A	102	102	422	72,207	電気通信サービス
NOKIA OYJ	4,519	3,961	1,414	241,527	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ	327	327	648	110,802	エネルギー
KONE OYJ-B	263	263	1,277	218,152	資本財
ORION OYJ-CLASS B	98	101	375	64,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METSO CORPORATION	519	519	595	101,629	資本財
NORDEA BANK ABP	—	2,366	2,694	460,125	銀行
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	8,008	9,764	12,439	2,124,580 <0.3%>
(アイルランド)					
KINGSPAN GROUP PLC	123	123	1,115	190,570	資本財
CRH PLC	604	—	—	—	素材
KERRY GROUP PLC-A	130	109	846	144,633	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	195	195	879	150,232	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC	883	883	917	156,752	銀行
AIB GROUP PLC	882	1,458	751	128,388	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	125	—	—	—	消費者サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,946	2,770	4,511	770,576 <0.1%>

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)	
(ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,257	2,356	875	149,561	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	396	396	793	135,443	エネルギー
JERONIMO MARTINS	249	218	447	76,390	生活必需品流通・小売り
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,903 3	2,971 3	2,116 -	361,394 <0.0%>
(その他)					
DSM-FIRMENICH AG	137	137	1,460	249,435	素材
AEGON LTD	-	1,018	615	105,200	保険
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	137 1	1,155 2	2,076 -	354,636 <0.0%>
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	146,311 222	138,625 218	406,971 -	69,506,645 <9.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC	298	298	689	138,532	素材
ASHTAD GROUP PLC	333	333	1,922	385,977	資本財
SEVERN TRENT PLC	174	174	416	83,647	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	732	732	371	74,545	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	291	293	875	175,766	資本財
CRH PLC	-	521	3,273	657,175	素材
AVIVA PLC	2,403	1,933	931	186,945	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	109	109	500	100,432	素材
DIAGEO	1,794	1,746	4,592	922,060	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	828	399	157	31,541	金融サービス
DCC PLC	66	66	375	75,452	資本財
BAE SYSTEMS PLC	2,401	2,400	3,292	661,016	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,697	1,579	3,761	755,234	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	310	310	701	140,854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	1,901	1,901	1,472	295,590	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	684	684	1,314	263,843	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	168	-	-	-	素材
ANGLO AMERICAN PLC	1,013	933	2,387	479,323	素材
COMPASS GROUP PLC	1,424	1,297	2,826	567,441	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	15,754	14,788	10,174	2,042,895	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	4,907	4,982	1,259	252,872	保険
UNILEVER PLC	2,004	1,933	8,227	1,651,846	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	505	505	496	99,706	公益事業
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	257	257	679	136,488	食品・飲料・タバコ
PEARSON	553	553	518	104,179	消費者サービス
PERSIMMON PLC	256	256	368	74,083	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL	2,122	2,122	1,623	325,972	保険
RIO TINTO PLC REG	886	880	4,920	988,027	素材
VODAFONE GROUP PLC	20,547	16,457	1,219	244,780	電気通信サービス

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)	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	560	566	2,479	497,820	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,494	1,455	4,986	1,001,143	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	2,124	1,818	739	148,517	商業・専門サービス
NATWEST GROUP PLC	4,120	4,262	1,318	264,788	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	409	409	202	40,666	金融サービス
SSE PLC	816	816	1,427	286,709	公益事業
BP PLC	14,405	13,152	6,405	1,286,060	エネルギー
SAGE GROUP PLC	766	766	816	163,922	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	264	264	454	91,166	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	52,546	48,284	2,683	538,826	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	2,641	2,641	387	77,790	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	6,010	5,255	1,635	328,294	生活必需品流通・小売り
3I GROUP PLC	747	747	2,184	438,583	金融サービス
SMITH & NEPHEW PLC	685	685	672	134,970	ヘルスケア機器・サービス
GSK PLC	3,186	3,194	5,557	1,115,902	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WPP PLC	858	858	712	143,121	メディア・娯楽
ASTRAZENECA	1,231	1,188	14,289	2,869,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	4,791	4,648	597	120,029	電気通信サービス
NATIONAL GRID PLC	2,869	2,854	2,502	502,383	公益事業
BARCLAYS	12,521	11,295	2,474	496,889	銀行
INTERTEK GROUP PLC	138	138	681	136,764	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	297	297	307	61,816	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	110	84	779	156,480	一般消費財・サービス流通・小売り
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	6,359	6,359	2,867	575,826	資本財
KINGFISHER PLC	1,537	1,537	407	81,911	一般消費財・サービス流通・小売り
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	302	325	2,982	598,777	金融サービス
SAINSBURY (J) PLC	1,483	1,483	414	83,212	生活必需品流通・小売り
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	437	87,858	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	69	69	362	72,792	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	—	4,536	638	128,104	公益事業
INTERCONTINENTAL HOTELS	148	138	1,083	217,580	消費者サービス
WHITBREAD PLC	174	174	507	101,826	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	164	179	341	68,503	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABRDN PLC	1,534	1,534	237	47,702	金融サービス
EXPERIAN PLC	741	741	2,761	554,475	商業・専門サービス
MONDI PLC	417	379	605	121,658	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	330	330	354	71,164	金融サービス
OCADO GROUP PLC	547	547	224	45,116	生活必需品流通・小売り
GLENCORE PLC	8,335	7,933	3,879	778,940	素材
ENTAIN PLC	496	496	334	67,162	消費者サービス
COCA-COLA HBC AG-CDI	179	179	494	99,381	食品・飲料・タバコ
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	510	510	254	51,158	保険
M&G PLC	2,291	1,315	264	53,164	金融サービス

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)		
ENDEAVOUR MINING PLC	—	176	308	62,031	素材	
WISE PLC - A	—	490	392	78,832	金融サービス	
INFORMA PLC	1,105	1,105	922	185,285	メディア・娯楽	
HALEON PLC	4,050	5,305	1,718	345,014	家庭用品・パーソナル用品	
SHELL PLC-NEW	5,620	5,020	13,960	2,802,933	エネルギー	
NATIONAL GRID PLC-RTS	—	832	157	31,617	公益事業	
AUTO TRADER GROUP PLC	724	724	530	106,527	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55	55	499	100,303	資本財	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	—	130	1,932	387,941	消費者サービス	
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	1,011	627	125,954	資本財	
JD SPORTS FASHION PLC	2,068	2,068	264	53,174	一般消費財・サービス流通・小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	217,441	209,994	154,417	31,003,936	
		76	82	—	<4.0%>	
(スイス)			千スイスフラン			
SIKA AG-BR	117	122	3,384	583,665	素材	
SGS SA	126	129	1,103	190,380	商業・専門サービス	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	2	449	77,604	食品・飲料・タバコ	
SWISSCOM	18	18	912	157,427	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	29	25	1,418	244,617	資本財	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.82	0.82	871	150,335	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.08	0.08	859	148,186	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	7	7	3,130	539,916	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	118	114	5,361	924,771	保険	
NOVARTIS	1,717	1,582	14,416	2,486,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	1,221	1,248	6,194	1,068,364	資本財	
ROCHE HOLDING AG-BR	22	22	558	96,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROCHE HOLDING GENUSS	558	540	12,372	2,133,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	156	148	522	90,189	商業・専門サービス	
HOLCIM LTD	448	388	3,095	533,929	素材	
CLARIANT AG-REG	173	173	256	44,199	素材	
NESTLE SA - REGISTERED	2,183	2,054	18,826	3,246,978	食品・飲料・タバコ	
BALOISE HOLDING AG - REG	43	42	656	113,179	保険	
TEMENOS AG - REG	51	51	302	52,182	ソフトウェア・サービス	
BACHEM HOLDING AG-REG B	18	18	156	27,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SONOVA HOLDING AG-REG	38	38	1,120	193,273	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	37	949	163,809	運輸	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	85	85	999	172,328	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,974	—	—	—	金融サービス	
SWATCH GROUP AG(BEARER)	24	24	481	83,057	耐久消費財・アパレル	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	148	25,571	耐久消費財・アパレル	
HELVETIA HOLDING AG-REG	—	29	358	61,871	保険	
LONZA GROUP AG-REG	57	55	2,741	472,813	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	24	21	1,337	230,607	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)		
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	428	73,852	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	56	56	477	82,274	不動産管理・開発	
AVOLTA AG	—	78	277	47,933	一般消費財・サービス流通・小売り	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	18	2,201	379,755	金融サービス	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	30	30	735	126,919	資本財	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	20	20	476	82,123	資本財	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	146	120	1,043	179,983	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	409	409	5,892	1,016,228	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD	187	152	826	142,497	金融サービス	
SWISS RE LTD	244	243	2,720	469,134	保険	
BKW AG	17	17	249	43,072	公益事業	
SIG GROUP AG	262	262	499	86,181	素材	
ALCON INC	383	383	3,104	535,509	ヘルスケア機器・サービス	
SANDOZ GROUP AG	—	304	983	169,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	24	24	231	39,997	銀行	
UBS GROUP AG	2,618	2,496	7,067	1,218,981	金融サービス	
VAT GROUP AG	19	19	946	163,278	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	14,754	11,671	111,150	19,170,183	
	銘柄 数 <比 率>	43	45	—	<2.5%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A	2,070	2,070	41,750	620,416	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	4,065	60,418	金融サービス	
SKF AB-B	360	210	4,919	73,102	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,312	1,142	17,001	252,640	銀行	
SWEDBANK AB-A	725	714	15,512	230,517	銀行	
SCA SV CELLULOSA B	538	559	8,956	133,088	素材	
VOLVO AB-A SHS	135	135	3,951	58,719	資本財	
VOLVO B	1,142	1,142	32,500	482,960	資本財	
HOLMEN AB-B SHARES	53	53	2,408	35,788	素材	
TELE2 AB-B SHS	467	467	4,755	70,669	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	212	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
SAAB AB-B	—	255	6,324	93,976	資本財	
SECURITAS B	283	283	3,189	47,393	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	1,404	1,285	36,485	542,174	金融サービス	
HENNES & MAURITZ B	552	409	7,698	114,401	一般消費財・サービス流通・小売り	
ASSA ABLOY AB-B	759	759	23,461	348,640	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	1,207	1,207	11,948	177,547	銀行	
ERICSSON (LM) B	2,146	2,146	13,624	202,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	876	875	20,715	307,839	資本財	
TELIA CO AB	2,306	1,237	3,298	49,011	電気通信サービス	
SKANSKA B	255	255	4,834	71,845	資本財	
BOLIDEN AB	222	222	8,242	122,478	素材	
ALFA LAVAL AB	192	189	9,166	136,216	資本財	



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)	
GETINGE AB-B SHS	177	177	3,407	50,628	ヘルスケア機器・サービス
KINNEVIK AB - B	187	—	—	—	金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	567	567	4,037	59,990	不動産管理・開発
INDUTRADE AB	226	226	6,163	91,592	資本財
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	3,390	50,381	資本財
SWEDISH ORPHAN BIVITRUM AB	143	143	3,953	58,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLAS COPCO B	1,276	1,146	19,864	295,184	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	118	118	4,323	64,240	金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	111	111	4,087	60,740	金融サービス
HEXAGON AB-B SHS	1,470	1,720	20,385	302,922	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAGAX AB-B	174	174	4,910	72,975	不動産管理・開発
EPIROC AB-A	534	534	11,925	177,217	資本財
EPIROC AB-B	288	288	5,876	87,317	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	494	494	13,397	199,087	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB	314	314	10,608	157,647	金融サービス
EVOLUTION AB	150	131	15,084	224,159	消費者サービス
EMBRACER GROUP AB	531	—	—	—	メディア・娯楽
LIFCO AB-B SHS	179	179	5,035	74,822	資本財
INVESTOR AB-A SHS	389	—	—	—	金融サービス
VOLVO CAR AB-B	498	498	1,683	25,021	自動車・自動車部品
BEIJER REF AB	—	268	4,513	67,075	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,228	1,228	6,734	100,075	資本財
NORDEA BANK ABP	2,585	—	—	—	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	140	140	4,227	62,816	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	29,476 45	24,550 42	438,421 —	6,514,950 <0.8%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
NORSK HYDRO	1,005	1,005	7,128	106,716	素材
TELENOR ASA	511	511	6,322	94,645	電気通信サービス
KONGSBERG GRUPPEN ASA	86	86	7,707	115,374	資本財
ORKLA	698	391	3,225	48,284	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA	734	664	20,040	300,005	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA	124	124	4,178	62,545	素材
MOWI ASA	319	319	6,137	91,883	食品・飲料・タバコ
AKER BP ASA	277	293	7,804	116,840	エネルギー
SALMAR ASA	54	54	3,557	53,255	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,408	51,022	保険
ADEVINTA ASA	191	191	2,175	32,567	メディア・娯楽
DNB BANK ASA	717	717	14,840	222,155	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,907 12	4,546 12	86,526 —	1,295,296 <0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B	68	68	6,508	148,990	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	4	3	3,792	86,818	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	2,610	59,753	運輸	
DANSKE BANK A/S	561	486	9,859	225,684	銀行	
GENMAB A/S	52	48	9,436	216,001	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVONESIS (NOVOZYMES) B	171	301	12,704	290,800	素材	
ROCKWOOL A/S-B SHS	7	7	2,160	49,460	資本財	
DSV A/S	142	142	14,856	340,061	運輸	
DEMANT A/S	85	85	2,780	63,634	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSEMS A/S	816	834	16,891	386,647	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,314	2,530	231,698	5,303,582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	92	97	8,202	187,754	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	297	297	4,242	97,111	保険	
PANDORA A/S	79	65	7,251	165,977	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	84	—	—	—	素材	
ORSTED A/S	154	129	5,324	121,868	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,934	5,097	338,320	7,744,147	
	銘柄 数 <比 率>	16	15	—	<1.0%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	121	121	580	60,720	ヘルスケア機器・サービス	
WESTPAC BANKING	2,722	2,761	7,355	768,897	銀行	
FORTESCUE LTD	1,385	1,373	3,640	380,503	素材	
BRAMBLES LTD	1,080	1,080	1,548	161,898	商業・専門サービス	
ASX LTD	145	145	920	96,206	金融サービス	
BHP GROUP LTD	3,999	3,883	17,505	1,829,836	素材	
AMPOL LTD	206	206	731	76,442	エネルギー	
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	1,191	124,593	商業・専門サービス	
CSL LIMITED	379	376	10,612	1,109,374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REA GROUP LTD	35	35	661	69,192	メディア・娯楽	
TRANSURBAN GROUP	2,496	2,249	2,825	295,366	運輸	
COCHLEAR LIMITED	47	47	1,530	159,989	ヘルスケア機器・サービス	
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,514	1,555	1,611	168,433	公益事業	
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,344	1,305	15,702	1,641,332	銀行	
RIO TINTO LTD	282	282	3,721	388,972	素材	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	462	462	2,073	216,785	消費者サービス	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,666	1,666	1,068	111,669	保険	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	369	307	1,466	153,297	素材	
IGO LTD	563	—	—	—	素材	
ORICA LTD	382	382	709	74,201	素材	
BLUESCOPE STEEL LTD	347	347	737	77,124	素材	
MACQUARIE GROUP LIMITED	290	282	5,421	566,701	金融サービス	
SUNCORP GROUP LIMITED	948	948	1,527	159,649	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,470	2,408	8,255	862,902	銀行	
NEWCREST MINING LIMITED	739	—	—	—	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)		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	850	850	515	53,932	運輸	
QBE INSURANCE GROUP	1,264	1,040	1,845	192,898	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,016	736	1,064	111,293	素材	
REECE LTD	168	168	425	44,501	資本財	
SANTOS	2,654	2,246	1,731	181,038	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	372	418	1,011	105,724	ヘルスケア機器・サービス	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	138	138	440	46,056	金融サービス	
WESFARMERS LTD	929	907	5,838	610,287	一般消費財・サービス流通・小売り	
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,470	1,411	3,899	407,621	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,014	920	2,903	303,546	生活必需品流通・小売り	
SEEK LTD	280	280	624	65,300	メディア・娯楽	
MINERAL RESOURCES LTD	144	144	1,080	112,947	素材	
PILBARA MINERALS LTD	2,094	2,094	814	85,181	素材	
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	—	126	496	51,924	資本財	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,195	1,195	440	46,003	運輸	
TREASURY WINE ESTATES LTD	639	639	743	77,688	食品・飲料・タバコ	
XERO LTD	113	113	1,514	158,294	ソフトウェア・サービス	
IDP EDUCATION LTD	177	177	292	30,595	消費者サービス	
TELSTRA GROUP LTD	3,084	3,084	1,082	113,176	電気通信サービス	
LOTTERY CORP LTD/THE	1,820	1,820	904	94,558	消費者サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	1,099	1,099	548	57,324	生活必需品流通・小売り	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	2,362	2,384	6,811	712,031	銀行	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,321	2,321	845	88,343	保険	
CAR GROUP LTD	—	293	1,003	104,866	メディア・娯楽	
SOUTH32 LTD	3,467	3,467	1,355	141,730	素材	
COLES GROUP LTD	1,084	1,084	1,779	185,976	生活必需品流通・小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	138	138	1,356	141,809	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	54,351	51,977	132,772	13,878,745	
	銘柄 数 <比率>	50	50	—	<1.8%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	824	824	625	60,349	運輸	
EBOS GROUP LTD	142	142	515	49,727	ヘルスケア機器・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	399	399	1,105	106,769	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,731	1,329	545	52,631	電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	646	646	415	40,112	公益事業	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	682	65,852	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,849	4,448	3,888	375,443	
	銘柄 数 <比率>	6	6	—	<0.0%>	
(香港)				千香港ドル		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	1,271	25,621	不動産管理・開発	
CLP HOLDINGS	1,375	1,365	9,022	181,806	公益事業	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	375	375	1,734	34,947	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	944	883	24,406	491,783	金融サービス	

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)		
MTR CORP	1,250	1,250	3,325	66,998	運輸	
HANG SENG BANK	594	594	6,700	135,011	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,252	1,252	3,162	63,714	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,120	1,120	5,101	102,797	公益事業	
WHARF HOLDINGS	—	840	2,158	43,499	不動産管理・開発	
HONG KONG & CHINA GAS	9,046	9,046	5,654	113,930	公益事業	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,740	1,740	6,829	137,614	消費者サービス	
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,815	2,815	7,150	144,074	銀行	
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,363	—	—	—	不動産管理・開発	
SINO LAND CO	3,154	3,154	2,766	55,736	不動産管理・開発	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,245	1,050	8,064	162,489	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC A	405	445	3,054	61,556	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,070	1,070	10,635	214,311	資本財	
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	920	—	—	—	資本財	
AIA GROUP LTD	9,312	8,642	53,277	1,073,550	保険	
SANDS CHINA LTD	1,980	1,980	3,857	77,719	消費者サービス	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,200	1,200	2,490	50,173	運輸	
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	1,387	27,952	不動産管理・開発	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,230	1,230	3,136	63,200	不動産管理・開発	
ESR GROUP LTD	1,570	1,570	1,836	37,013	不動産管理・開発	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,459	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
WH GROUP LTD	6,583	6,583	3,732	75,211	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,139	2,289	9,159	184,570	資本財	
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,644	1,219	3,940	79,400	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	58,480	54,406	183,855	3,704,685	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	25	—	<0.5%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,474	1,474	604	70,502	資本財	
DBS GROUP	1,404	1,557	5,573	650,157	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	428	428	255	29,808	不動産管理・開発	
SEATRIUM LTD	21,527	1,076	188	21,975	資本財	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	80	80	219	25,637	資本財	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	660	660	634	74,069	金融サービス	
GENTING SINGAPORE LTD	3,150	2,928	266	31,083	消費者サービス	
KEPPEL LTD	1,128	1,128	763	89,088	資本財	
OCBC BANK	2,571	2,571	3,727	434,902	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	1,083	1,083	731	85,306	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	939	940	2,870	334,902	銀行	
UOL GROUP LIMITED	475	—	—	—	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	257	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,809	6,221	1,530	178,544	電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	—	841	439	51,213	公益事業	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	559	65,215	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種		
			株 数 (百株)	評 価 額		評 価 額	
						外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	2,235	2,601	691	80,713	不動産管理・開発		
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	46,007 16	25,375 15	19,056 —	2,223,120 <0.3%>		
(イスラエル)			千イスラエルシケル				
BANK HAPOALIM BM	983	983	3,372	144,046	銀行		
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,125	1,125	3,396	145,101	銀行		
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	1,769	—	—	—	電気通信サービス		
FIRST INTL BANK ISRAEL	50	—	—	—	銀行		
ELBIT SYSTEMS LTD	21	21	1,523	65,087	資本財		
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	100	—	—	—	半導体・半導体製造装置		
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	995	995	1,894	80,928	銀行		
ICL LTD	594	594	1,054	45,034	素材		
NICE LTD	49	49	3,540	151,226	ソフトウェア・サービス		
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	125	125	1,686	72,050	銀行		
AZRIELI GROUP	15	15	352	15,042	不動産管理・開発		
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	5,829 11	3,909 8	16,820 —	718,518 <0.1%>		
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	887,596 1,210	829,399 1,194	— —	734,844,688 <95.4%>		

(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。

### <外国新株予約権証券>

銘柄	証券数 (証券)	当期首(前期末)	当 期 末			
			証券数 (証券)	評 価 額	評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
(カナダ)				千カナダドル		
CONSTELLATION SOFTWA WRT	—	—	1,490	—	—	—
合 計	証券数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	— —	1,490 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 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12	12	1,462	230,193	
BOSTON PROPERTIES	11	11	654	102,945	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	37	37	723	113,856	
PROLOGIS INC	73	71	7,485	1,178,176	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11	11	2,244	353,226	
CAMDEN PROPERTY TRUST	7	7	786	123,810	
CROWN CASTLE INC	33	32	3,149	495,709	
ESSEX PROPERTY TRUST	5	5	1,328	209,183	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	29	25	1,673	263,362	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	45	54	1,035	163,004	
WELLTOWER INC	35	43	4,435	698,213	
KIMCO REALTY CORP	47	47	873	137,435	
IRON MOUNTAIN INC	23	23	1,854	291,885	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14	14	863	135,838	
HOST HOTELS AND RESORTS INC	56	56	1,031	162,368	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	9	9	1,198	188,596	
REALTY INCOME CORP	49	64	3,303	520,047	
REGENCY CENTERS CORP	12	12	737	116,007	
UDR INC	23	23	909	143,229	
SIMON PROPERTY GROUP	25	25	3,823	601,832	
PUBLIC STORAGE	12	11	3,204	504,387	
SUN COMMUNITIES INC	10	10	1,265	199,159	
VENTAS INC	31	31	1,489	234,405	
EXTRA SPACE STORAGE INC	10	15	2,234	351,640	
DIGITAL REALTY TRUST INC	23	23	3,356	528,351	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORPORATION	37	36	6,714	1,056,899	
WP CAREY INC	16	16	898	141,494	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30	—	—	—	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24	24	891	140,372	
INVITATION HOMES INC	45	45	1,533	241,360	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	18	18	798	125,632	
EQUINIX INC	7	7	5,636	887,255	
VICI PROPERTIES INC	75	83	2,367	372,583	
SBA COMMUNICATIONS CORP	8	8	1,673	263,339	
小 計	口 数 ・ 金 額	966	925	71,637	11,275,807
	銘柄 数 <比率>	35	33	—	<1.5%>

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)	
(カナダ)			千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4	4	213	24,581	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	15	264	30,512	
小 計	口 数 ・ 金 額	20	20	477	55,093
	銘 柄 数 <比 率>	2	2	—	<0.0%>
(フランス)			千ユーロ		
KLEPIERRE	17	17	444	75,958	
GECINA SA	3	3	310	52,967	
COVIVIO(FP)	4	4	243	41,627	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	10	828	141,455	
国小計	口 数 ・ 金 額	35	35	1,826	312,009
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.0%>
(ベルギー)			千ユーロ		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	12	12	346	59,153	
国小計	口 数 ・ 金 額	12	12	346	59,153
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.0%>
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	48	48	2,173	371,163
	銘 柄 数 <比 率>	5	5	—	<0.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	79	—	—	—	
SEGRO PLC	103	78	703	141,156	
LAND SECURITIES GROUP PLC	56	56	363	73,009	
小 計	口 数 ・ 金 額	239	134	1,066	214,165
	銘 柄 数 <比 率>	3	2	—	<0.0%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	266	266	529	55,334	
APA GROUP	83	83	711	74,351	
GPT GROUP	167	167	730	76,337	
STOCKLAND	207	207	947	99,081	
DEXUS	94	94	648	67,764	
GOODMAN GROUP	133	135	4,635	484,546	
VICINITY CENTERS	305	305	582	60,923	
LENDLEASE GROUP	64	—	—	—	
SCENTRE GROUP	381	381	1,208	126,341	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,704	1,641	9,994	1,044,682
	銘 柄 数 <比 率>	9	8	—	<0.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	170	166	5,582	112,493	

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)
HKT TRUST AND HKT LTD		315	315	2,920	58,839
小 計	口 数 ・ 金 額	485	481	8,502	171,332
	銘 柄 数 <比 率>	2	2	—	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		338	338	666	77,800
CAPITALAND ASCENDAS REIT		284	284	747	87,178
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		283	283	385	44,930
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA		220	220	270	31,568
小 計	口 数 ・ 金 額	1,125	1,125	2,069	241,477
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	4,590	4,377	—	13,373,721
	銘 柄 数 <比 率>	60	56	—	<1.7%>

(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	17,055	—
	S&P/TSE 60	705	—
	SWISS MKT IX	961	—
	DJ EURO STOXX	1,927	—
	SPI 200 FUTU	733	—
	FTSE 100	1,262	—

(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	734,844,688	95.4
投 資 信 託 受 益 証 券	133,190	0.0
投 資 証 券	13,240,531	1.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	22,349,399	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	770,567,808	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(770,040,412千円)の投資信託財産総額(770,567,808千円)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=157.40円

1カナダドル=115.26円

1ユーロ=170.79円

1イギリスポンド=200.78円

1スイスフラン=172.47円

1スウェーデンクローナ=14.86円

1ノルウェークローネ=14.97円

1デンマーククローネ=22.89円

1オーストラリアドル=104.53円

1ニュージーランドドル=96.55円

1香港ドル=20.15円

1シンガポールドル=116.66円

1イスラエルシェケル=42.718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 2024年5月29日現在
(A) 資 産	771,480,966,257円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	14,437,511,412
株 式(評価額)	734,844,688,186
投資信託受益証券(評価額)	133,190,840
投資証券(評価額)	13,240,531,141
未 収 入 金	1,496,594,709
未 収 配 当 金	1,025,901,054
未 収 利 息	967
差 入 委 託 証 拠 金	6,302,547,948
(B) 負 債	1,165,633,354
未 払 金	920,358,200
未 払 解 約 金	245,275,154
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	770,315,332,903
元 本	115,404,015,522
次 期 繰 越 損 益 金	654,911,317,381
(D) 受 益 権 総 口 数	115,404,015,522口
1万口当たり基準価額(C/D)	66,749円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	12,552,332,918円
受 取 配 当 金	11,983,530,144
受 取 利 息	329,050,300
そ の 他 収 益 金	240,015,933
支 払 利 息	△263,459
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	206,372,024,590
売 買 益	225,476,443,809
売 買 損	△19,104,419,219
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,992,957,199
取 引 益	3,324,302,832
取 引 損	△1,331,345,633
(D) そ の 他 費 用	△180,275,014
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	220,737,039,693
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	459,709,490,599
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	54,701,355,337
(H) 解 約 差 損 益 金	△80,236,568,248
(I) 計 (E+F+G+H)	654,911,317,381
次 期 繰 越 損 益 金(I)	654,911,317,381

(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121,644,600,809円、期中追加設定元本額は12,271,959,846円、期中一部解約元本額は18,512,545,133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	34,233,901,914円
世界経済インデックスファンド	13,991,533,668円
DC外国株式インデックス・オープン	13,156,676,577円
DC世界経済インデックスファンド	9,213,061,493円
分散投資コア戦略ファンドS	6,861,869,398円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	4,902,262,860円
DCマイセクション75	4,043,367,206円
DCマイセクション50	3,037,646,999円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	2,252,728,392円
DCマイセクションS75	1,951,629,914円
DCマイセクションS50	1,795,303,866円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,523,153,911円
分散投資コア戦略ファンドA	1,450,995,739円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,441,009,290円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,403,258,728円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,170,915,186円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,159,409,978円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	999,415,785円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	888,788,670円
外国株式インデックス・オープン	876,748,737円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	857,482,818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)	727,948,979円
グローバル経済コア	681,371,732円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	680,167,753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)	574,267,433円
DCマイセクション25	535,511,151円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	430,283,398円
DCマイセクションS25	326,526,062円
コア投資戦略ファンド(成長型)	273,795,458円
SMT 世界経済インデックス・オープン	254,916,315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)	216,523,655円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	191,306,176円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	173,023,680円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	168,456,311円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	161,828,459円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	157,998,954円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	156,432,494円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	156,318,641円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	155,645,401円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	125,129,236円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	122,583,106円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	122,490,672円
コア投資戦略ファンド(切替型)	119,535,001円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	114,572,329円
SMT インデックスバランス・オープン	113,787,462円
コア投資戦略ファンド(安定型)	111,815,412円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	111,043,923円

DCターゲット・イヤー ファンド2045	102,067,281円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	99,558,131円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	95,628,175円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	92,059,747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)	79,090,167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)	78,612,474円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	76,774,165円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,091,314円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	67,997,457円
10資産分散投資ファンド	61,825,769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)	60,868,495円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	56,273,050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)	47,164,856円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	31,423,278円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	29,143,797円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	27,737,963円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	22,197,325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)	19,960,481円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	17,961,616円
グローバル10資産バランスファンド	14,987,386円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,541,807円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	12,895,831円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,523,031円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,888,530円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,183,882円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,530,473円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,456,907円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	5,360,270円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,805,608円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,770,669円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	50,271円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	24,991円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	24,991円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	23,954円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	21,884円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	21,804円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	13,729円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	12,139円
DCマイセクションS50(2024-2026リスク抑制型)	1,502円

## お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)

# 新興国株式インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2023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12月12日から無期限です。
運用方針	主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、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		株式組入比率	株式先物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	円	%	騰落率	騰落率				
第11期(2019年11月11日)	28,752	7.2	31,224	7.6	96.3	3.0	0.6	62,222 百万円
第12期(2020年11月10日)	31,648	10.1	34,564	10.7	95.8	3.8	0.3	82,503
第13期(2021年11月10日)	37,038	17.0	40,526	17.3	93.6	6.2	0.3	104,132
第14期(2022年11月10日)	34,922	△5.7	38,407	△5.2	95.8	3.8	0.4	114,243
第15期(2023年11月10日)	39,228	12.3	43,509	13.3	94.4	5.2	0.4	164,504

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物率	投資信託証券組入比率
	円	%	騰落率	騰落率			
(当期首) 2022年11月10日	34,922	—	38,407	—	95.8	3.8	0.4
11月末	35,156	0.7	38,619	0.6	95.8	3.9	0.3
12月末	33,780	△3.3	37,187	△3.2	96.7	3.0	0.3
2023年1月末	36,180	3.6	39,887	3.9	104.8	2.0	0.4
2月末	35,137	0.6	38,639	0.6	97.1	2.8	0.4
3月末	35,195	0.8	38,702	0.8	95.1	4.5	0.3
4月末	34,836	△0.2	38,388	△0.0	96.2	4.0	0.3
5月末	36,328	4.0	40,062	4.3	94.2	6.0	0.3
6月末	38,519	10.3	42,518	10.7	95.1	4.5	0.4
7月末	39,733	13.8	43,922	14.4	96.0	3.7	0.4
8月末	39,172	12.2	43,262	12.6	96.6	3.1	0.4
9月末	38,356	9.8	42,382	10.3	95.9	3.8	0.4
10月末	37,422	7.2	41,396	7.8	94.8	4.9	0.4
(当期末) 2023年11月10日	39,228	12.3	43,509	13.3	94.4	5.2	0.4

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。

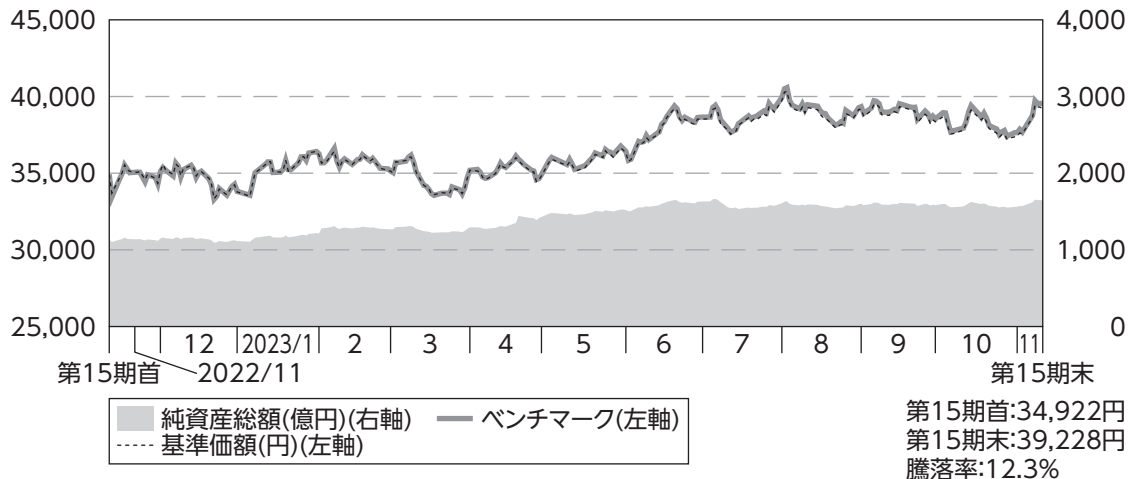
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス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MSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、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

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

## 投資環境



新興国株式市場は上昇しました。

中国本土で新型コロナウイルス関連規制の緩和による経済再開期待が高まったことや、中国当局による大手不動産開発会社への支援などが好感され、2023年1月にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国の領空に中国の気球が侵入し米軍が気球を撃墜したことなどから、米中対立の激化が懸念され下落しました。8月初旬にかけては、中国共産党による不動産市場へのさらなる緩和姿勢や地方債務問題に取り組む方針などが好感され上昇しましたが、期末にかけては中国の大手不動産開発会社の社債利払い延期などを受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから上げ幅を縮小しました。

外国為替市場では、新興国通貨に対し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エマージング・マーケット・インデックス(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

資金の流入などには、ヘッジ目的で海外の株価指数先物を利用し、DR(預託証券)および先物を含む株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

### (2) ポートフォリオ構成

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

## 当ファンドの組入資産の内容

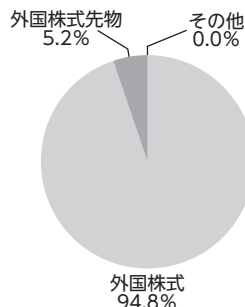
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	6.2%
2	MSCI EMERG M 2312	ー	5.2%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	3.8%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.7%
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	ケイマン諸島	2.5%
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.2%

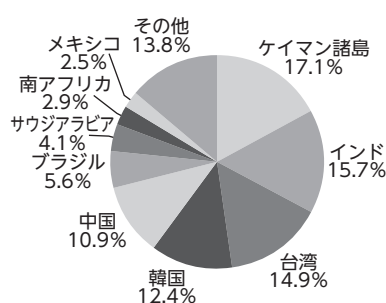
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MEITUAN-CLASS B	ケイマン諸島	1.1%
8	PDD HOLDINGS INC-ADR	ケイマン諸島	0.9%
9	ICICI BANK LTD	インド	0.8%
10	INFOSYS LTD	インド	0.8%
組入銘柄数		1,248	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

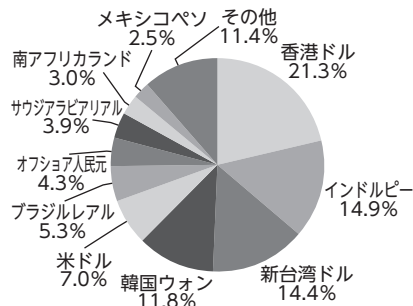
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

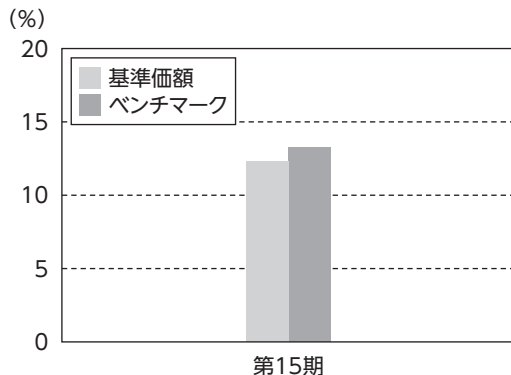


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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5.2%買建てております。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は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\*1、先物要因、為替評価差要因\*2(いずれもマイナス要因)です。

\*1 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。

\*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

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

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月1日~2023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)	10円 (8) (-) (-) (0) (-) (2)	0.026% (0.021) (-) (-) (0.000) (-) (0.005)	(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)	9 (9) (-) (-) (-) (0)	0.025 (0.025) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	66  (66)  (-) (0)	0.179  (0.179)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	85	0.230	

(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(36,651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 4,801 (234)	千米ドル 9,591 (-)	百株 3,251 (2,273)	千米ドル 1,675 (5,299)
	メ キ シ コ	31,698 (3,135)	千メキシコペソ 127,124 (-)	25,085	千メキシコペソ 34,926
	ブ ラ ジ ル	30,371 (939)	千ブラジルリアル 65,537 (165)	5,865 (118)	千ブラジルリアル 14,135 (64)
	チ リ	29,379 (18)	千チリペソ 998,752 (1,443)	10 (-)	千チリペソ 502 (1,443)
	コ ロ ン ビ ア	640	千コロンビアペソ 2,295,955	8,361	千コロンビアペソ 3,188,943
	ギ リ シ ャ	1,978 (-)	千ユーロ 1,625 (△17)	320	千ユーロ 517
	ト ル コ	14,497 (2,884)	千トルコリラ 62,203 (-)	3,296	千トルコリラ 8,888
	チ ェ コ	72	千チェココルナ 6,641	93	千チェココルナ 6,441
	ハ ン ガ リ ー	240	千ハンガリーフォリント 212,263	91	千ハンガリーフォリント 98,786
	ポ ー ラ ン ド	3,456	千ポーランドズロチ 9,002	2,337	千ポーランドズロチ 1,638
国	香 港	377,389 (9,386)	千香港ドル 571,296 (41,156)	127,961 (-)	千香港ドル 90,188 (41)
	マ レ ー シ ア	24,370 (53)	千マレーシアリンギット 19,459 (24)	13,890	千マレーシアリンギット 3,749
	タ イ	72,438 (620)	千タイバーツ 214,520 (-)	15,997	千タイバーツ 48,046

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フィリピン	百株 16,005 (630)	千フィリピンペソ 98,326 (-)	百株 46,592 (259)	千フィリピンペソ 67,116 (197)
	インドネシア	1,450,788 (39,161)	千インドネシアルピア 78,306,769 (355,963)	46,423 (517)	千インドネシアルピア 15,890,741 (30,557)
	韓 国	6,144 (454)	千韓国ウォン 47,048,785 (583,389)	1,523 (557)	千韓国ウォン 8,226,201 (271,399)
	台 湾	133,450 (6,506)	千新台幣ドル 1,203,284 (179)	15,240	千新台幣ドル 163,528
	中国オフショア	104,619 (4,366)	千オフショア人民元 140,409 (316)	31,367	千オフショア人民元 42,241
	イ ン ド	72,347 (9,543)	千インドルピー 3,496,740 (-)	7,538	千インドルピー 535,604
	カ タ ー ル	13,424	千カタールリアル 9,181	-	千カタールリアル -
	南 ア フ リ カ	16,811 (67)	千南アフリカランド 148,422 (681)	2,249	千南アフリカランド 39,055
	アラブ首長国連邦	25,395 (233)	千アラブ首長国連邦ディルハム 17,391 (-)	1,896	千アラブ首長国連邦ディルハム 441
	サウジアラビア	9,035 (3,505)	千サウジアラビアリアル 47,232 (-)	1,332 (0.06)	千サウジアラビアリアル 4,442 (-)
ク ウ ェ ー ト	7,848 (2,030)	千クウェート・ディナール 671 (2)	1,031 (111)	千クウェート・ディナール 98 (0.14242)	

(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				
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,960	5,454	—	—
小 計	38,960	5,454	—	—
ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	68,800	1,459	—	—
小 計	68,800	1,459	—	—
香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	— (19,877)	— (41)	19,877	31
小 計	— (19,877)	— (41)	19,877	31

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引	46,644	43,074	—	—

(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	47,906,677千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	136,301,723千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.35

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

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	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.839051	百万円 0.839051	% 100.0	百万円 0.839051	百万円 0.839051	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	48,256	6,468	13.4	48,209	6,474	13.4

(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	当期末(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	
TRIP.COM GROUP LTD	670	—	—	—	消費者サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	146	22,124	素材
CREDCORP LTD	87	108	1,298	196,688	銀行
SOUTHERN COPPER CORP	115	157	1,099	166,511	素材
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	4,039	4,039	516	78,288	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,394	1,394	189	28,708	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	1,524	—	—	—	不動産管理・開発
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	247	1,407	301	45,678	ソフトウェア・サービス
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	0.04	0.04	—	—	素材
SEVERSTAL - GDR REG S	387	387	—	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	0.01	—	—	—	生活必需品流通・小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	527	546	773	117,156	一般消費財・サービス流通・小売り
TAL EDUCATION GROUP- ADR	410	792	734	111,152	消費者サービス
VK CO LTD	193	193	—	—	メディア・娯楽
YANDEX NV-A	327	327	—	—	メディア・娯楽
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1	1	—	—	素材
H WORLD GROUP LTD-ADR	242	301	1,043	158,063	消費者サービス
JOYY INC	61	61	254	38,568	メディア・娯楽
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	78	78	205	31,132	半導体・半導体製造装置
ZAI LAB LTD-ADR	128	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	140	140	—	—	銀行
QIFU TECHNOLOGY INC	80	207	311	47,233	金融サービス
NIO INC - ADR	1,712	2,312	1,727	261,609	自動車・自動車部品
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,135	1,135	845	128,098	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR	122	122	325	49,290	メディア・娯楽
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	—	107	276	41,824	一般消費財・サービス流通・小売り
WEIBO CORP-SPON ADR	52	52	59	9,037	メディア・娯楽
KANZHUN LTD	221	388	572	86,755	メディア・娯楽
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	681	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KE HOLDINGS INC	805	1,140	1,661	251,628	不動産管理・開発
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	62	80	516	78,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LI AUTO INC - ADR	675	—	—	—	自動車・自動車部品
XPENG INC - ADR	532	—	—	—	自動車・自動車部品
OZON HOLDINGS PLC - ADR	75	75	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
LUFAX HOLDING LTD-ADR	1,141	1,141	117	17,801	金融サービス
PDD HOLDINGS INC-ADR	655	944	10,235	1,549,987	一般消費財・サービス流通・小売り
YUM CHINA HOLDINGS INC	540	664	2,866	434,110	消費者サービス
IQIYI INC-ADR	289	594	288	43,665	メディア・娯楽
HUTCHMED CHINA-ADR	72	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	537	638	1,512	228,985	運輸
BEIGENE LTD-ADR	60	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	20,203	19,714	27,882	4,222,248	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	40	32	—	<2.6%>
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	3,135	3,135	3,526	30,050	資本財
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	2,424	3,131	66,570	567,213	食品・飲料・タバコ
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,884	5,906	5,032	42,880	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,818	1,818	14,643	124,774	食品・飲料・タバコ
GRUMA S. A. B. -B	259	259	8,427	71,807	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	426	426	7,035	59,944	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	1,020	12,830	109,322	資本財
CEMEX SAB-SPONS	20,634	22,142	27,235	232,059	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	3,246	4,123	63,065	537,348	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	1,785	1,785	5,617	47,861	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	145	350	7,780	66,293	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,818	1,818	6,255	53,302	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	233	335	12,811	109,160	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	4,229	4,888	36,911	314,503	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	35,136	—	—	—	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	2,525	2,717	10,620	90,494	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	504	818	14,122	120,331	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	6,666	8,272	53,367	454,720	生活必需品流通・小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	436	599	13,608	115,949	運輸
OPERADORA DE SITES MEX- A-1	2,211	2,211	4,063	34,625	電気通信サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV	—	35,213	53,277	453,954	電気通信サービス
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	1,756	—	—	—	電気通信サービス
BANCO DEL BAJIO SA	—	1,427	7,720	65,778	銀行
小 計	92,653	102,401	434,525	3,702,378	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	21	21	—	<2.3%>
(ブラジル)			千ブラジルリアル		
BRF SA	1,063	—	—	—	食品・飲料・タバコ
VALE SA	5,095	5,253	37,024	1,134,242	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	370	370	1,518	46,530	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	1,224	2,117	7,892	241,779	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	1,160	1,565	7,748	237,371	銀行
ITAUSA SA	5,283	7,746	7,227	221,418	銀行
GERDAU SA-PREF	1,418	1,555	3,535	108,295	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,963	5,941	22,302	683,244	エネルギー
VIBRA ENERGIA SA	1,730	1,730	3,710	113,683	一般消費財・サービス流通・小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	5,764	7,280	25,394	777,953	エネルギー
CCR SA	1,256	2,486	3,090	94,666	運輸
WEG SA	2,175	2,558	8,291	254,024	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,849	8,281	12,638	387,170	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	3,260	3,260	4,394	134,635	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	994	994	1,244	38,125	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)		
SUZANO SA	900	1,217	6,506	199,333	素材	
CPFL ENERGIA SA	272	272	951	29,148	公益事業	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6,122	7,802	22,815	698,957	銀行	
BRASKEM SA-PREF A	193	—	—	—	素材	
ENGIE BRASIL SA	462	462	1,896	58,106	公益事業	
LOCALIZA RENT A CAR	924	1,373	7,588	232,461	運輸	
LOJAS RENNER S.A.	1,159	2,164	2,932	89,848	一般消費財・サービス流通・小売り	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	1,772	54,287	エネルギー	
COSAN SA	1,621	1,621	2,814	86,209	エネルギー	
TOTVS SA	579	579	1,793	54,951	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,651	1,651	5,497	168,427	公益事業	
AMERICANAS SA	730	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
JBS SA	1,100	1,100	2,317	71,003	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	2,118	2,118	2,711	83,064	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	505	505	3,086	94,557	公益事業	
ENEVA SA	—	1,022	1,176	36,036	公益事業	
HYPERA SA	545	545	1,764	54,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	7,998	8,874	10,968	336,019	金融サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	3,055	3,055	522	16,004	一般消費財・サービス流通・小売り	
TELEFONICA BRASIL S.A.	523	894	4,426	135,597	電気通信サービス	
RAIA DROGASIL SA	1,225	1,892	4,889	149,779	生活必需品流通・小売り	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	1,089	3,408	104,422	保険	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	6,131	10,451	4,661	142,802	ヘルスケア機器・サービス	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	1,326	1,385	42,450	生活必需品流通・小売り	
AMBEV SA	6,286	7,562	10,140	310,661	食品・飲料・タバコ	
NATURA &CO HOLDING SA	1,003	1,003	1,349	41,331	家庭用品・パーソナル用品	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	—	1,518	1,897	58,130	生活必需品流通・小売り	
TIM SA	961	961	1,655	50,726	電気通信サービス	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	456	957	2,291	70,187	ヘルスケア機器・サービス	
LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT	2	—	—	—	運輸	
ITAUSA SA-RECEIPT	—	107	101	3,102	銀行	
RUMO SA	1,597	2,443	5,582	171,014	運輸	
PRIO SA	847	1,300	5,814	178,141	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	92,438	117,764	270,732	8,293,968	
	銘 柄 数 < 比 率 >	45	44	—	< 5.0% >	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	115,501	115,501	472,170	78,322	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	61	69	161,306	26,756	銀行	
BANCO DE CHILE	48,626	75,832	711,304	117,989	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	236,579	39,243	素材	
EMPRESAS COPEC SA	447	904	578,707	95,994	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	73	73	40,395	6,700	食品・飲料・タバコ	
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	24,611	24,611	124,043	20,576	運輸	
ENEL AMERICAS SA	34,913	34,913	338,622	56,169	公益事業	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	180	212	928,647	154,041	資本財	
FALABELLA SA	708	708	132,890	22,043	一般消費財・サービス流通・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)	
CENCOSUD SA	1,379	3,064	464,704	77,083	生活必需品流通・小売り
ENEL CHILE SA	25,612	25,612	139,282	23,103	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	253,477 12	282,864 12	4,328,654 -	718,024 <0.4%>
(コロンビア)			千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA	505	505	776,859	29,256	公益事業
ECOPETROL SA	7,934	-	-	-	エネルギー
BANCOLOMBIA SA	293	506	1,561,498	58,806	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	615	615	1,663,486	62,646	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	9,348 4	1,627 3	4,001,843 -	150,709 <0.1%>
(ギリシャ)			千ユーロ		
ALPHA SERVICES AND HLD	2,636	2,636	377	61,000	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE	736	736	405	65,577	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	262	262	338	54,618	電気通信サービス
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	4,276	4,276	653	105,573	銀行
MYTILINEOS S. A.	98	202	705	114,038	資本財
MOTOR OIL (HELLAS) SA	-	52	116	18,805	エネルギー
OPAP SA	184	205	318	51,384	消費者サービス
JUMBO SA	193	193	517	83,617	一般消費財・サービス流通・小売り
PUBLIC POWER CORP	208	558	547	88,447	公益事業
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS	-	1,130	315	50,961	銀行
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	8,597 8	10,255 10	4,295 -	694,027 <0.4%>
(トルコ)			千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.	2,763	5,861	17,210	91,192	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	995	1,991	8,498	45,033	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,167	2,588	9,712	51,464	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	65	163	13,677	72,471	自動車・自動車部品
HEKTAS TICARET T. A. S	-	1,330	3,012	15,963	素材
KOC HOLDING AS	898	898	12,880	68,249	資本財
SASA POLYESTER SANAYI	-	1,180	5,230	27,716	素材
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	2,987	2,987	14,596	77,344	資本財
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	-	316	8,374	44,375	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO	866	866	19,938	105,649	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,430	1,430	7,948	42,117	電気通信サービス
TURKIYE IS BANKASI-C	3,844	3,844	7,712	40,865	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	116	1,425	21,474	113,784	エネルギー
YAPI VE KREDI BANKASI	-	3,711	6,298	33,371	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING	2,113	2,113	12,344	65,407	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	428	812	24,855	131,703	生活必需品流通・小売り
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS	-	167	375	1,991	素材
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS	-	71	5,310	28,137	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	17,677 12	31,763 18	199,452 -	1,056,839 <0.6%>

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期末		業種
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(チェコ)			千		
KOMERCNI BANKA AS	226	133	8,952	58,911	銀行
CEZ AS	179	252	25,169	165,618	公益事業
MONETA MONEY BANK AS	607	607	5,500	36,193	銀行
小計	1,013	992	39,622	260,723	
銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)			千		
RIGHTER GEDEON NYRT	151	287	256,369	109,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	445	445	127,157	54,177	エネルギー
OTP BANK NYRT	386	400	550,288	234,459	銀行
小計	983	1,132	933,816	397,868	
銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ポーランド)			千		
M BANK SA	14	14	761	27,699	銀行
BUDIMEX	—	26	1,265	46,063	資本財
KGHM POLSKA MIEDZ SA	201	201	2,210	80,451	素材
BANK PEKAO SA	276	276	3,622	131,847	銀行
ORANGE POLSKA SA	556	—	—	—	電気通信サービス
ORLEN SA	833	1,029	6,513	237,070	エネルギー
LPP SA	1	1	1,753	63,817	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA	73	73	3,483	126,790	銀行
CD PROJEKT SA	67	67	737	26,840	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA	1,302	1,302	5,717	208,099	銀行
CYFROWY POLSAT SA	360	360	442	16,121	メディア・娯楽
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	634	998	720	26,219	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	485	865	4,098	149,188	保険
DINO POLSKA SA	59	94	4,072	148,229	生活必需品流通・小売り
ALLEGRO.EU SA	392	837	2,595	94,455	一般消費財・サービス流通・小売り
PEPCO GROUP NV	—	228	418	15,244	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	5,260	6,379	38,413	1,398,138	
銘柄数 <比率>	14	15	—	<0.8%>	
(ロシア)			千		
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	11,414	11,414	0.00011	—	銀行
PHOSAGRO PJSC	88	88	—	—	素材
POLYUS PJSC	39	39	—	—	素材
TATNEFT PJSC	1,794	1,794	0.00001	—	エネルギー
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	1,959	1,959	0.00001	—	素材
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	797	797	—	—	電気通信サービス
MAGNIT PJSC	79	79	—	—	生活必需品流通・小売り
NOVATEK PJSC	1,059	1,059	0.00001	—	エネルギー
GAZPROM PJSC	13,106	13,106	0.00013	—	エネルギー
LUKOIL PJSC	440	440	—	—	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC	1,340	1,340	0.00001	—	エネルギー
VTB BANK PJSC	7,560,740	7,560,740	0.0756	0.124	銀行
MMC NORILSK NICKEL PJSC	72	72	—	—	素材

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種		
			株 数 (百株)	評 価 額		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
SURGUTNEFTEGAS PJSC	12,320	12,320	0.00012	—	エネルギー		
小 計	7,605,253	7,605,253	0.076	0.124			
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14	14	—	<0.0%>		
(香港)			千香港ドル				
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	670	2,340	2,503	48,548	素材		
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	3,220	3,220	2,208	42,830	運輸		
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	5,980	2,230	43,250	運輸		
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	152	152	1,928	37,395	食品・飲料・タバコ		
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,445	2,375	4,465	86,576	素材		
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	595	595	1,535	29,765	公益事業		
HUANENG POWER INTL INC-H	7,040	7,040	2,555	49,551	公益事業		
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	7,840	7,840	3,755	72,816	生活必需品流通・小売り		
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	1,960	4,290	5,834	113,129	エネルギー		
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	798	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)		
HENGAN INTL GROUP CO LTD	875	875	2,305	44,706	家庭用品・パーソナル用品		
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	11,441	13,881	9,508	184,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	4,685	5,845	8,569	166,159	不動産管理・開発		
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	4,051	5,411	15,611	302,698	不動産管理・開発		
CITIC LTD	7,680	10,380	7,027	136,258	資本財		
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	2,480	2,480	801	15,532	運輸		
LENOVO GROUP LTD	9,000	11,880	10,787	209,160	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
PETROCHINA CO LTD-H	26,480	32,180	15,961	309,489	エネルギー		
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,840	1,840	1,321	25,619	保険		
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	33,434	38,694	15,554	301,611	エネルギー		
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	990	19,208	消費者サービス		
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	3,110	4,930	5,906	114,520	ソフトウェア・サービス		
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	986	1,170	6,967	135,096	公益事業		
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	5,480	5,480	3,704	71,829	公益事業		
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,507	2,507	1,181	22,902	運輸		
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,156	3,206	2,301	44,633	不動産管理・開発		
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,655	1,655	1,662	32,227	運輸		
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	1,343	26,040	素材		
WHARF HOLDINGS	1,540	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)		
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	1,423	1,423	810	15,709	運輸		
CHINA GAS HOLDINGS LTD	4,664	4,664	3,358	65,113	公益事業		
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	1,247	24,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	7,580	9,480	9,053	175,545	自動車・自動車部品		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	1,060	1,068	2,520	48,872	公益事業		
BYD CO LTD-H	1,085	1,690	41,574	806,119	自動車・自動車部品		
CHINA OILFIELD SERVICES-H	2,420	2,420	2,098	40,682	エネルギー		
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	—	—	—	メディア・娯楽		
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	3,850	3,850	1,028	19,935	商業・専門サービス		
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	175	175	1,679	32,558	運輸		
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	8,892	11,972	10,979	212,885	保険		
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,750	2,750	970	18,822	資本財		
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	2,574	2,574	3,809	73,866	公益事業		

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)	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	4,937	4,937	5,757	111,630	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	9,180	13,200	13,939	270,281	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	9,050	10,624	206,012	素材
MMG LIMITED	3,040	—	—	—	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	3,992	3,992	3,057	59,292	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	4,088	5,134	99,558	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	—	220	179	3,485	エネルギー
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	4,160	4,243	82,275	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	880	1,160	6,658	129,106	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	4,460	4,460	2,461	47,736	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	4,860	4,860	1,744	33,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	2,080	2,460	10,110	196,044	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	3,100	3,100	1,732	33,600	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	13,810	19,710	6,918	134,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	4,020	4,580	11,450	222,015	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	7,929	10,591	324,931	6,300,429	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	8,190	10,580	40,204	779,555	保険
LI NING CO LTD	2,920	3,800	9,500	184,205	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,006	19,516	公益事業
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	1,971	38,224	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	2,140	6,300	3,276	63,521	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,533	29,740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	4,600	4,555	11,045	214,179	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	5,180	5,180	4,009	77,748	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	13,714	13,714	6,322	122,593	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	4,420	3,757	72,848	資本財
BAIDU INC-CLASS A	2,819	3,514	36,796	713,490	メディア・娯楽
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	121,876	152,016	67,799	1,314,626	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	996	1,221	10,006	194,018	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	946	18,361	自動車・自動車部品
MINTH GROUP LTD	640	1,760	3,139	60,881	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,640	3,640	1,619	31,407	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	4,120	7,280	2,686	52,087	素材
BANK OF CHINA LTD-H	102,282	123,942	34,579	670,502	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	—	—	—	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	725	725	579	11,232	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,949	6,219	18,502	358,757	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	70,435	100,565	37,309	723,434	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,810	1,810	1,677	32,533	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	517	10,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,960	1,960	631	12,237	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	3,290	3,290	1,990	38,594	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	780	780	1,463	28,372	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	1,579	30,622	資本財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	10,166	—	—	—	不動産管理・開発
CMOC GROUP LTD-H	8,100	8,100	3,458	67,064	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)	
CHINA CITIC BANK-H	9,512	15,652	5,446	105,615	銀行
SUNNY OPTICAL TECH	929	1,195	8,263	160,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,516	1,988	18,090	350,780	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	250	250	476	9,229	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	1,393	27,028	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	6,259	588	11,408	不動産管理・開発
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	4,380	4,380	1,357	26,327	耐久消費財・アパレル
KINGSOFT CORP LTD	920	1,712	5,084	98,591	メディア・娯楽
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	—	31,490	3,747	72,660	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	545	1,665	2,387	46,295	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	7,060	7,060	2,527	49,007	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	436	8,469	食品・飲料・タバコ
DONGYUE GROUP	1,470	1,470	876	16,987	素材
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	605	1,605	5,689	110,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,560	2,579	50,023	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	3,866	3,866	6,579	127,584	保険
CRRC CORP LTD-H	4,090	9,360	3,023	58,621	資本財
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	1,650	1,650	1,156	22,427	耐久消費財・アパレル
SINOPHARM GROUP CO-H	1,912	1,912	3,636	70,514	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	2,360	—	—	—	エネルギー
CHINA RESOURCES CEMENT	2,880	2,880	558	10,833	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,583	3,583	1,322	25,639	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,190	5,555	3,916	75,936	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,520	4,520	2,906	56,354	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,474	28,581	ヘルスケア機器・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	2,520	2,882	55,899	一般消費財・サービス流通・小売り
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	1,162	—	—	—	資本財
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	1,600	1,600	1,433	27,797	資本財
LONGFOR PROPERTIES	2,290	3,435	4,204	81,524	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	964	1,054	1,764	34,211	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	6,744	6,744	1,726	33,476	銀行
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,412	—	—	—	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	3,750	3,750	832	16,142	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	39,100	39,350	11,096	215,165	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	920	920	1,810	35,106	一般消費財・サービス流通・小売り
FAR EAST HORIZON LTD	2,400	2,400	1,336	25,920	金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	660	660	891	17,276	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	2,857	2,857	4,635	89,877	金融サービス
SEAZEN GROUP LTD	7,680	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	2,470	2,470	3,280	63,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	3,572	3,572	1,621	31,444	金融サービス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	1,208	23,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	9,390	18,780	4,732	91,764	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	730	730	1,321	25,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,830	4,830	2,038	39,521	金融サービス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	2,760	2,760	1,656	32,109	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)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	1,280	—	—	—	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	—	—	—	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	10,590	10,750	3,891	75,456	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	480	480	706	13,700	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	1,320	1,320	3,161	61,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EAST BUY HOLDING LTD	—	440	1,304	25,296	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	2,320	3,410	2,441	47,341	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	537	537	991	19,221	生活必需品流通・小売り
SHANDONG GOLD MINING CO LTD-H	950	950	1,369	26,562	素材
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	1,045	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHINA TOWER CORP LTD-H	45,660	70,820	5,523	107,109	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	19,062	24,042	39,717	770,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIGENE LTD	—	1,109	12,998	252,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI APPTec CO LTD-H	422	636	6,101	118,304	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	5,589	8,061	92,707	1,797,593	消費者サービス
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	1,668	1,668	2,465	47,802	消費者サービス
HAILILAO INTERNATIONAL HOLDI	1,160	2,340	3,898	75,590	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	6,259	8,959	4,399	85,302	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	1,390	2,030	9,601	186,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	8,320	8,320	640	12,422	金融サービス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	1,040	1,040	532	10,324	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	2,430	2,430	1,620	31,427	資本財
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1,240	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	100	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	1,140	4,100	2,652	51,435	一般消費財・サービス流通・小売り
HANSH PHARMACEUTICAL GROUP	1,220	1,220	1,771	34,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	5,640	5,640	2,763	53,586	食品・飲料・タバコ
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	19,309	26,039	213,917	4,147,862	一般消費財・サービス流通・小売り
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	334	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC - CL A	2,735	3,791	38,707	750,533	一般消費財・サービス流通・小売り
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,950	1,950	1,261	24,463	食品・飲料・タバコ
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	—	90	819	15,889	一般消費財・サービス流通・小売り
JIU MAOJIU INTERNATIONAL HOLD	570	2,350	2,042	39,597	消費者サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	2,116	3,724	21,394	414,837	メディア・娯楽
HAIER SMART HOME CO LTD-H	3,030	3,106	6,957	134,904	耐久消費財・アパレル
BILIBILI INC-CLASS Z	266	266	3,053	59,210	メディア・娯楽
AKESO INC	—	610	2,909	56,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETEASE INC	2,584	3,136	55,449	1,075,171	メディア・娯楽
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	880	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,680	12,680	2,345	45,485	メディア・娯楽
GDS HOLDINGS LTD-CL A	1,267	1,267	1,355	26,286	ソフトウェア・サービス
NONGFU SPRING CO LTD-H	2,276	2,826	12,476	241,924	食品・飲料・タバコ
LI AUTO INC-CLASS A	—	1,716	26,587	515,528	自動車・自動車部品
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,508	1,934	7,370	142,912	生活必需品流通・小売り
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	352	754	3,717	72,076	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	676	1,190	3,451	66,914	不動産管理・開発

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)	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	51	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	1,784	3,155	2,524	48,940	不動産管理・開発
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	2,445	2,445	13,178	255,532	消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP	646	646	1,498	29,060	一般消費財・サービス流通・小売り
JD LOGISTICS INC	—	3,262	3,105	60,214	運輸
TRIP.COM GROUP LTD	—	876	23,001	445,993	消費者サービス
XPENG INC - CLASS A SHARES	—	1,671	10,832	210,034	自動車・自動車部品
ZAI LAB LTD	—	1,282	2,994	58,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	900	900	1,813	35,163	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H	14,280	14,280	2,627	50,947	公益事業
GF SECURITIES CO LTD-H	886	886	894	17,351	金融サービス
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	584	584	2,046	39,689	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	2,660	2,660	2,878	55,806	金融サービス
3SBIO INC	1,190	4,455	3,145	60,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	—	3,390	1,613	31,288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA LITERATURE LTD	516	516	1,545	29,965	メディア・娯楽
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	640	640	1,007	19,532	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	2,460	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	2,250	2,250	1,516	29,404	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	238	238	1,284	24,896	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,161	1,161	2,496	48,400	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1,080	2,340	3,397	65,881	自動車・自動車部品
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	2,036	3,512	4,670	90,569	金融サービス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,460	6,280	31,651	613,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	540	540	1,564	30,334	素材
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	—	914	1,547	30,004	不動産管理・開発
HUISHAN DAIRY UNTRADE	4,350	4,350	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	6,500	6,500	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	1,053,062	1,311,876	1,794,414	34,793,696	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	194	189	—	<21.2%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	3,007	3,007	1,151	36,891	銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	9,433	9,200	5,317	170,336	銀行
CELCOMDIGI BHD	4,980	4,980	2,121	67,956	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,065	1,072	784	25,120	運輸
RHB BANK BHD	2,170	2,193	1,234	39,557	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	—	—	—	資本財
GAMUDA BHD	—	1,619	744	23,857	資本財
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	166	166	285	9,142	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	1,212	2,311	74,053	銀行
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	506	1,142	2,499	80,071	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	5,711	8,815	8,039	257,519	銀行
MISC BHD	2,175	2,175	1,566	50,172	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	72	182	2,220	71,124	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	734	734	1,065	34,129	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	884	2,022	64,788	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)		
PETRONAS GAS BHD	755	1,484	2,513	80,526	公益事業	
TELECOM MALAYSIA BHD	2,715	2,715	1,414	45,319	電気通信サービス	
TENAGA NATIONAL BHD	3,052	4,417	4,373	140,096	公益事業	
QL RESOURCES BHD	1,248	1,248	698	22,386	食品・飲料・タバコ	
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	872	27,959	エネルギー	
PUBLIC BANK BERHAD	18,704	21,229	8,937	286,287	銀行	
TOP GLOVE CORP BHD	5,049	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
GENTING BHD	2,716	2,716	1,146	36,714	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	916	29,369	消費者サービス	
IOI CORPORATION BHD	2,703	2,703	1,070	34,292	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY BERHAD	3,363	3,363	800	25,642	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,813	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	5,410	5,410	1,325	42,464	電気通信サービス	
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,079	34,583	電気通信サービス	
INARI AMERTRON BHD	2,747	2,747	813	26,046	半導体・半導体製造装置	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,699	4,164	2,998	96,035	素材	
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	4,714	2,800	89,694	ヘルスケア機器・サービス	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	4,802	7,576	3,704	118,669	素材	
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	1,072	34,344	食品・飲料・タバコ	
MR DIY GROUP M BHD	3,034	3,034	482	15,455	一般消費財・サービス流通・小売り	
小 計	株 数 銘柄数 <比率>	107,358 34	117,892 32	68,387 —	2,190,609 <1.3%>	
(タイ)			千タイパーツ			
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,776	1,776	4,795	20,283	生活必需品流通・小売り	
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	8,334	35,254	銀行	
CP AXTRA PCL-NVDR	—	2,379	6,364	26,920	生活必需品流通・小売り	
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	814	3,560	11,482	48,571	公益事業	
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	—	—	—	電気通信サービス	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	832	832	10,940	46,279	銀行	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	—	17,132	13,105	55,438	エネルギー	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	169	712	9,184	38,851	公益事業	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	1,218	1,218	8,712	36,852	電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	5,564	5,564	10,460	44,247	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,532	2,038	45,243	191,380	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	8,401	8,401	9,913	41,934	一般消費財・サービス流通・小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	389	4,960	41,416	175,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PTT PCL-NVDR	13,936	16,846	56,012	236,934	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,849	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	1,015	1,015	4,669	19,749	金融サービス	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	6,627	28,033	不動産管理・開発	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	1,026	1,304	38,337	162,168	素材	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	5,270	6,549	45,188	191,145	運輸	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	2,263	3,784	23,650	100,039	不動産管理・開発	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	11,769	18,881	50,506	213,643	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	827	827	19,269	81,508	ヘルスケア機器・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,627	3,627	10,065	42,579	消費者サービス	



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)	
THAI OIL PCL-NVDR	1,303	2,936	13,872	58,682	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	7,838	9,564	52,602	222,506	生活必需品流通・小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	8,095	8,095	5,990	25,338	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	2,008	2,008	32,529	137,600	エネルギー
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,064	2,064	5,263	22,263	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	4,861	4,861	17,622	74,542	素材
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	726	—	—	—	金融サービス
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	2,199	2,199	10,170	43,020	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	8,170	8,170	6,536	27,647	運輸
B GRIMM POWER PCL-NVDR	534	3,210	7,736	32,723	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	4,029	4,029	18,029	76,265	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR	2,931	2,931	7,034	29,755	食品・飲料・タバコ
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	1,651	—	—	—	金融サービス
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	8,103	8,103	2,852	12,065	消費者サービス
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	1,822	1,822	6,786	28,708	一般消費財・サービス流通・小売り
SCG PACKAGING PCL-NVDR	2,027	2,027	7,449	31,510	素材
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	763	—	—	—	金融サービス
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	2,890	7,924	14,817	62,679	一般消費財・サービス流通・小売り
SCB X PCL-NVDR	887	812	7,937	33,574	銀行
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	—	20,156	11,690	49,451	電気通信サービス
CARABAO GROUP PCL-NVDR	463	—	—	—	食品・飲料・タバコ
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	898	898	3,771	15,953	金融サービス
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	682	682	2,966	12,549	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	149,943 43	207,004 40	669,939 —	2,833,844 <1.7%>
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC	7,941	12,809	37,786	102,412	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,379	2,379	11,611	31,470	資本財
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	2,125	2,348	24,372	66,056	銀行
GLOBE TELECOM INC	50	—	—	—	電気通信サービス
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,531	1,531	31,697	85,910	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	3,035	5,861	22,858	61,954	資本財
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	610	610	13,324	36,113	消費者サービス
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,612	1,612	8,588	23,277	銀行
BDO UNIBANK INC	2,199	3,947	53,294	144,443	銀行
PLDT INC	104	104	12,949	35,096	電気通信サービス
SM PRIME HOLDINGS INC	15,677	15,533	49,396	133,879	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP	955	955	10,721	29,059	食品・飲料・タバコ
SM INVESTMENTS CORP	362	362	29,644	80,346	資本財
AYALA CORPORATION	282	544	34,305	92,978	資本財
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	23,557	—	—	—	金融サービス
MANILA ELECTRIC COMPANY	531	531	19,623	53,185	公益事業
GT CAPITAL HOLDINGS INC	68	—	—	—	資本財
ACEN CORP	8,218	—	—	—	公益事業
MONDE NISSIN CORP	4,905	—	—	—	食品・飲料・タバコ

銘柄	株数 (百株)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CONVERGE INFORMATION AND COM	3,200	—	—	—	電気通信サービス
小 計	79,348	49,132	360,176	976,185	
	銘柄数 <比率>	20	14	—	<0.6%>
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
ANEKA TAMBANG TBK PT	9,858	9,858	1,631,499	15,825	素材
BARITO PACIFIC TBK PT	28,825	28,922	3,094,663	30,018	素材
UNITED TRACTORS TBK PT	2,009	2,009	4,595,587	44,577	エネルギー
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	4,291	4,291	2,714,057	26,326	食品・飲料・タバコ
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	25,420	32,773	18,844,475	182,791	資本財
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,923	9,533	5,386,145	52,245	食品・飲料・タバコ
GUDANG GARAM TBK PT	596	—	—	—	食品・飲料・タバコ
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,442	7,540	6,465,550	62,715	素材
BANK MANDIRI	25,130	61,017	35,848,028	347,725	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	11,574	11,574	4,166,640	40,416	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA	87,236	109,604	56,994,090	552,842	銀行
BANK NEGARA INDONESIA PT	8,102	25,846	12,561,156	121,843	銀行
KALBE FARMA TBK PT	41,885	41,885	6,785,370	65,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	3,456	3,949	2,517,513	24,419	素材
BANK CENTRAL ASIA PT	70,152	86,893	78,203,700	758,575	銀行
PT VALE INDONESIA TBK	3,042	3,042	1,429,740	13,868	素材
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	62,417	72,998	25,768,294	249,952	電気通信サービス
ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	21,623	21,623	5,297,635	51,387	エネルギー
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	5,994	6,263,730	60,758	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	10,761	—	—	—	電気通信サービス
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	21,387	21,387	6,202,230	60,161	生活必需品流通・小売り
SARANA MENARA NUSANTARA PT	28,406	28,406	2,712,773	26,313	電気通信サービス
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	9,640	—	—	—	素材
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	—	1,346,399	10,097,992	97,950	一般消費財・サービス流通・小売り
BANK JAGO TBK PT	4,749	—	—	—	銀行
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	16,232	16,232	3,733,583	36,215	素材
小 計	508,767	1,951,777	301,314,452	2,922,750	
	銘柄数 <比率>	25	22	—	<1.8%>
(韓国)			千韓国ウォン		
SKC CO LTD	17	14	123,581	14,224	素材
CHEIL COMMUNICATIONS INC	98	—	—	—	メディア・娯楽
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	60	60	616,284	70,934	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	41	41	1,028,541	118,385	保険
DB INSURANCE CO LTD	42	100	834,127	96,008	保険
COWAY CO LTD	90	90	461,739	53,146	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	188	139	1,243,977	143,181	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	35	—	—	—	商業・専門サービス
CJ CORP	12	—	—	—	資本財
KAKAO CORP	378	520	2,372,112	273,030	メディア・娯楽
CJ ENM CO LTD	8	—	—	—	メディア・娯楽
HANWHA OCEAN CO LTD	—	145	350,582	40,352	資本財
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	310	310	232,612	26,773	金融サービス

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)	
NCSOFT CORPORATION	19	27	716,530	82,472	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	221	221	228,993	26,357	電気通信サービス
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	550	820	1,157,062	133,177	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	—	86	511,037	58,820	資本財
LG H&H CO LTD	13	13	449,800	51,772	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	61	80	3,780,672	435,155	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	8	8	258,715	29,778	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	3	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	594	677	2,358,674	271,483	銀行
HMM CO LTD	355	355	582,582	67,055	運輸
S-OIL CORPORATION	63	63	427,929	49,254	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	123	182	575,694	66,262	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	479	—	—	—	金融サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	159	603,593	69,473	金融サービス
POSCO FUTURE M CO LTD	33	47	1,386,957	159,638	資本財
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	19	23	365,233	42,038	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	43	43	291,884	33,595	一般消費財・サービス流通・小売り
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	43	62	614,362	70,713	資本財
HYUNDAI MOBIS	81	101	2,273,152	261,639	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	689	873	11,183,360	1,287,204	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	97	97	345,298	39,743	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	34	34	350,763	40,372	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	168	207	3,623,802	417,099	自動車・自動車部品
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	—	28	214,206	24,655	資本財
HYUNDAI STEEL CO	111	111	383,782	44,173	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	283	283	326,078	37,531	銀行
KIA CORP	327	392	3,041,410	350,066	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	12	12	577,920	66,518	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	264	442	760,485	87,531	公益事業
KOREAN AIR LINES CO LTD	237	268	580,696	66,838	運輸
CJ LOGISTICS	8	—	—	—	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	18	18	248,258	28,574	素材
HLB INC	100	239	732,626	84,325	ヘルスケア機器・サービス
LG ELECTRONICS INC	135	172	1,789,239	205,941	耐久消費財・アパレル
LG CORP	116	166	1,377,616	158,563	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	121	124,338	14,311	金融サービス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	67	—	—	—	資本財
NAVER CORP	170	215	4,276,759	492,255	メディア・娯楽
L&F CO LTD	30	43	663,761	76,398	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	262,774	30,245	金融サービス
PACIFIC CORP	33	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	77	285	443,610	51,059	消費者サービス
POSCO HOLDINGS INC	101	117	5,426,992	624,646	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	185	303	745,380	85,793	資本財
COSMOAM&T CO LTD	—	39	618,181	71,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDI CO LTD	68	88	3,877,708	446,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	68	92	1,232,605	141,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GREEN CROSS CORP	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,036	7,504	52,760,079	6,072,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	951	951	681,410	78,430	資本財
HANWHA AEROSPACE CO LTD	—	58	724,171	83,352	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,077	1,330	7,569,236	871,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUHAN CORPORATION	125	131	816,770	94,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	190	190	142,690	16,423	自動車・自動車部品
GS HOLDINGS CORP	65	65	277,894	31,985	資本財
LG DISPLAY CO LTD	383	383	510,935	58,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	122	175	2,771,952	319,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	—	72	445,137	51,235	半導体・半導体製造装置
HANA FINANCIAL GROUP	410	512	2,075,584	238,899	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	27	27	484,306	55,743	運輸
CELLTRION PHARM INC	19	20	147,719	17,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOTTE SHOPPING CO	10	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	73	—	—	—	保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	121	121	840,678	96,762	保険
AMOREPACIFIC CORP	37	37	545,490	62,785	家庭用品・パーソナル用品
JYP ENTERTAINMENT CORP	—	41	439,845	50,626	メディア・娯楽
SK INNOVATION CO LTD	67	100	1,365,984	157,224	エネルギー
ECOPRO CO LTD	—	31	2,283,957	262,883	素材
CJ CHEILJEDANG CORP	7	18	558,136	64,241	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	136,785	15,744	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	26	645,692	74,319	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	45	63	1,020,482	117,457	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	486	645	3,449,586	397,047	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	58	134	624,514	71,881	資本財
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	21	21	89,889	10,346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	79	169	903,070	103,943	金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	11	11	347,805	40,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	38	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMART	35	—	—	—	生活必需品流通・小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	70	70	308,077	35,459	自動車・自動車部品
HD HYUNDAI	51	51	306,656	35,296	エネルギー
BGF RETAIL CO LTD/NEW	16	16	239,904	27,612	生活必需品流通・小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	31	31	387,094	44,554	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	11	—	—	—	素材
NETMARBLE CORP	24	24	115,608	13,306	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	770	1,138	1,397,635	160,867	銀行
ECOPRO BM CO LTD	65	82	2,045,652	235,454	資本財
SD BIOSENSOR INC	39	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	31	31	272,384	31,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KRAFTON INC	35	37	723,704	83,298	メディア・娯楽
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	21	21	234,553	26,997	資本財
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	23	23	157,347	18,110	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)		
SK SQUARE CO LTD	116	116	557,931	64,217	資本財	
SK BIOSCIENCE CO LTD	21	21	144,480	16,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KAKAO GAMES CORP	30	30	81,264	9,353	メディア・娯楽	
HYBE CO LTD	24	24	524,488	60,368	メディア・娯楽	
LG ENERGY SOLUTION	31	73	3,161,301	363,865	資本財	
KAKAOBANK CORP	184	354	852,788	98,156	銀行	
F&F CO LTD / NEW	30	30	283,899	32,676	耐久消費財・アパレル	
KAKAOPAY CORP	—	30	130,415	15,010	金融サービス	
SAMSUNG SDS CO LTD	37	72	1,046,710	120,476	ソフトウェア・サービス	
ALTEOGEN INC	34	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMSUNG C&T CORP	119	119	1,383,942	159,291	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	22	26	1,934,025	222,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP	46	46	218,967	25,203	メディア・娯楽	
DOOSAN BOBCAT INC	43	120	489,969	56,395	資本財	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	88	153	1,081,344	124,462	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	20,480	24,999	167,794,042	19,313,094	
	銘柄 数 < 比 率 >	111	103	—	< 11.7% >	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACCTON TECHNOLOGY CORP	700	700	38,780	181,843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACER INC	2,558	6,178	21,623	101,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	920	1,270	45,371	212,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	619	859	35,451	166,237	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	2,341	4,541	18,348	86,038	素材	
TAIWAN BUSINESS BANK	—	7,987	10,463	49,063	銀行	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	1,880	12,690	59,504	半導体・半導体製造装置	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	—	750	17,325	81,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	1,000	1,000	17,200	80,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,410	2,110	32,599	152,862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	2,862	4,082	89,411	419,257	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EVA AIRWAYS CORP	3,860	3,860	11,444	53,666	運輸	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	1,187	1,187	21,781	102,135	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,935	6,083	10,585	49,637	銀行	
CHINA AIRLINES LTD	4,650	4,650	9,741	45,680	運輸	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	7,932	37,195	自動車・自動車部品	
CHINA STEEL	14,942	17,792	43,680	204,823	素材	
ADVANTECH CO LTD	433	762	26,043	122,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COMPAL ELECTRONICS	4,317	8,057	23,850	111,837	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	2,399	3,029	91,476	428,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,150	2,590	16,731	78,455	半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	5,053	5,843	68,657	321,939	電気通信サービス	
AUO CORP	7,560	12,680	20,289	95,137	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN MOBILE CO LTD	2,452	2,452	24,127	113,137	電気通信サービス	
EVERGREEN MARINE	1,232	1,832	19,970	93,643	運輸	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,620	10,951	51,351	資本財	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	704	789	14,754	69,185	耐久消費財・アパレル	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	399	23,682	111,050	耐久消費財・アパレル	

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)	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	740	960	46,389	217,526	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	5,048	5,978	46,809	219,494	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	4,200	5,420	34,041	159,623	素材
GIANT MANUFACTURING	344	357	6,071	28,468	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,968	2,418	218,832	1,026,128	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	9,549	11,664	71,970	337,474	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	10,953	15,183	31,505	147,734	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	420	540	34,868	163,502	一般消費財・サービス流通・小売り
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	2,160	2,160	16,999	79,710	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	13,896	14,338	35,845	168,083	金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	10,161	15,310	69,127	324,144	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	18,962	25,762	29,497	138,318	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	14,916	20,025	48,962	229,587	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	15,852	19,382	189,754	889,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	13,946	16,849	65,040	304,982	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	150	150	32,035	150,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	13,480	20,006	35,511	166,517	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	19,318	19,318	17,309	81,166	保険
INVENTEC CO LTD	2,805	4,555	19,427	91,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,254	3,534	39,586	185,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,684	17,914	33,052	154,984	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	22,582	26,412	66,955	313,960	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	12,732	16,533	44,309	207,773	銀行
NAN YA PLASTICS CORP	6,477	7,707	50,330	236,002	素材
WISTRON CORP	—	4,270	42,102	197,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	2,737	2,737	8,103	37,999	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	6,453	7,763	54,658	256,297	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	885	885	23,552	110,440	生活必需品流通・小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,122	2,382	19,202	90,040	エネルギー
E INK HOLDINGS INC	940	1,440	24,840	116,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	3,100	2,790	9,586	44,951	不動産管理・開発
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	2,021	2,021	13,864	65,009	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	6,484	9,134	30,051	140,914	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	31,323	38,863	2,164,718	10,150,582	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	15,260	17,010	82,668	387,641	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LIMITED	746	746	3,459	16,221	運輸
WALSIN LIHWA CORP	3,092	5,022	17,853	83,717	資本財
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,490	3,630	9,112	42,727	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	435	425	23,210	108,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANG MING MARINE TRANSPORT	2,170	2,170	9,081	42,583	運輸
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	4,720	4,720	14,089	66,065	運輸
GLOBAL UNICHIP CORP	—	130	21,645	101,495	半導体・半導体製造装置
INNOLUX CORP	13,900	13,205	16,177	75,855	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	2,606	2,606	19,160	89,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	210	210	4,777	22,402	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EMEMORY TECHNOLOGY INC	60	120	27,900	130,825	半導体・半導体製造装置

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)		
PEGATRON CORP	2,004	3,404	26,556	124,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	185	185	20,319	95,282	資本財	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,803	2,207	39,284	184,211	金融サービス	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	80	80	8,520	39,951	半導体・半導体製造装置	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	30	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	1,379	1,379	14,274	66,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	11,107	15,149	38,933	182,563	銀行	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	4,518	6,899	30,876	144,784	銀行	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	90	90	12,825	60,137	資本財	
WIWYNN CORP	80	160	28,560	133,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	4,273	5,143	60,689	284,577	半導体・半導体製造装置	
SILERGY CORP	360	530	17,384	81,515	半導体・半導体製造装置	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	3,010	5,760	16,387	76,841	半導体・半導体製造装置	
PHARMAESSENTIA CORP	—	250	9,362	43,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOMO.COM INC	60	66	3,544	16,619	一般消費財・サービス流通・小売り	
GLOBALWAFERS CO LTD	240	420	21,588	101,228	半導体・半導体製造装置	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	310	310	9,656	45,280	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	420,849	545,566	5,067,778	23,763,322	
	銘 柄 数 < 比 率 >	87	90	—	<14.4%>	
(中国オフショア)				千円/千人民元		
EVE ENERGY CO LTD-A	75	394	1,894	39,295	資本財	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	91	91	610	12,658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	1,716	1,716	1,139	23,646	金融サービス	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	103	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	327	327	297	6,175	半導体・半導体製造装置	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	112	112	499	10,361	素材	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	481	481	687	14,268	資本財	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	183	183	393	8,160	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	80	80	558	11,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	430	—	—	—	素材	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	407	407	676	14,040	資本財	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	—	41	124	2,582	ソフトウェア・サービス	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	22	22	345	7,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	—	73	203	4,214	資本財	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	404	404	575	11,942	資本財	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	163	163	473	9,822	メディア・娯楽	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	285	285	554	11,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,113	—	—	—	素材	
GEM CO LTD-A	—	2,898	1,733	35,949	素材	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	55	55	450	9,341	ソフトウェア・サービス	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	409	8,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	615	615	370	7,679	メディア・娯楽	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	100	100	902	18,710	資本財	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	413	537	422	8,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	277	277	655	13,601	耐久消費財・アパレル	

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)	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	348	348	573	11,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	94	94	212	4,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	274	274	498	10,333	食品・飲料・タバコ
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	84	84	213	4,418	資本財
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	288	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAIID GROUP CO-A	170	170	766	15,890	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	58	58	137	2,846	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	335	335	1,249	25,909	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	148	941	19,520	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	53	53	87	1,805	食品・飲料・タバコ
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	201	201	470	9,769	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	796	796	725	15,059	エネルギー
CHINA BAOAN GROUP-A	640	640	703	14,590	資本財
TIANQI LITHIUM CORP-A	114	114	628	13,027	素材
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	348	348	387	8,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	470	470	503	10,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	922	—	—	—	素材
NAVINFO CO LTD-A	332	332	336	6,976	ソフトウェア・サービス
BY-HEALTH CO LTD-A	297	297	542	11,262	家庭用品・パーソナル用品
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	5,664	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	378	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	312	6,488	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	188	188	431	8,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	484	484	543	11,266	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	440	9,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	68	68	530	10,995	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	197	197	689	14,311	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OPILM GROUP CO LTD-A	313	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	1,374	1,374	524	10,887	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	705	917	1,654	34,315	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	280	280	871	18,086	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	—	502	1,372	28,480	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	229	4,754	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	148	148	256	5,311	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,994	1,994	1,130	23,452	資本財
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	1,050	21,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	97	97	406	8,440	ヘルスケア機器・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD-A	280	280	820	17,018	エネルギー
TONGLING NONFERROUS METALS-A	3,316	3,316	984	20,429	素材
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	245	245	603	12,517	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	184	3,969	82,341	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	283	283	1,788	37,099	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	595	595	412	8,553	食品・飲料・タバコ
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	295	368	714	14,816	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	334	334	366	7,604	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	264	343	381	7,920	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)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	812	16,856	金融サービス
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	536	536	439	9,117	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	464	464	1,482	30,756	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	476	476	804	16,697	素材
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	960	19,923	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	270	5,609	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	303	303	647	13,438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	557	557	367	7,625	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	523	10,867	ソフトウェア・サービス
HESTEEL CO LTD-A	-	8,321	1,805	37,456	素材
GOERTEK INC -A	269	269	500	10,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	1,520	1,520	1,073	22,267	金融サービス
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	425	-	-	-	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	583	583	1,466	30,427	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	168	168	228	4,746	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,020	1,122	462	9,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	199	199	114	2,373	金融サービス
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	793	793	298	6,185	不動産管理・開発
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	433	433	723	15,018	自動車・自動車部品
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	12	785	2,027	42,055	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	99	99	504	10,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EAST MONEY INFORMATION CO-A	978	1,174	1,824	37,853	金融サービス
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,103	22,897	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	302	415	6,579	136,490	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	641	641	453	9,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	452	9,390	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	547	547	606	12,572	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	435	435	1,465	30,409	耐久消費財・アパレル
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	-	2,251	2,212	45,900	金融サービス
PING AN BANK CO LTD-A	1,194	1,194	1,252	25,981	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	381	381	703	14,588	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	934	19,384	金融サービス
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	642	13,322	不動産管理・開発
ZTE CORP-A	126	764	2,115	43,883	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	801	801	517	10,733	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	432	432	610	12,671	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	902	18,730	金融サービス
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	201	201	182	3,792	資本財
BYD CO LTD -A	97	170	4,068	84,387	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	500	500	332	6,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	248	248	697	14,465	素材
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	108	108	468	9,709	素材
LB GROUP CO LTD-A	153	153	271	5,630	素材
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	223	223	237	4,917	素材
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	142	142	560	11,626	半導体・半導体製造装置
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	499	499	886	18,394	素材

銘柄	当 期 (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)	
CHACHA FOOD CO LTD-A	100	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	31	31	796	16,529	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	277	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	224	224	479	9,945	半導体・半導体製造装置
PERFECT WORLD CO LTD-A	228	228	312	6,484	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	16	16	427	8,874	食品・飲料・タバコ
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,475	1,475	1,051	21,815	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHAN-A	170	170	799	16,578	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	80	80	404	8,398	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	185	185	490	10,177	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNDA HOLDING CO LTD-A	218	218	202	4,199	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	825	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	161	161	961	19,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	2	187	2,791	57,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	56	56	430	8,940	食品・飲料・タバコ
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	248	248	148	3,071	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	203	531	2,125	44,081	運輸
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	63	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	602	602	379	7,867	金融サービス
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	75	75	575	11,932	半導体・半導体製造装置
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	455	455	275	5,710	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	269	269	254	5,284	ソフトウェア・サービス
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	28	28	129	2,690	耐久消費財・アパレル
CSC FINANCIAL CO LTD-A	241	241	629	13,068	金融サービス
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	112	162	416	8,644	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	276	276	342	7,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	371	371	530	11,005	素材
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	—	114	673	13,975	食品・飲料・タバコ
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	437	437	448	9,300	金融サービス
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	185	222	548	11,384	生活必需品流通・小売り
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	1,096	1,096	784	16,267	素材
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	206	206	482	10,003	素材
CHONGQING FULING ZHACAI-A	46	59	93	1,936	食品・飲料・タバコ
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	554	554	869	18,043	素材
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	112	157	533	11,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	41	41	285	5,921	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	70	70	314	6,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUEWEI FOOD CO LTD-A	70	70	240	4,979	食品・飲料・タバコ
OPPEIN HOME GROUP INC-A	77	77	682	14,166	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	74	74	275	5,719	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	87	87	878	18,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAI CIRCUITS CO LTD-A	47	47	354	7,356	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	84	84	1,007	20,908	自動車・自動車部品
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMAC-A	97	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	123	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	55	55	277	5,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)		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)	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	92	147	384	7,980	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	108	108	335	6,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	573	573	467	9,704	金融サービス
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	24	24	139	2,903	素材
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	—	1,574	1,926	39,964	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	493	493	524	10,881	素材
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	—	108	828	17,190	自動車・自動車部品
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	28	28	192	4,003	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	427	—	—	—	金融サービス
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	451	451	703	14,585	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	84	79	2,243	46,540	ヘルスケア機器・サービス
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	30	30	264	5,486	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	72	72	183	3,798	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	31	40	369	7,660	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	177	397	7,615	157,982	資本財
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	62	62	659	13,674	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD-A	164	164	1,464	30,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	—	5,228	1,976	40,993	不動産管理・開発
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	42	42	218	4,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	17	17	251	5,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	792	792	1,144	23,740	素材
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	6	9	77	1,603	素材
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	101	101	652	13,543	半導体・半導体製造装置
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	117	164	800	16,609	素材
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	70	70	1,193	24,760	半導体・半導体製造装置
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	210	210	1,197	24,842	半導体・半導体製造装置
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	116	116	515	10,692	資本財
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	72	72	804	16,696	半導体・半導体製造装置
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	53	74	286	5,950	半導体・半導体製造装置
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	111	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	362	362	531	11,031	資本財
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	3,086	4,011	1,014	21,054	銀行
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	195	195	69	1,440	素材
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	379	379	828	17,186	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	467	467	395	8,205	金融サービス
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	79	79	611	12,682	半導体・半導体製造装置
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	125	125	560	11,619	資本財
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	3,388	3,971	1,957	40,610	運輸
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	28	28	525	10,905	半導体・半導体製造装置
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	25	40	527	10,943	資本財
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	1,415	1,415	652	13,531	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	794	794	878	18,232	金融サービス
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	190	190	820	17,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	161	209	571	11,852	素材
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	24	24	168	3,484	資本財
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	101	101	351	7,297	食品・飲料・タバコ

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)	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	—	665	1,907	39,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	94	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	14	18	88	1,840	素材
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	244	342	835	17,325	半導体・半導体製造装置
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	—	3,148	2,323	48,192	金融サービス
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	74	104	519	10,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	30	30	378	7,841	食品・飲料・タバコ
JINKO SOLAR CO LTD-A	—	229	232	4,820	半導体・半導体製造装置
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	—	114	1,513	31,398	半導体・半導体製造装置
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPE-A	20	20	687	14,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	64	64	810	16,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	48	48	1,606	33,315	ソフトウェア・サービス
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	641	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	6,031	6,031	1,314	27,273	資本財
PETROCHINA CO LTD-A	1,000	1,000	709	14,707	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	5,786	5,786	2,765	57,371	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	10,321	3,746	77,717	銀行
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	200	890	2,734	56,715	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	1,377	1,860	5,702	118,296	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	668	1,048	4,535	94,088	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	952	2,055	3,107	64,454	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,383	4,373	3,030	62,863	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	2,736	2,736	1,050	21,793	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	633	13,140	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	92	115	20,632	427,991	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	989	5,119	2,974	61,694	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	496	1,410	3,168	65,729	金融サービス
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	182	1,002	2,515	52,171	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	444	444	219	4,559	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,798	1,798	4,059	84,217	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,605	1,605	1,144	23,738	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,289	8,353	2,480	51,462	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,109	5,624	2,896	60,081	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,194	1,194	667	13,845	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	343	343	947	19,660	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	580	580	260	5,402	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	—	4,228	1,898	39,379	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	387	3,695	2,242	46,525	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	294	294	702	14,565	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	286	286	408	8,483	金融サービス
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	818	818	916	19,004	不動産管理・開発
CRRG CORP LTD-A	1,858	1,858	992	20,581	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	381	391	1,891	39,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	208	208	442	9,177	素材
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	315	315	513	10,644	金融サービス

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)	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	1,011	2,252	46,725	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	599	12,429	資本財
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	3,157	3,157	1,158	24,034	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	796	16,529	銀行
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	—	895	670	13,905	エネルギー
GEMDALE CORP-A	455	455	247	5,143	不動産管理・開発
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	175	403	3,423	71,024	素材
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	—	4,867	2,160	44,826	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,056	2,691	3,196	66,316	素材
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	828	—	—	—	金融サービス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	676	1,769	2,140	44,401	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	699	839	1,903	39,492	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	122	207	1,988	41,253	一般消費財・サービス流通・小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	737	15,300	素材
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	1,225	1,225	418	8,690	金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,643	1,643	948	19,665	素材
AIR CHINA LTD-A	259	259	203	4,217	運輸
TBEA CO LTD-A	225	292	418	8,683	資本財
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	—	2,301	1,603	33,268	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	3,309	3,309	1,075	22,308	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	845	17,536	資本財
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	552	552	1,420	29,470	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	197	4,105	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	160	160	470	9,754	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	1,140	1,140	481	9,979	金融サービス
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	598	12,415	自動車・自動車部品
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	923	923	1,333	27,666	公益事業
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	410	8,513	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	1,475	1,475	1,140	23,651	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	104	216	160	3,325	ヘルスケア機器・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	—	1,835	1,768	36,694	運輸
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	1,142	1,142	732	15,194	金融サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A	284	284	1,421	29,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	72	72	165	3,434	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	742	15,404	資本財
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	207	310	611	12,682	エネルギー
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	168	3,493	運輸
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	432	432	662	13,746	資本財
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	878	99	194	4,027	エネルギー
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	165	165	540	11,210	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	131	131	227	4,723	ソフトウェア・サービス
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	185	185	683	14,176	自動車・自動車部品
AVICOPTER PLC-A	155	155	578	11,993	資本財
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	—	3,076	2,448	50,791	金融サービス
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	—	2,377	1,916	39,757	エネルギー
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	600	600	238	4,953	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)	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	228	228	132	2,752	資本財
ZHANGZHOU PIENITZEHUANG PHA-A	39	39	978	20,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	93	93	2,330	48,342	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	208	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	1,467	911	18,897	エネルギー
KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A	304	—	—	—	素材
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	1,105	1,105	711	14,761	一般消費財・サービス流通・小売り
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	85	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	322	1,167	24,222	ソフトウェア・サービス
ZHEJIANG JUHUA CO-A	—	1,294	1,921	39,861	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	2,866	2,866	854	17,716	素材
BEIJING TIANANTAN BIOLOGICAL-A	280	831	2,438	50,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	411	411	600	12,456	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	—	640	891	18,493	エネルギー
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	115	115	396	8,230	食品・飲料・タバコ
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	179	250	199	4,137	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	90	90	142	2,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	243	243	426	8,856	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	882	18,301	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	79	95	417	8,659	ソフトウェア・サービス
JCET GROUP CO LTD-A	298	298	940	19,515	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	75	75	191	3,979	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	79	79	595	12,351	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	262	262	857	17,782	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	100	—	—	—	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	179	179	546	11,342	素材
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	47	47	482	10,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA JUSHI CO LTD -A	922	922	1,080	22,415	素材
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	471	471	669	13,883	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	114	114	667	13,849	資本財
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	902	902	742	15,399	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	98	98	134	2,780	素材
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	78	101	681	14,134	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	107	107	373	7,750	食品・飲料・タバコ
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	—	103	565	11,736	素材
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	33	59	445	9,247	資本財
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	90	90	707	14,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	—	37	464	9,644	資本財
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	210	210	1,093	22,682	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD-A	254	254	803	16,672	半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	2,413	2,413	1,148	23,826	公益事業
ZANGGE MINING CO LTD-A	374	374	849	17,626	素材
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	27	27	317	6,575	資本財
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	470	1,003	2,432	50,453	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	90	90	1,290	26,764	自動車・自動車部品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	962	962	1,748	36,279	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)		
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	202	540	2,081	43,183	食品・飲料・タバコ	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	173	173	969	20,107	食品・飲料・タバコ	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	293	293	554	11,505	自動車・自動車部品	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	263	263	769	15,969	資本財	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7	7	50	1,037	自動車・自動車部品	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	723	723	1,093	22,691	金融サービス	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	1,256	26,066	公益事業	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	22	22	107	2,231	食品・飲料・タバコ	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	183	183	1,377	28,584	食品・飲料・タバコ	
SKSHU PAINT CO LTD-A	—	99	586	12,167	素材	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	2,297	2,297	1,571	32,597	銀行	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	1,127	1,127	1,201	24,921	銀行	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	392	392	758	15,731	自動車・自動車部品	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	557	557	765	15,875	運輸	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	79	79	291	6,051	耐久消費財・アパレル	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	20	20	181	3,755	ヘルスケア機器・サービス	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	556	556	917	19,041	公益事業	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	151	211	574	11,921	半導体・半導体製造装置	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	101	141	508	10,542	生活必需品流通・小売り	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	29	29	874	18,142	メディア・娯楽	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	82	82	411	8,531	資本財	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	405	405	364	7,558	金融サービス	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	124	—	—	—	素材	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	36	36	61	1,273	金融サービス	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	110	110	426	8,853	商業・専門サービス	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	128	128	158	3,295	不動産管理・開発	
小 計	株 数 銘柄数	金 額 <比率>	177,568 345	255,186 347	342,099 —	7,096,437 <4.3%>
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,870	4,813	1,112,212	2,035,349	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	962	935	35,871	65,645	エネルギー	
ASIAN PAINTS LTD	469	569	175,325	320,845	素材	
BANK OF BARODA	—	2,483	47,924	87,701	銀行	
EICHER MOTORS LTD	178	178	63,291	115,824	自動車・自動車部品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	1,107	1,501	233,146	426,658	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	13	13	35,992	65,865	素材	
ICICI BANK LTD	6,532	8,122	761,418	1,393,395	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	594	594	17,726	32,439	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	2,269	2,688	155,607	284,761	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	264	264	19,445	35,585	運輸	
TATA STEEL LTD	9,408	11,379	136,212	249,268	素材	
JSW STEEL LTD	993	993	74,548	136,424	素材	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	610	932	84,129	153,957	食品・飲料・タバコ	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	—	29	21,209	38,813	金融サービス	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	145	150	70,126	128,330	食品・飲料・タバコ	
NESTLE INDIA LIMITED	39	51	124,677	228,158	食品・飲料・タバコ	

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)	
GAIL INDIA LTD	2,621	5,045	62,690	114,722	公益事業
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	735	1,681	293,417	536,954	銀行
VEDANTA LTD	1,071	1,071	25,201	46,119	素材
SUPREME INDUSTRIES LTD	—	100	42,313	77,433	素材
TITAN CO LTD	465	565	185,673	339,782	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	3,815	5,397	103,984	190,291	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	95	260	55,344	101,281	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	265	265	31,988	58,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MPHASIS LTD	77	193	42,320	77,446	ソフトウェア・サービス
ACC LTD	53	—	—	—	素材
BAJAJ FINANCE LTD	344	441	326,163	596,879	金融サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	2,193	—	—	—	金融サービス
INFOSYS LTD	4,286	5,324	732,264	1,340,044	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	1,795	1,820	69,232	126,696	ソフトウェア・サービス
TATA ELXSI LTD	41	41	33,607	61,501	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	4	4	46,695	85,453	自動車・自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	2,906	5,970	61,458	112,469	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	1,040	1,295	320,847	587,151	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	134	145	77,141	141,168	ヘルスケア機器・サービス
CUMMINS INDIA LTD	—	209	36,679	67,123	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	1,398	1,390	176,287	322,606	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	797	797	42,717	78,172	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	122	137	43,539	79,676	自動車・自動車部品
SRF LTD	191	191	44,766	81,922	素材
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	88	88	22,815	41,752	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	126	183	99,900	182,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	2,948	3,589	334,672	612,450	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	324	585	64,232	117,546	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	1,222	1,451	170,805	312,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	147	219	76,712	140,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	157	213	221,845	405,976	自動車・自動車部品
AUROBINDO PHARMA LTD	354	354	33,667	61,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TVS MOTOR CO LTD	—	412	67,959	124,366	自動車・自動車部品
JINDAL STEEL & POWER LTD	697	697	43,591	79,772	素材
BIOCON LTD	582	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	1,866	5,212	46,879	85,790	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	212	385	74,976	137,206	金融サービス
PETRONET LNG LTD	837	837	16,764	30,678	エネルギー
CIPLA LTD	599	885	109,659	200,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	826	1,075	325,459	595,591	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	133	198	171,315	313,507	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	—	2,419	41,244	75,477	資本財
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	1,173	1,431	479,405	877,312	ソフトウェア・サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	342	230	50,918	93,180	資本財
NTPC LTD	6,641	6,641	157,866	288,895	公益事業
YES BANK LTD	10,201	23,524	43,238	79,126	銀行



銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMBUJA CEMENTS LTD	735	735	30,762	56,295	素材
BHARAT FORGE LTD	303	303	31,308	57,295	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,805	1,796	87,022	159,251	素材
ITC LTD	3,451	4,804	208,730	381,976	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	181	291	71,649	131,117	素材
UNITED PHOSPHORUS LTD	696	696	38,346	70,173	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	122	122	25,024	45,794	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS INDIA LTD	110	110	37,413	68,467	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	78	143	65,612	120,071	メディア・娯楽
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	—	704	26,990	49,391	資本財
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	633	633	62,606	114,570	家庭用品・パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	721	947	106,551	194,989	ソフトウェア・サービス
INDIAN HOTELS CO LIMITED	—	1,644	66,629	121,932	消費者サービス
MINDTREE LTD	62	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MARICO LTD	817	817	42,526	77,823	食品・飲料・タバコ
POWER FINANCE CORPORATION	—	2,057	57,086	104,468	金融サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	8	8	33,365	61,059	耐久消費財・アパレル
ABB LTD INDIA	—	52	22,650	41,450	資本財
DLF LTD	879	879	52,860	96,734	不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	3,803	8,009	168,205	307,816	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	647	1,045	84,314	154,294	運輸
REC LTD	—	1,865	59,324	108,563	金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	550	550	87,067	159,333	金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	96	96	52,268	95,650	自動車・自動車部品
JUBILANT FOODWORKS LTD	439	439	22,217	40,658	消費者サービス
ADANI POWER LTD	856	856	34,343	62,848	公益事業
MUTHOOT FINANCE LTD	124	124	16,312	29,852	金融サービス
COAL INDIA LTD	1,803	2,954	95,587	174,925	エネルギー
HDFC BANK LTD	—	4,614	686,201	1,255,748	銀行
TATA MOTORS LTD	2,189	2,773	180,034	329,462	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	1,995	1,995	49,469	90,528	公益事業
INDUS TOWERS LTD	905	—	—	—	電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	127	127	46,596	85,271	素材
VARUN BEVERAGES LTD	—	803	80,518	147,349	食品・飲料・タバコ
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	—	211	66,641	121,953	自動車・自動車部品
LTIMINDTREE LTD	57	156	82,486	150,950	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	425	425	39,923	73,059	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	267	267	10,554	19,314	公益事業
TRENT LTD	192	379	94,017	172,051	一般消費財・サービス流通・小売り
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	1,290	1,401	87,076	159,350	保険
BHARAT ELECTRONICS LTD	5,074	5,074	70,021	128,140	資本財
AU SMALL FINANCE BANK LTD	301	301	20,848	38,152	銀行
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	—	212	43,227	79,105	資本財
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	141	39,139	71,625	金融サービス
BANDHAN BANK LTD	748	748	16,248	29,735	銀行
ADANI TOTAL GAS LTD	330	—	—	—	公益事業

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
GODREJ PROPERTIES LTD	127	127	23,090	42,256	不動産管理・開発
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	548	548	63,165	115,592	金融サービス
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	310	606	45,521	83,303	金融サービス
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	229	229	15,409	28,200	商業・専門サービス
ZOMATO LTD	4,278	8,422	102,627	187,807	消費者サービス
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	—	1,201	71,309	130,496	ヘルスケア機器・サービス
SONA BLW PRECISION FORGINGS	—	592	33,536	61,372	自動車・自動車部品
AXIS BANK LTD	2,880	3,597	367,710	672,910	銀行
HAVELLS INDIA LTD	356	356	44,725	81,847	資本財
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	4,711	101,469	185,688	金融サービス
ASTRAL LTD	—	199	37,844	69,254	資本財
BERGER PAINTS INDIA LTD	294	353	20,434	37,394	素材
ADANI ENERGY SOLUTIONS LTD	328	—	—	—	公益事業
GRASIM INDUSTRIES LTD	315	468	90,688	165,959	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	212	285	107,078	195,953	生活必需品流通・小売り
IDFC FIRST BANK LTD	—	5,310	44,940	82,241	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	336	336	45,630	83,503	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	317	453	23,926	43,786	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	148	264	68,324	125,033	運輸
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	537	727	98,219	179,740	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	125,461 108	199,813 122	13,382,571 —	24,490,105 <14.9%>
(カタル)			千カタルリアル		
QATAR NATIONAL BANK	5,900	7,413	11,771	489,592	銀行
COMMERCIAL BANK QSC	3,260	5,313	2,826	117,552	銀行
OOREDOO QSC	728	728	712	29,617	電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	599	599	964	40,118	エネルギー
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	965	965	1,635	68,036	公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	985	2,145	2,101	87,404	銀行
INDUSTRIES QATAR	1,967	2,829	3,643	151,553	資本財
QATAR ISLAMIC BANK	2,063	2,595	4,672	194,315	銀行
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	4,697	4,697	1,623	67,536	エネルギー
MASRAF AL RAYAN	7,323	11,431	2,661	110,676	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	2,074	2,074	553	23,023	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,439	4,439	710	29,540	素材
DUKHAN BANK	—	3,197	1,221	50,800	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	35,004 12	48,429 13	35,099 —	1,459,767 <0.9%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	146	146	2,406	19,542	素材
BIDVEST GROUP LTD	277	503	13,493	109,569	資本財
CLICKS GROUP LTD	354	354	10,113	82,120	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY LIMITED	595	987	12,919	104,904	保険
GOLD FIELDS LTD	1,200	1,442	35,506	288,311	素材
REMGRO LTD	746	746	10,450	84,858	金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	375	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り

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)	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	563	998	8,726	70,862	素材
EXXARO RESOURCES LTD	342	342	6,487	52,678	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	113	146	27,608	224,181	銀行
MTN GROUP LTD	2,192	2,553	24,283	197,184	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	513	—	—	—	素材
FIRSTSTRAND LTD	6,175	8,166	51,513	418,288	金融サービス
NASPERS LTD-N SHS	276	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
NEDBANK GROUP LTD	631	631	13,094	106,325	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	59	99	6,635	53,876	素材
SASOL LTD	722	881	20,360	165,329	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	600	852	21,007	170,582	生活必需品流通・小売り
MR PRICE GROUP LTD	285	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,737	2,036	39,009	316,755	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	—	—	—	生活必需品流通・小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,104	1,763	12,322	100,060	一般消費財・サービス流通・小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	561	561	9,590	77,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABSA GROUP LTD	1,091	1,401	24,823	201,566	銀行
SANLAM LTD	2,140	3,074	21,207	172,205	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	1,140	1,508	12,132	98,516	素材
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,814	22,853	素材
VODACOM GROUP	844	793	8,677	70,461	電気通信サービス
NEPI ROCKCASTLE N.V.	605	673	7,002	56,863	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	4,896	9,746	11,734	95,287	保険
REINET INVESTMENTS SCA	171	171	7,083	57,520	金融サービス
PEPKOR HOLDINGS LTD	1,445	4,755	8,707	70,707	一般消費財・サービス流通・小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	405	—	—	—	メディア・娯楽
SIBANYE STILLWATER LTD	3,949	3,949	9,174	74,493	素材
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	480	480	5,586	45,363	素材
NASPERS LTD-N SHS	—	305	98,796	802,226	一般消費財・サービス流通・小売り
OUTSURANCE GROUP LTD	—	721	2,979	24,190	保険
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	—	674	21,537	174,887	素材
BID CORP LTD	439	580	24,660	200,239	生活必需品流通・小売り
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	37,474 36	52,104 33	592,449 —	4,810,691 <2.9%>	
(アラブ首長国連邦)			千アラブ首長国 連邦ディルハム		
ABU DHABI ISLAMIC BANK	1,857	1,857	1,969	81,331	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK	3,354	5,251	2,904	119,937	銀行
EMIRATES TELECOM GROUP CO	4,357	5,585	10,891	449,816	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	3,270	4,714	3,922	161,990	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	5,293	7,240	9,701	400,686	銀行
EMAAAR PROPERTIES PJSC	5,768	11,086	7,538	311,358	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	4,870	7,258	4,093	169,069	不動産管理・開発
EMIRATES NBD PJSC	2,702	2,702	4,810	198,678	銀行
MULTIPLY GROUP	—	5,196	1,917	79,192	資本財
AMERICANA RESTAURANTS INTERN	—	4,314	1,453	60,049	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)	
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	4,440	4,440	1,536	63,449	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	35,915	59,647	50,739	2,095,560	
	株 数 銘柄数 <比率>	9	11	—	<1.3%>
(サウジアラビア)			千サウジアラビアリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	265	510	1,925	77,874	素材
JARIR MARKETING CO	125	1,250	1,792	72,488	一般消費財・サービス流通・小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	—	62	739	29,922	保険
ETHIAD ETISALAT CO	488	488	2,315	93,626	電気通信サービス
SAUDI AWWAL BANK	1,167	1,478	5,131	207,536	銀行
AL RAJHI BANK	2,485	3,075	21,773	880,510	銀行
ARAB NATIONAL BANK	860	860	2,083	84,263	銀行
BANK ALBILAD	611	897	3,296	133,312	銀行
BANK AL-JAZIRA	358	978	1,668	67,458	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	675	948	3,527	142,666	銀行
RIYAD BANK	1,660	2,344	6,436	260,289	銀行
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	706	706	1,045	42,278	銀行
SAUDI TELECOM CO	1,835	3,013	11,510	465,480	電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	282	374	4,923	199,108	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	1,191	1,439	11,198	452,849	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	1,119	1,621	2,804	113,413	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	384	853	1,940	78,463	素材
SAVOLA	253	362	1,348	54,518	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	319	319	379	15,364	素材
ALMARAI CO	301	301	1,624	65,674	食品・飲料・タバコ
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	42	42	622	25,179	メディア・娯楽
EMAAE ECONOMIC CITY	461	—	—	—	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	472	472	1,516	61,324	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	117	117	442	17,880	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	1,034	1,034	1,108	44,839	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	1,009	1,009	1,486	60,117	不動産管理・開発
RABIGH REFINING AND PETROCHE	449	449	438	17,718	エネルギー
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	905	905	1,312	53,072	電気通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	60	142	2,915	117,911	保険
ALINMA BANK	1,242	1,613	5,622	227,356	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO	1,065	2,108	7,864	318,039	素材
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	79	159	1,716	69,419	ヘルスケア機器・サービス
DALLAH HEALTHCARE CO	—	68	1,067	43,162	ヘルスケア機器・サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	3,066	4,162	13,945	563,943	エネルギー
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	117	117	2,990	120,922	ヘルスケア機器・サービス
ACWA POWER CO	91	169	3,584	144,940	公益事業
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	—	93	1,265	51,191	素材
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	—	44	1,373	55,551	ソフトウェア・サービス
NAHDI MEDICAL CO	—	64	845	34,173	生活必需品流通・小売り
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	39	109	1,873	75,770	金融サービス
ELM CO	24	40	2,903	117,416	ソフトウェア・サービス
POWER & WATER UTILITY CO FOR	—	160	876	35,442	公益事業

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
THE SAUDI NATIONAL BANK		2,762	4,370	15,317	619,426	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	28,132 37	39,341 42	158,553 —	6,411,902 <3.9%>	
(クウェート)				千クウェート・ディナール		
KUWAIT FINANCE HOUSE		9,321	12,929	897	440,606	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO		2,968	2,968	142	70,105	電気通信サービス
GULF BANK		1,371	1,551	37	18,439	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT		8,931	12,049	1,072	526,591	銀行
AGILITY		1,576	3,233	169	83,046	運輸
MABANEE CO KPSC		1,337	1,418	118	58,078	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK K. S. C		1,528	1,620	97	47,661	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	27,036 7	35,772 7	2,534 —	1,244,529 <0.8%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	10,913,312 1,244	13,078,694 1,240	— —	155,297,427 <94.4%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		邦貨換算金額 (千円)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	391,700	11,241		95,785
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	97,360	14,324		122,052
小 計	口 数 ・ 金 額	450,100	489,060	25,566	217,838
	銘 柄 数 <比 率>	2	2	—	<0.1%>
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	45,900	1,353		41,467
ENERGISA SA-UNITS	37,400	37,400	1,792		54,904
KLABIN SA-UNIT	100,000	100,000	2,261		69,266
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	200,300	6,519		199,734
小 計	口 数 ・ 金 額	314,800	383,600	11,926	365,373
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.2%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	478,733	4,950		40,194
小 計	口 数 ・ 金 額	478,733	478,733	4,950	40,194
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	1,243,633	1,351,393	—	623,406
	銘 柄 数 <比 率>	7	7	—	<0.4%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	MSCI EMERG M	8,526	—

(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
株 式	155,297,427	94.2%
投 資 信 託 受 益 証 券	487,426	0.3
投 資 証 券	135,980	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,931,784	5.4
投 資 信 託 財 産 総 額	164,852,617	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(164,567,837千円)の投資信託財産総額(164,852,617千円)に対する比率は99.8%です。

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

1米ドル=151.43円	1メキシコペソ=8.5205円	1ブラジルレアル=30.6353円
1チリペソ=0.165877円	1コロンビアペソ=0.03766円	1ユーロ=161.56円
1イギリスポンド=185.08円	1トルコリラ=5.2987円	1チェココナ=6.5802円
1ハンガリーフォリント=0.426067円	1ポーランドズロチ=36.3973円	1ロシアルーブル=1.65円
1香港ドル=19.39円	1マレーシアリンギット=32.0325円	1タイバーツ=4.23円
1フィリピンペソ=2.7103円	1インドネシアルピア=0.0097円	1韓国ウォン=0.1151円
1新台湾ドル=4.6891円	1オフショア人民元=20.7438円	1インドルピー=1.83円
1カタールリアル=41.59円	1南アフリカランド=8.12円	1アラブ首長国連邦ディルハム=41.30円
1サウジアラビアリアル=40.44円	1クウェート・ディナール=491.02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 2023年11月10日現在
(A) 資 産	164,920,447,425円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,503,319,583
株 式(評価額)	155,297,427,328
投資信託受益証券(評価額)	487,426,422
投資証券(評価額)	135,980,476
未 収 入 金	123,926,100
未 収 配 当 金	203,368,549
差 入 委 託 証 拠 金	1,168,998,967
(B) 負 債	415,987,498
未 払 金	259,644,459
未 払 解 約 金	156,342,980
未 払 利 息	57
そ の 他 未 払 費 用	2
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	164,504,459,927
元 本	41,935,603,524
次 期 繰 越 損 益 金	122,568,856,403
(D) 受 益 権 総 口 数	41,935,603,524口
1万口当たり基準価額(C/D)	39,228円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	4,188,069,288円
受 取 配 当 金	4,034,836,619
受 取 利 息	106,982,057
そ の 他 収 益 金	46,735,760
支 払 利 息	△485,148
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,100,953,465
売 買 益	26,493,493,644
売 買 損	△13,392,540,179
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	242,805,788
取 引 益	1,135,442,921
取 引 損	△892,637,133
(D) そ の 他 費 用	△272,108,055
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	17,259,720,486
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	81,529,469,186
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	34,497,961,479
(H) 解 約 差 損 益 金	△10,718,294,748
(I) 計 (E+F+G+H)	122,568,856,403
次 期 繰 越 損 益 金(I)	122,568,856,403

(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32,714,193,593円、期中追加設定元本額は13,135,238,010円、期中一部解約元本額は3,913,828,079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。

世界経済インデックスファンド	9,998,563,511円
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,681,173,036円
DC世界経済インデックスファンド	7,264,996,363円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,043,436,095円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	2,272,805,509円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,452,511,178円
分散投資コア戦略ファンドS	1,419,462,050円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,149,700,192円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,015,754,264円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	782,747,081円
グローバル経済コア	417,761,723円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	385,409,398円
分散投資コア戦略ファンドA	310,316,270円
SMT 世界経済インデックス・オープン	242,050,933円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	233,992,225円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	172,756,262円
コア投資戦略ファンド(成長型)	142,991,154円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	98,760,072円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	95,525,041円
SMT インデックスバランス・オープン	95,202,337円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	93,733,030円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	90,532,563円
私募世界経済バシブファンド(適格機関投資家専用)	83,089,105円
コア投資戦略ファンド(切替型)	62,028,588円
コア投資戦略ファンド(安定型)	60,817,634円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	57,500,179円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	43,789,988円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	39,223,600円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	35,711,445円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	26,821,331円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,687,015円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	14,175,859円
10資産分散投資ファンド	13,147,546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)	12,259,652円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,679,596円
グローバル10資産バランスファンド	1,491,699円

## お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)



# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第24期（決算日 2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	わが国の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		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
第20期(2020年5月29日)	円	%			%	%	百万円
	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
第23期(2023年5月29日)	13,656	△1.3	374,891	△1.3	100.1	—	633,923
第24期(2024年5月29日)	12,992	△4.9	356,646	△4.9	99.9	—	660,373

(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
	騰落	率	騰落	率		
(当期首) 2023年 5月29日	円	%			%	%
	13,656	—	374,891	—	100.1	—
5月末	13,671	0.1	375,266	0.1	99.8	—
6月末	13,706	0.4	376,290	0.4	99.8	—
7月末	13,494	△1.2	370,426	△1.2	99.8	—
8月末	13,397	△1.9	367,761	△1.9	99.7	—
9月末	13,302	△2.6	365,131	△2.6	99.9	—
10月末	13,090	△4.1	359,310	△4.2	99.8	—
11月末	13,366	△2.1	366,877	△2.1	99.7	—
12月末	13,421	△1.7	368,384	△1.7	99.8	—
2024年 1月末	13,324	△2.4	365,748	△2.4	99.8	—
2月末	13,366	△2.1	366,902	△2.1	99.8	—
3月末	13,351	△2.2	366,497	△2.2	99.9	—
4月末	13,199	△3.3	362,353	△3.3	99.9	—
(当期末) 2024年 5月29日						
	12,992	△4.9	356,646	△4.9	99.9	—

(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。

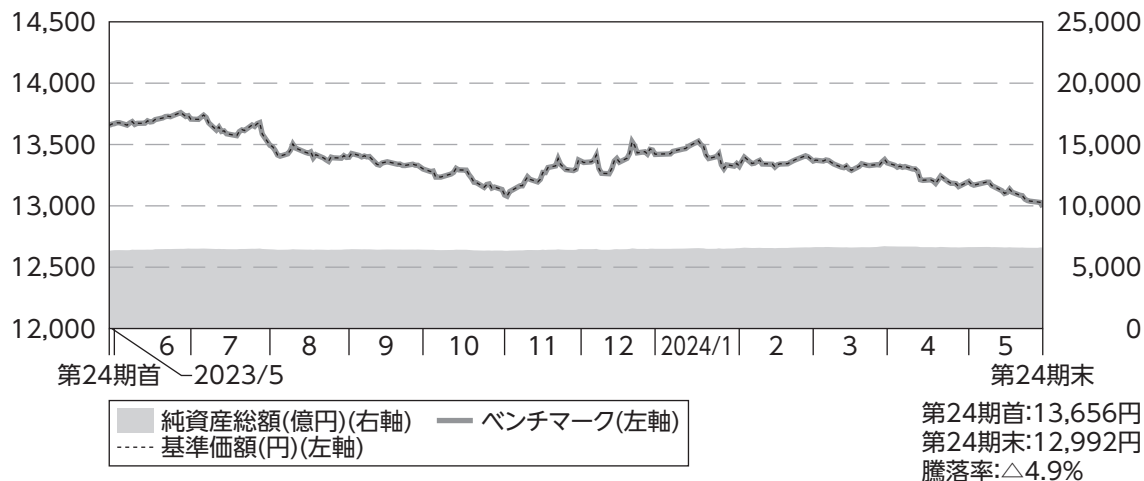
ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

【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。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

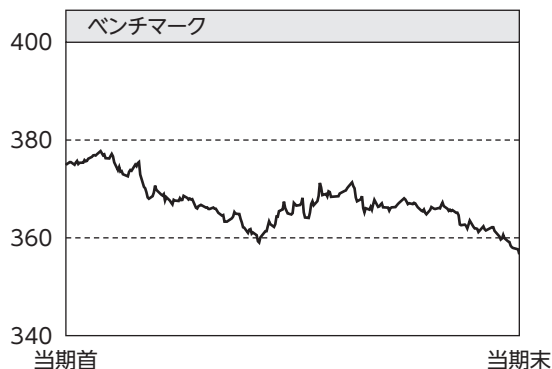


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額は、ベンチマークとほぼ同じ動きとなり、下落しました。

## 投資環境



国内金利は、2023年7月下旬に日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決定し、長期金利の事実上の上限を1%に引き上げたことを受けて、国内金利は上昇(価格は下落)しました。その後10月末にかけても米長期金利が上昇したことや、日銀が10月末の金融政策決定会合で一段の長短金利操作の柔軟化に動くとの思惑が高まったことから、金利上昇圧力が強まりやすい状況が続きました。2023年11月から2024年1月にかけては米国の追加利上げ観測が後退し、米長期金利が急速に低下したことや、日銀が本格的な金融政策の修正には慎重との見方が一時強まったことから、国内金利には低下圧力(価格は上昇)が一時的に強まりました。しかし、その後、3月に日銀によってマイナス金利が解除されるとの観測が強まったことから、国内金利は上昇に転じました。実際に3月の日銀金融政策決定会合でマイナス金利が解除された後も、日銀による追加利上げ観測が一部にくすぶり続けたことから期末にかけての国内金利には上昇圧力がかかりました。

## 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

キャッシュ部分はヘッジ目的で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

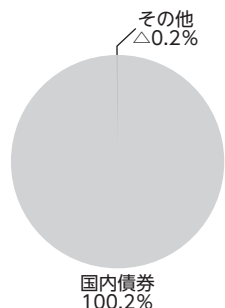
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
2	第350回利付国債(10年)	日本	1.0%
3	第370回利付国債(10年)	日本	0.9%
4	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%
5	第148回利付国債(5年)	日本	0.9%
6	第339回利付国債(10年)	日本	0.9%

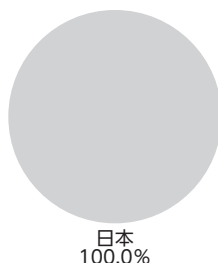
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第346回利付国債(10年)	日本	0.9%
8	第149回利付国債(5年)	日本	0.9%
9	第153回利付国債(5年)	日本	0.8%
10	第366回利付国債(10年)	日本	0.8%
組入銘柄数		1,038	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

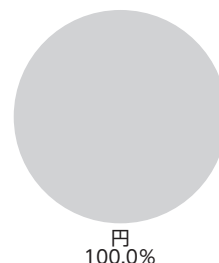
### ○資産別配分



### ○国別配分



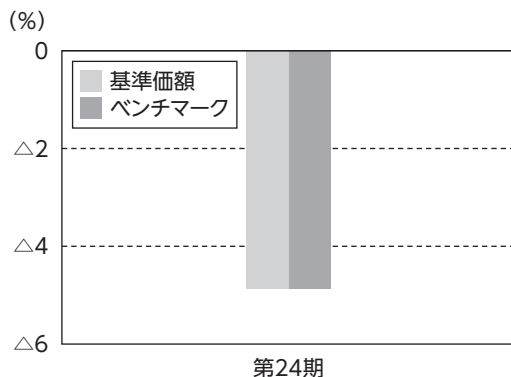
### ○通貨別配分



(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
	(2023年5月30日~2024年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用  (保管費用)  (監査費用) (その他)	0  (-)  (-) (0)	0.000  (-)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
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(13,390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	157,609,055	101,348,310
	地 方 債 証 券	5,320,876	3,573,226
	特 殊 債 券	10,298,090	7,994,020 (682,206)
	社債券(投資法人債券を含む)	9,652,345	5,913,332

(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 21,169	百万円 21,167	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 12	百万円 12	% 100.0	百万円 12	百万円 12	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	254,304	25,136	9.9	250,657	24,308	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。

※ 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(邦貨建)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 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
国 債 証 券	千円 585,397,000	千円 558,393,748	% 84.6	% —	% 53.6	% 21.0	% 10.0
地 方 債 証 券	33,502,430 (33,502,430)	32,895,868 (32,895,868)	5.0 (5.0)	— (—)	3.0 (3.0)	1.4 (1.4)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	36,293,918 (36,293,918)	35,245,116 (35,245,116)	5.3 (5.3)	— (—)	3.1 (3.1)	1.5 (1.5)	0.7 (0.7)
金 融 債 証 券	2,100,000 (2,100,000)	2,076,348 (2,076,348)	0.3 (0.3)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	32,700,000 (32,700,000)	31,358,100 (31,358,100)	4.7 (4.7)	— (—)	1.8 (1.8)	2.1 (2.1)	0.8 (0.8)
合 計	689,993,348 (104,596,348)	659,969,181 (101,575,433)	99.9 (15.4)	— (—)	61.5 (7.9)	26.2 (5.2)	12.2 (2.2)

(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449回利付国債(2年)	0.005	1,090,000	1,087,863	2025/6/1
第450回利付国債(2年)	0.005	1,140,000	1,137,457	2025/7/1
第451回利付国債(2年)	0.005	1,180,000	1,176,884	2025/8/1
第452回利付国債(2年)	0.005	3,140,000	3,130,548	2025/9/1
第453回利付国債(2年)	0.005	1,650,000	1,644,373	2025/10/1
第454回利付国債(2年)	0.1	2,890,000	2,882,601	2025/11/1
第455回利付国債(2年)	0.005	1,050,000	1,045,348	2025/12/1
第456回利付国債(2年)	0.1	1,100,000	1,096,249	2026/1/1
第457回利付国債(2年)	0.1	2,720,000	2,709,555	2026/2/1
第458回利付国債(2年)	0.2	1,490,000	1,486,230	2026/3/1
第459回利付国債(2年)	0.2	30,000	29,912	2026/4/1
第460回利付国債(2年)	0.3	2,240,000	2,236,774	2026/5/1
第144回利付国債(5年)	0.1	6,580,000	6,571,314	2025/6/20
第145回利付国債(5年)	0.1	5,020,000	5,010,462	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	4,800,000	4,785,072	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	5,040,000	5,009,205	2026/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	5,890,000	5,843,704	2026/6/20
第149回利付国債(5年)	0.005	5,680,000	5,628,652	2026/9/20
第150回利付国債(5年)	0.005	5,310,000	5,254,829	2026/12/20
第151回利付国債(5年)	0.005	3,250,000	3,211,682	2027/3/20
第152回利付国債(5年)	0.1	690,000	683,686	2027/3/20

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153回利付国債(5年)	0.005	5,620,000	5,545,366	2027/6/20
第154回利付国債(5年)	0.1	4,990,000	4,930,619	2027/9/20
第155回利付国債(5年)	0.3	2,670,000	2,652,698	2027/12/20
第156回利付国債(5年)	0.2	3,650,000	3,613,573	2027/12/20
第157回利付国債(5年)	0.2	2,460,000	2,431,513	2028/3/20
第158回利付国債(5年)	0.1	3,270,000	3,219,936	2028/3/20
第159回利付国債(5年)	0.1	950,000	933,584	2028/6/20
第160回利付国債(5年)	0.2	2,950,000	2,910,735	2028/6/20
第161回利付国債(5年)	0.3	1,410,000	1,396,830	2028/6/20
第162回利付国債(5年)	0.3	1,630,000	1,611,483	2028/9/20
第163回利付国債(5年)	0.4	3,480,000	3,455,083	2028/9/20
第164回利付国債(5年)	0.2	1,750,000	1,718,552	2028/12/20
第165回利付国債(5年)	0.3	2,510,000	2,476,014	2028/12/20
第166回利付国債(5年)	0.4	1,540,000	1,526,324	2028/12/20
第167回利付国債(5年)	0.4	1,570,000	1,553,153	2029/3/20
第168回利付国債(5年)	0.6	1,940,000	1,937,284	2029/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	740,000	796,728	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,030,000	1,064,144	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	730,000	751,009	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,150,000	1,176,783	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,250,000	1,221,612	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,630,000	1,549,233	2053/3/20



銘柄名	期			償還年月日
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	
第7回利付国債(40年)	1.7	1,460,000	1,317,912	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,310,000	1,088,583	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	2,260,000	1,347,479	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,040,000	1,432,345	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,765,000	1,181,702	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,630,000	958,179	2059/3/20
第13回利付国債(40年)	0.5	2,330,000	1,345,342	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	2,310,000	1,421,689	2061/3/20
第15回利付国債(40年)	1.0	2,950,000	2,006,118	2062/3/20
第16回利付国債(40年)	1.3	2,840,000	2,116,595	2063/3/20
第17回利付国債(40年)	2.2	150,000	144,775	2064/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	5,810,000	5,820,690	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	4,430,000	4,438,948	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	5,030,000	5,030,000	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	4,760,000	4,739,056	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	3,670,000	3,648,273	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	5,900,000	5,859,467	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	4,880,000	4,841,057	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	5,750,000	5,697,387	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,840,000	3,800,025	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,260,000	4,209,306	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	5,160,000	5,090,494	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	6,570,000	6,469,413	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	4,835,000	4,751,451	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	4,230,000	4,146,372	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,415,000	4,317,031	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	4,420,000	4,310,693	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	4,570,000	4,450,174	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	4,580,000	4,452,996	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	3,780,000	3,668,452	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	4,110,000	3,980,165	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	4,565,000	4,409,653	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	5,430,000	5,231,533	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	5,060,000	4,860,433	2030/12/20
第362回利付国債(10年)	0.1	4,450,000	4,261,320	2031/3/20
第363回利付国債(10年)	0.1	5,220,000	4,980,871	2031/6/20
第364回利付国債(10年)	0.1	5,320,000	5,057,564	2031/9/20
第365回利付国債(10年)	0.1	5,277,000	4,997,635	2031/12/20
第366回利付国債(10年)	0.2	5,760,000	5,477,875	2032/3/20
第367回利付国債(10年)	0.2	5,280,000	5,004,172	2032/6/20
第368回利付国債(10年)	0.2	5,490,000	5,184,810	2032/9/20
第369回利付国債(10年)	0.5	5,130,000	4,953,117	2032/12/20
第370回利付国債(10年)	0.5	6,110,000	5,879,408	2033/3/20
第371回利付国債(10年)	0.4	4,790,000	4,553,182	2033/6/20
第372回利付国債(10年)	0.8	5,220,000	5,126,718	2033/9/20
第373回利付国債(10年)	0.6	5,300,000	5,092,770	2033/12/20
第374回利付国債(10年)	0.8	2,580,000	2,517,048	2034/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	122,420	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	175,707	2030/2/20

銘柄名	期			償還年月日
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	131,420	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	125,226	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	54,894	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	580,000	646,375	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	380,000	421,769	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	850,000	911,361	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	249,436	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	162,081	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	260,000	276,377	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	208,509	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	400,000	435,088	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	750,000	843,007	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	385,546	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	200,000	226,870	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	1,130,000	1,271,374	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	315,000	351,335	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	530,000	590,950	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	545,121	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	750,000	836,287	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	300,000	341,031	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	488,879	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	680,000	772,738	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	600,000	667,656	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	1,510,000	1,697,934	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	1,670,000	1,896,301	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	1,830,000	2,076,098	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	1,870,199	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,970,000	2,175,411	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,400,000	1,522,962	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,700,000	1,867,790	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	2,290,000	2,410,018	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	2,145,000	2,312,374	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,480,000	2,591,624	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	2,420,000	2,519,220	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,715,000	2,775,300	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,560,000	1,562,184	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,800,000	1,826,820	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,190,000	1,185,751	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	1,310,000	1,280,852	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,530,000	1,492,407	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,390,000	1,352,567	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,270,000	1,233,678	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,600,000	1,497,632	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,820,000	1,700,025	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,620,000	1,537,639	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,870,000	1,706,169	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,750,000	1,593,025	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	1,870,000	1,498,543	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,940,000	1,375,227	2046/6/20

銘柄名	期			償還年月日
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	
第52回利付国債(30年)	0.5	1,860,000	1,377,534	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	1,630,000	1,231,220	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	1,920,000	1,512,940	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,620,000	1,271,100	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,760,000	1,375,035	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,480,000	1,151,336	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	2,130,000	1,649,919	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	1,430,000	1,075,631	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	1,630,000	1,282,174	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,350,000	1,006,263	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	1,285,000	903,958	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,380,000	938,579	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	1,520,000	1,028,386	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	1,385,000	932,160	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	1,495,000	1,000,962	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,665,000	1,175,107	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,560,000	1,095,666	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	1,610,000	1,158,539	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	1,920,000	1,376,352	2051/3/20
第71回利付国債(30年)	0.7	1,470,000	1,048,859	2051/6/20
第72回利付国債(30年)	0.7	1,710,000	1,215,382	2051/9/20
第73回利付国債(30年)	0.7	1,820,000	1,288,596	2051/12/20
第74回利付国債(30年)	1.0	1,770,000	1,359,006	2052/3/20
第75回利付国債(30年)	1.3	1,660,000	1,374,563	2052/6/20
第76回利付国債(30年)	1.4	1,760,000	1,490,966	2052/9/20
第77回利付国債(30年)	1.6	2,010,000	1,784,377	2052/12/20
第78回利付国債(30年)	1.4	1,500,000	1,264,995	2053/3/20
第79回利付国債(30年)	1.2	1,350,000	1,080,054	2053/6/20
第80回利付国債(30年)	1.8	2,070,000	1,919,034	2053/9/20
第81回利付国債(30年)	1.6	1,260,000	1,111,647	2053/12/20
第82回利付国債(30年)	1.8	980,000	906,166	2054/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	173,003	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	275,054	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	224,351	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	398,931	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	614,526	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	298,120	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	482,431	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	299,158	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	510,000	527,936	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,790,000	1,849,732	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	436,417	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	362,967	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	656,025	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	469,615	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	917,769	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	427,962	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	638,413	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	830,000	876,704	2027/6/20

銘柄名	期			償還年月日
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,669,865	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	900,000	951,201	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	463,597	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,510,000	1,596,145	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	510,566	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	765,872	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,180,000	1,268,393	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	428,376	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	170,044	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,256,723	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	680,000	727,076	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,173,997	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	840,000	889,947	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	920,000	975,402	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,176,516	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,045,660	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	990,000	1,062,101	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	2,020,000	2,174,227	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,200,000	2,374,966	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	759,430	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,660,000	1,805,963	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,480,000	1,601,389	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	711,717	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	565,356	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,370,000	1,445,007	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,470,000	1,579,456	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	900,000	961,566	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,800,000	1,959,240	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	760,000	822,472	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,240,000	1,359,932	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	930,000	1,007,552	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,098,438	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	1,340,000	1,444,252	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	740,000	792,340	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	2,055,000	2,200,699	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	1,290,000	1,372,534	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	790,000	840,678	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,810,000	1,939,704	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	1,640,000	1,757,899	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	130,000	138,340	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,150,000	1,215,354	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,200,000	1,276,908	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	1,330,000	1,394,664	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	480,000	507,144	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	2,490,000	2,650,131	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	1,650,000	1,755,583	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	1,265,000	1,356,548	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,660,000	1,751,233	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,160,000	1,214,299	2033/3/20

銘柄名	当期			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(20年)	1.7	2,275,000	2,418,302	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,670,000	2,835,192	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,740,000	2,880,918	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,260,000	2,351,439	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	2,980,000	3,096,339	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	2,970,000	3,052,476	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	2,515,000	2,530,391	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	2,680,000	2,690,291	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,350,000	2,377,565	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,845,000	2,842,155	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,640,000	2,574,633	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,690,000	2,439,695	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	3,200,000	2,818,368	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	3,050,000	2,774,859	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,400,000	2,200,800	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	2,430,000	2,247,725	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	2,390,000	2,172,916	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	1,650,000	1,493,514	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	2,610,000	2,351,949	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	2,370,000	2,096,525	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	2,410,000	2,121,571	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	1,890,000	1,703,835	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,430,000	2,116,845	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	1,630,000	1,390,862	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	2,240,000	1,870,758	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,550,000	2,116,296	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,960,000	1,617,392	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	1,750,000	1,460,200	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	2,400,000	1,990,104	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	2,530,000	2,086,035	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	2,270,000	1,893,543	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	2,350,000	1,949,536	2041/3/20
第177回利付国債(20年)	0.4	2,460,000	1,993,608	2041/6/20
第178回利付国債(20年)	0.5	2,520,000	2,068,516	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	2,825,000	2,307,290	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	2,200,000	1,888,062	2042/3/20
第181回利付国債(20年)	0.9	2,430,000	2,113,225	2042/6/20
第182回利付国債(20年)	1.1	2,360,000	2,117,911	2042/9/20
第183回利付国債(20年)	1.4	2,490,000	2,343,289	2042/12/20
第184回利付国債(20年)	1.1	2,340,000	2,083,512	2043/3/20
第185回利付国債(20年)	1.1	2,540,000	2,252,522	2043/6/20
第186回利付国債(20年)	1.5	2,320,000	2,199,777	2043/9/20
第187回利付国債(20年)	1.3	1,900,000	1,733,712	2043/12/20
第188回利付国債(20年)	1.6	880,000	843,823	2044/3/20
小計		585,397,000	558,393,748	
<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	98,989	2026/12/18
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	70,234	2051/9/20

銘柄名	当期			期末
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第6回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	0.433	100,000	98,930	2028/12/20
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	109,943	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	106,469	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	101,523	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	97,595	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	200,000	211,876	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	106,316	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	107,023	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	71,096	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	212,024	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	210,918	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	198,820	2025/12/19
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	99,968	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	99,141	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	98,946	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	294,525	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	192,996	2029/12/20
第830回東京都公募公債	0.275	300,000	284,223	2032/6/18
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	99,618	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	99,268	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	99,205	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	195,510	2028/12/28
令和4年度第10回北海道公募公債	0.554	200,000	192,262	2032/12/27
令和5年度第6回北海道公募公債	0.802	100,000	97,414	2033/8/31
第31回1号宮城県公募公債(10年)	0.515	200,000	200,478	2025/9/29
第39回1号宮城県公募公債(10年)	0.605	100,000	96,000	2033/7/28
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	227,210	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	106,860	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	214,288	2030/11/12
第17回神奈川県公募公債(20年)	1.975	100,000	107,634	2031/7/11
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	105,717	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	101,810	2034/9/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	99,697	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	99,100	2027/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	98,946	2027/6/18
第243回神奈川県公募公債	0.075	200,000	192,942	2029/12/20
第260回神奈川県公募公債	0.77	208,000	203,471	2033/3/18
第6回大阪府公募公債(20年)	1.98	200,000	214,478	2030/9/13
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	300,000	319,872	2031/9/26
第10回大阪府公募公債(20年)	1.72	100,000	105,749	2032/9/24
第399回大阪府公募公債(10年)	0.529	100,000	100,241	2025/8/28
第400回大阪府公募公債(10年)	0.531	300,000	300,741	2025/9/29
第402回大阪府公募公債(10年)	0.493	100,000	100,160	2025/11/27
第407回大阪府公募公債(10年)	0.09	156,000	154,904	2026/4/27
第410回大阪府公募公債(10年)	0.001	200,000	197,904	2026/7/28
第439回大阪府公募公債(10年)	0.193	200,000	195,582	2028/12/27
第440回大阪府公募公債(10年)	0.2	100,000	97,726	2029/1/30
第458回大阪府公募公債(10年)	0.1	100,000	95,937	2030/7/30

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465回大阪府公募債(10年)	0.12	160,000	152,550	2031/2/25		
第468回大阪府公募債(10年)	0.129	182,000	173,038	2031/5/28		
第469回大阪府公募債(10年)	0.128	200,000	189,900	2031/6/27		
平成21年度第3回京都府公募債(20年)	2.19	100,000	107,618	2029/9/20		
平成23年度第5回京都府公募債(20年)	1.79	100,000	106,363	2031/10/17		
平成28年度第5回京都府公募債(20年)	0.327	100,000	88,200	2036/8/15		
平成29年度第5回京都府公募債(20年)	0.63	100,000	90,007	2037/8/14		
令和2年度第12回京都府公募債	0.12	140,500	134,386	2030/12/16		
第2回兵庫県公募債(20年)	2.37	100,000	105,893	2027/9/17		
第6回兵庫県公募債(15年)	1.35	100,000	102,870	2028/7/14		
第7回兵庫県公募債(15年)	1.12	100,000	101,909	2028/12/25		
第8回兵庫県公募債(15年)	1.09	100,000	101,755	2029/4/16		
第9回兵庫県公募債(20年)	2.25	400,000	432,292	2029/11/19		
第35回兵庫県公募債(20年)	0.578	100,000	87,893	2038/5/28		
令和元年度第17回兵庫県公募債	0.15	300,000	290,205	2030/1/28		
第1回静岡県公募債(20年)	2.18	100,000	102,405	2025/9/19		
第9回静岡県公募債(30年)	1.539	100,000	92,076	2045/6/20		
第12回静岡県公募債(30年)	0.822	100,000	76,213	2048/3/19		
第15回静岡県公募債(20年)	1.701	100,000	105,679	2032/10/15		
第18回静岡県公募債(20年)	1.473	100,000	102,596	2034/7/10		
平成29年度第5回静岡県公募債	0.19	100,000	98,976	2027/6/18		
平成29年度第8回静岡県公募債	0.21	100,000	99,036	2027/6/18		
平成29年度第11回静岡県公募債	0.215	100,000	98,914	2027/9/17		
令和2年度第11回静岡県公募債	0.204	310,000	298,114	2030/12/20		
令和5年度第7回静岡県公募債	0.745	165,000	160,582	2033/6/20		
平成21年度第5回愛知県公募債(20年)	2.28	100,000	107,757	2029/6/20		
平成27年度第17回愛知県公募債(10年)	0.38	100,000	99,958	2026/1/27		
平成27年度第18回愛知県公募債(10年)	0.22	100,000	99,666	2026/2/16		
平成28年度第5回愛知県公募債(10年)	0.07	100,000	99,163	2026/6/29		
平成29年度第6回愛知県公募債(10年)	0.22	200,000	198,038	2027/7/28		
平成29年度第12回愛知県公募債(20年)	0.606	300,000	267,807	2037/11/20		
平成30年度第1回愛知県公募債(10年)	0.185	100,000	98,394	2028/4/27		
平成30年度第6回愛知県公募債(30年)	0.777	100,000	75,011	2048/6/19		
令和元年度第16回愛知県公募債(10年)	0.09	200,000	192,810	2030/2/15		
令和2年度第7回愛知県公募債(10年)	0.145	100,000	96,257	2030/7/31		
令和3年度第6回愛知県公募債(30年)	0.718	200,000	140,092	2051/6/20		
令和5年度第6回愛知県公募債(10年)	0.673	100,000	96,568	2033/7/28		
平成20年度第1回広島県公募債(20年)	2.34	100,000	107,146	2028/9/21		
平成21年度第1回広島県公募債(20年)	2.21	200,000	214,636	2029/5/28		
平成27年度第4回広島県公募債	0.476	125,230	125,426	2025/11/25		
平成29年度第1回広島県公募債	0.175	100,000	98,964	2027/5/25		
令和2年度第7回広島県公募債	0.214	390,000	374,169	2031/3/19		
令和4年度第2回広島県公募債	0.369	100,000	95,357	2032/7/22		
第3回埼玉県公募債(10年)	0.706	100,000	97,103	2033/5/20		
第3回埼玉県公募債(20年)	2.42	100,000	105,730	2027/6/18		
第6回埼玉県公募債(20年)	2.26	100,000	106,810	2028/9/21		
第6回埼玉県公募債(30年)	0.957	100,000	80,375	2046/12/20		

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回埼玉県公募債(15年)	0.34	600,000	540,636	2035/8/17		
第7回埼玉県公募債(20年)	2.29	200,000	215,628	2029/6/22		
第8回埼玉県公募債(15年)	0.367	200,000	178,476	2036/4/18		
第10回埼玉県公募債(20年)	1.94	200,000	214,288	2030/11/12		
第18回埼玉県公募債(20年)	0.323	200,000	177,262	2036/5/20		
平成27年度第7回埼玉県公募債	0.469	100,000	100,123	2025/12/25		
平成28年度第6回埼玉県公募債	0.085	100,000	99,075	2026/9/29		
平成28年度第9回埼玉県公募債	0.249	100,000	98,283	2027/2/24		
平成29年度第4回埼玉県公募債	0.19	100,000	99,973	2026/6/22		
令和2年度第7回埼玉県公募債	0.125	100,000	95,869	2030/10/16		
令和2年度第8回埼玉県公募債	0.12	100,000	95,648	2030/12/17		
令和3年度第8回埼玉県公募債	0.125	150,000	141,771	2031/10/27		
平成19年度第1回福岡県公募債(20年)	2.38	100,000	105,890	2027/8/20		
平成20年度第2回福岡県公募債(20年)	2.05	100,000	106,139	2028/12/20		
平成22年度第1回福岡県公募債(15年)	1.67	100,000	101,916	2025/11/21		
平成23年度第1回福岡県公募債(20年)	2.008	100,000	107,788	2031/5/23		
平成23年度第1回福岡県公募債(15年)	1.491	100,000	102,471	2026/11/27		
平成24年度第1回福岡県公募債(30年)	2.12	100,000	104,018	2042/9/19		
平成26年度第4回福岡県公募債(20年)	1.249	100,000	99,891	2035/2/23		
平成27年度第7回福岡県公募債	0.464	100,000	100,115	2025/12/25		
平成30年度第1回福岡県公募債(30年)	0.777	100,000	75,011	2048/6/19		
平成20年度第1回福岡県公募債(20年)	0.639	100,000	88,396	2038/8/20		
令和2年度第1回福岡県公募債	0.155	300,000	289,290	2030/6/24		
令和3年度第2回福岡県公募債	0.155	100,000	95,307	2031/5/30		
令和3年度第1回福岡県公募債(15年)	0.299	100,000	88,078	2036/7/14		
令和5年度第1回福岡県公募債(グリーンボンド・10年)	0.681	100,000	96,850	2033/5/30		
令和5年度第3回福岡県公募債	0.656	100,000	96,592	2033/6/13		
第5回千葉県公募債(20年)	2.26	200,000	213,620	2028/9/21		
第6回千葉県公募債(20年)	2.26	100,000	107,423	2029/4/20		
第13回千葉県公募債(20年)	1.701	100,000	105,679	2032/10/15		
第20回千葉県公募債(20年)	0.42	100,000	89,830	2036/4/15		
平成28年度第4回千葉県公募債	0.085	100,000	99,079	2026/9/25		
平成28年度第6回千葉県公募債	0.18	120,000	118,968	2027/1/25		
令和元年度第7回千葉県公募債	0.08	300,000	289,002	2030/2/25		
令和2年度第7回千葉県公募債	0.15	100,000	96,112	2030/9/25		
令和4年度第6回千葉県公募債	0.554	130,000	125,222	2032/12/24		
令和6年度第1回千葉県公募債	0.87	100,000	97,329	2034/4/25		
平成27年度第1回新潟県公募債	0.476	100,000	100,120	2025/11/27		
令和3年度第1回長野県公募債(10年)	0.19	300,000	287,124	2031/4/16		
令和4年度第1回長野県公募債(10年)	0.299	300,000	285,333	2032/4/23		
令和6年度第1回長野県公募債(10年)	1.043	300,000	296,700	2034/5/25		
令和5年度第1回茨城県公募債	0.681	100,000	96,743	2033/6/30		
第1回群馬県公募債(20年)	1.841	200,000	212,934	2030/10/18		
第28回群馬県公募債(10年)	0.656	100,000	96,587	2033/6/20		
平成29年度第1回岐阜県公募債(10年)	0.205	100,000	98,826	2027/10/29		
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	125,743	2025/7/25		
第149回共同発行市場公募地方債	0.5	100,000	100,222	2025/8/25		
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	100,187	2025/11/25		

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156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	99,394	2026/3/25
第157回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	99,301	2026/4/24
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	198,334	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	198,186	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	396,272	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	98,903	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	99,140	2027/1/25
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	99,271	2027/2/25
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	197,910	2027/6/25
第174回共同発行市場公募地方債	0.145	594,300	586,455	2027/9/24
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	98,863	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	295,131	2028/4/25
第219回共同発行市場公募地方債	0.145	100,000	95,162	2031/6/25
第228回共同発行市場公募地方債	0.199	200,000	188,922	2032/3/25
第233回共同発行市場公募地方債	0.315	200,000	189,640	2032/8/25
第243回共同発行市場公募地方債	0.681	100,000	96,789	2033/6/24
第244回共同発行市場公募地方債	0.59	100,000	95,879	2033/7/25
第245回共同発行市場公募地方債	0.778	100,000	97,381	2033/8/25
令和4年度第3回長崎県公募債(10年)	0.364	100,000	95,442	2032/6/18
令和4年度第1回熊本市公募債	0.449	101,000	96,483	2032/11/30
平成27年度第1回静岡市公募債	0.476	100,000	100,157	2025/11/25
平成29年度第1回静岡市公募債	0.22	100,000	98,835	2027/11/24
平成30年度第1回浜松市公募債	0.145	100,000	97,530	2029/1/25
令和2年度第1回静岡市公募債	0.14	200,000	191,756	2030/11/18
第138回大阪市公募債(20年)	2.08	200,000	215,460	2030/6/14
第15回大阪市公募債(30年)	0.704	100,000	69,767	2051/6/20
第19回大阪市公募債(20年)	1.138	100,000	98,633	2035/4/24
第22回大阪市公募債(20年)	0.347	600,000	533,142	2036/5/30
第24回大阪市公募債(20年)	0.655	100,000	90,814	2037/4/21
令和3年度第2回大阪市公募債	0.16	200,000	190,776	2031/5/21
第1回名古屋市公募債(30年)	2.53	100,000	112,747	2035/3/20
第5回名古屋市公募債(30年)	2.49	100,000	111,527	2039/3/18
第9回名古屋市公募債(20年)	2.07	100,000	106,227	2028/12/20
第11回名古屋市公募債(30年)	1.774	100,000	96,594	2044/9/20
第499回名古屋市公募債(10年)	0.225	100,000	99,178	2027/3/26
第512回名古屋市公募債(10年)	0.15	300,000	289,221	2030/6/20
平成28年度第6回京都市公募債	0.18	200,000	198,276	2027/1/27
令和2年度第1回京都市公募債	0.135	200,000	192,194	2030/8/27
令和5年度第7回京都市公募債	0.482	100,000	98,963	2029/3/21
平成18年度第3回神戸市公募債(20年)	2.54	120,000	125,074	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公募債(20年)	2.38	200,000	213,886	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公募債(20年)	2.233	100,000	108,283	2030/1/29
平成24年度第12回神戸市公募債(20年)	1.711	100,000	105,699	2032/12/17
令和2年度第9回神戸市公募債(30年)	0.674	100,000	70,408	2050/6/20
令和3年度第6回神戸市公募債(30年)	0.713	100,000	69,966	2051/6/20
第20回横浜市の公募債(20年)	2.1	300,000	321,690	2029/10/19
平成27年度第3回横浜市公募債	0.524	100,000	100,248	2025/8/18

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成28年度第4回横浜市公募債	0.175	100,000	99,130	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公募債	0.24	100,000	99,091	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公募債	0.195	100,000	98,462	2028/4/17
平成30年度第4回横浜市公募債	0.289	100,000	98,419	2028/10/17
第30回横浜市公募債(20年)	1.376	200,000	203,024	2034/10/20
令和2年度第1回横浜市公募債	0.15	300,000	289,257	2030/6/12
令和3年度第2回横浜市公募債	0.16	100,000	95,384	2031/5/23
平成23年度第9回札幌市公募債(15年)	1.493	100,000	102,633	2027/2/12
平成26年度第10回札幌市公募債(20年)	1.267	100,000	100,014	2035/3/20
平成27年度第9回札幌市公募債(10年)	0.19	100,000	99,689	2025/12/19
令和5年度第3回札幌市公募債(10年)	0.605	200,000	192,250	2033/6/20
第11回川崎市公募債(20年)	1.84	100,000	106,461	2030/10/18
第13回川崎市公募債(30年)	1.695	200,000	177,302	2033/6/20
第17回川崎市公募債(20年)	1.527	100,000	104,043	2033/5/9
第89回川崎市公募債	0.16	100,000	99,141	2026/12/18
第93回川崎市公募債	0.105	100,000	95,848	2030/9/20
平成27年度第2回北九州市公募債	0.484	100,000	100,152	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公募債	0.08	100,000	99,319	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市公募債(20年)	2.14	100,000	107,354	2029/9/18
平成25年度第6回福岡市公募債(20年)	1.511	100,000	103,345	2034/2/17
2023年度第8回福岡市公募債(10年)	0.831	100,000	97,102	2034/3/15
平成28年度第4回広島市公募債	0.165	105,000	104,103	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公募債	0.23	170,000	167,766	2028/2/25
令和元年度第6回広島市公募債	0.115	550,000	530,898	2030/2/25
令和2年度第3回広島市公募債(5年)	0.02	300,000	298,614	2025/10/24
令和元年度第5回千葉市公募債	0.08	200,000	192,668	2030/2/25
令和3年度第8回千葉市公募債	0.209	300,000	283,602	2032/3/25
令和4年度第1回千葉市公募債	0.274	100,000	94,929	2032/4/22
令和5年度第2回福井県公募債	0.605	100,000	96,057	2033/7/14
平成27年度第1回山梨県公募債(10年)	0.495	100,000	100,197	2025/10/30
平成30年度第3回岡山県公募債(10年)	0.15	100,000	97,384	2029/3/29
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	105,759	2027/12/20
小 計		33,502,430	32,895,868	
<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	125,126	2026/3/13
第44回政府保証日本政策金融公庫債券	0.115	117,000	115,865	2027/1/18
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	98,982	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	206,904	2028/9/24
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	183,706	2028/9/15
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	99,006	2026/12/14
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	105,636	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	214,590	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	216,044	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	107,235	2040/5/31

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	108,347	2030/12/27	
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	106,589	2031/12/26	
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	100,000	104,725	2032/8/31	
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.641	100,000	105,353	2032/9/30	
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	105,439	2032/12/28	
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	100,000	106,293	2033/7/29	
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	206,212	2034/3/31	
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.427	100,000	102,424	2034/7/31	
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	204,054	2034/9/29	
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	99,282	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	199,532	2035/3/30	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.484	112,000	112,235	2025/6/30	
第261回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.381	140,000	140,053	2025/11/28	
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	199,766	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	99,547	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	71,563	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	247,000	244,119	2026/11/30	
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.085	112,000	110,868	2026/12/28	
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	202,984	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	99,007	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	197,908	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	98,816	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	118,351	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	196,474	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	265,098	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	210,079	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	96,610	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	96,297	2029/10/31	

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400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.442	400,000	267,524	2050/1/31	
第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.001	120,000	115,069	2030/3/29	
第76回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	150,000	150,220	2025/9/12	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	500,000	500,260	2025/11/18	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	100,028	2025/12/12	
第81回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.145	100,000	99,572	2026/2/16	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,307	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	99,006	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	248,404	2027/4/16	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	359,000	354,954	2027/6/14	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	98,905	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	98,848	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	108,524	2028/2/15	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	153,377	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	98,205	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	96,542	2029/7/13	
第17回政府保証民間都市開発債券	0.145	300,000	298,671	2026/2/26	
第37回新関西国際空港株式会社債	1.991	100,000	91,509	2053/12/19	
第1回国立大学法人東京大学債券	0.823	100,000	62,943	2060/3/19	
第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.225	100,000	98,971	2027/4/13	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	52,690	2070/7/16	
第5回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.21	130,000	133,530	2025/12/19	
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	200,000	209,716	2027/4/20	
第21回道路債券	2.75	100,000	113,816	2033/6/20	
第28回道路債券	2.83	200,000	228,896	2033/12/20	
第33回道路債券	2.91	200,000	230,216	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	106,498	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	112,322	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	106,962	2028/6/20	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	107,878	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	105,616	2032/9/17	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	101,327	2034/6/20	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	92,691	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	197,446	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	532,410	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	72,971	2058/3/19	
第247回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.342	200,000	161,432	2040/3/19	
第296回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.3	100,000	99,245	2027/2/26	
第301回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.201	200,000	197,702	2027/5/26	
第302回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.934	100,000	91,539	2038/5/26	

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3 1 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.186	300,000	279,072	2039/8/19
第3 1 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.385	100,000	89,240	2045/8/21
第3 1 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.213	100,000	94,567	2038/9/21
第2回公営企業債券(30年)	2.39	300,000	332,391	2033/12/20
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	101,982	2029/1/26
第5回公営企業債券(30年)	2.72	300,000	340,806	2034/9/22
第7回公営企業債券(30年)	2.67	200,000	226,320	2035/6/20
第8回公営企業債券(30年)	2.5	100,000	111,425	2035/9/21
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.043	200,000	214,498	2030/6/28
第10回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.752	200,000	211,156	2030/8/28
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	0.633	200,000	138,078	2050/8/26
第12回公営企業債券(20年)	2.58	100,000	104,183	2026/6/19
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	500,000	531,340	2031/12/26
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	100,000	104,951	2032/7/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	105,089	2032/9/28
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	500,000	519,070	2034/1/27
第30回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.171	100,000	98,147	2035/4/27
第45回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.248	100,000	98,696	2035/7/27
第76回地方公共団体金融機構債券	0.505	200,000	200,290	2025/9/26
F 7 7 回地方公共団体金融機構債券	1.519	200,000	204,628	2026/10/20
第83回地方公共団体金融機構債券	0.09	200,000	198,406	2026/4/28
第80回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.454	300,000	244,029	2040/10/26
第88回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	98,916	2026/9/28
第116回地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	97,309	2029/1/26
第119回地方公共団体金融機構債券	0.125	100,000	96,932	2029/4/27
F 1 2 9 回地方公共団体金融機構債券	1.07	700,000	705,607	2025/7/29
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	100,826	2025/7/30
F 1 4 3 回地方公共団体金融機構債券	1.351	100,000	102,406	2027/8/25
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	202,038	2025/10/28
第169回地方公共団体金融機構債券	0.681	200,000	192,136	2033/6/28
第170回地方公共団体金融機構債券	0.663	100,000	95,803	2033/7/28
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	0.929	200,000	201,638	2026/6/26
F 2 0 6 回地方公共団体金融機構債券	1.065	100,000	101,553	2028/1/28
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	100,647	2026/2/4
F 2 1 4 回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	101,037	2027/4/28
F 2 2 6 回地方公共団体金融機構債券	1.096	100,000	101,596	2029/2/28
F 2 4 6 回地方公共団体金融機構債券	1.196	100,000	101,489	2032/2/25
F 4 4 1 回地方公共団体金融機構債券	0.227	100,000	98,705	2027/10/25
第29回首都高速道路株式会社社債	0.125	100,000	98,828	2026/12/18
第33回首都高速道路株式会社社債	0.523	200,000	197,780	2028/12/20
第27回阪神高速道路株式会社社債	0.27	100,000	99,061	2027/3/19
第28回阪神高速道路株式会社社債	0.305	100,000	99,470	2026/6/19
第30回阪神高速道路株式会社社債	0.339	300,000	297,543	2027/5/31
第4回株式会社日本政策金融公庫社債	2.2	100,000	107,366	2029/9/20
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	108,265	2031/5/9
第1 1 7 回都市再生債券	0.804	200,000	199,014	2030/11/20
第1 5 9 回都市再生債券	0.43	200,000	109,008	2059/3/19

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1 6 1 回都市再生債券	0.687	100,000	60,586	2059/3/19
第1 7 1 回都市再生債券	0.886	200,000	127,238	2061/3/18
第1 9 1 回都市再生債券	1.907	100,000	86,984	2063/3/19
第6 2 回独立行政法人福祉医療機構債券	0.18	100,000	96,107	2030/6/20
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.18	85,920	84,708	2032/5/10
第3回一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	100,000	104,668	2027/3/19
第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.16	59,972	59,227	2033/1/10
第4回一般担保住宅金融公庫債券	2.41	100,000	104,676	2026/12/18
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.08	104,046	102,380	2033/4/10
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.06	117,960	115,504	2034/2/10
第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.14	41,954	41,182	2034/2/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.13	148,914	145,743	2034/6/10
第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.13	102,312	100,238	2034/8/10
第1 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	105,839	2027/12/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	13,106	13,444	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	12,723	13,078	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	14,253	14,738	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	16,593	17,140	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	17,496	18,117	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	17,821	18,422	2044/12/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	37,136	38,345	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	16,781	17,285	2045/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	16,775	17,677	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	16,179	17,275	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	15,928	16,405	2046/5/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	33,780	34,646	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	17,775	18,232	2046/8/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	23,795	24,270	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	22,605	23,066	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	22,782	23,264	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	48,782	49,612	2047/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	61,134	61,338	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	31,783	31,805	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	98,430	99,252	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	33,234	33,540	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	28,709	29,026	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	27,648	27,743	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	32,628	32,979	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	161,541	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	85,176	85,474	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	115,740	115,961	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	33,793	33,643	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	35,204	35,027	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	36,038	35,699	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	106,348	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	113,319	112,052	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	38,874	38,246	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	82,502	80,347	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	46,595	45,420	2050/3/10

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9 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	49,730	48,184	2050/5/10
第9 6回一般担保住宅金融支援機構債券	1.583	300,000	308,349	2027/3/19
第9 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	48,883	47,616	2050/6/10
第9 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	153,375	149,740	2050/7/10
第9 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	103,122	100,421	2050/8/10
第10 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	50,469	49,034	2050/9/10
第10 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	54,346	52,671	2051/1/10
第10 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	60,504	56,548	2051/5/10
第11 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	66,003	61,815	2051/10/10
第11 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	65,319	60,969	2051/11/10
第11 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	65,970	61,766	2051/12/10
第11 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	66,396	62,503	2052/1/10
第11 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	66,667	62,570	2052/2/10
第11 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	68,809	64,315	2052/7/10
第12 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	276,200	258,255	2052/8/10
第12 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	68,534	63,883	2052/9/10
第12 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	68,313	63,669	2052/10/10
第12 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	69,325	64,603	2052/11/10
第12 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	141,304	131,227	2052/12/10
第12 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	138,302	128,784	2053/1/10
第12 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	142,058	132,413	2053/2/10
第13 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	70,942	65,947	2053/3/10
第13 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	141,258	130,954	2053/4/10
第13 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	71,372	66,263	2053/6/10
第13 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	144,006	133,176	2053/7/10
第13 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	144,360	133,485	2053/8/10
第13 5回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	102,591	2043/3/20
第13 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	73,345	68,171	2053/10/10
第13 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	72,739	67,805	2053/11/10
第14 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	72,747	67,074	2054/1/10
第14 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	150,672	138,099	2054/3/10
第14 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	75,866	69,399	2054/4/10
第14 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	74,786	68,543	2054/5/10
第14 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	152,462	139,287	2054/6/10
第14 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	77,588	70,289	2054/7/10
第14 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	234,405	211,048	2054/9/10
第14 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	158,136	142,366	2054/10/10
第15 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	80,792	73,716	2055/2/10
第15 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	81,435	74,051	2055/3/10
第15 8回一般担保住宅金融支援機構債券	0.547	100,000	99,883	2027/5/20
第16 0回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	166,700	152,168	2055/9/10
第16 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	84,442	76,927	2055/11/10
第16 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	170,172	154,871	2055/12/10
第16 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	171,742	155,895	2056/1/10
第16 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	85,251	77,639	2056/2/10
第16 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	171,740	157,073	2056/3/10
第16 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	170,966	156,054	2056/5/10
第16 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	86,998	79,263	2056/6/10
第17 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	88,045	79,689	2056/8/10

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17 2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	262,908	237,921	2056/9/10
第17 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	88,076	79,751	2056/10/10
第17 5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	89,716	81,478	2056/12/10
第17 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	89,509	82,143	2057/3/10
第18 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	90,762	83,338	2057/6/10
第18 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.53	91,636	84,215	2057/8/10
第18 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	185,086	169,585	2057/9/10
第18 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.76	93,688	88,018	2057/12/10
第18 8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	186,570	179,301	2058/1/10
第19 1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	94,834	91,168	2058/4/10
第19 2回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	85,771	2036/7/18
第19 3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	95,563	91,841	2058/6/10
第19 4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.94	95,875	91,978	2058/7/10
第19 6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	194,410	187,821	2058/9/10
第19 7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	97,523	94,646	2058/10/10
第19 9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	97,981	95,384	2058/12/10
第20 8回一般担保住宅金融支援機構債券	0.215	200,000	197,794	2027/5/20
第3 2 0回一般担保住宅金融支援機構債券	0.753	100,000	70,525	2051/3/20
第3 5 4回一般担保住宅金融支援機構債券	0.964	300,000	274,518	2038/7/20
第3 5 6回一般担保住宅金融支援機構債券	1.156	100,000	93,992	2038/8/20
第2 1 回国際協力機構債券	1.734	100,000	104,878	2033/9/20
第6 4 回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	96,240	2029/11/29
第6 7 回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	193,014	2030/1/31
第7 3 回東日本高速道路株式会社債	0.21	500,000	479,920	2030/7/17
第8 6 回東日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	98,614	2026/12/18
第1 0 6 回東日本高速道路株式会社債	0.38	100,000	98,572	2028/7/31
第1 1 1 回東日本高速道路株式会社債	0.607	100,000	99,051	2029/4/25
第8 5 回中日本高速道路株式会社債	0.07	200,000	198,970	2025/10/21
第9 8 回中日本高速道路株式会社債	0.514	200,000	198,838	2028/2/21
第1 0 0 回中日本高速道路株式会社債	0.385	100,000	98,744	2028/5/18
第1 0 1 回中日本高速道路株式会社債	0.439	100,000	98,775	2028/8/17
第1 0 3 回中日本高速道路株式会社債	0.588	400,000	396,936	2028/11/21
第1 0 4 回中日本高速道路株式会社債	0.528	100,000	98,808	2029/1/31
第1 0 5 回中日本高速道路株式会社債	0.597	200,000	197,886	2029/3/28
第2 7 回西日本高速道路株式会社債	0.58	200,000	200,426	2025/9/2
第5 4 回西日本高速道路株式会社債	0.07	600,000	597,906	2025/6/20
第7 1 回西日本高速道路株式会社債	0.315	100,000	98,950	2027/9/17
第7 4 回西日本高速道路株式会社債	0.499	200,000	198,910	2027/12/20
第7 7 回西日本高速道路株式会社債	0.39	200,000	197,514	2028/5/25
第7 8 回西日本高速道路株式会社債	0.369	100,000	98,532	2028/7/27
第8 0 回西日本高速道路株式会社債	0.484	100,000	98,927	2028/8/31
第8 2 回西日本高速道路株式会社債	0.558	100,000	99,166	2028/10/13
第8 5 回西日本高速道路株式会社債	0.508	100,000	98,680	2029/2/16
第9 2 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	98,933	2026/8/19
第1 2 7 回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	181,784	2034/5/30
第2 0 回アンデス開発公社円貨債(2 0 2 3)	0.73	300,000	298,101	2027/1/7
小 計		36,293,918	35,245,116	



当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
<b>金融債券</b>					
い第843号商工債	0.12	200,000	199,192	2025/8/27	
い第847号商工債	0.1	100,000	99,295	2025/12/26	
い第850号商工債	0.1	200,000	198,190	2026/3/27	
い第876号商工債	0.45	400,000	393,584	2028/5/26	
い第878号商工債	0.43	100,000	98,183	2028/7/27	
第376回信金中金債(5年)	0.05	100,000	99,121	2026/3/27	
第379回信金中金債(5年)	0.04	100,000	98,901	2026/6/26	
第384回信金中金債(5年)	0.03	200,000	197,216	2026/11/27	
第385回信金中金債(5年)	0.04	400,000	394,312	2026/12/25	
第394回信金中金債(5年)	0.15	100,000	98,371	2027/9/27	
第16号商工債(10年)	0.45	100,000	99,845	2025/12/19	
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	100,138	2025/9/26	
小計		2,100,000	2,076,348		
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
第519回中部電力株式会社社債	0.84	100,000	89,809	2037/1/23	
第540回中部電力株式会社社債	0.53	100,000	80,830	2040/2/24	
第545回中部電力株式会社社債	0.3	100,000	94,216	2031/7/25	
第508回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	99,067	2027/4/23	
第510回関西電力株式会社社債	0.49	200,000	198,062	2027/7/23	
第511回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	98,682	2027/9/17	
第524回関西電力株式会社社債	0.514	100,000	98,092	2028/10/25	
第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	95,492	2030/12/20	
第538回関西電力株式会社社債	0.39	100,000	95,004	2031/1/24	
第550回関西電力株式会社社債	0.39	100,000	98,840	2027/5/25	
第554回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	99,776	2025/10/24	
第398回中国電力株式会社社債	0.425	100,000	98,923	2027/7/23	
第400回中国電力株式会社社債	0.34	100,000	98,544	2027/9/24	
第416回中国電力株式会社社債	0.355	200,000	193,990	2029/5/25	
第425回中国電力株式会社社債	0.37	100,000	95,893	2030/6/25	
第448回中国電力株式会社社債	0.92	300,000	288,732	2033/5/25	
第457回中国電力株式会社社債	1.401	100,000	99,258	2034/5/25	
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	98,827	2027/6/25	
第330回北陸電力株式会社社債	0.34	200,000	193,756	2029/5/25	
第339回北陸電力株式会社社債	0.5	200,000	176,060	2035/8/24	
第496回東北電力株式会社社債	0.355	100,000	98,560	2027/9/24	
第508回東北電力株式会社社債	0.465	100,000	97,527	2029/4/25	
第521回東北電力株式会社社債	0.45	200,000	192,798	2030/5/24	
第527回東北電力株式会社社債	0.32	100,000	94,624	2031/2/25	
第535回東北電力株式会社社債	0.2	100,000	97,166	2028/7/25	
第309回四国電力株式会社社債	0.4	100,000	96,226	2030/5/24	
第314回四国電力株式会社社債	0.29	100,000	94,219	2031/5/23	
第349回九州電力株式会社社債	0.43	200,000	198,048	2027/4/23	
第465回九州電力株式会社社債	0.38	100,000	97,848	2028/7/25	
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	97,984	2028/8/25	
第476回九州電力株式会社社債	0.43	100,000	97,259	2029/5/25	
第484回九州電力株式会社社債	0.375	200,000	192,994	2029/11/22	
第489回九州電力株式会社社債	0.44	100,000	96,288	2030/5/24	
第494回九州電力株式会社社債	0.31	100,000	94,166	2031/5/23	

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516回九州電力株式会社社債	0.92	200,000	192,256	2033/5/25	
第332回北海道電力株式会社社債	0.907	100,000	90,968	2036/4/25	
第340回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	99,138	2027/4/23	
第350回北海道電力株式会社社債	0.754	100,000	86,028	2038/3/25	
第385回北海道電力株式会社社債	1.03	100,000	96,891	2033/5/25	
第39回大成建設株式会社無担保社債	0.37	100,000	95,699	2030/6/14	
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	98,454	2027/11/30	
第32回清水建設株式会社無担保社債	0.55	100,000	98,914	2028/2/24	
第9回五洋建設株式会社無担保社債	0.802	100,000	98,821	2029/2/28	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	300,000	296,733	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	94,371	2031/6/3	
第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,684	2025/10/27	
第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,584	2025/12/5	
第19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	0.28	100,000	99,524	2026/3/6	
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	198,038	2026/6/3	
第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.18	300,000	299,337	2025/6/6	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.8	100,000	95,590	2033/5/25	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	99,716	2025/8/29	
第27回株式会社ニチレイ無担保社債	0.42	200,000	198,704	2026/11/24	
第8回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	1.043	100,000	98,626	2029/2/16	
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	97,781	2028/10/20	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	0.32	100,000	99,293	2026/4/13	
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	98,247	2028/5/26	
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	97,016	2030/4/22	
第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.32	100,000	99,426	2026/2/27	
第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.694	100,000	99,398	2028/3/1	
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	198,930	2025/12/19	
第16回株式会社セブン&アイホールディングス無担保社債	0.4	100,000	99,404	2026/11/2	
第17回株式会社セブン&アイホールディングス無担保社債	0.687	100,000	99,276	2028/11/2	
第13回旭化成株式会社無担保社債	0.12	100,000	99,663	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	97,917	2028/11/29	
第13回イビデン株式会社無担保社債	0.29	200,000	199,388	2025/9/12	
第4回エフ・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	97,865	2028/8/31	
第56回三井化学株式会社無担保社債	0.3	100,000	99,477	2026/2/27	
第13回J.S.R株式会社無担保社債	0.619	100,000	93,425	2032/9/1	
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	98,153	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	197,118	2027/2/26	

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	199,368	2025/6/11
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	77,112	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	98,043	2028/3/23
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	1.223	100,000	97,604	2033/12/7
第4回株式会社電通グループ無担保社債	0.22	100,000	99,722	2025/7/8
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	200,000	193,624	2030/7/8
第2回株式会社ADEKA無担保社債	0.692	100,000	98,860	2029/2/28
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	300,000	280,914	2031/10/14
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,614	2025/12/5
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.32	200,000	198,626	2026/8/31
第10回テルモ株式会社無担保社債	0.519	300,000	298,875	2027/4/23
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	99,384	2026/3/6
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	94,715	2029/7/31
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	0.834	100,000	95,500	2032/6/15
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	98,764	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	99,251	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	97,321	2029/4/19
第11回住友理工株式会社無担保社債	0.78	100,000	95,063	2032/9/1
第34回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,101	2026/6/19
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	299,136	2025/7/14
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	0.425	100,000	98,613	2027/9/1
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.315	100,000	98,347	2027/10/14
第14回株式会社LIXIL無担保社債	0.475	100,000	98,668	2027/8/27
第15回株式会社小松製作所無担保社債	0.24	100,000	99,151	2026/7/13
第17回株式会社クボタ無担保社債	0.95	100,000	96,481	2033/4/20
第8回株式会社タダノ無担保社債	0.28	100,000	99,553	2025/7/17
第17回株式会社日立製作所無担保社債	1.371	100,000	102,125	2028/12/13
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	95,981	2030/3/12
第23回株式会社日立製作所無担保社債	1.184	100,000	97,192	2033/12/14
第1回株式会社安川電機無担保社債	0.13	100,000	98,913	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	99,632	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	95,604	2030/7/16
第21回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,321	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	95,029	2030/12/24
第26回パナソニック株式会社無担保社債	1.342	100,000	98,912	2033/9/14
第37回ソーグループ株式会社無担保社債	0.28	200,000	199,210	2025/12/8
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	98,267	2028/3/17
第35回三菱重工株式会社無担保社債	0.33	100,000	98,497	2027/8/27
第22回J.A.三井リース株式会社無担保社債	0.45	100,000	98,708	2027/9/1
第27回J.A.三井リース株式会社無担保社債	0.43	100,000	99,075	2027/1/25
第28回J.A.三井リース株式会社無担保社債	0.634	100,000	98,294	2029/1/25
第29回J.A.三井リース株式会社無担保社債	0.708	200,000	199,894	2027/5/28
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,179	2026/2/4
第32回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.11	200,000	197,268	2026/9/29
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.219	200,000	189,564	2031/3/18
第8回株式会社SUBARU無担保社債	1.059	100,000	98,758	2030/11/29

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1回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,054	2026/3/11
第4回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.771	200,000	198,668	2029/4/25
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	81,196	2040/3/9
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	98,942	2027/7/12
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	106,185	2033/3/4
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	193,460	2029/7/11
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	98,698	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	98,193	2028/9/14
第60回住友商事株式会社無担保社債	0.574	100,000	95,309	2032/5/24
第3回岩谷産業株式会社無担保社債	0.714	100,000	97,618	2029/9/7
第43回株式会社丸井グループ無担保社債	0.4	200,000	197,974	2027/1/22
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	0.629	100,000	98,274	2029/1/23
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.629	100,000	98,398	2029/1/31
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	95,792	2029/12/12
第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.4	100,000	98,642	2027/9/2
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	107,866	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	104,449	2027/4/20
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.831	100,000	99,242	2029/4/26
第9回みずほリース株式会社無担保社債	0.23	100,000	97,126	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	198,746	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	400,000	384,804	2030/9/20
第25回N.T.T.ファイナンス株式会社無担保社債	0.648	100,000	98,074	2030/6/20
第26回N.T.T.ファイナンス株式会社無担保社債	0.838	200,000	192,276	2033/6/20
第30回N.T.T.ファイナンス株式会社無担保社債	1.213	300,000	297,219	2033/9/20
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.22	100,000	97,220	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	99,060	2026/6/19
第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.25	200,000	199,340	2025/9/19
第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.3	100,000	99,589	2025/12/19
第86回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.663	300,000	299,793	2027/6/18
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	99,486	2025/10/21
第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,569	2025/10/21
第41回コーリス株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,009	2026/4/17
第44回コーリス株式会社無担保社債	0.904	100,000	99,672	2029/5/22
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	99,551	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	98,789	2026/7/31
第32回株式会社ジャックス無担保社債	0.23	100,000	98,906	2026/6/8

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35回株式会社ジャックス無担保社債	0.25	100,000	98,587	2026/12/9
第38回株式会社ジャックス無担保社債	0.824	100,000	99,365	2028/3/1
第39回株式会社ジャックス無担保社債	0.555	100,000	98,838	2027/7/16
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.28	100,000	95,830	2029/10/19
第212回オックス株式会社無担保社債	0.654	100,000	99,285	2028/3/8
第36回三井住友ファイナンス & リース株式会社無担保社債	0.26	200,000	198,212	2026/6/15
第42回三井住友ファイナンス & リース株式会社無担保社債	0.564	200,000	199,168	2027/4/19
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	197,128	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	98,469	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	97,823	2028/10/18
第311回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	98,184	2027/8/27
第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.794	100,000	99,045	2028/2/24
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	98,482	2026/9/4
第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	300,000	299,250	2025/9/5
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.75	200,000	197,342	2027/9/3
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.68	200,000	198,740	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	197,274	2026/11/13
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	198,878	2026/3/13
第84回三井不動産株式会社無担保社債	1.057	200,000	193,956	2033/9/12
第86回三井不動産株式会社無担保社債	1.831	200,000	184,042	2043/9/11
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	197,122	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	81,607	2039/8/5
第135回三菱地所株式会社無担保社債	0.26	100,000	94,021	2031/6/20
第109回住友不動産株式会社無担保社債	0.31	100,000	94,464	2031/5/9
第17回日本ビルファンド投資法人無担保社債	0.888	100,000	85,146	2038/5/21
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	0.624	100,000	95,139	2032/6/2
第135回東武鉄道株式会社無担保社債	1.351	100,000	99,344	2034/5/30
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	75,696	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	82,264	2040/6/11
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	100,587	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	83,394	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	69,629	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	83,338	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	98,016	2028/9/7
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	104,185	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	213,540	2028/12/12
第109回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.283	100,000	97,848	2035/7/27
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	98,803	2026/7/28

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125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	79,860	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	69,645	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	96,116	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	70,068	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	80,545	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	61,524	2061/7/15
第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.21	300,000	298,869	2025/10/14
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	106,241	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	66,208	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	78,103	2047/8/30
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.582	100,000	80,305	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	106,664	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	96,012	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	99,199	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	69,302	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	58,190	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	48,797	2070/1/31
第54回東京地下鉄株式会社社債	1.055	100,000	62,508	2061/10/14
第56回東京地下鉄株式会社社債	1.066	100,000	73,308	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	140,410	2049/11/19
第13回日本航空株式会社無担保社債	1.634	100,000	98,876	2034/5/23
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	97,562	2028/11/22
第30回KDDI株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,565	2025/10/27
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.82	100,000	98,350	2028/7/12
第31回株式会社光通信無担保社債	1.38	200,000	166,472	2036/2/1
第33回株式会社光通信無担保社債	0.85	100,000	91,045	2031/6/16
第36回株式会社光通信無担保社債	0.8	100,000	89,821	2031/11/4
第31回沖繩電力株式会社社債	0.18	100,000	99,732	2025/6/25
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	88,069	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	98,890	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	97,859	2028/7/20
第77回電源開発株式会社無担保社債	0.4	100,000	98,906	2027/5/20
第84回電源開発株式会社無担保社債	0.754	100,000	99,746	2028/2/18
第86回電源開発株式会社無担保社債	0.93	100,000	96,291	2033/5/20
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	200,000	197,346	2029/10/9
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	98,498	2030/7/16
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	96,361	2032/10/8
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	100,000	95,882	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	262,677	2036/8/29
第64回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.55	100,000	99,073	2033/4/19
第67回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.6	100,000	92,794	2038/7/13
第69回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.724	100,000	99,989	2033/10/13

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9回株式会社JERA無担保社債	0.664	100,000	93,774	2032/5/25
第22回株式会社JERA無担保社債	0.5	200,000	198,440	2027/2/25
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	1.2	100,000	99,159	2030/9/6
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	1.431	100,000	97,129	2034/2/28
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.805	100,000	69,788	2050/9/9
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.225	200,000	190,822	2030/9/10
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	200,000	188,708	2031/6/3
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	80,032	2041/6/3
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	196,802	2028/6/6
第27回フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 円貨社債	0.554	100,000	99,775	2025/10/10
第41回フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 円貨社債	0.82	200,000	199,856	2026/10/16
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,054	2026/6/17

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32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.713	200,000	199,116	2026/7/13
第33回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.914	100,000	98,822	2028/7/13
第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.622	400,000	398,056	2026/6/12
第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債 (2023)	0.76	100,000	99,357	2026/6/29
第8回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債 (2023)	1.01	400,000	398,256	2028/9/7
小 計		32,700,000	31,358,100	
合 計		689,993,348	659,969,181	

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
	659,969,181	99.0	659,969,181	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,824,812	1.0	6,824,812	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	666,793,993	100.0	666,793,993	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 2024年5月29日現在
(A)資産	666,894,040,619円
コール・ローン等	4,773,389,492
公社債(評価額)	659,969,181,473
未収入金	590,871,000
未収利息	1,420,475,281
前払費用	40,076,373
差入委託証拠金	100,047,000
(B)負債	6,520,648,772
未払金	6,365,253,640
未払解約金	55,348,132
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純資産総額(A-B)	660,373,391,847
元本	508,297,614,856
次期繰越損益金	152,075,776,991
(D)受益権総口数	508,297,614,856口
1万口当たり基準価額(C/D)	12.992円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A)配当等収益	4,936,587,676円
受取利息	4,936,966,522
支払利息	△378,846
(B)有価証券売買損益	△37,695,137,513
売買益	50,166,329
売買損	△37,745,303,842
(C)先物取引等取引損益	△1,275,700
取引益	10,997,100
取引損	△12,272,800
(D)その他費用	△17
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△32,759,825,554
(F)前期繰越損益金	169,709,216,505
(G)追加信託差損益金	25,142,635,221
(H)解約差損益金	△10,016,249,181
(I)計(E+F+G+H)	152,075,776,991
次期繰越損益金(I)	152,075,776,991

(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。

## &lt;注記事項&gt;

※当ファンドの期首元本額は464,214,231,123円、期中追加設定元本額は73,916,959,310円、期中一部解約元本額は29,833,575,577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 98,469,000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。

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)	106,533,820,816円
DC日本債券インデックス・オープンS	87,453,482,214円
DC日本債券インデックス・オープンP	61,613,705,679円
DCマイセクション50	38,456,213,405円
DCマイセクション25	29,720,085,109円
分散投資コア戦略ファンドS	26,903,202,649円
DCマイセクションS50	21,785,083,043円
分散投資コア戦略ファンドA	18,842,053,099円
DCマイセクションS25	18,095,878,536円
日本債券ファンド・シリーズ1	17,617,963,964円
SMT 国内債券インデックス・オープン	16,944,986,081円
DCマイセクション75	13,082,195,211円
世界経済インデックスファンド	7,641,352,754円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,338,195,114円
DCマイセクションS75	6,035,578,133円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	5,126,250,339円

DC世界経済インデックスファンド	4,813,676,161円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,277,069,786円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	3,051,144,383円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,019,788,906円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,012,847,528円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,342,114,954円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	1,258,088,673円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	1,072,210,836円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,019,219,378円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	906,347,877円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	744,019,332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)	519,984,310円
グローバル10資産バランスファンド	496,588,616円
10資産分散投資ファンド	462,516,240円
グローバル経済コア	404,956,956円
DC日本債券インデックス・オープン	398,192,402円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	350,833,257円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	327,115,065円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	229,313,528円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2030	163,405,668円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	151,954,950円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	103,023,970円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	94,200,741円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2040	93,879,680円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	89,411,391円
SMT インデックスバランス・オープン	73,369,311円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	65,515,307円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	64,927,446円
SMT 世界経済インデックス・オープン	61,790,479円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	56,406,128円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	50,929,959円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	48,119,467円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	44,505,217円
DCターゲット・イヤール ファンド2055	41,903,339円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	28,376,519円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2050	27,959,526円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	24,034,042円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	22,629,970円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2060	20,884,252円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	20,028,504円
SBI資産設計オープン(分配型)	19,512,476円
私塾世界経済バンプファンド(適格機関投資家専用)	18,519,285円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	8,968,360円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,254,689円
エマージング株式オープン	2,227,240円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,321,333円
DCマイセクションS50(2024-2026リスク抑制型)	279,544円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2065	230,560円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2060	219,546円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2035	162,493円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2055	161,936円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2040	147,264円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2050	139,965円
DCターゲット・イヤールファンド(ライフステージ対応型)2045	139,965円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 外国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第24期（決算日 2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運用方針	日本を除く世界の主要国の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
	期騰落	中率	期騰落	中率			
第20期(2020年5月29日)	円 29,017	% 6.0	481,049	% 5.9	% 97.3	% 2.1	百万円 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
第23期(2023年5月29日)	31,760	3.3	525,385	3.1	98.4	0.8	269,104
第24期(2024年5月29日)	36,514	15.0	604,736	15.1	98.1	0.8	348,177

(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
	騰落	率	騰落	率		
(当期首) 2023年 5月29日	円 31,760	% －	525,385	% －	% 98.4	% 0.8
5月末	31,812	0.2	527,860	0.5	98.1	0.9
6月末	33,081	4.2	548,017	4.3	98.1	1.0
7月末	32,368	1.9	534,743	1.8	98.1	0.8
8月末	33,251	4.7	550,428	4.8	98.3	0.6
9月末	32,760	3.1	542,874	3.3	97.5	1.3
10月末	32,721	3.0	541,404	3.0	97.8	0.9
11月末	33,866	6.6	563,373	7.2	98.0	0.8
12月末	33,905	6.8	559,659	6.5	98.2	0.7
2024年 1月末	34,506	8.6	573,726	9.2	97.5	1.2
2月末	34,953	10.1	580,855	10.6	98.2	0.7
3月末	35,389	11.4	587,851	11.9	98.5	0.5
4月末	36,058	13.5	597,531	13.7	97.7	1.0
(当期末) 2024年 5月29日	36,514	15.0	604,736	15.1	98.1	0.8

(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。

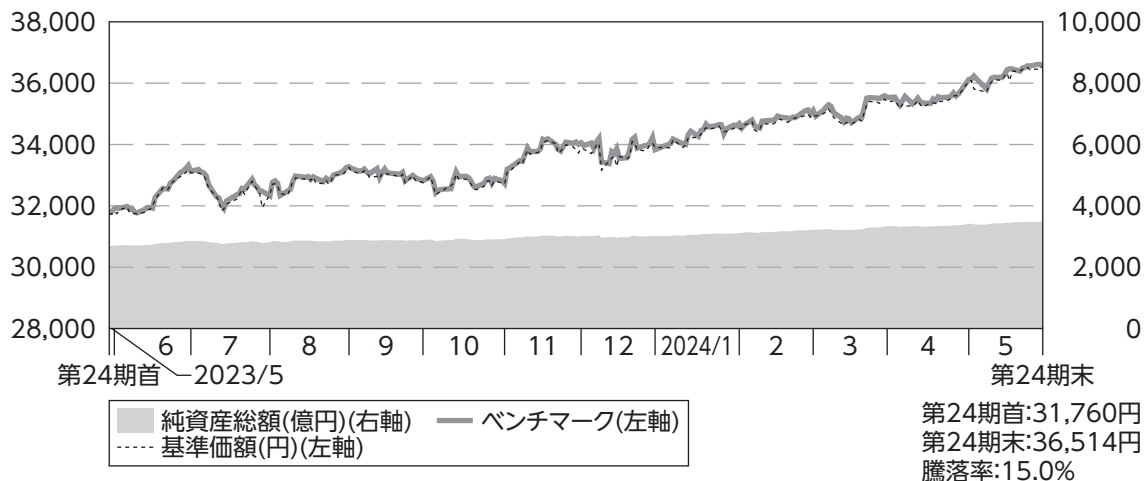
ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）です。

【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。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

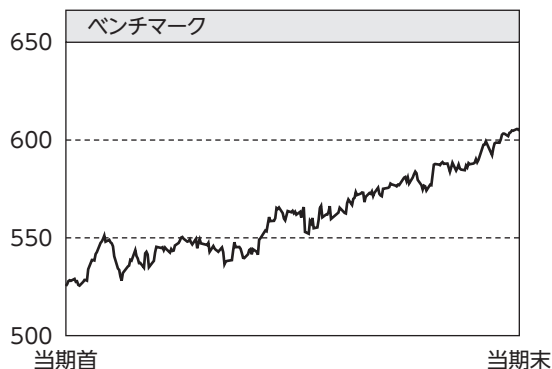


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークである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った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2023年10月中旬にかけて、主要中央銀行の金融引き締め長期化観測などを背景に上昇（債券価格は下落）しました。12月下旬にかけて、主要国の長期金利は、主要先進国のインフレ鈍化を示す指標を受けて、主要中央銀行の利下げ観測が高まったことから低下（債券価格は上昇）しました。2024年1月以降は米国の堅調な経済指標などを背景に、FRB（米連邦準備理事会）による早期利下げ観測が後退し、期末にかけて主要国の長期金利は上昇しました。

外国為替市場では、日本と主要国の中央銀行の金融政策の違いを背景に、主要国通貨は対円で上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークである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。キャッシュ部分はヘッジ目的で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

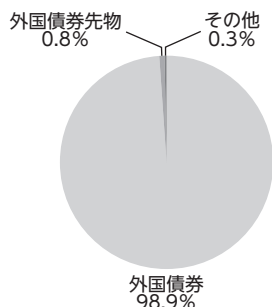
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.7%
2	T 4.375% 08/31/28	アメリカ	0.6%
3	T 4.125% 11/15/32	アメリカ	0.6%
4	T 3.375% 05/15/33	アメリカ	0.6%
5	T 2.75% 08/15/32	アメリカ	0.5%
6	T 3% 07/15/25	アメリカ	0.5%

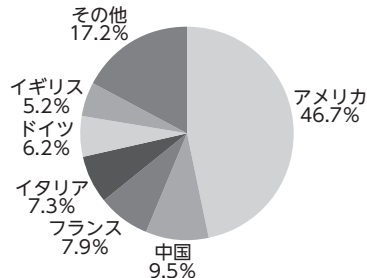
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.5%
8	T 3.5% 02/15/33	アメリカ	0.5%
9	T 1.125% 08/31/28	アメリカ	0.5%
10	T 1.625% 05/15/26	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		891	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

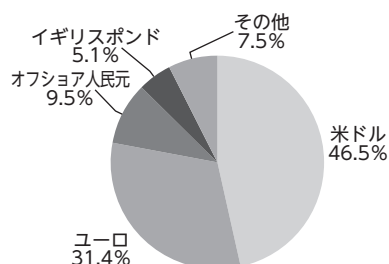
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

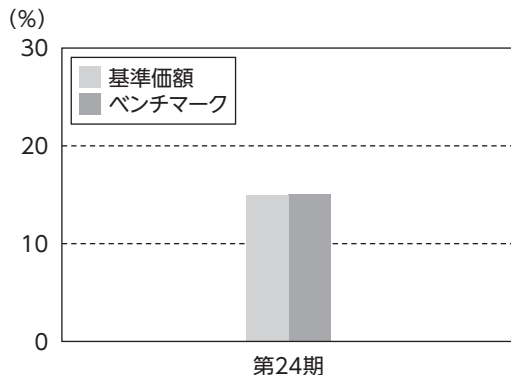


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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0.8%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マイナス要因は、カストディーコスト等です。

## 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
	(2023年5月30日~2024年5月29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	11	0.031	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(11)	(0.031)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	11	0.032	

(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(33,722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 292,754	千米ドル 193,959
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 21,830	千カナダドル 13,302
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 85,309	千メキシコペソ 76,751
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 35,326	千ユーロ 26,304
	イ タ リ ア	国 債 証 券	30,709	23,662
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	36,630	25,432
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	4,661	2,726
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	22,100	16,336
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	5,986	3,805
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	4,478	3,278
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,231	748
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	1,052	1,637
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 25,632	千イギリスポンド 9,141
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 4,049	千スウェーデンクローナ 1,102
ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 10,315	千ノルウェークローネ 6,250	
デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 5,534	千デンマーククローネ 8,753	
ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 15,687	千ポーランドズロチ 9,443	
オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 5,840	千オーストラリアドル 6,809	
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ニュージーランドドル 2,920	千ニュージーランドドル 1,692	
シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,177	千シンガポールドル 1,160	
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 8,378	千マレーシアリンギット 5,877	
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 998,443	千オフショア人民元 216,726	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 10,351	千イスラエルシェケル 3,085	

(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 36,966	百万円 36,581	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 48,609	百万円 300	% 0.6	百万円 12,405	百万円 25	% 0.2
金 銭 信 託	49	49	100.0	49	49	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	635,410	54,942	8.6	635,095	54,871	8.6

(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

### <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 1,160,890	千米ドル 1,016,740	千円 160,034,924	% 46.0	% —	% 19.2	% 17.2	% 9.5
カ ナ ダ	千カナダドル 65,620	千カナダドル 60,226	6,941,656	2.0	—	1.1	0.4	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 349,130	千メキシコペソ 312,515	2,929,453	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 132,080	千ユーロ 122,691	20,954,455	6.0	—	3.3	1.8	0.8
イ タ リ ア	153,190	145,291	24,814,279	7.1	—	4.1	1.9	1.0
フ ラ ン ス	174,490	159,085	27,170,192	7.8	—	4.3	2.4	1.1
オ ラ ン ダ	32,800	29,764	5,083,513	1.5	—	0.9	0.4	0.1
ス ペ イ ン	104,360	97,245	16,608,555	4.8	—	2.7	1.4	0.7
ベ ル ギ ー	38,480	35,333	6,034,528	1.7	—	1.2	0.4	0.2
オ ー ス ト リ ア	26,040	23,202	3,962,832	1.1	—	0.7	0.4	0.1
フ ィ ン ラ ン ド	12,100	10,440	1,783,078	0.5	—	0.3	0.1	0.1
ア イ ル ラ ン ド	11,620	10,091	1,723,570	0.5	—	0.3	0.1	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 107,290	千イギリスポンド 87,875	17,643,544	5.1	—	3.5	1.2	0.4
ス ウ ェ ー デ ン	千スウェーデンクローナ 46,670	千スウェーデンクローナ 44,960	668,118	0.2	—	0.1	0.1	0.0
ノ ル ウ ェ ー	千ノルウェークローネ 40,570	千ノルウェークローネ 37,432	560,360	0.2	—	0.1	0.0	0.0
デ ン マ ー ク	千デンマーククローネ 41,820	千デンマーククローネ 39,037	893,560	0.3	—	0.2	0.0	0.0
ポ ー ラ ン ド	千ポーランドズロチ 49,230	千ポーランドズロチ 45,369	1,822,191	0.5	—	0.2	0.3	0.1
オ ー ス ト ラ リ ア	千オーストラリアドル 47,940	千オーストラリアドル 42,856	4,479,809	1.3	—	0.9	0.3	0.1
ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	千ニューージーランドドル 9,860	千ニューージーランドドル 8,592	829,602	0.2	—	0.2	0.1	0.0
シ ン ガ ポ ー ル	千シンガポールドル 12,860	千シンガポールドル 12,108	1,412,615	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マ レ ー シ ア	千マレーシアリンギット 49,630	千マレーシアリンギット 50,659	1,697,340	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中 国 オ フ シ ョ ア	千オフショア人民元 1,449,280	千オフショア人民元 1,501,067	32,513,721	9.3	—	4.3	3.2	1.9
イ ス ラ エ ル	千イスラエルシェケル 30,790	千イスラエルシェケル 26,872	1,147,950	0.3	—	0.1	0.1	0.1
合 計	—	—	341,709,856	98.1	—	48.7	32.3	17.2

(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 (%)	当 期		未 期	
		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 0.25% 05/31/25	0.25	3,900	3,711	584,170	2025/5/31
T 0.25% 06/30/25	0.25	3,800	3,603	567,256	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	7,640	7,217	1,136,020	2025/7/31
T 0.25% 08/31/25	0.25	5,250	4,939	777,527	2025/8/31
T 0.25% 09/30/25	0.25	3,000	2,812	442,687	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,362	529,232	2025/10/31
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,405	1,165,669	2026/1/31
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,653	1,204,705	2025/4/30
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,801	755,779	2027/7/31
T 0.375% 09/30/27	0.375	6,580	5,708	898,483	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,797	440,271	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,716	584,937	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	4,500	4,161	655,011	2026/2/28
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,602	409,593	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,088	486,083	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	6,960	6,125	964,214	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,072	641,010	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,513	1,025,259	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	7,500	6,687	1,052,535	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	9,100	7,241	1,139,857	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	10,800	9,857	1,551,509	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	9,424	1,483,363	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,174	342,260	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	9,600	8,325	1,310,414	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,384	1,162,352	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	6,000	5,558	874,898	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	9,500	8,772	1,380,757	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,682	579,613	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	1,830	1,669	262,838	2026/8/31
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,366	1,159,472	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	2,900	2,647	416,733	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	8,878	1,397,460	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,043	951,270	2028/7/31
T 1.125% 02/15/31	1.125	4,080	3,285	517,190	2031/2/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,032	1,106,964	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,029	162,065	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	5,200	3,098	487,778	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	12,030	10,415	1,639,412	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	8,480	7,471	1,175,989	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,032	1,106,964	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	5,550	2,684	422,555	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	6,000	5,261	828,176	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,000	7,872	1,239,054	2028/6/30
T 1.25% 08/15/31	1.25	9,230	7,374	1,160,709	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	9,500	8,250	1,298,574	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,414	1,009,567	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,519	1,026,102	2026/12/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	5,700	2,849	448,502	2050/8/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	3,520	3,067	482,746	2028/10/31
T 1.375% 11/15/31	1.375	12,580	10,071	1,585,311	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	3,712	584,421	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	8,680	7,529	1,185,126	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,507	866,911	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,478	862,359	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	15,500	14,403	2,267,110	2026/8/15
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,559	1,032,453	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	5,600	5,289	832,616	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	10,770	10,104	1,590,506	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	5,960	4,929	775,841	2031/5/15

銘柄	利率 (%)	当 期		未 期	
		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 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	5,840	919,351	2029/8/15
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,595	408,578	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	3,691	581,020	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,422	696,032	2026/11/30
T 1.75% 01/31/29	1.75	6,000	5,286	832,160	2029/1/31
T 1.75% 08/15/41	1.75	7,080	4,592	722,896	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,601	409,504	2029/11/15
T 1.875% 02/15/32	1.875	11,720	9,693	1,525,755	2032/2/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	5,300	834,259	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	3,769	593,396	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	6,500	6,016	946,986	2027/2/28
T 1.875% 02/28/29	1.875	8,470	7,494	1,179,654	2029/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	4,868	766,328	2026/7/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	3,300	1,872	294,801	2051/11/15
T 2% 02/15/50	2.0	2,750	1,635	257,503	2050/2/15
T 2% 08/15/25	2.0	3,450	3,322	523,026	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	7,850	4,610	725,667	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	3,220	3,009	473,745	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	6,200	4,187	658,032	2041/11/15
T 2.125% 05/15/25	2.125	4,230	4,108	646,603	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,407	536,404	2026/5/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	5,550	5,195	817,811	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	4,300	2,680	421,888	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,142	1,124,287	2026/3/31
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	4,591	722,725	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	7,530	6,979	1,098,506	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	1,640	1,074	169,129	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	3,487	548,975	2049/8/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,224	664,992	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,056	1,110,673	2027/11/15
T 2.375% 02/15/42	2.375	5,500	3,933	619,076	2042/2/15
T 2.375% 03/31/29	2.375	4,900	4,431	697,568	2029/3/31
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,477	389,944	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	11,690	10,930	1,720,477	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	6,010	5,423	853,686	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	8,150	5,258	827,612	2051/5/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	4,100	2,670	420,328	2049/11/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	2,810	1,970	310,106	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	2,450	1,698	267,304	2046/2/15
T 2.5% 03/31/27	2.5	7,100	6,678	1,051,142	2027/3/31
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,450	1,002	157,719	2046/5/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,508	709,658	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	7,740	7,094	1,116,697	2029/2/15
T 2.625% 05/31/27	2.625	2,400	2,258	355,470	2027/5/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,604	882,109	2025/12/31
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,122	963,755	2028/2/15
T 2.75% 04/30/27	2.75	5,450	5,153	811,151	2027/4/30
T 2.75% 05/31/29	2.75	5,700	5,234	823,916	2029/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,359	843,617	2025/6/30
T 2.75% 08/15/32	2.75	12,900	11,313	1,780,816	2032/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	7,100	5,359	843,568	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	2,900	456,612	2047/8/15
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,699	1,054,453	2025/8/31
T 2.75% 11/15/42	2.75	6,020	4,531	713,251	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,180	343,137	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	3,915	616,316	2025/4/30
T 2.875% 04/30/29	2.875	3,300	3,052	480,443	2029/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	10,060	9,418	1,482,499	2028/5/15
T 2.875% 05/15/32	2.875	10,100	8,974	1,412,601	2032/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	5,050	3,857	607,144	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	6,080	4,409	694,118	2049/5/15

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)		
T 2.875% 05/15/52	2.875	10,800	7,759	1,221,419	2052/5/15	
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,732	587,509	2025/5/31	
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,319	837,213	2025/7/31	
T 2.875% 08/15/28	2.875	8,220	7,669	1,207,252	2028/8/15	
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	1,717	270,334	2045/8/15	
T 2.875% 11/15/46	2.875	940	694	109,244	2046/11/15	
T 2.875% 11/30/25	2.875	9,000	8,713	1,371,445	2025/11/30	
T 3% 02/15/47	3.0	6,600	4,976	783,228	2047/2/15	
T 3% 02/15/48	3.0	1,000	748	117,754	2048/2/15	
T 3% 02/15/49	3.0	1,000	744	117,164	2049/2/15	
T 3% 05/15/42	3.0	2,450	1,930	303,909	2042/5/15	
T 3% 05/15/45	3.0	700	535	84,261	2045/5/15	
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	2,415	380,183	2047/5/15	
T 3% 07/15/25	3.0	11,150	10,885	1,713,397	2025/7/15	
T 3% 08/15/48	3.0	3,250	2,424	381,554	2048/8/15	
T 3% 08/15/52	3.0	5,200	3,834	603,533	2052/8/15	
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,085	643,132	2025/9/30	
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	4,857	764,512	2025/10/31	
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,150	338,459	2044/11/15	
T 3% 11/15/45	3.0	2,300	1,753	275,962	2045/11/15	
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	846	133,229	2042/2/15	
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,800	3,027	476,533	2043/2/15	
T 3.125% 05/15/48	3.125	4,780	3,655	575,329	2048/5/15	
T 3.125% 08/15/25	3.125	10,200	9,956	1,567,224	2025/8/15	
T 3.125% 08/15/44	3.125	1,840	1,446	227,744	2044/8/15	
T 3.125% 08/31/27	3.125	6,150	5,855	921,708	2027/8/31	
T 3.125% 08/31/29	3.125	7,150	6,666	1,049,312	2029/8/31	
T 3.125% 11/15/28	3.125	10,410	9,787	1,540,477	2028/11/15	
T 3.25% 05/15/42	3.25	4,150	3,394	534,305	2042/5/15	
T 3.25% 06/30/29	3.25	3,000	2,818	443,665	2029/6/30	
T 3.375% 05/15/33	3.375	13,630	12,459	1,961,120	2033/5/15	
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	2,467	388,309	2044/5/15	
T 3.375% 08/15/42	3.375	2,300	1,911	300,837	2042/8/15	
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	4,232	666,251	2048/11/15	
T 3.5% 01/31/30	3.5	4,000	3,785	595,783	2030/1/31	
T 3.5% 02/15/33	3.5	11,200	10,356	1,630,181	2033/2/15	
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	682	107,373	2039/2/15	
T 3.5% 04/30/30	3.5	3,500	3,305	520,342	2030/4/30	
T 3.5% 09/15/25	3.5	2,900	2,840	447,054	2025/9/15	
T 3.625% 02/15/44	3.625	4,890	4,169	656,277	2044/2/15	
T 3.625% 02/15/53	3.625	9,550	7,966	1,253,972	2053/2/15	
T 3.625% 05/15/53	3.625	2,300	1,919	302,074	2053/5/15	
T 3.625% 08/15/43	3.625	4,700	4,020	632,858	2043/8/15	
T 3.75% 04/15/26	3.75	6,570	6,425	1,011,335	2026/4/15	
T 3.75% 06/30/30	3.75	3,000	2,868	451,541	2030/6/30	
T 3.75% 11/15/43	3.75	4,730	4,115	647,774	2043/11/15	
T 3.875% 01/15/26	3.875	6,500	6,380	1,004,216	2026/1/15	
T 3.875% 02/15/43	3.875	2,500	2,224	350,061	2043/2/15	
T 3.875% 08/15/33	3.875	8,170	7,755	1,220,781	2033/8/15	
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,320	207,814	2040/8/15	
T 3.875% 09/30/29	3.875	3,540	3,421	538,521	2029/9/30	
T 3.875% 11/30/29	3.875	8,130	7,851	1,235,773	2029/11/30	
T 4% 01/15/27	4.0	3,200	3,136	493,704	2027/1/15	
T 4% 02/15/26	4.0	6,500	6,389	1,005,775	2026/2/15	
T 4% 02/28/30	4.0	6,200	6,018	947,289	2030/2/28	
T 4% 07/31/30	4.0	3,980	3,857	607,120	2030/7/31	
T 4% 10/31/29	4.0	6,550	6,366	1,002,094	2029/10/31	
T 4% 11/15/52	4.0	7,400	6,618	1,041,777	2052/11/15	
T 4.125% 08/15/53	4.125	4,300	3,928	618,378	2053/8/15	
T 4.125% 08/31/30	4.125	9,200	8,974	1,412,556	2030/8/31	
T 4.125% 10/31/27	4.125	3,100	3,043	479,019	2027/10/31	
T 4.125% 11/15/32	4.125	14,000	13,581	2,137,793	2032/11/15	
T 4.25% 02/15/54	4.25	3,250	3,036	477,979	2054/2/15	

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)		
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	865	136,286	2039/5/15	
T 4.25% 10/15/25	4.25	6,900	6,819	1,073,311	2025/10/15	
T 4.25% 11/15/40	4.25	740	703	110,797	2040/11/15	
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	984	154,940	2038/2/15	
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	1,842	289,994	2040/5/15	
T 4.375% 05/15/41	4.375	650	626	98,581	2041/5/15	
T 4.375% 08/15/26	4.375	6,000	5,933	933,923	2026/8/15	
T 4.375% 08/31/28	4.375	14,150	14,009	2,205,068	2028/8/31	
T 4.375% 11/15/39	4.375	960	933	146,919	2039/11/15	
T 4.375% 11/30/30	4.375	4,500	4,449	700,414	2030/11/30	
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,096	172,641	2036/2/15	
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	547	86,170	2038/5/15	
T 4.5% 07/15/26	4.5	10,000	9,915	1,560,627	2026/7/15	
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	1,679	264,277	2039/8/15	
T 4.5% 11/15/33	4.5	9,270	9,235	1,453,740	2033/11/15	
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,378	216,999	2040/2/15	
T 4.625% 09/30/30	4.625	3,010	3,018	475,041	2030/9/30	
T 4.625% 10/15/26	4.625	9,520	9,469	1,490,516	2026/10/15	
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	756	119,062	2041/2/15	
T 4.75% 11/15/53	4.75	3,180	3,227	508,039	2053/11/15	
T 4.875% 10/31/30	4.875	2,500	2,541	399,955	2030/10/31	
T 5% 08/31/25	5.0	4,250	4,241	667,538	2025/8/31	
T 5.0% 05/15/37	5.0	400	419	66,080	2037/5/15	
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,334	210,887	2028/11/15	
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,052	323,031	2031/2/15	
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,731	272,576	2026/2/15	
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,517	238,839	2027/11/15	
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,139	179,427	2030/5/15	
小計				160,034,924		
<b>(カナダ)</b>		千カナダドル	千カナダドル			
<b>国債証券</b>						
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,125	245,041	2026/3/1	
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	3,010	2,864	330,200	2025/9/1	
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,320	2,185	218,487	2030/12/1	
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	743	85,730	2027/6/1	
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,427	164,506	2026/9/1	
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	1,880	1,745	201,192	2027/3/1	
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,146	362,709	2030/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	910	863	99,471	2026/6/1	
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,770	3,258	375,579	2031/6/1	
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	3,620	3,098	357,149	2031/12/1	
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	2,920	1,962	226,236	2053/12/1	
CAN 2% 06/01/28	2.0	410	383	44,194	2028/6/1	
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,520	1,341	154,603	2032/6/1	
CAN 2% 12/01/51	2.0	3,650	2,647	305,151	2051/12/1	
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,280	1,250	144,111	2025/6/1	
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	240	226	25,907	2029/6/1	
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	2,300	2,099	242,017	2032/12/1	
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	1,200	1,113	128,399	2033/6/1	
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	1,600	1,543	177,876	2027/9/1	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,050	907	104,635	2048/12/1	
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	1,420	1,210	139,564	2055/12/1	
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	620	521	60,123	2064/12/1	
CAN 3% 04/01/26	3.0	1,340	1,309	150,953	2026/4/1	
CAN 3% 06/01/34	3.0	1,850	1,744	201,055	2034/6/1	
CAN 3% 10/01/25	3.0	3,290	3,225	371,760	2025/10/1	
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	2,070	2,025	233,447	2028/9/1	
CAN 3.25% 12/01/33	3.25	1,310	1,263	145,664	2033/12/1	
CAN 3.5% 03/01/28	3.5	1,160	1,145	132,032	2028/3/1	
CAN 3.5% 08/01/25	3.5	920	908	104,725	2025/8/1	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	960	942	108,668	2045/12/1	
CAN 4% 03/01/29	4.0	2,400	2,424	279,438	2029/3/1	
CAN 4% 05/01/26	4.0	2,250	2,238	257,982	2026/5/1	

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	740	771	88,942	2041/6/1	
CAN 4.5% 02/01/26	4.5	300	300	34,635	2026/2/1	
CAN 4.5% 11/01/25	4.5	1,330	1,329	153,283	2025/11/1	
CAN 5% 06/01/37	5.0	630	714	82,402	2037/6/1	
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,490	1,630	187,960	2029/6/1	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,620	1,872	215,811	2033/6/1	
小計				6,941,656		
<b>(メキシコ)</b>						
		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
<b>国債証券</b>						
MBO10 10% 11/20/36	10.0	8,550	8,712	81,666	2036/11/20	
MBO10 5.5% 03/04/27	5.5	33,260	29,658	278,010	2027/3/4	
MBO10 5.75% 03/05/26	5.75	46,850	43,287	405,767	2026/3/5	
MBO10 7% 09/03/26	7.0	9,290	8,679	81,356	2026/9/3	
MBO10 7.5% 05/26/33	7.5	24,150	20,893	195,850	2033/5/26	
MBO10 7.5% 06/03/27	7.5	31,510	29,411	275,696	2027/6/3	
MBO10 7.75% 05/29/31	7.75	41,040	36,816	345,115	2031/5/29	
MBO10 7.75% 11/13/42	7.75	31,010	25,440	238,478	2042/11/13	
MBO10 7.75% 11/23/34	7.75	10,250	8,908	83,508	2034/11/23	
MBO10 8% 07/31/53	8.0	21,820	17,992	168,656	2053/7/31	
MBO10 8% 11/07/47	8.0	24,600	20,475	191,936	2047/11/7	
MBO10 8.5% 03/01/29	8.5	14,540	13,768	129,060	2029/3/1	
MBO10 8.5% 05/31/29	8.5	30,830	29,201	273,729	2029/5/31	
MBO10 8.5% 11/18/38	8.5	21,430	19,268	180,621	2038/11/18	
小計				2,929,453		
<b>(ドイツ)</b>						
		千ユーロ	千ユーロ			
<b>国債証券</b>						
BK0 2.5% 03/19/26	2.5	250	247	42,245	2026/3/19	
BK0 2.8% 06/12/25	2.8	1,490	1,481	253,087	2025/6/12	
BK0 3.1% 09/18/25	3.1	1,360	1,357	231,795	2025/9/18	
BK0 3.1% 12/12/25	3.1	1,820	1,817	310,393	2025/12/12	
DBR 0% 02/15/30	—	970	840	143,516	2030/2/15	
DBR 0% 02/15/31	—	1,660	1,404	239,911	2031/2/15	
DBR 0% 02/15/32	—	3,100	2,558	436,932	2032/2/15	
DBR 0% 05/15/35	—	2,980	1,793	306,251	2035/5/15	
DBR 0% 05/15/36	—	2,430	1,777	303,571	2036/5/15	
DBR 0% 08/15/26	—	2,920	2,739	467,908	2026/8/15	
DBR 0% 08/15/29	—	2,950	2,585	441,608	2029/8/15	
DBR 0% 08/15/30	—	2,350	2,013	343,805	2030/8/15	
DBR 0% 08/15/30	—	1,480	1,268	216,653	2030/8/15	
DBR 0% 08/15/31	—	3,990	3,336	569,849	2031/8/15	
DBR 0% 08/15/50	—	4,580	2,287	390,629	2050/8/15	
DBR 0% 08/15/52	—	3,020	1,436	245,355	2052/8/15	
DBR 0% 11/15/27	—	2,420	2,205	376,717	2027/11/15	
DBR 0% 11/15/28	—	1,990	1,773	302,946	2028/11/15	
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	1,940	1,811	309,374	2027/2/15	
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	1,370	1,229	210,005	2029/2/15	
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,090	1,894	323,604	2028/8/15	
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,873	490,699	2026/2/15	
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	1,360	1,257	214,713	2028/2/15	
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	350	326	55,726	2027/8/15	
DBR 1% 05/15/38	1.0	2,080	1,671	285,446	2038/5/15	
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,430	2,365	403,952	2025/8/15	
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,490	2,588	442,139	2048/8/15	
DBR 1.7% 08/15/32	1.7	3,160	2,967	506,813	2032/8/15	
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	3,050	2,499	426,825	2053/8/15	
DBR 2.1% 11/15/29	2.1	3,430	3,344	571,152	2029/11/15	
DBR 2.2% 02/15/34	2.2	1,830	1,770	302,422	2034/2/15	
DBR 2.3% 02/15/33	2.3	4,630	4,541	775,670	2033/2/15	
DBR 2.4% 11/15/30	2.4	1,390	1,375	234,953	2030/11/15	
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,930	2,814	480,713	2044/7/4	
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	2,920	2,802	478,623	2046/8/15	
DBR 2.5% 08/15/54	2.5	1,330	1,275	217,759	2054/8/15	
DBR 2.6% 08/15/33	2.6	1,790	1,795	306,661	2033/8/15	

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,030	2,170	370,691	2042/7/4	
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,570	2,929	500,402	2037/1/4	
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,810	2,146	366,616	2039/7/4	
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,430	1,544	263,748	2028/7/4	
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,130	2,533	432,743	2034/7/4	
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	1,980	2,492	425,731	2040/7/4	
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	3,100	3,642	622,095	2031/1/4	
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,810	3,086	527,132	2028/1/4	
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,484	253,467	2030/1/4	
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	2,690	2,980	509,028	2027/7/4	
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	2,904	496,031	2026/4/10	
OBL 0% 04/16/27	—	2,550	2,354	402,151	2027/4/16	
OBL 0% 10/09/26	—	2,680	2,504	427,337	2026/10/9	
OBL 0% 10/10/25	—	4,000	3,832	654,627	2025/10/10	
OBL 1.3% 10/15/27	1.3	3,550	3,389	578,844	2027/10/15	
OBL 2.1% 04/12/29	2.1	1,480	1,444	246,674	2029/4/12	
OBL 2.2% 04/13/28	2.2	2,950	2,897	494,862	2028/4/13	
OBL 2.4% 10/19/28	2.4	4,270	4,224	721,428	2028/10/19	
<b>(イタリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
BTPS 0% 04/01/26	—	2,240	2,104	359,356	2026/4/1	
BTPS 0% 08/01/26	—	3,230	3,001	512,673	2026/8/1	
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,495	255,407	2028/3/15	
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	1,880	1,641	280,365	2029/2/15	
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,818	310,588	2026/2/1	
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	1,300	1,158	197,783	2028/7/15	
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,571	439,234	2031/8/1	
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,340	2,193	374,587	2027/1/15	
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,920	2,455	419,307	2031/4/1	
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,320	923	157,652	2037/3/1	
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,320	1,892	323,230	2032/6/1	
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,916	327,275	2030/8/1	
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	1,490	1,379	235,655	2027/9/15	
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,771	302,539	2031/12/1	
BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	2,350	2,206	376,885	2027/4/1	
BTPS 1.2% 08/15/25	1.2	850	826	141,171	2025/8/15	
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,670	1,585	270,863	2026/12/1	
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	2,250	1,999	341,553	2030/4/1	
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,180	905	154,608	2036/3/1	
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,255	385,237	2025/5/15	
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	788	134,644	2045/4/30	
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,361	404,384	2025/6/1	
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,080	1,042	178,026	2026/6/1	
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	2,430	2,111	360,631	2032/3/1	
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,263	386,574	2030/12/1	
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,350	816	139,438	2051/9/1	
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	960	689	117,757	2041/3/1	
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,652	452,961	2025/7/1	
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,155	368,057	2028/2/1	
BTPS 2% 12/01/25	2.0	3,220	3,152	538,359	2025/12/1	
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,320	2,229	380,841	2027/8/1	
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	1,440	1,402	239,468	2026/7/15	
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	690	418	71,494	2072/3/1	
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	1,020	673	115,085	2052/9/1	
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,205	376,632	2027/6/1	
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,650	1,378	235,455	2036/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,600	2,341	399,968	2033/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,380	993	169,748	2050/9/1	
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	1,660	1,637	279,741	2025/11/15	
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	2,520	2,305	393,812	2032/12/1	
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	1,760	1,719	293,607	2027/12/1	
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,110	866	147,990	2047/3/1	
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	830	604	103,249	2067/3/1	

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 2.8% 06/15/29	2.8	2,610	2,535	432,977	2029/6/15	
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,420	1,387	236,894	2028/12/1	
BTPS 2.95% 02/15/27	2.95	330	326	55,719	2027/2/15	
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	1,110	975	166,619	2038/9/1	
BTPS 3% 08/01/29	3.0	1,150	1,127	192,570	2029/8/1	
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,250	213,514	2040/3/1	
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	1,860	1,699	290,187	2038/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	2,270	1,953	333,650	2046/9/1	
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,890	1,801	307,639	2035/3/1	
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	2,000	2,001	341,833	2028/4/1	
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	1,820	1,605	274,287	2048/3/1	
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	910	909	155,418	2026/1/15	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,360	2,366	404,172	2030/3/1	
BTPS 3.7% 06/15/30	3.7	1,030	1,040	177,626	2030/6/15	
BTPS 3.8% 04/15/26	3.8	1,440	1,448	247,450	2026/4/15	
BTPS 3.8% 08/01/28	3.8	1,760	1,787	305,275	2028/8/1	
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,470	1,375	234,912	2049/9/1	
BTPS 3.85% 09/15/26	3.85	860	868	148,293	2026/9/15	
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	2,860	2,914	497,813	2029/12/15	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,070	3,085	527,025	2037/2/1	
BTPS 4% 04/30/35	4.0	880	890	152,067	2035/4/30	
BTPS 4% 10/30/31	4.0	1,250	1,283	219,292	2031/10/30	
BTPS 4% 11/15/30	4.0	1,800	1,846	315,372	2030/11/15	
BTPS 4.1% 02/01/29	4.1	440	453	77,380	2029/2/1	
BTPS 4.15% 10/01/39	4.15	460	459	78,484	2039/10/1	
BTPS 4.2% 03/01/34	4.2	1,920	1,979	338,041	2034/3/1	
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	1,800	1,879	321,066	2033/11/1	
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	1,060	1,113	190,201	2033/5/1	
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	1,560	1,597	272,871	2043/9/1	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,116	361,407	2026/3/1	
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	1,510	1,547	264,329	2053/10/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	2,770	473,241	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,600	1,707	291,585	2044/9/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	3,170	3,478	594,099	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,260	2,474	422,643	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,680	2,933	501,089	2039/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	2,710	2,955	504,843	2029/11/1	
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,618	447,288	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	1,140	1,312	224,178	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,700	2,972	507,693	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,524	260,397	2026/11/1	
<b>(フランス)</b>						
<b>国債証券</b>						
FRTR 0% 02/25/26	—	4,020	3,805	649,985	2026/2/25	
FRTR 0% 02/25/27	—	4,000	3,685	629,444	2027/2/25	
FRTR 0% 05/25/32	—	3,780	2,995	511,549	2032/5/25	
FRTR 0% 11/25/29	—	4,820	4,120	703,720	2029/11/25	
FRTR 0% 11/25/30	—	5,810	4,822	823,710	2030/11/25	
FRTR 0% 11/25/31	—	4,890	3,936	672,393	2031/11/25	
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,290	4,004	683,906	2026/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	3,950	3,838	655,505	2025/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	4,500	4,274	730,121	2026/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,400	4,483	765,682	2029/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	2,690	1,761	300,881	2040/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	1,290	482	82,385	2072/5/25	
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	2,030	1,192	203,740	2044/6/25	
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	5,200	4,799	819,700	2028/2/25	
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	5,410	4,970	848,854	2028/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	2,940	1,541	263,256	2052/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	3,040	1,557	266,044	2053/5/25	
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	3,850	3,502	598,187	2028/11/25	
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,970	4,689	800,859	2027/5/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	4,670	4,518	771,678	2025/11/25	

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)		
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,460	3,771	644,180	2034/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,450	3,608	616,273	2036/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	2,740	2,470	363,059	2038/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,080	5,543	946,827	2031/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,050	2,048	349,948	2050/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,680	1,092	186,529	2066/5/25	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,250	2,672	456,353	2039/6/25	
FRTR 2% 05/25/48	2.0	2,860	2,026	376,226	2048/5/25	
FRTR 2% 11/25/32	2.0	2,900	2,687	459,021	2032/11/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	5,570	5,446	930,265	2030/5/25	
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	1,440	1,260	215,349	2043/5/25	
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	3,140	3,097	528,986	2026/9/24	
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	4,370	4,334	740,318	2029/2/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,730	4,693	801,595	2027/10/25	
FRTR 3% 05/25/33	3.0	4,210	4,202	717,830	2033/5/25	
FRTR 3% 05/25/54	3.0	2,380	2,164	369,665	2054/5/25	
FRTR 3% 06/25/49	3.0	770	716	122,363	2049/6/25	
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,860	2,799	478,157	2045/5/25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,730	4,759	812,893	2026/4/25	
FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	3,100	3,212	548,590	2033/11/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,540	2,784	475,491	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,780	1,971	336,640	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	2,140	2,321	396,489	2038/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,440	3,960	676,403	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,440	2,804	479,055	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,920	6,604	1,127,917	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,370	5,245	895,921	2032/10/25	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	1,968	336,228	2025/10/25	
<b>(オランダ)</b>						
<b>国債証券</b>						
NETHER 0% 01/15/26	—	1,190	1,131	193,321	2026/1/15	
NETHER 0% 01/15/27	—	1,730	1,602	273,705	2027/1/15	
NETHER 0% 01/15/29	—	1,610	1,416	241,902	2029/1/15	
NETHER 0% 01/15/38	—	1,170	786	131,319	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,740	809	138,308	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,350	1,142	195,051	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,370	1,128	192,666	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,910	1,846	315,382	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	950	836	142,931	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,470	1,025	175,169	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,750	1,660	283,588	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	1,150	960	164,032	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	900	843	144,077	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,610	1,482	253,199	2028/7/15	
NETHER 2% 01/15/54	2.0	1,120	924	157,816	2054/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	1,000	984	168,203	2030/1/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,550	1,515	258,764	2033/1/15	
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	1,320	1,285	219,540	2033/7/15	
NETHER 2.5% 07/15/34	2.5	500	483	82,659	2034/7/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,840	1,793	306,340	2047/1/15	
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	680	709	121,250	2044/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,700	1,883	321,651	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,660	1,843	314,872	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,530	1,667	284,756	2028/1/15	
<b>(スペイン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SPGB 0% 01/31/26	—	2,660	2,521	430,588	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	2,910	2,677	457,375	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	3,050	2,729	466,151	2028/1/31	
SPGB 0% 05/31/25	—	3,060	2,955	504,777	2025/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	2,200	1,794	306,531	2031/4/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,210	2,772	473,453	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	2,570	2,128	363,486	2031/10/31	

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 0.6% 10/31/29	0.6	1,970	1,732	295,827	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,825	311,819	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,272	388,152	2027/7/30	
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	2,750	2,456	419,572	2029/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,050	179,495	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	1,180	764	130,492	2042/7/30	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,000	1,079	184,323	2050/10/31	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,110	1,470	251,157	2040/10/31	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	2,980	2,665	455,171	2030/10/31	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,070	1,981	338,492	2026/10/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	2,450	2,302	393,187	2028/4/30	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	2,050	1,919	327,887	2028/7/30	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,497	426,593	2029/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	2,280	2,161	369,084	2027/10/31	
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	320	54,754	2071/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,500	1,433	244,771	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,450	1,425	243,441	2025/4/30	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,190	1,879	320,915	2035/7/30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	1,810	1,205	205,960	2052/10/31	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,300	2,245	383,546	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,020	1,895	323,743	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	1,570	1,545	263,933	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,190	2,034	347,462	2033/7/30	
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	2,530	2,408	411,355	2032/10/31	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,710	1,413	241,332	2048/10/31	
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	1,670	1,655	282,729	2026/5/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,850	1,607	274,592	2046/10/31	
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	1,990	1,974	337,178	2033/4/30	
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	2,150	2,134	364,513	2034/4/30	
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	1,190	1,137	194,354	2043/7/30	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,530	1,382	236,178	2066/7/30	
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	660	673	114,981	2029/5/31	
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	2,270	2,315	395,522	2033/10/31	
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	1,330	1,367	233,626	2039/7/30	
SPGB 4% 10/31/54	4.0	650	657	112,238	2054/10/31	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	1,800	1,931	329,836	2037/1/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	2,880	491,883	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,880	2,121	362,267	2041/7/30	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,730	1,985	339,080	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,710	4,029	688,170	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,420	1,699	290,172	2044/10/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,250	2,663	454,815	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,310	2,437	416,259	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	910	1,026	175,313	2029/1/31	
<b>(ベルギー)</b>						
<b>国債証券</b>						
BGB 0% 10/22/27	—	900	815	139,284	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	1,460	1,177	201,166	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,420	1,201	205,221	2030/6/22	
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	1,220	991	169,380	2032/6/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	660	420	71,859	2040/6/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	440	180	30,752	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,000	1,945	332,314	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,510	1,415	241,687	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,600	1,473	251,625	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,670	1,516	258,941	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	1,840	1,763	301,134	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,560	1,369	233,965	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,310	1,135	193,925	2033/4/22	
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	1,050	652	111,478	2053/6/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	652	111,408	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,080	764	130,647	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,100	767	131,101	2050/6/22	

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	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	650	549	93,901	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	880	644	110,109	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	670	508	86,866	2057/6/22	
BGB 2.7% 10/22/29	2.7	180	178	30,433	2029/10/22	
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	560	523	89,487	2039/4/22	
BGB 2.85% 10/22/34	2.85	680	664	113,445	2034/10/22	
BGB 3% 06/22/33	3.0	1,450	1,446	247,037	2033/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,050	1,043	178,258	2034/6/22	
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	1,020	974	166,489	2054/6/22	
BGB 3.45% 06/22/43	3.45	440	441	75,372	2043/6/22	
BGB 3.5% 06/22/55	3.5	530	523	89,427	2055/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	930	973	166,191	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,156	197,551	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,750	1,947	332,619	2041/3/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,166	199,297	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,810	2,117	361,690	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,040	2,228	380,540	2028/3/28	
<b>(オーストリア)</b>						
<b>国債証券</b>						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,480	1,253	214,154	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	1,670	1,372	234,432	2031/2/20	
RAGB 0% 10/20/28	—	880	775	132,436	2028/10/20	
RAGB 0% 10/20/40	—	580	344	58,908	2040/10/20	
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	720	508	86,770	2036/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,410	1,260	215,260	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,490	1,388	237,182	2027/4/20	
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	350	152	26,082	2071/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	880	813	138,899	2028/2/20	
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	442	75,500	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	1,480	1,403	239,682	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	230	101	17,404	2120/6/30	
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	1,230	1,054	180,122	2032/2/20	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,190	1,156	197,559	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,080	781	133,507	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	310	181	31,064	2086/11/2	
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	660	505	86,341	2049/5/23	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	650	476	81,314	2117/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	930	877	149,928	2034/5/23	
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	1,500	1,485	253,731	2033/2/20	
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	720	710	121,308	2034/2/20	
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	220	219	37,572	2029/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	700	690	117,963	2044/6/20	
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	440	430	73,578	2053/10/20	
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	230	236	40,402	2030/10/20	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	470	80,387	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,460	1,609	274,930	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,170	1,203	205,620	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,292	220,783	2027/7/15	
<b>(フィンランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
RFGB 0% 09/15/26	—	460	428	73,250	2026/9/15	
RFGB 0% 09/15/30	—	720	599	102,462	2030/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	440	310	52,961	2036/4/15	
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	207	35,510	2052/4/15	
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	630	514	87,889	2031/9/15	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	300	188	32,199	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	570	542	92,726	2026/4/15	
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	490	303	51,858	2043/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	540	498	85,162	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	730	658	112,549	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	530	467	79,873	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	510	441	75,375	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	440	426	72,909	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)		
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	640	536	91,622	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	350	334	57,092	2027/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	610	432	73,908	2047/4/15	
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	570	508	86,778	2032/9/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	470	431	73,771	2042/7/4	
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	400	379	64,841	2038/4/15	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	546	93,286	2028/7/4	
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	240	239	40,855	2029/4/15	
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	230	218	37,352	2055/4/15	
RFGB 3% 09/15/33	3.0	580	578	98,789	2033/9/15	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	640	644	110,050	2025/7/4	
<b>(アイルランド)</b>						
<b>国債証券</b>						
IRISH 0% 10/18/31	—	1,070	871	148,818	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	670	619	105,758	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	780	663	113,303	2030/10/18	
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	380	310	52,950	2032/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	690	525	89,824	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	360	239	40,883	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	770	715	122,175	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,000	961	164,219	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	980	902	154,214	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	430	377	64,455	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	470	428	73,180	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	665	96,602	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	740	633	108,270	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	980	811	138,614	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	930	908	155,172	2030/5/15	
IRISH 2.6% 10/18/34	2.6	200	193	33,084	2034/10/18	
IRISH 3% 10/18/43	3.0	370	363	62,042	2043/10/18	
ユーロ計				108,135,005		
<b>(イギリス)</b>						
<b>国債証券</b>						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,260	1,172	235,492	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	1,510	1,300	261,202	2028/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	2,710	2,063	414,364	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	2,980	2,706	543,398	2026/10/22	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	1,930	1,528	306,832	2030/10/22	
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	2,180	1,843	370,109	2029/1/31	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	2,150	622	124,970	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,400	1,341	269,440	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,250	1,517	304,729	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	1,450	568	114,152	2050/10/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,530	743	149,326	2046/1/31	
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	3,400	2,538	509,633	2033/7/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,410	1,191	239,167	2029/10/22	
UKT 1% 01/31/32	1.0	3,700	2,936	589,526	2032/1/31	
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	2,050	1,308	262,675	2039/1/31	
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	1,050	370	74,398	2073/10/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	1,250	1,138	228,679	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	2,420	1,151	231,233	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,030	1,222	245,405	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,504	302,049	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,700	938	188,362	2047/7/22	
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	1,140	566	113,680	2053/7/31	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,070	962	193,200	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,340	681	136,887	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,550	691	138,923	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,080	619	124,286	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	1,740	897	180,198	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	1,890	1,384	278,027	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,380	2,298	461,424	2025/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,420	876	176,019	2065/7/22	

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 3.25% 01/22/44	3.25	2,010	1,643	329,991	2044/1/22	
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	3,960	3,685	739,989	2033/1/31	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	1,820	1,534	308,077	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,470	1,172	235,491	2068/7/22	
UKT 3.5% 10/22/25	3.5	2,350	2,306	463,137	2025/10/22	
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	1,930	1,787	358,868	2038/1/29	
UKT 3.75% 03/07/27	3.75	650	636	127,875	2027/3/7	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,150	979	196,373	2052/7/22	
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	2,910	2,464	494,843	2053/10/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,250	1,108	222,631	2060/1/22	
UKT 4% 10/22/63	4.0	1,190	1,050	210,838	2063/10/22	
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	3,340	3,306	663,885	2027/1/29	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,890	1,868	375,190	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,320	1,330	267,079	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,270	1,228	246,575	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,800	1,797	360,950	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,450	1,392	279,610	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,770	1,659	333,119	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,610	1,499	301,019	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,700	1,574	316,102	2055/12/7	
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	430	405	81,474	2054/7/31	
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	2,690	2,707	543,689	2028/6/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,390	1,412	283,689	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,440	2,397	481,394	2042/12/7	
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	1,780	1,829	367,314	2034/1/31	
UKT 4.75% 10/22/43	4.75	1,030	1,039	208,623	2043/10/22	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,710	1,770	355,516	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,400	1,436	288,379	2038/12/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	2,010	2,159	433,644	2028/12/7	
小計				17,643,544		
<b>(スウェーデン)</b>						
<b>国債証券</b>						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	4,470	3,838	57,039	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	6,780	6,344	94,284	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	6,440	5,915	87,901	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	7,580	7,274	108,103	2026/11/12	
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	4,360	4,139	61,513	2033/11/11	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	5,510	5,463	81,194	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,560	7,507	111,559	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	3,970	4,476	66,523	2039/3/30	
小計				668,118		
<b>(ノルウェー)</b>						
<b>国債証券</b>						
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	4,780	4,045	60,554	2031/9/17	
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	5,200	4,544	68,034	2030/8/19	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,520	4,341	64,991	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,630	4,391	65,734	2027/2/17	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	4,100	3,728	55,823	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	4,650	4,367	65,385	2028/4/26	
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,730	3,329	49,837	2032/5/18	
NGB 3% 08/15/33	3.0	4,630	4,383	65,618	2033/8/15	
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	1,860	1,843	27,591	2042/10/6	
NGB 3.625% 04/13/34	3.625	2,470	2,457	36,789	2034/4/13	
小計				560,360		
<b>(デンマーク)</b>						
<b>国債証券</b>						
DGB 0% 11/15/31	—	6,540	5,449	124,734	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	5,570	2,903	66,472	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	4,430	4,118	94,269	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	5,570	5,003	114,525	2029/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	6,560	6,439	147,397	2025/11/15	

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)		
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	3,680	3,581	81,969	2033/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	9,470	11,541	264,191	2039/11/15	
小計				893,560		
<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% 10/25/25	—	940	875	35,150	2025/10/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,260	2,003	80,473	2026/10/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	3,900	2,989	120,081	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	3,560	2,669	107,210	2032/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,900	4,618	185,515	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	5,530	5,063	203,348	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	3,270	2,957	118,801	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,000	5,201	208,895	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,480	4,385	176,136	2025/7/25	
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	2,110	2,013	80,883	2027/5/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	4,320	4,329	173,903	2029/4/25	
POLGB 6% 10/25/33	6.0	4,350	4,407	177,031	2033/10/25	
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	3,610	3,853	154,759	2028/7/25	
小計				1,822,191		
<b>(オーストラリア)</b>		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル			
<b>国債証券</b>						
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,100	1,984	207,436	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,390	2,207	230,793	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	2,780	2,221	232,188	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	1,710	1,409	147,300	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,770	2,223	232,387	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	2,400	2,017	210,916	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,860	1,032	107,952	2051/6/21	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,000	1,650	172,570	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,480	1,388	145,118	2028/5/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	2,340	2,150	224,755	2030/5/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,330	1,049	109,702	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,470	1,270	132,846	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,530	1,470	153,759	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,578	165,001	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,780	1,670	174,653	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,350	1,038	108,601	2047/3/21	
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,840	1,662	173,786	2033/11/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,810	1,751	183,103	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	940	816	85,312	2039/6/21	
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	1,690	1,578	165,031	2034/12/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,220	1,146	119,828	2037/4/21	
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	1,980	1,898	198,468	2034/5/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,770	1,777	185,781	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	3,010	3,071	321,045	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,010	2,053	214,643	2027/4/21	
ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	720	734	76,822	2054/6/21	
小計				4,479,809		
<b>(ニュージーランド)</b>		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル			
<b>国債証券</b>						
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	990	832	80,407	2028/5/15	
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	730	670	64,716	2026/5/15	
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	1,000	812	78,400	2031/5/15	
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	460	287	27,793	2041/5/15	
NZGB 2% 05/15/32	2.0	700	573	55,389	2032/5/15	
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	630	498	48,144	2037/4/15	
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	600	396	38,320	2051/5/15	
NZGB 3% 04/20/29	3.0	830	770	74,432	2029/4/20	
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	1,320	1,198	115,729	2033/4/14	
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	450	429	41,509	2034/5/15	
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	840	834	80,539	2027/4/15	
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	490	486	46,933	2030/5/15	

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)		
NZGB 4.5% 05/15/35	4.5	440	426	41,179	2035/5/15	
NZGB 5% 05/15/54	5.0	380	373	36,105	2054/5/15	
小計				829,602		
<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	790	757	88,345	2025/11/1	
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	870	826	96,439	2026/11/1	
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	560	510	58,469	2031/7/1	
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	730	559	65,233	2050/3/1	
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	420	319	37,225	2051/10/1	
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	830	808	94,358	2026/6/1	
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	760	684	79,795	2036/8/1	
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	900	889	103,765	2025/6/1	
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	380	340	39,683	2039/7/1	
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	720	702	81,979	2028/5/1	
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	460	438	51,141	2032/8/1	
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	820	756	88,310	2046/3/1	
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	587	68,571	2042/4/1	
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	637	74,388	2029/7/1	
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	420	414	48,335	2027/9/1	
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	710	693	80,882	2030/9/1	
SIGB 3% 04/01/29	3.0	150	148	17,284	2029/4/1	
SIGB 3% 08/01/72	3.0	490	464	54,219	2072/8/1	
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	836	97,554	2033/9/1	
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	740	742	86,630	2027/3/1	
小計				1,412,615		
<b>(マレーシア)</b>		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
<b>国債証券</b>						
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,650	1,529	51,261	2031/4/15	
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,506	50,487	2027/5/31	
MGS 3.519% 04/20/28	3.519	710	706	23,687	2028/4/20	
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	1,310	1,283	43,010	2032/7/15	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,930	2,937	98,416	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	2,360	2,272	76,147	2040/5/22	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,770	1,761	59,032	2034/7/5	
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,880	1,873	62,971	2033/4/15	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	2,160	2,180	73,047	2029/8/15	
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,139	38,185	2027/3/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,988	66,630	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,470	2,492	83,496	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	604	20,267	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,690	1,702	57,027	2025/9/15	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	3,070	2,993	100,286	2050/6/15	
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,490	2,549	85,426	2031/6/30	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	1,750	1,798	60,262	2035/5/31	
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,520	2,562	85,870	2026/4/15	
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	1,090	1,131	37,923	2053/3/31	
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	3,070	3,184	106,692	2030/4/15	
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	350	362	12,157	2029/4/30	
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	870	920	30,830	2033/11/7	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	1,970	2,118	70,994	2042/10/15	
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	980	1,058	35,457	2046/3/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,780	2,988	100,138	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	1,840	2,010	67,365	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,680	1,860	62,324	2048/7/6	
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,030	1,138	38,131	2043/9/30	
小計				1,697,340		
<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 2% 06/15/25	2.0	43,900	44,020	953,505	2025/6/15	
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	28,600	28,760	622,963	2026/8/15	
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	17,100	17,190	372,345	2025/8/25	

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
CGB 2.22% 09/25/25	2.22	27,270	27,439	594,340	2025/9/25
CGB 2.28% 11/25/25	2.28	30,220	30,445	659,464	2025/11/25
CGB 2.3% 05/15/26	2.3	47,100	47,501	1,028,897	2026/5/15
CGB 2.33% 12/15/25	2.33	35,250	35,551	770,050	2025/12/15
CGB 2.37% 01/15/29	2.37	19,460	19,695	426,614	2029/1/15
CGB 2.37% 01/20/27	2.37	43,880	44,350	960,646	2027/1/20
CGB 2.39% 11/15/26	2.39	42,750	43,212	936,000	2026/11/15
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	42,610	43,079	933,119	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	17,700	17,919	388,152	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	29,300	29,607	641,318	2026/2/15
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	20,000	20,295	439,616	2027/4/15
CGB 2.48% 09/25/28	2.48	26,500	26,897	582,602	2028/9/25
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	26,760	27,144	587,954	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	58,370	59,265	1,283,722	2033/8/25
CGB 2.54% 12/25/30	2.54	30,500	31,034	672,224	2030/12/25
CGB 2.55% 10/15/28	2.55	27,250	27,763	601,371	2028/10/15
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	32,050	32,693	708,155	2032/9/1
CGB 2.6% 09/15/30	2.6	30,500	31,122	674,134	2030/9/15
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	23,550	24,005	519,965	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	36,400	37,203	805,851	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	20,940	21,414	463,853	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	38,220	38,962	843,946	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	34,280	35,225	762,999	2033/5/25
CGB 2.67% 11/25/33	2.67	13,600	13,991	303,056	2033/11/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	33,530	34,376	744,609	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	32,900	33,463	724,834	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	19,420	19,940	431,927	2032/8/15
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	14,500	14,964	324,146	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	25,490	26,242	568,424	2029/6/15
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	10,700	11,038	239,102	2032/5/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	30,300	31,271	677,360	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	23,080	23,800	515,526	2029/3/24
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	42,000	43,344	938,864	2030/3/25
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	4,600	4,765	103,230	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	31,030	31,843	689,732	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	11,300	11,791	255,417	2033/2/25
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	24,210	25,230	546,503	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	29,200	30,219	654,576	2028/10/14
CGB 3% 10/15/53	3.0	9,330	10,173	220,358	2053/10/15
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	12,590	13,057	282,824	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	21,690	22,799	493,839	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	53,270	54,246	1,175,007	2025/10/22
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	18,800	19,222	416,368	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	8,970	9,871	213,820	2052/10/25
CGB 3.19% 04/15/53	3.19	18,160	20,430	442,536	2053/4/15
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	6,850	7,318	158,522	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	14,110	14,776	320,064	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	13,750	15,664	339,294	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	20,930	23,942	518,600	2050/3/16
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	8,350	9,840	213,145	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	13,540	16,414	355,536	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	19,620	24,060	521,164	2050/9/14
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	17,280	21,238	460,035	2049/7/22
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	15,720	19,919	431,468	2048/10/22
小 計				32,513,721	
(イスラエル) 国債証券		千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル		
ILGOV 0.5% 02/27/26	0.5	1,510	1,412	60,347	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,340	99,987	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	3,530	2,869	122,585	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	2,510	1,933	82,605	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	2,630	1,733	74,041	2037/5/31

銘柄	利率 (%)	額面金額	期 末		
			評 価 額	外貨建金額	償還年月日
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	3,450	3,342	142,780	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	2,030	1,896	81,004	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,700	2,452	104,764	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	1,420	882	37,712	2052/11/29
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	2,040	1,960	83,763	2029/2/28
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	2,570	2,027	86,608	2047/3/31
ILGOV 4% 03/30/35	4.0	760	697	29,796	2035/3/30
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	1,880	1,929	82,407	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	1,340	1,393	59,544	2026/10/30
小 計				1,147,950	
合 計				341,709,856	

(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 EURO-SCHATZ	233	—
US 5YR NOTE	581	—
EURO-BOBL FU	357	—
EURO-BUND	732	—
国 US 10YR NOTE	393	—
US LONG BOND	437	—

(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 341,709,856	% 98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,549,470	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	348,259,326	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(345,942,267千円)の投資信託財産総額(348,259,326千円)に対する比率は99.3%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=157.40円	1カナダドル=115.26円	1メキシコペソ=9.3738円
1ユーロ=170.79円	1イギリスポンド=200.78円	1スウェーデンクローナ=14.86円
1ノルウェークローネ=14.97円	1デンマーククローネ=22.89円	1ポーランドズロチ=40.1636円
1オーストラリアドル=104.53円	1ニュージーランドドル=96.55円	1シンガポールドル=116.66円
1マレーシアリンギット=33.5047円	1オフショア人民元=21.6604円	1イスラエルシケル=42.718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 2024年5月29日現在
(A)資 産	351,498,601,487円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,660,217,418
公 社 債(評価額)	341,709,856,193
未 収 入 金	3,263,204,057
未 収 利 息	2,424,799,648
前 払 費 用	230,496,609
差 入 委 託 証 拠 金	210,027,562
(B)負 債	3,321,508,325
未 払 金	3,248,793,989
未 払 解 約 金	72,714,336
(C)純 資 産 総 額(A-B)	348,177,093,162
元 本	95,353,277,023
次 期 繰 越 損 益 金	252,823,816,139
(D)受 益 権 総 口 数	95,353,277,023口
1万口当たり基準価額(C/D)	36,514円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A)配 当 等 収 益	7,947,505,082円
受 取 利 息	7,940,856,817
そ の 他 収 益 金	7,417,313
支 払 利 息	△769,048
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	35,138,557,401
売 買 益	40,604,453,431
売 買 損	△5,465,896,030
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△61,588,552
取 引 益	154,376,069
取 引 損	△215,964,621
(D)そ の 他 費 用	△99,911,907
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	42,924,562,024
(F)前 期 繰 越 損 益 金	184,374,116,405
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	40,923,721,636
(H)解 約 差 損 益 金	△15,398,583,926
(I)計 (E+F+G+H)	252,823,816,139
次 期 繰 越 損 益 金(I)	252,823,816,139

(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84,730,057,526円、期中追加設定元本額は17,092,076,647円、期中一部解約元本額は6,468,857,150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。

世界経済インデックスファンド	22,541,012,138円
DC世界経済インデックスファンド	14,536,796,234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)	13,022,433,668円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,753,793,834円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,496,265,072円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,365,641,307円
DC外国債券インデックス・オープン	2,223,840,466円
DCマイセレクション25	1,862,937,665円
DCマイセレクション50	1,810,010,441円
分散投資コア戦略ファンドS	1,606,006,912円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,500,288,290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)	1,483,293,615円
DCマイセレクション75	1,453,138,215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)	1,230,031,587円
グローバル経済コア	1,141,655,780円
DCマイセレクションS25	1,127,386,111円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,091,440,911円
DCマイセレクションS50	999,896,473円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	953,359,726円
分散投資コア戦略ファンドA	845,594,890円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	781,681,031円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	780,431,853円
外国債券ファンド・シリーズ1	763,941,046円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	758,264,536円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	713,734,962円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	631,478,687円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	629,965,197円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	617,206,666円
DCマイセレクションS75	582,796,607円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	489,015,401円
SMT 世界経済インデックス・オープン	428,498,249円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	356,741,086円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	330,367,435円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	309,732,561円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	269,315,338円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,720,149円
SMT インデックスバランス・オープン	178,327,693円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	163,828,094円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	142,122,851円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	128,647,735円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	125,953,518円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	103,346,180円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	101,173,528円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	90,970,944円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	65,742,230円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	61,897,125円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	56,337,815円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	52,436,368円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	50,767,118円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	50,453,080円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	46,572,182円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	45,240,512円

10資産分散投資ファンド	35,744,317円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	26,173,354円
グローバル10資産バランスファンド	25,281,452円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	23,039,454円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	22,855,843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)	13,644,183円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	11,211,126円
SBI資産設計オープン(分配型)	9,302,961円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,394,096円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,888,696円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,041,844円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	997,055円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	22,496円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	22,344円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	22,342円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	22,232円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	21,744円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	21,683円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	16,457円

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 新興国債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日 2023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12月11日から無期限です。
運用方針	新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	新興国の債券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		債組比	券入率	債先比	債券物率	純資産額
	円	%	騰落率	騰落率					
第11期(2019年11月11日)	17,520	7.5	33,355.04	8.7	96.7	—	—	百万円	
第12期(2020年11月10日)	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—	—	53,734	
第13期(2021年11月10日)	17,665	4.3	34,005.46	4.3	97.1	—	—	61,667	
第14期(2022年11月10日)	18,499	4.7	35,702.58	5.0	97.0	—	—	79,131	
第15期(2023年11月10日)	21,759	17.6	42,040.77	17.8	97.2	—	—	88,174	
								122,661	

(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	騰落率		
(当期首) 2022年11月10日	18,499	—	35,702.58	—	97.0	—
11月末	18,309	△1.0	35,263.57	△1.2	96.0	—
12月末	17,853	△3.5	34,477.89	△3.4	95.8	—
2023年 1月末	18,392	△0.6	35,423.91	△0.8	96.3	—
2月末	18,620	0.7	35,809.02	0.3	96.5	—
3月末	18,927	2.3	36,370.52	1.9	96.1	—
4月末	19,217	3.9	36,860.17	3.2	96.1	—
5月末	19,770	6.9	38,041.49	6.6	95.6	—
6月末	21,059	13.8	40,502.34	13.4	95.0	—
7月末	21,129	14.2	40,572.98	13.6	95.9	—
8月末	21,424	15.8	41,220.47	15.5	96.0	—
9月末	20,933	13.2	40,162.18	12.5	96.4	—
10月末	20,961	13.3	40,317.53	12.9	96.1	—
(当期末) 2023年11月10日	21,759	17.6	42,040.77	17.8	97.2	—

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）です。

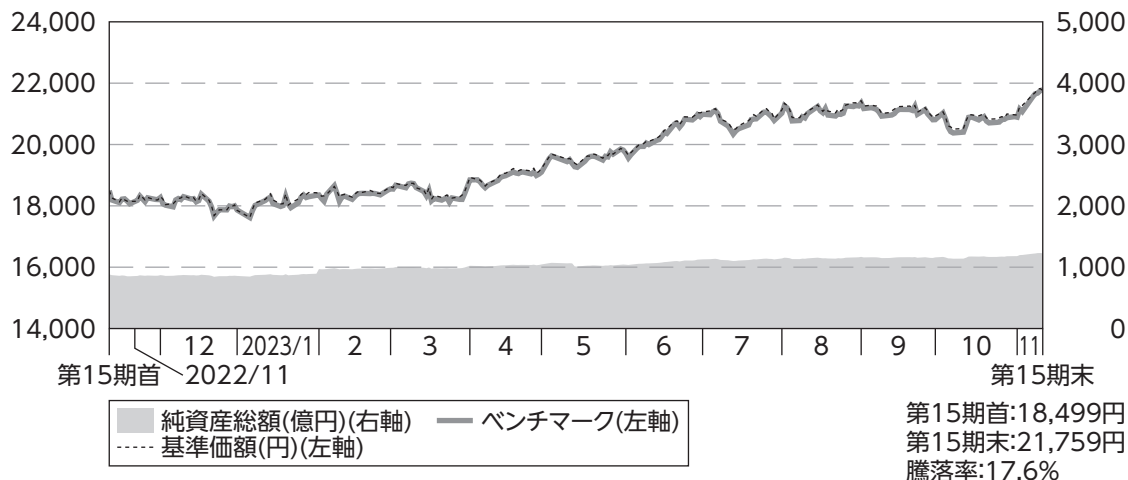
【JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド】とは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。

【同指数】に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

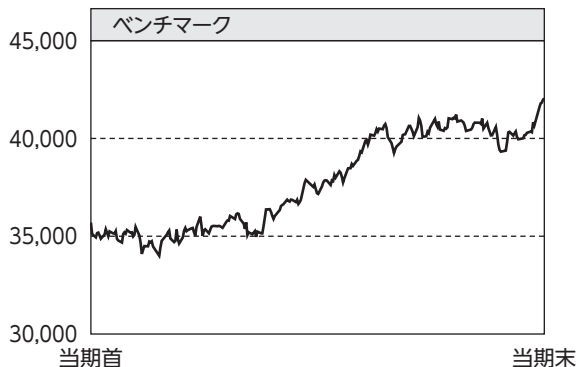


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(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った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

## 投資環境



新興国為替市場では、2022年12月の日銀による長期金利の変動許容幅引き上げが事実上の金融引き締めと受け止められ、対新興国通貨で円買いが進行し、2023年の年明けにかけて新興国通貨は対円で上値の重い展開となりましたが、その後は日本との金利差が意識され、新興国通貨は対円で概ね上昇推移となりました。

新興国債券市場では、インフレ期待の低下を受けてFRB(米連邦準備理事会)による利上げペース減速の可能性が意識されたことや、2023年3月に米国地方銀行の経営破綻などに端を発した信用不安の広がりを受けて、リスク回避の機運が高まったことなどから、新興国金利は期初から低下基調(債券価格は上昇)が続きました。7月以降は、米国の堅調な経済指標やインフレ圧力が継続する中、FRBとECB(欧州中央銀行)高官らの発言を背景に利上げ長期化観測が高まったことなどをを受けて主要国の長期金利は上昇し、新興国金利も上昇しました。期末にかけては、欧米の軟調な経済指標などをを受けて主要国の長期金利が低下し、その影響を受けて新興国金利も低下しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(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) 債券組入比率

期を通じて高位を維持しました。

## (2) ポートフォリオ構成

ベンチマークの投資国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

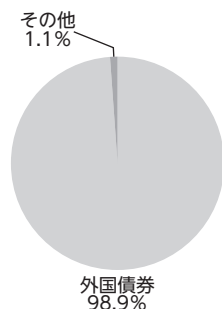
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	2.0%
2	BLTN 0% 01/01/26	ブラジル	1.5%
3	BLTN 0% 07/01/26	ブラジル	1.5%
4	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.5%
5	BNTNF 10% 01/01/25	ブラジル	1.4%
6	BNTNF 10% 01/01/27	ブラジル	1.3%

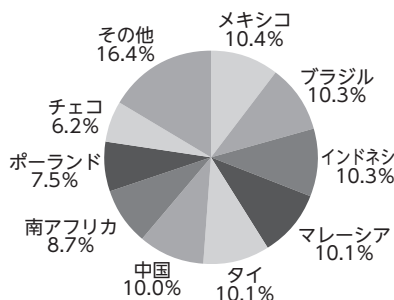
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	BNTNF 10% 01/01/29	ブラジル	1.2%
8	SAGB 8% 01/31/30	南アフリカ	1.2%
9	MBONO 7.75% 05/29/31	メキシコ	1.1%
10	MBONO 5.75% 03/05/26	メキシコ	1.1%
組入銘柄数		272	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

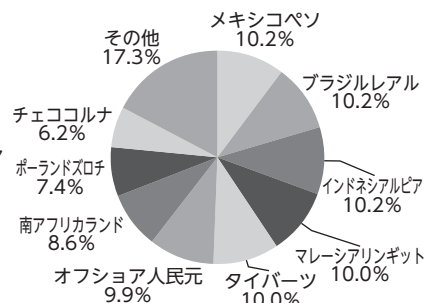
### ○資産別配分



### ○国別配分



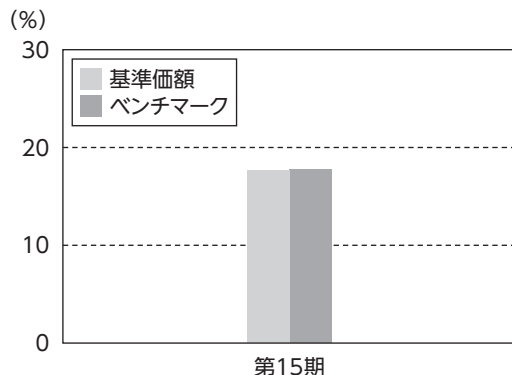
### ○通貨別配分



(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。

ベンチマークとの乖離の主なマイナス要因は、為替評価差要因\*等です。

\*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

主として、新興国の現地通貨建て債券に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月1日~2023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)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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)	23  (23)  (-) (0)	0.115  (0.115)  (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	23	0.115	

(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(19,716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 国	メ キ シ コ 国 債 証 券	千メキシコペソ 429,052	千メキシコペソ 159,844
	ブ ラ ジ ル 国 債 証 券	千ブラジルリアル 282,145	千ブラジルリアル 223,245
	チ リ 国 債 証 券	千チリペソ 3,541,818	千チリペソ 1,416,158
	コ ロ ン ビ ア 国 債 証 券	千コロンビアペソ 40,140,465	千コロンビアペソ 21,479,142
	ペ ル ー 国 債 証 券	千ペルー・ソル 22,870	千ペルー・ソル 14,146
	ウ ル グ ア イ 国 債 証 券	千ウルグアイペソ 26,197	千ウルグアイペソ -
	ド ミ ニ カ 共 和 国 国 債 証 券	千ドミニカペソ 79,018	千ドミニカペソ 32,764 (8,160)
	チ ェ コ 国 債 証 券	千チェココルナ 418,582	千チェココルナ 148,306
	ハ ン ガ リ ー 国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 1,913,423	千ハンガリーフォリント 1,349,531
	ポ ー ラ ン ド 国 債 証 券	千ポーランドズロチ 67,537	千ポーランドズロチ 44,331
	ル ー マ ニ ア 国 債 証 券	千ルーマニア・レイ 64,735	千ルーマニア・レイ 35,039
	マ レ ー シ ア 国 債 証 券	千マレーシアリンギット 179,505	千マレーシアリンギット 86,846
	タ イ 国 債 証 券	千タイバーツ 1,087,866	千タイバーツ 483,861
	国	イ ン ド ネ シ ア 国 債 証 券	千インドネシアルピア 481,368,380
中 国 オ フ シ ョ ア 国 債 証 券		千オフショア人民元 242,042	千オフショア人民元 93,832
南 ア フ リ カ 国 債 証 券		千南アフリカランド 360,747	千南アフリカランド 154,044

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

利害関係人<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	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 7	百万円 7	100.0	百万円 7	百万円 7	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	272,149	29,712	10.9	271,759	29,743	10.9

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

## ＜外国(外貨建)公社債＞

## (A) 債券種類別開示

区 分	額 面 金 額	当 期		組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	未		
		評 価 額				残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メ キ シ コ	千メキシコペソ 1,578,350	千メキシコペソ 1,432,475	千円 12,205,407	% 10.0	% —	% 5.2	% 2.9	% 1.8
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 455,600	千ブラジルレアル 400,529	12,270,350	10.0	10.0	2.2	4.6	3.2
チ リ	千チリペソ 14,480,000	千チリペソ 13,782,340	2,286,173	1.9	—	1.1	0.4	0.4
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 176,310,000	千コロンビアペソ 146,078,820	5,501,328	4.5	—	2.0	2.5	—
ペ ル ー	千ペルー・ソル 73,150	千ペルー・ソル 70,657	2,811,449	2.3	—	1.9	0.3	0.1
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 67,000	千ウルグアイペソ 64,160	243,635	0.2	—	0.1	0.1	—
ドミニカ共和国	千ドミニカペソ 64,000	千ドミニカペソ 68,233	181,816	0.1	0.1	0.1	—	—
チ ェ コ	千チェココルナ 1,242,100	千チェココルナ 1,130,230	7,437,141	6.1	—	3.8	1.4	0.8
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 10,716,500	千ハンガリーフォリント 9,029,623	3,847,224	3.1	—	1.1	1.4	0.6
ポーランド	千ポーランドズロチ 272,600	千ポーランドズロチ 248,649	9,050,183	7.4	—	2.0	3.5	1.9
ルーマニア	千ルーマニア・レイ 148,500	千ルーマニア・レイ 140,738	4,576,626	3.7	—	1.7	1.2	0.8
マレーシア	千マレーシアリンギット 378,950	千マレーシアリンギット 379,643	12,160,927	9.9	—	5.4	2.7	1.8
タイ	千タイバーツ 2,908,800	千タイバーツ 2,859,710	12,096,574	9.9	—	5.6	2.6	1.7
フィリピン	千フィリピンペソ 30,000	千フィリピンペソ 28,451	77,112	0.1	—	0.1	—	—
インドネシア	千インドネシアルピア 1,237,800,000	千インドネシアルピア 1,263,592,572	12,256,847	10.0	—	7.1	2.4	0.5
中国オフショア	千オフショア人民元 567,100	千オフショア人民元 577,993	11,989,777	9.8	—	4.8	4.0	1.0
南アフリカ	千南アフリカランド 1,555,700	千南アフリカランド 1,261,921	10,246,806	8.4	8.4	6.9	1.4	—
合 計	—	—	119,239,383	97.2	18.5	51.2	31.5	14.6

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

(注2) 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 (%)	当 期		末 期		償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債建金額	
			外債建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(メキシコ)</b>						
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
MBOXO 10% 11/20/36	10.0	38,800	39,790	339,035		2036/11/20
MBOXO 10% 12/05/24	10.0	86,250	85,291	726,729		2024/12/5
MBOXO 5% 03/06/25	5.0	57,500	53,608	456,770		2025/3/6
MBOXO 5.5% 03/04/27	5.5	109,000	95,579	814,388		2027/3/4
MBOXO 5.75% 03/05/26	5.75	175,300	159,078	1,355,432		2026/3/5
MBOXO 7% 09/03/26	7.0	33,000	30,489	259,787		2026/9/3
MBOXO 7.5% 05/26/33	7.5	77,000	66,576	567,265		2033/5/26
MBOXO 7.5% 06/03/27	7.5	139,000	128,969	1,098,886		2027/6/3
MBOXO 7.75% 05/29/31	7.75	176,100	158,007	1,346,302		2031/5/29
MBOXO 7.75% 11/13/42	7.75	123,500	102,433	872,783		2042/11/13
MBOXO 7.75% 11/23/34	7.75	28,100	24,497	208,731		2034/11/23
MBOXO 8% 07/31/53	8.0	72,500	60,499	515,482		2053/7/31
MBOXO 8% 09/05/24	8.0	128,400	125,264	1,067,317		2024/9/5
MBOXO 8% 11/07/47	8.0	96,000	80,761	688,131		2047/11/7
MBOXO 8.5% 05/31/29	8.5	139,600	132,819	1,131,689		2029/5/31
MBOXO 8.5% 11/18/38	8.5	98,300	88,806	756,673		2038/11/18
小 計				12,205,407		
<b>(ブラジル)</b>						
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル			
BLTN 0% 01/01/26	—	76,500	61,504	1,884,202		2026/1/1
BLTN 0% 07/01/24	—	37,250	34,808	1,066,375		2024/7/1
BLTN 0% 07/01/25	—	45,300	38,386	1,175,980		2025/7/1
BLTN 0% 07/01/26	—	78,000	59,548	1,824,285		2026/7/1
BLTN 0% 07/01/27	—	18,000	12,370	378,965		2027/7/1
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	55,300	54,700	1,675,758		2025/1/1
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	50,400	49,434	1,514,434		2027/1/1
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	49,700	47,618	1,458,800		2029/1/1
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	19,850	18,663	571,757		2031/1/1
BNTNF 10% 01/01/33	10.0	23,900	22,117	677,580		2033/1/1
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,377	42,208		2028/1/10
小 計				12,270,350		
<b>(チリ)</b>						
国債証券		千チリペソ	千チリペソ			
BTPCL 2.3% 10/01/28	2.3	625,000	527,205	87,451		2028/10/1
BTPCL 2.5% 03/01/25	2.5	2,985,000	2,821,289	467,986		2025/3/1
BTPCL 4.5% 03/01/26	4.5	1,960,000	1,882,814	312,315		2026/3/1
BTPCL 4.7% 09/01/30	4.7	2,090,000	1,927,473	319,723		2030/9/1
BTPCL 5% 03/01/35	5.0	2,210,000	2,018,783	334,869		2035/3/1
BTPCL 5% 10/1/28	5.0	820,000	780,189	129,415		2028/10/1
BTPCL 6% 01/01/43	6.0	1,800,000	1,806,572	299,668		2043/1/1
BTPCL 6% 04/01/33	6.0	1,500,000	1,493,259	247,697		2033/4/1
BTPCL 7% 05/01/34	7.0	490,000	524,752	87,044		2034/5/1
小 計				2,286,173		
<b>(コロンビア)</b>						
国債証券		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	65,300,000	62,229,787	2,343,573		2027/6/28
COLTES 6.25% 11/26/25	6.25	20,800,000	19,396,620	730,476		2025/11/26
COLTES 7.25% 10/18/34	7.25	45,100,000	34,520,518	1,300,042		2034/10/18
COLTES 7.25% 10/26/50	7.25	45,110,000	29,931,893	1,127,235		2050/10/26
小 計				5,501,328		
<b>(ペルー)</b>						
国債証券		千ペルー・ソル	千ペルー・ソル			
PERUGB 5.35% 08/12/40	5.35	4,950	4,043	160,896		2040/8/12
PERUGB 5.4% 08/12/34	5.4	7,250	6,313	251,215		2034/8/12
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	3,700	3,686	146,697		2024/8/12

銘柄	利率 (%)	当 期		末 期		償還年月日
		額面金額	評 価 額		外債建金額	
			外債建金額	邦貨換算金額 (千円)		
<b>(ウルグアイ)</b>						
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
PERUGB 5.94% 02/12/29	5.94	8,800	8,620	343,023		2029/2/12
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	8,300	7,848	312,282		2032/8/12
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	6,650	6,674	265,587		2028/8/12
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	11,050	10,710	426,170		2037/8/12
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	10,500	10,542	419,463		2031/8/12
PERUGB 7.3% 08/12/33	7.3	9,400	9,547	379,871		2033/8/12
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	2,550	2,670	106,241		2026/8/12
小 計				2,811,449		
<b>(ドミニカ共和国)</b>						
国債証券		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ			
URUGIA 8.25% 05/21/31	8.25	25,000	23,175	88,004		2031/5/21
URUGIA 8.5% 03/15/28	8.5	17,000	16,221	61,599		2028/3/15
URUGIA 9.75% 07/20/33	9.75	25,000	24,762	94,030		2033/7/20
小 計				243,635		
<b>(チェコ)</b>						
国債証券		千チェココロンナ	千チェココロンナ			
CZGB 0% 12/12/24	—	24,000	22,772	149,844		2024/12/12
CZGB 0.05% 11/29/29	0.05	26,100	20,204	132,947		2029/11/29
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	55,200	48,420	318,618		2027/2/10
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	98,900	79,874	525,590		2030/5/15
CZGB 1% 06/26/26	1.0	68,800	62,883	413,784		2026/6/26
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	98,000	78,494	516,509		2031/3/13
CZGB 1.25% 02/14/25	1.25	58,500	55,724	366,676		2025/2/14
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	34,700	22,542	148,331		2040/4/24
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	51,500	41,735	274,630		2032/6/23
CZGB 1.95% 07/30/37	1.95	29,000	21,500	141,478		2037/7/30
CZGB 2% 10/13/33	2.0	74,500	59,944	394,444		2033/10/13
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	75,700	72,576	477,566		2025/9/17
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	98,700	90,908	598,194		2028/8/25
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	80,500	73,969	486,732		2029/7/23
CZGB 3.5% 05/30/35	3.5	22,000	20,039	131,865		2035/5/30
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	34,500	33,363	219,541		2036/12/4
CZGB 4.5% 11/11/32	4.5	25,000	25,075	164,998		2032/11/11
CZGB 4.9% 04/14/34	4.9	47,500	49,072	322,907		2034/4/14
CZGB 5% 09/30/30	5.0	80,000	82,814	544,932		2030/9/30
CZGB 5.5% 12/12/28	5.5	69,000	72,881	479,571		2028/12/12
CZGB 6% 02/26/26	6.0	63,000	65,293	429,642		2026/2/26
CZGB 6.2% 06/16/31	6.2	27,000	30,140	198,331		2031/6/16
小 計				7,437,141		
<b>(ハンガリー)</b>						
国債証券		千ハンガリーフォロント	千ハンガリーフォロント			
HGB 1% 11/26/25	1.0	835,000	735,175	313,234		2025/11/26
HGB 1.5% 04/22/26	1.5	610,500	532,417	226,845		2026/4/22
HGB 1.5% 08/26/26	1.5	514,000	438,416	186,794		2026/8/26
HGB 2% 05/23/29	2.0	403,000	315,750	134,530		2029/5/23
HGB 2.25% 04/20/33	2.25	712,000	490,710	209,075		2033/4/20
HGB 2.25% 06/22/34	2.25	221,000	146,081	62,240		2034/6/22
HGB 2.5% 10/24/24	2.5	578,000	547,129	233,113		2024/10/24
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	485,500	422,978	180,217		2026/12/22
HGB 3% 04/25/41	3.0	371,000	218,574	93,127		2041/4/25

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)		
HGB 3% 06/26/24	3.0	307,500	296,614	126,377	2024/6/26	
HGB 3% 08/21/30	3.0	715,000	570,455	243,052	2030/8/21	
HGB 3% 10/27/27	3.0	822,000	707,025	301,240	2027/10/27	
HGB 3% 10/27/38	3.0	530,000	330,155	140,668	2038/10/27	
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	812,000	636,806	271,322	2031/10/22	
HGB 4.5% 03/23/28	4.5	263,000	237,130	101,033	2028/3/23	
HGB 4.75% 11/24/32	4.75	640,000	540,124	230,129	2032/11/24	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	900,000	869,778	370,583	2025/6/24	
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	767,000	754,352	321,404	2028/10/22	
HGB 9.5% 10/21/26	9.5	230,000	239,946	102,233	2026/10/21	
小計				3,847,224		
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
国債証券						
POLGB 0% 10/25/25	—	11,500	10,462	380,802	2025/10/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	18,500	16,031	583,498	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	14,300	13,417	488,367	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	19,800	15,241	554,763	2030/10/25	
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	22,700	17,030	619,857	2032/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	18,950	18,438	671,116	2024/10/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	21,300	19,854	722,660	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	23,700	21,513	783,047	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	21,000	18,924	688,797	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	26,100	22,804	830,010	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	23,050	22,299	811,624	2025/7/25	
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	21,100	20,071	730,535	2027/5/25	
POLGB 6% 10/25/33	6.0	12,200	12,592	458,327	2033/10/25	
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	18,400	19,967	726,772	2028/7/25	
小計				9,050,183		
(ルーマニア)		千ルーマニア・レイ	千ルーマニア・レイ			
国債証券						
ROMGB 2.5% 10/25/27	2.5	7,500	6,496	211,253	2027/10/25	
ROMGB 3.25% 06/24/26	3.25	6,500	6,070	197,407	2026/6/24	
ROMGB 3.5% 11/25/25	3.5	5,800	5,534	179,973	2025/11/25	
ROMGB 3.65% 07/28/25	3.65	10,400	10,039	326,487	2025/7/28	
ROMGB 3.65% 09/24/31	3.65	8,800	7,186	233,704	2031/9/24	
ROMGB 3.7% 11/25/24	3.7	10,000	9,790	318,385	2024/11/25	
ROMGB 4.15% 01/26/28	4.15	9,000	8,253	268,393	2028/1/26	
ROMGB 4.15% 10/24/30	4.15	7,400	6,400	208,137	2030/10/24	
ROMGB 4.25% 04/28/36	4.25	6,600	5,162	167,868	2036/4/28	
ROMGB 4.5% 06/17/24	4.5	2,200	2,179	70,881	2024/6/17	
ROMGB 4.75% 02/24/25	4.75	8,600	8,460	275,120	2025/2/24	
ROMGB 4.75% 10/11/34	4.75	7,200	6,043	196,525	2034/10/11	
ROMGB 4.85% 04/22/26	4.85	4,700	4,560	148,304	2026/4/22	
ROMGB 4.85% 07/25/29	4.85	7,800	7,157	232,765	2029/7/25	
ROMGB 5% 02/12/29	5.0	6,000	5,568	181,086	2029/2/12	
ROMGB 5.8% 07/26/27	5.8	6,500	6,358	206,757	2027/7/26	
ROMGB 6.7% 02/25/32	6.7	6,800	6,785	220,667	2032/2/25	
ROMGB 7.35% 04/28/31	7.35	4,800	4,955	161,136	2031/4/28	
ROMGB 7.9% 02/24/38	7.9	5,400	5,855	190,425	2038/2/24	
ROMGB 8% 04/29/30	8.0	3,500	3,716	120,848	2030/4/29	
ROMGB 8.25% 09/29/32	8.25	5,500	6,019	195,732	2032/9/29	
ROMGB 8.75% 10/30/28	8.75	7,500	8,141	264,762	2028/10/30	
小計				4,576,626		
(マレーシア)		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット			
国債証券						
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	16,200	14,862	476,093	2031/4/15	
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	8,650	8,668	277,678	2024/6/14	

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)		
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	17,650	17,564	562,624	2027/5/31	
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	21,500	20,923	670,233	2032/7/15	
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	36,400	36,260	1,161,513	2028/6/15	
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	27,350	25,756	825,059	2040/5/22	
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	8,200	8,047	257,793	2034/7/5	
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	15,200	15,308	490,358	2025/3/14	
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	41,300	41,395	1,325,997	2029/8/15	
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	15,500	15,623	500,456	2027/11/16	
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	10,450	10,534	337,446	2026/11/30	
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	24,600	24,855	796,182	2026/7/15	
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	28,700	28,967	927,889	2025/9/15	
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	5,450	5,479	175,537	2024/9/30	
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	18,250	17,394	557,179	2050/6/15	
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	9,100	9,147	293,004	2024/7/15	
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	13,650	13,987	448,061	2035/5/31	
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	4,800	4,868	155,951	2053/3/31	
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	7,000	7,215	231,142	2029/4/30	
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	8,800	9,324	298,681	2042/10/15	
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	16,300	17,459	559,261	2037/4/7	
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	16,100	17,556	562,386	2038/6/8	
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	7,800	8,441	270,394	2048/7/6	
小計				12,160,927		
(タイ)		千タイバート	千タイバート			
国債証券						
THAIGB 0.75% 06/17/24	0.75	102,500	101,520	429,431	2024/6/17	
THAIGB 0.75% 09/17/24	0.75	84,000	82,849	350,455	2024/9/17	
THAIGB 0.95% 06/17/25	0.95	142,200	138,812	587,178	2025/6/17	
THAIGB 1% 06/17/27	1.0	163,000	153,783	650,502	2027/6/17	
THAIGB 1.45% 12/17/24	1.45	164,000	162,361	686,787	2024/12/17	
THAIGB 1.585% 12/17/35	1.585	59,800	49,924	211,178	2035/12/17	
THAIGB 1.6% 06/17/35	1.6	65,100	55,378	234,251	2035/6/17	
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	104,100	96,920	409,974	2029/12/17	
THAIGB 2% 06/17/42	2.0	78,600	62,026	262,370	2042/6/17	
THAIGB 2% 12/17/31	2.0	113,000	104,874	443,620	2031/12/17	
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	203,100	200,419	847,773	2026/12/17	
THAIGB 2.35% 06/17/26	2.35	142,000	141,257	597,520	2026/6/17	
THAIGB 2.65% 06/17/28	2.65	140,000	139,621	590,597	2028/6/17	
THAIGB 2.875% 06/17/46	2.875	102,100	88,589	374,735	2046/6/17	
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	101,000	101,542	429,526	2028/12/17	
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	148,700	146,567	619,979	2038/6/17	
THAIGB 3.35% 06/17/33	3.35	122,000	125,229	529,720	2033/6/17	
THAIGB 3.39% 06/17/37	3.39	76,000	76,483	323,523	2037/6/17	
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	157,200	157,126	664,645	2036/6/17	
THAIGB 3.45% 06/17/43	3.45	69,000	68,433	289,473	2043/6/17	
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	116,500	121,113	512,310	2031/6/20	
THAIGB 3.775% 06/25/32	3.775	180,000	189,146	800,088	2032/6/25	
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	105,400	108,301	458,116	2025/12/12	
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	169,500	187,426	792,813	2029/6/22	
小計				12,096,574		
(フィリピン)		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ			
国債証券						
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	30,000	28,451	77,112	2036/1/14	
(インドネシア)		千インドネシアルピア	千インドネシアルピア			
国債証券						
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,300,000	8,606,282	83,480	2030/8/15	
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	7,500,000	8,042,005	78,007	2025/9/15	
INDOGB 5.125% 04/15/27	5.125	63,000,000	60,194,580	583,887	2027/4/15	
INDOGB 5.5% 04/15/26	5.5	109,000,000	106,165,459	1,029,804	2026/4/15	

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評価額	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	16,000,000	15,618,232	151,496	2028/5/15
INDOGB 6.25% 06/15/36	6.25	17,800,000	16,917,971	164,104	2036/6/15
INDOGB 6.375% 04/15/32	6.375	62,000,000	60,240,058	584,328	2032/4/15
INDOGB 6.375% 07/15/37	6.375	16,100,000	15,346,473	148,860	2037/7/15
INDOGB 6.375% 08/15/28	6.375	43,500,000	43,013,235	417,228	2028/8/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	75,500,000	73,499,470	712,944	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	53,000,000	52,872,433	512,862	2025/6/15
INDOGB 6.625% 02/15/34	6.625	15,000,000	14,723,182	142,814	2034/2/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	20,000,000	19,682,683	190,922	2033/5/15
INDOGB 7% 02/15/33	7.0	83,000,000	84,574,510	820,372	2033/2/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	38,600,000	38,897,335	377,304	2027/5/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	71,000,000	71,493,634	693,488	2030/9/15
INDOGB 7.125% 06/15/38	7.125	16,000,000	16,357,600	158,668	2038/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/42	7.125	43,800,000	43,988,834	426,691	2042/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/43	7.125	18,500,000	18,711,270	181,499	2043/6/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	51,000,000	53,101,791	515,087	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	34,700,000	36,146,361	350,619	2038/5/15
INDOGB 7.5% 06/15/35	7.5	68,700,000	71,666,685	695,166	2035/6/15
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	18,400,000	19,124,117	185,503	2032/8/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	54,200,000	57,640,155	559,109	2029/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	33,700,000	37,062,006	359,501	2036/5/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	13,400,000	14,593,996	141,561	2032/6/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	44,000,000	48,858,660	473,929	2034/3/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	24,200,000	27,138,649	263,244	2039/4/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	40,100,000	41,813,569	405,591	2026/9/15
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	38,700,000	42,942,812	416,545	2031/5/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	28,700,000	31,379,759	304,383	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	13,178,754	127,833	2031/7/15
小計				12,256,847	
(中国オフショア) 国債証券		千円ジョア人民元	千円ジョア人民元		
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	13,600	13,523	280,523	2025/4/9
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	10,200	10,167	210,907	2025/8/25
CGB 2.26% 02/24/25	2.26	3,000	2,996	62,157	2025/2/24
CGB 2.3% 05/15/26	2.3	14,000	13,993	290,285	2026/5/15
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	10,000	9,946	206,338	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	21,000	20,957	434,745	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	16,000	16,020	332,323	2026/2/15
CGB 2.48% 04/15/27	2.48	5,400	5,403	112,080	2027/4/15
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	6,000	6,003	124,527	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	4,200	4,157	86,243	2033/8/25
CGB 2.6% 09/01/32	2.6	16,900	16,803	348,575	2032/9/1
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	17,800	17,888	371,085	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	5,500	5,486	113,806	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	5,000	4,997	103,663	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	10,000	10,064	208,780	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	8,000	7,999	165,942	2033/5/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	27,300	27,361	567,588	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	10,000	10,082	209,141	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	10,000	10,022	207,906	2032/8/15
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	7,700	7,748	160,725	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	10,900	10,985	227,875	2029/6/15
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	4,500	4,532	94,017	2032/5/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	12,000	12,113	251,273	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	12,000	12,134	251,717	2029/3/24
CGB 2.8% 03/25/30	2.8	9,000	9,088	188,523	2030/3/25
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	9,900	10,022	207,896	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	18,400	18,650	386,890	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	17,200	17,558	364,236	2033/2/25

銘柄	利率 (%)	期		末	
		額面金額	評価額	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CGB 2.89% 11/18/31	2.89	8,000	8,139	168,846	2031/11/18
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	10,000	10,174	211,049	2028/10/14
CGB 2.94% 10/17/24	2.94	23,000	23,160	480,429	2024/10/17
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	9,800	10,023	207,924	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	8,500	8,748	181,477	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	7,300	7,406	153,633	2025/10/22
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	19,500	19,826	411,282	2026/3/11
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	4,600	4,698	97,457	2052/10/25
CGB 3.12% 12/05/26	3.12	15,000	15,344	318,295	2026/12/5
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	8,300	8,572	177,820	2029/11/21
CGB 3.22% 12/06/25	3.22	21,600	22,039	457,173	2025/12/6
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	22,000	22,578	468,356	2026/6/6
CGB 3.25% 11/22/28	3.25	10,300	10,682	221,593	2028/11/22
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	22,000	23,063	478,424	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	9,700	10,038	208,243	2027/12/3
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	14,200	14,790	306,810	2029/5/23
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	4,000	4,198	87,089	2052/4/15
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	8,800	9,555	198,219	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	8,500	9,519	197,471	2051/4/12
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	16,500	18,723	388,397	2050/9/14
小計				11,989,777	
(南アフリカ) 国債証券		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	207,400	215,810	1,752,377	2026/12/21
SAGB 11.625% 03/31/53	11.625	16,500	15,476	125,665	2053/3/31
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	72,200	45,886	372,600	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	92,100	54,458	442,204	2041/2/28
SAGB 7% 02/28/31	7.0	102,700	82,919	673,310	2031/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	190,600	170,587	1,385,166	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	165,500	139,202	1,130,320	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	145,700	110,557	897,724	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	112,000	81,704	663,436	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	181,700	131,714	1,069,520	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	151,000	123,065	999,287	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	118,300	90,540	735,192	2040/1/31
小計				10,246,806	
合計				119,239,383	

(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。

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	119,239,383	97.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,516,095	2.9
投 資 信 託 財 産 総 額	122,755,478	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(122,124,162千円)の投資信託財産総額(122,755,478千円)に対する比率は99.5%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=151.43円	1メキシコペソ=8.5205円	1ブラジルレアル=30.6353円
1チリペソ=0.165877円	1コロンビアペソ=0.03766円	1ペルー・ソル=39.7896円
1ウルグアイペソ=3.7973円	1ドミニカペソ=2.6646円	1ユーロ=161.56円
1チェココナ=6.5802円	1ハンガリーフォリント=0.426067円	1ポーランドズロチ=36.3973円
1ルーマニア・レイ=32.5187円	1マレーシアリンギット=32.0325円	1タイバーツ=4.23円
1フィリピンペソ=2.7103円	1インドネシアルピア=0.0097円	1オフショア人民元=20.7438円
1南アフリカランド=8.12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 2023年11月10日現在
(A) 資 産	122,755,478,007円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,487,100,463
公 社 債 (評価額)	119,239,383,782
未 収 利 息	1,816,897,809
前 払 費 用	212,095,953
(B) 負 債	93,492,950
未 払 解 約 金	93,492,542
未 払 利 息	387
そ の 他 未 払 費 用	21
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	122,661,985,057
元 本	56,372,858,492
次 期 繰 越 損 益 金	66,289,126,565
(D) 受 益 権 総 口 数	56,372,858,492口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,759円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	6,372,486,767円
受 取 利 息	6,373,280,400
そ の 他 収 益 金	71,916
支 払 利 息	△865,549
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	11,401,195,780
売 買 益	12,772,304,545
売 買 損	△1,371,108,765
(C) そ の 他 費 用	△122,715,929
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	17,650,966,618
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	40,511,111,167
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	12,564,139,349
(G) 解 約 差 損 益 金	△4,437,090,569
(H) 計 (D+E+F+G)	66,289,126,565
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	66,289,126,565

(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47,663,305,590円、期中追加設定元本額は13,446,721,298円、期中一部解約元本額は4,737,168,396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。

世界経済インデックスファンド	19,468,805,143円
DC世界経済インデックスファンド	14,244,781,680円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,804,582,742円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,552,956,831円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,540,957,166円
分散投資コア戦略ファンドS	1,042,725,547円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	995,680,503円
グローバル経済コア	820,321,639円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	715,157,460円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	623,928,987円
SMT 世界経済インデックス・オープン	472,204,344円
分散投資コア戦略ファンドA	395,863,625円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	242,877,543円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	242,168,757円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	230,204,334円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	226,968,022円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	225,814,900円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	224,099,208円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	221,877,764円
SMT インデックスバランス・オープン	182,976,326円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	162,669,884円
My SMT 新興国債券インデックス(ノーロード)	152,161,830円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	145,958,376円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	108,856,092円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	92,855,237円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	78,807,700円
10資産分散投資ファンド	42,777,463円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	34,554,195円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	32,364,228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)	22,306,619円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	13,029,257円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	8,853,220円
グローバル10資産バランスファンド	2,711,870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16期（決算日 2023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 先比	投信証 託証入 組入比	資 券 率	純 資 産 額
	円 騰 落	% 中 率	円 騰 落	% 中 率				
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	
第16期(2023年11月10日)	20,865	△2.8	20,641	△2.9	2.9	97.1	114,790	

(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 先比	投信証 託証入 組入比	資 券 率
	円 騰 落	% 騰 落 率	円 騰 落	% 騰 落 率			
(当期首) 2022年11月10日	21,469	—	21,266	—	3.1	96.9	%
11月末	21,792	1.5	21,586	1.5	3.1	96.9	%
12月末	21,020	△2.1	20,822	△2.1	3.0	97.0	%
2023年 1月末	20,352	△5.2	20,157	△5.2	3.0	97.0	%
2月末	20,671	△3.7	20,480	△3.7	3.0	97.0	%
3月末	20,069	△6.5	19,881	△6.5	2.9	97.1	%
4月末	21,098	△1.7	20,901	△1.7	2.9	97.1	%
5月末	21,235	△1.1	21,036	△1.1	2.9	97.1	%
6月末	21,103	△1.7	20,905	△1.7	2.8	97.1	%
7月末	21,352	△0.5	21,149	△0.5	2.8	97.2	%
8月末	21,668	0.9	21,463	0.9	3.4	96.6	%
9月末	21,330	△0.6	21,127	△0.7	3.2	96.8	%
10月末	20,890	△2.7	20,673	△2.8	3.3	96.6	%
(当期末) 2023年11月10日	20,865	△2.8	20,641	△2.9	2.9	97.1	%

(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。

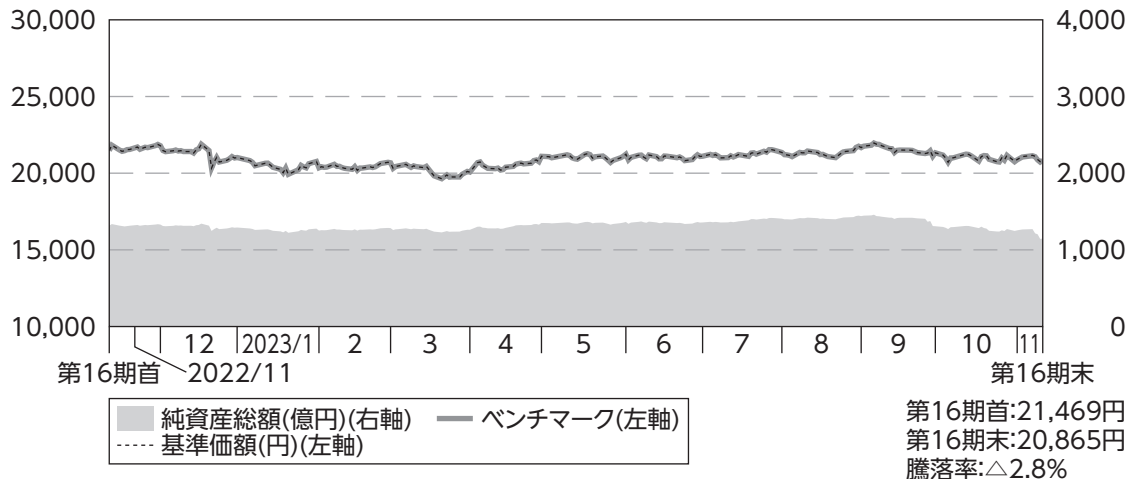
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

【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

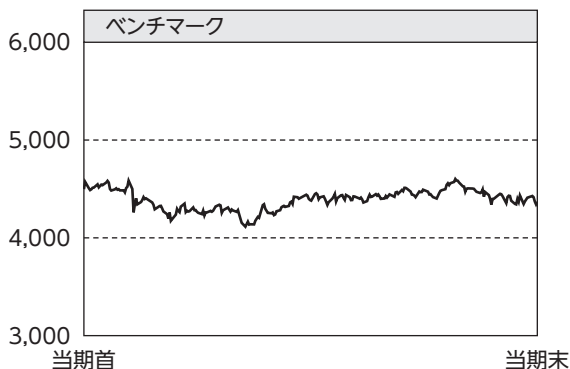


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で下落しました。

## 投資環境



当期のJ-REIT市場は下落しました。

日銀により長期金利の変動許容幅が拡大されたことが事実上の利上げと受け止められたことや、公募増資の発表が相次ぎ短期的な需給への影響が意識されたことなどから2023年1月にかけて下落しました。2023年3月中旬にかけては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一時的に下落する局面もありましたが、その後は各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対しての過度な懸念が後退したことなどから上昇しました。2023年4月以降は米雇用統計の発表などを受け景気の減速懸念が後退したことや、日銀金融政策決定会合での金融政策の現状維持の決定が好感されたことも追い風となり上昇しましたが、高値警戒感が強まる中、米金融引き締め長期化の観測に加えて米暫定予算の成立が危ぶまれたことから米政府機関閉鎖の可能性が懸念され、下落しました。

## 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

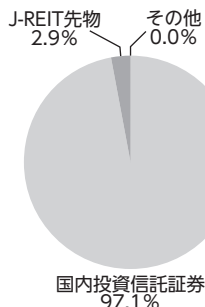
### ○上位10銘柄

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	5.1%
4	日本プロジスリート投資法人	日本	4.5%
5	日本都市ファンド投資法人	日本	4.4%
6	KDX不動産投資法人	日本	4.4%

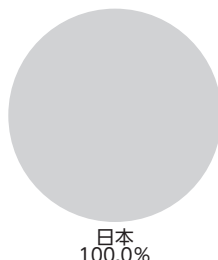
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	GLP投資法人	日本	4.3%
8	大和ハウスリート投資法人	日本	3.9%
9	オリックス不動産投資法人	日本	3.2%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数			59

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

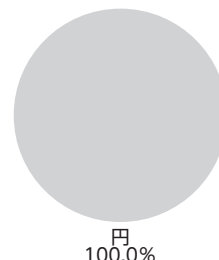
### ○資産別配分



### ○国別配分



### ○通貨別配分

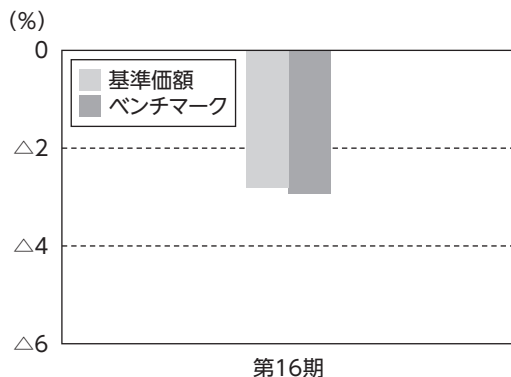


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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2.9%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2023年10月の指数構成銘柄の吸収合併により生じた価格差によるものです。

## 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
	(2022年11月11日~2023年11月10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)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(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	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
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(21,048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	476	54,972	666	78,398
	サンケイリアルエステート投資法人	748	66,316	1,045	95,430
	SOS i LA物流リート投資法人	1,473 (70)	194,566 (9,401)	1,637	205,567
	SOS i LA物流リート投資法人	70 (△70)	9,401 (△9,401)	—	—
	東海道リート投資法人	606 (286)	73,293 (32,569)	708	87,182
	東海道リート投資法人	286 (△286)	32,569 (△32,569)	—	—
	日本アコモデーションファンド投資法人	819	512,713	1,139	713,076
	森ヒルズリート投資法人	2,807	419,249	3,897	564,315
	産業ファンド投資法人	3,982	587,960	5,029	712,956
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,647	887,250	3,776	1,276,233
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,911 (△8,607)	405,775 (△1,812,442)	1,708	376,581
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,236	495,975	1,761	719,406
	GLP投資法人	9,668	1,397,160	11,040	1,535,718
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,426 (34)	457,724 (9,504)	1,605	521,233
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	34 (△34)	9,504 (△9,504)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	5,083 (223)	1,522,649 (64,703)	5,710	1,615,229
	日本プロロジスリート投資法人	223 (△223)	64,703 (△64,703)	—	—
	星野リゾート・リート投資法人	543	360,943	601	383,036
	One リート投資法人	406	99,653	568	145,624
	イオンリート投資法人	4,115 (124)	616,312 (16,796)	3,974	584,868
イオンリート投資法人	124 (△124)	16,796 (△16,796)	—	—	
ヒューリックリート投資法人	2,227	353,675	3,094	489,845	
日本リート投資法人	770	259,443	1,071	374,281	
積水ハウス・リート投資法人	7,147	560,637	10,332	834,983	
トーセイ・リート投資法人	511	68,134	838	115,129	
内	ケネディクス商業リート投資法人	1,024 (△5,097)	267,361 (△1,359,835)	1,021	283,273
	ヘルスケア&メディカル投資法人	579	94,200	808	122,300



		当期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
国		口	千円	口	千円
		サムティ・レジデンシャル投資法人	775	89,300	881
	野村不動産マスターファンド投資法人	7,683	1,234,188	10,681	1,779,703
	いちごホテルリート投資法人	391	41,898	544	59,254
	ラサールロジポート投資法人	3,631	560,957	4,183	628,136
	スターアジア不動産投資法人	6,842	375,445	4,842	279,664
	マリモ地方創生リート投資法人	695	90,143	495	62,992
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,213	585,572	1,354	646,823
	大江戸温泉リート投資法人	373	23,830	615	39,865
	投資法人みらい	3,715	170,298	4,152	192,931
	森トラスト・ホテルリート投資法人	138 (△2,807)	18,563 (△394,098)	80	10,763
	三菱地所物流リート投資法人	830	337,189	1,130	439,728
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,504	265,565	1,397	235,855
	ザイマックス・リート投資法人	380	43,427	532	61,717
	タカラレーベン不動産投資法人	1,365 (172)	128,592 (15,208)	1,553	151,814
	タカラレーベン不動産投資法人	172 (△172)	15,208 (△15,208)	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,061	143,207	1,441	186,362
	日本ビルファンド投資法人	2,770	1,618,190	3,852	2,318,356
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,739	1,530,949	3,373	1,944,490
	日本都市ファンド投資法人	11,732	1,157,846	19,133	1,873,428
	オリックス不動産投資法人	4,743	843,456	6,590	1,169,835
	日本プライムリアルティ投資法人	1,590	567,262	2,225	798,859
	NTT都市開発リート投資法人	2,571 (306)	344,037 (37,427)	3,202	432,308
	NTT都市開発リート投資法人	306 (△306)	37,427 (△37,427)	—	—
	東急リアル・エステート投資法人	1,600	303,532	2,221	411,334
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,371	259,799	2,431	277,499
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,260	783,705	7,502	1,148,122
	森トラストリート投資法人	4,605 (13,715)	362,016 (394,098)	5,896	450,398
	インヴィンシブル投資法人	16,297	907,604	15,627	903,664
	フロンティア不動産投資法人	879	424,809	1,223	571,797
	平和不動産リート投資法人	2,378 (92)	354,818 (13,637)	2,416	353,635
	平和不動産リート投資法人	92 (△92)	13,637 (△13,637)	—	—
内	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,572	479,111	2,561	758,751
	福岡リート投資法人	1,215	199,930	1,694	275,311

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国       内	KDX不動産投資法人	1,435 (26,917)	453,325 (3,172,277)	4,118	906,714
	いちごオフィスリート投資法人	1,946	173,841	2,705	235,301
	大和証券オフィス投資法人	489	306,021	703	459,984
	阪急阪神リート投資法人	1,397	201,183	1,545	221,317
	スターツプロシード投資法人	405	91,583	566	123,360
	大和ハウスリート投資法人	3,582	1,006,532	4,980	1,358,545
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,253	693,295	10,919	800,714
	大和証券リビング投資法人	4,333	482,746	4,679	526,332
	ジャパンエクセレント投資法人	2,142	270,545	3,513	463,547

(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	REIT先物取引	百万円 25,632	百万円 26,144	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 27	百万円 27	% 100.0	百万円 27	百万円 27	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	748,719	71,510	9.6	744,223	71,859	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。

\* 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		2,382		2,192	259,094	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		3,754		3,457	312,512	0.3
S O S i L A物流リート投資法人		5,478		5,384	643,388	0.6
東海道リート投資法人		1,421		1,605	200,625	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人		4,046		3,726	2,265,408	2.0
森ヒルズリート投資法人		13,779		12,689	1,763,771	1.5
産業ファンド投資法人		17,511		16,464	2,242,396	2.0
アドバンス・レジデンス投資法人		11,716		10,587	3,440,775	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		8,404		—	—	—
アクティブピア・プロパティーズ投資法人		6,186		5,661	2,264,400	2.0
GLP投資法人		37,821		36,449	4,978,933	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		5,451		5,306	1,687,308	1.5
日本プロロジスリート投資法人		19,201		18,797	5,174,814	4.5
星野リゾート・リート投資法人		2,049		1,991	1,184,645	1.0
Oneリート投資法人		2,044		1,882	484,615	0.4
イオンリート投資法人		12,971		13,236	1,891,424	1.6
ヒューリックリート投資法人		10,963		10,096	1,523,486	1.3
日本リート投資法人		3,806		3,505	1,200,462	1.0
積水ハウス・リート投資法人		35,609		32,424	2,535,556	2.2
トーセイ・リート投資法人		2,599		2,272	308,764	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		5,094		—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,889		2,660	383,572	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		3,046		2,940	318,990	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		37,892		34,894	5,820,319	5.1
いちごホテルリート投資法人		1,941		1,788	183,091	0.2
ラサールロジポート投資法人		14,345		13,793	2,068,950	1.8
スターアジア不動産投資法人		14,630		16,630	949,573	0.8
マリモ地方創生リート投資法人		1,463		1,663	211,034	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4,629		4,488	2,098,140	1.8
大江戸温泉リート投資法人		1,891		1,649	108,009	0.1
投資法人みらい		14,236		13,799	623,024	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		2,749		—	—	—
三菱地所物流リート投資法人		4,026		3,726	1,406,565	1.2
CREロジスティクスファンド投資法人		4,538		4,645	745,987	0.6
ザイマックス・リート投資法人		1,901		1,749	204,982	0.2
タカラレーベン不動産投資法人		5,132		5,116	498,810	0.4

銘 柄	当期首(前期末)		当 期		末	
	口 数 (口)	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	比 率 (%)
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,108	4,728	589,581	0.5		
日本ビルファンド投資法人	13,670	12,588	7,653,504	6.7		
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,718	11,084	6,240,292	5.4		
日本都市ファンド投資法人	59,122	51,721	5,068,658	4.4		
オリックス不動産投資法人	23,347	21,500	3,674,350	3.2		
日本プライムリアルティ投資法人	8,014	7,379	2,564,202	2.2		
N T T都市開発リート投資法人	11,264	10,939	1,401,285	1.2		
東急リアル・エステート投資法人	7,856	7,235	1,292,171	1.1		
グローバル・ワン不動産投資法人	8,028	7,968	895,603	0.8		
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,379	24,137	3,615,722	3.1		
森トラストリート投資法人	8,375	20,799	1,522,486	1.3		
インヴィンシブル投資法人	51,574	52,244	2,972,683	2.6		
フロンティア不動産投資法人	4,348	4,004	1,811,810	1.6		
平和不動産リート投資法人	8,008	8,062	1,139,966	1.0		
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,901	6,912	1,968,537	1.7		
福岡リート投資法人	6,060	5,581	904,680	0.8		
KDX不動産投資法人	6,818	31,052	5,008,687	4.4		
いちごオフィスリート投資法人	9,601	8,842	743,612	0.6		
大和証券オフィス投資法人	2,449	2,235	1,457,220	1.3		
阪急阪神リート投資法人	5,293	5,145	727,503	0.6		
スターツプロシード投資法人	2,031	1,870	381,480	0.3		
大和ハウスリート投資法人	17,663	16,265	4,422,453	3.9		
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,787	36,121	2,405,658	2.1		
大和証券リビング投資法人	16,237	15,891	1,733,708	1.5		
ジャパンエクセレント投資法人	10,749	9,378	1,236,958	1.1		
合 計	口 数 ・ 金 額	696,993	680,943	111,416,247		
	銘 柄 数 <比 率>	61	58	<97.1%>		

(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	アドバンス・ロジスティクス投資法人
SOS i LA物流リート投資法人	日本ビルファンド投資法人
日本アコモデーションファンド投資法人	オリックス不動産投資法人
森ヒルズリート投資法人	NTT都市開発リート投資法人
産業ファンド投資法人	東急リアル・エステート投資法人
アドバンス・レジデンス投資法人	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
ヘルスケア&メディカル投資法人	福岡リート投資法人
ラサールロジポート投資法人	KDX不動産投資法人
スターアジア不動産投資法人	いちごオフィスリート投資法人
マリモ地方創生リート投資法人	大和証券オフィス投資法人
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	阪急阪神リート投資法人
大江戸温泉リート投資法人	スターツプロシード投資法人
投資法人みらい	大和ハウスリート投資法人
CREロジスティクスファンド投資法人	ジャパン・ホテル・リート投資法人
タカラレーベン不動産投資法人	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	期			末
			買	建	額	建
			(百万円)			(百万円)
国内	東	証 R E I T 指 数			3,355	—

## 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 111,416,247	% 92.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,055,244	7.5
投 資 信 託 財 産 総 額	120,471,491	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 2023年11月10日現在
(A)資 産	120,471,491,820円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,232,349,014
投 資 証 券(評価額)	111,416,247,550
未 収 入 金	122,018,001
未 収 配 当 金	1,432,956,164
差 入 委 託 証 拠 金	267,921,091
(B)負 債	5,681,027,880
未 払 金	211,410,108
未 払 解 約 金	5,469,613,245
未 払 利 息	4,444
そ の 他 未 払 費 用	83
(C)純 資 産 総 額(A-B)	114,790,463,940
元 本	55,015,213,467
次 期 繰 越 損 益 金	59,775,250,473
(D)受 益 権 総 口 数	55,015,213,467口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,865円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配 当 等 収 益	5,319,385,391円
受 取 配 当 金	5,320,964,111
受 取 利 息	12,383
そ の 他 収 益 金	61,938
支 払 利 息	△1,653,041
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△8,360,807,690
売 買 益	944,750,922
売 買 損	△9,305,558,612
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△144,825,090
取 引 益	376,947,140
取 引 損	△521,772,230
(D)そ の 他 費 用	△83
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△3,186,247,472
(F)前 期 繰 越 損 益 金	70,219,792,611
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	12,054,054,754
(H)解 約 差 損 益 金	△19,312,349,420
(I)計 (E+F+G+H)	59,775,250,473
次 期 繰 越 損 益 金(I)	59,775,250,473

(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61,225,723,115円、期中追加設定元本額は11,096,208,886円、期中一部解約元本額は17,306,718,534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)	26,696,166,094円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,705,566,878円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,926,122,015円
分散投資コア戦略ファンドS	1,830,619,539円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,011,513,433円
コア投資戦略ファンド(切替型)	750,196,687円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	526,962,705円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	524,199,116円
J-REIT バッジ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	508,830,600円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	420,963,439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)	350,225,825円
J-REIT バッジ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	280,493,401円
グローバル経済コア	280,077,565円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	256,354,957円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	129,646,228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)	70,179,766円
SMT インデックスバランス・オープン	23,921,569円
10資産分散投資ファンド	23,142,611円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,349,392円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,440,387円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	8,937,152円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,941,545円
グローバル10資産バランスファンド	2,695,542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16期（決算日 2023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	騰落率		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産総額
		円	%	騰落	騰落率		
第12期(2019年11月11日)	19,790		9.2	21,166	9.9	99.4	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838		△14.9	18,082	△14.6	99.6	80,213
第14期(2021年11月10日)	24,699		46.7	26,632	47.3	99.5	102,118
第15期(2022年11月10日)	24,409		△1.2	26,413	△0.8	99.5	84,560
第16期(2023年11月10日)	24,877		1.9	27,027	2.3	99.7	105,580

## 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	騰落	騰落率	
(当期首)		%		%	%
2022年11月10日	24,409	—	26,413	—	99.5
11月末	24,538	0.5	26,563	0.6	99.6
12月末	23,010	△5.7	24,929	△5.6	99.3
2023年1月末	24,559	0.6	26,625	0.8	99.5
2月末	24,824	1.7	26,920	1.9	99.6
3月末	23,125	△5.3	25,064	△5.1	99.1
4月末	23,661	△3.1	25,657	△2.9	99.4
5月末	24,019	△1.6	26,050	△1.4	99.5
6月末	25,766	5.6	27,974	5.9	99.1
7月末	25,906	6.1	28,139	6.5	99.6
8月末	26,306	7.8	28,577	8.2	99.3
9月末	24,838	1.8	26,979	2.1	99.2
10月末	23,407	△4.1	25,419	△3.8	99.6
(当期末)					
2023年11月10日	24,877	1.9	27,027	2.3	99.7

(注) 騰落率は期首比です。

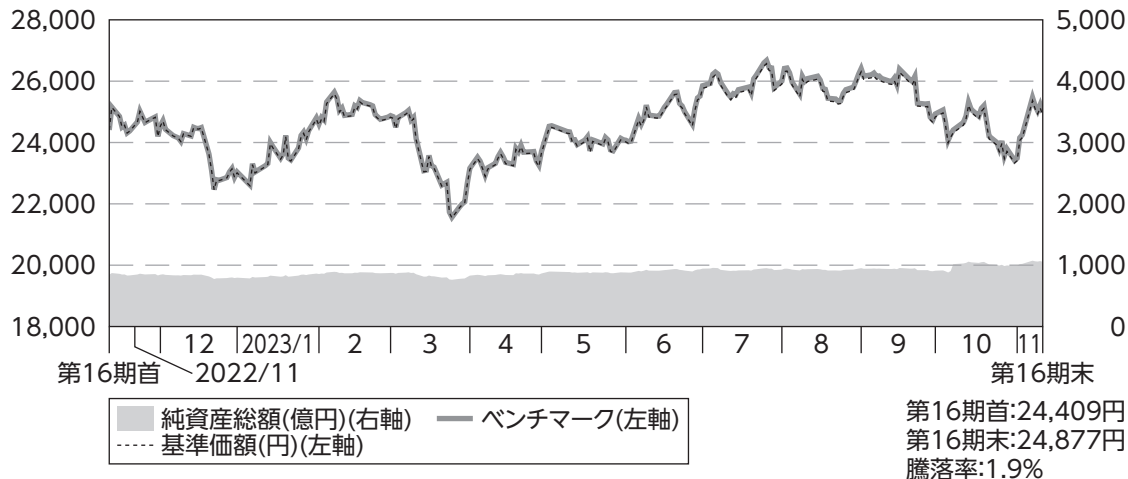
ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）です。

S&P先進国REIT指数とは、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。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「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、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

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



海外REIT市場は、米国でCPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化し利上げ幅の縮小や先行きの利上げ停止への期待が高まったことなどから2023年2月上旬にかけて上昇しました。その後は一時下落に転じる場面もありましたが、予想を上回る経済指標を受けた米国景気の軟着陸期待の高まりなどから7月にかけて堅調に推移しました。しかし8月以降は、米国で大手自動車メーカーのストライキなど新たなインフレ要因への警戒から長期金利が大きく上昇したことが嫌気されたほか、各国中央銀行が政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから下落しました。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

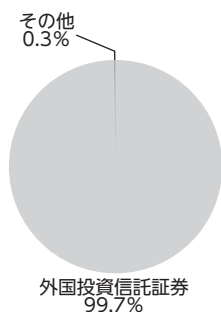
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.2%
2	EQUINIX INC	アメリカ	6.1%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	4.0%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.3%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.3%
6	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	3.2%

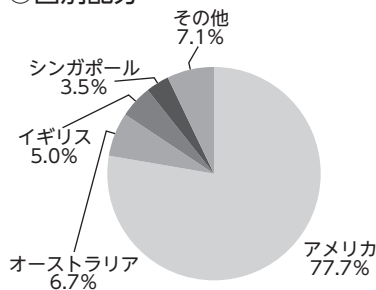
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.0%
8	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.4%
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	2.1%
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.1%
組入銘柄数		308	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

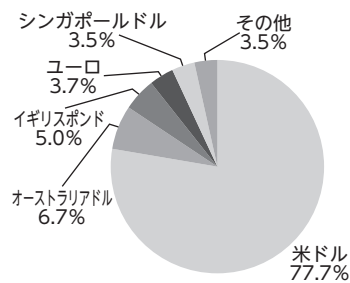
### ○資産別配分



### ○国別配分



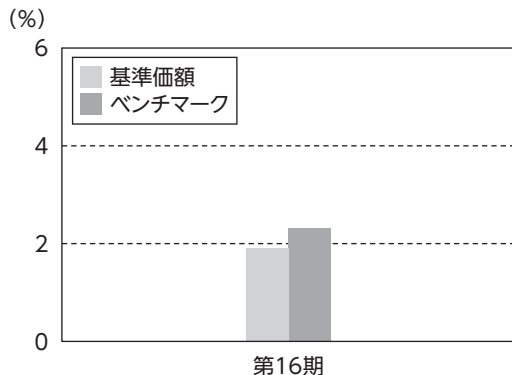
### ○通貨別配分



(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
	(2022年11月11日~2023年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.006%	(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)	(1)	(0.006)	
(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	9	0.037	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(9)	(0.037)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	13	0.054	

(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(24,496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
外 国				
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,934	3,168	4,938	588
ALEXANDER'S INC	450	77	304	72
BOSTON PROPERTIES	24,272	1,415	5,579	347
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,581	1,245	4,180	129
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,550	179	12,620	110
AGREE REALTY CORP	20,291	1,260	—	—
SL GREEN REALTY CORP	11,270	352	3,635	96
EPR PROPERTIES	8,886	361	—	—
PROLOGIS INC	139,764	15,888	28,523	3,423
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,621	3,510	2,940	524
LXP INDUSTRIAL TRUST	40,300	363	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,552	1,759	4,289	481
VERIS RESIDENTIAL INC	11,160	179	—	—
NNN REIT INC	29,244	1,141	3,720	161
COUSINS PROPERTIES INC	22,590	484	4,760	111
URSTADT BIDDLE - CL A	— (△15,050)	— (△273)	—	—
SITE CENTERS CORP	26,800	333	8,467	113
SAFEHOLD INC	9,190 (△33,950)	197 (—)	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST	9,578	2,071	2,337	532
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	54,542	3,253	9,526	614
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,637	989	1,220	118
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,159	811	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	85,695	1,688	14,661	333
EQUITY COMMONWEALTH	12,310	238	—	—
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,767	276	—	—
SERVICE PROPERTIES TRUST	22,510	192	—	—
WELLTOWER INC	117,844	9,452	9,276	714
EASTGROUP PROPERTIES, INC	7,141	1,182	630	111

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
KIMCO REALTY CORP	91,383	1,665	15,899	322
KILROY REALTY CORPORATION	13,040	418	—	—
LTC PROPERTIES INC	5,950	196	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	23,290	91	—	—
IRON MOUNTAIN INC	43,014	2,436	6,883	389
MACERICH CO/THE	25,590	256	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,626	2,128	4,868	324
ACADIA REALTY TRUST	13,670	195	4,773	72
HOST HOTELS AND RESORTS INC	110,956	1,822	26,803	457
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,682	2,450	2,407	369
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,044	70	7,383	72
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,530	231	—	—
CENTERSPACE	1,650	95	—	—
GETTY REALTY CORP	6,730	201	—	—
RPT REALTY	20,120	190	15,897	169
REALTY INCOME CORP	143,367	7,968	14,630	909
REGENCY CENTERS CORP	23,982 (5,222)	1,431 (273)	4,073	255
UDR INC	50,084	1,892	14,611	597
COPT DEFENSE PROPERTIES	15,717	376	2,500	57
SAUL CENTERS INC	1,740	70	1,694	72
SIMON PROPERTY GROUP	49,338	5,389	10,149	1,183
LIFE STORAGE INC	4,747 ( $\Delta$ 42,213)	563 ( $\Delta$ 4,365)	2,480	309
PUBLIC STORAGE	23,721	6,443	4,570	1,323
SUN COMMUNITIES INC	18,460	2,323	3,023	405
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,050	375	4,289	92
UMH PROPERTIES INC	7,880	116	—	—
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,792	81	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,018	132	—	—
VENTAS INC	61,420	2,649	11,091	519
VORNADO REALTY TRUST	18,020	385	—	—
ELME COMMUNITIES	20,990	330	6,957	109
KITE REALTY GROUP TRUST	33,956	721	4,640	105
EXTRA SPACE STORAGE INC	27,458 (37,780)	3,501 (4,365)	3,440	525

		当期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	34,040	319	10,190	105
	CUBESMART	33,973	1,342	5,922	257
	DIGITAL REALTY TRUST INC	49,638	5,681	6,150	687
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24,640	198	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	81,310	535	12,030	114
	DOUGLAS EMMETT INC-W/I	25,390	302	9,850	129
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	16,000	194	—	—
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	16,880	88	—	—
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,580	88	—	—
	TERRENO REALTY CORP	17,850	1,068	—	—
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,950	191	8,049	185
	RLJ LODGING TRUST	27,190	275	10,590	111
	AMERICOLD REALTY TRUST	39,962	1,195	15,190	498
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,950	205	6,538	86
	CHATHAM LODGING TRUST	5,760	70	5,558	71
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	26,933	355	—	—
	WHITESTONE REIT	8,880	83	—	—
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	15,730	95	—	—
	STAG INDUSTRIAL INC	26,134	907	2,930	107
	WP CAREY INC	33,712	2,121	4,944	361
	ALEXANDER & BALDWIN INC	11,075	191	4,394	86
	GLADSTONE LAND CORP	6,430	89	—	—
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	56,222	948	6,690	127
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,986	868	—	—
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES	9,180	93	—	—
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,935	759	—	—
	PHYSICIANS REALTY TRUST	33,570	434	—	—
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	46,139	2,370	3,901	208
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	55,111	1,811	9,442	311
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	33,250	502	5,970	110
	INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,350	248	—	—
	JBG SMITH PROPERTIES	16,140	227	7,110	112
	NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	— (△63,086)	— (△393)	—	—
	UNITI GROUP INC	142,940	730	—	—



	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
INVITATION HOMES INC	88,868	2,811	20,947	708
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	— (—)	— (△7)	127,300	73
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,310	223	19,585	132
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,750	175	4,324	97
SAFEHOLD INC	— (3,093)	— (—)	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	25,060	571	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,715	1,941	5,754	280
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44,041	924	5,270	116
PRIME US REIT	— (—)	— (△4)	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,280	83	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	12,620	290	4,400	103
FARMLAND PARTNERS INC	5,149	57	—	—
CITY OFFICE REIT INC	—	—	9,752	95
ORION OFFICE REIT INC	12,000	115	7,530	70
NETSTREIT CORP	17,229	287	—	—
CARETRUST REIT INC	12,970	249	—	—
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	364	—	—
INDUS REALTY TRUST INC	—	—	2,340	156
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	17,320	569	3,480	118
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	—	1,856	25
APARTMENT INCOME REIT CO	19,480	642	4,750	170
BROADSTONE NET LEASE INC-A	33,588	529	5,000	83
CTO REALTY GROWTH INC	4,000	65	—	—
STAR HOLDINGS	— (6,183)	— (—)	—	—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,140	88	—	—
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	190,000 (—)	106 (△3)	—	—
NET LEASE OFFICE PROPERTY	— (8,467)	— (—)	—	—
STORE CAPITAL CORP	4,060	128	129,849	4,186
PARAMOUNT GROUP INC	20,120	87	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,360	99	7,499	70
URBAN EDGE PROPERTIES	19,910	293	5,711	87

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	EQUINIX INC	14,739	10,495	2,350	1,728
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14,190	179	—	—
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,880	206	7,000	86
	NEXPOINT RESIDENTIAL	3,050	94	—	—
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,600	284	—	—
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	3,930	111	—	—
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,390	480	6,760	103
	GLOBAL NET LEASE INC	23,960 (42,267)	231 (393)	—	—
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490 (179)	190 (1)	—	—
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	34,820	425	13,859	170
	VICI PROPERTIES INC	166,899	5,007	23,742	752
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,060	368	—	—
	小 計	3,735,461 (△51,108)	152,665 (△13)	849,171	30,322
	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,491	304	—	—
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,580	639	2,825	143
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	15,000	133	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,681	611	11,619	234
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	8,000	137	—	—
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	—	—	8,481	127
	PRIMARIS REIT	8,325	110	6,259	94
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,546	277	—	—
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9,052	112	—	—
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	10,773	104	—	—
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	—	—	5,934	97
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	—	8,700	27
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	14,183	192	—	—
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	5,334	119	45,062	1,056
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,801	287	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	24,950	320	—	—
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	—	—	23,900	59
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	23,728	322	7,075	103
	SLATE GROCERY REIT	15,480	203	16,202	225

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	SLATE OFFICE REI	—	—	17,000	27
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	—	—	12,000	125
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	13,747	228	—	—
	小 計	214,671	4,105	165,057	2,322
	ドイツ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	—	—	7,200	30
	小 計	—	—	7,200	30
	フランス				
	ICADE	4,417 (—)	148 (△28)	—	—
	ALTAREA	—	—	521 (—)	69 (0.31344)
	KLEPIERRE	25,191 (—)	571 (△81)	3,390	80
	GECINA SA	8,000	772	3,409	339
	COVIVIO (FP)	9,356	418	1,645	72
	MERCIALYS	21,221	178	—	—
	CARMILA	6,000 (—)	83 (△30)	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,327	834	5,183	246
	小 計	91,512 (—)	3,007 (△141)	14,148 (—)	807 (0.31344)
	オランダ				
	WERELDHAVE NV	8,823	128	5,117	71
	NSI NV	—	—	2,691	68
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,997	171	—	—
	小 計	16,820	300	7,808	139
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	26,172 (—)	142 (△8)	—	—
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	— (—)	— (△15)	—	—
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	42,822	342	—	—
	小 計	68,994 (—)	484 (△23)	—	—
	ベルギー				
	COFINIMMO	8,208	585	2,319	175

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	RETAIL ESTATES	2,210	120	—	—
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	5,697	78	—	—
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,705	798	3,000	79
	MONTEA NV	4,230	288	—	—
	AEDIFICA	9,180	532	(—)	(28)
	CARE PROPERTY INVEST	12,000	156	4,113	67
	CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	(10,887)	(—)	10,887	6
	AEDIFICA SA-RIGHTS	(20,737)	(28)	20,737	8
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,670	221	—	—
	小 計	80,900 (31,624)	2,781 (28)	41,056 (—)	338 (28)
	その他				
	CROMWELL REIT EUR	(—) (—)	(—) (△13)	—	—
	小 計	(—) (—)	(—) (△13)	—	—
	ユ ー ロ 計	258,226 (31,624)	6,573 (△148)	70,212 (—)	1,316 (29)
	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	129,650	451	20,138	63
	DERWENT LONDON PLC	16,649	347	3,000	64
	BIG YELLOW GROUP PLC	21,900	223	—	—
	HAMMERSON PLC	909,460	226	241,321	60
	WORKSPACE GROUP PLC	19,080	88	—	—
	UNITE GROUP PLC	74,278	695	30,484	273
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	174,230	164	—	—
	SHAFTESBURY PLC	(△139,823)	(△525)	—	—
	SEGRO PLC	183,936	1,355	23,590	182
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,460	667	21,309	126
	ASSURA PLC	505,423	239	120,000	59
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	110,000	51	136,908	71
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,583	228	14,378	62
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	—	—	135,000	61

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	HELICAL PLC	65,400	163	—	—
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	80,000	50	—	—
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	128,750	68	—	—
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	38,640	332	7,090	62
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	123,420	213	—	—
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	337,675 (469,245)	381 (525)	—	—
	WAREHOUSE REIT PLC	60,185	64	52,309	60
	NEWRIVER REIT PL	70,000	54	—	—
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	—	330,067	262
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	111	—	—
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	168,840	135	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	288,560	405	48,784	62
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	391,491	304	—	—
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	72,010	61	—	—
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	—	—	110,000	75
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	130	—	—
	LXI REIT PLC	335,710	320	119,999	110
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	73,230	78	—	—
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	80,000	73	67,062	69
	小 計	4,868,134 (329,422)	7,688 (—)	1,481,439	1,728
	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	94,560	336	31,619	115
	MIRVAC GROUP	580,488	1,227	70,000	157
	CHARTER HALL RETAIL REIT	67,470	228	—	—
	GPT GROUP	256,974	1,039	41,111	170
	CENTURIA CAPITAL GROUP	217,027	325	—	—
	ABACUS GROUP	120,145	127	—	—
	STOCKLAND	347,474	1,334	40,803	169
	DEXUS	156,893	1,155	14,931	118
	GOODMAN GROUP	257,879	5,286	41,786	824
	VICINITY CENTERS	517,712	946	79,179	146
	CHARTER HALL GROUP	65,454	685	10,617	119

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	53,150	215	—	—
	REGION RE GROUP	157,570	348	—	—
	ARENA REIT	31,370	118	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	101,860	298	35,000	108
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	89,730	337	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	302,130	703	30,000	74
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	25,000	88	40,179	125
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	70	138,903	105
	RURAL FUNDS GROUP	90,748	165	—	—
	SCENTRE GROUP	716,370	1,849	87,218	232
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	—	190,640	135
	HMC CAPITAL LTD	57,170	263	—	—
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	52,350	131	—	—
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	431,268	511	96,718	114
	HEALTHCO REIT	243,191	346	80,000	114
	ABACUS STORAGE KING	153,450 (194,329)	162 (—)	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	99,190	153	136,206	207
	WAYPOINT REIT LTD	69,640	156	—	—
	小 計	5,486,263 (194,329)	18,613 (—)	1,164,910	3,039
	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	240,000	286	—	—
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,000	138	241,387	490
	GOODMAN PROPERTY TRUST	157,325	327	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	180,000	153	—	—
	ARGOSY PROPERTY LTD	90,000	103	—	—
	STRIDE PROPERTY GROUP	—	—	300,000	380
	小 計	727,325	1,008	541,387	871
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	586,500	26,105	54,100	2,544
	PROSPERITY REIT	260,000	368	260,000	578
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	566,000	1,253	575,000	1,078
	CHAMPION REIT	422,000	1,273	—	—

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	FORTUNE REIT	270,000	1,472	—	—
	LINK REIT -RIGHTS	— (206,000)	— (—)	206,000	886
	小 計	2,104,500 (206,000)	30,472 (—)	1,095,100	5,089
	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	717,100 (—)	1,346 (△8)	60,000	120
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	677,100 (—)	1,841 (△36)	122,500	329
	SUNTEC REIT	265,600 (—)	320 (△9)	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	435,200 (—)	723 (△64)	—	—
	STARHILL GLOBAL REIT	200,000	95	186,400	97
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	606,100 (—)	607 (△20)	95,200	101
	KEPPEL REIT	242,000	211	—	—
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	172,200	364	—	—
	ESR-LOGOS REIT	1,188,200 (—)	361 (△11)	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	— (—)	— (△2)	—	—
	CAPITALAND CHINA TRUST	89,300 (—)	101 (△30)	—	—
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	— (—)	— (△6)	538,100	122
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	184,900 (—)	232 (△6)	—	—
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	70,700 (—)	263 (△7)	—	—
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	279,800 (—)	636 (△1)	—	—
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	343,900 (—)	516 (△10)	64,700	106
	PARAGON REIT	351,900	300	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	— (—)	— (△0.38454)	—	—
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	— (—)	— (△3)	1,273,644	270

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	330,300	198	156,100	102
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	— (—)	— (△17)	328,400	181
	KEPPEL DC REIT	171,900 (—)	352 (△15)	—	—
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	361,500 (—)	402 (△37)	—	—
	小 計	6,687,700 (—)	8,877 (△290)	2,825,044	1,432
	韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	—	—	42,950	171,252
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	—	—	13,200	65,553
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10,000	60,467	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	— (4,501)	— (19,702)	15,754	66,831
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	—	—	14,201	45,803
	JR REIT XXVII	19,000	76,455	—	—
	SK REITS CO LTD	22,000 (14,685)	90,561 (60,336)	— (—)	— (1,044)
	SHINHAN ALPHA REIT CO-RTS	— (6,670)	— (—)	6,670	1,085
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,000 (—)	74,010 (△166)	— (—)	— (1)
	D&D PLATFORM REIT CO LTD	—	—	— (—)	— (382)
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	— (—)	— (△779)	— (—)	— (389)
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	— (14,685)	— (—)	— (14,685)	— (331)
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	— (4,501)	— (—)	— (4,501)	— (483)
	小 計	72,000 (45,042)	301,496 (79,092)	92,775 (19,186)	350,526 (2,632)

(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	25,797	—	—	7,163	5	0.1
金 銭 信 託	0.525324	0.525324	100.0	0.525324	0.525324	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	21,604	2,183	10.1	21,587	2,198	10.2

(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。

### 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	70,288	93,284	8,822	1,336,036	1.3	
ALEXANDER'S INC	1,190	1,336	252	38,271	0.0	
BOSTON PROPERTIES	67,517	86,210	4,499	681,328	0.6	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	110,823	146,224	4,518	684,209	0.6	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	72,024	83,954	524	79,457	0.1	
AGREE REALTY CORP	37,791	58,082	3,303	500,279	0.5	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	81	12,356	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	30,439	38,074	1,165	176,425	0.2	
EPR PROPERTIES	35,511	44,397	1,982	300,183	0.3	
PROLOGIS INC	439,354	550,595	56,865	8,611,135	8.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,793	84,474	14,053	2,128,188	2.0	
LXP INDUSTRIAL TRUST	132,496	172,796	1,425	215,873	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	50,428	63,691	5,548	840,152	0.8	
VERIS RESIDENTIAL INC	37,510	48,670	676	102,444	0.1	
NNN REIT INC	83,841	109,365	4,179	632,966	0.6	
COUSINS PROPERTIES INC	71,685	89,515	1,652	250,230	0.2	
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	—	—	—	—	
SITE CENTERS CORP	88,151	106,484	1,357	205,592	0.2	
SAFEHOLD INC	40,416	27,084	449	68,123	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST	30,829	38,070	7,902	1,196,628	1.1	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	160,241	205,257	11,024	1,669,417	1.6	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,470	43,887	4,016	608,290	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	62,519	79,678	3,420	517,977	0.5	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	255,424	326,458	5,135	777,620	0.7	
EQUITY COMMONWEALTH	52,660	64,970	1,222	185,158	0.2	

※ 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	49,792	62,559	1,124	170,235	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	78,173	100,683	695	105,352	0.1
WELLTOWER INC	221,128	329,696	27,905	4,225,725	4.0
EASTGROUP PROPERTIES, INC	20,624	27,135	4,523	684,979	0.6
KIMCO REALTY CORP	292,774	368,258	6,518	987,045	0.9
KILROY REALTY CORPORATION	49,792	62,832	1,783	270,025	0.3
LTC PROPERTIES INC	19,175	25,125	792	119,961	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	116,800	235	35,727	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	104,507	397	60,136	0.1
IRON MOUNTAIN INC	137,603	173,734	10,227	1,548,783	1.5
MACERICH CO/THE	101,670	127,260	1,266	191,746	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	82,800	110,558	7,185	1,088,049	1.0
ACADIA REALTY TRUST	47,870	56,767	804	121,808	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	338,412	422,565	6,866	1,039,821	1.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	54,646	69,921	8,375	1,268,247	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,550	19,211	190	28,858	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	21,139	25,669	1,290	195,480	0.2
CENTERSPACE	7,349	8,999	459	69,634	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	8,599	158	24,024	0.0
GETTY REALTY CORP	20,690	27,420	752	113,936	0.1
RPT REALTY	43,950	48,173	513	77,690	0.1
REALTY INCOME CORP	294,425	423,162	21,230	3,214,864	3.0
REGENCY CENTERS CORP	72,902	98,033	5,824	881,949	0.8
UDR INC	144,582	180,055	5,759	872,230	0.8
COPT DEFENSE PROPERTIES	53,219	66,436	1,563	236,821	0.2
SAUL CENTERS INC	6,800	6,846	238	36,087	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	156,090	195,279	22,220	3,364,895	3.2
LIFE STORAGE INC	39,946	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	75,268	94,419	23,284	3,525,997	3.3
SUN COMMUNITIES INC	58,379	73,816	8,443	1,278,646	1.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,407	62,168	1,493	226,220	0.2
UMH PROPERTIES INC	25,129	33,009	478	72,429	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	26,942	318	48,182	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,793	7,811	305	46,307	0.0
VENTAS INC	189,214	239,543	10,079	1,526,409	1.4
VORNADO REALTY TRUST	76,257	94,277	1,927	291,808	0.3
ELME COMMUNITIES	41,374	55,407	725	109,912	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	103,723	133,039	2,748	416,218	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,891	125,689	14,843	2,247,807	2.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	45,973	98	14,967	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,505	124,355	1,177	178,330	0.2
CUBESMART	106,251	134,302	4,915	744,347	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	137,142	180,630	23,050	3,490,490	3.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	99,846	124,486	1,004	152,126	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	283,552	352,832	1,637	247,912	0.2
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	83,212	98,752	1,110	168,232	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)	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	58,955	74,955	891	135,070	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	75,292	420	63,620	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	67,550	399	60,453	0.1
TERRENO REALTY CORP	31,471	49,321	2,664	403,532	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,331	29,232	538	81,538	0.1
RLJ LODGING TRUST	77,042	93,642	919	139,249	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	127,511	152,283	3,823	579,041	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,226	71,638	833	126,163	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	22,938	108	16,499	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,562	241	36,502	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	109,335	136,268	1,858	281,462	0.3
WHITESTONE REIT	23,074	31,954	328	49,791	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	76,753	412	62,530	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	84,837	108,041	3,709	561,661	0.5
WP CAREY INC	98,249	127,017	6,894	1,044,031	1.0
ALEXANDER & BALDWIN INC	36,712	43,393	686	103,953	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15,061	21,491	292	44,324	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	180,143	229,675	3,275	495,958	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,109	36,095	3,326	503,679	0.5
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	41,231	416	63,122	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,541	85,476	3,266	494,705	0.5
PHYSICIANS REALTY TRUST	107,135	140,705	1,549	234,589	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	80,979	123,217	5,488	831,060	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	143,210	188,879	6,512	986,195	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	105,006	132,286	1,703	258,013	0.2
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,242	16,592	1,246	188,766	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	47,111	56,141	744	112,813	0.1
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	—	—	—	—
UNITI GROUP INC	—	142,940	683	103,465	0.1
INVITATION HOMES INC	274,483	342,404	10,686	1,618,245	1.5
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	342,700	83	12,714	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	68,118	77,843	652	98,781	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,286	21,712	451	68,321	0.1
SAFEHOLD INC	8,335	—	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	66,851	91,911	2,073	313,991	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	33,166	90	13,710	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	120,938	155,899	7,013	1,062,114	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	141,856	180,627	3,766	570,296	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	28,700	59	8,996	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	0.00002	0.003	0.0
PRIME US REIT	295,000	295,000	39	5,986	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	13,280	180	27,349	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	5,700	85	12,955	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	31,919	40,139	972	147,215	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	28,000	305	46,216	0.0
CITY OFFICE REIT INC	25,050	15,298	64	9,799	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)		
ORION OFFICE REIT INC	30,374	34,844	174	26,487	0.0	
NETSTREIT CORP	23,831	41,060	621	94,136	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	17,000	33	5,122	0.0	
CARETRUST REIT INC	45,932	58,902	1,265	191,680	0.2	
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	19,000	262	39,733	0.0	
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	—	—	—	—	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	55,243	69,083	2,276	344,802	0.3	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	—	—	—	—	
APARTMENT INCOME REIT CO	72,989	87,719	2,559	387,606	0.4	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	81,949	110,537	1,585	240,031	0.2	
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	12,400	201	30,531	0.0	
STAR HOLDINGS	—	6,183	69	10,449	0.0	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	15,737	336	50,973	0.0	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	368,800	193	29,319	0.0	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	—	8,467	107	16,270	0.0	
STORE CAPITAL CORP	125,789	—	—	—	—	
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	100,128	426	64,591	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	37,791	343	51,962	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	55,595	69,794	1,118	169,419	0.2	
EQUINIX INC	43,383	55,772	42,219	6,393,368	6.1	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	42,991	57,181	614	93,083	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,132	64,012	752	113,993	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	13,856	406	61,624	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,398	48,998	1,492	226,080	0.2	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	14,980	385	58,343	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	100,761	125,391	1,956	296,212	0.3	
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	115,311	921	139,517	0.1	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	—	15,669	124	18,815	0.0	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	35	5,361	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	835,164	65	9,864	0.0	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	106,435	127,396	1,658	251,176	0.2	
VICI PROPERTIES INC	459,464	602,621	16,939	2,565,175	2.4	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	38,562	53,622	1,170	177,259	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	12,568,769	15,403,951	540,713	81,880,308	
	銘 柄 数 < 比 率 >	145	143	—	< 77.6 % >	
(カナダ)			千カナダドル			
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	30,663	43,154	991	108,737	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	39,175	49,930	2,216	243,082	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	76,841	680	74,650	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,377	90,439	1,564	171,557	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	37,679	617	67,674	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	5,339	43	4,818	0.0	
PRIMARIS REIT	28,309	30,375	407	44,663	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,047	13,593	902	98,937	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	30,330	187	20,552	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	26,577	354	38,875	0.0	

銘柄	当期中(前期末)		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)		
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	42,842	507	55,619	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,099	58,872	267	29,307	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	6,956	93	10,197	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	—	—	—	—	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	59,149	73,332	886	97,213	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	20,000	58	6,425	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	39,728	—	—	—	—	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,334	19,135	1,238	135,855	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	25,800	37	4,102	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	76,025	100,975	1,290	141,498	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	11,100	156	17,124	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	27,730	376	41,230	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	—	—	—	—	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	16,000	71	7,807	0.0	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	9,500	139	15,333	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,695	66,348	906	99,377	0.1	
SLATE GROCERY REIT	17,300	16,578	174	19,104	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	16,015	109	11,993	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	—	—	—	—	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	—	—	—	—	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	21,900	35,647	598	65,666	0.1	
小計	口数・金額	901,473	951,087	14,878	1,631,407	
	銘柄数<比率>	31	26	—	<1.5%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	37,000	37,000	249	40,230	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	—	—	—	—	
小計	口数・金額	44,200	37,000	249	40,230	
	銘柄数<比率>	2	1	—	<0.0%>	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	72	11,791	0.0	
小計	口数・金額	33,790	33,790	72	11,791	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	15,570	19,987	639	103,331	0.1	
ALTAREA	2,480	1,959	138	22,407	0.0	
KLEPIERRE	92,974	114,775	2,598	419,814	0.4	
GECINA SA	25,736	30,327	2,962	478,693	0.5	
COVIVIO(FP)	21,972	29,683	1,281	206,977	0.2	
MERCIALYS	36,384	57,605	474	76,733	0.1	
CARMILA	26,392	32,392	461	74,521	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	49,378	61,522	3,131	505,920	0.5	
小計	口数・金額	270,886	348,250	11,688	1,888,400	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<1.8%>	
(オランダ)				千ユーロ		
VASTNED RETAIL	10,650	10,650	207	33,448	0.0	
WERELDHAVE NV	22,670	26,376	393	63,578	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)		
NSI NV	10,050	7,359	129	20,972	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,493	25,490	557	90,023	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	60,863	69,875	1,287	208,023	
		4	4	—	<0.2%>	
(スペイン)			千ユーロ			
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,272	167,444	944	152,574	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	34,000	194	31,420	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	157,888	200,710	1,707	275,789	0.3	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	333,160	402,154	2,845	459,784	
		3	3	—	<0.4%>	
(ベルギー)			千ユーロ			
COFINIMMO	14,199	20,088	1,266	204,623	0.2	
RETAIL ESTATES	5,335	7,545	475	76,795	0.1	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	17,797	359	58,080	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	66,064	94,769	2,348	379,403	0.4	
MONTEA NV	4,970	9,200	639	103,301	0.1	
AEDIFICA	18,867	28,047	1,618	261,454	0.2	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	22,887	290	46,959	0.0	
XIOR STUDENT HOUSING NV	9,813	17,483	541	87,561	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	146,348	217,816	7,540	1,218,179	
		8	8	—	<1.2%>	
(アイルランド)			千ユーロ			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	210,000	207	33,588	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	210,000	210,000	207	33,588	
		1	1	—	<0.0%>	
(その他)			千ユーロ			
CROMWELL REIT EUR	170,400	170,400	207	33,586	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	170,400	170,400	207	33,586	
		1	1	—	<0.0%>	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,269,647	1,489,285	24,099	3,893,583	
		28	27	—	<3.7%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	446,042	555,554	1,742	322,449	0.3	
DERWENT LONDON PLC	53,156	66,805	1,368	253,220	0.2	
BIG YELLOW GROUP PLC	82,773	104,673	1,099	203,415	0.2	
HAMMERSON PLC	1,673,646	2,341,785	571	105,840	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	65,316	84,396	474	87,862	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,715	0.0	
UNITE GROUP PLC	190,394	234,188	2,248	416,097	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	630,955	805,185	772	142,913	0.1	
SHAFTESBURY PLC	139,823	—	—	—	—	
SEGRO PLC	572,354	732,700	5,697	1,054,488	1.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	355,654	442,805	2,665	493,365	0.5	
ASSURA PLC	1,400,809	1,786,232	801	148,371	0.1	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	233,848	110	20,385	0.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	109,600	143,805	589	109,016	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)		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	215,000	90	16,752	0.0	
HELICAL PLC	—	65,400	136	25,237	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	348,000	226	41,865	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	534,722	307	57,004	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	98,896	130,446	986	182,520	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	464,236	587,656	1,037	191,967	0.2	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	378,400	244	45,172	0.0	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	354,157	1,161,077	1,354	250,779	0.2	
WAREHOUSE REIT PLC	230,000	237,876	192	35,573	0.0	
NEWRIVER REIT PL	126,000	196,000	156	29,020	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	—	—	—	—	
PRS REIT PLC/THE	260,002	260,002	210	38,978	0.0	
CLS HOLDINGS PLC	—	75,636	69	12,836	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	203,286	118	21,897	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	589,189	758,029	601	111,395	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	888,708	1,128,484	1,659	307,232	0.3	
CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	234,276	203	37,723	0.0	
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	—	391,491	312	57,748	0.1	
HOME REIT PLC	374,236	374,236	142	26,354	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	378,010	347	64,365	0.1	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	—	—	—	—	
LIFE SCIENCE REIT PLC	—	176,938	119	22,202	0.0	
AEW UK REIT PLC	68,000	68,000	65	12,031	0.0	
LXI REIT PLC	811,588	1,027,299	968	179,294	0.2	
REGIONAL REIT LTD	222,000	222,000	63	11,730	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	296,651	350	64,786	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	229,355	242,293	202	37,444	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,029,027	17,745,144	28,317	5,241,057	
	銘 柄 数 < 比 率 >	37	38	—	< 5.0 % >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST	228,066	291,007	992	95,492	0.1	
MIRVAC GROUP	1,867,868	2,378,356	4,697	452,016	0.4	
CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	669,440	251	24,157	0.0	
CHARTER HALL RETAIL REIT	244,874	312,344	1,011	97,384	0.1	
GPT GROUP	906,785	1,122,648	4,389	422,406	0.4	
CENTURIA CAPITAL GROUP	274,928	491,955	617	59,412	0.1	
ABACUS GROUP	194,329	314,474	319	30,715	0.0	
STOCKLAND	1,130,026	1,436,697	5,516	530,892	0.5	
DEXUS	509,145	651,107	4,557	438,592	0.4	
GOODMAN GROUP	804,776	1,020,869	22,938	2,207,412	2.1	
VICINITY CENTERS	1,831,690	2,270,223	4,075	392,142	0.4	
CHARTER HALL GROUP	223,905	278,742	2,781	267,696	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	138,810	309	29,787	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	226,796	927	89,262	0.1	
REGION RE GROUP	528,421	685,991	1,447	139,287	0.1	
ARENA REIT	161,278	192,648	645	62,104	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)		
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	255,476	322,336	957	92,124	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	286,964	376,694	1,243	119,622	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	113,000	291	28,054	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	473,590	745,720	1,573	151,414	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	102,706	283	27,278	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	324,500	315,597	173	16,703	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	181,331	272,079	510	49,091	0.0	
SCENTRE GROUP	2,456,991	3,086,143	7,931	763,237	0.7	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	—	—	—	—	
HMC CAPITAL LTD	92,191	149,361	699	67,265	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	210,134	540	51,968	0.0	
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	734,103	1,068,653	1,202	115,691	0.1	
HEALTHCO REIT	137,130	300,321	411	39,592	0.0	
ABACUS STORAGE KING	—	347,779	363	34,972	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	240,945	203,929	250	24,137	0.0	
WAYPOINT REIT LTD	336,956	406,596	943	90,774	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	15,987,473	20,503,155	72,853	7,010,694	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 6.6% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AMP NZ OFFICE LTD	556,295	796,295	911	81,337	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	181,387	—	—	—	—	
GOODMAN PROPERTY TRUST	498,199	655,524	1,337	119,297	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	923,753	762	67,986	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	507,278	558	49,779	0.0	
STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,696,912	2,882,850	3,569	318,401	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	4	—	< 0.3% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	997,800	1,530,200	60,442	1,171,987	1.1	
PROSPERITY REIT	752,000	752,000	1,007	19,538	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	1,306,660	1,476	28,629	0.0	
CHAMPION REIT	745,000	1,167,000	2,894	56,117	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	561,000	1,155	22,408	0.0	
FORTUNE REIT	605,000	875,000	3,998	77,535	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,976,460	6,191,860	70,975	1,376,218	
	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	2,383,544	3,040,644	5,533	616,152	0.6	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,581,818	2,136,418	5,832	649,381	0.6	
SUNTEC REIT	1,060,900	1,326,500	1,472	163,938	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,523,285	1,958,485	3,055	340,170	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	849,400	863,000	409	45,641	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	847,977	1,358,877	1,216	135,411	0.1	
KEPPEL REIT	936,300	1,178,300	948	105,609	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	469,862	642,062	1,341	149,408	0.1	
ESR-LOGOS REIT	2,418,564	3,606,764	973	108,425	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)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	397,900	387	43,194	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	553,921	643,221	498	55,502	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	—	—	—	—	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	459,900	574	64,006	0.1	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	163,200	233,900	806	89,846	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	941,863	1,221,663	2,675	297,883	0.3	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,090,073	1,369,273	1,848	205,814	0.2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	540,000	329	36,675	0.0	
PARAGON REIT	409,600	761,500	609	67,828	0.1	
EC WORLD REIT	180,000	180,000	46	5,200	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	295,800	199	22,230	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	—	—	—	—	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	883,950	1,058,150	581	64,797	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	—	—	—	—	
KEPPEL DC REIT	626,303	798,203	1,436	159,969	0.2	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,364,796	1,726,296	1,812	201,816	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	21,934,200	25,796,856	32,592	3,628,904	
	銘 柄 数<比 率>	25	22	—	<3.4%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	—	—	—	—	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	—	—	—	—	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	46,380	289,411	33,311	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	—	—	—	—	
LOTTE REIT CO LTD	72,480	72,480	221,064	25,444	0.0	
KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	25,433	138,101	15,895	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	—	—	—	—	
JR REIT XXVII	76,683	95,683	387,516	44,603	0.0	
SK REITS CO LTD	39,229	75,914	299,860	34,513	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	102,340	341,815	39,342	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	28,240	84,720	9,751	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	14,949	50,452	5,807	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	456,338	461,419	1,812,941	208,669	
	銘 柄 数<比 率>	12	8	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD	103,500	103,500	1,592	62,676	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	115,000	885	34,842	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	360,000	529	20,823	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	578,500	578,500	3,007	118,341	
	銘 柄 数<比 率>	3	3	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	75,398,799	92,004,107	—	105,307,588	
	銘 柄 数<比 率>	324	308	—	<99.7%>	

(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	105,307,588	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	672,617	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	105,980,205	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(105,580,274千円)の投資信託財産総額(105,980,205千円)に対する比率は99.6%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=151.43円	1カナダドル=109.65円	1ユーロ=161.56円
1イギリスポンド=185.08円	1オーストラリアドル=96.23円	1ニュージーランドドル=89.21円
1香港ドル=19.39円	1シンガポールドル=111.34円	1韓国ウォン=0.1151円
1イスラエルシェケル=39.3481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 2023年11月10日現在
(A)資 産	105,980,205,739円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	537,071,979
投 資 証 券(評価額)	105,307,588,300
未 収 入 金	3,605,255
未 収 配 当 金	131,940,205
(B)負 債	400,172,240
未 払 金	269,166,320
未 払 解 約 金	131,005,839
未 払 利 息	80
そ の 他 未 払 費 用	1
(C)純 資 産 総 額(A-B)	105,580,033,499
元 本	42,440,513,111
次 期 繰 越 損 益 金	63,139,520,388
(D)受 益 権 総 口 数	42,440,513,111口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,877円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配 当 等 収 益	3,780,759,271円
受 取 配 当 金	3,767,102,940
受 取 利 息	13,702,551
そ の 他 収 益 金	3,802
支 払 利 息	△50,022
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,333,019,067
売 買 益	9,018,650,058
売 買 損	△10,351,669,125
(C)そ の 他 費 用	△35,275,760
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	2,412,464,444
(E)前 期 繰 越 損 益 金	49,916,887,937
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	16,210,411,963
(G)解 約 差 損 益 金	△5,400,243,956
(H) 計 (D+E+F+G)	63,139,520,388
次 期 繰 越 損 益 金(H)	63,139,520,388

- (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34,643,734,497円、期中追加設定元本額は11,402,252,400円、期中一部解約元本額は3,605,473,786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)	19,405,996,820円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,247,254,798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)	1,622,820,631円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,580,923,198円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,382,411,427円
分散投資コア戦略ファンドA	1,038,546,021円
コア投資戦略ファンド(切替型)	589,093,366円
コア投資戦略ファンド(安定型)	515,173,421円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	444,030,757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)	239,927,885円
グローバル経済コア	237,253,600円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	176,477,358円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	170,480,212円
SMT インデックスバランス・オープン	111,160,303円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	109,346,956円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	95,120,470円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	92,963,651円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	92,682,971円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	92,598,015円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	92,211,639円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	91,680,030円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	79,974,585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)	79,493,312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)	63,295,249円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	59,598,092円
グローバル3資産バランスオープン	55,090,495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)	50,693,016円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,438,228円
10資産分散投資ファンド	12,808,800円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,945,768円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,828,344円
グローバル10資産バランスファンド	2,324,119円

## お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)

# 新興国REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第10期（決算日 2024年10月21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2014年11月28日から無期限です。
運用方針	新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）に上場している不動産投資信託証券に投資し、S&P新興国REIT指数（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	新興国の金融商品取引所等（これに準ずるものを含みます。）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		投信証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第6期(2020年10月20日)	4,591	△40.4	4,914	△40.2	95.9	百万円 324
第7期(2021年10月20日)	6,529	42.2	6,973	41.9	98.2	482
第8期(2022年10月20日)	7,516	15.1	8,201	17.6	97.5	516
第9期(2023年10月20日)	7,785	3.6	8,634	5.3	97.6	501
第10期(2024年10月21日)	9,295	19.4	10,664	23.5	98.3	559

ベンチマークは、S&P新興国REIT指数（配当込み、円換算ベース）です。

S&P新興国REIT指数とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJ」）が公表する指数で、新興国に上場する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。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「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。

S&P新興国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「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。

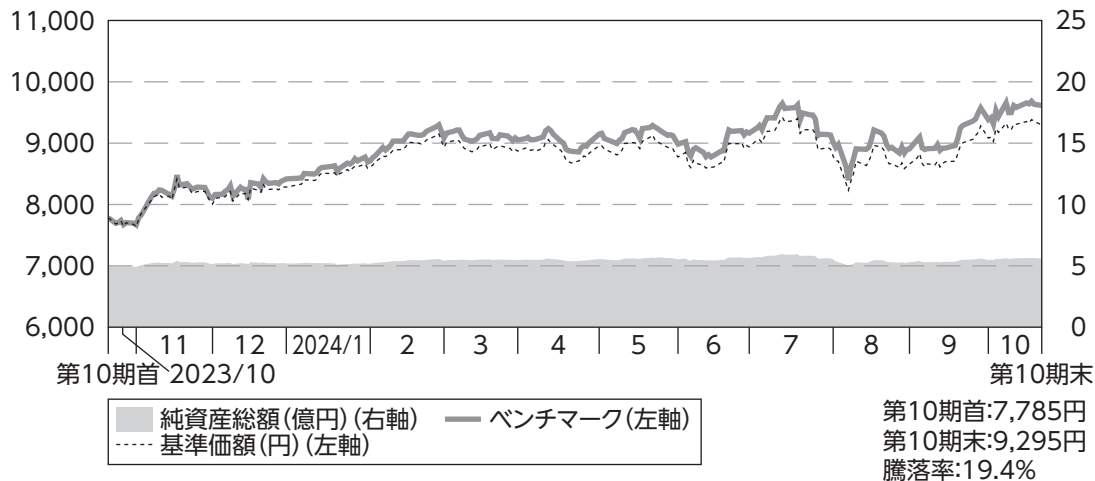
## 当期中の基準価額と市況の推移

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 %		騰 落 率 %	
(当 期 首) 2023年10月20日	7,785	—	8,634	—	97.6
10月末	7,639	△1.9	8,502	△1.5	97.5
11月末	8,007	2.9	8,986	4.1	97.3
12月末	8,283	6.4	9,334	8.1	98.8
2024年 1月末	8,613	10.6	9,660	11.9	98.3
2月末	8,933	14.7	10,074	16.7	97.2
3月末	8,871	13.9	10,038	16.3	97.6
4月末	8,957	15.1	10,145	17.5	96.7
5月末	8,774	12.7	9,963	15.4	94.6
6月末	8,938	14.8	10,163	17.7	98.1
7月末	8,784	12.8	9,994	15.8	96.6
8月末	8,657	11.2	9,876	14.4	96.6
9月末	9,083	16.7	10,405	20.5	98.4
(当 期 末) 2024年10月21日	9,295	19.4	10,664	23.5	98.3

(注) 騰落率は期首比です。

## 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、2023年10月20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新興国REIT指数(配当込み、円換算ベース)の動きを概ね反映して、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



新興国REIT市場は上昇しました。南アフリカREIT市場は、長期金利が低下基調となったことや南アフリカ準備銀行による利下げなどが好感されて大きく上昇しました。メキシコREIT市場は、メキシコ中央銀行のハト派的な姿勢が好感されたことや主要REITの好業績への期待などから2024年2月にかけて上昇しましたが、その後は上値の重い展開となりました。インドREIT市場は、インド株式市場が過去最高値を更新して堅調に推移する中、主要なオフィスREITの底堅い決算などが好感されて上昇しました。タイREIT市場は、2024年4-6月期の実質GDP(国内総生産)成長率が市場予想を上回ったことなどから上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるS&P新興国REIT指数(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

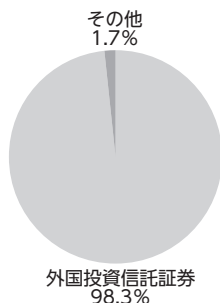
### ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	インド	10.4%
2	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	メキシコ	8.4%
3	PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	メキシコ	8.3%
4	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	南アフリカ	6.6%
5	REDEFINE PROPERTIES LTD	南アフリカ	5.1%
6	NEXUS SELECT TRUST	インド	3.8%

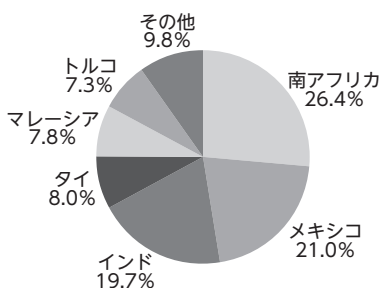
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	メキシコ	3.2%
8	VUKILE PROPERTY FUND LTD	南アフリカ	2.7%
9	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	インド	2.6%
10	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	インド	2.5%
組入銘柄数		62	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

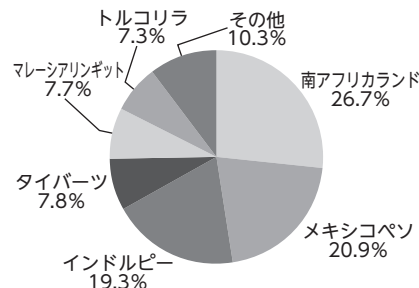
### ○資産別配分



### ○国別配分



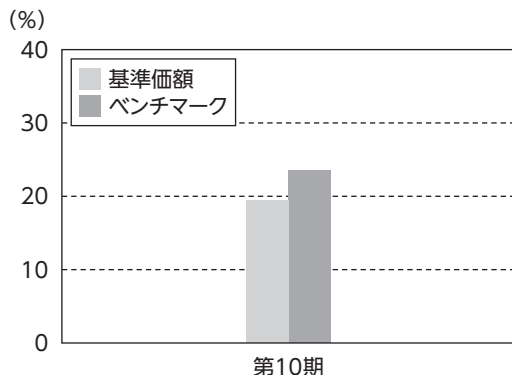
### ○通貨別配分



(注)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ベンチマーク騰落率を下回りました。

差異の主な要因は、為替評価差要因※1、配当課税要因※2、取引コスト要因、キャッシュ要因(いずれもマイナス要因)などです。

※1 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です。

※2 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

主として、新興国の金融商品取引所等(これに準ずるものを含みます。)に上場している不動産投資信託証券に投資し、S&P新興国REIT指数(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
	(2023年10月21日~2024年10月21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)	3円 (-) (-) (-) (3) (-) (-)	0.030% (-) (-) (-) (0.030) (-) (-)	(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)	2 (-) (-) (-) (-) (2)	0.022 (-) (-) (-) (-) (0.022)	(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)	92  (92)  (-) (0)	1.070  (1.069)  (-) (0.001)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	97	1.122	

(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(8,628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
外 国				
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	12,800	311	53,400	1,522
MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	3,600 (3,241)	111 (108)	13,700	444
PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	3,300	126	73,300	2,662
PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	34,000 (1,313)	2,293 (-)	9,900	729
小 計	53,700 (4,554)	2,843 (108)	150,300	5,359
トルコ	口	千トルコリラ	口	千トルコリラ
IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	-	-	5,200	107
REYSAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	3,000 (48,000)	149 (-)	15,000	216
AKFEN GAYRIMENKUL YATIRIM OR	114,000	219	-	-
TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	-	-	2,280	72
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	32,120	347	39,880	351
OZAK GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	-	-	9,000	93
AKIS GAYRIMENKUL YATIRIMI AS	6,000 (78,000)	103 (-)	9,000	111
SERVET GAYRIMENKUL YATIRIM O	450	165	220	75
YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	-	-	2,940	114
PEKER GAYRIMENKUL YATIRIM OR	-	-	39,500	335
ROENESANS GAYRIMENKUL YATIRI	3,900	445	-	-
KIZILBUK GAYRIMENKUL YATIRIM	-	-	3,000	85
AVRUPAKENT GAYRIMENKUL YATIR	8,870	389	-	-
ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	-	-	17,580	80
PASIFIK GAYRIMENKUL YATIRIM	77,000 (84,780)	122 (-)	16,000	85
ASCE GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	19,000	283	19,000	225
AKFEN GAYRIMENKUL YATIRIM RTS	- (65,000)	- (-)	65,000	119
小 計	264,340 (275,780)	2,227 (-)	243,600	2,076
香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	20,000	22	92,000	110

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	—	—	8,000	21
	小 計	20,000	22	100,000	131
	マレーシア	口	千マレーシアリンギット	口	千マレーシアリンギット
	AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,500	15	51,500	91
	YTL HOSPITALITY REIT	75,000	90	—	—
	CAPITALAND MALAYSIA TRUST	155,000	107	—	—
	SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	11,700	18	41,900	65
	PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	15,000	18
	IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	10,100	18	59,300	111
	小 計	260,300	250	167,700	288
	タイ	口	千タイバーツ	口	千タイバーツ
	LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	10,000	117	41,400	553
	CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	87,000 (—)	899 (△29)	49,700	569
	IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	—	—	11,300	140
	WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	—	—	20,500	196
	FRASERS PROPERTY THAILAND IN	98,000	1,033	103,900	880
	小 計	195,000 (—)	2,049 (△29)	226,800	2,340
	フィリピン	口	千フィリピンペソ	口	千フィリピンペソ
	RL COMMERCIAL REIT INC	50,000	290	69,000	324
	MREIT INC	20,000	275	18,000	226
	CITICORE ENERGY REIT CORP	250,000	763	303,000	793
	AREIT INC	30,800	1,035	13,000	452
	小 計	350,800	2,364	403,000	1,797
	インド	口	千インドルピー	口	千インドルピー
	EMBASSY OFFICE PARKS REIT	22,500 (—)	7,991 (△856)	10,940	3,819
	BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	2,500 (—)	707 (△236)	1,500	367
	MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	1,300 (—)	439 (△34)	5,170	1,691
	NEXUS SELECT TRUST	92,080 (—)	12,478 (△75)	9,170	1,272
	小 計	118,380 (—)	21,617 (△1,203)	26,780	7,150
	南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
	REDEFINE PROPERTIES LTD	30,710	123	141,150	550
	EMIRA PROPERTY FUND LTD	—	—	23,614	252

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	—	—	25,020	54
	VUKILE PROPERTY FUND LTD	17,090	285	16,070	236
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	16,490	196	62,500	712
	BURSTONE GROUP LIMITED	—	—	11,420	82
	FAIRVEST LTD-B	—	—	21,000	71
	ATTACQ LTD	—	—	14,380	164
	RESILIENT REIT LTD	1,500	71	5,990	270
	EQUITES PROPERTY FUND LTD	6,100	77	14,330	192
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	2,000	61	5,420	168
	STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	4,000	54	11,150	157
	小 計	77,890	871	352,044	2,912
	サウジアラビア	口	千サウジアラビリアル	口	千サウジアラビリアル
	RIYAD REIT FUND	—	—	1,700	14
	MUSHARAKA REIT FUND	—	—	2,290	12
	AL RAJHI REIT	12,600	110	4,250	37
	BONYAN REIT	—	—	1,460	13
	AL MAATHER REIT FUND	1,300	11	—	—
	MULKIA GULF REAL ESTATE REIT	7,100	40	—	—
	SEDCO CAPITAL REIT FUND	5,000	43	—	—
	DERAYAH REIT	—	—	1,560	12
	ALINMA RETAIL REIT FUND	—	—	3,000	14
	小 計	26,000	206	14,260	105

(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	180	12	6.7	216	40	18.5
金 銭 信 託	0.012903	0.012903	100.0	0.012903	0.012903	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	485	55	11.3	488	55	11.3

(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		比 率 (%)
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
<b>(メキシコ)</b>					
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	309,200	268,600	千メキシコペソ 6,250	46,976	8.4
MACQUARIE MEXICO REAL ESTATE	80,200	73,341	2,382	17,909	3.2
PLA ADMINISTRADORA INDUSTRIA	85,700	15,700	602	4,530	0.8
PROLOGIS PROPERTY MEXICO SA	64,800	90,213	6,148	46,207	8.3
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	539,900 4	447,854 4	15,383 —	115,623 <20.7%>
<b>(トルコ)</b>					
IS GAYRIMENKUL YATIRIM ORTAK	51,071	45,871	千トルコリラ 714	3,124	0.6
SINPAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	76,700	76,700	569	2,489	0.4
REYSAS GAYRIMENKUL YATIRIM O	16,000	52,000	572	2,502	0.4
AKFEN GAYRIMENKUL YATIRIM OR	65,000	179,000	329	1,440	0.3
TORUNLAR GAYRIMENKUL YATIRIM	16,000	13,720	628	2,748	0.5
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	191,362	183,602	1,791	7,838	1.4
OZAK GAYRIMENKUL YATIRIM ORT	43,000	34,000	313	1,371	0.2
AKIS GAYRIMENKUL YATIRIMI AS	42,000	117,000	685	2,999	0.5
SERVET GAYRIMENKUL YATIRIM O	1,140	1,370	385	1,686	0.3
YENI GIMAT GAYRIMENKUL ORTAK	22,138	19,198	1,066	4,664	0.8
PEKER GAYRIMENKUL YATIRIM OR	39,500	—	—	—	—
ROENESANS GAYRIMENKUL YATIRI	—	3,900	401	1,757	0.3
KIZILBUK GAYRIMENKUL YATIRIM	12,000	9,000	269	1,180	0.2
AVRUPAKENT GAYRIMENKUL YATIR	—	8,870	388	1,700	0.3
ZIRAAT GAYRIMENKUL YATIRIM O	104,000	86,420	864	3,780	0.7
PASIFIK GAYRIMENKUL YATIRIM	60,000	205,780	255	1,116	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	739,911 14	1,036,431 15	9,235 —	40,399 <7.2%>
<b>(香港)</b>					
CHINA MERCHANTS COMMERCIAL R	72,000	—	千香港ドル —	—	—
SF REAL ESTATE INVESTMENT TR	58,000	50,000	154	2,971	0.5
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	130,000 2	50,000 1	154 —	2,971 <0.5%>
<b>(マレーシア)</b>					
AXIS REAL ESTATE INVESTMENT	176,500	133,500	千マレーシアリンギット 240	8,337	1.5
YTL HOSPITALITY REIT	—	75,000	88	3,070	0.5
CAPITALAND MALAYSIA TRUST	—	155,000	107	3,737	0.7
SUNWAY REAL ESTATE INVESTMENT	223,000	192,800	345	11,973	2.1
PAVILION REAL ESTATE INVESTMENT	122,700	107,700	159	5,530	1.0
IGB REAL ESTATE INVESTMENT T	183,000	133,800	290	10,073	1.8
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	705,200 4	797,800 6	1,231 —	42,721 <7.6%>
<b>(タイ)</b>					
LOTUS'S RETAIL GROWTH FREEHO	174,000	142,600	千タイバーツ 1,967	8,875	1.6
CPN RETAIL GROWTH LEASEHOLD	185,500	222,800	2,807	12,660	2.3
BA AIRPORT LEASEHOLD REIT	78,300	78,300	775	3,496	0.6
IMPACT GROWTH REAL ESTATE IN	71,500	60,200	734	3,312	0.6
WHA PREMIUM GROWTH FREEHOLD	181,300	160,800	1,704	7,687	1.4

銘柄	当期末(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)	
FRASERS PROPERTY THAILAND IN	164,600	158,700	1,729	7,801	1.4
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	855,200 6	823,400 6	9,719 —	43,833 <7.8%>
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
RL COMMERCIAL REIT INC	431,700	412,700	2,480	6,444	1.2
MREIT INC	106,000	108,000	1,501	3,900	0.7
CITICORE ENERGY REIT CORP	303,000	250,000	765	1,987	0.4
AREIT INC	72,520	90,320	3,522	9,152	1.6
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	913,220 4	861,020 4	8,269 —	21,485 <3.8%>
(インド)			千インドルピー		
EMBASSY OFFICE PARKS REIT	71,839	83,399	32,598	58,350	10.4
BROOKFIELD INDIA REAL ESTATE	26,651	27,651	8,071	14,448	2.6
MINDSPACE BUSINESS PARKS REI	24,792	20,922	7,745	13,864	2.5
NEXUS SELECT TRUST	—	82,910	11,952	21,394	3.8
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	123,282 3	214,882 4	60,367 —	108,058 <19.3%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
REDEFINE PROPERTIES LTD	784,627	674,187	3,337	28,299	5.1
EMIRA PROPERTY FUND LTD	23,614	—	—	—	—
SA CORPORATE REAL ESTATE FUN	275,044	250,024	702	5,957	1.1
VUKILE PROPERTY FUND LTD	96,165	97,185	1,812	15,370	2.7
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	375,593	329,583	4,373	37,087	6.6
BURSTONE GROUP LIMITED	70,263	58,843	563	4,775	0.9
FAIRVEST LTD-B	150,040	129,040	606	5,143	0.9
ATTACQ LTD	81,466	67,086	872	7,395	1.3
RESILIENT REIT LTD	32,432	27,942	1,569	13,309	2.4
EQUITES PROPERTY FUND LTD	85,527	77,297	1,140	9,668	1.7
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	39,395	35,975	1,519	12,886	2.3
STOR-AGE PROPERTY REIT LTD	48,877	41,727	622	5,282	0.9
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	2,063,043 12	1,788,889 11	17,119 —	145,175 <26.0%>
(サウジアラビア)			千サウジアラビアリアル		
RIYAD REIT FUND	13,266	11,566	76	3,041	0.5
MUSHARAKA REIT FUND	8,654	6,364	32	1,293	0.2
AL RAJHI REIT	13,464	21,814	185	7,388	1.3
BONYAN REIT	7,800	6,340	57	2,306	0.4
AL MAATHER REIT FUND	3,945	5,245	46	1,868	0.3
MULKIA GULF REAL ESTATE REIT	—	7,100	39	1,564	0.3
SEDCO CAPITAL REIT FUND	9,489	14,489	116	4,659	0.8
ALAHLI REIT FUND 1	4,800	4,800	35	1,396	0.2
DERAYAH REIT	11,621	10,061	62	2,481	0.4
ALINMA RETAIL REIT FUND	10,174	7,174	35	1,400	0.3
ALKHABEER REIT	8,225	8,225	50	1,992	0.4
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	91,438 10	103,178 11	737 —	29,395 <5.3%>
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数<比 率>	6,161,194 59	6,123,454 62	—	549,663 <9.3%>

(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) 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。

※純資産総額の10%を超える不動産投資信託証券の内容

■EMBASSY OFFICE PARKS REIT(当期末組入比率10.4%)

①投資法人の目的及び基本的性格

主としてインドのオフィス用不動産等の運営を通じて、配当と純資産価値を最大化することを目指します。

②開示されている直近決算期における投資口1口当たりの資産運用報酬等

投資信託の資産運用報酬等に相当する詳細な開示がないため、1口当たりの資産運用報酬等に関する開示は出来ません。

ホームページアドレス <https://www.embassyofficeparks.com/>

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 549,663	% 98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,698	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	560,361	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(559,896千円)の投資信託財産総額(560,361千円)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=149.43円

1ポーランドズロチ=37.6967円

1タイバーツ=4.51円

1南アフリカランド=8.48円

1メキシコペソ=7.5159円

1香港ドル=19.23円

1フィリピンペソ=2.5983円

1サウジアラビアリアル=39.85円

1トルコリラ=4.3742円

1マレーシアリンギット=34.6944円

1インドルピー=1.79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 2024年10月21日現在
(A)資 産	561,717,613円
コール・ローン等	8,886,738
投資証券(評価額)	549,663,992
未 収 入 金	1,357,120
未 収 配 当 金	1,809,761
未 収 利 息	2
(B)負 債	2,683,092
未 払 金	1,356,544
未 払 解 約 金	1,326,548
(C)純 資 産 総 額(A-B)	559,034,521
元 本	601,420,692
次 期 繰 越 損 益 金	△42,386,171
(D)受 益 権 総 口 数	601,420,692口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,295円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年10月21日 至 2024年10月21日
(A)配 当 等 収 益	29,113,908円
受 取 配 当 金	28,623,159
受 取 利 息	490,844
支 払 利 息	△95
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	69,541,844
売 買 益	114,023,160
売 買 損	△44,481,316
(C)そ の 他 費 用	△5,696,447
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	92,959,305
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△142,846,775
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△9,197,341
(G)解 約 差 損 益 金	16,698,640
(H)計 (D+E+F+G)	△42,386,171
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△42,386,171

(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644,804,803円、期中追加設定元本額は73,643,020円、期中一部解約元本額は117,027,131円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT 新興国REITインデックス・オープン

392,154,851円

SMT インデックスバランス・オープン

209,265,841円

## お知らせ

該当事項はありません。