

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	2020年1月31日から無期限
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が運用する「F0Fs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）」を主要投資対象とします。
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。株式への直接投資は行いません。外貨建資産への直接投資は行いません。デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

世界成長スマートファンド

愛称：スマート・ブレンダー

運用報告書（全体版）

第3期（決算日 2022年10月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。さて、「世界成長スマートファンド」は2022年10月26日に第3期の決算を行いました。

ここに期間中の運用状況についてご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申し上げます。

スカイオーシャン・アセットマネジメント

〒220-8611 神奈川県横浜市西区みなとみらい3-1-1

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

【運用報告書の表記について】

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

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		投資信託 組入比率	純資産額
		税金 分	込配 み金		
(設定日)	円	円	%	%	百万円
2020年1月31日	10,000	—	—	—	1,102
1期(2020年10月26日)	9,814	0	△1.9	98.4	3,044
2期(2021年10月26日)	10,457	0	6.6	96.9	3,536
3期(2022年10月26日)	9,884	0	△5.5	98.9	4,709

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

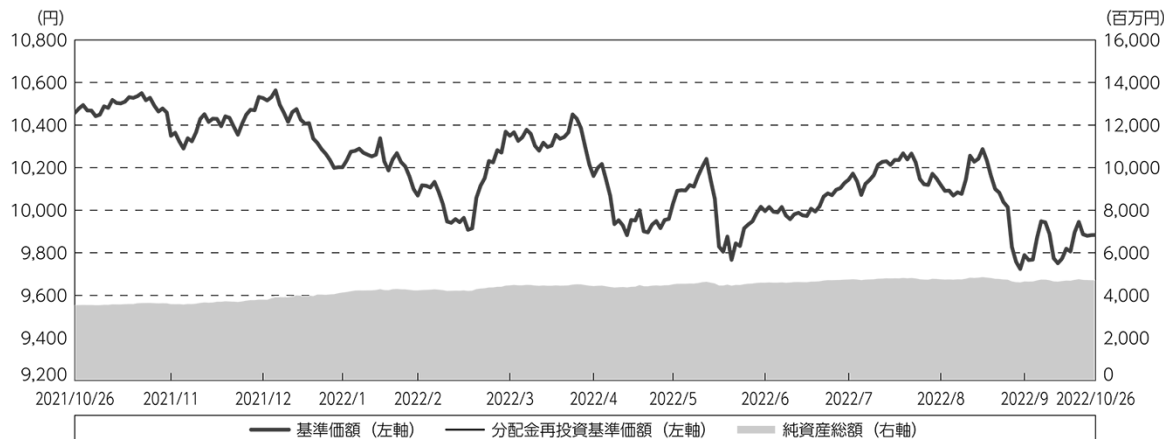
年月日	基準価額	騰落率		投資信託 組入比率	託券率
		騰	落		
(期首)	円	%	%	%	%
2021年10月26日	10,457	—	—	96.9	96.9
10月末	10,469	0.1	—	96.9	96.9
11月末	10,350	△1.0	—	97.0	97.0
12月末	10,527	0.7	—	97.1	97.1
2022年1月末	10,202	△2.4	—	97.2	97.2
2月末	10,069	△3.7	—	97.2	97.2
3月末	10,350	△1.0	—	97.2	97.2
4月末	10,161	△2.8	—	97.2	97.2
5月末	10,031	△4.1	—	97.1	97.1
6月末	9,996	△4.4	—	97.1	97.1
7月末	10,144	△3.0	—	97.2	97.2
8月末	10,119	△3.2	—	98.3	98.3
9月末	9,789	△6.4	—	98.7	98.7
(期末)					
2022年10月26日	9,884	△5.5	—	98.9	98.9

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2021年10月27日～2022年10月26日)

期中の基準価額等の推移



期 首：10,457円

期 末：9,884円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 5.5% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2021年10月26日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドの主な投資対象である「F0Fs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)」の基準価額が下落したことから、当ファンドの基準価額も下落しました。「F0Fs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)」では、リスク抑制ポートフォリオ^{※1}の「先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり」やリターン獲得ポートフォリオ^{※2}の「新興国株式インデックス マザーファンド」などの下落がマイナスに影響しましたが、リターン獲得ポートフォリオの「外国株式インデックス マザーファンド」や「新興国債券インデックス マザーファンド」などの上昇がプラスに寄与しました。

※1 債券85%、金15%(いずれも為替ヘッジあり)を目標に構成されるポートフォリオ

※2 株式40%、債券50%、REIT10%を目標に構成されるポートフォリオ

組入ファンド			当期末 組入比率	騰落率	
FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	ポートフォリオ	投資資産	98.9%	-4.9%	
国内株式インデックス マザーファンド	リターン獲得 ポートフォリオ	株式	1.5%	-1.9%	
外国株式インデックス マザーファンド			13.8%	6.4%	
新興国株式インデックス マザーファンド			9.3%	-12.2%	
国内債券インデックス マザーファンド		債券	1.8%	-4.3%	
外国債券インデックス マザーファンド			16.6%	1.9%	
新興国債券インデックス マザーファンド			12.7%	2.4%	
J-REITインデックス マザーファンド		REIT	0.6%	-6.4%	
グローバルREITインデックス マザーファンド			5.1%	-2.7%	
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり		リスク抑制 ポートフォリオ	債券 金	32.3%	-13.1%
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）				5.4%	-10.5%
その他			1.0%	-	
FOFs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）			0.0%	-0.2%	

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

(注) 「FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）」の組入資産の比率は、「FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）」に対する評価額の割合です。

投資環境

■国内株式市場

国内株式市場は下落しました。円安・米ドル高が進行したことが下支えとなりましたが、世界的なリスクオフの展開が続いたことや、新型コロナウイルスに伴う行動制限がマイナスに影響しました。

■先進国株式市場

先進国株式市場は上昇しました。ロシアのウクライナ侵攻に伴う地政学リスクや、欧米中央銀行の利上げが下落材料となったものの、先進国通貨が円に対して上昇したことがプラスに寄与しました。

■新興国株式市場

新興国株式市場は下落しました。世界的なリスク回避の流れが続いたことに加え、中国で景気後退懸念が高まったことから、中国株式を中心に下落しました。

■国内債券市場

国内債券市場は下落しました。日銀が緩和的な金融政策を続けているものの、世界的な利上げの影響を受けて、国内債券市場でも利回りが上昇（価格は下落）しました。

■先進国債券市場

先進国債券市場は、利回りが上昇（価格は下落）しました。世界的なインフレ懸念と、各国の中央銀行が金融引き締め政策を継続したことが、利回りの上昇に影響しました。一方で、先進国通貨が円に対して上昇したことがプラスに寄与しました。

■新興国債券市場

新興国債券市場は上昇しました。新興国の利回りは上昇（価格は下落）しましたが、新興国通貨が円に対して上昇し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。リスク許容度の悪化に加え、日本入国時の水際措置が外国人観光客の需要回復にブレーキをかけている状況がマイナスに影響しました。

■先進国REIT市場

先進国REIT市場は下落しました。金融引き締め of 長期化と景気後退が意識されたことがマイナスに影響しました。

■金市場

金は下落しました。期初は上昇する場面もありましたが、その後は米ドルの上昇が続いたことなどから、金は下落基調となりました。

当ファンドのポートフォリオ**○当ファンド**

「F0Fs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）」への投資を高位に保つ運用を行いました。

・F0Fs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）

日本を含む世界[※]の株式（DR（預託証券）を含みます。）、債券、REIT、金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。

「経済環境」及び「金融環境」に関する経済指標等を用いて市場の緊張度合いを測り、これに応じてリターン獲得ポートフォリオ及びリスク抑制ポートフォリオへの投資割合を変更しました。期初の配分は、リターン獲得ポートフォリオ65%、リスク抑制ポートフォリオ35%の積極的な配分としていましたが、2022年5月にはリターン獲得ポートフォリオ60%、リスク抑制ポートフォリオ40%に変更しました。

※REITは新興国を含みません

当ファンドのベンチマークとの差異

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

分配金

基準価額水準、市場動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。
 なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項 目	第3期
	2021年10月27日～ 2022年10月26日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	473

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

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

○今後の運用方針

○当ファンド

「FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、日本を含む世界[※]の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券、REIT、金に分散投資します。

※REITは新興国を含みません

・FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)

日本を含む世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券、REIT、金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す。

「経済環境」及び「金融環境」に関する経済指標等を用いて市場の緊張度合いを測り、これに応じてリターン獲得ポートフォリオ及びリスク抑制ポートフォリオへの投資割合を変更します。

リスク抑制ポートフォリオの実質組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

・FOFs用短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)

主としてわが国の公社債に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 73	% 0.720	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(26)	(0.253)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(45)	(0.440)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.006	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	74	0.726	
期中の平均基準価額は、10,183円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

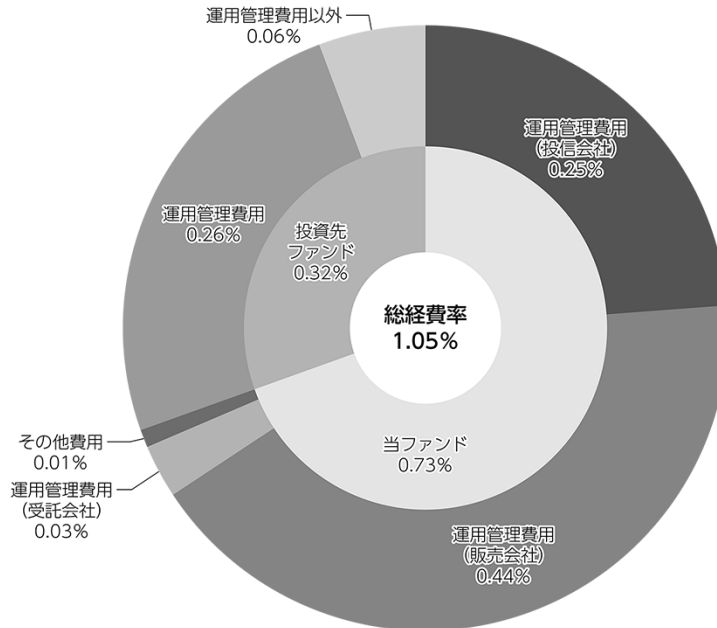
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

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

(参考情報)

○総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.05%です。



(単位:%)

総経費率(①+②+③)	1.05
①当ファンドの費用の比率	0.73
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.26
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.06

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

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

○売買及び取引の状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	1,413,313,670	1,469,300	25,713,561	27,000

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
	FOFs用短期金融資産ファンド（適格機関投資家専用）	10,111	10,111	9	0.0
	FOFs用世界成長戦略ファンド（適格機関投資家専用）	3,234,541,588	4,622,141,697	4,658,194	98.9
	合計	3,234,551,699	4,622,151,808	4,658,204	98.9

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	4,658,204	98.3
コール・ローン等、その他	82,105	1.7
投資信託財産総額	4,740,309	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,740,309,913
コール・ローン等	82,105,562
投資信託受益証券(評価額)	4,658,204,351
(B) 負債	30,911,991
未払解約金	14,030,552
未払信託報酬	16,753,379
未払利息	224
その他未払費用	127,836
(C) 純資産総額(A-B)	4,709,397,922
元本	4,764,547,441
次期繰越損益金	△ 55,149,519
(D) 受益権総口数	4,764,547,441口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,884円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,382,152,653円、期中追加設定元本額は1,819,402,510円、期中一部解約元本額は437,007,722円です。

(注) 1口当たり純資産額は0.9884円です。

(注) 2022年10月26日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は55,149,519円です。

○損益の状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 119,582
支払利息	△ 119,582
(B) 有価証券売買損益	△205,345,116
売買益	6,411,381
売買損	△211,756,497
(C) 信託報酬等	△ 31,406,179
(D) 当期損益金(A+B+C)	△236,870,877
(E) 前期繰越損益金	143,313,726
(F) 追加信託差損益金	38,407,632
(配当等相当額)	(82,043,502)
(売買損益相当額)	(△ 43,635,870)
(G) 計(D+E+F)	△ 55,149,519
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△ 55,149,519
追加信託差損益金	38,407,632
(配当等相当額)	(82,043,502)
(売買損益相当額)	(△ 43,635,870)
分配準備積立金	143,389,817
繰越損益金	△236,946,968

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

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

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

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(82,043,502円)および分配準備積立金(143,389,817円)より分配対象収益は225,433,319円(1万口当たり473円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金 (税込み)	0円
------------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	信託期間は2020年1月30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	FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場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コクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックスマザーファンド	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
	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	日本を除く世界の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。
	先進国ハインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	先進国 ^① の債券(国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。)を主要投資対象とします。 ※①は、IMF(International Monetary Fund)(国際通貨基金)の略称です。)が定義する先進国を指します。
組入制限	ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。 iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
	FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
	国内株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。
	外国株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式インデックスマザーファンド	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	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。
分配方針	先進国ハインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	ゴールドマザーファンド (為替ヘッジあり)	株式(新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 (2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用世界成長戦略ファンド (適格機関投資家専用)

運用報告書(全体版)

第3期(決算日 2022年8月22日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 証券組 比率	純資産 総額
	(分配落)	税金 分配	期中 騰落率						
設定日(2020年1月30日)	円 10,000	円 —	% —	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期(2020年8月20日)	9,908	0	△0.9	12.8	0.5	69.9	0.1	14.3	2,539
第2期(2021年8月20日)	10,428	0	5.2	24.5	0.8	59.1	0.3	12.5	3,745
第3期(2022年8月22日)	10,419	0	△0.1	23.6	1.0	61.3	0.2	12.2	7,048

(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」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株式組 比率	株式先 物比率	債券組 比率	債券先 物比率	投資信託 証券組 比率
	騰落率						
(当期首) 2021年 8月20日	円 10,428	% —	% 24.5	% 0.8	% 59.1	% 0.3	% 12.5
8月末	10,560	1.3	24.9	0.9	57.4	0.3	12.5
9月末	10,381	△0.5	25.0	0.9	59.3	0.3	12.3
10月末	10,611	1.8	25.6	0.8	59.6	0.2	12.8
11月末	10,509	0.8	24.9	1.0	57.9	0.4	12.7
12月末	10,676	2.4	25.1	1.1	58.7	0.4	12.9
2022年 1月末	10,387	△0.4	24.4	1.1	58.8	0.4	12.6
2月末	10,270	△1.5	24.4	1.1	59.0	0.2	12.9
3月末	10,537	1.0	25.3	1.0	57.7	0.3	13.4
4月末	10,368	△0.6	24.3	1.0	58.8	0.1	13.5
5月末	10,262	△1.6	22.8	1.3	59.3	0.3	12.3
6月末	10,188	△2.3	23.3	0.8	61.5	0.2	12.4
7月末	10,359	△0.7	22.8	1.1	61.1	0.1	11.9
(当期末) 2022年 8月22日	10,419	△0.1	23.6	1.0	61.3	0.2	12.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

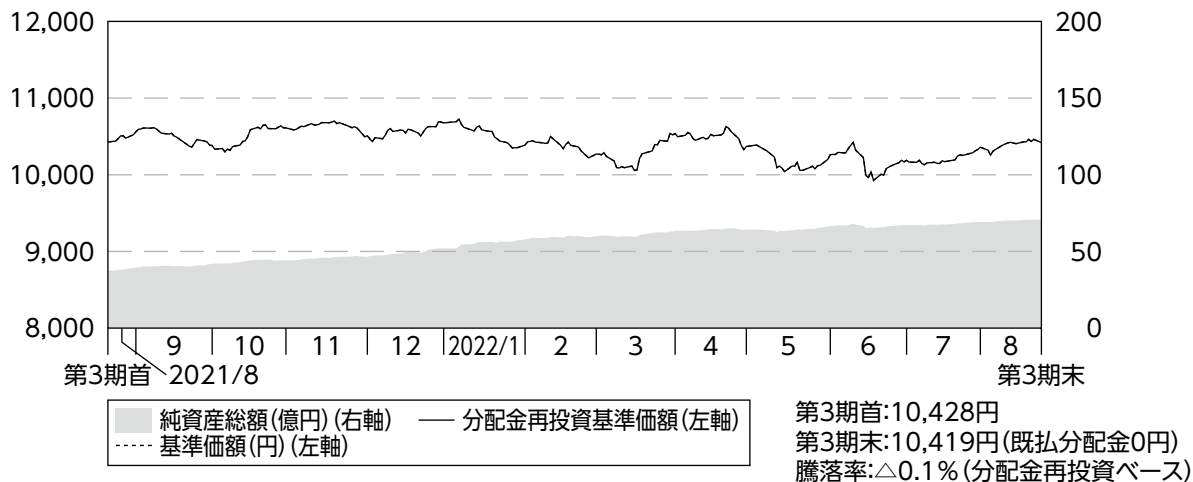
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額は、2021年8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

当期の基準価額は概ね横ばいとなりました。

米国の金融引き締めペースの加速や、ロシアのウクライナ侵攻、中国大手不動産開発会社の債務問題などへの警戒感が続きましたが、為替市場では世界的な円安の展開となったことから、外貨建資産に投資を行うリターン獲得ポートフォリオが上昇しました。一方で、保有する国の国債利回りが上昇（価格は下落）したことや、米ドル高に伴い金下落したこと、リスク抑制ポートフォリオは下落しました。

マザーファンド別では、リターン獲得ポートフォリオの「グローバルREITインデックス マザーファンド」や「外国株式インデックス マザーファンド」が大きく上昇した一方で、リスク抑制ポートフォリオの「先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり」が大きく下落しました。

組入ファンド	ポートフォリオ	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
国内株式インデックス マザーファンド	リターン獲得 ポートフォリオ	株式	1.5%	8.5%
外国株式インデックス マザーファンド			13.6%	16.2%
新興国株式インデックス マザーファンド			9.8%	4.2%
国内債券インデックス マザーファンド		債券	1.7%	△2.6%
外国債券インデックス マザーファンド			16.0%	2.7%
新興国債券インデックス マザーファンド			12.2%	3.4%
J-REITインデックス マザーファンド		REIT※	0.6%	△0.9%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.6%		18.8%	
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	リスク抑制 ポートフォリオ	為替ヘッジ付先進国債券	32.4%	△13.6%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)		金	5.5%	△3.7%

※ 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

国内株式は上昇しました。国内での新型コロナウイルス感染拡大、米国の金融引き締めペースの加速懸念、ウクライナを巡る地政学リスクなどが懸念材料となりましたが、円安の進行による輸出関連企業の業績改善期待などを受けて上昇しました。

先進国株式市場

先進国株式は上昇しました。米国の金融引き締めペースの加速懸念や、ロシアのウクライナ侵攻による地政学リスクの高まりなどが、マイナスに影響しました。一方で、当期後半にかけて世界的な円安が進み、先進国通貨が円に対して上昇したことがプラスに寄与し、先進国株式は上昇しました。

新興国株式市場

新興国株式は上昇しました。中国大手不動産開発会社の債務問題や、米国の金融引き締めペースの加速、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻などがマイナスに影響しました。一方で、新興国通貨の多くが円に対して上昇したことから、新興国株式は上昇しました。

国内債券市場

国内債券は下落しました。期初から期中にかけては、欧米主要国の国債利回りが上昇（価格は下落）した影響から、国内の10年国債の利回りも、日銀の長短金利操作の許容レンジ上限（0.25%）付近まで上昇しました。その後は、日銀が連続指し値オペの実施を公表して利回りの上昇をけん制したことなどから、概ねレンジ内での推移となりました。

先進国債券市場

先進国債券は上昇しました。世界的なインフレへの警戒感や主要国の利上げなどにより、多くの国の国債利回りが上昇しました。先進国通貨が円に対して上昇したことから、先進国債券は円ベースで上昇しましたが、為替ヘッジベースでは下落しました。

投資環境

新興国債券市場

新興国債券は上昇しました。米国の利上げなどが新興国債券からの資金流出につながりましたが、新興国通貨の多くが円に対して上昇したことから、新興国債券は上昇しました。

国内REIT市場

国内REITは下落しました。REIT関連施設再開への期待がプラスに寄与したものの、世界的なリスクオフの展開で上値の重い展開となりました。

先進国REIT市場

先進国REITは上昇しました。先進国株式同様に、市場のリスク許容度の低下がマイナスに影響しましたが、先進国通貨が円に対して大きく上昇したことから、先進国REITは上昇しました。

金市場

金は下落しました。ウクライナを巡る地政学リスクが高まったことにより金価格が上昇する場面もありましたが、期を通じて米ドルが上昇したことが金の下落要因となりました。

○当ファンド

日本を含む世界の株式・公社債・REIT・金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。期初はリターン獲得ポートフォリオ65%、リスク抑制ポートフォリオ35%程度のリスク資産多めの配分で開始しましたが、期中にリターン獲得ポートフォリオへの配分を引き下げ、期末時点ではリターン獲得ポートフォリオ60%、リスク抑制ポートフォリオ40%程度の配分としました。

・国内株式インデックス マザーファンド

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

・外国株式インデックス マザーファンド

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

・新興国株式インデックス マザーファンド

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

・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、資金の流出入等に対応するため債券先物取引を利用し、先物を含む外国債券の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

・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・マーケッツ・グローバル・ディバースィファイド(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。組み入れ等には、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。

・先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

IMF(国際通貨基金)が定義する先進国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国および各銘柄への投資割合を決定しました。為替ヘッジコストが低く、ロールダウン効果の高い欧州諸国を中心にポートフォリオに組み入れました。なお、組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

・ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

ベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。金現物に投資するETF(上場投資信託証券)の組入比率を期を通じて高位に維持し、組入外貨建資産については原則として対円での為替ヘッジを行いました。

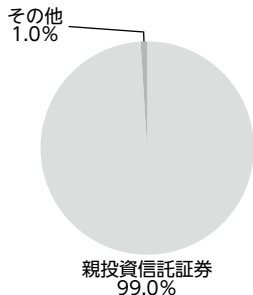
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

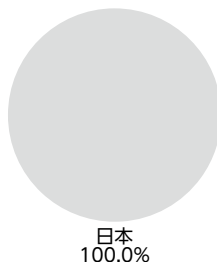
	当期末
	2022年8月22日
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	32.4%
外国債券インデックス マザーファンド	16.0%
外国株式インデックス マザーファンド	13.6%
新興国債券インデックス マザーファンド	12.2%
新興国株式インデックス マザーファンド	9.8%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.6%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	5.5%
国内債券インデックス マザーファンド	1.7%
国内株式インデックス マザーファンド	1.5%
J-REITインデックス マザーファンド	0.6%
その他	1.0%
組入ファンド数	10

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

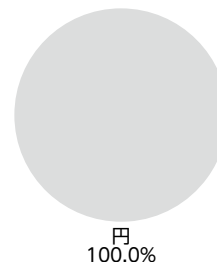
○資産別配分



○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3期	
	2021年8月21日~2022年8月22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)	645

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

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

(注3)－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

○当ファンド

主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界の株式(DR(預託証券)を含みます。)、債券、及び不動産投資信託証券、並びに金現物市場の代表的指数への連動を目指す上場投資信託証券に実質的に分散投資します。

「経済環境」及び「金融環境」に関する経済指標等を用いて、市場の緊張度合いを測り、これに応じて「リターン獲得ポートフォリオ」及び「リスク抑制ポートフォリオ」への投資割合を変更します。

リスク抑制ポートフォリオの実質組入外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

・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)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

・外国株式インデックス マザーファンド

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

・新興国株式インデックス マザーファンド

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

・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・ディバースファイド(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。)不動産投資信託証券に投資し、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

・ グローバルREITインデックス マザーファンド

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

・ 先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

主として、先進国の債券(国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。)に投資します。

ポートフォリオの構築に当たっては、主として先進国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への投資割合を決定します。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。

・ ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

主として別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)(以下「ベンチマーク」といいます。)に連動する投資成果を目指します。別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

別に定める「ベンチマーク」とは、次のものをいいます。

LBMA金価格(円ヘッジベース)

ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年8月21日~2022年8月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	29円	0.276%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,425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)	(24)	(0.232)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(3)	(0.033)	
(b) 売買委託手数料	0	0.004	(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)	(0.002)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(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)	(0.002)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	7	0.064	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(6)	(0.058)	
(監査費用)	(1)	(0.006)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	36	0.347	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当		期	
	設		約	
	口	金	口	金
	数	額	数	額
	千口	千円	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	10,397	22,252	2,431	5,154
グローバルREITインデックス マザーファンド	70,503	173,635	29,025	72,539
新興国株式インデックス マザーファンド	98,237	352,729	10,214	35,880
国内株式インデックス マザーファンド	26,509	50,703	3,949	7,265
外国株式インデックス マザーファンド	100,531	415,503	28,445	118,237
国内債券インデックス マザーファンド	45,128	63,217	7,592	10,524
外国債券インデックス マザーファンド	181,695	560,814	38,790	120,203
新興国債券インデックス マザーファンド	236,796	413,436	33,450	57,422
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	174,876	220,800	4,875	6,204
先進国ハイインカム入替戦略 マザーファンド 為替ヘッジあり	1,553,831	1,449,028	26,295	25,874

株式売買比率

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

<新興国株式インデックス マザーファンド>

項	目	当	期
(a)	当期中の株式売買金額	25,511,693千円	
(b)	当期中の平均組入株式時価総額	98,406,671千円	
(c)	売買高比率(a)/(b)	0.25	

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<国内株式インデックス マザーファンド>

項	目	当	期
(a)	当期中の株式売買金額	118,709,044千円	
(b)	当期中の平均組入株式時価総額	481,310,465千円	
(c)	売買高比率(a)/(b)	0.24	

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式インデックス マザーファンド>

項	目	当	期
(a)	当期中の株式売買金額	78,052,760千円	
(b)	当期中の平均組入株式時価総額	502,993,419千円	
(c)	売買高比率(a)/(b)	0.15	

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コール・ローン	百万円 13,726	百万円 764	% 5.6	百万円 13,692	百万円 764	% 5.6

(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。

<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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コール・ローン	百万円 800,499	百万円 36,107	% 4.5	百万円 801,531	百万円 36,107	% 4.5

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<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	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 17,830	百万円 46	% 0.3	百万円 19,363	百万円 -	% -
コール・ローン	39,917	1,606	4.0	39,846	1,606	4.0

<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	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コール・ローン	百万円 26,908	百万円 1,316	% 4.9	百万円 26,948	百万円 1,316	% 4.9

<平均保有割合 0.5%>

(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 770,738	百万円 34,773	% 4.5	百万円 771,659	百万円 34,773	% 4.5

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 46,800	百万円 83	% 0.2	百万円 72,150	百万円 32	% 0.0
コール・ローン	196,392	8,238	4.2	196,347	8,238	4.2

<平均保有割合 0.2%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内債券インデックス 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 274,914	百万円 11,065	% 4.0	百万円 282,157	百万円 11,065	% 3.9

<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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 42,440	百万円 106	% 0.2	百万円 26,751	百万円 325	% 1.2
コール・ローン	1,065,373	46,347	4.4	1,066,513	46,347	4.3

<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 250,992	百万円 11,217	% 4.5	百万円 250,897	百万円 11,217	% 4.5

<平均保有割合 0.9%>

(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。

<ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)>

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 32,981	百万円 1,801	% 5.5	百万円 32,937	百万円 1,801	% 5.5

<平均保有割合 1.0%>

(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。

<先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり>

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	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 149,994	百万円 149,994	% 100.0	百万円 142,740	百万円 142,740	% 100.0
為替直物取引	26,496	26,496	100.0	32,218	32,218	100.0
コール・ローン	103,711	3,809	3.7	103,951	3,809	3.7

<平均保有割合 14.9%>

(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	141百万円	136百万円	1,426百万円

(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。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	11,163	19,130	42,423
グローバルREITインデックス マザーファンド	103,540	145,019	393,306
新興国株式インデックス マザーファンド	103,412	191,434	694,200
国内株式インデックス マザーファンド	30,622	53,182	104,795
外国株式インデックス マザーファンド	140,237	212,323	960,849
国内債券インデックス マザーファンド	51,080	88,616	122,157
外国債券インデックス マザーファンド	214,220	357,125	1,129,409
新興国債券インデックス マザーファンド	275,621	478,967	860,417
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	155,667	325,669	389,793
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	1,064,825	2,592,362	2,281,278

(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	54,578,193千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	41,017,034千口
新興国株式インデックス マザーファンド	31,497,822千口
国内株式インデックス マザーファンド	263,601,210千口
外国株式インデックス マザーファンド	127,919,434千口
国内債券インデックス マザーファンド	455,042,574千口
外国債券インデックス マザーファンド	100,884,333千口
新興国債券インデックス マザーファンド	47,678,167千口
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	27,864,700千口
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	11,616,383千口

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	42,423	0.6
グローバルREITインデックス マザーファンド	393,306	5.6
新興国株式インデックス マザーファンド	694,200	9.8
国内株式インデックス マザーファンド	104,795	1.5
外国株式インデックス マザーファンド	960,849	13.6
国内債券インデックス マザーファンド	122,157	1.7
外国債券インデックス マザーファンド	1,129,409	16.0
新興国債券インデックス マザーファンド	860,417	12.2
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	389,793	5.5
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	2,281,278	32.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	79,403	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	7,058,030	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(111,253,047千円)の投資信託財産総額(111,391,555千円)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(114,217,307千円)の投資信託財産総額(114,323,119千円)に対する比率は99.9%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(579,288,114千円)の投資信託財産総額(579,740,490千円)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(316,014,171千円)の投資信託財産総額(319,168,693千円)に対する比率は99.0%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(84,405,658千円)の投資信託財産総額(85,669,910千円)に対する比率は98.5%です。

(注6) ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)において、当期末における外貨建純資産(34,413,904千円)の投資信託財産総額(34,495,508千円)に対する比率は99.8%です。

(注7) 先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジありにおいて、当期末における外貨建純資産(10,191,550千円)の投資信託財産総額(10,435,394千円)に対する比率は97.7%です。

(注8) 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=137.17円

1ブラジルリアル=26.532円

1ペルー・ソル=35.4941円

1ユーロ=137.55円

1スウェーデンクローナ=12.95円

1トルコリラ=7.585円

1ポーランドズロチ=28.9703円

1オーストラリアドル=94.37円

1シンガポールドル=98.43円

1フィリピンペソ=2.4521円

1新台湾ドル=4.5679円

1イスラエルシェケル=41.9766円

1アラブ首長国連邦ディルハム=37.41円

1カナダドル=105.48円

1チリペソ=0.145443円

1ウルグアイペソ=3.3884円

1イギリスポンド=162.08円

1ノルウェークローネ=13.95円

1チェココルナ=5.5864円

1ロシアルーブル=2.31円

1ニュージーランドドル=84.85円

1マレーシアリンギット=30.5944円

1インドネシアルピア=0.0093円

1オブショア人民元=20.0572円

1カタールリアル=37.32円

1サウジアラビアリアル=36.59円

1メキシコペソ=6.7948円

1コロンビアペソ=0.031291円

1ドミニカペソ=2.555円

1スイスフラン=142.96円

1デンマーククローネ=18.50円

1ハンガリーフォリント=0.340282円

1ルーマニア・レイ=28.1832円

1香港ドル=17.48円

1タイバーツ=3.83円

1韓国ウォン=0.1026円

1インドルピー=1.73円

1南アフリカランド=8.05円

1クウェート・ディナール=447.10円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年8月22日現在
(A) 資産	7,058,030,491円
コール・ローン等	72,527,270
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	42,423,901
グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	393,306,952
新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	694,200,501
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	104,795,733
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	960,849,092
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	122,157,557
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,129,409,713
新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	860,417,139
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)(評価額)	389,793,861
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり(評価額)	2,281,278,772
未収入金	6,870,000
(B) 負債	9,160,430
未払信託報酬	8,980,847
未払利息	30
その他未払費用	179,553
(C) 純資産総額(A-B)	7,048,870,061
元本	6,765,493,491
次期繰越損益金	283,376,570
(D) 受益権総口数	6,765,493,491口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,419円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年8月21日 至 2022年8月22日
(A) 配当等収益	△18,683円
受取利息	346
支払利息	△19,029
(B) 有価証券売買損益	2,791,787
売買益	255,044,110
売買損	△252,252,323
(C) 信託報酬等	△15,901,729
(D) 当期損益金(A+B+C)	△13,128,625
(E) 前期繰越損益金	149,474,324
(F) 追加信託差損益金 (配当等相当額)	147,030,871 (172,521,691)
(売買損益相当額)	(△25,490,820)
(G) 計(D+E+F)	283,376,570
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	283,376,570
追加信託差損益金 (配当等相当額)	147,030,871 (176,312,471)
(売買損益相当額)	(△29,281,600)
分準備積立金	260,249,871
繰越損益金	△123,904,172

(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3,591,991,343円、期中追加設定元本額は3,352,654,839円、期中一部解約元本額は179,152,691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)		110,775,547円
(B)	有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)		－円
(C)	収益調整金額		176,312,471円
(D)	分配準備積立金額		149,474,324円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		436,562,342円
(F)	期末残存口数		6,765,493,491口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		645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

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率		
第18期(2018年5月29日)	円	%		%	%	百万円
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	98.3	497,213

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1)騰落率は期首比です。

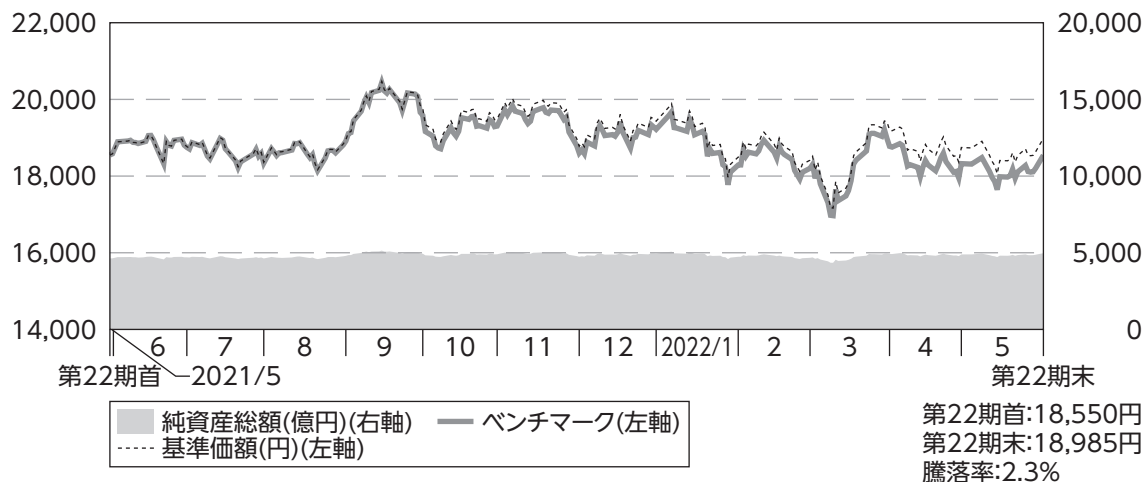
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



国内株式市場は下落しました。

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

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

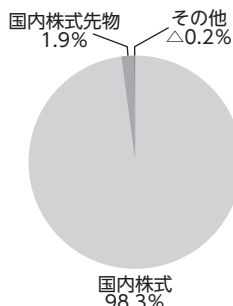
○上位10銘柄

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

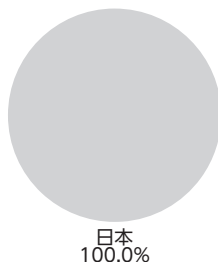
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	東京エレクトロン	日本	1.5%
8	リクルートホールディングス	日本	1.3%
9	任天堂	日本	1.3%
10	日立製作所	日本	1.3%
組入銘柄数			2,103

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

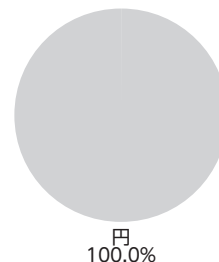
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

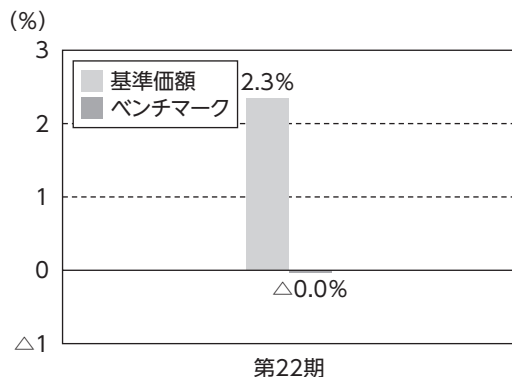


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<株 式>

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

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

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

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

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

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

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■ 利害関係人の発行する有価証券等

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

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
三井金属鉱業	46.1	51.7	176,555	
東邦亜鉛	9.5	10.1	24,108	
三菱マテリアル	112.9	115.9	230,525	
住友金属鉱山	218.4	221.3	1,196,569	
DOWAホールディングス	43.3	47.2	222,548	
古河機械金属	28.3	30.1	37,173	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17.9	22.2	41,913	
東邦チタニウム	30.7	34.3	72,270	
UACJ	26	27.2	59,051	
CKサンエツ	3.6	3.8	15,656	
古河電気工業	53.1	56.7	123,039	
住友電気工業	596.3	683.7	997,176	
フジクラ	206.3	213.4	162,824	
昭和電線ホールディングス	16.6	16.7	29,475	
東京特殊電線	2.2	2.6	6,032	
タツタ電線	30.4	34	16,218	
カナレ電気	2.9	2.9	4,903	
平河ヒューテック	9.6	10.7	11,834	
リョービ	21.1	21	22,869	
アーレスティ	21.3	20.7	7,659	
アサヒホールディングス	64.2	76.7	160,379	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	9.6	10	13,000	
宮地エンジニアリンググループ	5.6	5.5	18,590	
トーカロ	44.1	49.4	67,134	
アルファC o	6	6.9	6,713	
SUMCO	217.9	308.5	636,127	
川田テクノロジーズ	3.5	3.7	12,617	
RS Technologies	5.5	6.2	37,634	
ジェイテックコーポレーション	1.9	2.5	5,692	
信和	9.1	11.9	9,436	
東洋製罐グループホールディングス	108.8	105.6	144,144	
ホッカンホールディングス	8.7	9.4	11,486	
コロナ	9.4	9.7	7,954	
横河ブリッジホールディングス	29.3	29.2	56,472	
駒井ハルテック	3.5	3.2	5,465	
高田機工	1.6	1.7	4,318	
三和ホールディングス	161.1	180.4	227,664	
文化シャッター	50.3	57.8	55,488	
三協立山	22	23.4	13,618	
アルインコ	11.3	13.1	11,095	
東洋シャッター	3.8	4.2	2,700	
L I X I L	235.3	301.2	768,060	
日本ファイルコン	11.9	12.4	6,212	
ノーリツ	35.4	32.6	49,943	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
長府製作所	17.4	19.5	35,100	
リンナイ	33.2	34.1	298,034	
ダイニチ工業	8.2	9.2	5,934	
日東精工	21.4	22.4	11,222	
三洋工業	2.1	2.3	4,146	
岡部	34.6	31.6	20,066	
ジーテクト	21.2	22	28,028	
東プレ	31.9	31.4	31,902	
高周波熱錬	32.9	30.3	19,604	
東京製綱	12.2	11.7	10,904	
サンコール	14.6	16.4	10,496	
モリテック スチール	13.3	14.9	4,619	
パイオラックス	25.3	25.9	43,512	
エイチワン	16.8	17.6	10,331	
日本発條	170.2	166.2	155,729	
中央発條	8.2	9.2	6,504	
アドバネクス	2.5	2.5	4,090	
立川ブラインド工業	7.5	7.8	8,494	
三益半導体工業	13.3	14.9	36,311	
機械(5.4%)				
日本ドライケミカル	4.3	4.5	6,889	
日本製鋼所	51.9	52.2	169,911	
三浦工業	74	77.9	227,779	
タクマ	58	58.4	84,154	
ツガミ	35.5	40.3	49,286	
オークマ	20	19.7	105,592	
芝浦機械	17.8	21.7	68,355	
アマダ	250.6	302.3	315,903	
アイダエンジニアリング	45	44.8	41,619	
滝澤鉄工所	5	5.6	7,442	
F U J I	68.3	80.4	180,980	
牧野フライス製作所	20.1	20	85,800	
オーエスジー	84.4	85.6	146,033	
ダイジェット工業	2.1	2.4	2,172	
旭ダイヤモンド工業	45.3	48.4	29,136	
DMG森精機	108.2	108.6	214,919	
ソディック	41.1	41.8	31,893	
ディスコ	23.2	28.2	992,640	
日東工器	8.2	9.7	14,433	
日進工具	13.5	15.1	20,490	
パンチ工業	14.4	16.4	7,691	
富士ダイス	8.7	9.8	6,566	
豊和工業	9.7	10.2	8,302	
OKK	6.6	7.1	7,753	
東洋機械金属	12.4	12.6	7,686	

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

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

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

銘柄	当 期 首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
マブチモーター	48.1	44.7	159,355	
日本電産	415.9	453.9	3,922,603	
トレックス・セミコンダクター	9.8	9.2	27,176	
東光高岳	9.5	11.4	20,303	
ダイヘン	18.9	19	78,375	
ヤーマン	28.9	32.6	39,315	
J V Cケンウッド	154.1	164	31,160	
ミマキエンジニアリング	17	19.5	11,173	
I - P E X	8.5	9.9	13,761	
日新電機	40.6	45.3	67,995	
大崎電気工業	34.6	33.5	16,616	
オムロン	143.8	161.1	1,196,167	
日東工業	25.4	24.3	53,217	
I D E C	23.2	24	63,408	
正興電機製作所	6.1	6.7	7,316	
不二電機工業	3.7	4.6	5,451	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62.4	60.3	125,544	
サクサホールディングス	4.2	4.5	6,817	
メルコホールディングス	6.2	5.4	19,764	
テクノメディカ	4.5	5.1	8,246	
日本電気	219.5	235	1,236,100	
富士通	155.5	174.1	3,394,950	
沖電気工業	70.3	75.1	56,700	
岩崎通信機	7.6	7.9	6,912	
電気興業	8.4	9.6	24,480	
サンケン電気	20.2	17.1	93,879	
ナカヨ	3.5	3.3	3,709	
アイホン	9.9	9.5	16,150	
ルネサスエレクトロニクス	744.7	1,052.4	1,610,172	
セイコーエプソン	214.4	224.1	482,935	
ワコム	126.6	151.3	146,761	
アルバック	31.8	38.5	213,290	
アクセル	8.3	9.1	7,689	
E I Z O	14.7	14.1	49,279	
日本信号	40.4	43.8	39,901	
京三製作所	37.5	39	16,965	
能美防災	23.4	23.9	40,653	
ホーチキ	13.4	13.7	16,714	
星和電機	10.4	10.8	5,000	
エレコム	40.1	45.1	70,401	
パナソニック ホールディングス	1,842.6	2,063.8	2,473,464	
シャープ	229.8	196.1	209,238	
アンリツ	103.9	124.6	179,922	
富士通ゼネラル	52.8	52.5	132,877	
ソニーグループ	1,082.3	1,212.1	14,539,139	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
マナーフォワード	—	38.7	140,868			
サインポスト	4.1	6.1	5,490			
電算システムホールディングス	—	7.9	19,291			
ソルクシーズ	6.9	16.7	6,412			
フェイス	5.6	5.3	3,604			
プロトコーポレーション	20.6	20.4	20,134			
ハイマックス	5.2	5.2	6,760			
野村総合研究所	294.6	342.5	1,233,000			
サイバネットシステム	12.5	13.8	10,350			
CEホールディングス	9.7	9.9	4,752			
日本システム技術	3.3	3.6	8,542			
インタージホールディングス	21.4	22	31,680			
東邦システムサイエンス	4.9	5.2	4,747			
ソースネクスト	81.7	82.8	19,044			
インフォコム	15.6	20.9	45,541			
シンプレクス・ホールディングス	—	30.1	58,454			
HEROZ	5	5.7	5,244			
ラクスル	18.5	22.1	47,271			
I P S	4.1	5.3	11,925			
F I G	19.7	21.3	6,624			
システムサポート	5.3	7	8,253			
イーソル	9.5	12	7,104			
アルテリア・ネットワークス	19	20.2	25,209			
E d u L a b	1.7	—	—			
東海ソフト	2.9	3.2	3,404			
ウイングアーク1 s t	9	14.6	20,600			
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4	4.4	7,312			
サーバーワークス	1.7	3.3	7,144			
東名	1.9	1.7	1,601			
ヴィッツ	1.8	1.9	2,257			
トビラシステムズ	2.5	4.1	3,325			
S a n s a n	15.1	62.8	66,819			
L i n k - U	3.4	3.7	2,442			
ギフティ	10.3	16.4	18,515			
ベース	2	3.3	20,592			
J M D C	—	23.8	127,568			
フォーカスシステムズ	11.8	12.3	11,414			
クレスコ	11.3	13.9	30,441			
フジ・メディア・ホールディングス	176.2	173.7	191,591			
オービック	53.4	59.8	1,153,542			
ジャストシステム	24.2	27.1	130,757			
T D C ソフト	15.2	15.8	16,621			
Zホールディングス	2,329.7	2,738.5	1,156,468			
トレンドマイクロ	90.6	95.9	729,799			
I Dホールディングス	6.7	12.2	10,638			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
日本オラクル	34.4	30.8	244,552			
アルファシステムズ	4.6	5.1	21,777			
フューチャー	20.6	40.2	68,058			
C A C H o l d i n g s	11.3	10.4	14,705			
S B テクノロジー	6.2	8.3	19,256			
トーセ	5.1	5.1	3,728			
オービックビジネスコンサルタント	17.3	18.2	81,718			
伊藤忠テクノソリューションズ	77.3	86.6	278,419			
アイティフォー	22.6	23.3	18,360			
東計電算	2.6	2.3	13,777			
エックスネット	3	3.2	3,225			
大塚商会	91.8	102.8	426,620			
サイボウズ	20	25.6	27,059			
電通国際情報サービス	21.1	24.9	103,086			
A C C E S S	21.6	21.8	12,927			
デジタルガレージ	28.1	31.5	126,630			
EMシステムズ	28.4	31.6	30,146			
ウェザーニューズ	5.2	6	40,620			
C I J	12	15	12,210			
ビジネスエンジニアリング	1.8	4.4	9,086			
日本エンタープライズ	19	20.6	3,399			
WOWOW	8.3	8.4	12,549			
スカラ	15.6	16.2	12,781			
インテリジェント ウェイブ	10.5	9.8	6,399			
I M A G I C A G R O U P	15.2	14.6	10,468			
ネットワンシステムズ	69.3	70.1	195,929			
システムソフト	37.5	53	5,883			
アルゴグラフィックス	13.3	14.8	46,768			
マーベラス	27.2	30.2	21,713			
エイベックス	29.4	32.9	38,065			
B I P R O G Y	58.9	59.4	171,369			
兼松エレクトロニクス	9.3	10.4	40,872			
都築電気	7.8	9	12,276			
T B S ホールディングス	112.7	99.8	171,955			
日本テレビホールディングス	141.8	158.7	194,248			
朝日放送グループホールディングス	17.4	16.6	11,055			
テレビ朝日ホールディングス	52.6	45.8	67,142			
スカパーJ SATホールディングス	112.5	161.2	75,119			
テレビ東京ホールディングス	12.3	12.3	25,116			
日本BS放送	6.1	6.6	7,002			
ビジョン	21.4	31.4	42,390			
スマートバリュー	4.9	4.7	2,594			
USEN-NEXT HOLDINGS	—	15.7	32,043			
ワイヤレスゲート	7.8	8.5	2,643			
コネクシオ	9.9	13.6	18,346			

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

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ベルーナ	36.9	41.4	27,613	
銀行業(5.2%)				
島根銀行	5.9	6.1	3,251	
じもとホールディングス	11.5	12.9	7,443	
めぶきフィナンシャルグループ	885.4	828.8	205,542	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	21.4	22.7	43,720	
九州フィナンシャルグループ	348	352.6	133,988	
ゆうちょ銀行	482.7	450.5	447,346	
富山第一銀行	40.6	43.5	17,226	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,038.1	993.2	436,014	
西日本フィナンシャルホールディングス	111.3	106.3	80,256	
三十三フィナンシャルグループ	14.7	16.1	22,137	
第四北越フィナンシャルグループ	27.7	28.3	71,599	
ひろぎんホールディングス	251.3	256.5	156,465	
おきなわフィナンシャルグループ	—	16.5	34,963	
十六フィナンシャルグループ	—	23.4	53,281	
北國フィナンシャルホールディングス	—	16.8	70,476	
プロクレアホールディングス	—	19.7	36,819	
新生銀行	138.9	124.5	243,148	
あおぞら銀行	101.5	106.6	286,114	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,656.2	11,437.2	8,444,084	
りそなホールディングス	1,966.4	2,067.5	991,366	
三井住友トラスト・ホールディングス	322.1	330.7	1,292,375	
三井住友フィナンシャルグループ	1,179.2	1,266	5,039,946	
千葉銀行	568.7	571.6	382,972	
群馬銀行	350.7	324.1	114,731	
武蔵野銀行	25.4	25.7	45,180	
千葉興業銀行	43.4	42.4	11,066	
筑波銀行	70.8	74.4	13,615	
七十七銀行	53.5	53.7	91,128	
青森銀行	13.2	—	—	
秋田銀行	10.2	11.7	17,924	
山形銀行	19.1	18.5	15,244	
岩手銀行	11.2	11.9	23,800	
東邦銀行	152.4	144.1	28,675	
東北銀行	8.2	8.8	8,641	
みちのく銀行	10.9	—	—	
ふくおかフィナンシャルグループ	153.8	145.5	325,920	
静岡銀行	415	417.2	315,820	
十六銀行	21.4	—	—	
スルガ銀行	149.4	167.3	60,060	
八十二銀行	383.8	389	176,217	
山梨中央銀行	19.8	19.7	22,123	
大垣共立銀行	33.7	34.3	59,819	
福井銀行	14.6	15.6	20,576	

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

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

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

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

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

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

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

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

銘柄	当 期 首 (前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
スバル興業	1	1.1	9,493	
東京テアトル	6.4	6.9	8,576	
タナベ経営	3.4	7.6	5,327	
ナガワ	5.3	5.4	48,654	
東京都競馬	10.9	13.9	52,264	
カナモト	29.2	31.2	59,779	
西尾レントオール	15.3	16.1	44,516	
トランス・コスモス	15.8	23.6	82,128	
乃村工藝社	71.1	79.6	74,187	
藤田観光	6.5	8.1	20,565	
KN T-C Tホールディングス	8.8	11.5	20,665	
日本管財	17.8	19.9	52,635	
トーカイ	16.1	15.4	25,979	
セコム	162.7	182.2	1,538,861	
セントラル警備保障	8	9.1	20,839	
丹青社	31.5	36.3	30,274	
メイテック	20	22	154,660	
応用地質	18.8	18.9	33,358	
船井総研ホールディングス	33.9	35.9	76,143	
進学会ホールディングス	7.1	7	2,597	
オオバ	11.9	12.4	9,262	
いであ	4.2	4.9	8,820	
学究社	5	6.2	10,168	
ベネッセホールディングス	60.6	61.8	129,223	
イオンディライト	20.4	21.4	60,797	
ナック	8.1	9.1	8,836	
ダイセキ	27.7	33.8	154,635	
ステップ	6.2	7	12,754	
合 計	株 数・金 額	181,054	201,473	488,516,185
	銘柄数<比率>	2,114	2,102	<98.3%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	9,617	—

投資信託財産の構成

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

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

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

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

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

(変更日:2022年4月4日)

外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

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

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

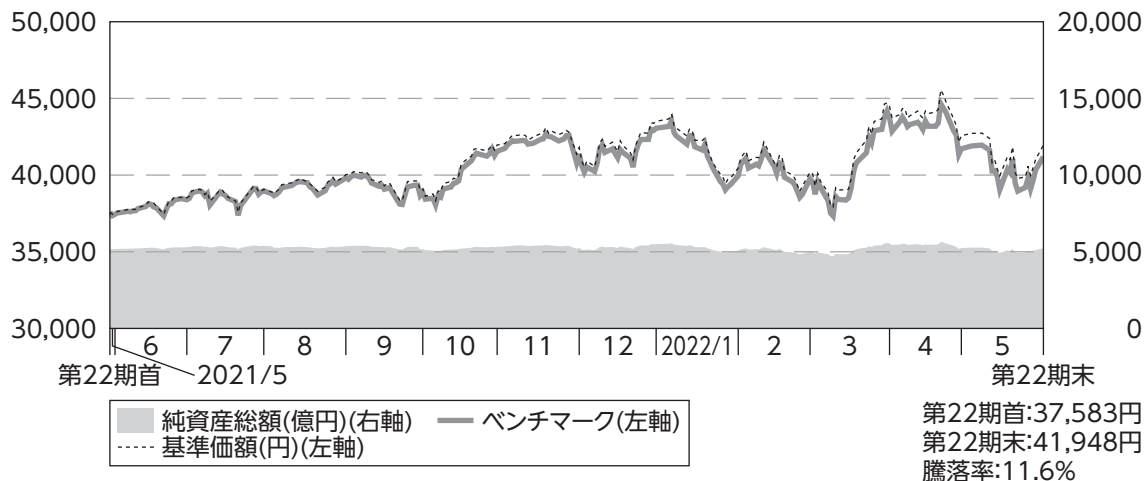
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

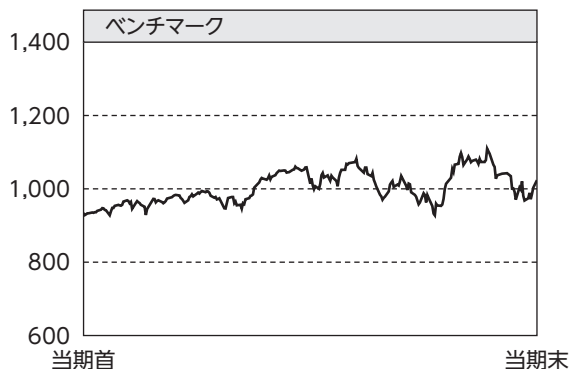


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

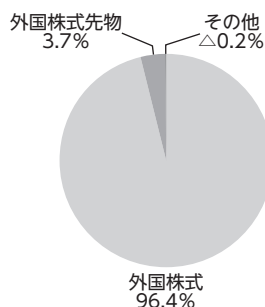
○上位10銘柄

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

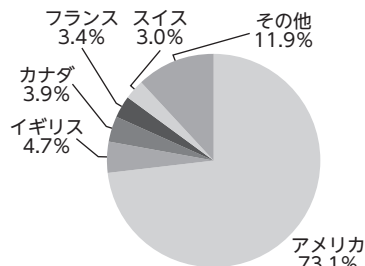
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.2%
8	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
9	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.9%
10	NVIDIA CORP	アメリカ	0.9%
組入銘柄数			1,286

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

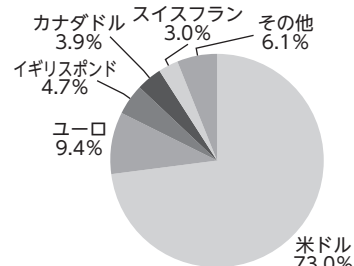
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

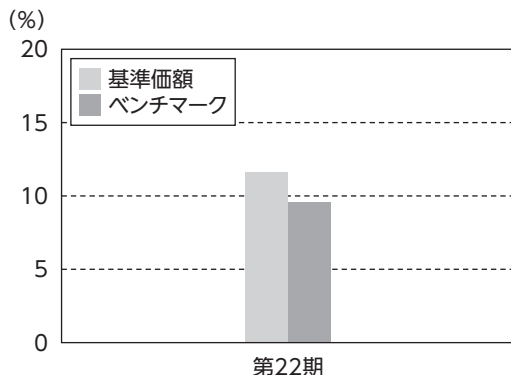


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、配当要因^{*1}および為替評価差要因^{*2}(いずれもプラス要因)です。

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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(40,771円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

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

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

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

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

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

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

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

<株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合>

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

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

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

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式>

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

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

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

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

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

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

投資信託財産の構成

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

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

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

1米ドル=127.02円

1カナダドル=99.87円

1ユーロ=136.29円

1イギリスポンド=160.39円

1スイスフラン=132.59円

1スウェーデンクローナ=12.94円

1ノルウェークローネ=13.40円

1デンマーククローネ=18.32円

1オーストラリアドル=91.02円

1ニュージーランドドル=83.10円

1香港ドル=16.18円

1シンガポールドル=92.82円

1イスラエルシェケル=37.927円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

<注記事項>

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

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021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(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		株式先物率 組入比率	株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率				
第9期(2017年11月10日)	30,310	41.2	25,570	38.3	98.5	1.0	0.5	百万円 47,713
第10期(2018年11月12日)	26,828	△11.5	22,122	△13.5	96.2	3.2	0.5	49,931
第11期(2019年11月11日)	28,752	7.2	23,119	4.5	96.3	3.0	0.6	62,222
第12期(2020年11月10日)	31,648	10.1	24,951	7.9	95.8	3.8	0.3	82,503
第13期(2021年11月10日)	37,038	17.0	28,575	14.5	93.6	6.2	0.3	104,132

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2020年11月10日	31,648	—	24,951	—	95.8	3.8	0.3
11月末	32,258	1.9	25,431	1.9	97.5	2.5	0.3
12月末	33,148	4.7	26,077	4.5	97.9	2.2	0.3
2021年1月末	35,716	12.9	28,066	12.5	96.8	2.9	0.3
2月末	37,088	17.2	29,244	17.2	94.9	4.9	0.3
3月末	37,060	17.1	29,055	16.4	94.4	5.3	0.3
4月末	37,808	19.5	29,564	18.5	93.2	6.5	0.3
5月末	38,002	20.1	29,707	19.1	94.1	5.7	0.3
6月末	38,841	22.7	30,289	21.4	93.1	6.7	0.3
7月末	36,326	14.8	28,210	13.1	96.2	3.4	0.4
8月末	36,267	14.6	28,097	12.6	93.9	5.8	0.4
9月末	36,038	13.9	27,854	11.6	95.0	4.7	0.3
10月末	37,414	18.2	28,850	15.6	93.9	5.8	0.3
(当期末) 2021年11月10日	37,038	17.0	28,575	14.5	93.6	6.2	0.3

(注1)騰落率は期首比です。

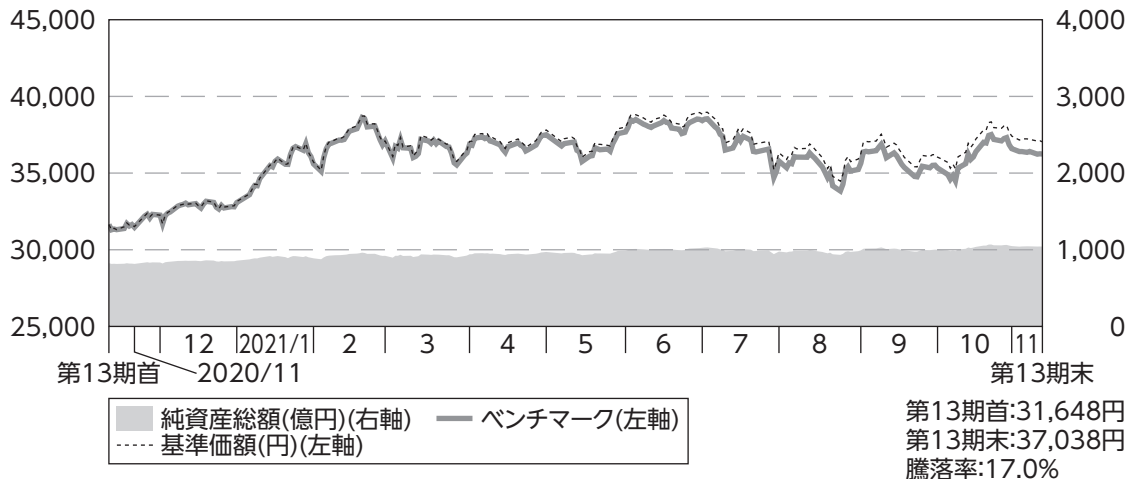
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

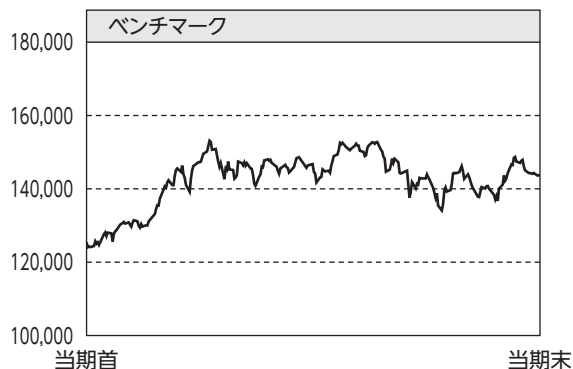


(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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(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。

当期初から2021年2月中旬にかけては、新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う経済正常化への期待が世界的に高まったことや、中国本土から大規模な資金が香港株式市場の中国株に流入したこと、中国の堅調な経済指標が好感されたことなどから大幅に上昇しました。2月下旬以降は、台湾株式市場や韓国株式市場で好調な市況を背景に鉄鋼や海運関連銘柄が牽引し、上昇する場面もありましたが、中国当局による大手IT関連企業などを対象とした規制強化が相次いだことや、中国大手不動産開発会社の債務問題が浮上し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから新興国株式市場は軟調に推移しました。

外国為替市場では、新興国通貨に対し総じ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エマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

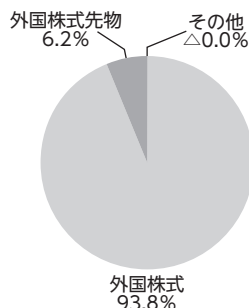
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	6.3%
2	MSCI EMERG M 2112	ー	6.2%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	4.0%
4	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	ケイマン諸島	3.6%
5	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.4%
6	MEITUAN-CLASS B	ケイマン諸島	1.6%

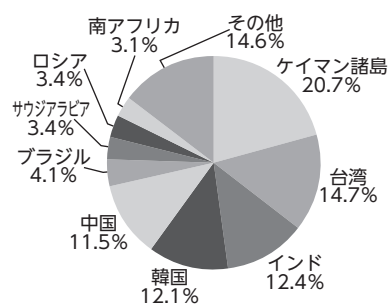
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.1%
8	INFOSYS LTD	インド	0.9%
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	0.8%
10	JD.COM INC-ADR	ケイマン諸島	0.8%
組入銘柄数			1,249

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

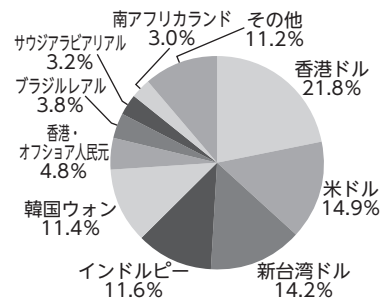
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

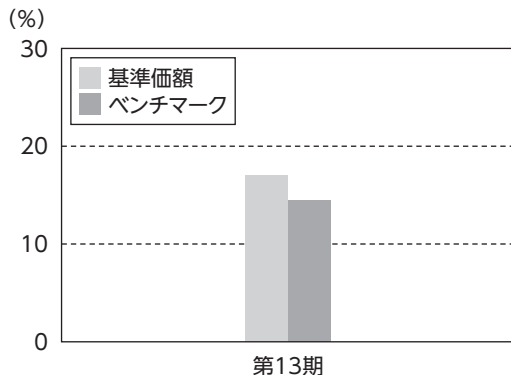


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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6.2%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、配当要因※(プラス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年11月11日~2021年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	9円	0.025%	(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)	(7)	(0.018)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(3)	(0.007)	
(b) 有価証券取引税	7	0.020	(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)	(7)	(0.020)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	53	0.147	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(53)	(0.147)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	69	0.192	

(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(36,330円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 7,105 (1,878)	千米ドル 25,013 (-)	百株 3,873 (1,904)	千米ドル 9,661 (55,095)
	メ キ シ コ	7,763 (3,599)	千メキシコペソ 27,778 (△507)	14,088	千メキシコペソ 31,396
	ブ ラ ジ ル	9,561 (8,927)	千ブラジルリアル 33,579 (31)	11,156 (995)	千ブラジルリアル 23,982 (13)
	チ リ	- (41)	千チリペソ - (74,866)	8,338 (19)	千チリペソ 320,325 (5,947)
	コ ロ ン ビ ア	232	千コロンビアペソ 731,187	-	千コロンビアペソ -
	ギ リ シ ャ	5,585 (8)	千ユーロ 673 (9)	134	千ユーロ 164
	イ ギ リ ス	179	千イギリスポンド 296	-	千イギリスポンド -
	ト ル コ	2,987	千トルコリラ 2,190	4,441	千トルコリラ 2,744
	チ ェ コ	472	千チェココルナ 4,128	539	千チェココルナ 3,933
	ハ ン ガ リ ー	35	千ハンガリーフォリント 57,680	27	千ハンガリーフォリント 38,640
	ポ ー ラ ン ド	428	千ポーランドズロチ 2,124	1,134	千ポーランドズロチ 2,332
	香 港	104,188 (16,714)	千香港ドル 256,807 (432,168)	150,917 (1,420)	千香港ドル 163,413 (5,070)
	国	マ レ ー シ ア	5,490 (13,600)	千マレーシアリンギット 3,108 (141)	9,317
タ イ		14,023 (368)	千タイバーツ 73,123 (-)	55,223 (1,218)	千タイバーツ 76,139 (6,726)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	フィリピン	百株 1,526	千フィリピンペソ 12,896	百株 12,579	千フィリピンペソ 26,575
	インドネシア	83,830 (71,640)	千インドネシアルピア 27,480,768 (4,665,326)	47,714 (12,730)	千インドネシアルピア 15,971,037 (337,120)
	韓国	1,848 (818)	千韓国ウォン 16,321,161 (301,078)	2,233 (90)	千韓国ウォン 12,167,514 (90,531)
	台湾	36,890 (4,410)	千新台幣ドル 366,811 (△132)	38,145	千新台幣ドル 273,500
	中国オフショア	37,201 (2,872)	千香港・オフショア人民元 76,714 (152)	30,679	千香港・オフショア人民元 51,215
	インド	29,018 (861)	千インドルピー 1,516,295 (-)	6,021	千インドルピー 424,379
	パキスタン	313	千パキスタンルピー 29,505	730	千パキスタンルピー 6,777
	カタール	3,715	千カタールリアル 2,355	769	千カタールリアル 1,395
	南アフリカ	3,931 (64)	千南アフリカランド 47,522 (-)	5,809	千南アフリカランド 94,949
	アラブ首長国連邦	7,598	千アラブ首長国連邦ディルハム 6,251	4,511	千アラブ首長国連邦ディルハム 2,030
国	サウジアラビア	1,551 (△265)	千サウジアラビアリアル 9,125 (-)	898	千サウジアラビアリアル 5,297
	クウェート	18,045 (947)	千クウェート・ディナール 1,276 (-)	1,071	千クウェート・ディナール 24

(注1)金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	イ タ	証券 — (64,319)	千タイバーツ — (146)	証券 23,844	千タイバーツ 101

(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					
	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	— (—)	— (△92)	—	—
	小 計	— (—)	— (△92)	—	—
	ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
	SUL AMERICA SA-UNITS	— (2,167)	— (—)	29,129	941
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	—	—	12,700	503
	BANCO INTER SA-UNITS	10,500 (21,000)	1,641 (—)	—	—
	GETNET ADQUIRENCIA E SERVICIO	— (11,475)	— (—)	11,475	82
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,900 (76,200)	918 (—)	—	—
	小 計	40,400 (110,842)	2,560 (—)	53,304	1,527
	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
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	183,686	2,705	—	—
	小 計	183,686	2,705	—	—

(注1)金額は受渡代金です。

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 35,010	百万円 32,088	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	25,159,357千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	90,566,180千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.27

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.083362	百万円 0.083362	% 100.0	百万円 0.083362	百万円 0.083362	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	34,238	126	0.4	34,157	126	0.4

(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		
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	126	14,273	素材	
CREDICORP LTD	73	76	952	107,523	銀行	
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	398	398	365	41,200	電気通信サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	113	95	573	64,711	素材	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	147	—	—	—	電気通信サービス	
YPF S. A. -SPONSORED ADR	155	155	70	7,982	エネルギー	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	151	1,561	318	35,958	消費者サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	474	527	612	69,078	小売	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	409	410	158	17,840	消費者サービス	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	20	20	87	9,823	各種金融	
ADECOAGRO SA	—	176	165	18,702	食品・飲料・タバコ	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	—	49	330	37,269	半導体・半導体製造装置	
BEST INC - ADR	141	—	—	—	運輸	
HUYA INC-ADR	82	82	73	8,293	メディア・娯楽	
NIO INC - ADR	963	1,475	5,995	676,683	自動車・自動車部品	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	390	648	515	58,226	メディア・娯楽	
AUTOHOME INC-ADR	65	65	248	28,040	メディア・娯楽	
GAOTU TECHEDU INC	78	163	47	5,335	消費者サービス	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	—	109	31	3,592	ソフトウェア・サービス	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	—	681	283	31,989	食品・飲料・タバコ	
DIDI GLOBAL INC	—	343	278	31,452	運輸	
KE HOLDINGS INC	100	355	704	79,490	不動産	
XPENG INC - ADR	—	407	1,807	203,972	自動車・自動車部品	
LUFAX HOLDING LTD	—	123	78	8,889	各種金融	
GLOBANT SA	38	44	1,593	179,809	ソフトウェア・サービス	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	2,020	—	—	—	小売	
YUM CHINA HOLDINGS INC	380	453	2,501	282,367	消費者サービス	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	389	447	1,244	140,463	運輸	
TRIP.COM GROUP LTD	524	556	1,692	191,032	消費者サービス	
SINA CORP	57	—	—	—	メディア・娯楽	
NETEASE INC-ADR	439	428	4,318	487,345	メディア・娯楽	
51JOB INC-ADR	27	27	145	16,470	商業・専門サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	293	300	4,861	548,724	メディア・娯楽	
VNET GROUP INC-ADR	—	74	124	14,037	ソフトウェア・サービス	
YANDEX NV-A	321	303	2,570	290,093	メディア・娯楽	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	139	191	882	99,550	消費者サービス	
JOYY INC	61	61	302	34,127	メディア・娯楽	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	76	90	534	60,292	ソフトウェア・サービス	
ZAI LAB LTD-ADR	51	76	665	75,110	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)	
360 DIGITECH INC	—	80	182	20,587	各種金融
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	121	182	1,414	159,639	メディア・娯楽
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	—	106	72	8,138	各種金融
I-MAB-SPONSORED ADR	—	29	169	19,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIBO CORP-SPON ADR	52	52	228	25,733	メディア・娯楽
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	—	55	119	13,436	ソフトウェア・サービス
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	—	50	70	8,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	—	124	116	13,154	ソフトウェア・サービス
DADA NEXUS LTD-ADR	—	76	161	18,213	小売
JD.COM INC-ADR	912	941	7,270	820,586	小売
AGORA INC-ADR	—	46	107	12,149	ソフトウェア・サービス
LI AUTO INC - ADR	—	601	1,802	203,421	自動車・自動車部品
OZON HOLDINGS PLC - ADR	—	75	335	37,833	小売
HELLO GROUP INC -SPN ADR	155	155	200	22,573	メディア・娯楽
BAOZUN INC-SPN ADR	35	35	58	6,623	小売
PINDUODUO INC-ADR	289	465	3,872	437,021	小売
IQIYI INC-ADR	212	289	237	26,823	メディア・娯楽
HUTCHMED CHINA-ADR	72	72	219	24,760	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIGENE LTD-ADR	—	49	1,822	205,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,040	—	—	—	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	544	544	47	5,387	不動産
LUKOIL PJSC-SPON ADR	432	440	4,446	501,817	エネルギー
GAZPROM OAO-SPON ADR	6,573	6,553	6,444	727,300	エネルギー
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	1,738	1,892	625	70,602	銀行
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR	1,232	1,232	590	66,605	エネルギー
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	108	105	2,654	299,633	エネルギー
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	195	195	625	70,601	素材
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	704	722	2,247	253,676	素材
ROSNEFT OJSC-GDR	1,465	1,340	1,190	134,337	エネルギー
SEVERSTAL - GDR REG S	387	387	918	103,621	素材
TATNEFT-SPONSORED ADR	269	299	1,364	153,963	エネルギー
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	3,780	3,780	535	60,414	銀行
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	472	399	752	84,939	食品・生活必需品小売り
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	—	193	383	43,323	メディア・娯楽
SBERBANK-SPONSORED ADR	2,969	2,853	5,729	646,679	銀行
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	268	268	673	76,030	素材
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	—	140	1,582	178,550	銀行
POLYUS PJSC-REG S-GDR	79	79	820	92,634	素材
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 <比 率>	32,869 56	36,076 72	85,356 —	9,633,307 <9.3%>
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	3,599	—	—	—	資本財
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	2,156	2,074	34,360	190,799	食品・飲料・タバコ
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,233	2,884	12,292	68,259	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,818	1,818	11,420	63,417	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)	
GRUMA S. A. B. -B	259	259	6,457	35,856	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	169	426	6,711	37,267	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	375	2,683	14,899	資本財
CEMEX SAB-SPONS	15,451	15,451	21,060	116,947	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,892	2,826	37,961	210,797	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	968	968	5,241	29,106	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	145	145	3,912	21,725	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,818	1,818	5,859	32,536	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	233	233	9,952	55,263	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,503	3,232	28,524	158,391	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	36,254	36,587	68,162	378,498	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,525	2,525	5,408	30,033	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	504	504	6,373	35,391	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	5,798	5,676	42,314	234,970	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	436	436	12,458	69,182	運輸
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	314	314	1,862	10,339	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	575	—	—	—	公益事業
TELESITES SAB DE CV	—	748	1,390	7,721	電気通信サービス
BECLÉ SAB DE CV	481	481	2,322	12,897	食品・飲料・タバコ
小 計	82,513	79,787	326,730	1,814,303	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	22	21	—	<1.7%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
BRF SA	525	525	1,235	25,422	食品・飲料・タバコ
VALE SA	3,957	4,303	28,379	583,784	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79	790	489	10,075	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	334	370	1,278	26,296	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	336	336	1,173	24,149	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	883	883	2,599	53,475	銀行
ITAUSA SA	5,058	5,031	5,051	103,920	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	957	—	—	—	小売
GERDAU SA-PREF	1,050	1,050	2,518	51,817	素材
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	197	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,230	3,751	10,334	212,579	エネルギー
VIBRA ENERGIA SA	760	1,346	3,079	63,351	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,846	5,444	14,503	298,357	エネルギー
COGNA EDUCACAO	1,812	—	—	—	消費者サービス
CCR SA	1,256	1,256	1,459	30,022	運輸
WEG SA	928	1,711	6,296	129,522	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	4,839	5,318	10,263	211,135	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	1,466	1,613	2,701	55,567	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	630	630	1,342	27,617	素材
BRADESPAR SA -PREF	—	271	1,241	25,538	素材
SUZANO SA	626	900	4,413	90,797	素材
CPFL ENERGIA SA	338	437	1,178	24,244	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	5,293	5,236	11,798	242,706	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)		
PORTO SEGURO SA	73	—	—	—	保険	
BRASKEM SA-PREF A	148	193	1,086	22,352	素材	
ENGIE BRASIL SA	292	292	1,160	23,875	公益事業	
ALPARGATAS SA - PREF	—	286	1,179	24,268	耐久消費財・アパレル	
LOCALIZA RENT A CAR	619	619	3,072	63,210	運輸	
LOJAS RENNER S.A.	829	1,159	3,747	77,087	小売	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	984	20,248	エネルギー	
COSAN SA	184	1,183	2,486	51,152	エネルギー	
TOTVS SA	—	579	2,032	41,817	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,104	809	1,882	38,725	公益事業	
AMERICANAS SA	223	397	1,398	28,759	小売	
JBS SA	1,286	1,100	4,151	85,398	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,021	1,138	1,533	31,551	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	347	347	1,256	25,854	公益事業	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	454	—	—	—	不動産	
HYPERA SA	353	353	1,042	21,436	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	2,227	6,373	8,055	165,710	各種金融	
TELEFONICA BRASIL S.A.	523	—	—	—	電気通信サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	3,336	3,055	4,011	82,514	小売	
CIELO SA	992	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
TELEFONICA BRASIL S.A.	—	523	2,604	53,566	電気通信サービス	
RAIA DROGASIL SA	1,225	1,225	2,986	61,436	食品・生活必需品小売り	
VIA S/A	1,359	1,359	1,024	21,078	小売	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	690	1,617	33,270	保険	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	544	544	4,014	82,575	ヘルスケア機器・サービス	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	201	1,005	1,334	27,454	ヘルスケア機器・サービス	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	415	727	14,965	食品・生活必需品小売り	
AMBEV SA	5,177	5,349	9,569	196,850	食品・飲料・タバコ	
NATURA &CO HOLDING SA	809	1,003	4,086	84,063	家庭用品・パーソナル用品	
TIM SA	961	961	1,231	25,323	電気通信サービス	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	—	456	2,641	54,340	ヘルスケア機器・サービス	
RUMO SA	1,142	1,597	2,703	55,617	運輸	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	939	—	—	—	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	68,638 51	74,974 48	184,964 —	3,804,888 <3.7%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	62,798	62,798	244,285	34,794	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	54	57	168,389	23,984	銀行	
BANCO DE CHILE	48,626	48,626	367,323	52,318	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	210,609	29,997	素材	
EMPRESAS COPEC SA	447	447	288,508	41,092	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	225	73	54,649	7,783	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	185	—	—	—	電気通信サービス	
ENEL AMERICAS SA	39,900	34,913	347,036	49,429	公益事業	
COLBUN SA	12,156	12,156	69,415	9,886	公益事業	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	期末		業種	
		株数 (百株)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
AGUAS ANDINAS SA-A	2,862	—	—	—	公益事業	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	105	125	654,952	93,286	素材	
FALABELLA SA	708	708	198,343	28,250	小売	
CENCOSUD SA	1,379	1,379	170,566	24,294	食品・生活必需品小売り	
CENCOSUD SHOPPING SA	416	416	34,112	4,858	不動産	
ENEL CHILE SA	25,612	25,612	88,287	12,574	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	196,991 16	188,674 13	2,896,480 —	412,551 <0.4%>	
(コロンビア)			千コロンビアペソ			
INTERCONEXION ELECTRICA SA	505	505	1,141,548	33,275	公益事業	
ECOPETROL SA	4,889	4,889	1,436,131	41,861	エネルギー	
BANCOLOMBIA SA	293	293	965,882	28,154	銀行	
BANCOLOMBIA SA-PREF	382	615	2,043,958	59,579	銀行	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	208	208	445,548	12,987	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,279 5	6,512 5	6,033,068 —	175,857 <0.2%>	
(ギリシャ)			千ユーロ			
ALPHA SERVICES AND HLD	—	2,636	294	38,566	銀行	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	262	262	399	52,287	電気通信サービス	
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	—	2,827	271	35,582	銀行	
MOTOR OIL (HELLAS) SA	57	—	—	—	エネルギー	
OPAP SA	176	184	242	31,699	消費者サービス	
JUMBO SA	148	193	250	32,793	小売	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	645 4	6,104 5	1,459 —	190,929 <0.2%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	267	446	628	96,183	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	267 1	446 1	628 —	96,183 <0.1%>	
(トルコ)			千トルコリラ			
AKBANK T. A. S.	2,763	2,763	1,740	20,190	銀行	
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	215	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	995	995	1,712	19,862	資本財	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,167	1,167	2,291	26,581	素材	
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	65	65	1,328	15,404	自動車・自動車部品	
KOC HOLDING AS	898	898	2,358	27,354	資本財	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	—	2,987	2,775	32,189	資本財	
TURK HAVA YOLLARI AO	621	—	—	—	運輸	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	1,430	1,430	2,383	27,648	電気通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	2,399	2,399	2,539	29,448	銀行	
TURKIYE IS BANKASI-C	1,730	1,730	1,076	12,481	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	116	116	1,775	20,589	エネルギー	
YAPI VE KREDI BANKASI	2,460	—	—	—	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,143	—	—	—	各種金融	

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)	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	428	428	2,811	32,606	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	16,436 14	14,982 11	22,793 —	264,357 <0.3%>
(チェコ)			千チェココロンナ		
KOMERCNI BANKA AS	74	74	7,127	36,927	銀行
CEZ AS	181	181	13,626	70,603	公益事業
MONETA MONEY BANK AS	687	620	5,517	28,588	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	943 3	876 3	26,271 —	136,119 <0.1%>
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント		
RIGHTER GEDEON NYRT	151	151	131,213	47,583	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	423	423	115,375	41,840	エネルギー
OTP BANK NYRT	248	256	472,686	171,417	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	823 3	831 3	719,275 —	260,840 <0.3%>
(ポーランド)			千ポーランドズロチ		
M BANK SA	16	—	—	—	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	131	131	1,997	56,886	素材
BANK PEKAO SA	225	236	3,012	85,801	銀行
ORANGE POLSKA SA	556	556	432	12,308	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	307	307	2,703	77,010	エネルギー
LPP SA	1	1	1,790	50,996	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA	36	36	1,347	38,382	銀行
CD PROJEKT SA	67	67	1,218	34,692	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA	1,042	933	4,443	126,554	銀行
GRUPA LOTOS SA	110	—	—	—	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	2,598	2,000	1,243	35,416	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA	360	360	1,274	36,291	メディア・娯楽
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	634	634	647	18,454	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	620	620	2,501	71,247	保険
DINO POLSKA SA	59	59	2,062	58,753	食品・生活必需品小売り
ALLEGRO. EU SA	273	392	1,659	47,273	小売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	7,043 16	6,337 14	26,336 —	750,069 <0.7%>
(香港)			千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	830	830	1,118	16,211	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	1,560	1,560	1,131	16,388	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	1,760	850	12,317	運輸
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	6,675	—	—	—	電気通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,240	1,445	5,404	78,308	素材
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	595	595	1,660	24,054	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H	3,700	3,700	1,369	19,836	公益事業
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	3,580	4,220	3,895	56,439	ヘルスケア機器・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,420	1,420	1,681	24,361	エネルギー
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	—	660	1,197	17,348	不動産

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)	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	785	525	2,044	29,630	家庭用品・パーソナル用品
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	3,080	—	—	—	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	3,680	3,680	2,686	38,925	自動車・自動車部品
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	9,561	9,561	7,658	110,976	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	4,090	4,155	6,931	100,433	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	3,471	3,671	10,646	154,263	不動産
CITIC LTD	6,770	6,170	4,436	64,280	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	2,480	2,480	1,302	18,865	運輸
LENOVO GROUP LTD	7,320	7,320	5,841	84,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	23,820	21,480	7,539	109,247	エネルギー
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	7,340	—	—	—	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,840	1,840	2,097	30,398	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	27,394	29,154	11,020	159,682	エネルギー
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	1,107	16,048	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,420	3,110	7,930	114,912	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	847	833	10,945	158,602	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	3,600	3,600	2,476	35,888	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,507	2,507	1,537	22,274	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,780	1,156	779	11,289	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,655	1,655	2,016	29,217	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	1,411	20,445	素材
WHARF HOLDINGS	1,000	1,540	4,158	60,249	不動産
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	1,279	1,279	1,142	16,552	運輸
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	1,340	1,340	1,133	16,426	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	2,862	3,056	5,610	81,300	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	2,281	33,056	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	6,090	6,300	16,411	237,802	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,360	3,360	614	8,909	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	1,060	1,060	4,202	60,900	公益事業
BYD CO LTD-H	825	885	27,488	398,302	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	13,560	—	—	—	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,920	1,920	1,367	19,808	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	14,500	1,261	18,279	メディア・娯楽
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	3,850	3,850	1,975	28,623	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,660	1,660	964	13,975	素材
CHINA YOUZAN LTD	—	14,560	1,324	19,198	ソフトウェア・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	6,892	6,892	4,818	69,814	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,750	2,750	1,482	21,477	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,754	1,754	3,409	49,407	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	3,527	3,527	11,623	168,418	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	8,710	9,180	12,539	181,702	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	7,290	7,727	111,970	素材
MMG LIMITED	—	3,040	951	13,787	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,440	2,440	2,908	42,143	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	3,735	—	—	—	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)	
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	2,118	2,897	41,983	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	860	—	—	—	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	5,570	—	—	—	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	380	—	—	—	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	640	—	—	—	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	2,280	3,461	50,150	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	460	680	4,443	64,390	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	3,200	3,200	3,308	47,944	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,660	1,660	585	8,490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,620	1,480	9,161	132,745	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	607	8,798	運輸
CNOOC LTD-R	18,830	—	—	—	エネルギー
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	—	1,010	1,458	21,132	素材
SINO BIOPHARMACEUTICAL	11,130	11,130	6,088	88,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,810	3,290	16,071	232,878	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	6,162	6,229	289,025	4,187,980	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	6,325	6,950	39,059	565,964	保険
LI NING CO LTD	2,170	2,375	22,028	319,187	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,720	24,925	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	12,069	12,069	881	12,766	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	2,743	39,759	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	2,140	2,140	1,221	17,705	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,836	26,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	1,680	—	—	—	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	3,925	3,310	5,362	77,698	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	4,740	5,180	5,967	86,475	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	10,984	10,984	5,261	76,241	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	1,700	1,312	19,016	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	102,476	103,856	54,212	785,545	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	848	848	13,771	199,549	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	1,931	27,982	自動車・自動車部品
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,420	1,420	742	10,761	不動産
MINTH GROUP LTD	—	640	2,048	29,675	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,290	1,290	1,229	17,813	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	4,120	4,120	3,679	53,311	素材
BANK OF CHINA LTD-H	86,352	88,012	24,203	350,705	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	1,325	1,189	17,240	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	725	784	11,366	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,352	1,352	561	8,130	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,369	4,299	26,977	390,906	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	64,645	62,655	26,503	384,030	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	905	905	550	7,972	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	841	12,197	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	762	11,047	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	5,190	—	—	—	資本財

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	780	780	1,688	24,469	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	2,878	41,705	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,420	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	8,979	8,009	5,374	77,876	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,420	4,680	2,157	31,261	素材
CHINA CITIC BANK-H	9,512	9,512	3,234	46,861	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	1,525	1,525	942	13,656	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	755	768	15,513	224,792	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,110	1,210	15,512	224,771	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	250	250	542	7,860	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	2,557	37,057	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	5,780	1,288	18,676	不動産
CHINA AOYUAN GROUP LTD	1,260	1,260	264	3,834	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	5,285	—	—	—	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,940	4,380	2,522	36,556	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	2,915	—	—	—	不動産
KINGSOFT CORP LTD	920	920	2,999	43,458	メディア・娯楽
SINOTRUK HONG KONG LTD	975	545	578	8,386	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,740	4,740	1,749	25,343	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	501	7,268	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	850	605	1,576	22,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,915	—	—	—	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,600	3,449	49,984	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,966	2,966	7,088	102,715	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,860	—	—	—	不動産
CRRC CORP LTD-H	5,110	—	—	—	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,590	2,590	833	12,084	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H	1,252	1,252	2,218	32,146	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	2,880	2,880	1,753	25,414	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,583	3,583	2,683	38,891	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,015	2,190	1,587	23,006	素材
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	—	1,780	857	12,431	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,510	1,510	413	5,995	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,310	3,390	5,796	83,997	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,748	25,340	ヘルスケア機器・サービス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,510	3,270	4,519	65,482	不動産
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	3,566	—	—	—	不動産
ZOOLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	1,162	1,162	610	8,839	資本財
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	—	1,600	1,308	18,964	資本財
LONGFOR PROPERTIES	1,970	1,970	6,737	97,624	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	964	964	2,096	30,381	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	6,744	6,744	2,056	29,804	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,560	1,560	157	2,283	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	314	1,412	2,544	36,872	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	6,850	3,750	1,020	14,779	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)	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	31,520	28,250	7,401	107,247	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	680	680	4,688	67,937	小売
FAR EAST HORIZON LTD	2,400	2,400	1,761	25,525	各種金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	660	2,319	33,615	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	2,485	2,485	4,701	68,126	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	2,040	2,040	1,138	16,494	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,000	1,000	1,300	18,837	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	2,421	35,092	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	2,288	33,153	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	9,390	2,197	31,838	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	555	730	2,675	38,767	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,760	5,640	2,227	32,280	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	715	—	—	—	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,830	4,830	2,101	30,444	各種金融
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	—	2,760	3,494	50,630	ソフトウェア・サービス
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	1,280	1,280	1,461	21,180	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	1,800	1,296	18,779	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	1,094	—	—	—	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	10,590	10,590	5,951	86,238	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	480	480	2,160	31,298	食品・飲料・タバコ
GENSRIPT BIOTECH CORP	820	1,320	3,867	56,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	225	—	—	—	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,360	1,640	9,085	131,650	不動産
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	1,310	1,310	467	6,776	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	401	537	1,664	24,121	ヘルスケア機器・サービス
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	700	700	887	12,861	消費者サービス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	—	507	737	10,692	素材
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	300	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	415	415	879	12,748	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	45,660	45,660	4,611	66,822	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	11,096	14,058	28,608	414,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTEC CO LTD-H	267	422	6,520	94,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIMOB INC	—	1,490	1,473	21,352	ソフトウェア・サービス
MEITUAN-CLASS B	3,827	4,366	118,056	1,710,640	小売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	684	684	1,202	17,423	消費者サービス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	850	1,160	2,418	35,045	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	3,862	5,319	7,596	110,077	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	940	1,390	10,633	154,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	—	640	824	11,944	不動産
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	8,320	8,320	1,056	15,310	各種金融
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	—	540	2,138	30,985	小売
LOGAN GROUP CO LTD	1,500	1,500	1,074	15,562	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,595	1,595	6,021	87,246	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	80	80	324	4,700	不動産
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	—	1,240	1,319	19,117	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	450	450	300	4,355	消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	58	100	1,591	23,053	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	1,140	1,045	15,147	小売
HANSHO PHARMACEUTICAL GROUP	1,220	1,220	2,103	30,476	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	1,440	3,460	4,006	58,056	食品・飲料・タバコ
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	16,426	258,066	3,739,380	小売
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	—	223	3,541	51,312	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	—	1,950	6,542	94,797	食品・飲料・タバコ
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	—	205	724	10,500	ヘルスケア機器・サービス
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	—	570	1,003	14,536	消費者サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	—	265	2,439	35,345	メディア・娯楽
HAIER SMART HOME CO LTD-H	—	2,446	6,714	97,289	耐久消費財・アパレル
AKESO INC	—	250	1,002	14,526	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	—	640	890	12,908	不動産
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	—	320	731	10,595	ソフトウェア・サービス
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	—	2,680	576	8,349	小売
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	—	750	780	11,302	不動産
NONGFU SPRING CO LTD-H	—	568	2,294	33,250	食品・飲料・タバコ
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	—	3,665	967	14,019	銀行
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	—	473	3,535	51,231	小売
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	—	676	2,700	39,131	不動産
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	—	51	692	10,035	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	1,784	3,229	46,788	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	1,925	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	450	450	2,099	30,418	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H	13,420	7,910	1,669	24,183	公益事業
BAIC MOTOR CORP LTD-H	1,170	—	—	—	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	886	886	1,128	16,355	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	272	584	2,575	37,318	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	2,092	1,356	1,545	22,399	各種金融
3SBIO INC	1,190	1,190	836	12,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGEND HOLDINGS CORP-H	905	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,575	1,575	554	8,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	9,270	9,270	945	13,700	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	322	516	2,776	40,225	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD	1,140	1,140	402	5,831	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	—	640	2,371	34,358	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	2,460	2,460	1,028	14,899	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	2,360	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	960	960	305	4,423	消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	800	800	520	7,546	不動産
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	2,390	—	—	—	保険
BOC AVIATION LTD	325	238	1,646	23,864	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	457	457	1,233	17,879	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	—	1,080	1,462	21,189	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	1,320	1,320	2,457	35,614	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,080	3,900	40,014	579,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	—	262	3,953	57,287	素材
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	152	152	1,535	22,245	食品・飲料・タバコ
HUIZHAN 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	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	979,813 206	948,379 213	1,559,573 —	22,598,214 <21.7%>
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	2,656	3,007	968	26,327	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	140	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	6,351	6,505	3,265	88,801	銀行
DIGI.COM BERHAD	3,117	3,117	1,321	35,935	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,065	1,065	684	18,607	運輸
RHB BANK BHD	2,064	2,108	1,134	30,839	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	382	296	8,070	資本財
GAMUDA BHD	1,415	—	—	—	資本財
YTL CORPORATION BERHAD	2,607	—	—	—	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	460	166	290	7,896	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	612	1,109	30,164	銀行
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	556	351	727	19,781	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	213	58	156	4,245	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	4,040	4,111	3,284	89,313	銀行
MISC BHD	1,250	1,250	872	23,731	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	69	72	964	26,233	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	734	734	1,306	35,523	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	251	509	13,854	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	755	755	1,236	33,626	公益事業
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	391	10,646	電気通信サービス
TENAGA NATIONAL BHD	2,751	3,052	2,933	79,768	公益事業
QL RESOURCES BHD	1,248	1,248	605	16,457	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	1,199	32,618	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	3,244	16,750	6,750	183,543	銀行
TOP GLOVE CORP BHD	5,049	5,049	1,176	31,987	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	132	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	1,282	1,282	282	7,668	ヘルスケア機器・サービス
SUPERMAX CORP BHD	1,582	1,617	276	7,519	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	3,072	1,885	968	26,344	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	1,183	32,167	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	2,703	2,703	1,029	28,006	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	3,363	3,363	746	20,302	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,813	1,813	1,031	28,049	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,852	2,852	1,106	30,097	電気通信サービス
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,229	33,435	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,699	2,699	2,237	60,838	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)	
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	2,293	1,478	40,214	ヘルスケア機器・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	700	700	298	8,127	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,443	2,886	1,532	41,668	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	995	27,070	食品・飲料・タバコ
小 計	78,659	88,432	45,585	1,239,488	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	40	36	—	<1.2%>	
(タイ)			千タイバーツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	519	—	—	—	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,776	1,776	6,171	21,230	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	5,176	17,805	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	543	543	2,402	8,265	公益事業
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,274	887	11,841	40,734	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	9,614	3,634	12,501	電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL-NVDR	783	—	—	—	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	31,473	—	—	—	銀行
IRPC PCL - NVDR	8,295	—	—	—	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	360	169	2,957	10,173	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	2,437	1,218	9,321	32,066	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	4,582	5,564	13,910	47,850	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,197	1,197	23,221	79,882	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	7,435	4,710	7,159	24,629	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	389	14,859	51,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	12,532	11,974	45,800	157,553	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	4,497	1,849	3,753	12,911	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	1,015	1,015	5,988	20,600	各種金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	7,412	25,497	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR	810	810	32,076	110,341	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	4,281	5,270	35,309	121,462	運輸
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	1,264	—	—	—	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	2,263	2,263	13,408	46,124	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	10,837	11,769	28,245	97,164	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	328	827	12,777	43,953	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,627	3,627	12,333	42,425	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	1,201	1,201	6,605	22,722	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	6,571	6,917	45,133	155,258	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	8,095	8,095	7,852	27,011	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,344	1,344	16,060	55,249	エネルギー
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	660	—	—	—	電気通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,064	2,064	8,926	30,708	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,249	2,249	13,945	47,973	素材
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	1,855	1,294	8,411	28,933	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	8,170	8,170	7,434	25,575	運輸
B GRIMM POWER PCL-NVDR	534	534	2,202	7,577	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	2,882	2,882	12,104	41,639	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR	660	660	2,194	7,549	食品・飲料・タバコ

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)		
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	1,651	1,651	3,070	10,563	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	8,103	8,103	3,808	13,100	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	1,822	1,822	6,604	22,720	小売	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	—	1,006	6,388	21,975	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	763	763	4,883	16,798	各種金融	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	—	736	2,042	7,025	ヘルスケア機器・サービス	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	—	2,890	7,514	25,848	小売	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	—	463	5,718	19,670	食品・飲料・タバコ	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	898	898	5,679	19,538	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	682	682	5,132	17,654	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	175,053	133,003	479,473	1,649,389	
	銘柄数 <比率>	43	42	—	<1.6%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
AYALA LAND INC	9,429	7,941	30,175	67,958	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,379	2,379	12,158	27,382	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	598	2,125	20,358	45,850	銀行	
GLOBE TELECOM INC	46	46	16,049	36,144	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,445	961	18,837	42,424	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	3,035	3,035	18,635	41,969	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	610	610	15,850	35,696	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,612	1,612	8,403	18,924	銀行	
BDO UNIBANK INC	2,199	2,199	29,028	65,374	銀行	
MEGAWORLD CORP	6,380	—	—	—	不動産	
PLDT INC	104	104	17,154	38,633	電気通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	930	—	—	—	不動産	
SM PRIME HOLDINGS INC	11,561	10,031	36,113	81,330	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	955	955	12,891	29,031	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	228	228	22,440	50,537	資本財	
AYALA CORPORATION	282	282	25,423	57,256	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	23,557	23,557	9,469	21,327	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	895	—	—	—	公益事業	
MANILA ELECTRIC COMPANY	291	291	8,645	19,470	公益事業	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	873	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	68	68	4,011	9,035	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	67,483	56,429	305,647	688,349	
	銘柄数 <比率>	21	17	—	<0.7%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
ANEKA TAMBANG TBK PT	—	9,858	2,306,772	18,454	素材	
BARITO PACIFIC TBK PT	28,825	28,825	2,796,025	22,368	素材	
UNITED TRACTORS TBK PT	2,009	2,009	4,630,745	37,045	エネルギー	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	4,291	4,291	2,724,785	21,798	食品・飲料・タバコ	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	21,527	22,184	12,977,640	103,821	自動車・自動車部品	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,923	7,923	4,872,645	38,981	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	596	596	1,957,860	15,662	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	9,179	—	—	—	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)	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,900	1,900	2,408,250	19,266	素材
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,442	2,442	2,112,330	16,898	素材
BANK MANDIRI	20,475	21,637	14,876,097	119,008	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	7,464	7,464	3,306,552	26,452	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA	58,996	68,047	28,919,983	231,359	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	7,915	—	—	—	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT	8,102	8,102	5,711,910	45,695	銀行
KALBE FARMA TBK PT	27,559	27,559	4,464,558	35,716	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	3,456	3,335,040	26,680	素材
BANK CENTRAL ASIA PT	10,510	57,725	44,303,937	354,431	銀行
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	53,497	56,013	20,780,823	166,246	電気通信サービス
XL AXIATA TBK PT	3,870	—	—	—	電気通信サービス
ACE HARDWARE INDONESIA	9,057	—	—	—	小売
ADARO ENERGY PT	14,393	14,393	2,454,006	19,632	エネルギー
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	1,610	1,436,925	11,495	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	—	10,761	3,002,319	24,018	電気通信サービス
SARANA MENARA NUSANTARA PT	—	28,406	3,380,314	27,042	電気通信サービス
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	—	15,421	5,011,825	40,094	素材
小 計	305,596	400,622	177,771,343	1,422,170	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	22	22	—	<1.4%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
SKC CO LTD	—	17	310,386	29,734	素材
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50	50	117,370	11,244	メディア・娯楽
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	42	30	306,625	29,374	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	31	31	693,084	66,397	保険
DB INSURANCE CO LTD	42	42	245,805	23,548	保険
COWAY CO LTD	50	50	409,192	39,200	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	132	132	1,139,822	109,195	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	23	8	69,888	6,695	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	45	—	—	—	公益事業
CJ CORP	12	12	119,679	11,465	資本財
KAKAO CORP	60	344	4,329,373	414,753	メディア・娯楽
SK TELECOM	42	31	978,329	93,723	電気通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	32	—	—	—	資本財
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	310	310	278,204	26,651	各種金融
NCSOFT CORPORATION	17	16	1,030,161	98,689	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	221	221	317,493	30,415	電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	—	288	760,716	72,876	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	59	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	9	9	1,165,364	111,641	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	48	48	3,744,261	358,700	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	11	8	307,388	29,447	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	2	3	245,070	23,477	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	518	508	1,905,568	182,553	銀行
HMM CO LTD	—	253	675,750	64,736	運輸

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)	
S-OIL CORPORATION	44	44	444,700	42,602	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	107	123	451,906	43,292	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	479	479	226,106	21,661	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	57	277,825	26,615	各種金融
POSCO CHEMICAL CO LTD	33	33	484,075	46,374	素材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	19	19	418,810	40,121	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	30	30	252,317	24,172	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	43	43	439,754	42,128	資本財
HYUNDAI MOBIS	69	71	1,768,326	169,405	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	590	603	6,573,027	629,695	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	92	97	497,191	47,630	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	30	34	341,795	32,744	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	156	148	3,173,061	303,979	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	72	111	463,784	44,430	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	283	283	315,879	30,261	銀行
KIA CORP	294	292	2,545,533	243,862	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	7	7	392,283	37,580	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	303	264	619,140	59,313	公益事業
HANWHA CORPORATION	28	—	—	—	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	91	237	732,348	70,158	運輸
CJ LOGISTICS	8	8	121,542	11,643	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	25	18	320,762	30,728	素材
DOUZONE BIZON CO LTD	14	14	114,338	10,953	ソフトウェア・サービス
LG ELECTRONICS INC	110	110	1,355,337	129,841	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	23	—	—	—	資本財
LG CORP	99	90	848,444	81,280	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	121	156,785	15,020	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	67	67	283,244	27,134	資本財
NAVER CORP	130	135	5,675,912	543,752	メディア・娯楽
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	402,214	38,532	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.68	—	—	—	食品・飲料・タバコ
PACIFIC CORP	33	33	168,801	16,171	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	132	77	207,595	19,887	消費者サービス
POSCO	79	80	2,306,505	220,963	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	185	185	436,977	41,862	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	60	58	4,407,216	422,211	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	56	68	1,102,045	105,575	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GREEN CROSS CORP	—	5	137,334	13,156	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5,138	5,171	36,459,145	3,492,786	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	593	593	352,870	33,805	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	889	886	5,853,342	560,750	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	8	8	211,440	20,255	小売
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	30	30	140,558	13,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORPORATION	55	58	350,765	33,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	190	190	273,600	26,210	自動車・自動車部品

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)	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	91	—	—	—	保険
GS HOLDINGS CORP	65	65	290,421	27,822	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	240	240	493,455	47,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	102	106	2,194,123	210,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANA FINANCIAL GROUP	325	339	1,501,120	143,807	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	23	15	252,174	24,158	運輸
LOTTE SHOPPING CO	10	10	107,536	10,301	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	74	74	502,130	48,104	保険
AMOREPACIFIC CORP	28	37	701,613	67,214	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	21	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	—	—	—	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	55	55	1,298,745	124,419	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	7	7	290,237	27,804	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	168,900	16,180	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	14	302,102	28,941	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	39	35	867,468	83,103	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	441	428	2,393,094	229,258	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	106	71	214,883	20,585	資本財
BNK FINANCIAL GROUP INC	481	—	—	—	銀行
HANMI PHARM CO LTD	4	4	138,722	13,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FILA HOLDINGS CORPORATION	40	40	156,876	15,028	耐久消費財・アパレル
EMART	18	18	306,628	29,374	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	40	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	70	70	303,131	29,039	自動車・自動車部品
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	13	51	318,052	30,469	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	5	5	91,683	8,783	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	29	31	359,759	34,464	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	—	11	177,837	17,036	素材
NETMARBLE CORP	24	24	324,147	31,053	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	594	594	787,129	75,407	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	—	31	308,190	29,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	—	15	226,500	21,698	素材
SK BIOSCIENCE CO LTD	—	21	466,200	44,661	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYBE CO LTD	—	15	601,783	57,650	メディア・娯楽
SAMSUNG SDS CO LTD	37	37	584,825	56,026	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	87	87	1,012,332	96,981	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	18	18	1,544,620	147,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOOSAN BOBCAT INC	43	43	190,629	18,262	資本財
CJ ENM CO LTD	8	8	142,677	13,668	小売
KMW CO LTD	19	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HLB INC	50	100	403,984	38,701	耐久消費財・アパレル
CELLTRION PHARM INC	12	19	220,911	21,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	19	38	193,435	18,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ECOPRO BM CO LTD	—	11	652,275	62,487	資本財
ALTEOGEN INC	18	28	221,882	21,256	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	
PEARL ABYSS CORP	9	46	526,351	50,424	メディア・娯楽
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	75	86	720,274	69,002	ヘルスケア機器・サービス
小 計	16,389	16,732	123,813,019	11,861,287	
	銘柄数 <比率>	106	104	—	<11.4%>
(台湾)			千新台幣ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	480	480	13,920	56,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	2,558	2,558	6,855	27,875	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	760	720	27,070	110,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	509	509	26,032	105,850	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	2,341	2,341	10,491	42,657	素材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	270	270	4,293	17,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN BUSINESS BANK	5,004	—	—	—	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	600	600	9,570	38,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	1,180	22,715	92,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	617	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	2,862	2,862	23,216	94,400	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	1,134	—	—	—	不動産
EVA AIRWAYS CORP	1,641	—	—	—	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	697	697	11,500	46,762	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,818	5,876	9,813	39,904	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	6,232	25,342	自動車・自動車部品
CHINA STEEL	12,662	12,662	43,686	177,631	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,262	3,393	9,839	40,010	保険
ADVANTECH CO LTD	433	433	16,857	68,545	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	4,317	4,317	10,513	42,748	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,099	2,179	57,962	235,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,540	1,150	7,900	32,124	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,973	4,103	45,750	186,024	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	9,450	9,450	19,421	78,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,782	1,922	18,989	77,212	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE	3,590	2,660	32,456	131,972	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,480	10,406	42,311	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	434	434	9,906	40,279	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	199	12,659	51,476	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	580	580	26,758	108,803	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,138	4,418	47,496	193,123	素材
FORMOSA TAPPETA CO.	1,210	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	3,960	4,200	33,856	137,665	素材
GIANT MANUFACTURING	344	344	10,408	42,320	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,608	1,658	162,156	659,343	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	7,100	8,104	59,242	240,887	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	9,640	10,593	21,663	88,086	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	300	300	18,840	76,605	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,570	1,570	9,891	40,217	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	11,701	10,561	25,559	103,925	各種金融

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)	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	8,941	8,881	51,955	211,255	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,567	16,247	23,234	94,473	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	12,609	13,974	37,731	153,418	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	13,332	13,682	147,770	600,850	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	11,733	12,113	40,822	165,986	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	110	110	22,742	92,472	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	12,295	10,094	18,472	75,111	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	11,955	12,628	12,477	50,733	保険
INVENTEC CO LTD	2,805	2,805	7,377	29,997	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,254	2,254	13,887	56,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,568	11,568	16,369	66,561	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	18,992	20,112	47,364	192,589	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	11,662	12,482	28,771	116,989	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	997	697	6,830	27,773	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	5,487	5,617	48,198	195,979	素材
WISTRON CORP	3,556	2,426	7,001	28,469	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	2,737	2,737	9,554	38,851	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	5,263	4,943	33,272	135,290	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	595	595	17,297	70,333	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,122	1,122	11,392	46,322	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	1,476	2,067	13,953	56,737	不動産
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	928	928	6,462	26,276	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	357	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,281	1,281	7,404	30,106	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	5,675	4,865	23,741	96,536	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	26,523	26,613	1,626,108	6,611,920	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	12,100	13,160	83,039	337,647	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LIMITED	—	649	11,909	48,423	運輸
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,490	3,490	9,824	39,946	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	387	387	16,629	67,618	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANG MING MARINE TRANSPORT	—	1,800	20,880	84,900	運輸
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	2,640	1,500	4,402	17,901	運輸
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	7,750	10,490	18,882	76,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	1,436	1,436	7,515	30,557	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	—	210	11,382	46,280	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	218	232	6,730	27,364	資本財
PEGATRON CORP	2,004	2,004	13,832	56,245	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	120	125	9,631	39,161	資本財
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,373	1,441	37,555	152,704	各種金融
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	30	30	5,115	20,798	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	599	599	6,171	25,095	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	10,872	10,784	24,803	100,855	銀行
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	3,308	4,518	20,311	82,587	銀行
WIWYNN CORP	80	80	7,528	30,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	3,493	3,593	37,728	153,406	半導体・半導体製造装置

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
SILERGY CORP	70	80	38,560	156,788	半導体・半導体製造装置	
MOMO.COM INC	—	50	8,675	35,273	小売	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	160	160	6,144	24,982	耐久消費財・アパレル	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	890	13,839	56,272	半導体・半導体製造装置	
PHISON ELECTRONICS CORP	115	225	8,723	35,469	半導体・半導体製造装置	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	320	11,168	45,410	半導体・半導体製造装置	
ONENESS BIOTECH CO LTD	—	200	5,080	20,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBALWAFERS CO LTD	240	240	18,696	76,019	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 銘 柄 数	354,982	358,137	3,628,887	14,755,420	
	金 額 <比 率>	87	87	—	<14.2%>	
(中国オフショア)				千香港・オフショア人民元		
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	373	—	—	—	—	商業・専門サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	—	75	1,019	18,008	18,008	資本財
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	—	1,271	1,019	18,016	18,016	各種金融
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	103	103	353	6,242	6,242	食品・飲料・タバコ
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	—	327	457	8,087	8,087	半導体・半導体製造装置
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	154	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	80	80	1,388	24,518	24,518	素材
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	183	183	501	8,866	8,866	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	134	134	333	5,884	5,884	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	80	80	1,130	19,977	19,977	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	22	22	600	10,612	10,612	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	471	471	1,157	20,447	20,447	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	261	261	445	7,860	7,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	163	163	716	12,657	12,657	メディア・娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	235	235	377	6,675	6,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	285	285	736	13,013	13,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YINTAI GOLD CO LTD-A	—	1,113	1,045	18,461	18,461	素材
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	41	41	46	829	829	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	301	30	51	917	917	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	337	—	—	—	—	素材
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	—	55	768	13,578	13,578	ソフトウェア・サービス
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	825	14,582	14,582	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	444	7,854	7,854	メディア・娯楽
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	—	100	1,602	28,300	28,300	資本財
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	210	295	688	12,162	12,162	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	1,033	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	—	277	818	14,451	14,451	耐久消費財・アパレル
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	703	703	259	4,586	4,586	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	242	290	841	14,866	14,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	—	596	951	16,814	16,814	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	134	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	274	274	644	11,388	11,388	食品・飲料・タバコ
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	136	136	554	9,787	9,787	資本財
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	250	84	224	3,970	3,970	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)	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	—	784	1,066	18,834	ソフトウェア・サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	288	288	408	7,218	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	170	170	1,115	19,705	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	264	58	347	6,131	資本財
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	—	180	632	11,176	ヘルスケア機器・サービス
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	239	335	1,911	33,770	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	99	1,272	22,482	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	133	2,365	食品・飲料・タバコ
ADDSINO CO LTD -A	347	58	95	1,688	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	228	—	—	—	メディア・娯楽
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	348	348	480	8,489	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	470	470	579	10,228	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	922	922	744	13,143	素材
NAVINFO CO LTD-A	332	332	427	7,547	耐久消費財・アパレル
BY-HEALTH CO LTD-A	297	297	703	12,433	家庭用品・パーソナル用品
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	378	378	527	9,315	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	204	3,618	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	558	9,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	323	484	765	13,530	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	244	4,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	—	49	1,099	19,424	半導体・半導体製造装置
INSUR ELECTRONIC INFORMAT-A	197	197	623	11,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	313	313	256	4,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	—	1,374	983	17,378	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	179	232	1,120	19,787	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	280	280	1,165	20,595	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	208	3,681	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	317	5,613	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	—	1,994	1,224	21,626	資本財
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	153	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	897	15,861	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	341	6,040	ヘルスケア機器・サービス
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	245	245	611	10,802	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	98	2,224	39,291	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	204	106	757	13,383	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	595	595	622	10,993	食品・飲料・タバコ
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	295	295	1,428	25,237	半導体・半導体製造装置
SONGCHEG PERFORMANCE DEVE-A	334	334	485	8,569	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	135	189	474	8,383	ソフトウェア・サービス
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	385	385	211	3,733	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	617	10,912	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	2,983	—	—	—	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	536	536	533	9,420	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	594	464	1,853	32,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	226	226	127	2,255	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)	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	1,044	18,443	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	417	7,370	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	303	303	743	13,134	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	557	557	397	7,025	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	635	11,227	ソフトウェア・サービス
GOERTEK INC -A	269	269	1,282	22,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	—	1,520	1,129	19,956	各種金融
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	806	806	572	10,108	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	240	240	883	15,605	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	—	168	362	6,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,020	1,020	635	11,225	耐久消費財・アパレル
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	199	199	143	2,534	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	793	793	475	8,404	消費者サービス
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	—	333	695	12,282	自動車・自動車部品
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	12	12	36	652	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	71	71	626	11,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	170	—	—	—	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	152	418	1,402	24,775	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,630	28,805	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	212	212	4,425	78,181	食品・飲料・タバコ
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	341	—	—	—	メディア・娯楽
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	641	641	417	7,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNING.COM CO LTD-A	458	458	202	3,575	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	574	10,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	547	547	515	9,102	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	185	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	585	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PING AN BANK CO LTD-A	1,194	1,194	2,093	36,973	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	381	381	639	11,304	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	1,164	20,569	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	978	17,283	不動産
ZTE CORP-A	126	126	396	7,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	801	801	563	9,946	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	432	432	677	11,965	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	1,210	21,387	各種金融
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	201	201	393	6,959	資本財
BYD CO LTD -A	—	97	3,110	54,948	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	500	500	328	5,793	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	—	124	1,901	33,594	素材
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	436	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	—	60	792	13,990	素材
LB GROUP CO LTD-A	—	153	413	7,308	素材
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	—	223	489	8,646	素材
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	165	165	119	2,113	メディア・娯楽
CHACHA FOOD CO LTD-A	100	100	560	9,892	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)	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	31	31	1,253	22,133	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	277	277	295	5,225	食品・飲料・タバコ
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	224	224	468	8,282	半導体・半導体製造装置
PERFECT WORLD CO LTD-A	228	228	418	7,394	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	48	16	384	6,790	食品・飲料・タバコ
GUOCHENG MINING CO LTD-A	311	—	—	—	資本財
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	—	170	1,321	23,342	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	80	80	443	7,837	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	185	185	711	12,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	690	—	—	—	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	218	218	372	6,577	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	825	825	337	5,960	半導体・半導体製造装置
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	—	233	2,033	35,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	—	161	1,290	22,788	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	38	2	76	1,346	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	1,178	20,813	食品・飲料・タバコ
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	248	248	192	3,391	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	137	203	1,223	21,615	運輸
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	—	63	909	16,073	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	602	602	429	7,592	各種金融
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	236	—	—	—	素材
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	455	455	329	5,819	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	269	269	333	5,892	ソフトウェア・サービス
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	—	28	514	9,092	耐久消費財・アパレル
CSC FINANCIAL CO LTD-A	241	241	689	12,175	各種金融
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	111	—	—	—	資本財
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	40	56	1,086	19,190	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	163	212	844	14,910	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	783	13,847	素材
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	437	437	553	9,772	各種金融
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	—	154	602	10,645	食品・生活必需品小売り
CHONGQING FULING ZHACAI-A	211	46	156	2,759	食品・飲料・タバコ
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	112	112	846	14,944	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	104	104	2,811	49,658	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	70	70	543	9,596	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUEWEI FOOD CO LTD-A	—	70	484	8,554	食品・飲料・タバコ
OPPEIN HOME GROUP INC-A	77	77	934	16,498	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	156	57	707	12,496	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	87	87	303	5,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	47	47	522	9,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	97	97	533	9,415	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	123	605	10,687	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	55	55	487	8,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	92	92	707	12,496	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	68	68	730	12,911	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)	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	441	441	448	7,930	各種金融
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	—	493	1,019	18,000	素材
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	28	28	311	5,508	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	427	427	412	7,286	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	451	451	522	9,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	53	84	3,110	54,945	ヘルスケア機器・サービス
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	—	974	904	15,983	消費者サービス
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	50	50	149	2,639	素材
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	30	30	660	11,670	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	139	72	454	8,023	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	14	21	730	12,907	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	134	134	8,887	157,001	資本財
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	44	62	1,030	18,203	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD-A	88	164	2,090	36,929	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	1,047	—	—	—	自動車・自動車部品
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	42	42	490	8,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	18	10	333	5,885	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	—	792	1,139	20,132	素材
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	—	70	1,122	19,832	半導体・半導体製造装置
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	—	282	974	17,209	資本財
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	29	54	1,512	26,708	半導体・半導体製造装置
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	—	38	925	16,355	資本財
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	—	168	433	7,665	食品・飲料・タバコ
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	946	946	375	6,634	各種金融
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	—	3,086	1,052	18,588	銀行
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	2,201	2,201	818	14,463	素材
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	—	379	1,534	27,114	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	467	467	495	8,752	各種金融
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	1,067	1,067	482	8,519	運輸
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	—	16	1,129	19,956	資本財
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	1,415	1,415	755	13,347	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	—	794	1,040	18,387	各種金融
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	—	101	662	11,707	食品・飲料・タバコ
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	—	78	420	7,432	ヘルスケア機器・サービス
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	—	174	1,590	28,093	半導体・半導体製造装置
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	—	51	1,089	19,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	—	30	568	10,048	食品・飲料・タバコ
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	—	20	1,183	20,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	—	48	1,396	24,663	ソフトウェア・サービス
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	—	10	938	16,569	耐久消費財・アパレル
PETROCHINA CO LTD-A	1,000	1,000	485	8,567	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,612	2,612	1,211	21,408	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	3,536	1,032	18,238	銀行
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	200	200	389	6,871	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	1,049	1,049	5,356	94,614	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)	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	668	668	3,319	58,633	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	952	952	1,743	30,791	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,383	1,383	1,181	20,863	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	2,736	2,736	1,058	18,703	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	944	16,675	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	76	76	13,604	240,309	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	989	989	457	8,088	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	432	432	1,105	19,520	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	182	182	504	8,918	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	444	444	205	3,631	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,340	1,340	2,725	48,145	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,223	—	—	—	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,289	1,289	427	7,559	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,109	2,109	963	17,025	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	1,102	—	—	—	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,194	1,194	659	11,642	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	343	343	1,448	25,588	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	580	580	255	4,507	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	1,664	—	—	—	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	387	387	244	4,313	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	294	294	1,115	19,704	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	730	286	488	8,631	各種金融
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	818	818	1,026	18,134	不動産
CRRC CORP LTD-A	790	1,858	1,112	19,659	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	317	381	1,897	33,524	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	534	208	1,044	18,459	素材
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	632	—	—	—	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	315	315	490	8,663	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	816	—	—	—	資本財
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	260	665	11,762	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	929	16,423	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	729	12,884	銀行
GEMDALE CORP-A	455	455	444	7,852	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	406	406	1,457	25,746	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	175	175	1,691	29,880	素材
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	182	182	62	1,099	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	823	—	—	—	メディア・娯楽
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	828	828	647	11,437	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	676	676	679	12,000	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	486	583	2,224	39,301	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	148	122	2,776	49,053	小売
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	1,198	21,172	素材
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	1,225	1,225	476	8,417	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,643	1,643	898	15,875	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	28	28	41	726	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)	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 CHINA LTD-A	259	259	232	4,103	運輸
TBEA CO LTD-A	—	225	559	9,881	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	—	3,309	1,250	22,094	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	1,155	20,410	資本財
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	—	552	1,166	20,599	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	265	4,691	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	160	160	465	8,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	1,140	1,140	543	9,605	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	917	16,201	自動車・自動車部品
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	236	236	303	5,369	素材
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	710	12,545	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	505	505	475	8,394	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	104	104	140	2,474	ヘルスケア機器・サービス
ZHONGJIN GOLD CORP-A	340	340	290	5,135	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	879	879	752	13,291	各種金融
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	72	72	145	2,571	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	1,789	31,605	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	409	—	—	—	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	405	405	164	2,897	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO-A	612	612	1,402	24,767	エネルギー
YUTONG BUS CO LTD-A	443	443	512	9,046	資本財
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	1,500	1,500	922	16,295	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	194	3,433	運輸
CHINA SPACESAT CO LTD -A	161	—	—	—	資本財
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	170	170	325	5,747	小売
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	—	603	865	15,284	食品・生活必需品小売り
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,400	—	—	—	不動産
SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	878	878	1,005	17,758	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	966	—	—	—	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	91	127	778	13,745	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	388	131	429	7,584	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	3,746	—	—	—	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	373	185	872	15,414	自動車・自動車部品
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	600	600	294	5,193	素材
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	—	228	237	4,196	資本財
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	39	39	1,649	29,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	195	195	229	4,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	67	93	2,832	50,040	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	208	208	366	6,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	909	1,090	449	7,938	エネルギー
KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A	—	304	384	6,793	素材
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	85	85	126	2,235	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	67	67	371	6,570	ソフトウェア・サービス
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	—	337	1,022	18,061	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	—	2,866	1,192	21,060	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)	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	234	234	678	11,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	115	115	427	7,554	食品・飲料・タバコ
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	—	1,547	1,762	31,125	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	90	90	191	3,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	310	—	—	—	運輸
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	243	243	569	10,052	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	1,595	28,177	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	47	61	452	7,985	ソフトウェア・サービス
JCET GROUP CO LTD-A	—	298	955	16,886	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	356	75	487	8,607	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	79	79	1,218	21,517	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	—	262	1,464	25,871	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	100	100	163	2,886	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	—	179	498	8,809	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	180	114	951	16,802	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	432	98	193	3,422	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	—	107	597	10,561	食品・飲料・タバコ
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	163	336	3,129	55,275	半導体・半導体製造装置
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	383	383	451	7,969	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	141	184	2,207	38,987	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	173	173	940	16,606	食品・飲料・タバコ
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	293	293	575	10,165	自動車・自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	—	188	1,438	25,405	資本財
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	723	1,236	21,839	各種金融
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	1,152	20,354	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	22	22	139	2,459	食品・飲料・タバコ
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	434	564	286	5,052	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	578	751	464	8,202	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	170	—	—	—	メディア・娯楽
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	—	392	1,636	28,914	自動車・自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	50	65	359	6,358	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	26	26	284	5,029	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	—	61	397	7,014	耐久消費財・アパレル
SDIC CAPITAL CO LTD-A	458	696	577	10,194	各種金融
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	47	20	441	7,795	ヘルスケア機器・サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	—	108	1,412	24,953	半導体・半導体製造装置
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	78	101	496	8,776	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	82	82	586	10,360	資本財
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	86	86	393	6,947	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	317	317	422	7,469	各種金融
CHIPENG JILONG GOLD MINING-A	—	788	1,341	23,705	素材
SPRING AIRLINES CO LTD-A	83	83	485	8,574	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	36	36	53	943	各種金融
DAWNING INFORMATION INDUST-A	56	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	110	110	692	12,227	商業・専門サービス

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)		
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,176	1,234	495	8,746	不動産	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	128	128	393	6,957	不動産	
小 計	131,897	141,292	282,069	4,982,624		
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	284	319	—	< 4.8% >	
(インド)			千インドルピー			
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,066	3,097	781,058	1,195,019	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	661	962	41,423	63,377	エネルギー	
ASIAN PAINTS LTD	322	422	132,737	203,089	素材	
EICHER MOTORS LTD	125	146	40,005	61,208	自動車・自動車部品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	756	1,016	90,703	138,777	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	9	9	26,335	40,293	素材	
ICICI BANK LTD	5,417	5,630	442,858	677,573	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	594	594	20,474	31,326	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	1,875	1,875	99,217	151,803	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	264	264	18,556	28,391	運輸	
LIC HOUSING FINANCE LTD	279	—	—	—	銀行	
TATA STEEL LTD	397	773	103,303	158,054	素材	
JSW STEEL LTD	802	802	54,324	83,115	素材	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	438	610	50,985	78,007	食品・飲料・タバコ	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	51	114	41,554	63,577	食品・飲料・タバコ	
NESTLE INDIA LIMITED	23	39	73,982	113,193	食品・飲料・タバコ	
GAIL INDIA LTD	1,747	1,747	26,328	40,283	公益事業	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	—	561	117,757	180,169	銀行	
VEDANTA LTD	1,987	1,472	46,912	71,775	素材	
TITAN INDUSTRIES LTD	328	407	102,445	156,742	耐久消費財・アパレル	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,527	2,527	39,586	60,567	エネルギー	
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	52	95	14,724	22,528	家庭用品・パーソナル用品	
LUPIN LTD	265	265	24,888	38,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACC LTD	—	53	13,491	20,641	素材	
BAJAJ FINANCE LTD	180	300	227,605	348,236	各種金融	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,774	1,873	551,041	843,092	銀行	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	794	—	—	—	メディア・娯楽	
INFOSYS LTD	3,655	3,708	646,209	988,700	ソフトウェア・サービス	
WIPRO LTD	1,187	1,449	95,414	145,984	ソフトウェア・サービス	
MRF LTD	—	1	10,441	15,975	自動車・自動車部品	
INDIAN OIL CORP LTD	1,937	1,937	27,068	41,415	エネルギー	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	871	892	217,096	332,158	家庭用品・パーソナル用品	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	—	101	45,845	70,143	ヘルスケア機器・サービス	
HCL TECHNOLOGIES LTD	1,220	1,231	144,443	220,998	ソフトウェア・サービス	
DABUR INDIA LTD	581	581	35,052	53,630	家庭用品・パーソナル用品	
HERO MOTOCORP LTD	103	122	33,218	50,823	自動車・自動車部品	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	—	88	22,050	33,737	自動車・自動車部品	
DR. REDDY'S LABORATORIES	126	126	60,594	92,709	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
IPCA LABORATORIES LTD	—	91	20,004	30,607	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BHARTI AIRTEL LTD	1,532	2,669	190,407	291,324	電気通信サービス	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
UNITED SPIRITS LTD	324	324	32,629	49,922	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	829	970	77,742	118,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	90	147	73,190	111,980	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	131	139	106,040	162,241	自動車・自動車部品
AUROBINDO PHARMA LTD	288	354	23,975	36,683	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	176	582	20,214	30,928	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	768	1,244	29,694	45,432	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	212	212	34,286	52,457	各種金融
PETRONET LNG LTD	837	837	19,738	30,199	エネルギー
CIPLA LTD	378	498	45,539	69,675	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	497	718	139,620	213,619	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	124	115	94,366	144,380	素材
BOSCH LTD	9	—	—	—	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	966	985	345,388	528,444	ソフトウェア・サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	—	269	44,122	67,507	資本財
NTPC LTD	2,600	5,131	71,067	108,733	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	117	117	32,502	49,729	各種金融
YES BANK LTD	—	10,201	13,364	20,447	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	735	735	31,711	48,517	素材
BHARAT FORGE LTD	303	303	25,290	38,693	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,213	1,805	83,860	128,306	素材
ITC LTD	3,884	2,890	66,122	101,168	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	122	181	43,533	66,606	素材
UNITED PHOSPHORUS LTD	542	542	40,455	61,896	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	61	61	17,397	26,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS INDIA LTD	59	59	14,272	21,837	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	64	78	48,851	74,742	メディア・娯楽
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	384	384	36,936	56,513	家庭用品・パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	480	721	112,432	172,021	ソフトウェア・サービス
MARICO LTD	424	424	23,960	36,660	家庭用品・パーソナル用品
PAGE INDUSTRIES LTD	6	6	23,901	36,569	耐久消費財・アパレル
DLF LTD	564	564	24,678	37,757	不動産
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	2,013	3,273	61,064	93,429	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	625	647	47,738	73,039	運輸
REC LTD	481	1,421	21,716	33,226	各種金融
BAJAJ FINSERV LTD	38	38	70,654	108,101	各種金融
BAJAJ AUTO LTD	83	58	22,083	33,788	自動車・自動車部品
JUBILANT FOODWORKS LTD	87	87	34,301	52,481	消費者サービス
MUTHOOT FINANCE LTD	—	124	20,237	30,963	各種金融
COAL INDIA LTD	1,473	1,803	30,745	47,040	エネルギー
TATA MOTORS LTD	1,900	1,900	96,875	148,219	自動車・自動車部品
INDUS TOWERS LTD	358	905	26,335	40,293	電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	—	81	22,697	34,726	素材
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	—	57	39,369	60,234	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	—	425	52,407	80,183	公益事業

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)
INDRAPRASTHA GAS LTD	132		267	13,201	20,198	公益事業
TRENT LTD	—		192	21,708	33,213	小売
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	740		945	66,759	102,142	保険
BHARAT ELECTRONICS LTD	—		1,162	25,676	39,284	資本財
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	40		40	10,945	16,746	各種金融
BANDHAN BANK LTD	748		748	22,959	35,128	銀行
ADANI TOTAL GAS LTD	—		269	42,447	64,944	公益事業
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	—		385	24,667	37,741	各種金融
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	—		310	33,588	51,390	各種金融
AXIS BANK LTD	2,447		2,478	184,639	282,497	銀行
HAVELLS INDIA LTD	234		234	31,150	47,659	資本財
BERGER PAINTS INDIA LTD	294		294	22,821	34,916	素材
ADANI TRANSMISSION LTD	—		272	50,638	77,477	公益事業
GRASIM INDUSTRIES LTD	417		315	58,765	89,910	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	175		175	83,364	127,547	食品・生活必需品小売り
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	235		235	35,519	54,344	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	317		317	20,667	31,620	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	83		83	18,017	27,566	運輸
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	414		537	64,913	99,318	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	66,506	90,365	7,905,721	12,095,754	
	銘柄数 <比率>	86	101	—	<11.6%>	
(パキスタン)				千パキスタンルピー		
LUCKY CEMENT	—		313	24,087	15,897	素材
MCB BANK LTD	533		533	8,358	5,516	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	730		—	—	—	エネルギー
HABIB BANK LTD	665		665	8,333	5,500	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	1,928	1,511	40,779	26,914	
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.0%>	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR NATIONAL BANK	4,897		4,844	10,173	314,559	銀行
COMMERCIAL BANK QSC	2,039		2,039	1,325	40,997	銀行
OOREDOO QSC	728		728	509	15,756	電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	573		604	1,129	34,929	エネルギー
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	624		624	1,061	32,810	公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	985		985	959	29,672	銀行
INDUSTRIES QATAR	1,967		1,967	3,101	95,894	資本財
QATAR ISLAMIC BANK	1,142		1,142	2,086	64,529	銀行
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	—		2,967	976	30,190	エネルギー
MASRAF AL RAYAN	4,065		4,065	2,015	62,310	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	2,074		2,074	672	20,786	不動産
MESALIEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,439		4,439	1,047	32,393	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	23,538	26,484	25,059	774,833	
	銘柄数 <比率>	11	12	—	<0.7%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	—		146	2,919	21,865	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)		
BIDVEST GROUP LTD	277	277	5,256	39,372	資本財	
CLICKS GROUP LTD	269	269	7,537	56,458	食品・生活必需品小売り	
DISCOVERY LIMITED	484	484	6,867	51,440	保険	
GOLD FIELDS LTD	971	971	13,876	103,937	素材	
REMGRO LTD	554	554	7,471	55,959	各種金融	
NORTHAM PLATINUM LTD	339	—	—	—	素材	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	563	563	3,062	22,940	素材	
EXXARO RESOURCES LTD	349	225	3,609	27,035	エネルギー	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	69	85	15,712	117,685	銀行	
MTN GROUP LTD	1,730	1,945	32,884	246,307	電気通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	447	394	11,261	84,351	素材	
FIRSTRAND LTD	5,258	5,603	32,986	247,066	各種金融	
NASPERS LTD-N SHS	468	232	59,207	443,462	小売	
NEDBANK GROUP LTD	380	444	7,471	55,964	銀行	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	73	61	9,374	70,213	素材	
SASOL LTD	572	572	15,469	115,865	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	584	600	11,296	84,608	食品・生活必需品小売り	
MR PRICE GROUP LTD	285	285	5,781	43,305	小売	
STANDARD BANK GROUP LTD	1,426	1,502	20,247	151,651	銀行	
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	232	4,566	34,200	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,104	1,104	6,282	47,057	小売	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	372	372	8,319	62,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABSA GROUP LTD	732	732	10,300	77,149	銀行	
TIGER BRANDS LTD	130	130	2,500	18,728	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	2,210	2,140	13,183	98,744	保険	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	882	917	17,433	130,573	素材	
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,209	16,550	素材	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	1,565	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	680	—	—	—	保険	
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	1,012	1,012	4,337	32,486	保険	
VODACOM GROUP	623	623	8,534	63,927	電気通信サービス	
NEPI ROCKCASTLE PLC	334	605	6,231	46,671	不動産	
OLD MUTUAL LTD	4,896	4,896	6,972	52,220	保険	
REINET INVESTMENTS SCA	171	171	4,672	34,995	各種金融	
PEPKOR HOLDINGS LTD	830	—	—	—	小売	
MULTICHOICE GROUP LTD	405	405	4,822	36,117	メディア・娯楽	
SIBANYE STILLWATER LTD	2,520	3,137	16,235	121,602	素材	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	—	339	6,984	52,314	素材	
BID CORP LTD	392	350	11,349	85,004	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	34,258 38	32,444 36	407,229 —	3,050,151 <2.9%>	
(アラブ首長国連邦)				千アラブ首長国 連邦ディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK	2,159	2,159	1,157	35,626	銀行	
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,850	3,850	1,882	57,953	不動産	

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)	
EMIRATES NBD PJSC	2,652	2,652	3,753	115,546	銀行
EMAAR MALLS PJSC	1,796	—	—	—	不動産
ABU DHABI ISLAMIC BANK	—	1,857	1,096	33,738	銀行
EMIRATES TELECOM GROUP CO	2,004	1,743	4,708	144,922	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	3,311	3,270	2,684	82,643	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,832	4,865	9,244	284,539	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC	5,094	3,675	1,539	47,400	不動産
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	—	2,714	1,167	35,921	小売
小 計	23,701	26,789	27,235	838,293	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8	9	—	<0.8%>	
(サウジアラビア)			千サウジアラビリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	265	265	1,927	58,108	素材
JARIR MARKETING CO	71	71	1,461	44,046	小売
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	66	66	551	16,622	保険
ETHAD ETISALAT CO	344	344	1,027	30,961	電気通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	717	944	3,119	94,034	銀行
AL RAJHI BANK	1,350	1,307	19,223	579,400	銀行
ARAB NATIONAL BANK	576	576	1,331	40,129	銀行
BANK ALBILAD	458	458	2,109	63,580	銀行
BANK AL-JAZIRA	358	358	679	20,487	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	690	675	3,224	97,196	銀行
RIYAD BANK	1,389	1,389	4,064	122,491	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP	1,016	—	—	—	銀行
SAUDI TELECOM CO	652	663	7,625	229,837	電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	239	242	4,225	127,342	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	975	973	12,422	374,406	素材
SAUDI CEMENT	74	74	446	13,452	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	922	922	2,411	72,684	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	210	210	726	21,897	素材
SAVOLA	253	253	904	27,261	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	319	319	775	23,384	素材
ALMARAI CO	301	301	1,572	47,403	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY	461	461	548	16,537	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	322	322	1,415	42,666	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	98	98	705	21,275	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	661	661	1,268	38,219	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	470	470	435	13,129	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE	235	235	640	19,313	エネルギー
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	—	268	358	10,795	電気通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	60	60	847	25,546	保険
ALINMA BANK	1,099	1,099	2,744	82,719	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	37	37	433	13,068	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO	449	449	3,553	107,109	素材
NATIONAL PETROCHEMICAL CO	—	136	589	17,752	素材
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	—	40	669	20,182	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期末		業種
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SAUDI AIRLINES CATERING CO	44	—	—	—	消費者サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	2,398	2,380	8,880	267,667	エネルギー
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	—	69	1,176	35,472	ヘルスケア機器・サービス
THE SAUDI NATIONAL BANK	1,593	2,364	15,841	477,466	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19,189 34	19,576 36	109,942 —	3,313,654 <3.2%>
(クウェート)			千クウェート・ディナール		
KUWAIT FINANCE HOUSE	—	5,142	433	162,507	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	—	2,150	128	48,111	電気通信サービス
NATIONAL BANK OF KUWAIT	—	7,228	737	276,376	銀行
AGILITY	—	1,429	144	54,110	運輸
MABANEE CO KPSC	—	670	56	20,995	不動産
BOUBYAN BANK K. S. C	—	1,300	104	39,329	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	— —	17,921 6	1,604 —	601,431 <0.6%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,692,452 1,180	2,773,728 1,239	— —	97,437,385 <93.6%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国新株予約権証券>

銘柄	証券数 (証券)	証券数 (証券)	期末		
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(タイ)			千タイバーツ		
BTS GROUP HOLDINGS PCL-CW22	—	40,475	57	197	
合計	証券数・金額 銘柄数<比率>	— —	40,475 1	57 —	197 <0.0%>

(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		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	308,400	308,400	6,451	35,825	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	58,400	6,450	35,817	
小 計	口 数 ・ 金 額 366,800	366,800	12,902	71,643	
	銘 柄 数 <比 率> 2	2	—	<0.1%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
SUL AMERICA SA-UNITS	26,962	—	—	—	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	58,600	45,900	1,549	31,866	
ENERGISA SA-UNITS	16,500	16,500	673	13,851	
KLABIN SA-UNIT	64,600	64,600	1,441	29,647	
BANCO INTER SA-UNITS	—	31,500	1,349	27,753	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	25,400	131,500	3,016	62,054	
小 計	口 数 ・ 金 額 192,062	290,000	8,029	165,173	
	銘 柄 数 <比 率> 5	5	—	<0.2%>	
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	295,047	478,733	6,391	47,869	
小 計	口 数 ・ 金 額 295,047	478,733	6,391	47,869	
	銘 柄 数 <比 率> 1	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 853,909	1,135,533	—	284,686	
	銘 柄 数 <比 率> 8	8	—	<0.3%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 MSCI EMERG M	6,443	—

(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	97,437,385	93.5
新 株 予 約 権 証 券	197	0.0
投 資 信 託 受 益 証 券	200,991	0.2
投 資 証 券	83,695	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,539,115	6.2
投 資 信 託 財 産 総 額	104,261,383	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(104,056,110千円)の投資信託財産総額(104,261,383千円)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=112.86円	1メキシコペソ=5.5529円	1ブラジルレアル=20.5709円
1チリペソ=0.142432円	1コロンビアペソ=0.029149円	1ユーロ=130.83円
1イギリスポンド=152.97円	1トルコリラ=11.5981円	1チェココルナ=5.1812円
1ハンガリーフォリント=0.362644円	1ポーランドズロチ=28.4806円	1香港ドル=14.49円
1マレーシアリンギット=27.1906円	1タイバーツ=3.44円	1フィリピンペソ=2.2521円
1インドネシアルピア=0.008円	1韓国ウォン=0.0958円	1新台幣ドル=4.0661円
1インドルピー=1.53円	1パキスタンルピー=0.66円	1カタールリアル=30.92円
1南アフリカランド=7.49円	1アラブ首長国連邦ディルハム=30.78円	1サウジアラビアリアル=30.14円
1クウェート・ディナール=374.83円	1香港・オフショア人民元=17.6645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 2021年11月10日現在
(A)資 産	104,348,859,892円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,142,318,509
株 式(評価額)	97,437,385,523
新株予約権証券(評価額)	197,712
投資信託受益証券(評価額)	200,991,203
投資証券(評価額)	83,695,030
未 収 入 金	111,675,621
未 収 配 当 金	82,978,857
差 入 委 託 証 拠 金	1,289,617,437
(B)負 債	216,411,975
未 払 金	196,104,538
未 払 解 約 金	20,307,222
未 払 利 息	215
(C)純 資 産 総 額(A-B)	104,132,447,917
元 本	28,114,813,263
次 期 繰 越 損 益 金	76,017,634,654
(D)受 益 権 総 口 数	28,114,813,263口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,038円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日
(A)配 当 等 収 益	1,940,637,691円
受 取 配 当 金	1,938,941,104
受 取 利 息	1,719,950
そ の 他 収 益 金	275,626
支 払 利 息	△298,989
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	11,960,993,228
売 買 益	23,245,174,338
売 買 損	△11,284,181,110
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	107,396,481
取 引 損	702,878,366
取 引 益	△595,481,885
(D)そ の 他 費 用	△144,807,831
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	13,864,219,569
(F)前 期 繰 越 損 益 金	56,434,361,358
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	12,515,270,479
(H)解 約 差 損 益 金	△6,796,216,752
(I)計 (E+F+G+H)	76,017,634,654
次 期 繰 越 損 益 金(I)	76,017,634,654

(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26,069,398,222円、期中追加設定元本額は4,711,515,456円、期中一部解約元本額は2,666,100,415円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,711,696,092円
DC新興国株式インデックス・オープン	5,108,045,604円
DC世界経済インデックスファンド	4,989,360,031円
世界経済インデックスファンド	4,855,658,021円
分散投資コア戦略ファンドS	1,291,777,359円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	817,704,272円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	665,946,316円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	571,010,419円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	474,869,833円
グローバル経済コア	352,275,605円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	324,344,522円
分散投資コア戦略ファンドA	223,488,884円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	209,811,818円
SMT 世界経済インデックス・オープン	131,975,703円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	123,078,811円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	86,295,499円
SMT インデックスバランス・オープン	82,918,447円
i-SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	35,900,151円
私募世界経済バシンプファンド(適格機関投資家専用)	16,877,329円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	15,903,844円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	8,003,862円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	5,548,514円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,383,777円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,378,675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)	2,841,596円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,718,279円

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第18期(2018年5月29日)	円 13,934	% 0.8	382.463	% 0.8	% 99.9	百万円 379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390.052	2.0	99.7	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388.127	△0.5	100.5	540,159
第21期(2021年5月31日)	14,082	△0.4	386.621	△0.4	99.8	628,366
第22期(2022年5月30日)	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8	624,929

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1)騰落率は期首比です。

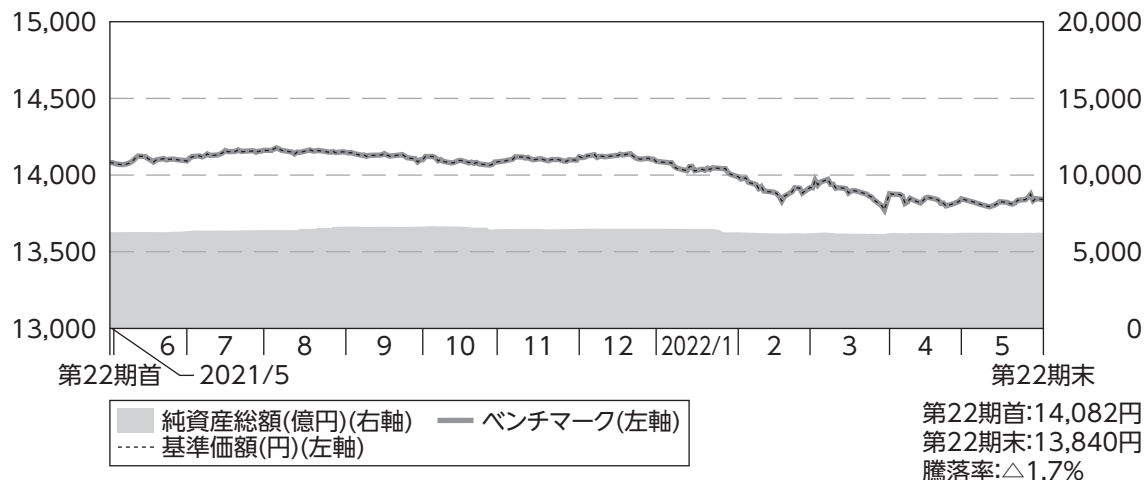
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

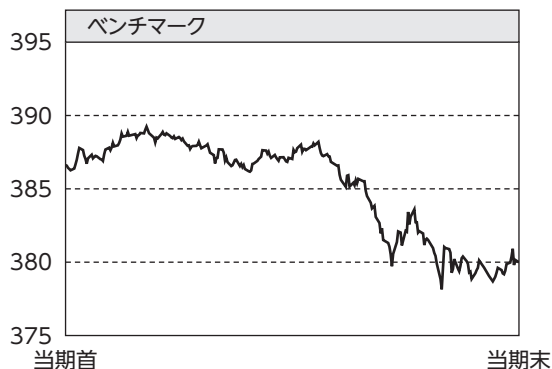


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

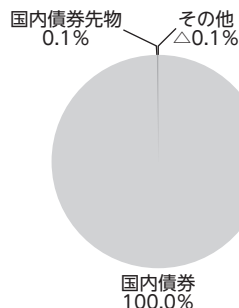
○上位10銘柄

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

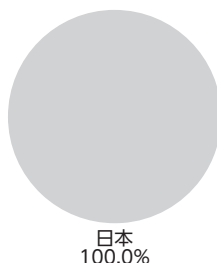
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%
9	第150回利付国債(5年)	日本	0.9%
10	第145回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数		992	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

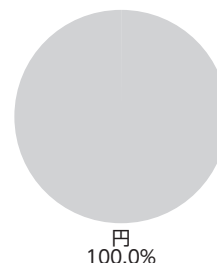
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

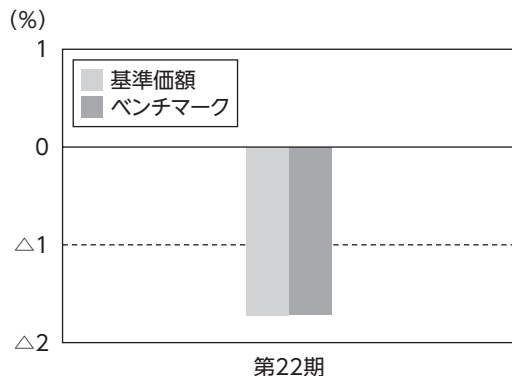


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<公社債>

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

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

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

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 296,828	百万円 6,676	% 2.2	百万円 296,847	百万円 6,445	% 2.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	503,715,000 (-)	523,319,672 (-)	83.7 (-)	- (-)	54.5 (-)	20.2 (-)	9.0 (-)
地 方 債 証 券	32,361,680 (32,361,680)	33,511,126 (33,511,126)	5.4 (5.4)	- (-)	3.3 (3.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	33,652,796 (33,652,796)	34,709,232 (34,709,232)	5.6 (5.6)	- (-)	3.3 (3.3)	1.2 (1.2)	1.1 (1.1)
金 融 債 証 券	2,200,000 (2,200,000)	2,200,178 (2,200,178)	0.4 (0.4)	- (-)	- (-)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	30,126,000 (30,126,000)	30,041,507 (30,041,507)	4.8 (4.8)	- (-)	2.2 (2.2)	1.8 (1.8)	0.8 (0.8)
合 計	602,055,476 (98,340,476)	623,781,716 (100,462,043)	99.8 (16.1)	- (-)	63.3 (8.8)	24.8 (4.6)	11.7 (2.7)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

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

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

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

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

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

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第86回利付国債(20年)	2.3	510,000	555,237	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,830,000	1,985,348	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	459,631	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	381,608	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	690,284	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	495,000	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	964,629	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	449,380	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	671,518	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	680,570	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,757,578	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	446,344	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	488,642	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,290,000	1,438,517	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	540,019	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	812,683	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,438,731	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	454,328	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	179,798	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,330,827	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	430,958	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	294,348	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	738,579	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	583,830	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,249,908	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,112,696	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	900,679	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	2,020,000	2,311,364	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,675,445	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	809,025	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,728,236	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,244,343	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	757,772	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	600,071	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,752,559	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,714,665	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,066,815	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,870,000	2,175,277	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	704,434	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,770,000	2,081,626	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	845,858	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,173,040	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,118,148	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	740,000	846,426	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,285,000	1,473,522	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,137,570	2031/9/20

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

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

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

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

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

銘 柄 名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第22回大阪府公募公債 (20年)	0.347	300,000	292,452	2036/5/30
第24回大阪府公募公債 (20年)	0.655	100,000	101,234	2037/4/21
平成25年度第8回大阪府公募公債	0.767	100,000	101,266	2024/1/31
令和3年度第2回大阪府公募公債	0.16	200,000	197,810	2031/5/21
第1回名古屋市公募公債 (30年)	2.53	100,000	125,341	2035/3/20
第5回名古屋市公募公債 (30年)	2.49	100,000	128,851	2039/3/18
第9回名古屋市公募公債 (20年)	2.07	100,000	112,326	2028/12/20
第11回名古屋市公募公債 (30年)	1.774	100,000	117,637	2044/9/20
第49回名古屋市公募公債 (10年)	0.225	100,000	100,725	2027/3/26
第512回名古屋市公募公債 (10年)	0.15	300,000	297,864	2030/6/20
平成28年度第6回京都市公募公債	0.18	200,000	201,072	2027/1/27
平成18年度第3回神戸市公募公債 (20年)	2.54	120,000	132,091	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公募公債 (20年)	2.38	200,000	226,606	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公募公債 (20年)	2.233	100,000	115,180	2030/1/29
平成24年度第12回神戸市公募公債 (20年)	1.711	100,000	113,960	2032/12/17
令和2年度第9回神戸市公募公債 (30年)	0.674	100,000	90,854	2050/6/20
令和3年度第6回神戸市公募公債 (30年)	0.713	100,000	91,370	2051/6/20
第5回横浜市公募公債 (20年)	2.17	100,000	106,540	2025/6/20
第20回横浜市公募公債 (20年)	2.1	300,000	341,298	2029/10/19
平成28年度第4回横浜市公募公債	0.175	100,000	100,511	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公募公債	0.24	100,000	100,747	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公募公債	0.195	100,000	100,379	2028/4/17
平成30年度第4回横浜市公募公債	0.289	100,000	100,815	2028/10/17
第30回横浜市公募公債 (20年)	1.376	200,000	222,130	2034/10/20
令和2年度第1回横浜市公募公債	0.15	300,000	297,987	2030/6/12
令和3年度第2回横浜市公募公債	0.16	100,000	98,905	2031/5/23
平成23年度第9回札幌市公募公債 (15年)	1.493	100,000	106,679	2027/2/12
平成26年度第9回札幌市公募公債 (10年)	0.43	100,000	101,048	2024/12/20
第11回川崎市公募公債 (20年)	1.84	100,000	113,062	2030/10/18
第89回川崎市公募公債	0.16	100,000	100,454	2026/12/18
第93回川崎市公募公債	0.105	100,000	98,778	2030/9/20
平成26年度第2回北九州市公募公債	0.451	100,000	101,107	2024/12/24
平成27年度第2回北九州市公募公債	0.484	100,000	101,575	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公募公債	0.08	100,000	100,115	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市公募公債 (20年)	2.14	100,000	113,927	2029/9/18
平成25年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.511	100,000	112,377	2034/2/17
平成26年度第5回福岡市公募公債	0.539	200,000	202,504	2024/10/28
平成30年度第5回福岡市公募公債 (5年)	0.03	200,000	200,046	2023/8/17
平成30年度第10回福岡市公募公債 (5年)	0.02	100,000	100,014	2023/12/26
平成25年度第3回広島市公募公債	0.67	150,000	151,719	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公募公債	0.456	100,000	101,121	2024/12/25
平成28年度第4回広島市公募公債	0.165	105,000	105,478	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公募公債	0.23	170,000	171,016	2028/2/25
令和元年度第6回広島市公募公債	0.115	550,000	545,391	2030/2/25
令和2年度第3回広島市公募公債 (5年)	0.02	200,000	199,868	2025/10/24

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

投資信託財産の構成

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

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

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

※担保に供している資産

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

国債証券 100,347,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

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

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1)騰落率は期首比です。

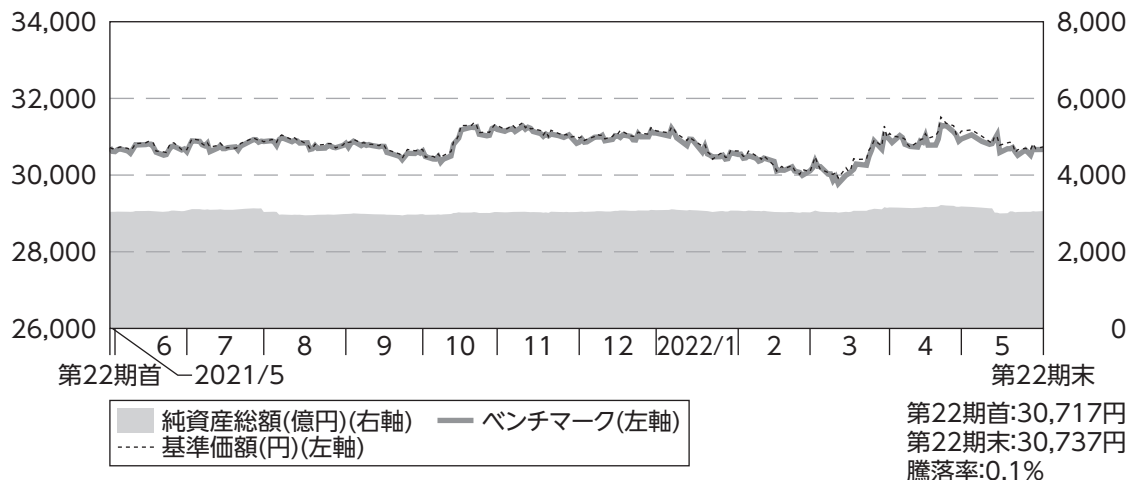
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

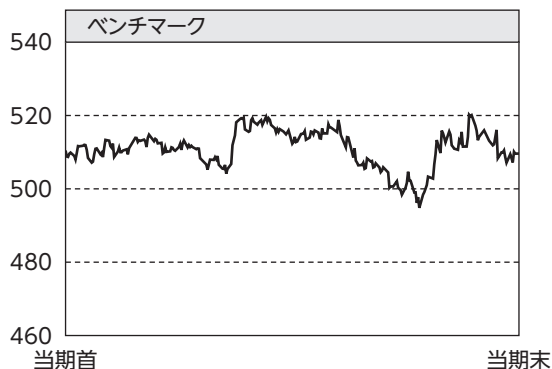


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

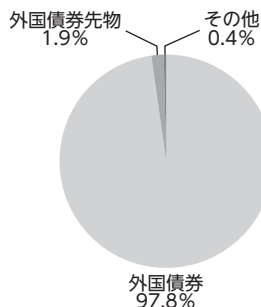
○上位10銘柄

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

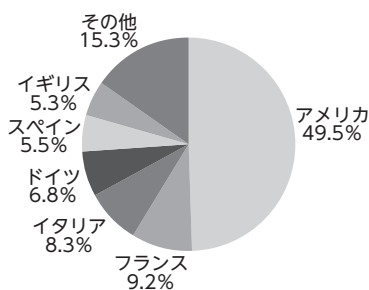
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
8	T 2% 08/15/51	アメリカ	0.5%
9	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
10	T 0.25% 09/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		826	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

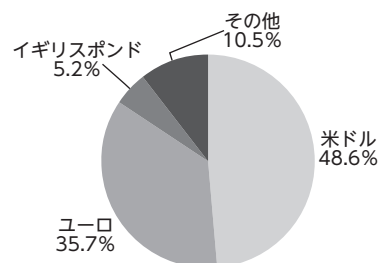
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

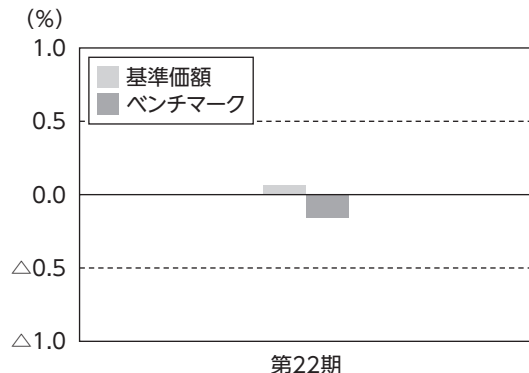


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(プラス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(30,845円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

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

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

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

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

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

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

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

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.125% 01/15/24	0.125	10,000	9,651	1,225,966	2024/1/15
T 0.125% 02/15/24	0.125	4,710	4,536	576,203	2024/2/15
T 0.125% 05/15/23	0.125	7,500	7,366	935,755	2023/5/15
T 0.125% 05/31/23	0.125	6,800	6,670	847,254	2023/5/31
T 0.125% 07/31/23	0.125	5,000	4,885	620,611	2023/7/31
T 0.125% 09/15/23	0.125	8,060	7,851	997,286	2023/9/15
T 0.125% 10/15/23	0.125	8,000	7,774	987,501	2023/10/15
T 0.125% 12/15/23	0.125	3,250	3,144	399,406	2023/12/15
T 0.25% 03/15/24	0.25	13,000	12,517	1,589,982	2024/3/15
T 0.25% 05/15/24	0.25	10,000	9,583	1,217,233	2024/5/15
T 0.25% 06/15/23	0.25	8,000	7,850	997,146	2023/6/15
T 0.25% 06/15/24	0.25	9,000	8,603	1,092,808	2024/6/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	1,000	928	117,969	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	5,200	4,818	612,024	2025/7/31
T 0.25% 09/30/23	0.25	12,000	11,697	1,485,836	2023/9/30
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,500	6,919	878,894	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,314	421,065	2025/10/31
T 0.25% 11/15/23	0.25	11,000	10,687	1,357,541	2023/11/15
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,349	933,557	2026/1/31
T 0.375% 04/15/24	0.375	7,000	6,736	855,693	2024/4/15
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,491	951,578	2025/4/30
T 0.375% 07/15/24	0.375	9,010	8,618	1,094,693	2024/7/15
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,878	619,607	2027/7/31
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,000	4,771	606,073	2024/8/15
T 0.375% 09/15/24	0.375	6,600	6,283	798,085	2024/9/15
T 0.375% 09/30/27	0.375	8,000	7,059	896,721	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,767	351,557	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,683	467,830	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	11,500	10,593	1,345,640	2026/2/28
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	6,800	863,743	2025/3/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,639	335,278	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,135	398,254	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	3,100	2,771	352,001	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,148	526,987	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,646	844,286	2027/10/31
T 0.625% 03/31/27	0.625	4,500	4,072	517,288	2027/3/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	14,100	11,988	1,522,754	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	8,000	7,338	932,168	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	10,105	1,283,564	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,227	282,991	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	10,000	8,891	1,129,386	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,599	965,292	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	11,000	10,214	1,297,395	2026/3/31
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,000	2,781	353,343	2026/4/30
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,700	470,093	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	11,830	10,891	1,383,432	2026/8/31
T 0.75% 11/15/24	0.75	10,860	10,388	1,319,517	2024/11/15
T 0.75% 12/31/23	0.75	3,370	3,288	417,732	2023/12/31
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,429	943,639	2026/6/30
T 0.875% 09/30/26	0.875	6,000	5,545	704,425	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,600	1,219,433	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,293	799,427	2028/7/31
T 1% 12/15/24	1.0	8,000	7,689	976,664	2024/12/15
T 1.125% 01/15/25	1.125	6,800	6,546	831,480	2025/1/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	15,050	13,192	1,675,681	2031/2/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 1.125% 02/28/25	1.125	8,500	8,165	1,037,157	2025/2/28
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,302	927,563	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,236	157,099	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	7,300	5,245	666,313	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	10,210	9,242	1,173,924	2028/8/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,150	4,726	600,338	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,333	931,532	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	8,650	5,721	726,702	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	8,000	7,326	930,619	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,500	8,685	1,103,272	2028/6/30
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,504	572,218	2023/7/31
T 1.25% 08/15/31	1.25	16,120	14,179	1,801,055	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	14,500	13,212	1,678,259	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,563	833,638	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,675	847,881	2026/12/31
T 1.375% 01/31/25	1.375	4,000	3,872	491,884	2025/1/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,962	630,324	2023/6/30
T 1.375% 08/15/50	1.375	9,900	6,767	859,617	2050/8/15
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,475	314,442	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	3,957	502,691	2023/9/30
T 1.375% 11/15/31	1.375	18,030	15,983	2,030,200	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	4,496	571,113	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	4,900	4,491	570,563	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,676	720,977	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,922	752,221	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	7,500	7,131	905,836	2026/8/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,299	1,054,238	2024/9/30
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,928	880,010	2028/11/30
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,787	989,194	2026/2/15
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,177	276,587	2026/5/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	11,150	10,170	1,291,906	2031/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	995	126,481	2023/5/31
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,263	795,626	2029/8/15
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,479	314,883	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,671	339,276	2026/10/31
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	5,042	640,484	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,558	578,979	2026/11/30
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,680	467,504	2023/5/15
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,364	300,394	2024/6/30
T 1.75% 08/15/41	1.75	14,500	11,494	1,460,050	2041/8/15
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,805	356,291	2029/11/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	6,453	819,699	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	5,138	652,654	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	4,000	3,849	488,927	2027/2/28
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,019	637,576	2026/7/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	5,913	751,194	2024/8/31
T 1.875% 11/15/51	1.875	9,300	7,243	920,111	2051/11/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,324	1,057,420	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,021	510,858	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,179	784,982	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,281	416,765	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,446	691,842	2024/6/30
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	6,747	857,014	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	15,150	12,151	1,543,541	2051/8/15
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	9,897	1,257,171	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	5,700	4,717	599,234	2041/11/15
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,078	645,031	2024/2/29

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,363	935,321	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,364	300,370	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,519	447,108	2026/5/31
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,763	605,004	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	5,000	4,952	629,071	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,674	339,715	2023/11/30
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	3,993	507,216	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,753	1,111,916	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	2,300	1,965	249,670	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,375	936,834	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	6,976	886,153	2024/4/30
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	5,598	711,121	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	8,338	1,059,125	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	4,190	3,510	445,895	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	4,687	595,401	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,252	794,255	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,067	1,278,828	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,335	550,744	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,451	946,499	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,496	571,121	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	5,400	5,352	679,933	2024/12/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	5,761	731,778	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,568	326,291	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,690	2,643	335,757	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	7,812	992,312	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	5,050	4,429	562,672	2051/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	4,984	633,115	2024/8/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	6,100	5,345	678,998	2049/11/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	3,470	3,477	441,766	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,984	633,164	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	1,710	1,506	191,360	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,000	3,524	447,705	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	7,909	1,004,692	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	5,050	4,447	564,927	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,570	580,514	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,677	594,118	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	13,340	13,213	1,678,428	2029/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,251	921,038	2025/3/31
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	4,928	626,032	2023/6/30
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,518	446,905	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,807	737,610	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,019	383,493	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,544	831,298	2028/2/15
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	3,906	496,206	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,516	700,683	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,007	127,977	2023/7/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,300	1,211	153,876	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,754	476,893	2047/8/15
T 2.75% 08/31/23	2.75	1,500	1,511	191,947	2023/8/31
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,915	878,457	2025/8/31
T 2.75% 11/15/23	2.75	2,320	2,336	296,838	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	3,920	3,646	463,141	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,834	359,989	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,025	511,295	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	7,297	926,920	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	4,150	3,934	499,746	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	5,388	684,452	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,845	488,438	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,496	698,107	2025/7/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 2.875% 08/15/28	2.875	3,920	3,938	500,213	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	2,167	275,370	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	4,792	608,801	2023/9/30
T 2.875% 10/31/23	2.875	7,900	7,972	1,012,630	2023/10/31
T 2.875% 11/15/46	2.875	2,500	2,363	300,233	2046/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,056	515,277	2023/11/30
T 2.875% 11/30/25	2.875	7,500	7,544	958,306	2025/11/30
T 3% 02/15/47	3.0	800	774	98,376	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	4,346	552,035	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	5,000	4,942	627,855	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	1,576	200,226	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	2,500	2,406	305,666	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	3,108	394,865	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	5,346	679,116	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,243	538,985	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,050	641,475	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,694	342,263	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	1,043	132,495	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,000	1,974	250,824	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	5,948	755,641	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	4,140	4,071	517,153	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	8,564	1,087,890	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	1,741	221,190	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	3,083	391,649	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	5,587	709,758	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	826	104,949	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	2,555	324,544	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,130	270,631	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,172	275,990	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	3,256	413,688	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,611	204,683	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,055	134,118	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	2,731	346,979	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,191	151,391	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,294	286,306	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,258	291,905	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,960	3,516	446,622	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,312	166,715	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	664	84,378	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,053	260,807	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,689	214,576	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	928	117,949	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,390	176,671	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,489	189,230	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,345	297,923	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,897	240,977	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,694	215,259	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,313	166,828	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,732	220,021	2023/8/15
小 計				147,572,910	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,090	208,797	2026/3/1
CAN 0.25% 04/01/24	0.25	2,400	2,303	230,069	2024/4/1
CAN 0.25% 05/01/23	0.25	2,600	2,549	254,663	2023/5/1
CAN 0.25% 08/01/23	0.25	1,360	1,326	132,435	2023/8/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	2,480	2,320	231,717	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,590	2,145	214,263	2030/12/1
CAN 0.75% 02/01/24	0.75	1,300	1,262	126,121	2024/2/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
CAN 0.75% 10/01/24	0.75	700	671	67,069	2024/10/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	749	74,820	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,431	142,965	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	1,440	1,390	138,832	2025/3/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	2,980	2,797	279,362	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,230	322,599	2030/6/1
CAN 1.5% 05/01/24	1.5	490	480	47,982	2024/5/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,060	105,892	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,304	130,316	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,970	3,565	356,125	2031/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	1,200	1,172	117,143	2024/9/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	4,170	3,724	371,926	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,830	1,431	142,965	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,263	126,165	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,290	1,199	119,834	2032/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	3,460	3,441	343,694	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	4,710	3,959	395,436	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,290	228,798	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,784	178,225	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,260	1,224	122,302	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,330	1,329	132,777	2024/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,650	1,626	162,468	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	760	743	74,253	2064/12/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,300	1,438	143,629	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,216	121,477	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	420	526	52,539	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,396	139,447	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	960	1,222	122,042	2033/6/1
小 計				6,159,165	
(メキシコ)					
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	9,578	62,216	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,560	31,259	203,043	2024/12/5
MBONO 5% 03/06/25	5.0	3,700	3,345	21,731	2025/3/6
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	12,500	10,952	71,137	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	47,710	43,077	279,804	2026/3/5
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	37,190	241,570	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	35,980	34,318	222,909	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,040	21,796	141,574	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	10,600	9,984	64,850	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	33,794	219,508	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	28,400	26,256	170,547	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	29,070	28,706	186,461	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	38,660	38,526	250,245	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	26,670	26,331	171,033	2038/11/18
小 計				2,306,634	
(ドイツ)					
国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0% 06/16/23	—	1,090	1,090	148,683	2023/6/16
BKO 0% 09/15/23	—	3,150	3,149	429,266	2023/9/15
BKO 0% 12/15/23	—	1,880	1,879	256,163	2023/12/15
DBR 0% 02/15/30	—	2,470	2,319	316,192	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	3,120	2,891	394,094	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	2,790	2,542	346,559	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,260	1,954	266,411	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	3,380	2,880	392,523	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,248	579,018	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,306	450,612	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	4,190	3,911	533,085	2030/8/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
DBR 0% 08/15/30	—	670	626	85,386	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	3,450	3,172	432,368	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	4,420	3,142	428,607	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	1,260	868	118,378	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,960	2,851	388,612	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	—	2,500	2,383	324,806	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	3,825	521,362	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,080	2,977	405,849	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,630	2,553	347,986	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,080	3,089	421,053	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,998	408,604	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	3,680	3,636	495,603	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	1,940	1,922	262,046	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,029	276,606	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,640	3,702	504,613	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	3,631	494,871	2048/8/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,065	417,794	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,345	319,728	2024/5/15
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,695	231,015	2024/2/15
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	2,931	399,530	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,360	4,226	575,994	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,810	4,894	667,058	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,230	3,048	415,504	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,060	553,415	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,150	3,170	432,153	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,167	431,633	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,990	4,258	684,371	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,480	3,913	533,305	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	3,933	536,102	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,001	409,109	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,551	484,000	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,751	238,735	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,266	172,548	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	3,330	3,316	452,309	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	3,007	409,924	2026/4/10
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,705	505,072	2025/4/11
OBL 0% 04/16/27	—	1,100	1,065	145,211	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	2,900	2,824	384,933	2026/10/9
OBL 0% 10/10/25	—	3,500	3,444	469,497	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,510	205,886	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,410	2,389	325,709	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	986	134,475	2024/1/15
BTPS 0% 01/30/24	—	940	927	126,384	2024/1/30
BTPS 0% 04/01/26	—	1,460	1,362	185,735	2026/4/1
BTPS 0% 04/15/24	—	3,000	2,944	381,508	2024/4/15
BTPS 0% 08/01/26	—	2,580	2,389	325,607	2026/8/1
BTPS 0% 08/15/24	—	1,500	1,461	199,225	2024/8/15
BTPS 0% 12/15/24	—	2,900	2,799	381,502	2024/12/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,503	204,934	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	2,900	2,896	394,822	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	564	76,983	2025/2/1
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	2,070	1,820	248,059	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,829	249,357	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	2,280	2,052	279,685	2028/7/15
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,114	151,838	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,599	354,231	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	670	671	91,483	2023/10/15

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,144	292,291	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,230	1,903	259,443	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	767	104,620	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,550	2,125	289,726	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,952	266,072	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,248	306,468	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,805	246,074	2031/12/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,898	258,799	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	1,773	241,708	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,700	1,400	190,940	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,296	312,937	2025/5/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,407	328,083	2024/11/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	913	124,460	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,412	328,751	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	2,812	383,301	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	2,713	369,837	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,337	318,565	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,680	1,190	162,262	2051/9/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,000	1,012	137,978	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	2,260	1,816	247,545	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,450	2,489	339,326	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,723	371,224	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,246	306,111	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,116	288,415	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	2,741	373,572	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,236	441,104	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	524	71,506	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	920	713	97,258	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,303	314,003	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	1,672	227,938	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	2,522	343,851	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,810	1,532	208,806	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,910	2,984	406,721	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,035	413,703	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,037	413,988	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,210	2,023	275,803	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,130	984	134,236	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	3,190	3,289	448,325	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,012	274,222	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,483	474,823	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,407	191,790	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	1,967	268,213	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,820	1,885	256,989	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,195	299,171	2048/3/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,246	578,745	2030/3/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,274	309,942	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,860	2,046	278,917	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,550	3,947	537,945	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	2,926	398,863	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,297	313,172	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,720	507,068	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	3,838	523,087	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	3,011	410,499	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,100	2,607	355,411	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,660	4,022	548,219	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,970	3,600	490,764	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,240	2,811	383,187	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,000	3,739	509,627	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,262	580,896	2029/11/1

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,881	392,692	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	2,940	3,714	506,243	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,600	4,432	604,159	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,726	235,326	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	895	122,005	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/24	—	4,850	4,832	658,613	2024/2/25
FRTR 0% 02/25/25	—	2,050	2,016	274,790	2025/2/25
FRTR 0% 02/25/26	—	5,210	5,067	690,629	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	—	3,560	3,413	465,192	2027/2/25
FRTR 0% 03/25/24	—	3,750	3,730	508,414	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	6,390	6,286	856,845	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/32	—	1,970	1,701	231,957	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	4,815	656,351	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	—	6,040	5,412	737,604	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	—	4,990	4,570	595,606	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,356	621,011	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,590	5,571	759,369	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	6,690	6,617	901,859	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,350	5,131	699,336	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	3,160	2,497	340,363	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	505	68,870	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,980	1,474	200,979	2044/6/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	6,290	6,194	844,233	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	3,350	2,387	325,375	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	2,060	1,438	196,047	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	5,850	5,738	782,068	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	4,671	636,676	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,380	5,335	727,231	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,090	3,919	534,147	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	5,130	4,819	656,812	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,770	6,880	937,769	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,590	3,202	436,497	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,380	5,470	745,536	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	1,614	220,066	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,320	3,314	451,727	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,289	584,633	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,560	3,571	486,706	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,253	579,648	2024/5/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	7,180	7,899	1,076,653	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,110	5,600	763,251	2027/10/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,400	4,221	575,340	2045/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	5,050	5,589	761,736	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,420	3,507	478,066	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	2,030	3,029	412,822	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	4,437	604,738	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,650	5,980	815,070	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,520	6,363	867,346	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,630	4,942	673,618	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	6,685	911,164	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	6,135	836,189	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,241	305,512	2025/10/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/24	—	2,230	2,224	303,109	2024/1/15
NETHER 0% 01/15/26	—	790	770	104,999	2026/1/15
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,774	241,871	2027/1/15
NETHER 0% 01/15/29	—	1,390	1,300	177,218	2029/1/15

当		期 末			
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NETHER 0% 01/15/38	—	960	759	103,546	2038/1/15
NETHER 0% 01/15/52	—	1,490	970	132,283	2052/1/15
NETHER 0% 07/15/30	—	1,500	1,374	187,376	2030/7/15
NETHER 0% 07/15/31	—	1,820	1,643	224,026	2031/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,310	2,287	311,794	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,570	1,488	202,810	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,040	877	119,628	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,320	2,302	313,783	2026/7/15
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	700	650	88,655	2032/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,560	1,554	211,919	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,700	1,683	229,482	2028/7/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,540	1,571	214,222	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,059	280,685	2024/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,020	2,263	308,452	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,330	2,963	403,870	2047/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,250	3,096	422,045	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,180	2,900	395,254	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,730	2,170	295,792	2028/1/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/25	—	2,280	2,230	304,047	2025/1/31
SPGB 0% 01/31/26	—	2,720	2,613	356,154	2026/1/31
SPGB 0% 01/31/27	—	1,560	1,469	200,210	2027/1/31
SPGB 0% 01/31/28	—	1,930	1,782	242,975	2028/1/31
SPGB 0% 04/30/23	—	1,630	1,629	222,134	2023/4/30
SPGB 0% 05/31/24	—	2,110	2,086	284,420	2024/5/31
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	3,180	2,721	370,974	2031/4/30
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,271	309,541	2024/7/30
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	3,590	3,599	490,607	2023/7/30
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,400	3,105	423,196	2030/4/30
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,960	1,717	234,012	2031/10/31
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,950	2,743	373,891	2029/10/31
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,939	264,304	2032/4/30
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,374	323,635	2027/7/30
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,172	159,733	2037/7/30
SPGB 1% 07/30/42	1.0	650	498	67,899	2042/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,470	1,665	227,027	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,260	1,831	249,547	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	2,927	398,928	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,750	2,768	377,327	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	3,070	3,067	418,033	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,570	3,559	485,163	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,672	364,295	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	3,040	3,055	416,405	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	411	56,085	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	2,650	2,677	364,946	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,113	424,401	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,750	2,625	357,890	2035/7/30
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	900	740	100,897	2052/10/31
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	2,899	395,210	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,990	2,024	275,852	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	2,922	398,309	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,501	340,954	2033/7/30
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	1,886	257,131	2048/10/31
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,050	3,202	436,468	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,200	2,338	318,655	2046/10/31
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,780	1,991	271,421	2066/7/30
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,677	364,950	2024/4/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,135	427,272	2037/1/31

当		期 末			
銘 柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	2,845	387,803	2023/10/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,169	431,986	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,240	3,023	412,400	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,574	350,934	2024/1/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,250	3,089	421,055	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,490	4,272	582,321	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,740	2,536	345,721	2044/10/31
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,860	3,862	526,379	2032/7/30
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,060	2,462	335,566	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,353	184,487	2029/1/31
(ベルギー)					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	—	430	409	55,791	2027/10/22
BGB 0% 10/22/31	—	1,680	1,466	199,874	2031/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,248	170,202	2030/6/22
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,030	1,032	140,714	2023/10/22
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	480	426	58,155	2032/6/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	1,240	940	128,203	2040/6/22
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,621	220,984	2024/10/22
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	342	46,726	2071/6/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,680	2,694	367,273	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,682	229,337	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,260	1,245	169,796	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,560	1,535	209,208	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,301	313,277	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	2,770	2,680	365,374	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,465	199,771	2033/4/22
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	610	502	68,507	2053/6/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	755	102,910	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,240	1,114	151,856	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,300	1,176	160,368	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,048	142,941	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	780	767	104,661	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,180	1,208	164,661	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	784	106,922	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,239	305,170	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,180	160,866	2034/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,566	213,503	2045/6/22
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,331	181,434	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,870	2,509	342,065	2041/3/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,305	177,978	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,290	3,149	429,296	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,507	478,014	2028/3/28
(オーストリア)					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	—	1,450	1,311	178,783	2030/2/20
RAGB 0% 02/20/31	—	1,640	1,453	198,110	2031/2/20
RAGB 0% 04/20/25	—	930	914	124,622	2025/4/20
RAGB 0% 07/15/23	—	1,120	1,120	152,760	2023/7/15
RAGB 0% 07/15/24	—	1,440	1,430	194,985	2024/7/15
RAGB 0% 10/20/40	—	670	477	65,042	2040/10/20
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	600	486	66,246	2036/10/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,693	230,836	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,090	1,071	146,024	2027/4/20
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	440	266	36,307	2071/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,210	1,193	162,608	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	592	80,727	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,076	282,958	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	330	167	22,880	2120/6/30

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	510	482	65,737	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,070	1,090	148,558	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,030	972	132,483	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	270	216	29,530	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,020	139,049	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,361	185,616	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	810	780	106,397	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,080	1,174	160,026	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,044	142,336	2044/6/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	638	87,026	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,400	327,199	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,370	1,591	216,840	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,502	204,819	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/23	—	570	569	77,582	2023/9/15
RFGB 0% 09/15/24	—	420	415	56,619	2024/9/15
RFGB 0% 09/15/26	—	200	192	26,257	2026/9/15
RFGB 0% 09/15/30	—	800	717	97,809	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	330	265	36,172	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	285	38,851	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	540	480	65,442	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	500	380	51,816	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	612	83,482	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	380	290	39,601	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	850	115,897	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	650	626	85,378	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	723	98,611	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	800	760	103,649	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	693	94,546	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	560	529	72,134	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	455	62,015	2047/4/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	752	102,588	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	640	723	98,657	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	606	82,648	2028/7/4
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	916	124,899	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	—	850	741	101,012	2031/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	899	122,598	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,090	991	135,187	2030/10/18
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	470	416	56,710	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	610	516	70,411	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	500	392	53,537	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	690	684	93,284	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,640	1,658	225,992	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,196	163,018	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	651	88,836	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	810	811	110,627	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	708	96,504	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	815	111,099	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,150	1,158	157,891	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,319	179,838	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,024	139,621	2024/3/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,160	1,316	179,406	2025/3/13
ユ ー ロ 計					107,984,367
(イギリス)					
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,520	1,446	232,005	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	3,300	3,227	517,637	2024/1/31

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,077	333,232	2028/1/31
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,110	1,072	172,015	2025/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	3,270	2,821	452,574	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,910	1,811	290,494	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,157	345,999	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,020	940	150,856	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	782	125,467	2061/10/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,659	266,102	2025/6/7
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,810	2,319	372,094	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	880	594	95,393	2050/10/22
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,360	2,343	375,912	2023/7/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,170	881	141,444	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	510	452	72,628	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,601	256,897	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	400	366	58,847	2032/1/31
UKT 1% 04/22/24	1.0	800	793	127,299	2024/4/22
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	500	424	68,100	2039/1/31
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	520	381	61,202	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	950	935	150,052	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	830	663	106,431	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,373	380,645	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,599	256,534	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,370	2,044	327,887	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	420	358	57,481	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,620	1,621	260,081	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	1,633	261,968	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,480	1,313	210,615	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,183	189,749	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,210	2,028	322,159	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,630	2,478	397,600	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,809	290,170	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,504	404,952	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,510	1,710	274,281	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,690	1,736	278,580	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,180	2,556	410,003	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,290	2,799	448,953	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	2,770	444,331	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,155	345,782	2052/7/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,306	370,019	2060/1/22
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,640	2,051	329,096	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,544	408,190	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,620	2,097	336,401	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,559	250,103	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,750	2,288	367,079	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,920	2,651	425,243	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,143	343,724	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,910	2,871	460,485	2055/12/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,860	2,348	376,707	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,210	3,037	487,197	2042/12/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,460	1,804	289,353	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,238	359,052	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,300	2,515	403,517	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,584	254,059	2028/12/7
小 計					15,794,705
(スウェーデン)		キスウェーデン クロナ	キスウェーデン クロナ		
国債証券					
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	6,470	5,738	74,256	2031/5/12
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,800	7,481	96,809	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,560	7,168	92,763	2029/11/12

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,440	8,283	107,188	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	12,561	162,539	2023/11/13
SGB 2.25% 06/31/32	2.25	4,980	5,328	68,955	2032/6/1
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	9,300	9,582	124,002	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,310	6,753	87,389	2039/3/30
小 計				813,906	
(ノルウェー)		千ノルウェー	千ノルウェー		
国債証券		クローネ	クローネ		
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,590	3,176	42,568	2031/9/17
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	6,480	5,878	78,770	2030/8/19
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,670	4,501	60,319	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,680	4,512	60,461	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,720	5,612	75,204	2025/3/13
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	6,340	5,972	80,036	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	5,020	4,855	65,064	2028/4/26
NGB 2% 05/24/23	2.0	10,660	10,679	143,105	2023/5/24
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,220	3,070	41,150	2032/5/18
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,760	7,863	105,368	2024/3/14
小 計				752,049	
(デンマーク)		千デンマーク	千デンマーク		
国債証券		クローネ	クローネ		
DGB 0% 11/15/24	—	2,550	2,514	46,062	2024/11/15
DGB 0% 11/15/31	—	5,830	5,165	94,629	2031/11/15
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	6,050	4,231	77,524	2052/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	8,850	8,612	157,790	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,410	11,853	217,149	2029/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,550	7,699	141,057	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,510	5,697	104,381	2025/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	13,290	19,447	356,278	2039/11/15
小 計				1,194,873	
(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% 07/25/24	—	2,160	1,885	56,302	2024/7/25
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,850	2,165	64,655	2026/10/25
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,039	90,752	2025/4/25
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,150	2,759	82,368	2030/10/25
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	650	423	12,645	2032/4/25
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	3,586	107,059	2024/10/25
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,550	3,309	98,809	2024/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,860	5,830	174,057	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	3,088	92,207	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	5,750	4,663	139,231	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,220	4,815	143,768	2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,910	4,449	132,840	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,410	2,334	69,697	2023/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	572	17,091	2029/4/25
小 計				1,281,487	
(オーストラリア)		千オーストラリア	千オーストラリア		
国債証券		ドル	ドル		
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	3,430	3,234	294,440	2024/11/21
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,138	194,682	2025/11/21
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,040	1,838	167,315	2026/9/21
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,250	2,659	242,112	2031/11/21
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,360	1,969	179,243	2030/12/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,272	206,870	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	2,756	250,935	2031/6/21
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,760	1,176	107,084	2051/6/21

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額	外貨建金額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,910	2,516	229,039	2032/11/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,140	1,088	99,065	2028/5/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,520	3,348	304,761	2030/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,388	126,365	2024/4/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,439	131,056	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,050	978	89,060	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,930	1,901	173,056	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,624	147,849	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,410	1,370	124,753	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,508	137,324	2047/3/21
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,000	970	88,342	2033/11/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,560	2,593	236,058	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,200	2,215	201,615	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,120	1,077	98,062	2039/6/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,672	152,268	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,890	1,982	180,422	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,310	2,565	233,478	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,504	227,979	2027/4/21
小 計				4,623,245	
(シンガポール)		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
国債証券					
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	750	704	65,351	2025/11/1
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	530	503	46,761	2026/11/1
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	650	598	55,534	2031/7/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	810	691	64,180	2050/3/1
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	320	275	25,547	2051/10/1
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	409	37,964	2024/2/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	1,080	1,068	99,135	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	890	839	77,942	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	730	730	67,828	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	430	408	37,926	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	530	533	49,496	2028/5/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	760	760	70,558	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	626	58,188	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	620	624	57,980	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	662	61,514	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	1,200	1,224	113,641	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,590	1,614	149,890	2024/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	886	82,296	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	920	85,487	2027/3/1
小 計				1,307,226	
(マレーシア)		千マレーシア	千マレーシア		
国債証券		リンギット	リンギット		
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,510	1,349	39,156	2031/4/15
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	1,920	1,925	55,877	2024/6/14
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,490	43,267	2027/5/31
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,870	2,852	82,799	2028/6/15
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,520	1,369	39,760	2040/5/22
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	930	942	27,350	2023/8/17
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,180	1,119	32,496	2034/7/5
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,670	1,601	46,485	2033/4/15
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,041	30,230	2025/3/14
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,500	1,489	43,239	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,135	32,964	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,987	57,691	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,120	2,135	61,997	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	605	17,564	2026/7/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	3,120	3,156	91,610	2025/9/15

当		期			末		
銘	柄	利率 (%)	評 価 額		償還年月日		
			額面金額	外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)	
MGS	4.059%	09/30/24	4.059	1,780	1,806	52,428	2024/9/30
MGS	4.065%	06/15/50	4.065	2,340	2,095	60,809	2050/6/15
MGS	4.181%	07/15/24	4.181	1,280	1,300	37,741	2024/7/15
MGS	4.232%	06/30/31	4.232	3,000	3,014	87,493	2031/6/30
MGS	4.254%	05/31/35	4.254	2,030	1,984	57,609	2035/5/31
MGS	4.392%	04/15/26	4.392	2,500	2,565	74,470	2026/4/15
MGS	4.498%	04/15/30	4.498	2,860	2,945	85,484	2030/4/15
MGS	4.642%	11/07/33	4.642	1,770	1,824	52,967	2033/11/7
MGS	4.736%	03/15/46	4.736	1,480	1,468	42,618	2046/3/15
MGS	4.762%	04/07/37	4.762	2,280	2,355	68,354	2037/4/7
MGS	4.893%	06/08/38	4.893	2,310	2,392	69,440	2038/6/8
MGS	4.921%	07/06/48	4.921	1,680	1,699	49,323	2048/7/6
MGS	4.935%	09/30/43	4.935	1,030	1,056	30,659	2043/9/30
小 計						1,471,893	
(中国オフショア)			千オフショア人民元	千オフショア人民元			
国債証券							
CGB	1.99%	04/09/25	1.99	29,520	29,240	553,007	2025/4/9
CGB	2.28%	03/17/24	2.28	9,700	9,720	183,830	2024/3/17
CGB	2.47%	09/02/24	2.47	18,980	19,083	360,906	2024/9/2
CGB	2.48%	04/15/27	2.48	9,000	9,001	170,240	2027/4/15
CGB	2.56%	10/21/23	2.56	30,440	30,628	579,262	2023/10/21
CGB	2.68%	05/21/30	2.68	22,480	22,308	421,898	2030/5/21
CGB	2.69%	08/12/26	2.69	17,240	17,391	328,905	2026/8/12
CGB	2.8%	03/24/29	2.8	7,900	7,946	150,287	2029/3/24
CGB	2.84%	04/08/24	2.84	11,650	11,793	223,043	2024/4/8
CGB	2.85%	06/04/27	2.85	12,330	12,512	236,648	2027/6/4
CGB	2.89%	11/18/31	2.89	5,510	5,562	105,208	2031/11/18
CGB	2.91%	10/14/28	2.91	10,280	10,419	197,053	2028/10/14
CGB	3.01%	05/13/28	3.01	7,230	7,378	139,539	2028/5/13
CGB	3.02%	05/27/31	3.02	6,850	6,971	131,841	2031/5/27
CGB	3.03%	03/11/26	3.03	26,760	27,345	517,164	2026/3/11
CGB	3.27%	11/19/30	3.27	6,850	7,120	134,656	2030/11/19
CGB	3.28%	12/03/27	3.28	5,410	5,614	106,182	2027/12/3
CGB	3.39%	03/16/50	3.39	5,520	5,614	106,179	2050/3/16
CGB	3.53%	10/18/51	3.53	2,950	3,092	58,487	2051/10/18
CGB	3.72%	04/12/51	3.72	2,390	2,577	48,753	2051/4/12
CGB	3.81%	09/14/50	3.81	7,460	8,164	154,413	2050/9/14
CGB	3.86%	07/22/49	3.86	5,580	6,141	116,143	2049/7/22
CGB	4.08%	10/22/48	4.08	4,110	4,671	88,351	2048/10/22
小 計						5,112,008	
(イスラエル)			千イスラエル シェケル	千イスラエル シェケル			
国債証券							
ILGOV	0.15%	07/31/23	0.15	840	829	31,474	2023/7/31
ILGOV	0.4%	10/31/24	0.4	1,210	1,166	44,236	2024/10/31
ILGOV	0.5%	02/27/26	0.5	860	809	30,692	2026/2/27
ILGOV	0.5%	04/30/25	0.5	2,420	2,316	87,848	2025/4/30
ILGOV	1%	03/31/30	1.0	2,830	2,549	96,708	2030/3/31
ILGOV	1.3%	04/30/32	1.3	280	250	9,482	2032/4/30
ILGOV	1.5%	05/31/37	1.5	2,190	1,807	68,565	2037/5/31
ILGOV	1.5%	11/30/23	1.5	2,230	2,241	85,009	2023/11/30
ILGOV	1.75%	08/31/25	1.75	1,240	1,236	46,902	2025/8/31
ILGOV	2%	03/31/27	2.0	2,750	2,725	103,382	2027/3/31
ILGOV	2.25%	09/28/28	2.25	2,010	2,004	76,018	2028/9/28
ILGOV	3.75%	03/31/24	3.75	4,080	4,231	160,473	2024/3/31
ILGOV	3.75%	03/31/47	3.75	3,130	3,391	128,622	2047/3/31
ILGOV	5.5%	01/31/42	5.5	2,030	2,755	104,494	2042/1/31
ILGOV	6.25%	10/30/26	6.25	3,060	3,581	135,829	2026/10/30
小 計						1,209,741	
合 計						297,584,217	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

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

投資信託財産の構成

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

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

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

1米ドル=127.02円

1ユーロ=136.29円

1ノルウェークローネ=13.40円

1オーストラリアドル=91.02円

1オフショア人民元=18.9124円

1カナダドル=99.87円

1イギリスポンド=160.39円

1デンマーククローネ=18.32円

1シンガポールドル=92.82円

1イスラエルシェケル=37.927円

1メキシコペソ=6.4954円

1スウェーデンクローナ=12.94円

1ポーランドズロチ=29.8545円

1マレーシアリングギット=29.0252円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

<注記事項>

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

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

該当事項はありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021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・ディバースファイド(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	券物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率					
第9期(2017年11月10日)	17,081	14.6	32,201.21	15.2	96.8	—	—	百万円 31,411	
第10期(2018年11月12日)	16,292	△4.6	30,698.89	△4.7	95.9	—	—	45,550	
第11期(2019年11月11日)	17,520	7.5	33,355.04	8.7	96.7	—	—	53,734	
第12期(2020年11月10日)	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—	—	61,667	
第13期(2021年11月10日)	17,665	4.3	34,005.46	4.3	97.1	—	—	79,131	

(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		債組入率	券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2020年11月10日	16,930	—	32,614.59	—	97.2	—
11月末	16,899	△0.2	32,444.01	△0.5	96.7	—
12月末	17,344	2.4	33,305.10	2.1	96.3	—
2021年1月末	17,215	1.7	33,168.88	1.7	95.8	—
2月末	17,210	1.7	33,279.87	2.0	96.1	—
3月末	17,181	1.5	33,051.70	1.3	95.1	—
4月末	17,502	3.4	33,694.43	3.3	95.7	—
5月末	17,888	5.7	34,537.40	5.9	95.1	—
6月末	17,884	5.6	34,491.41	5.8	94.9	—
7月末	17,632	4.1	34,039.22	4.4	96.1	—
8月末	17,712	4.6	34,154.94	4.7	95.4	—
9月末	17,514	3.4	33,770.39	3.5	95.2	—
10月末	17,631	4.1	34,001.56	4.3	95.8	—
(当期末) 2021年11月10日	17,665	4.3	34,005.46	4.3	97.1	—

(注1)騰落率は期首比です。

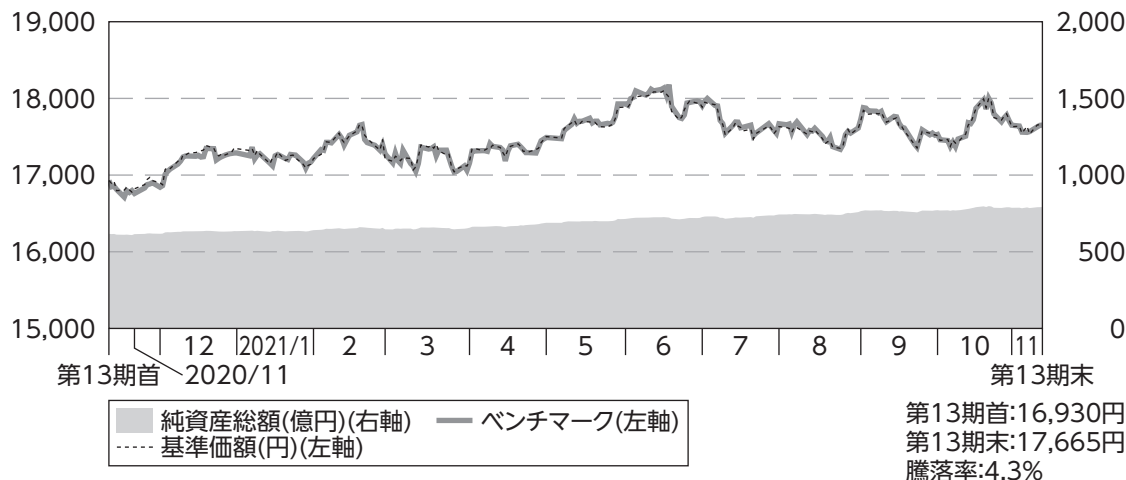
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、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)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・ディバースィファイドとは、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



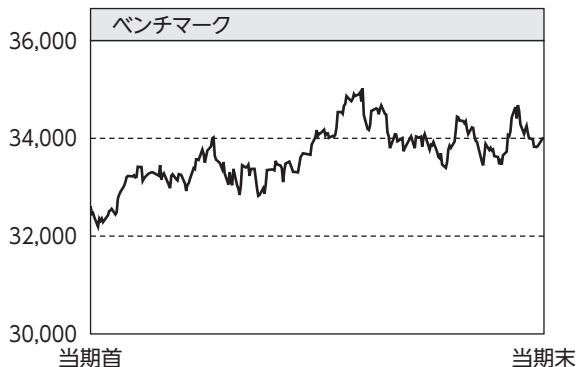
(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

2021年6月中旬にかけて、リスク選好の動きから新興国金利が上昇(債券価格は下落)推移となったものの、米国金融当局者から金融緩和の長期化を示唆する発言が相次いだことが新興国通貨全般の支えとなったほか、日米の長期金利差拡大やリスク選好姿勢の継続などを背景に新興国通貨に対して円安が進行したことから、基準価額は上昇推移となりました。6月下旬から8月下旬にかけては、新型コロナウイルス変異株の感染拡大を背景にリスク回避姿勢が高まる中、新興国通貨に対して低リスク通貨とされる円へ買いが優勢となり、基準価額は下落しました。9月以降は、欧米先進国で金融政策の正常化へ向けた動きにより金利上昇圧力が強まり、その流れが新興国債券に波及した影響により新興国金利が上昇した一方で、米国株式が底堅く推移したことなどを背景としてリスク回避姿勢が和らいだことにより新興国通貨が対円で上昇したため、基準価額は上下動を伴いながらもレンジ内推移となりました。

投資環境



新興国為替市場では、2021年6月中旬にかけて、リスク選好姿勢の継続から新興国通貨は対円で上昇しました。その後、新興国通貨は8月下旬にかけてリスク回避姿勢の高まりから下落した後、9月以降はリスク回避姿勢が和らいだことにより再び上昇しました。

新興国債券市場では、新興国金利はレンジ内推移の後、2021年2月中旬から3月末にかけて、リスク選好の動きから上昇しました。その後再びレンジ内推移となった後、9月下旬から、米国株式が底堅く推移したことなどを背景としてリスク回避姿勢が和らいだことにより、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

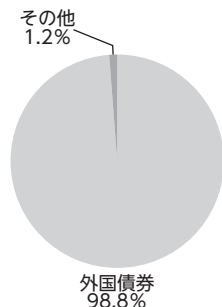
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	2.7%
2	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	1.9%
3	BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	1.6%
4	BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	1.5%
5	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.4%
6	COLTES 7.25% 10/18/34	コロンビア	1.2%

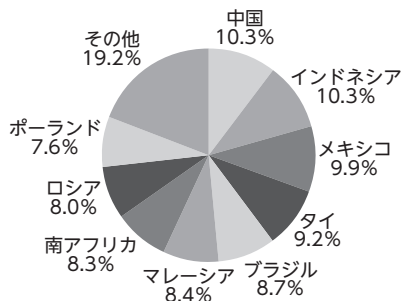
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MBONO 5.75% 03/05/26	メキシコ	1.1%
8	MGS 3.885% 08/15/29	マレーシア	1.1%
9	SAGB 8.75% 02/28/48	南アフリカ	1.0%
10	SAGB 8% 01/31/30	南アフリカ	1.0%
組入銘柄数		239	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

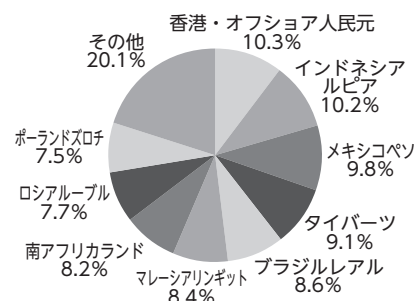
○資産別配分



○国別配分



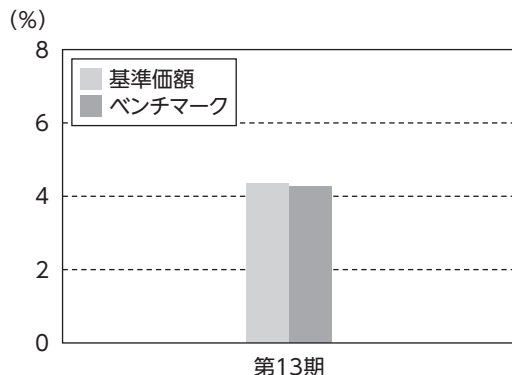
○通貨別配分



(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。

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
	(2020年11月1日~2021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)	16 (16) (-) (0)	0.093 (0.091) (-) (0.002)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	16	0.093	

(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(17,467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	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 395,768	千メキシコペソ 95,563	
	ブ ラ ジ ル	国 債 証 券	千ブラジルリアル 123,018	千ブラジルリアル 44,601	
	チ リ	国 債 証 券	千チリペソ 2,355,971	千チリペソ 614,748	
	コ ロ ン ビ ア	国 債 証 券	千コロンビアペソ 55,149,108	千コロンビアペソ 43,469,338	
	ペ ル ー	国 債 証 券	千ペルーヌエボソル 7,997	千ペルーヌエボソル 3,475	
	ウ ル グ ア イ	国 債 証 券	千ウルグアイペソ 25,251	千ウルグアイペソ 21,076	
	ド ミ ニ カ 共 和 国	国 債 証 券	千ドミニカペソ 9,598	千ドミニカペソ -	
	ト ル コ	国 債 証 券	千トルコリラ 43,755	千トルコリラ 16,173	
	チ ェ コ	国 債 証 券	千チェココルナ 261,225	千チェココルナ 25,953	
	ハ ン ガ リ ー	国 債 証 券	千ハンガリーフォリント 2,620,755	千ハンガリーフォリント 642,870	
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 74,323	千ポーランドズロチ 30,425	
	ロ シ ア	国 債 証 券	千ロシアルーブル 971,652	千ロシアルーブル 387,152	
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリングット 112,378	千マレーシアリングット 33,058	
	国	タ イ	国 債 証 券	千タイバーツ 717,789	千タイバーツ 128,675
フ ィ リ ピ ン		国 債 証 券	千フィリピンペソ 11,950	千フィリピンペソ 12,905	
イ ン ド ネ シ ア		国 債 証 券	千インドネシアルピア 273,114,350	千インドネシアルピア 88,427,112	
南 ア フ リ カ		国 債 証 券	千南アフリカランド 214,581	千南アフリカランド 34,107	
中 国 オ フ シ ョ ア		国 債 証 券	千香港・オフショア人民元 205,311	千香港・オフショア人民元 65,172	

(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。)

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 0.011725	百万円 0.011725	100.0	百万円 0.011725	百万円 0.011725	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	214,544	643	0.3	214,227	643	0.3

(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(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 1,322,700	千メキシコペソ 1,362,723	千円 7,567,065	% 9.6	% —	% 4.8	% 3.4	% 1.4
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 371,800	千ブラジルレアル 325,660	6,699,136	8.5	8.5	1.8	3.1	3.6
チ リ	千チリペソ 11,980,000	千チリペソ 11,101,341	1,581,186	2.0	—	1.1	0.8	0.1
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 107,600,000	千コロンビアペソ 114,336,758	3,332,802	4.2	—	4.0	0.2	—
ペ ル ー	千ペルーヌエボソル 56,650	千ペルーヌエボソル 58,085	1,632,435	2.1	—	1.7	0.4	—
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 37,500	千ウルグアイペソ 37,024	95,994	0.1	—	0.1	—	—
ドミニカ共和国	千ドミニカペソ 53,400	千ドミニカペソ 60,406	120,491	0.2	0.2	—	0.1	0.1
ト ル コ	千トルコリラ 130,600	千トルコリラ 108,241	1,255,398	1.6	1.6	0.4	0.7	0.5
チ ェ コ	千チェココルナ 737,400	千チェココルナ 697,275	3,612,725	4.6	—	2.7	1.4	0.5
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 8,290,000	千ハンガリーフォリント 8,087,040	2,932,716	3.7	—	1.7	1.6	0.4
ポーランド	千ポーランドズロチ 213,000	千ポーランドズロチ 207,692	5,915,219	7.5	—	2.5	3.6	1.4
ロ シ ア	千ロシアルーブル 4,007,050	千ロシアルーブル 3,826,801	6,122,881	7.7	—	4.2	2.6	1.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 235,850	千マレーシアリンギット 239,885	6,522,629	8.2	—	5.1	2.1	1.0
タ イ	千タイバーツ 1,953,200	千タイバーツ 2,079,100	7,152,106	9.0	—	5.7	2.4	1.0
フィリピン	千フィリピンペソ 45,000	千フィリピンペソ 50,092	112,813	0.1	—	0.1	—	0.0
インドネシア	千インドネシアルピア 914,300,000	千インドネシアルピア 987,613,288	7,900,906	10.0	—	6.8	2.6	0.6
南アフリカ	千南アフリカランド 942,250	千南アフリカランド 849,052	6,359,403	8.0	8.0	7.7	—	0.4
中国オフショア	千香港・オフショア人民元 444,100	千香港・オフショア人民元 450,288	7,954,119	10.1	—	5.2	3.7	1.1
合 計	—	—	76,870,033	97.1	18.3	55.5	28.5	13.2

(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 (%)	期末			
		額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(メキシコ)					
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBO10 10% 11/20/36	10.0	31,800	39,275	218,091	2036/11/20
MBO10 10% 12/05/24	10.0	100,250	108,505	602,520	2024/12/5
MBO10 5.75% 03/05/26	5.75	158,800	150,798	837,366	2026/3/5
MBO10 6.5% 06/09/22	6.5	103,700	103,944	577,194	2022/6/9
MBO10 6.75% 03/09/23	6.75	92,600	92,963	516,219	2023/3/9
MBO10 7.5% 06/03/27	7.5	128,500	128,664	714,460	2027/6/3
MBO10 7.75% 05/29/31	7.75	102,100	105,645	586,641	2031/5/29
MBO10 7.75% 11/13/42	7.75	77,000	77,853	432,310	2042/11/13
MBO10 7.75% 11/23/34	7.75	32,600	33,825	187,831	2034/11/23
MBO10 8% 09/05/24	8.0	115,400	118,250	656,632	2024/9/5
MBO10 8% 11/07/47	8.0	85,100	88,106	489,247	2047/11/7
MBO10 8% 12/07/23	8.0	97,950	100,127	555,997	2023/12/7
MBO10 8.5% 05/31/29	8.5	116,900	125,796	698,533	2029/5/31
MBO10 8.5% 11/18/38	8.5	82,000	88,965	494,018	2038/11/18
小計				7,567,065	
(ブラジル)					
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
BLTN 0% 01/01/24	—	92,100	72,169	1,484,601	2024/1/1
BLTN 0% 07/01/22	—	22,350	20,878	429,489	2022/7/1
BLTN 0% 07/01/23	—	70,000	57,946	1,192,018	2023/7/1
BLTN 0% 07/01/24	—	19,500	14,452	297,301	2024/7/1
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	60,400	59,098	1,215,719	2023/1/1
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	31,800	30,398	625,332	2025/1/1
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	38,200	35,982	740,194	2027/1/1
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	23,100	21,412	440,472	2029/1/1
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	11,050	10,161	209,027	2031/1/1
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,346	27,701	2028/1/10
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	1,900	1,812	37,277	2024/1/5
小計				6,699,136	
(チリ)					
国債証券		千チリペソ	千チリペソ		
BTPCL 2.3% 10/01/28	2.3	675,000	543,914	77,470	2028/10/1
BTPCL 2.5% 03/01/25	2.5	2,685,000	2,437,699	347,206	2025/3/1
BTPCL 4% 03/01/23	4.0	840,000	827,264	117,828	2023/3/1
BTPCL 4.5% 03/01/26	4.5	1,820,000	1,743,505	248,330	2026/3/1
BTPCL 4.7% 09/01/30	4.7	1,740,000	1,605,839	228,722	2030/9/1
BTPCL 5% 03/01/35	5.0	2,040,000	1,836,471	261,572	2035/3/1
BTPCL 5% 10/01/28	5.0	660,000	631,560	89,954	2028/10/1
BTPCL 6% 01/01/43	6.0	1,520,000	1,475,086	210,099	2043/1/1
小計				1,581,186	
(コロンビア)					
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	62,800,000	72,319,224	2,108,033	2027/6/28
COLTES 6.25% 11/26/25	6.25	5,600,000	5,459,888	159,150	2025/11/26
COLTES 7.25% 10/18/34	7.25	33,300,000	31,349,952	913,819	2034/10/18
COLTES 7.25% 10/26/50	7.25	5,900,000	5,207,694	151,799	2050/10/26
小計				3,332,802	
(ペルー)					
国債証券		千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
PERUGB 5.35% 08/12/40	5.35	4,500	3,851	108,240	2040/8/12

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(ウルグアイ)					
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
PERUGB 5.4% 08/12/34	5.4	6,350	5,830	163,867	2034/8/12
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	3,700	3,808	107,034	2024/8/12
PERUGB 5.94% 02/12/29	5.94	7,400	7,651	215,040	2029/2/12
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	6,300	6,403	179,961	2032/8/12
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	7,700	8,179	229,890	2028/8/12
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	6,950	7,135	200,541	2037/8/12
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	7,700	8,343	234,480	2031/8/12
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	6,050	6,880	193,378	2026/8/12
小計				1,632,435	
(ドミニカ共和国)					
国債証券		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
DOMREP 8.25% 05/21/31	8.25	25,000	24,359	63,157	2031/5/21
DOMREP 8.5% 03/15/28	8.5	12,500	12,665	32,836	2028/3/15
小計				95,994	
(トルコ)					
国債証券		千トルコリラ	千トルコリラ		
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	3,950	3,410	39,559	2024/3/20
TURKGB 10.5% 08/11/27	10.5	8,650	6,264	72,661	2027/8/11
TURKGB 10.6% 02/11/26	10.6	11,050	8,643	100,249	2026/2/11
TURKGB 10.7% 08/17/22	10.7	8,650	8,323	96,540	2022/8/17
TURKGB 11% 02/24/27	11.0	7,400	5,569	64,597	2027/2/24
TURKGB 11.7% 11/13/30	11.7	16,600	11,808	136,957	2030/11/13
TURKGB 12.2% 01/18/23	12.2	9,900	9,424	109,302	2023/1/18
TURKGB 12.4% 03/08/28	12.4	4,700	3,660	42,449	2028/3/8
TURKGB 12.6% 10/01/25	12.6	17,400	14,775	171,368	2025/10/1
TURKGB 16.2% 06/14/23	16.2	7,100	7,016	81,378	2023/6/14
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	6,200	5,500	63,791	2023/3/8
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	8,300	6,267	72,694	2025/3/12
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	5,100	4,802	55,700	2022/9/14
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	15,600	12,773	148,145	2024/7/24
小計				1,255,398	
(チェコ)					
国債証券		千チェココルナ	千チェココルナ		
CZGB 0.05% 11/29/29	0.05	31,100	25,165	130,389	2029/11/29
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	53,700	47,031	243,679	2027/2/10
CZGB 0.45% 10/25/23	0.45	47,000	44,693	231,567	2023/10/25
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	54,900	47,666	246,971	2030/5/15
CZGB 1% 06/26/26	1.0	72,800	67,045	347,374	2026/6/26
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	46,000	40,396	209,301	2031/3/13
CZGB 1.25% 02/14/25	1.25	53,000	50,175	259,967	2025/2/14
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	22,700	18,801	97,411	2040/4/24
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	28,000	25,844	133,907	2032/6/23
CZGB 2% 10/13/33	2.0	59,700	55,722	288,710	2033/10/13
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	51,900	50,868	263,561	2025/9/17
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	64,800	63,777	330,443	2028/8/25
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	50,300	50,266	260,439	2029/7/23
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	28,000	33,386	172,984	2036/12/4

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)		
CZGB 4.7%	09/12/22	4.7	35,800	36,350	188,339	2022/9/12
CZGB 5.7%	05/25/24	5.7	37,700	40,082	207,676	2024/5/25
小計					3,612,725	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォロント	千ハンガリーフォロント		
国債証券						
HGB 1%	11/26/25	1.0	475,000	438,600	159,055	2025/11/26
HGB 1.5%	04/22/26	1.5	610,500	566,806	205,548	2026/4/22
HGB 1.5%	08/23/23	1.5	322,500	320,213	116,123	2023/8/23
HGB 1.5%	08/26/26	1.5	394,000	362,913	131,608	2026/8/26
HGB 1.75%	10/26/22	1.75	275,000	274,692	99,615	2022/10/26
HGB 2%	05/23/29	2.0	343,000	304,896	110,568	2029/5/23
HGB 2.25%	04/20/33	2.25	512,000	435,783	158,034	2033/4/20
HGB 2.5%	10/24/24	2.5	548,000	543,824	197,214	2024/10/24
HGB 2.75%	12/22/26	2.75	470,500	456,723	165,628	2026/12/22
HGB 3%	06/26/24	3.0	402,500	406,291	147,339	2024/6/26
HGB 3%	08/21/30	3.0	555,000	524,219	190,105	2030/8/21
HGB 3%	10/27/27	3.0	592,000	575,572	208,727	2027/10/27
HGB 3%	10/27/38	3.0	380,000	325,736	118,126	2038/10/27
HGB 3.25%	10/22/31	3.25	692,000	661,275	239,807	2031/10/22
HGB 5.5%	06/24/25	5.5	660,000	716,575	259,861	2025/6/24
HGB 6.0%	11/24/23	6.0	471,000	506,254	183,590	2023/11/24
HGB 6.75%	10/22/28	6.75	382,000	455,061	165,025	2028/10/22
HGB 7%	06/24/22	7.0	205,000	211,601	76,735	2022/6/24
小計					2,932,716	
(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 0.25%	10/25/26	0.25	14,000	12,358	351,985	2026/10/25
POLGB 0.75%	04/25/25	0.75	20,050	18,709	532,850	2025/4/25
POLGB 1.25%	10/25/30	1.25	15,800	13,857	394,662	2030/10/25
POLGB 2.25%	10/25/24	2.25	17,950	17,674	503,369	2024/10/25
POLGB 2.5%	01/25/23	2.5	19,900	19,985	566,622	2023/1/25
POLGB 2.5%	04/25/24	2.5	14,250	14,146	402,902	2024/4/25
POLGB 2.5%	07/25/26	2.5	24,100	23,799	677,830	2026/7/25
POLGB 2.5%	07/25/27	2.5	14,400	14,173	403,669	2027/7/25
POLGB 2.75%	04/25/28	2.75	18,800	18,742	533,796	2028/4/25
POLGB 2.75%	10/25/29	2.75	22,150	22,028	627,394	2029/10/25
POLGB 3.25%	07/25/25	3.25	13,250	13,453	383,164	2025/7/25
POLGB 4%	10/25/23	4.0	10,850	11,108	316,365	2023/10/25
POLGB 5.75%	09/23/22	5.75	7,500	7,745	220,606	2022/9/23
小計					5,915,219	
(ロシア)			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
国債証券						
RFLB 4.5%	07/16/25	4.5	270,000	239,252	382,803	2025/7/16
RFLB 5.7%	05/17/28	5.7	219,000	193,486	309,578	2028/5/17
RFLB 6%	10/06/27	6.0	217,500	196,798	314,877	2027/10/6
RFLB 6.1%	07/18/35	6.1	214,500	182,779	292,447	2035/7/18
RFLB 6.5%	02/28/24	6.5	149,000	143,688	229,901	2024/2/28
RFLB 6.9%	05/23/29	6.9	158,000	148,670	237,872	2029/5/23
RFLB 6.9%	07/23/31	6.9	170,000	158,045	252,872	2031/7/23
RFLB 7%	01/25/23	7.0	71,200	70,252	112,403	2023/1/25
RFLB 7%	08/16/23	7.0	107,200	105,016	168,026	2023/8/16

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)		
RFLB 7.05%	01/19/28	7.05	230,500	219,816	351,706	2028/1/19
RFLB 7.1%	10/16/24	7.1	165,100	160,564	256,903	2024/10/16
RFLB 7.15%	11/12/25	7.15	210,400	203,454	325,527	2025/11/12
RFLB 7.25%	05/10/34	7.25	160,500	152,349	243,759	2034/5/10
RFLB 7.4%	07/17/24	7.4	202,200	198,457	317,531	2024/7/17
RFLB 7.4%	12/07/22	7.4	195,100	193,427	309,484	2022/12/7
RFLB 7.6%	07/20/22	7.6	117,700	117,430	187,888	2022/7/20
RFLB 7.65%	04/10/30	7.65	221,500	217,800	348,481	2030/4/10
RFLB 7.7%	03/16/39	7.7	133,500	131,203	209,926	2039/3/16
RFLB 7.7%	03/23/33	7.7	185,000	182,269	291,631	2033/3/23
RFLB 7.75%	09/16/26	7.75	141,500	139,875	223,800	2026/9/16
RFLB 7.95%	10/07/26	7.95	181,000	180,364	288,583	2026/10/7
RFLB 8.15%	02/03/27	8.15	170,000	170,804	273,286	2027/2/3
RFLB 8.5%	09/17/31	8.5	116,650	120,991	193,586	2031/9/17
小計					6,122,881	
(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	8,700	8,109	220,500	2031/4/15
MGS 3.478%	06/14/24	3.478	5,150	5,262	143,095	2024/6/14
MGS 3.48%	03/15/23	3.48	17,600	17,893	486,541	2023/3/15
MGS 3.502%	05/31/27	3.502	10,950	11,089	301,530	2027/5/31
MGS 3.733%	06/15/28	3.733	25,250	25,804	701,639	2028/6/15
MGS 3.757%	04/20/23	3.757	4,850	4,956	134,757	2023/4/20
MGS 3.757%	05/22/40	3.757	12,650	12,013	326,656	2040/5/22
MGS 3.8%	08/17/23	3.8	7,100	7,283	198,043	2023/8/17
MGS 3.828%	07/05/34	3.828	8,200	8,032	218,403	2034/7/5
MGS 3.885%	08/15/29	3.885	29,800	30,584	831,598	2029/8/15
MGS 3.899%	11/16/27	3.899	14,800	15,272	415,258	2027/11/16
MGS 3.9%	11/30/26	3.9	8,050	8,358	227,276	2026/11/30
MGS 3.906%	07/15/26	3.906	8,700	9,009	244,982	2026/7/15
MGS 3.955%	09/15/25	3.955	26,000	26,959	733,056	2025/9/15
MGS 4.059%	09/30/24	4.059	10,900	11,316	307,702	2024/9/30
MGS 4.065%	06/15/50	4.065	9,250	8,986	244,344	2050/6/15
MGS 4.181%	07/15/24	4.181	7,600	7,896	214,705	2024/7/15
MGS 4.254%	05/31/35	4.254	12,950	13,261	360,597	2035/5/31
MGS 4.762%	04/07/37	4.762	7,350	7,794	211,939	2037/4/7
小計					6,522,629	
(タイ)			千タイバート	千タイバート		
国債証券						
THAIG 0.75%	06/17/24	0.75	90,500	90,510	311,357	2024/6/17
THAIG 0.95%	06/17/25	0.95	116,700	116,823	401,873	2025/6/17
THAIG 1.45%	12/17/24	1.45	103,000	104,868	360,747	2024/12/17
THAIG 1.585%	12/17/35	1.585	56,800	51,915	178,588	2035/12/17
THAIG 1.6%	06/17/35	1.6	44,100	40,593	139,640	2035/6/17
THAIG 1.6%	12/17/29	1.6	85,100	85,336	293,557	2029/12/17
THAIG 1.875%	06/17/22	1.875	59,300	59,783	205,656	2022/6/17
THAIG 2%	06/17/42	2.0	65,600	58,559	201,443	2042/6/17
THAIG 2%	12/17/22	2.0	65,000	66,030	227,144	2022/12/17
THAIG 2.125%	12/17/26	2.125	170,600	178,824	615,156	2026/12/17
THAIG 2.4%	12/17/23	2.4	123,000	127,452	438,436	2023/12/17
THAIG 2.875%	06/17/46	2.875	20,500	20,954	72,084	2046/6/17
THAIG 2.875%	12/17/28	2.875	83,200	90,777	312,272	2028/12/17

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)		
THAIGB 3.3%	06/17/38	3.3	178,700	197,018	677,743	2038/6/17
THAIGB 3.4%	06/17/36	3.4	129,200	144,878	498,381	2036/6/17
THAIGB 3.625%	06/16/23	3.625	99,000	103,763	356,947	2023/6/16
THAIGB 3.65%	06/20/31	3.65	107,500	124,437	428,065	2031/6/20
THAIGB 3.775%	06/25/32	3.775	152,500	178,348	613,519	2032/6/25
THAIGB 3.85%	12/12/25	3.85	97,400	108,439	373,031	2025/12/12
THAIGB 4.875%	06/22/29	4.875	105,500	129,783	446,456	2029/6/22
小計					7,152,106	
(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 3.9%	11/26/22	3.9	15,000	15,072	33,943	2022/11/26
PHILIP 6.25%	01/14/36	6.25	30,000	35,020	78,869	2036/1/14
小計					112,813	
(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	9,342,394	74,739	2030/8/15
INDOGB 11%	09/15/25	11.0	16,200,000	19,546,920	156,375	2025/9/15
INDOGB 5.5%	04/15/26	5.5	36,500,000	37,149,335	297,194	2026/4/15
INDOGB 5.625%	05/15/23	5.625	60,300,000	61,885,890	495,087	2023/5/15
INDOGB 6.125%	05/15/28	6.125	45,000,000	46,092,150	368,737	2028/5/15
INDOGB 6.25%	06/15/36	6.25	17,800,000	17,850,190	142,801	2036/6/15
INDOGB 6.375%	04/15/32	6.375	16,000,000	16,448,326	131,586	2032/4/15
INDOGB 6.5%	02/15/31	6.5	82,500,000	84,042,500	512,340	2031/2/15
INDOGB 6.5%	06/15/25	6.5	66,300,000	69,929,262	559,434	2025/6/15
INDOGB 6.625%	05/15/33	6.625	31,000,000	31,280,550	250,244	2033/5/15
INDOGB 7%	05/15/27	7.0	40,800,000	43,870,608	350,964	2027/5/15
INDOGB 7%	09/15/30	7.0	54,000,000	56,927,880	455,423	2030/9/15
INDOGB 7.125%	06/15/42	7.125	17,300,000	18,097,703	144,781	2042/6/15
INDOGB 7.5%	04/15/40	7.5	34,000,000	36,182,460	289,459	2040/4/15
INDOGB 7.5%	05/15/38	7.5	21,000,000	22,077,720	176,621	2038/5/15
INDOGB 7.5%	06/15/35	7.5	27,200,000	29,169,824	233,358	2035/6/15
INDOGB 7.5%	08/15/32	7.5	21,900,000	23,565,714	188,525	2032/8/15
INDOGB 8.125%	05/15/24	8.125	35,600,000	38,948,892	311,591	2024/5/15
INDOGB 8.25%	05/15/29	8.25	31,700,000	35,810,856	286,486	2029/5/15
INDOGB 8.25%	05/15/36	8.25	31,800,000	35,858,634	286,869	2036/5/15
INDOGB 8.25%	06/15/32	8.25	18,400,000	20,951,712	167,613	2032/6/15
INDOGB 8.375%	03/15/24	8.375	53,600,000	58,665,736	469,325	2024/3/15
INDOGB 8.375%	03/15/34	8.375	52,000,000	59,179,640	473,437	2034/3/15
INDOGB 8.375%	04/15/39	8.375	21,200,000	24,085,744	192,685	2039/4/15
INDOGB 8.375%	09/15/26	8.375	29,100,000	32,966,226	263,729	2026/9/15
INDOGB 8.75%	05/15/31	8.75	34,700,000	40,710,040	325,680	2031/5/15
INDOGB 9%	03/15/29	9.0	19,700,000	23,075,792	184,606	2029/3/15
INDOGB 9.5%	07/15/31	9.5	11,400,000	13,900,590	111,204	2031/7/15
小計					7,900,906	
(南アフリカ)			千南アフリカ ランド	千南アフリカ ランド		
国債証券						
SAGB 10.5%	12/21/26	10.5	132,100	146,394	1,096,495	2026/12/21
SAGB 6.25%	03/31/36	6.25	43,600	30,943	231,765	2036/3/31
SAGB 6.5%	02/28/41	6.5	34,100	22,867	171,277	2041/2/28
SAGB 7%	02/28/31	7.0	64,700	54,705	409,746	2031/2/28
SAGB 7.75%	02/28/23	7.75	38,900	40,078	300,189	2023/2/28

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)		
SAGB 8%	01/31/30	8.0	113,700	105,490	790,126	2030/1/31
SAGB 8.25%	03/31/32	8.25	80,700	73,026	546,966	2032/3/31
SAGB 8.5%	01/31/37	8.5	97,700	83,867	628,168	2037/1/31
SAGB 8.75%	01/31/44	8.75	68,200	57,760	432,627	2044/1/31
SAGB 8.75%	02/28/48	8.75	126,100	106,530	797,913	2048/2/28
SAGB 8.875%	02/28/35	8.875	78,000	70,810	530,372	2035/2/28
SAGB 9%	01/31/40	9.0	64,450	56,576	423,755	2040/1/31
小計					6,359,403	
(中国オフショア)			千香港・オフ ショア人民元	千香港・オフ ショア人民元		
国債証券						
CGB 1.99%	04/09/25	1.99	20,000	19,530	344,991	2025/4/9
CGB 2.36%	07/02/23	2.36	18,000	17,975	317,525	2023/7/2
CGB 2.68%	05/21/30	2.68	27,300	26,700	471,655	2030/5/21
CGB 2.69%	08/12/26	2.69	6,000	5,990	105,823	2026/8/12
CGB 2.84%	04/08/24	2.84	11,700	11,780	208,092	2024/4/8
CGB 2.85%	06/04/27	2.85	24,500	24,554	433,745	2027/6/4
CGB 2.88%	11/05/23	2.88	16,900	17,023	300,715	2023/11/5
CGB 2.94%	10/17/24	2.94	23,000	23,215	410,094	2024/10/17
CGB 3.01%	05/13/28	3.01	15,000	15,107	266,862	2028/5/13
CGB 3.02%	05/27/31	3.02	8,500	8,590	151,754	2031/5/27
CGB 3.02%	10/22/25	3.02	28,000	28,346	500,719	2025/10/22
CGB 3.03%	03/11/26	3.03	17,500	17,728	313,169	2026/3/11
CGB 3.12%	12/05/26	3.12	20,000	20,350	359,479	2026/12/5
CGB 3.13%	11/21/29	3.13	20,700	20,964	370,328	2029/11/21
CGB 3.19%	04/11/24	3.19	24,100	24,483	432,496	2024/4/11
CGB 3.22%	12/06/25	3.22	12,000	12,236	216,156	2025/12/6
CGB 3.25%	06/06/26	3.25	22,000	22,506	397,572	2026/6/6
CGB 3.25%	11/22/28	3.25	14,900	15,234	269,117	2028/11/22
CGB 3.27%	11/19/30	3.27	22,000	22,605	399,306	2030/11/19
CGB 3.28%	12/03/27	3.28	20,000	20,532	362,691	2027/12/3
CGB 3.29%	05/23/29	3.29	26,000	26,699	471,636	2029/5/23
CGB 3.29%	10/18/23	3.29	16,000	16,263	287,284	2023/10/18
CGB 3.72%	04/12/51	3.72	7,300	7,693	135,910	2051/4/12
CGB 3.81%	09/14/50	3.81	22,700	24,172	426,991	2050/9/14
小計					7,954,119	
合計					76,870,033	

(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	千円 76,870,033	% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,112,266	3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	79,982,299	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(78,636,187千円)の投資信託財産総額(79,982,299千円)に対する比率は98.3%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=112.86円	1メキシコペソ=5.5529円	1ブラジルレアル=20.5709円
1チリペソ=0.142432円	1コロンビアペソ=0.029149円	1ペルーヌエボソル=28.1042円
1ウルグアイペソ=2.5927円	1ドミニカペソ=1.9947円	1トルコリラ=11.5981円
1チェココルナ=5.1812円	1ハンガリーフォリント=0.362644円	1ポーランドズロチ=28.4806円
1ロシアルーブル=1.60円	1マレーシアリンギット=27.1906円	1タイバーツ=3.44円
1フィリピンペソ=2.2521円	1インドネシアルピア=0.008円	1南アフリカランド=7.49円
1香港・オフショア人民元=17.6645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 2021年11月10日現在
(A) 資 産	79,982,299,898円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,806,182,607
公 社 債(評価額)	76,870,033,652
未 収 利 息	1,162,577,426
前 払 費 用	143,506,213
(B) 負 債	850,342,340
未 払 金	799,248,799
未 払 解 約 金	51,092,326
未 払 利 息	1,215
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	79,131,957,558
元 本	44,796,605,697
次 期 繰 越 損 益 金	34,335,351,861
(D) 受 益 権 総 口 数	44,796,605,697口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,665円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	3,634,710,647円
受 取 利 息	3,635,128,537
支 払 利 息	△417,890
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△777,914,188
売 買 益	4,713,759,238
売 買 損	△5,491,673,426
(C) そ の 他 費 用	△65,325,891
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,791,470,568
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	25,242,773,189
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,683,349,923
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,382,241,819
(H) 計 (D+E+F+G)	34,335,351,861
次 期 繰 越 損 益 金(H)	34,335,351,861

(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36,424,298,034円、期中追加設定元本額は10,248,651,738円、期中一部解約元本額は1,876,344,075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。

DC世界経済インデックスファンド	9,917,225,301円
世界経済インデックスファンド	9,910,136,787円
DC新興国債券インデックス・オープン	5,007,535,066円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,587,499,587円
外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	3,856,537,990円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,230,586,380円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,798,837,446円
グローバル経済コア	731,606,837円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	519,110,234円
分散投資コア戦略ファンドS	487,361,674円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	405,351,996円
コア投資戦略ファンド(成長型)	399,809,303円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	326,257,124円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	315,983,357円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	312,177,488円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	303,113,947円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	301,290,551円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	300,810,171円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	289,902,869円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	285,373,626円
SMT 世界経済インデックス・オープン	269,909,313円
分散投資コア戦略ファンドA	227,137,108円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	193,825,508円
SMT インデックスバランス・オープン	165,422,913円
コア投資戦略ファンド(切替型)	148,300,289円
コア投資戦略ファンド(安定型)	146,670,330円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	89,771,518円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	79,205,033円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	76,222,253円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	43,103,997円
私募世界経済バシブファンド(適格機関投資家専用)	35,060,113円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	8,467,537円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,654,572円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	5,423,511円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	5,024,122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)	4,354,318円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	3,013,823円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,531,705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14期（決算日 2021年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	REIT 物 率	投資 信託 証券 組入 比率	純 資 産 額
	円	%	円	%				
第10期(2017年11月10日)	14,567	△4.7	14,447	△4.7	2.0	2.0	98.0	百万円 82,590
第11期(2018年11月12日)	16,899	16.0	16,737	15.9	2.5	2.5	97.5	103,475
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	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	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	3.8	96.1	111,120

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	REIT 物 率	投資 信託 証券 組入 比率
	円	%	円	%			
(当期首) 2020年11月10日	17,549	—	17,391	—	3.4	3.4	96.6
11月末	17,348	△1.1	17,191	△1.2	3.4	3.4	96.6
12月末	18,394	4.8	18,226	4.8	3.3	3.3	96.6
2021年 1月末	19,107	8.9	18,932	8.9	3.4	3.4	96.6
2月末	20,092	14.5	19,893	14.4	3.3	3.3	96.7
3月末	21,001	19.7	20,801	19.6	3.3	3.3	96.7
4月末	21,573	22.9	21,367	22.9	3.5	3.5	96.5
5月末	21,726	23.8	21,518	23.7	3.5	3.5	96.5
6月末	22,591	28.7	22,375	28.7	3.5	3.5	96.5
7月末	22,759	29.7	22,542	29.6	3.6	3.6	96.4
8月末	22,704	29.4	22,483	29.3	3.5	3.5	96.3
9月末	21,992	25.3	21,777	25.2	3.5	3.5	96.5
10月末	22,252	26.8	22,036	26.7	3.8	3.8	96.2
(当期末) 2021年11月10日	21,895	24.8	21,683	24.7	3.8	3.8	96.1

(注1)騰落率は期首比です。

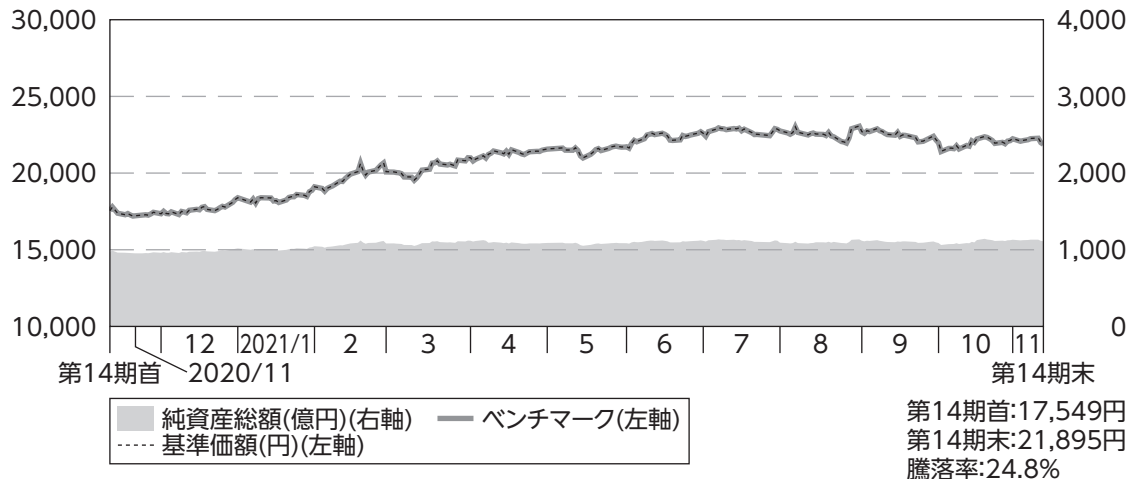
(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。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

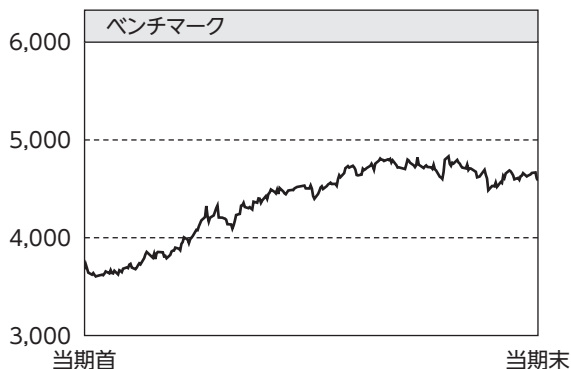


(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



J-REIT市場は上昇しました。

当期初から2021年7月末にかけて、米国の大型経済対策などによる景気回復期待を背景に世界的にリスクオンの動きとなる中、株式市場と比べたJ-REIT市場の出遅れ感が強く意識され見直し買いが入ったほか、FTSEグローバル株式指数へのJ-REIT組み入れやJ-REITの相対的な配当利回りの高さなどに着目した資金流入などにより大幅に上昇しました。その後は一進一退の展開となりましたが、9月以降は複数のREITによる公募増資の発表を受けて需給悪化懸念が広がったことや、中国大手不動産開発会社の債務問題などが心理的な重石となったことなどから上昇幅を縮小しました。

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

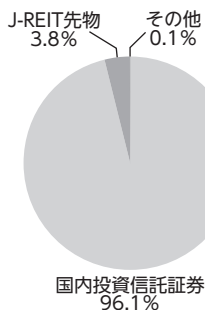
○上位10銘柄

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	6.9%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.8%
3	GLP投資法人	日本	5.1%
4	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.0%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.6%
6	日本都市ファンド投資法人	日本	4.4%

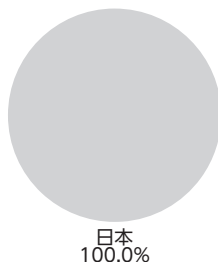
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	大和ハウスリート投資法人	日本	4.2%
8	東証REIT指数先物 2112	日本	3.8%
9	オリックス不動産投資法人	日本	3.1%
10	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数			62

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

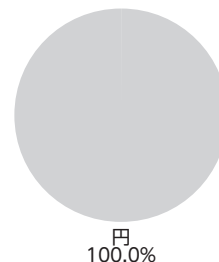
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

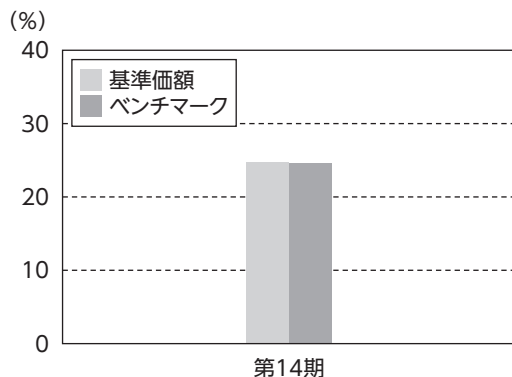


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスでJ-REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.8%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。



当ファンドの基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年11月11日~2021年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.003%	(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)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(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	-	-	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	1	0.003	

(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(20,961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	490 (116)	68,287 (16,852)	390	51,955
	エスコンジャパンリート投資法人	116 (△116)	16,852 (△16,852)	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人	727 (319)	89,379 (38,703)	578	68,070
	サンケイリアルエステート投資法人	319 (△319)	38,703 (△38,703)	—	—
	S O S i L A物流リート投資法人	2,123 (145)	344,054 (17,139)	599	88,378
	S O S i L A物流リート投資法人	145 (△145)	17,139 (△17,139)	—	—
	東海道リート投資法人	750	81,539	24	2,583
	日本アコモデーションファンド投資法人	623	382,981	791	497,944
	MCUBS MidCity投資法人	412 (△12,345)	38,471 (△1,043,176)	738	69,006
	森ヒルズリート投資法人	1,696	259,775	2,715	415,444
	産業ファンド投資法人	2,049	415,855	3,232	634,058
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,653	588,393	2,013	688,326
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,322	277,069	1,605	337,947
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,016	465,011	1,154	541,709
	G L P投資法人	8,000	1,408,720	7,079	1,270,889
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	739 (27)	242,106 (7,630)	1,018	337,692
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	27 (△27)	7,630 (△7,630)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	2,914	1,038,362	3,568	1,243,226
	星野リゾート・リート投資法人	221	145,403	335	209,113
	O n eリート投資法人	398	118,068	367	110,260
イオンリート投資法人	2,818	426,285	2,175	319,474	
ヒューリックリート投資法人	2,238	394,478	1,734	295,563	
日本リート投資法人	456	190,554	895	377,875	
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6,548	128,413	73,076	1,611,711	
積水ハウス・リート投資法人	4,747 (359)	421,506 (31,439)	6,794	599,125	
積水ハウス・リート投資法人	359 (△359)	31,439 (△31,439)	—	—	
内	トーセイ・リート投資法人	309	40,877	620	82,748
	ケネディクス商業リート投資法人	847	236,009	871	238,064
	ヘルスケア&メディカル投資法人	307	44,838	495	69,859

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	サムティ・レジデンシャル投資法人	476 (71)	57,674 (8,851)	392	45,537
	サムティ・レジデンシャル投資法人	71 (△71)	8,851 (△8,851)	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,672	769,622	7,511	1,244,453
	いちごホテルリート投資法人	244	21,081	485	41,543
	ラサールレジポート投資法人	2,602	470,899	2,540	443,612
	スターアジア不動産投資法人	2,071	117,187	2,917	165,216
	マリモ地方創生リート投資法人	144	18,249	226	28,476
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	648	380,574	739	408,514
	大江戸温泉リート投資法人	236	18,629	377	29,944
	投資法人みらい	1,916	99,270	2,296	110,737
	森トラスト・ホテルリート投資法人	439	58,805	458	59,969
	三菱地所物流リート投資法人	620	275,763	541	244,319
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,500	279,599	655	116,530
	ザイマックス・リート投資法人	211	23,754	422	48,583
	タカラレーベン不動産投資法人	834 (443)	94,569 (49,800)	652	71,788
	タカラレーベン不動産投資法人	443 (△443)	49,800 (△49,800)	—	—
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,305	181,394	880	126,524
	日本ビルファンド投資法人	1,641	1,128,372	2,554	1,703,266
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,444	954,959	2,321	1,506,924
	日本都市ファンド投資法人	6,188 (31,301)	726,625 (1,043,176)	9,124	1,099,845
	オリックス不動産投資法人	2,880	548,708	4,629	880,248
	日本プライムリアルティ投資法人	1,101	445,410	1,319	522,663
	N T T都市開発リート投資法人	1,723 (95)	257,285 (14,252)	2,087	314,361
	N T T都市開発リート投資法人	95 (△95)	14,252 (△14,252)	—	—
	東急リアル・エステート投資法人	970	178,762	1,559	285,975
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,002	117,516	1,612	191,841
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,727	557,600	4,537	676,625
	森トラスト総合リート投資法人	1,031	152,239	1,658	247,738
	インヴィンシブル投資法人	7,280	301,449	8,864	357,715
	フロンティア不動産投資法人	611 (61)	294,723 (31,063)	785	367,828
	フロンティア不動産投資法人	61 (△61)	31,063 (△31,063)	—	—
	内	平和不動産リート投資法人	1,122 (101)	176,563 (16,268)	1,437
平和不動産リート投資法人		101 (△101)	16,268 (△16,268)	—	—

		当 期				
		買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
		千円		千円		
国	日本ロジスティクスファンド投資法人	947	310,540	1,520	485,851	
	福岡リート投資法人	741	126,112	1,195	204,214	
	ケネディクス・オフィス投資法人	454	337,557	725	547,837	
	いちごオフィスリート投資法人	1,192	106,733	2,017	183,152	
	大和証券オフィス投資法人	290	213,215	491	366,317	
	阪急阪神リート投資法人	648	100,435	1,044	157,356	
	スターツプロシード投資法人	222	52,743	359	81,631	
	大和ハウスリート投資法人	2,554 (202)	804,027 (60,961)	3,300	981,216	
	大和ハウスリート投資法人	202 (△202)	60,961 (△60,961)	—	—	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	4,516	284,527	8,840	555,029	
	大和証券リビング投資法人	2,592 (139)	280,673 (15,794)	2,989	327,764	
	内	大和証券リビング投資法人	139 (△139)	15,794 (△15,794)	—	—
		ジャパンエクセレント投資法人	1,343	187,315	2,158	307,221

(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
		百万円		百万円	
国	R E I T 先 物 取 引	14,909	14,750	—	—

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.127193	0.127193	100.0	0.127193	0.127193	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	697,612	3,744	0.5	695,925	3,744	0.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘 柄	当期首(前期末)		当 期		末	
	口	数 (口)	口	数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)
エスコンジャパンリート投資法人		1,692		1,908	268,074	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		2,534		3,002	367,745	0.3
S O S i L A物流リート投資法人		2,307		3,976	677,510	0.6
東海道リート投資法人		—		726	78,480	0.1
日本アコモデーションファンド投資法人		3,441		3,273	2,075,082	1.9
MCUBS M i d C i t y投資法人		12,671		—	—	—
森ヒルズリート投資法人		12,164		11,145	1,734,162	1.6
産業ファンド投資法人		14,638		13,455	2,787,876	2.5
アドバンス・レジデンス投資法人		9,836		9,476	3,420,836	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6,756		6,473	1,400,109	1.3
アクティビア・プロパティーズ投資法人		5,189		5,051	2,298,205	2.1
GLP投資法人		29,775		30,696	5,657,272	5.1
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		4,519		4,267	1,384,641	1.2
日本プロロジスリート投資法人		15,669		15,015	5,578,072	5.0
星野リゾート・リート投資法人		1,576		1,462	1,076,032	1.0
O n e リート投資法人		1,614		1,645	491,361	0.4
イオンリート投資法人		10,503		11,146	1,723,171	1.6
ヒューリックリート投資法人		8,337		8,841	1,511,811	1.4
日本リート投資法人		3,364		2,925	1,253,362	1.1
インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		66,528		—	—	—
積水ハウス・リート投資法人		30,458		28,770	2,454,081	2.2
トーセイ・リート投資法人		2,291		1,980	262,548	0.2
ケネディクス商業リート投資法人		3,808		3,784	1,084,494	1.0
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,209		2,021	326,189	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		1,993		2,148	255,397	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人		33,487		30,648	5,109,021	4.6
いちごホテルリート投資法人		1,811		1,570	145,539	0.1
ラサールロジポート投資法人		11,540		11,602	2,212,501	2.0
スターアジア不動産投資法人		10,640		9,794	605,269	0.5
マリモ地方創生リート投資法人		970		888	118,015	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		3,614		3,523	2,071,524	1.9
大江戸温泉リート投資法人		1,671		1,530	126,072	0.1
投資法人みらい		11,184		10,804	554,245	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		2,243		2,224	310,915	0.3
三菱地所物流リート投資法人		2,330		2,409	1,156,320	1.0
CREロジスティクスファンド投資法人		2,826		3,671	800,278	0.7
ザイマックス・リート投資法人		1,587		1,376	160,579	0.1

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
タカラレーベン不動産投資法人	3,112	3,737	412,938		0.4
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,270	3,695	613,370		0.6
日本ビルファンド投資法人	11,654	10,741	7,647,592		6.9
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,355	9,478	6,454,518		5.8
日本都市ファンド投資法人	19,455	47,820	4,853,730		4.4
オリックス不動産投資法人	20,633	18,884	3,433,111		3.1
日本プライムリアルティ投資法人	6,447	6,229	2,585,035		2.3
NTT都市開発リート投資法人	9,353	9,084	1,382,584		1.2
東急リアル・エステート投資法人	6,943	6,354	1,200,906		1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	7,191	6,581	780,506		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	22,146	21,336	3,040,380		2.7
森トラスト総合リート投資法人	7,401	6,774	990,358		0.9
インヴィンシブル投資法人	43,299	41,715	1,812,516		1.6
フロンティア不動産投資法人	3,436	3,323	1,694,730		1.5
平和不動産リート投資法人	6,354	6,140	970,120		0.9
日本ロジスティクスファンド投資法人	6,766	6,193	2,049,883		1.8
福岡リート投資法人	5,356	4,902	828,928		0.7
ケネディクス・オフィス投資法人	3,203	2,932	2,078,788		1.9
いちごオフィスリート投資法人	8,591	7,766	669,429		0.6
大和証券オフィス投資法人	2,206	2,005	1,467,660		1.3
阪急阪神リート投資法人	4,677	4,281	720,492		0.6
スターツプロシード投資法人	1,613	1,476	346,712		0.3
大和ハウスリート投資法人	14,775	14,231	4,625,075		4.2
ジャパン・ホテル・リート投資法人	33,359	29,035	1,939,538		1.7
大和証券リビング投資法人	13,064	12,806	1,448,358		1.3
ジャパンエクセレント投資法人	9,609	8,794	1,228,521		1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	622,043	549,536	106,812,580	
	銘 柄 数 <比 率>	62	61	<96.1%>	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	期		末					
			買	建	額	売	建	額		
			(百万円)		(百万円)					
国内	東	証	R	E	I	T	指	数	4,248	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	106,812,580	95.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,728,870	4.2
投 資 信 託 財 産 総 額	111,541,450	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 2021年11月10日現在
(A)資 産	111,541,450,652円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,311,026,516
投 資 証 券(評価額)	106,812,580,450
未 収 入 金	112,627,502
未 収 配 当 金	969,472,344
差 入 委 託 証 拠 金	335,743,840
(B)負 債	421,081,136
未 払 金	183,909,555
未 払 解 約 金	237,164,222
未 払 利 息	7,359
(C)純 資 産 総 額(A-B)	111,120,369,516
元 本	50,752,359,768
次 期 繰 越 損 益 金	60,368,009,748
(D)受 益 権 総 口 数	50,752,359,768口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,895円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日
(A)配 当 等 収 益	3,808,739,813円
受 取 配 当 金	3,809,905,517
受 取 利 息	15,936
そ の 他 収 益 金	237
支 払 利 息	△1,181,877
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	18,790,461,775
売 買 益	18,843,396,736
売 買 損	△52,934,961
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	797,851,000
取 引 益	994,381,000
取 引 損	△196,530,000
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	23,397,052,588
(E)前 期 繰 越 損 益 金	41,984,669,259
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	8,629,602,660
(G)解 約 差 損 益 金	△13,643,314,759
(H) 計 (D+E+F+G)	60,368,009,748
次 期 繰 越 損 益 金(H)	60,368,009,748

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は55,613,724,754円、期中追加設定元本額は7,731,734,385円、期中一部解約元本額は12,593,099,371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)	23,397,493,075円
SMT J-REITインデックス・オープン	15,835,438,347円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,886,625,627円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,657,099,646円
分散投資コア戦略ファンドS	1,541,414,897円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,286,420,154円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	878,687,418円
コア投資戦略ファンド(切替型)	778,199,200円
分散投資コア戦略ファンドA	720,122,850円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	665,888,004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)	488,222,662円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	416,146,403円
J-REIT パッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	302,498,187円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-11(適各機関投資家専用)	265,797,294円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	255,743,577円
グローバル経済コア	239,663,056円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	53,619,238円
SMT インデックスバランス・オープン	27,092,933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)	19,776,133円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	13,158,340円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,513,012円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,840,543円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,899,172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14期（決算日 2021年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第10期(2017年11月10日)	17,843	20.7	19,040	21.3	99.3	63,032
第11期(2018年11月12日)	18,126	1.6	19,461	2.2	99.4	74,818
第12期(2019年11月11日)	19,790	9.2	21,365	9.8	99.4	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838	△14.9	18,254	△14.6	99.6	80,213
第14期(2021年11月10日)	24,699	46.7	26,879	47.2	99.5	102,118

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2020年11月10日	16,838	—	18,254	—	99.6
11月末	17,254	2.5	18,705	2.5	99.6
12月末	17,431	3.5	18,911	3.6	99.2
2021年 1月末	17,850	6.0	19,393	6.2	99.7
2月末	18,803	11.7	20,473	12.2	99.6
3月末	20,203	20.0	21,926	20.1	99.3
4月末	21,144	25.6	22,964	25.8	99.7
5月末	21,617	28.4	23,492	28.7	99.6
6月末	22,284	32.3	24,236	32.8	99.3
7月末	22,848	35.7	24,867	36.2	96.3
8月末	23,324	38.5	25,386	39.1	99.4
9月末	22,791	35.4	24,807	35.9	99.4
10月末	24,780	47.2	26,974	47.8	99.8
(当期末) 2021年11月10日	24,699	46.7	26,879	47.2	99.5

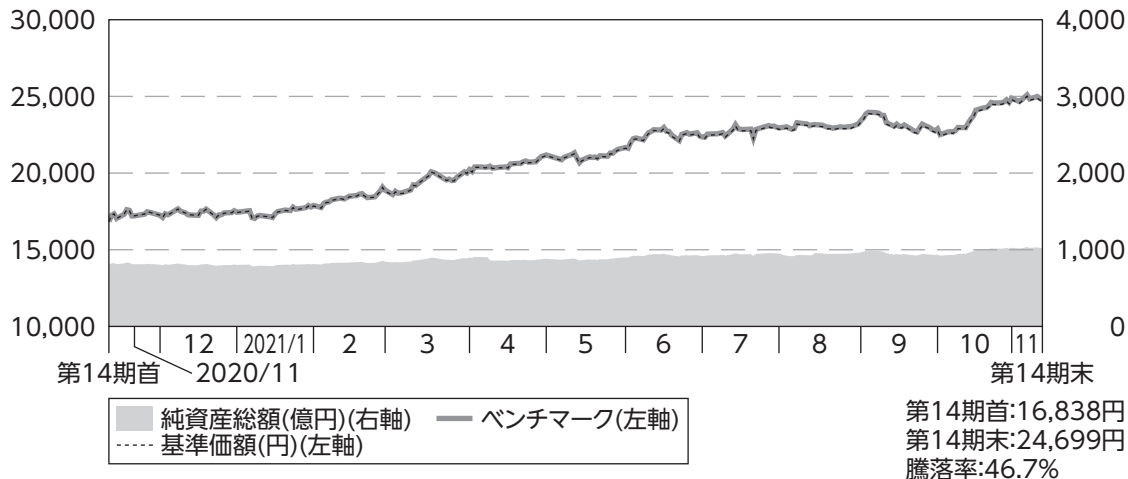
(注)騰落率は期首比です。

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

S&P先進国REIT指数(以下「当インデックス」とは、S&P Dow Jones Indices LLC(以下「SPDJ」)が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT(不動産投資信託証券)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「円換算ベース」は、ドルベース指数をもとに当社が独自に円換算した指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。当インデックスは、S&P Globalの一部門であるSPDJの商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC(以下「S&P」)の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC(以下「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、また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、また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

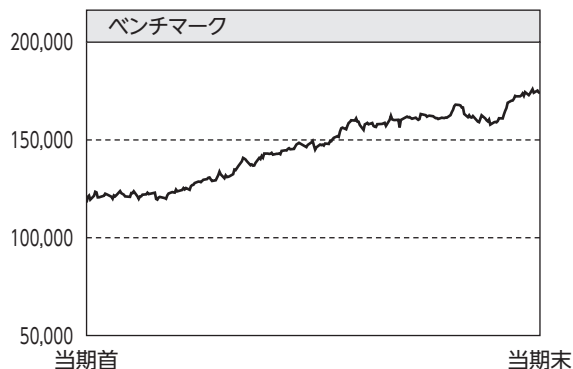


(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



海外REIT市場は、英国で感染力の高い新型コロナウイルス変異株による感染が急拡大したことが嫌気される場面もありましたが、2021年1月以降は米国での1.9兆ドル規模の追加経済対策の成立や米欧のワクチン接種の進展、ISM(米供給管理協会)製造業景況指数などの良好な経済指標を受けて景気回復期待が高まったことなどから堅調に推移しました。9月にはFOMC(米連邦公開市場委員会)において年内の量的金融緩和の縮小開始が強く示唆され、参加者の利上げ予想も前倒しされたことなどから一時下落する場面もあったものの、その後は7-9月期の決算が概ね良好な結果となったことなどを背景に上昇し、高値圏で期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

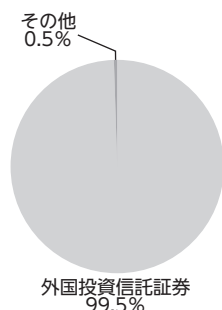
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.7%
2	EQUINIX INC	アメリカ	4.4%
3	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	3.4%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.0%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	2.7%
6	REALTY INCOME CORP	アメリカ	2.4%

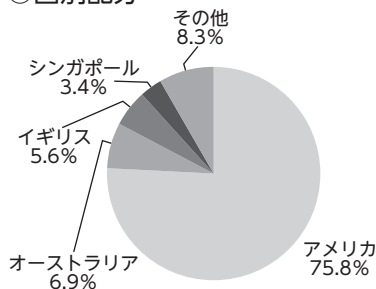
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	WELLTOWER INC	アメリカ	2.2%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.1%
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.8%
10	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	アメリカ	1.8%
組入銘柄数		329	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

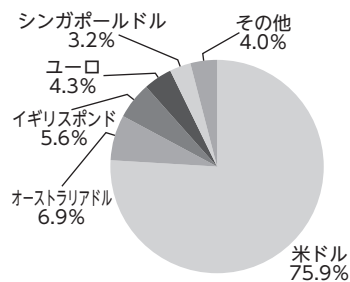
○資産別配分



○国別配分



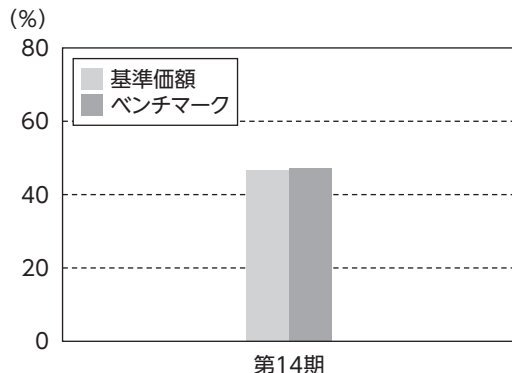
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当課税要因※(マイナス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年11月11日~2021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	1	0.005	(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)	(1)	(0.005)	
(c) その他費用	8	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、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(8)	(0.037)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	10	0.048	

(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(20,860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	15,885	2,946	14,308	2,591
ALEXANDER' S INC	—	—	300	88
BOSTON PROPERTIES	5,927	686	17,890	1,901
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,814	326	19,304	727
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,645 (△516)	112 (678)	31,000	211
AGREE REALTY CORP	6,136	418	2,200	151
SL GREEN REALTY CORP	4,920 (15)	369 (75)	13,515	955
EPR PROPERTIES	—	—	5,970	262
PROLOGIS INC	34,940	4,346	100,763	11,419
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,174	1,361	19,885	3,838
LEXINGTON CORP PROPERTIES	—	—	21,500	245
CAMDEN PROPERTY TRUST	6,326	903	12,720	1,520
MACK-CALI REALTY CORP	—	—	19,100	284
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,439	305	20,026	896
COUSINS PROPERTIES INC	6,683	256	18,475	670
URSTADT BIDDLE - CL A	—	—	7,450	102
SITE CENTERS CORP	16,800	239	11,500	160
DUKE REALTY CORP	15,759	794	46,747	2,096
ESSEX PROPERTY TRUST	2,960	902	9,030	2,534
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,460	1,393	47,485	3,434
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,700	329	7,078	751
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,365	290	14,274	700
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,526	725	70,204	2,278
EQUITY COMMONWEALTH	—	—	9,067	257
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,300	100	8,719	263
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,800	129	10,680	466
SERVICE PROPERTIES TRUST	—	—	9,575	122
WELLTOWER INC	21,874	1,786	57,597	4,279

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
EASTGROUP PROPERTIES, INC	1,000	172	3,937	588
KIMCO REALTY CORP	20,254 (94,174)	437 (1,161)	51,857	988
KILROY REALTY CORPORATION	4,180	282	12,397	821
LTC PROPERTIES INC	2,948	115	9,300	342
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	—	—	10,000	47
MONMOUTH REIT -CL A	—	—	7,100	127
BRANDYWINE REALTY TRUST	—	—	12,000	154
IRON MOUNTAIN INC	14,259	636	38,349	1,464
MACERICH CO/THE	53,745	933	3,000	36
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	10,702	840	25,329	1,794
ACADIA REALTY TRUST	—	—	7,000	139
HOST HOTELS AND RESORTS INC	40,823	684	90,783	1,488
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,737	1,017	14,363	2,196
NATL HEALTH INVESTORS INC	—	—	3,214	229
CENTERSPACE	—	—	1,400	97
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	—	—	4,600	99
PENN REAL ESTATE INVEST TST	35,000	89	—	—
PS BUSINESS PARKS INC	—	—	1,517	228
RPT REALTY	9,000	101	24,000	233
REALTY INCOME CORP	37,255 (89,744)	2,467 (4,686)	40,835	2,690
REGENCY CENTERS CORP	7,240	479	23,271	1,386
UDR INC	15,499	808	51,047	2,440
CORPORATE OFFICE PPTYS	—	—	11,400	306
CORECIVIC INC	—	—	84,463	598
SAUL CENTERS INC	—	—	2,000	85
SIMON PROPERTY GROUP	25,205	2,702	39,011	4,542
LIFE STORAGE INC	3,136 (14,883)	372 (—)	3,624	364
PUBLIC STORAGE	6,534	1,943	20,202	5,327
SUN COMMUNITIES INC	13,728	2,273	12,405	2,019
TAUBMAN CENTERS INC	—	—	40,750	1,751
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	5,100	97	17,000	190
UMH PROPERTIES INC	4,000	93	5,680	108

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	—	—	5,500	100
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	—	—	1,500	105
VENTAS INC	18,077 (7,024)	1,025 (196)	45,997	2,501
VORNADO REALTY TRUST	9,173	401	19,256	852
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	10,500	243
GEO GROUP INC/THE	—	—	12,000	93
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	—	—	10,460 (66,885)	265 (1,308)
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,892	288	17,478	789
KITE REALTY GROUP TRUST	— (72,216)	— (821)	14,650	249
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,925	825	14,527	2,064
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	—	—	21,000	102
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	18,430	215	41,880	485
CUBESMART	9,007	416	20,390	839
DIGITAL REALTY TRUST INC	17,025	2,492	34,030	4,971
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	—	—	11,300	118
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	53,235	1,098	56,917	1,202
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	12,888	419	24,511	781
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	19,260	341	29,116	478
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	—	—	13,155	228
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	—	—	13,000	113
TERRENO REALTY CORP	—	—	4,715	278
AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,900	109	3,438	115
RLJ LODGING TRUST	—	—	20,400	277
AMERICOLD REALTY TRUST	42,543	1,588	29,343	1,117
CORESITE REALTY CORP	2,001	280	4,356	537
VEREIT INC	13,497 (△662,860)	600 (△4,686)	39,380	1,020
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	—	—	17,722	367
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	—	—	4,000	104
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,108	138	17,820	315
WHITESTONE REIT	—	—	19,250	134
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	—	—	12,170	321
STAG INDUSTRIAL INC	11,320	438	17,173	597

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	— (△115,918)	— (△821)	29,856	280
CYRUSONE INC	5,942	443	12,922	940
WP CAREY INC	11,069	849	19,283	1,413
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	—	5,430	102
GLADSTONE LAND CORP	4,000	101	—	—
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	9,208	262	26,535	744
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	—	—	4,870	354
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	—	—	7,500	97
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	6,888	297	6,325	272
PHYSICIANS REALTY TRUST	—	—	13,337	245
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	9,227	500	11,827	624
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	13,059	513	31,575	1,106
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	15,493	275	22,700	372
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,360	289	1,600	324
JBG SMITH PROPERTIES	3,705	110	9,304	294
AMERICAN FINANCE TRUST INC	—	—	8,000	78
RETAIL VALUE	— (560)	— (8)	—	—
INVITATION HOMES INC	32,318	1,216	72,405	2,454
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	—	—	30,230	491
QTS REALTY TRUST INC	1,912	147	40,849	3,147
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	120,000 (—)	92 (△10)	120,000	88
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	—	—	9,217	104
SAFEHOLD INC	—	—	1,600	108
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,290	425	9,712	300
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	4,781	132	9,129	222
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12,127	216	19,252	327
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	14,498 (1,399)	669 (60)	24,497	1,092
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	11,909	271	35,691	727
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	146	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	35,200	618
PRIME US REIT	— (—)	— (△6)	—	—

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	137	—	—
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	106	—	—
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	— (6,500)	— (60)	—	—
FARMLAND PARTNERS INC	—	—	6,800	92
CITY OFFICE REIT INC	—	—	12,000	103
NETSTREIT CORP	20,992	447	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	235	—	—
WASHINGTON PRIME GROUP INC	— (△80,222)	— (—)	10,028	19
CARETRUST REIT INC	—	—	13,000	279
CTO REALTY GROWTH INC	2,800 (△2,800)	112 (△112)	—	—
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	163	—	—
APARTMENT INCOME REIT CO	6,448 (94,106)	316 (—)	13,415	586
BROADSTONE NET LEASE INC-A	86,966	2,015	—	—
CTO REALTY GROWTH INC	— (2,800)	— (112)	—	—
CEDAR REALTY TRUST INC	6,800	159	—	—
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	— (△45,000)	— (△196)	—	—
STORE CAPITAL CORP	9,477	324	19,878	675
PARAMOUNT GROUP INC	—	—	13,000	138
GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,400	94	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	—	—	16,830	253
EQUINIX INC	4,119	3,209	11,213	8,243
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	—	—	5,600	121
XENIA HOTELS & RESORTS INC	—	—	6,800	134
NEXPOINT RESIDENTIAL	—	—	2,711	111
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	12,000	653	6,814	309
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	2,238	110	3,995	199
APPLE HOSPITALITY REIT INC	—	—	22,872	319
GLOBAL NET LEASE INC	5,600	91	7,480	124
MANULIFE US REAL ESTATE INV	— (—)	— (△7)	150,000	110

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	11,900	234	36,481	686
	VICI PROPERTIES INC	65,502	1,958	68,858	1,994
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	—	—	3,000	57
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	7,694	213	7,900	220
	DIGITALBRIDGE GROUP INC	60,497	392	105,110	643
	小 計	1,457,018 (△523,895)	63,899 (2,020)	3,067,761 (66,885)	130,246 (1,308)
	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,000	390	19,600	552
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	6,000	364	12,500	719
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	14,700	241	26,000	394
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	11,500	251	18,000	381
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	—	—	3,000	125
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	—	—	8,500	94
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	—	—	5,000	107
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	—	—	2,700	121
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	9,500	105	13,000	142
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	6,000	92
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,000	109	16,400	262
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	20,300	266	18,000	233
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	84	—	—
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	23,200	342	7,900	112
	BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	82	—	—
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,335	549	6,250	516
	CHOICE PROPERTIES REIT	—	—	22,500	307
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	—	—	4,000	77
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	114	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	17,310	276
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	—	—	23,500	606
	NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	116	—	—
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	—	—	6,000	105
	小 計	173,135	3,020	236,160	5,230
	ドイツ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	—	—	8,000	72

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	6,000 (-)	107 (△52)	16,300	249
	小 計	6,000 (-)	107 (△52)	24,300	322
	イタリア				
	COIMA RES SPA	11,900	84	-	-
	小 計	11,900	84	-	-
	フランス				
	ICADE	1,060	76	2,800	176
	ALTAREA	- (-)	- (△13)	850	140
	KLEPIERRE	7,990 (-)	174 (△111)	30,635	622
	GECINA SA	2,410	311	6,803	853
	COVIVIO (FP)	2,360	180	6,399	483
	MERCIALYS	9,000	85	7,000	71
	CARMILA	- (-)	- (△8)	5,000	65
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,150	437	29,125	1,956
	小 計	28,970 (-)	1,266 (△133)	88,612	4,369
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL	- (1,093)	- (-)	-	-
	VASTNED RETAIL	-	-	3,100	71
	WERELDHAVE NV	-	-	6,100	71
	NSI NV	-	-	2,250	72
	小 計	- (1,093)	- (-)	11,450	215
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	11,000 (-)	102 (△31)	28,600	238
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	- (-)	- (△3)	20,000	88
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	26,500 (-)	244 (△55)	50,432	446
	小 計	37,500 (-)	347 (△89)	99,032	773

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ベルギー				
BEFIMMO S. C. A.	—	—	2,100	73
COFINIMMO	2,568	336	3,818	494
RETAIL ESTATES	—	—	1,200	71
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	—	—	3,200	71
WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,996	182	10,544	316
MONTEA NV	—	—	1,600	160
AEDIFICA	2,270	264	3,611	375
XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	— (8,700)	— (5)	— (8,700)	— (5)
XIOR STUDENT HOUSING NV	— (1,740)	— (79)	— (—)	— (5)
小 計	9,834 (10,440)	782 (85)	26,073 (8,700)	1,564 (11)
アイルランド				
HIBERNIA REIT PLC	—	—	117,000	142
小 計	—	—	117,000	142
その他				
CROMWELL REIT EUR	— (△640,000)	— (—)	110,000	55
小 計	— (△640,000)	— (—)	110,000	55
ユ ー ロ 計	94,204 (△628,467)	2,589 (△189)	476,467 (8,700)	7,442 (11)
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	58,000	301	124,182	629
DERWENT LONDON PLC	3,300	124	11,059	363
BIG YELLOW GROUP PLC	18,400	256	22,500	279
HAMMERSON PLC	201,164	70	446,484	117
WORKSPACE GROUP PLC	—	—	7,700	64
UNITE GROUP PLC	9,000	109	49,110	531
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	—	—	111,649	166
SHAFTESBURY PLC	50,400	286	53,500	320
SEGRE PLC	54,600	659	146,806	1,505
LAND SECURITIES GROUP PLC	43,200	310	109,248	751
ASSURA PLC	—	—	240,000	176

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	23,800	175	51,600	369
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	98,000	77	160,000	123
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	—	—	19,500	154
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	—	—	70,000	153
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	—	—	60,000	44
	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	—	—	75,000	116
	GCP STUDENT LIVING PLC	25,000	53	67,000	120
	RDI REIT PLC	—	—	154,400	187
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	—	50,000	58
	PRS REIT PLC/THE	255,000	281	—	—
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	—	—	70,000	75
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	90,000	103	55,000	58
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	134,000	289	284,954	555
	CUSTODIAN REIT PLC	—	—	58,000	53
	HOME REIT PLC	132,934	148	—	—
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	—	—	70,000	60
	LXI REIT PLC	112,008	161	51,000	66
	REGIONAL REIT LTD	—	—	70,000	54
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	—	—	42,000	46
	小 計	1,308,806	3,408	2,730,692	7,205
	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	56,500	237	122,500	515
	MIRVAC GROUP	131,210	390	447,984	1,169
	CROMWELL PROPERTY GROUP	—	—	360,000	308
	CHARTER HALL RETAIL REIT	—	—	28,000	103
	GPT GROUP	109,440	523	265,502	1,234
	CENTURIA CAPITAL GROUP	90,300	269	38,000	104
	ABACUS PROPERTY GROUP	(40,123)	(116)	—	—
	STOCKLAND	111,890	497	315,858	1,412
	DEXUS	48,360	507	148,872	1,476
	GOODMAN GROUP	67,650	1,496	197,025	3,849
	VICINITY CENTERS	107,770	170	386,477	617
	CHARTER HALL GROUP	11,700	193	48,025	666
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	—	—	32,000	103

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	—	—	45,800	232
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	—	—	104,000	252
	ARENA REIT	—	—	40,000	114
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	35,000	125	18,394	62
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	135,105 (25,369)	667 (117)	134,274	659
	DEXUS INDUSTRIA REIT	38,000	132	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	— (55,000)	— (110)	80,000	149
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	—	—	32,000	101
	HOME CONSORTIUM	16,500	122	— (—)	— (50)
	RURAL FUNDS GROUP	— (25,329)	— (62)	47,000	124
	IRONGATE GROUP	—	—	68,000	101
	SCENTRE GROUP	269,370	734	695,772	1,936
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	—	—	52,900	158
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	223,142 (45,500)	295 (50)	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	— (20,000)	— (50)	28,055	59
	AVENTUS GROUP	40,000	132	36,500	104
	WAYPOINT REIT LTD	— (△25,697)	— (△70)	80,000	197
	小 計	1,491,937 (185,624)	6,497 (436)	3,852,938 (—)	15,817 (50)
	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	— (32,894)	— (50)	—	—
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	—	—	16,111	47
	GOODMAN PROPERTY TRUST	—	—	80,000	179
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	—	—	240,000	303
	ARGOSY PROPERTY LTD	—	—	60,000	92
	小 計	— (32,894)	— (50)	396,111	623
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	93,000	6,687	267,400	19,035

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	PROSPERITY REIT	—	—	200,000	476
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	—	—	150,000	581
	CHAMPION REIT	—	—	165,000	730
	FORTUNE REIT	—	—	226,000	1,690
	小 計	93,000	6,687	1,008,400	22,515
	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	510,000	1,054	634,800	1,350
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	315,200 (66,318)	963 (132)	326,600	1,002
	SUNTEC REIT	—	—	202,000	310
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168,400 (—)	345 (△22)	247,500	502
	STARHILL GLOBAL REIT	—	—	250,000	110
	ASCOTT TRUST	— (—)	— (△12)	125,000	131
	KEPPEL REIT	190,000	218	285,000	327
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	276,100	682	303,000	708
	ESR REIT	— (44,930)	— (17)	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	— (—)	— (△6)	—	—
	CAPITALAND CHINA TRUST	92,800 (26,192)	129 (21)	79,000	103
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	— (—)	— (△17)	—	—
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	— (—)	— (△4)	100,000	118
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	22,500 (—)	107 (△5)	55,000	233
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	— (1,526,400)	— (88)	2,480,400	126
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	165,800 (46,103)	473 (120)	175,000	498
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	150,000 (—)	314 (△6)	358,700	752
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	140,000 (53,977)	121 (28)	150,000	107
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	—	—	478,540	205

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	245,000 (-)	246 (△37)	395,000	389
	SPH REIT	-	-	150,000	124
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	- (-)	- (△1)	689,516	369
	EC WORLD REIT	- (-)	- (△2)	-	-
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- (-)	- (△1)	250,000	100
	LIPPO MALLS INDONESIA RE-RTS	- (1,526,400)	- (-)	- (1,526,400)	- (2)
	FIRST REAL ESTATE INVT-RTS	- (527,338)	- (-)	527,338	1
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	- (-)	- (△0.80822)	460,000	214
	IREIT GLOBAL	- (71,565)	- (42)	-	-
	KEPPEL DC REIT	96,900 (-)	249 (△4)	181,800	479
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	225,400 (-)	329 (△36)	278,000	404
	小 計	2,598,100 (3,889,223)	5,235 (292)	9,182,194 (1,526,400)	8,674 (2)
	韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	53,493	-	-
	LOTTE REIT CO LTD	- (28,500)	- (137,236)	25,050	128,789
	LOTTE REIT CO LTD-RIGHTS	- (28,500)	- (-)	- (28,500)	- (3,428)
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	20,000	98,531	-	-
	JR REIT XXVII	64,338	343,829	-	-
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	54,685	426,229	-	-
	小 計	150,276 (57,000)	922,083 (137,236)	25,050 (28,500)	128,789 (3,428)
	イスラエル	口	千イスラエルシェケル	口	千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	-	-	28,000	433
	小 計	-	-	28,000	433

(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^{*}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	7,791	—	—	19,995	16	0.1
金銭信託	0.000955	0.000955	100.0	0.000955	0.000955	100.0
コール・ローン	36,595	184	0.5	36,443	184	0.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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	75,111	76,688	15,870	1,791,153	1.8	
ALEXANDER'S INC	1,490	1,190	328	37,105	0.0	
BOSTON PROPERTIES	91,098	79,135	9,299	1,049,502	1.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	144,943	135,453	3,857	435,380	0.4	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	94,622	79,751	640	72,275	0.1	
AGREE REALTY CORP	34,169	38,105	2,658	300,047	0.3	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	101	11,449	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	46,455	37,875	2,903	327,645	0.3	
EPR PROPERTIES	47,882	41,912	2,184	246,584	0.2	
PROLOGIS INC	476,036	410,213	60,896	6,872,736	6.7	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	90,976	77,265	18,553	2,093,964	2.1	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	174,408	152,908	2,267	255,924	0.3	
CAMDEN PROPERTY TRUST	62,413	56,019	9,128	1,030,219	1.0	
MACK-CALI REALTY CORP	61,336	42,236	815	91,998	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	111,205	97,618	4,476	505,247	0.5	
COUSINS PROPERTIES INC	94,418	82,626	3,293	371,701	0.4	
URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	15,050	315	35,584	0.0	
SITE CENTERS CORP	94,320	99,620	1,670	188,547	0.2	
DUKE REALTY CORP	239,972	208,984	11,838	1,336,143	1.3	
ESSEX PROPERTY TRUST	42,232	36,162	12,318	1,390,234	1.4	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	220,306	190,281	16,299	1,839,558	1.8	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,928	39,550	5,069	572,190	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	80,762	71,853	4,332	488,992	0.5	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	348,571	299,893	10,190	1,150,084	1.1	
EQUITY COMMONWEALTH	76,912	67,845	1,757	198,315	0.2	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	87,029	81,610	2,609	294,459	0.3	

* 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	65,752	57,872	2,707	305,605	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	103,744	94,169	1,105	124,771	0.1
WELLTOWER INC	269,631	233,908	19,973	2,254,198	2.2
EASTGROUP PROPERTIES, INC	25,236	22,299	4,421	498,979	0.5
KIMCO REALTY CORP	277,299	339,870	7,901	891,817	0.9
KILROY REALTY CORPORATION	67,166	58,949	4,220	476,353	0.5
LTC PROPERTIES INC	26,976	20,624	698	78,859	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	142,800	132,800	468	52,906	0.1
MONMOUTH REIT -CL A	62,052	54,952	1,156	130,487	0.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	105,620	93,620	1,306	147,500	0.1
IRON MOUNTAIN INC	184,472	160,382	7,630	861,231	0.8
MACERICH CO/THE	67,797	118,542	2,543	287,105	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,782	94,155	7,953	897,606	0.9
ACADIA REALTY TRUST	53,940	46,940	1,053	118,932	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	451,304	401,344	7,356	830,269	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	73,128	64,502	13,064	1,474,502	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	21,650	253	28,636	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	28,244	25,030	1,407	158,843	0.2
CENTERSPACE	8,899	7,499	756	85,353	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,199	8,599	292	32,986	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	35,000	56	6,399	0.0
GETTY REALTY CORP	21,985	21,985	719	81,210	0.1
PS BUSINESS PARKS INC	12,689	11,172	1,974	222,808	0.2
RPT REALTY	58,950	43,950	610	68,847	0.1
REALTY INCOME CORP	221,064	307,228	21,800	2,460,449	2.4
REGENCY CENTERS CORP	100,891	84,860	6,254	705,846	0.7
UDR INC	189,351	153,803	8,493	958,520	0.9
CORPORATE OFFICE PPTYS	74,559	63,159	1,784	201,369	0.2
CORECIVIC INC	84,463	—	—	—	—
SAUL CENTERS INC	8,800	6,800	350	39,508	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	195,908	182,102	30,500	3,442,259	3.4
LIFE STORAGE INC	29,766	44,161	5,780	652,357	0.6
PUBLIC STORAGE	98,128	84,460	27,449	3,097,950	3.0
SUN COMMUNITIES INC	63,122	64,445	12,486	1,409,194	1.4
TAUBMAN CENTERS INC	40,750	—	—	—	—
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	69,270	57,370	1,157	130,661	0.1
UMH PROPERTIES INC	27,000	25,320	601	67,868	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	20,150	456	51,554	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	8,473	6,973	415	46,942	0.0
VENTAS INC	239,651	218,755	11,554	1,304,056	1.3
VORNADO REALTY TRUST	100,291	90,208	4,082	460,786	0.5
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	56,070	45,570	1,179	133,153	0.1
GEO GROUP INC/THE	76,306	64,306	601	67,858	0.1
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	77,345	—	—	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	88,380	76,794	4,151	468,536	0.5
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	118,586	2,557	288,684	0.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	83,586	73,984	14,627	1,650,845	1.6
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	57,973	322	36,443	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)	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	147,497	124,047	1,591	179,619	0.2
CUBESMART	123,373	111,990	6,057	683,653	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	173,526	156,521	24,597	2,776,048	2.7
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	125,540	114,240	1,182	133,443	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	338,528	334,846	7,132	804,942	0.8
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	108,820	97,197	3,489	393,810	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	79,115	69,259	1,258	142,027	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	81,079	67,924	1,281	144,578	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	76,470	63,470	651	73,566	0.1
TERRENO REALTY CORP	43,364	38,649	2,921	329,717	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,595	30,057	1,190	134,366	0.1
RLJ LODGING TRUST	112,691	92,291	1,394	157,385	0.2
AMERICOLD REALTY TRUST	130,640	143,840	4,208	475,000	0.5
CORESITE REALTY CORP	27,185	24,830	3,995	450,892	0.4
VEREIT INC	688,743	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	89,335	71,613	1,813	204,723	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	31,830	27,830	757	85,495	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	29,639	424	47,901	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,360	341	38,524	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	136,456	127,744	1,866	210,635	0.2
WHITESTONE REIT	38,340	19,090	185	20,898	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	96,900	84,730	2,251	254,079	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	97,831	91,978	3,895	439,619	0.4
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	145,774	—	—	—	—
CYRUSONE INC	75,076	68,096	5,541	625,430	0.6
WP CAREY INC	111,658	103,444	7,941	896,265	0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC	47,000	41,570	1,055	119,166	0.1
GLADSTONE LAND CORP	11,500	15,500	386	43,610	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	138,931	121,604	4,087	461,271	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,566	30,696	2,806	316,710	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,000	30,500	464	52,459	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	65,819	66,382	3,238	365,453	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	131,899	118,562	2,193	247,546	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	79,195	76,595	5,298	598,027	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	170,668	152,152	6,131	692,026	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	65,538	58,331	1,435	162,013	0.2
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,638	13,398	3,762	424,597	0.4
JBG SMITH PROPERTIES	71,542	65,943	1,978	223,344	0.2
AMERICAN FINANCE TRUST INC	67,590	59,590	514	58,106	0.1
RETAIL VALUE	8,969	9,529	59	6,689	0.0
INVITATION HOMES INC	360,577	320,490	12,989	1,465,990	1.4
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	30,230	—	—	—	—
QTS REALTY TRUST INC	38,937	—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC	22,000	22,000	342	38,634	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	470,000	376	42,435	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	90,335	81,118	847	95,669	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	15,900	442	49,922	0.0
SAFEHOLD INC	9,940	8,340	620	70,019	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)		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	68,320	2,003	226,074	0.2	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	43,270	38,922	1,003	113,200	0.1	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	73,383	66,258	1,268	143,201	0.1	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,903	124,303	6,038	681,520	0.7	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	188,767	164,985	4,071	459,546	0.5	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	28,700	156	17,717	0.0	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	35,200	—	—	—	—	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	40	4,561	0.0	
PRIME US REIT	295,000	295,000	246	27,800	0.0	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	—	7,000	141	15,934	0.0	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	—	5,700	108	12,190	0.0	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,500	13,000	106	12,001	0.0	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	14,850	207	23,446	0.0	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	12,200	148	16,743	0.0	
CITY OFFICE REIT INC	37,050	25,050	471	53,263	0.1	
NETSTREIT CORP	—	20,992	500	56,528	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	17,000	242	27,397	0.0	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	90,250	—	—	—	—	
CARETRUST REIT INC	65,477	52,477	1,108	125,143	0.1	
INDUS REALTY TRUST INC	—	2,340	173	19,579	0.0	
APARTMENT INCOME REIT CO	—	87,139	4,647	524,572	0.5	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	—	86,966	2,265	255,680	0.3	
CTO REALTY GROWTH INC	—	2,800	155	17,503	0.0	
CEDAR REALTY TRUST INC	—	6,800	153	17,375	0.0	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	—	—	—	—	
STORE CAPITAL CORP	145,678	135,277	4,627	522,296	0.5	
PARAMOUNT GROUP INC	102,726	89,726	834	94,176	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	33,930	569	64,218	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	76,680	59,850	1,104	124,691	0.1	
EQUINIX INC	57,071	49,977	39,871	4,499,858	4.4	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	53,268	47,668	1,030	116,257	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	69,830	63,030	1,224	138,216	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	15,100	12,389	927	104,726	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,124	45,310	2,817	317,969	0.3	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,300	12,543	594	67,085	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	138,263	115,391	1,879	212,145	0.2	
GLOBAL NET LEASE INC	58,892	57,012	893	100,826	0.1	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	70	7,991	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	886,564	736,564	522	59,021	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	155,994	131,413	2,754	310,863	0.3	
VICI PROPERTIES INC	342,155	338,799	9,906	1,118,045	1.1	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	22,900	19,900	312	35,238	0.0	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,250	44,044	1,289	145,545	0.1	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	325,506	280,893	2,188	246,955	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	16,356,888	14,155,365	683,603	77,151,546	
	銘 柄 数 < 比 率 >	155	156	—	< 75.6% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	48,076	41,476	1,335	121,169	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)		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	52,420	45,920	2,794	253,436	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	92,539	81,239	1,371	124,378	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TR	95,631	89,131	2,039	184,966	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	36,942	33,942	1,520	137,887	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	47,120	547	49,618	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	13,820	335	30,434	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	11,360	622	56,442	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	40,330	487	44,187	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,577	26,577	501	45,510	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	43,490	34,090	628	56,984	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,170	60,470	819	74,316	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	12,890	247	22,435	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	8,700	83	7,583	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	42,950	58,250	1,001	90,872	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	—	20,000	83	7,528	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	47,000	1,090	98,899	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,620	18,705	1,884	170,909	0.2	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	25,800	192	17,503	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	108,670	86,170	1,322	119,969	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	11,100	255	23,135	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	27,730	509	46,202	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	25,000	114	10,339	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	—	23,900	108	9,841	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	74,815	57,505	1,097	99,515	0.1	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	—	—	—	—	
SLATE GROCERY REIT	10,300	10,300	137	12,481	0.0	
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	—	9,000	117	10,685	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	17,000	88	8,064	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	12,000	163	14,813	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,850	29,850	686	62,270	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,089,400	1,026,375	22,187	2,012,385	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	30	—	< 2.0% >	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	45,000	37,000	371	48,649	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	110,000	99,700	1,941	253,961	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	155,000	136,700	2,313	302,610	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.3% >	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	137	17,926	0.0	
COIMA RES SPA	—	11,900	87	11,427	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	33,790	45,690	224	29,353	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 0.0% >	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	19,880	18,140	1,244	162,805	0.2	
ALTAREA	2,730	1,880	352	46,092	0.0	
KLEPIERRE	130,130	107,485	2,382	311,760	0.3	
GECINA SA	34,685	30,292	3,713	485,876	0.5	
COVIVIO(FP)	30,792	26,753	2,021	264,537	0.3	

銘柄	当期末(前期末)		当期			比率 (%)
	口数 (口)	口数 (口)	評価額		比率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
MERCIALYS	26,000	28,000	269	35,277	0.0	
CARMILA	30,000	25,000	352	46,117	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	88,146	65,171	4,505	589,424	0.6	
小計	口数・金額	362,363	302,721	14,842	1,941,891	
	銘柄数<比率>	8	8	—	<1.9%>	
(オランダ)			千ユーロ			
EUROCOMMERCIAL	19,690	—	—	—	—	
VASTNED RETAIL	13,750	10,650	265	34,763	0.0	
WERELDHAVE NV	28,770	22,670	321	42,027	0.0	
NSI NV	12,300	10,050	357	46,742	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	—	20,783	432	56,569	0.1	
小計	口数・金額	74,510	64,153	1,376	180,103	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.2%>	
(スペイン)			千ユーロ			
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	161,062	143,462	1,229	160,851	0.2	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	54,000	34,000	184	24,153	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,418	187,486	1,810	236,850	0.2	
小計	口数・金額	426,480	364,948	3,224	421,855	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.4%>	
(ベルギー)			千ユーロ			
BEFIMMO S. C. A.	16,110	14,010	498	65,160	0.1	
COFINIMMO	17,017	15,767	2,232	292,091	0.3	
RETAIL ESTATES	7,600	6,400	449	58,863	0.1	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	15,300	12,100	326	42,742	0.0	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	83,470	77,922	3,132	409,820	0.4	
MONTEA NV	6,900	5,300	682	89,309	0.1	
AEDIFICA	21,260	19,919	2,302	301,253	0.3	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	15,000	408	53,476	0.1	
XIOR STUDENT HOUSING NV	8,700	10,440	537	70,342	0.1	
小計	口数・金額	191,357	176,858	10,571	1,383,060	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<1.4%>	
(アイルランド)			千ユーロ			
HIBERNIA REIT PLC	482,550	365,550	469	61,407	0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	260,000	426	55,785	0.1	
小計	口数・金額	742,550	625,550	895	117,193	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
(その他)			千ユーロ			
CROMWELL REIT EUR	910,000	160,000	411	53,797	0.1	
小計	口数・金額	910,000	160,000	411	53,797	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
ユーロ計	口数・金額	2,896,050	1,876,620	33,859	4,429,865	
	銘柄数<比率>	30	31	—	<4.3%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	594,850	528,668	2,675	409,203	0.4	
DERWENT LONDON PLC	70,541	62,782	2,154	329,505	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	101,146	97,046	1,460	223,419	0.2	
HAMMERSON PLC	2,536,320	2,291,000	775	118,628	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	78,047	70,347	577	88,401	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)	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,418	0.0
UNITE GROUP PLC	260,682	220,572	2,442	373,680	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	840,537	728,888	1,121	171,595	0.2
SHAFTESBURY PLC	160,293	157,193	1,014	155,215	0.2
SEGRO PLC	761,570	669,364	8,865	1,356,190	1.3
LAND SECURITIES GROUP PLC	477,505	411,457	2,867	438,695	0.4
ASSURA PLC	1,707,040	1,467,040	1,071	163,933	0.2
STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	260,756	195	29,836	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	169,580	141,780	1,063	162,660	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	350,000	176	26,930	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	330,000	320	49,066	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	552,000	490,000	380	58,165	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	135,537	116,037	1,431	219,037	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	567,660	497,660	1,341	205,238	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	495,000	435,000	432	66,142	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	545,297	470,297	799	122,300	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC	300,000	258,000	543	83,076	0.1
RDI REIT PLC	154,400	—	—	—	—
NEWRIVER REIT PL	186,000	186,000	140	21,538	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	380,067	330,067	309	47,359	0.0
PRS REIT PLC/THE	—	255,000	257	39,397	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	203,286	198	30,319	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	431,000	466,000	552	84,471	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,092,658	941,704	2,143	327,863	0.3
CUSTODIAN REIT PLC	292,276	234,276	230	35,335	0.0
HOME REIT PLC	—	132,934	152	23,283	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	376,000	306,000	272	41,613	0.0
AEW UK REIT PLC	118,000	118,000	129	19,747	0.0
LXI REIT PLC	330,000	391,008	561	85,890	0.1
REGIONAL REIT LTD	292,000	222,000	197	30,223	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	177,355	211	32,338	0.0
小 計	15,961,363	14,539,477	37,077	5,671,724	
銘柄数<比率>	34	35	—	<5.6%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BWP TRUST	328,160	262,160	1,090	90,747	0.1
MIRVAC GROUP	2,507,500	2,190,726	6,265	521,350	0.5
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,222,633	862,633	720	59,936	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	324,160	296,160	1,255	104,488	0.1
GPT GROUP	1,237,517	1,081,455	5,569	463,437	0.5
CENTURIA CAPITAL GROUP	304,000	356,300	1,190	99,023	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	192,593	232,716	830	69,130	0.1
STOCKLAND	1,530,344	1,326,376	5,995	498,862	0.5
DEXUS	696,940	596,428	6,691	556,834	0.5
GOODMAN GROUP	1,069,018	939,643	22,128	1,841,320	1.8
VICINITY CENTERS	2,435,040	2,156,333	3,816	317,588	0.3
CHARTER HALL GROUP	295,694	259,369	4,964	413,081	0.4
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	198,760	166,760	703	58,557	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP	202,588	156,788	1,001	83,366	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)		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	689,060	585,060	1,696	141,180	0.1	
ARENA REIT	241,053	201,053	908	75,617	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	285,000	301,606	1,121	93,359	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,112	320,312	1,553	129,267	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	75,000	113,000	380	31,687	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	626,340	601,340	1,449	120,590	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	114,885	82,885	290	24,207	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	324,500	324,500	365	30,376	0.0	
HOME CONSORTIUM	91,000	107,500	856	71,292	0.1	
RURAL FUNDS GROUP	212,766	191,095	548	45,635	0.0	
IRONGATE GROUP	340,000	272,000	432	35,986	0.0	
SCENTRE GROUP	3,310,393	2,883,991	9,026	751,127	0.7	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	242,250	189,350	710	59,084	0.1	
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	—	268,642	397	33,083	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	249,000	240,945	566	47,115	0.0	
AVENTUS GROUP	230,000	233,500	810	67,420	0.1	
WAYPOINT REIT LTD	495,796	390,099	1,080	89,914	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	20,366,102	18,190,725	84,421	7,024,672	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 6.9% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AMP NZ OFFICE LTD	650,000	682,894	1,092	87,869	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	239,460	223,349	661	53,166	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	680,300	600,300	1,440	115,862	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,098,490	858,490	978	78,705	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	562,278	502,278	758	60,993	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,230,528	2,867,311	4,931	396,597	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.4% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	1,337,800	1,163,400	80,856	1,171,607	1.1	
PROSPERITY REIT	952,000	752,000	2,271	32,907	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	968,000	818,000	2,756	39,944	0.0	
CHAMPION REIT	1,303,000	1,138,000	4,631	67,112	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	561,000	2,524	36,580	0.0	
FORTUNE REIT	982,000	756,000	6,146	89,059	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	6,103,800	5,188,400	99,186	1,437,211	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.4% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,929,844	2,805,044	6,030	505,324	0.5	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,792,400	1,847,318	5,726	479,839	0.5	
SUNTEC REIT	1,382,700	1,180,700	1,818	152,353	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,659,800	1,580,700	3,113	260,920	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	859,400	554	46,445	0.0	
ASCOTT TRUST	1,116,877	991,877	1,091	91,420	0.1	
KEPPEL REIT	1,146,400	1,051,400	1,209	101,311	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	661,162	634,262	1,490	124,890	0.1	
ESR REIT	1,404,065	1,448,995	688	57,670	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	417,200	529	44,395	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	467,729	507,721	604	50,624	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)		
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	538,100	142	11,948	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	275,000	382	32,028	0.0	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	258,000	225,500	1,093	91,639	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	—	—	—	—	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,052,060	1,088,963	2,929	245,446	0.2	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,450,173	1,241,473	2,644	221,569	0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	701,000	744,977	666	55,867	0.1	
SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	—	—	—	—	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,372,100	1,222,100	1,209	101,375	0.1	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	540,000	342	28,731	0.0	
SPH REIT	726,800	576,800	588	49,296	0.0	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	—	—	—	—	
EC WORLD REIT	180,000	180,000	146	12,291	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	295,800	252	21,191	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,523,644	1,273,644	560	46,956	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	555,000	499	41,853	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	—	—	—	—	
IREIT GLOBAL	334,420	405,985	263	22,111	0.0	
KEPPEL DC REIT	794,803	709,903	1,668	139,784	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,662,696	1,610,096	2,431	203,714	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	29,029,229	24,807,958	38,680	3,241,001	
	銘 柄 数<比 率>	31	27	—	<3.2%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	42,950	211,099	20,223	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	19,093	152,171	14,578	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	—	11,253	66,167	6,338	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	69,030	72,480	406,612	38,953	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	—	20,000	135,000	12,933	0.0	
JR REIT XXVII	—	64,338	350,642	33,591	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	—	54,685	355,452	34,052	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	131,073	284,799	1,677,145	160,670	
	銘 柄 数<比 率>	3	7	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD	131,500	103,500	2,157	78,399	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	131,500	103,500	2,157	78,399	
	銘 柄 数<比 率>	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	95,295,933	83,040,530	—	101,604,075	
	銘 柄 数<比 率>	322	329	—	<9.5%>	

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

(注2) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	101,604,075	99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	740,657	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	102,344,732	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(102,118,960千円)の投資信託財産総額(102,344,732千円)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=112.86円	1カナダドル=90.70円	1ユーロ=130.83円
1イギリスポンド=152.97円	1オーストラリアドル=83.21円	1ニュージーランドドル=80.42円
1香港ドル=14.49円	1シンガポールドル=83.79円	1韓国ウォン=0.0958円
1イスラエルシェケル=36.33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 2021年11月10日現在
(A)資 産	102,533,890,848円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	292,607,376
投 資 証 券(評価額)	101,604,075,350
未 収 入 金	526,355,608
未 収 配 当 金	110,852,514
(B)負 債	415,617,846
未 払 金	189,168,171
未 払 解 約 金	226,449,174
未 払 利 息	501
(C)純 資 産 総 額(A-B)	102,118,273,002
元 本	41,344,855,558
次 期 繰 越 損 益 金	60,773,417,444
(D)受 益 権 総 口 数	41,344,855,558口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,699円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年11月11日 至 2021年11月10日
(A)配 当 等 収 益	2,839,610,715円
受 取 配 当 金	2,731,871,684
受 取 利 息	4,255
そ の 他 収 益 金	107,812,028
支 払 利 息	△77,252
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	31,240,570,791
売 買 益	31,891,326,098
売 買 損	△650,755,307
(C)そ の 他 費 用	△34,927,097
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	34,045,254,409
(E)前 期 繰 越 損 益 金	32,574,915,014
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	6,742,936,576
(G)解 約 差 損 益 金	△12,589,688,555
(H)計 (D+E+F+G)	60,773,417,444
次 期 繰 越 損 益 金(H)	60,773,417,444

(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47,638,239,657円、期中追加設定元本額は5,806,807,418円、期中一部解約元本額は12,100,191,517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)	18,527,832,170円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,900,520,336円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,749,701,772円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,688,304,507円
分散投資コア戦略ファンドS	1,476,522,681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)	1,332,838,008円
コア投資戦略ファンド(安定型)	773,880,033円
コア投資戦略ファンド(切替型)	707,282,641円
分散投資コア戦略ファンドA	686,275,561円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	395,165,566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)	380,060,218円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	243,042,473円
グローバル経済コア	234,147,354円
SMT インデックスバランス・オープン	148,832,557円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	120,780,943円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	117,898,872円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	115,466,049円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	114,483,266円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	113,795,776円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	111,276,286円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	109,554,738円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	102,813,861円
グローバル3資産バランスオープン	65,498,256円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	50,672,643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)	40,337,933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)	13,960,331円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,849,517円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,003,794円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,057,416円

お知らせ

該当事項はありません。

先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり

運用報告書

第6期（決算日 2022年2月7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2016年10月26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	先進国 [※] の債券(国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。)を主要投資対象とします。 ※この投資信託における「先進国」とは、IMF(“International Monetary Fund”(国際通貨基金)の略称です。)が定義する先進国を指します。
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 円	価 額		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額 総
		騰 落 率	中 率			
第2期(2018年2月7日)	9,884	△1.1	%	97.4	%	百万円 13,421
第3期(2019年2月7日)	10,311	4.3	%	97.6	—	31,413
第4期(2020年2月7日)	10,701	3.8	%	97.6	—	31,606
第5期(2021年2月8日)	10,285	△3.9	%	98.0	—	21,992
第6期(2022年2月7日)	9,534	△7.3	%	98.2	—	12,242

(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。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 円	価 額		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
		騰 落 率	率		
(当 期 首) 2021年 2月8日	10,285	—	%	98.0	%
2月末	9,893	△3.8	%	97.7	—
3月末	9,855	△4.2	%	98.9	—
4月末	9,885	△3.9	%	98.3	—
5月末	9,901	△3.7	%	98.1	—
6月末	9,934	△3.4	%	97.6	—
7月末	10,164	△1.2	%	95.5	—
8月末	10,142	△1.4	%	92.2	—
9月末	9,911	△3.6	%	98.1	—
10月末	9,765	△5.1	%	101.6	—
11月末	9,863	△4.1	%	94.1	—
12月末	9,830	△4.4	%	98.4	—
2022年 1月末	9,651	△6.2	%	95.6	—
(当 期 末) 2022年 2月7日	9,534	△7.3	%	98.2	—

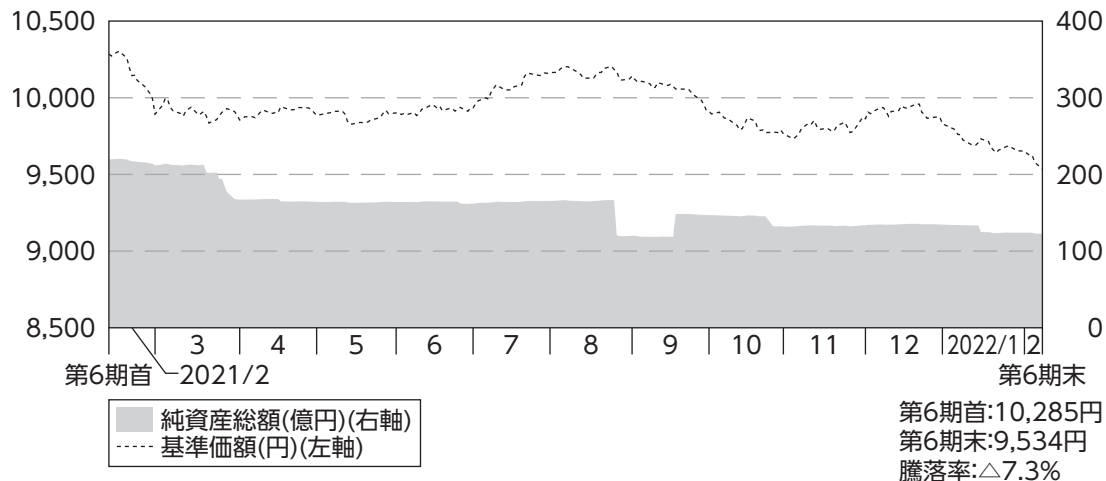
(注1) 騰落率は期首比です。

(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。

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



基準価額の主な変動要因

期初から3月下旬にかけては、米国での追加経済対策の早期成立や新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により、景気や物価の回復が意識され投資国の金利は概ね上昇（債券価格は下落）し、基準価額は下落しました。

4月上旬から8月上旬にかけては、経済の回復ペースが鈍い中、FRB（米連邦準備理事会）の金融引き締め観測が後退したことから投資国の金利は概ね低下（債券価格は上昇）し、基準価額は上昇しました。

8月中旬から期末にかけては、新型コロナウイルス・オミクロン株の感染拡大などにより基準価額は上昇する局面もありましたが、オミクロン株に対する過度な警戒感の後退や、12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）や2022年1月のFRB議長会見の内容を受けた金融引き締め観測の高まり、高インフレを背景としたECB（欧州中央銀行）の利上げ観測の高まりなどから投資国の金利は概ね上昇し、基準価額は下落しました。

投資環境

期初から3月下旬にかけては、米国での追加経済対策の早期成立や新型コロナウイルスのワクチン接種の進展により、景気や物価の回復が意識され投資国の金利は概ね上昇しました。

4月上旬から8月上旬にかけては、経済の回復ペースが鈍い中、FRB(米連邦準備理事会)の金融引き締め観測が後退し投資国の金利は概ね低下しました。

8月中旬から期末にかけては、新型コロナウイルス・オミクロン株の感染拡大などにより投資国の金利は低下する局面もありましたが、オミクロン株に対する過度な警戒感の後退や、高インフレを背景としたFRBやECB(欧州中央銀行)の利上げ観測の高まりなどから、概ね上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

IMF(国際通貨基金)が定義する先進国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国および各銘柄への投資割合を決定しました。期初時点では、為替ヘッジコストが低く、ロールダウン効果の高いシンガポール、ノルウェーを中心にポートフォリオに組み入れました。期末時点では、シンガポール、フィンランド、アイルランド、イスラエル、オーストラリア、ノルウェー、ベルギー、カナダ、フランス、米国を組み入れています。なお、組入外貨建資産については、対円での為替ヘッジを行いました。

当ファンドの組入資産の内容

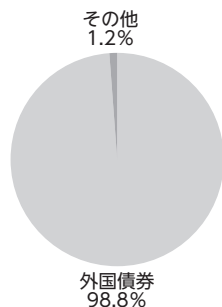
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	RFGB 0.125% 09/15/31	フィンランド	17.5%
2	SIGB 2.625% 05/01/28	シンガポール	14.3%
3	SIGB 1.625% 07/01/31	シンガポール	11.6%
4	ILGOV 1.5% 05/31/37	イスラエル	8.4%
5	IRISH 0.55% 04/22/41	アイルランド	7.9%
6	NGB 3% 03/14/24	ノルウェー	7.0%

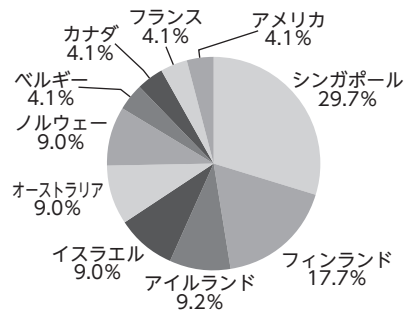
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ACGB 0.25% 11/21/25	オーストラリア	4.9%
8	BGB 0.4% 06/22/40	ベルギー	4.1%
9	CAN 4.0% 06/01/41	カナダ	4.0%
10	FRTR 1.5% 05/25/31	フランス	4.0%
組入銘柄数		16	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

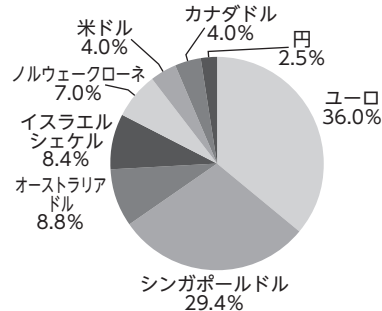
○資産別配分



○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。

今後の運用方針

主として、先進国の債券(国債、州政府債、政府保証債、国際機関債等をいいます。)に投資します。ポートフォリオの構築に当たっては、主として先進国の債券の中から、格付、流動性、財政健全度、為替ヘッジコスト控除後の金利水準等にかかる評価・分析を行い、投資対象国及び各銘柄への投資割合を決定します。組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行うことにより為替変動リスクの低減を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年2月9日~2022年2月7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= $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税= $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	5 (5) (-) (0)	0.051 (0.051) (-) (0.000)	(c) その他費用= $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	5	0.051	

(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(9,899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 22,476	千米ドル 26,921
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 38,315	千カナダドル 44,269
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	千ユーロ 10,951	千ユーロ 15,209
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	22,495	26,573
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	7,201	12,249
	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	28,136	11,002
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	32,456	34,640
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 16,312	千イギリスポンド 16,281
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 73,452	千スウェーデンクローナ 202,451
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 450,166	千ノルウェークローネ 724,036
国	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 42,294	千オーストラリアドル 53,854
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 72,631	千シンガポールドル 86,357
	イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 36,930	千イスラエルシェケル 69,140

(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。)

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為 替 先 物 取 引	194,335	194,335	100.0	183,626	183,626	100.0
為 替 直 物 取 引	18,027	18,027	100.0	27,507	27,507	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	114,159	549	0.5	114,390	677	0.6

(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 3,190	千米ドル 4,193	千円 483,383	% 3.9	% —	% 3.9	% —	% —
カ ナ ダ	千カナダドル 4,200	千カナダドル 5,459	493,515	4.0	—	4.0	—	—
フ ラ ン ス	千ユーロ 3,400	千ユーロ 3,702	488,597	4.0	—	4.0	—	—
ベ ル ギ ー	4,100	3,752	495,193	4.0	—	4.0	—	—
フィンランド	16,800	16,246	2,144,160	17.5	—	17.5	—	—
アイルランド	8,800	8,453	1,115,723	9.1	—	9.1	—	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 79,700	千ノルウェークローネ 81,163	1,062,427	8.7	—	—	8.7	—
オーストラリア	千オーストラリアドル 13,500	千オーストラリアドル 13,330	1,086,444	8.9	—	3.9	4.9	—
シンガポール	千シンガポールドル 41,000	千シンガポールドル 41,796	3,581,162	29.3	—	25.8	3.5	—
イスラエル	千イスラエルシケル 32,400	千イスラエルシケル 29,957	1,077,482	8.8	—	8.8	—	—
合 計	—	—	12,028,092	98.2	—	81.2	17.1	—

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ) 国債証券 T 4.5% 02/15/36	4.5	千米ドル 3,190	千米ドル 4,193	483,383		2036/2/15
(カナダ) 国債証券 CAN 4.0% 06/01/41	4.0	千カナダドル 4,200	千カナダドル 5,459	493,515		2041/6/1
(フランス) 国債証券 FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	千ユーロ 3,400	千ユーロ 3,702	488,597		2031/5/25
(ベルギー) 国債証券 BGB 0.4% 06/22/40	0.4			495,193		2040/6/22
(フィンランド) 国債証券 RFG 0.125% 09/15/31	0.125			2,144,160		2031/9/15
(アイルランド) 国債証券 IRISH 0.55% 04/22/41 IRISH 1.7% 05/15/37	0.55 1.7	7,800 1,000	7,325 1,128	966,802 148,920		2041/4/22 2037/5/15
ユーロ計				4,243,674		
(ノルウェー) 国債証券 NGB 1.75% 03/13/25 NGB 3% 03/14/24	1.75 3.0	千ノルウェー クローネ 17,100 62,600	千ノルウェー クローネ 17,008 64,154	222,639 839,788		2025/3/13 2024/3/14
小計				1,062,427		

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(オーストラリア) 国債証券 ACGB 0.25% 11/21/25 ACGB 2.75% 05/21/41	0.25 2.75	千オースト リアドル 7,800 5,700	千オースト リアドル 7,410 5,920	603,921 482,523		2025/11/21 2041/5/21
小計				1,086,444		
(シンガポール) 国債証券 SIGB 1.25% 11/01/26 SIGB 1.625% 07/01/31 SIGB 2.625% 05/01/28	1.25 1.625 2.625	千シンガポ ールドル 5,000 16,800 19,200	千シンガポ ールドル 4,933 16,592 20,271	422,659 1,421,603 1,736,899		2026/11/1 2031/7/1 2028/5/1
小計				3,581,162		
(イスラエル) 国債証券 ILGOV 1.5% 05/31/37 ILGOV 5.5% 01/31/42	1.5 5.5	千イスラエ ルシェケル 31,300 1,100	千イスラエ ルシェケル 28,313 1,643	1,018,353 59,129		2037/5/31 2042/1/31
小計				1,077,482		
合計				12,028,092		

(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	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 12,028,092	% 75.1		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,984,185	24.9		
投 資 信 託 財 産 総 額	16,012,277	100.0		

(注1) 当期末における外貨建純資産(11,942,016千円)の投資信託財産総額(16,012,277千円)に対する比率は74.6%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=115.26円

1カナダドル=90.40円

1ユーロ=131.98円

1ノルウェークローネ=13.09円

1オーストラリアドル=81.50円

1シンガポールドル=85.68円

1イスラエルシェケル=35.9667円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年2月7日現在
(A)資 産	28,574,104,562円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	321,227,984
公 社 債(評価額)	12,028,092,219
未 収 入 金	16,155,027,826
未 収 利 息	32,106,400
前 払 費 用	37,650,133
(B)負 債	16,331,747,900
未 払 金	16,292,252,024
未 払 解 約 金	39,495,414
未 払 利 息	462
(C)純 資 産 総 額(A-B)	12,242,356,662
元 本	12,840,218,290
次 期 繰 越 損 益 金	△597,861,628
(D)受 益 権 総 口 数	12,840,218,290口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,534円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年2月9日 至 2022年2月7日
(A)配 当 等 収 益	251,682,430円
受 取 利 息	251,883,655
支 払 利 息	△201,225
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,485,622,962
売 買 益	2,826,950,913
売 買 損	△4,312,573,875
(C)そ の 他 費 用	△7,799,669
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,241,740,201
(E)前 期 繰 越 損 益 金	608,795,933
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△16,272,680
(G)解 約 差 損 益 金	51,355,320
(H) 計 (D+E+F+G)	△597,861,628
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△597,861,628

- (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21,383,859,868円、期中追加設定元本額は4,954,641,962円、期中一部解約元本額は13,498,283,540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。

先進国ハイインカム入替戦略オープン 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	3,999,866,978円
先進国ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	3,730,634,804円
先進国ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり2017-02(適格機関投資家専用)	1,878,551,749円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1,736,674,654円
先進国ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり2019-01(適格機関投資家専用)	1,122,285,938円
先進国ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり2018-06(適格機関投資家専用)	281,994,989円
先進国ハイインカム入替戦略ファンド 為替ヘッジあり2018-01(適格機関投資家専用)	89,209,178円
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	1,000,000円

お知らせ

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

運用報告書

第5期(決算日 2022年7月11日)

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2017年10月11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	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。 別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。 iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
組入制限	株式(新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
設定日(2017年10月11日)	10,000	—	10,000	—	—	百万円 3,000
第1期(2018年7月10日)	9,520	△4.8	9,624	△3.8	100.0	17,516
第2期(2019年7月10日)	10,200	7.1	10,341	7.5	99.8	27,180
第3期(2020年7月10日)	12,833	25.8	13,346	29.1	99.0	28,966
第4期(2021年7月12日)	12,644	△1.5	13,227	△0.9	98.9	36,114
第5期(2022年7月11日)	12,005	△5.1	12,602	△4.7	100.1	30,762

ベンチマークは、LBMA金価格(円ヘッジベース)です。

LBMA金価格とは、正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

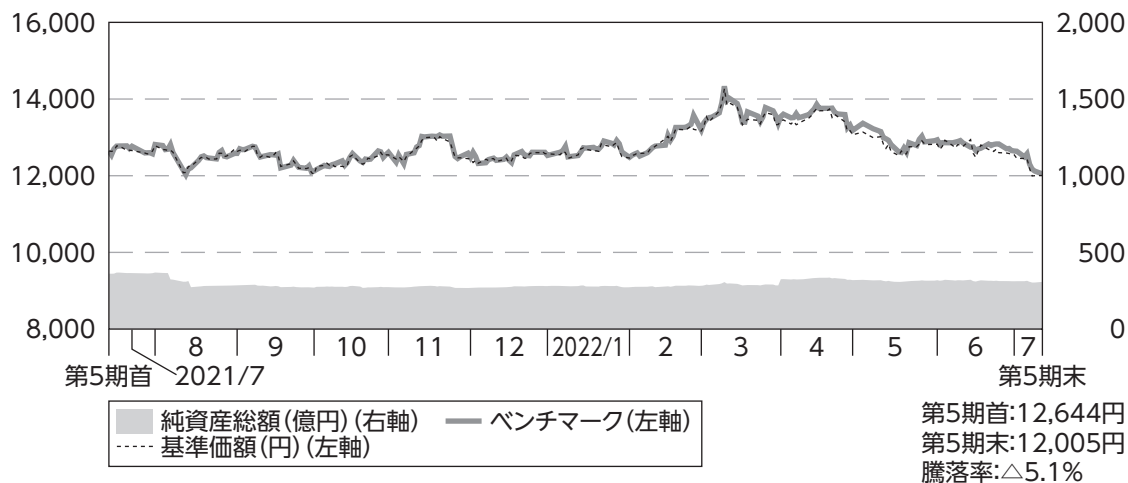
当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		投資信託証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(当 期 首) 2021年 7月12日	円 12,644	% ー	13,227	% ー	% 98.9
7月末	12,783	1.1	13,404	1.3	98.3
8月末	12,635	△0.1	13,161	△0.5	99.7
9月末	12,032	△4.8	12,681	△4.1	101.5
10月末	12,544	△0.8	13,192	△0.3	101.9
11月末	12,437	△1.6	13,052	△1.3	100.7
12月末	12,573	△0.6	13,106	△0.9	101.0
2022年 1月末	12,461	△1.4	13,055	△1.3	99.9
2月末	13,166	4.1	13,801	4.3	99.9
3月末	13,431	6.2	14,168	7.1	99.9
4月末	13,068	3.4	13,788	4.2	105.3
5月末	12,821	1.4	13,533	2.3	98.5
6月末	12,545	△0.8	13,228	0.0	106.0
(当 期 末) 2022年 7月11日	12,005	△5.1	12,602	△4.7	100.1

(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

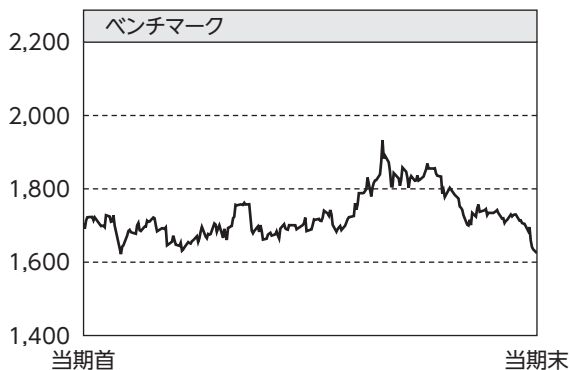


(注)ベンチマークは、2021年7月12日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)の動きを反映して、基準価額は下落しました。

投資環境



金価格は下落しました。

新型コロナウイルスの感染拡大懸念が支えとなった一方、米国の利上げ前倒し観測が高まったことなどから2022年2月上旬にかけて一進一退の展開となりました。3月上旬にかけては、世界的にインフレ懸念が高まっていることや、ロシアによるウクライナへの軍事侵攻を背景に金に対する安全資産需要が強まったことなどから大幅に上昇しました。その後は、ドル高が大幅に進行したことやFRB(米連邦準備理事会)による利上げペースが一段と加速するとの見方が強まったこと、米10年国債利回りが約11年ぶりの高水準まで上昇したことなどが嫌気されて下落し、期末を迎えました。

当ファンドのポートフォリオ

金現物に投資するETF(上場投資信託証券)の組入比率を期を通じて高位に維持し、組入外貨建資産については原則として対円での為替ヘッジを行うことでベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

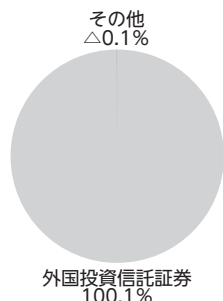
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	100.1%
2	――	――	――
3	――	――	――
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――

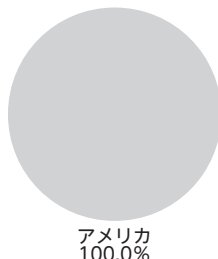
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数			1

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

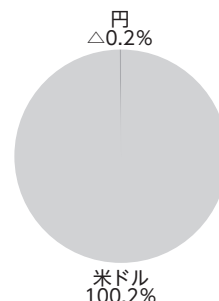
○資産別配分



○国別配分



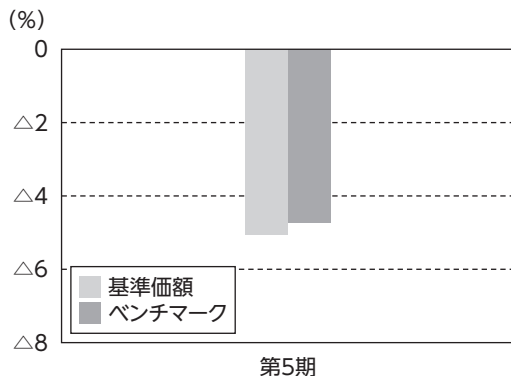
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。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に概ね連動しました。
差異の主な要因は、キャッシュ要因(マイナス要因)です。

今後の運用方針

主として別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)に投資するとともに、組入外貨建資産について原則として対円での為替ヘッジを行うことで、別に定める金現物市場を代表する指標(円ヘッジベース)(以下「ベンチマーク」といいます。)に連動する投資成果を目指します。

別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

別に定める「ベンチマーク」とは、次のものをいいます。

LBMA金価格(円ヘッジベース)

ただし、この投資信託が主要投資対象とする投資対象上場投資信託証券が参照するベンチマークが変更された場合、上記のベンチマークも変更となる場合があります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年7月13日~2022年7月11日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (-) (-) (-) (1) (-) (-)	0.006% (-) (-) (-) (0.006) (-) (-)	(a) 売買委託手数料= $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	0 (-) (-) (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税= $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (2) (-) (0)	0.016 (0.016) (-) (0.000)	(c) その他費用= $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.022	

(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(12,708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	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES GOLD TRUST	1,346	47,192	3,942	134,806
小 計	1,346	47,192	3,942	134,806

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コール・ローン	百万円 41,881	百万円 1,671	% 4.0	百万円 41,925	百万円 1,673	% 4.0

(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		
	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) ISHARES GOLD TRUST			千米ドル	
	9,416	6,820	225,696	30,800,841
合 計	口 数 ・ 金 額 9,416	6,820	225,696	30,800,841
	銘 柄 数 < 比 率 > 1	1	—	<100.1%>

(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。

※ 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。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 30,800,841	% 98.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	539,103	1.7
投 資 信 託 財 産 総 額	31,339,944	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(30,830,126千円)の投資信託財産総額(31,339,944千円)に対する比率は98.4%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=136.47円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年7月11日現在
(A)資 産	62,921,335,647円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	529,941,278
投資信託受益証券(評価額)	30,800,841,961
未 収 入 金	31,590,552,408
(B)負 債	32,158,581,840
未 払 金	32,146,857,996
未 払 解 約 金	11,723,825
未 払 利 息	19
(C)純 資 産 総 額(A-B)	30,762,753,807
元 本	25,625,430,409
次 期 繰 越 損 益 金	5,137,323,398
(D)受 益 権 総 口 数	25,625,430,409口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,005円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年7月13日 至 2022年7月11日
(A)配 当 等 収 益	△77,101円
受 取 利 息	1,327
支 払 利 息	△78,428
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,927,005,300
売 買 益	7,558,863,751
売 買 損	△9,485,869,051
(C)そ の 他 費 用	△4,866,307
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,931,948,708
(E)前 期 繰 越 損 益 金	7,551,613,217
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,041,828,694
(G)解 約 差 損 益 金	△2,524,169,805
(H)計 (D+E+F+G)	5,137,323,398
次 期 繰 越 損 益 金(H)	5,137,323,398

(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28,562,552,203円、期中追加設定元本額は6,967,660,991円、期中一部解約元本額は9,904,782,785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。

分散投資コア戦略ファンドS	10,094,568,830円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,170,298,646円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	2,991,595,246円
分散投資コア戦略ファンドA	2,712,735,507円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,142,523,185円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,401,776,538円
グローバル経済コア	865,761,480円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	703,991,983円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	531,503,932円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	517,708,034円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	319,203,374円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	114,323,910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)	59,439,744円

お知らせ

該当事項はありません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

FOFs用短期金融資産ファンド (適格機関投資家専用)

運用報告書 (全体版)

第12期 (決算日 2022年9月26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			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 金 配 分	期 騰 落 率			
	円	円	%	%	%	百万円
第 8 期 (2018年9月25日)	9,920	0	△0.2	3.7	—	9
第 9 期 (2019年9月25日)	9,897	0	△0.2	—	—	115
第10期 (2020年9月25日)	9,879	0	△0.2	—	—	15
第11期 (2021年9月27日)	9,860	0	△0.2	—	—	13
第12期 (2022年9月26日)	9,842	0	△0.2	—	—	13

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出してしております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
(当 期 首) 2021年 9月27日	円	%	%	%
9月末	9,860	—	—	—
10月末	9,859	△0.0	—	—
11月末	9,857	△0.0	—	—
12月末	9,855	△0.1	—	—
2022年 1月末	9,853	△0.1	—	—
2月末	9,852	△0.1	—	—
3月末	9,851	△0.1	—	—
4月末	9,850	△0.1	—	—
5月末	9,848	△0.1	—	—
6月末	9,846	△0.1	—	—
7月末	9,845	△0.2	—	—
8月末	9,844	△0.2	—	—
(当 期 末) 2022年 9月26日	9,842	△0.2	—	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

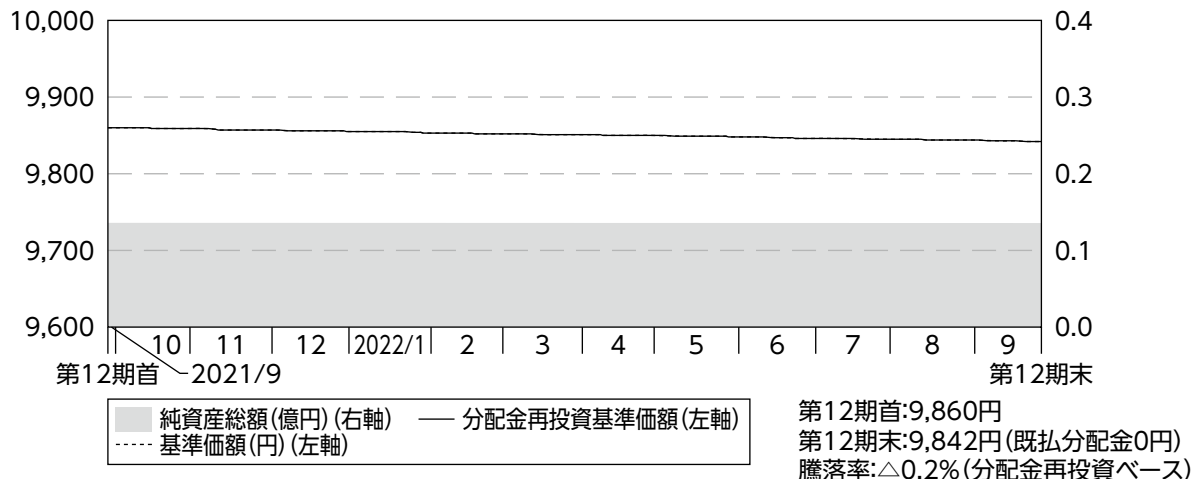
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出してしております。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

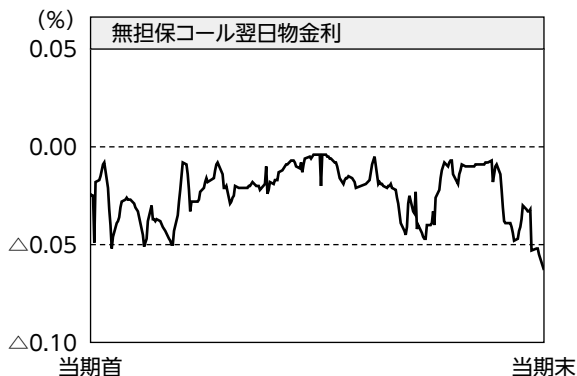


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2021年9月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08~0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等にて運用を行いましたが、マイナス利回りや信託報酬などの要因により、基準価額(分配金再投資ベース)は小幅に下落しました。

投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～0.00%近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

【「短期金融資産 マザーファンド」の運用経過】

日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等にて運用を行いました。

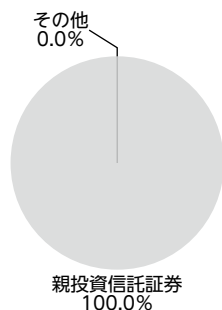
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

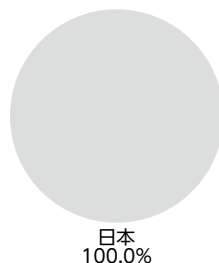
	当期末
	2022年9月26日
短期金融資産 マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

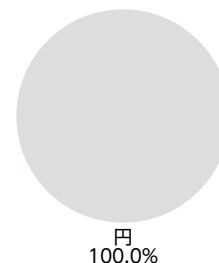
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。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12期	
	2021年9月28日~2022年9月26日	
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	483

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年9月28日~2022年9月26日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.143%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は9,851円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(11)	(0.110)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(2)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	—	—	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(商品)	(—)	(—)	
(先物・オプション)	(—)	(—)	
(c) 有価証券取引税	—	—	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(—)	(—)	
(新株予約権証券)	(—)	(—)	
(オプション証券等)	(—)	(—)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(—)	(—)	
(公社債)	(—)	(—)	
(投資信託証券)	(—)	(—)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(—)	(—)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(—)	(—)	
合計	15	0.148	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 —	千円 —	千口 19	千円 19

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 2	百万円 0.152277	% 7.6	百万円 2	百万円 0.150224	% 7.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<短期金融資産 マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 2,928,178	百万円 136,215	% 4.7	百万円 2,929,111	百万円 135,105	% 4.6

<平均保有割合 0.1%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
短期金融資産 マザーファンド	千口 13,428	千口 13,408	千円 13,564

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、9,046,164千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
短期金融資産 マザーファンド	千円 13,564	% 99.9
コール・ローン等、その他	17	0.1
投資信託財産総額	13,581	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年9月26日現在
(A)資 産	13,581,257円
コール・ローン等	16,936
短期金融資産 マザーファンド(評価額)	13,564,267
未 収 入 金	54
(B)負 債	10,427
未 払 信 託 報 酬	9,699
そ の 他 未 払 費 用	728
(C)純 資 産 総 額(A-B)	13,570,830
元 本	13,789,186
次 期 繰 越 損 益 金	△218,356
(D)受 益 権 総 口 数	13,789,186口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,842円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年9月28日 至 2022年9月26日
(A)有 価 証 券 売 買 損 益	△5,535円
売 買 損	△5,535
(B)信 託 報 酬 等	△20,021
(C)当 期 損 益 金(A+B)	△25,556
(D)前 期 繰 越 損 益 金	△74,902
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	△117,898
(配 当 等 相 当 額)	(654,973)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,871)
(F) 計 (C+D+E)	△218,356
(G)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△218,356
追 加 信 託 差 損 益 金	△117,898
(配 当 等 相 当 額)	(654,973)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△772,871)
分 配 準 備 積 立 金	11,111
繰 越 損 益 金	△111,569

- (注1) (A)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (B)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は13,789,186円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は0円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	－円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	654,973円
(D) 分配準備積立金額	11,111円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	666,084円
(F) 期末残存口数	13,789,186口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	483円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

短期金融資産 マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2022年9月26日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債券先物率 債組入比率	純資産額
	円	騰落率	期騰	期中率		
第11期(2018年9月25日)	10,138	△0.1	10,106	△0.1	3.7	百万円 8,170
第12期(2019年9月25日)	10,129	△0.1	10,100	△0.1	—	8,839
第13期(2020年9月25日)	10,124	△0.0	10,096	△0.0	—	9,348
第14期(2021年9月27日)	10,120	△0.0	10,093	△0.0	—	10,085
第15期(2022年9月26日)	10,116	△0.0	10,091	△0.0	—	9,151

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		参考指数		債券先物率 債組入比率
	円	騰落率	期騰	期中率	
(当期首) 2021年 9月27日	10,120	—	10,093	—	—
9月末	10,120	0.0	10,093	△0.0	—
10月末	10,120	0.0	10,093	△0.0	—
11月末	10,119	△0.0	10,093	△0.0	—
12月末	10,119	△0.0	10,093	△0.0	—
2022年 1月末	10,118	△0.0	10,092	△0.0	—
2月末	10,118	△0.0	10,092	△0.0	—
3月末	10,118	△0.0	10,092	△0.0	—
4月末	10,118	△0.0	10,092	△0.0	—
5月末	10,118	△0.0	10,092	△0.0	—
6月末	10,117	△0.0	10,092	△0.0	—
7月末	10,117	△0.0	10,092	△0.0	—
8月末	10,117	△0.0	10,091	△0.0	—
(当期末) 2022年 9月26日	10,116	△0.0	10,091	△0.0	—

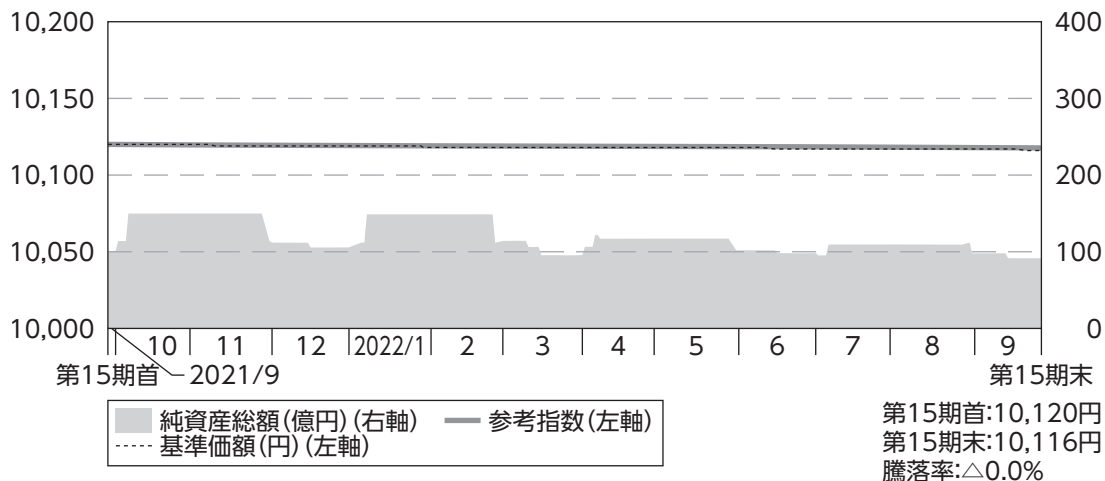
(注1)騰落率は期首比です。

(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

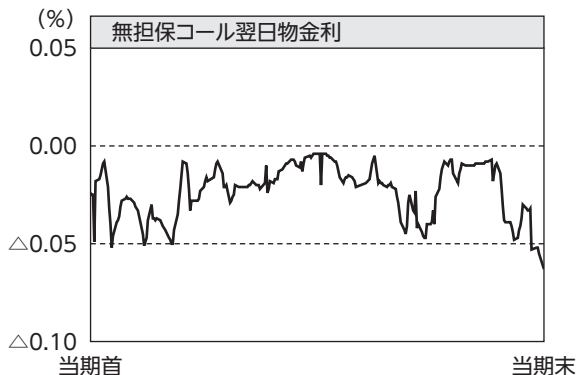


(注)参考指数は、2021年9月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りはマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に△0.1%のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね△0.08～0.00%近辺で推移しました。このような中、コールローン等にて運用を行い、基準価額は横ばい推移となりました。

投資環境



日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」政策が継続され、引き続き良好な国債需給環境が継続したことから、当期の短期国債利回りは概ねマイナス圏で推移しました。また、日銀は当座預金の一部に $\Delta 0.1\%$ のマイナス金利を適用する方針を維持したことから、無担保コール翌日物金利は概ね $\Delta 0.08\sim 0.00\%$ 近辺で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

日銀の金融緩和継続により短期国債のマイナス金利が常態化する中、コールローン等にて運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

当期末における該当事項はありません。

○資産別配分



短期金融資産等
100.0%

○国別配分



日本
100.0%

○通貨別配分



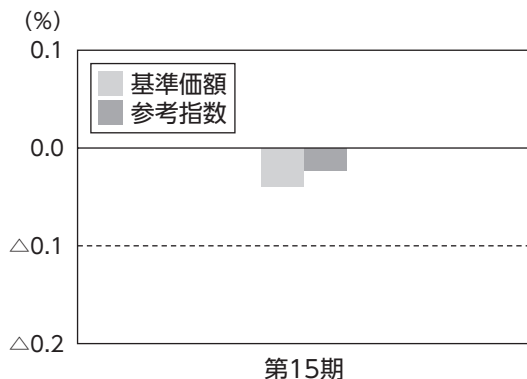
円
100.0%

(注)比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

当期中における該当事項はありません。

売買および取引の状況

当期中における該当事項はありません。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,928,178	百万円 136,215	% 4.7	百万円 2,929,111	百万円 135,105	% 4.6

(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。

組入資産の明細

当期末における該当事項はありません。

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	千円 9,152,935	% 100.0
投 資 信 託 財 産 総 額	9,152,935	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2022年9月26日現在
(A)資 産	9,152,935,950円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,152,935,950
(B)負 債	1,523,169
未 払 解 約 金	1,502,802
未 払 利 息	20,367
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	9,151,412,781
元 本	9,046,164,083
次 期 繰 越 損 益 金	105,248,698
(D)受 益 権 総 口 数	9,046,164,083口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,116円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年9月28日 至 2022年9月26日
(A)配 当 等 収 益	△4,634,183円
受 取 利 息	55,856
支 払 利 息	△4,690,039
(B)当 期 損 益 金 (A)	△4,634,183
(C)前 期 繰 越 損 益 金	119,674,108
(D)追 加 信 託 差 損 益 金	169,275,273
(E)解 約 差 損 益 金	△179,066,500
(F) 計 (B+C+D+E)	105,248,698
次 期 繰 越 損 益 金 (F)	105,248,698

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

(注2) (E)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9,965,821,749円、期中追加設定元本額は14,244,392,485円、期中一部解約元本額は15,164,050,151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。

バランスG(25)VA(適格機関投資家専用)	5,278,040,765円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	3,567,940,491円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	114,624,285円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	59,568,699円
FOFs用 短期金融資産ファンド(適格機関投資家専用)	13,408,726円
ブラジル高配当株オープン(毎月決算型)	9,880,568円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,207,063円
米国成長株式ファンド	493,486円

お知らせ

該当事項はありません。