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2018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	以下の投資信託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 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド 日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド 国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用) 日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用) FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用) SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用) 国内債券インデックス マザーファンド マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用) 明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用) ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用) SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用) 外国株式インデックス マザーファンド 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用) ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用) ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け) Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL 世界債券総合インデックスマザーファンド フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用) 新興国株式インデックス マザーファンド ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用) J-REITインデックス マザーファンド グローバルREITインデックス マザーファンド グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり) BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用) 米国株式LSマザーファンド コモディティLSアルファ・マザーファンド 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド GBCAマザーファンド(ミドルリスク型) ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用) ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用) MA Hedge Fund Strategies Limited MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR
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。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 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、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

コア投資戦略ファンド(積極成長型)
(愛称:コアラップ(積極成長型))

運用報告書(全体版)

第6期（決算日　2024年7月10日）

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011　東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ　https://www.smtam.jp/

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

<510156>

【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。
・－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			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	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率						
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
第2期(2020年7月10日)	10,298	0	△1.6	37.7	0.9	13.2	△0.0	44.9	953
第3期(2021年7月12日)	12,532	0	21.7	36.2	0.9	15.5	0.1	45.6	1,462
第4期(2022年7月11日)	12,627	0	0.8	28.7	0.8	14.8	0.1	52.6	2,455
第5期(2023年7月10日)	13,568	0	7.5	18.4	0.5	11.1	△0.3	60.9	3,964
第6期(2024年7月10日)	16,170	0	19.2	15.6	0.5	11.7	△0.4	70.0	5,402

(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

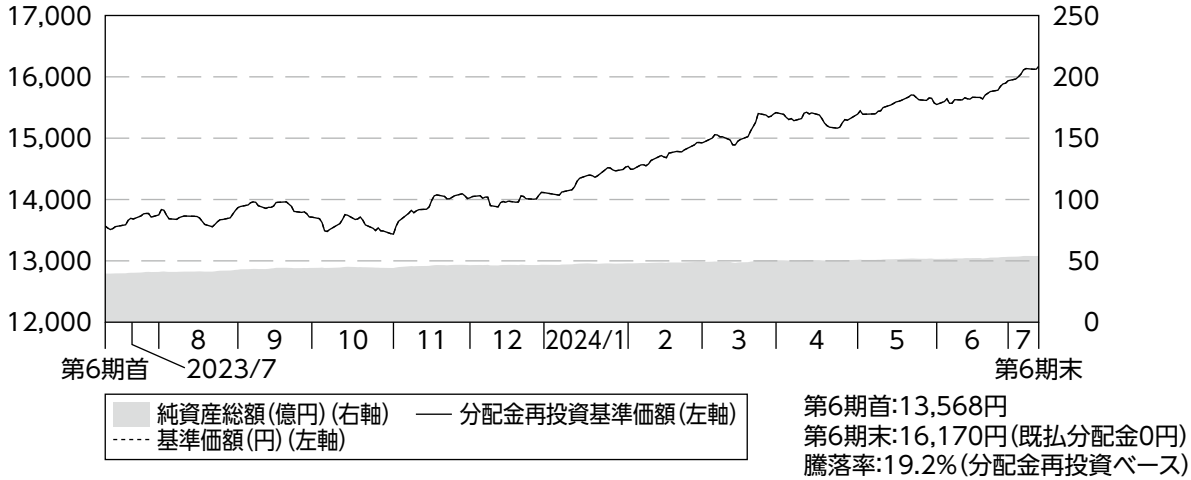
年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率					
(当期首)	円	%	%	%	%	%	%
2023年 7月10日	13,568	－	18.4	0.5	11.1	△0.3	60.9
7月末	13,749	1.3	19.3	0.5	11.2	△0.3	62.0
8月末	13,867	2.2	19.2	0.5	11.0	△0.3	62.1
9月末	13,713	1.1	18.6	0.5	11.6	△0.5	60.2
10月末	13,435	△1.0	19.0	0.6	12.5	△0.2	64.4
11月末	14,028	3.4	19.4	0.6	11.9	△0.2	65.7
12月末	14,113	4.0	19.4	0.5	11.6	△0.2	65.8
2024年 1月末	14,542	7.2	20.2	0.4	11.7	△0.2	66.0
2月末	14,923	10.0	20.5	0.5	11.6	△0.2	66.1
3月末	15,417	13.6	19.7	0.6	11.3	△0.1	66.1
4月末	15,392	13.4	14.9	0.6	11.7	△0.4	69.4
5月末	15,549	14.6	15.1	0.6	11.8	△0.4	69.4
6月末	15,937	17.5	15.2	0.7	11.8	△0.4	69.4
(当期末)							
2024年 7月10日	16,170	19.2	15.6	0.5	11.7	△0.4	70.0

(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



第6期首:13,568円
第6期末:16,170円(既払分配金0円)
騰落率:19.2%(分配金再投資ベース)

(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、2023年7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

当ファンドの投資対象ファンドの当期における騰落率は以下の通りです。

組入ファンド	投資資産※1※2	当作成対象期間末組入比率	騰落率
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	7.2%	32.7%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	国内株式	1.2%	37.0%
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	国内株式	1.2%	15.1%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	4.6%	38.6%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	3.6%	28.7%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	4.6%	47.0%
SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	1.2%	11.2%
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	国内債券	2.2%	△4.3%
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	国内債券	1.9%	△4.0%
ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	国内債券	1.4%	△4.8%
SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	国内債券	1.8%	△4.6%
外国株式インデックス マザーファンド	外国株式	3.8%	41.7%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	外国株式	1.3%	44.1%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	外国株式	3.6%	21.4%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	外国株式	3.6%	24.4%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	外国株式	3.8%	39.9%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	外国株式	3.8%	39.4%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	外国株式	3.9%	48.9%
世界債券総合インデックスマザーファンド	外国債券	7.3%	18.2%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	外国債券	3.6%	16.6%
新興国株式インデックス マザーファンド	外国株式	1.3%	31.4%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	外国債券	3.6%	17.3%
J-REITインデックス マザーファンド	国内リート	5.5%	△3.3%
グローバルREITインデックス マザーファンド	海外リート	6.2%	22.2%
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	コモディティ	2.0%	18.7%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	コモディティ	4.8%	15.1%
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY	ヘッジファンド	0.9%	3.8%
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド	1.1%	3.9%
米国株式LSマザーファンド	ヘッジファンド	1.6%	16.3%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ヘッジファンド	1.3%	2.5%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ヘッジファンド	0.4%	△1.5%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	ヘッジファンド	0.4%	△1.7%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド	1.2%	△9.1%
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド	0.9%	△5.1%
MA Hedge Fund Strategies Limited	ヘッジファンド	0.9%	2.2%
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	ヘッジファンド	0.5%	6.9%

※1 リートとは、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。
※2 外国株式には、先進国および新興国の株式に投資するファンドが含まれます。外国債券には、先進国および新興国の債券に投資するファンドが含まれます。
(注1)比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。
(注2)期中に組み入れたファンドの騰落率は当ファンドへの組入日からのものです。

投資環境

○国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。期初から円安・米ドル高が好感されて上昇しましたが、その後は、中国景気の先行き不透明感や米国の金融引き締め長期化懸念などから上値の重い展開が続き、2023年12月にかけては一進一退の展開となりました。2024年に入ると、国内の賃金上昇・デフレ脱却や日本企業の資本効率改善に対する期待から、株式市場は一段高となりました。期末にかけては円安・米ドル高を背景に堅調に推移しました。

○国内債券市場

国内債券市場は下落しました。期初から2023年10月までは日銀が長期金利の事実上の上限を1%に引き上げたことや、米長期金利が上昇したことを受けて、金利上昇圧力が強まりやすい状況が続き、債券価格は下落しました。11月から2024年1月にかけては米国の追加利上げ観測が後退したことや、日銀が利上げには慎重との見方が一時強まったことから、債券価格は上昇しましたが、その後はマイナス金利が解除されるとの観測が強まったことや、実際にマイナス金利が解除された後も追加利上げ観測がくすぶっていたことから、期末にいたるまで、債券価格は下落基調となりました。

○先進国株式市場

先進国株式市場は上昇しました。期初から2023年10月にかけては、米国経済の軟着陸期待が強まったことは好材料となりましたが、大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、各国中央銀行が政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから下落基調となりました。11月以降は、物価指標の伸びが鈍化したことで主要国で早期の利下げ転換期待が高まったことや、生成AI（人工知能）市場の成長期待を背景に半導体関連株が買われたことなどから期末にいたるまで堅調に上昇しました。

○先進国債券市場

先進国債券市場は上昇しました。期初から2023年10月にかけて、主要中央銀行の金融引き締め長期化観測などを背景に、下落基調となりました。11月より12月下旬にかけて、主要先進国のインフレ鈍化を示す指標を受けて主要国の中央銀行の利下げ観測が高まったことから債券価格は上昇しました。2024年以降は米国の堅調な経済指標などを背景に、FRB（米連邦準備理事会）による早期利下げ観測が後退し、債券価格は緩やかに下落しました。

○新興国株式市場

新興国株式市場は上昇しました。期初から2023年10月にかけては、米国経済の軟着陸期待は好材料となりましたが、中国の景気回復の遅れや米国の金融引き締め長期化、中東情勢の不安定化などに対する懸念により緩やかに下落しました。11月以降は、米国の早期利下げ観測など世界的な金融緩和への期待から新興国株式市場は上昇に転じました。2024年以降は、AI関連ハイテク株の上昇、中国当局による景気支援策への期待などを受けて、新興国株式市場は期末にいたるまで堅調に推移しました。

投資環境

○新興国債券市場

新興国債券市場は上昇しました。期初から2023年10月にかけては、米国の堅調な経済指標やインフレ圧力が継続する中、主要国中央銀行の高官らの発言を背景に利上げ長期化観測が高まったことなどを受けて主要国の長期金利が上昇したことが新興国金利の上昇要因（価格は下落）となりました。その後、欧米の軟調な経済指標などを受けて主要国の長期金利が低下したことを受けて新興国金利も低下（価格は上昇）しました。2023年の年末から2024年4月上旬にかけては、欧米で先行きの利下げ観測が高まったことを受けて新興国金利は低下基調となりましたが、その後は堅調な経済指標を背景に米国の利下げ観測が大幅に後退し、新興国における利下げの先送りや政策金利の高止まりが意識されたことなどから新興国金利は上昇しました。

○国内リート市場

国内リート市場は下落しました。期初から2023年9月上旬にかけては、価格下落により利回りで見た割安感が強まったことなどから上昇しましたが、年末にかけては日銀による金融政策正常化の影響に対する慎重な見方や、世界的な利上げ長期化が意識されたことなどから下落しました。その後は複数銘柄による公募増資を受けて短期的な需給悪化懸念が意識されたことなどから軟調に推移しましたが、2024年3月の日銀金融政策決定会合では金融政策に想定していたほどの見直しは無いことが確認されると切り返す展開となりました。当期末にかけては、米国の利下げ時期についての観測が後ろ倒しとなる中、日本においても金利の先高感が徐々に意識される展開となったことや、グローバル株価指数からのJ-REIT複数銘柄除外に伴う思惑等が影響し、軟調に推移しました。

○海外リート市場

海外リート市場は上昇しました。期前半は、FOMC（米連邦公開市場委員会）において2024年の利下げ幅見通しが縮小されたことや、各国の長期金利が水準を切り上げたことで利回り面でのリートの魅力度低下が意識されたことなどから2023年10月にかけて下落しました。11月以降は、インフレ鈍化を背景に各国で早期の利下げ転換への期待が高まったことや、底堅い経済指標を受けて米国経済が軟着陸に向かうとの見方が強まったことなどから上昇しました。期後半は、米国で雇用や消費の底堅さを示す指標が続いたことや、FRB高官から早期利下げに否定的な発言が相次いだことなどが嫌気されて4月にかけて下落しましたが、その後はFRB議長の発言や景気、インフレ関連指標の伸び鈍化を受けて年内の利下げ観測が高まったことなどから上昇しました。

○コモディティ市場

商品市場は上昇しました。主要中央銀行による利上げサイクルが終盤に近いとの見方が広がり、景気回復や商品需要の拡大などへの期待感から、期初から2023年9月中旬にかけて上昇しました。その後は、再び世界的な景気悪化が意識されたことでエネルギーセクターを中心に下落しましたが、2024年2月下旬以降は中東の地政学リスクの高まりなどを背景に上昇に転じました。

金価格は上昇しました。期初から2023年10月末頃にかけては、FRBによる金融引き締めの長期化が金価格の重しとなりました。一方中東情勢が緊迫化したことで金の需要が高まりました。2024年1月末頃にかけては、FRBによる金融引き締めが終了したとの見方から米国債利回りが低下し、その後3月末頃にかけて再度中東情勢が緊迫化したことで金価格は上昇しました。期末にかけては中東情勢を巡る過度な警戒感が後退したことや各種経済指標を受けて年内の利下げ観測が後退したことで金価格の上昇は一服しました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

国内外の株式および債券、ならびにリートや商品といった様々な資産に分散投資し、投資対象ファンドのリスク・リターン特性を踏まえ、これらを適切に組み合わせることで中長期的な成長を目指しポートフォリオの組成を行いました。また、デリバティブを含めた様々な投資対象および投資戦略を駆使するヘッジファンド等のほか、金への投資も行うことで短期的な下振れリスクの抑制が期待できるポートフォリオの構築も意識しファンド運営を行いました。

・国内株式インデックス マザーファンド

投資割合の見直しなどにより、当期末時点における組入比率は7.2%となりました。

・世界債券総合インデックスマザーファンド

投資割合の見直しなどにより、当期末時点における組入比率は7.3%となりました。

・ウエスタン・グローバル債券ファンド（適格機関投資家専用）

投資割合の見直しなどにより、当期末時点における組入比率は3.6%となりました。

・フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド（適格機関投資家専用）

投資割合の見直しなどにより、当期末時点における組入比率は3.6%となりました。

・国内株式アクティブバリューファンド（適格機関投資家専用）

投資割合の見直しなどにより、当期末時点における組入比率は4.6%となりました。

当ファンドのポートフォリオ

組入ファンド	当期首(前期末)	当期末	差
国内株式インデックス マザーファンド	12.4%	7.2%	△5.3%
世界債券総合インデックスマザーファンド	2.2%	7.3%	+5.1%
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	1.0%	3.6%	+2.6%
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	1.0%	3.6%	+2.6%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	2.3%	4.6%	+2.3%
J−REITインデックス マザーファンド	7.6%	5.5%	△2.1%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.5%	4.8%	△1.7%
日本債券ツイン戦略マザーファンド	1.5%	−	△1.5%
グローバルREITインデックス マザーファンド	4.9%	6.2%	+1.3%
SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	0.6%	1.8%	+1.2%
SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	−	1.2%	+1.2%
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	−	1.2%	+1.2%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	3.5%	4.6%	+1.2%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	2.3%	1.3%	△1.1%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	2.2%	1.2%	△1.0%
米国株式LSマザーファンド	2.4%	1.6%	△0.9%
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	1.9%	1.1%	△0.8%
ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	0.6%	1.4%	+0.8%
MA Hedge Fund Strategies Limited	1.6%	0.9%	△0.7%
外国株式インデックス マザーファンド	3.2%	3.8%	+0.7%
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund − クラスS-JPY	1.6%	0.9%	△0.6%
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	1.5%	0.9%	△0.6%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	3.3%	3.9%	+0.6%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	3.3%	3.8%	+0.5%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	3.3%	3.8%	+0.5%
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	1.8%	2.2%	+0.4%
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1.5%	1.9%	+0.4%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	0.8%	0.4%	△0.4%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	0.8%	0.4%	△0.4%
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	0.8%	0.5%	△0.3%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	3.3%	3.6%	+0.3%
新興国株式インデックス マザーファンド	1.1%	1.3%	+0.3%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	3.3%	3.6%	+0.3%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	3.4%	3.6%	+0.2%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	1.1%	1.3%	+0.2%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	1.2%	1.2%	+0.0%
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	2.0%	2.0%	+0.0%

(注)比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

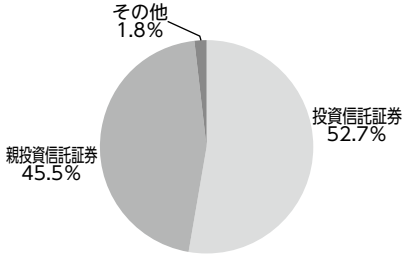
当ファンドの組入資産の内容

○組入上位ファンド

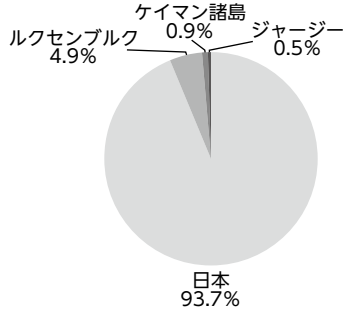
順位	ファンド名	当期末 2024年7月10日
1	世界債券総合インデックスマザーファンド	7.3%
2	国内株式インデックス マザーファンド	7.2%
3	グローバルREITインデックス マザーファンド	6.2%
4	J−REITインデックス マザーファンド	5.5%
5	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	4.8%
6	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	4.6%
7	FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	4.6%
8	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	3.9%
9	世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	3.8%
10	外国株式インデックス マザーファンド	3.8%
組入ファンド数		36

(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した。
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6期
		2023年7月11日~2024年7月10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）	6,170

（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、国内株式、国内債券、先進国株式、先進国債券、新興国株式、新興国債券、国内リート、海外リート、バンクローン、コモディティ、ヘッジファンド及びその他の様々な資産を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。
各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの投資割合は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じても調整を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。
国内株式、先進国株式、新興国株式、国内リート、海外リート、コモディティを実質的な投資対象とする投資対象ファンドへの投資割合の合計は純資産総額に対して、90%未満とします。
投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されたり、新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

1万口当たりの費用明細

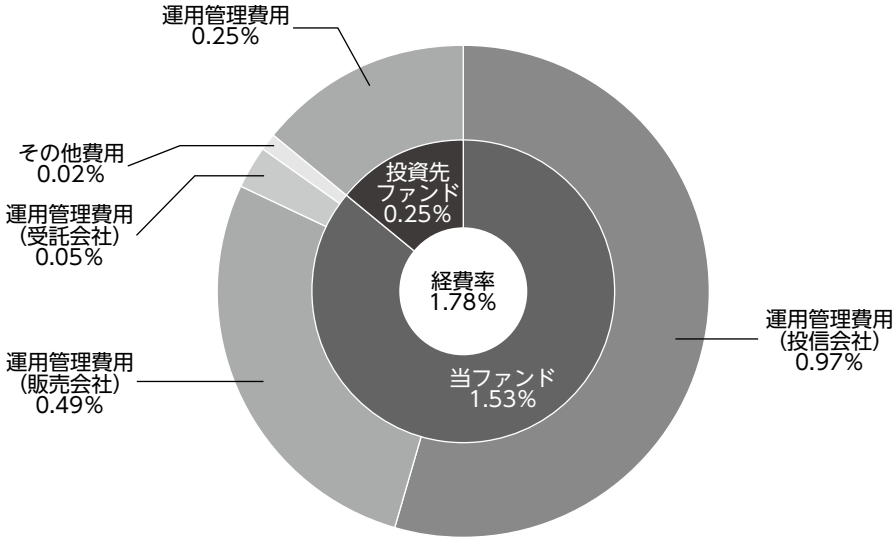
項目	当期 (2023年7月11日~2024年7月10日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	221円	1.518%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は14,555円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(141)	(0.968)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(72)	(0.495)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(8)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b)売買委託手数料=$\frac{\text{〔期中の売買委託手数料〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$×10,000
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	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
(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	0.001	(c)有価証券取引税=$\frac{\text{〔期中の有価証券取引税〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$×10,000
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	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
(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	2	0.017	(d)その他費用=$\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}$×10,000
(保管費用)	(2)	(0.012)	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)	(1)	(0.005)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	223	1.538	

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

<参考情報>

経費率(投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。)

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した経費率(年率)は1.78%です。



経費率(①+②)	1.78%
①当ファンドの費用の比率	1.53%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.25%

(注1)当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。
(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。
(注3)各比率は、年率換算した値です。
(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。
(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。
(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。
(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。
(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。
(注9)投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。
(注10)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当期			
		買付		売付	
		口数	買付額	口数	売付額
		千口	千円	千口	千円
国内	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	－	－	0.819	8,932
	ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	6,864	6,000	27,376	23,633
	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	62,121	113,940	681	1,369
	世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	27,493	31,780	11,932	17,109
	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund-クラスS-JPY	0.8298	9,000	2	23,188
	明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	48,984	46,000	－	－
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	14	27,690	8	19,370
	ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	20,377	28,700	9,654	16,741
	ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	56,048	54,900	－	－
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	18,190	36,274	2,257	4,945
	フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	117,293	129,480	－	－
	日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	9,095	22,860	2,196	6,583
	ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	99,060	128,360	－	－
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	24,578	31,800	6,147	9,356
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	11,492	10,000	22,373	19,349
	FOFs用 ピクテ マルチストラテジーリンクファンド(適格機関投資家専用)	5,852	6,000	24,602	25,382
	SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	77,460	75,400	－	－
	SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	58,118	58,190	1,266	1,410
	FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	25,597	45,970	1,319	2,639
	マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	55,140	52,000	－	－
	MA Hedge Fund Strategies Limited	0.407	4,000	2	20,870

(注)金額は受渡代金です。

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	32,949	69,690	29,646	62,620
グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	35,753	88,570	4,719	13,000
新興国株式インデックス　マザーファンド	3,462	13,310	－	－
国内株式インデックス　マザーファンド	30,649	73,310	118,636	329,810
外国株式インデックス　マザーファンド	6,583	33,500	2,527	15,660
グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	20,639	12,680	－	－
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	20,612	25,830	46,852	58,260
コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	3,273	4,000	23,645	28,650
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	3,358	4,500	2,696	4,000
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	5,899	7,880	3,365	5,610
米国株式ＬＳマザーファンド	10,631	12,270	32,172	37,000
日本債券ツイン戦略マザーファンド	8,413	8,000	69,552	64,148
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	2,495	2,880	10,158	11,870
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	4,272	3,830	13,439	12,040
世界債券総合インデックスマザーファンド	239,370	255,250	2,998	3,360
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	9,815	57,740	290	1,910

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	29,402,555千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	169,687,475千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.17

(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	105,810,143千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	614,344,945千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.17

(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	54,183,980千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	640,090,614千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.08

(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。

＜日本株式ESGセレクト･リーダーズ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	6,116,112千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	13,044,986千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.46

(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ESGリーダーズ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	5,317,915千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	13,748,692千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.38

(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。

＜日本株式エクセレント･フォーカス マザーファンド＞

項目	当期
(a) 当期中の株式売買金額	31,633,784千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	45,486,746千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.69

(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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	918	877	95.5	200	128	64.0
金銭信託	4	4	100.0	4	4	100.0
コール・ローン	45,952	3,730	8.1	45,994	3,740	8.1

(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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	46	46	100.0	46	46	100.0
コール・ローン	855,764	79,914	9.3	854,155	79,593	9.3

<平均保有割合　0.2%>
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	25,016	571	2.3	15,243	2,122	13.9
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	34,944	2,234	6.4	36,582	2,587	7.1

<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。

※ 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。

＜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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	54,470	3,989	7.3	33,126	1,285	3.9
金銭信託	2	2	100.0	2	2	100.0
コール・ローン	56,738	6,279	11.1	55,712	6,065	10.9

〈平均保有割合　0.0%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜国内株式インデックス 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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	87	87	100.0	87	87	100.0
コール・ローン	1,114,175	107,202	9.6	1,121,337	108,756	9.7

〈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。

＜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	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	42,794	3,394	7.9	47,751	8,955	18.8
金銭信託	6	6	100.0	6	6	100.0
コール・ローン	201,089	22,936	11.4	196,204	21,916	11.2

〈平均保有割合　0.0%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜グローバル･コモディティ(米ドル建て) 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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	3,627	238	6.6	2,471	1,210	49.0
金銭信託	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	66,417	5,531	8.3	66,268	5,501	8.3

〈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。

＜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	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	377,179	526	0.1	371,735	30,600	8.2
為替直物取引	3,737	－	－	12,792	500	3.9
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	35,238	2,434	6.9	35,278	2,443	6.9

〈平均保有割合　0.8%〉
(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。

＜コモディティLSアルファ･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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	52,757	4,381	8.3	52,765	4,383	8.3

〈平均保有割合　0.4%〉
(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。

＜日本株式ESGセレクト･リーダーズ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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	27,870	2,558	9.2	28,409	2,674	9.4

〈平均保有割合　0.4%〉
(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ESGリーダーズ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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	3,357	123	3.7	2,362	461	19.5
金銭信託	0.327216	0.327216	100.0	0.327216	0.327216	100.0
コール・ローン	6,572	689	10.5	6,576	690	10.5

〈平均保有割合　0.4%〉
(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。

＜米国株式LS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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	244,105	244,105	100.0	238,598	238,598	100.0
為替直物取引	－	－	－	8,772	8,772	100.0
金銭信託	20	20	100.0	20	20	100.0
コール・ローン	220,545	16,194	7.3	220,889	16,273	7.4

〈平均保有割合　0.4%〉
(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。

＜日本債券ツイン戦略マザーファンド＞

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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	45	45	100.0	45	45	100.0
コール・ローン	228,398	13,244	5.8	230,630	13,724	6.0

〈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。

＜GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)＞

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	373,781	373,781	100.0	376,356	376,356	100.0
為替直物取引	994	994	100.0	－	－	－
金銭信託	100	100	100.0	100	100	100.0
コール・ローン	1,481,879	111,291	7.5	1,483,509	111,668	7.5

〈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。

＜米国株式イントラデイ･トレンド戦略マザーファンド＞

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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	20,664	1,538	7.4	20,620	1,529	7.4

〈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。

＜世界債券総合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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	73,091	3,618	4.9	6,963	4,756	68.3
金銭信託	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	105,546	7,372	7.0	105,673	7,400	7.0

〈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。

＜日本株式エクセレント･フォーカス 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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	17	17	100.0	17	17	100.0
コール・ローン	80,114	11,637	14.5	79,606	11,531	14.5

〈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
投資信託受益証券	145百万円	18百万円	457百万円

(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)当該投資信託受益証券の発行者は、日興アセットマネジメント株式会社です。

＜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	105百万円	154百万円	2,283百万円

(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。

＜日本株式ESGセレクト･リーダーズ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	16百万円	11百万円	92百万円

(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

＜当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細＞

ファンド名	当期末		
	口数	評価額	比率
株式ファンド	千口	千円	%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	125,106	249,951	4.6
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	128,463	207,533	3.8
ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	105,690	204,552	3.8
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	83,770	197,136	3.6
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	60,673	192,612	3.6
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	121,784	192,602	3.6
SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)	56,852	63,840	1.2
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	125,874	249,331	4.6
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	78	210,071	3.9
債券ファンド			
明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	109,872	101,764	1.9
ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)	78,986	76,024	1.4
フィデリティ外国債券アクティブ・セレクト・ファンド(適格機関投資家専用)	154,623	196,402	3.6
ウエスタン・グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)	130,787	196,599	3.6
SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)	100,596	96,401	1.8
マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)	127,653	118,194	2.2
その他			
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	78,350	63,157	1.2
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	56,923	48,373	0.9
FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	56,770	60,159	1.1
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	2	24,592	0.5
BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund-クラスS-JPY	4	51,117	0.9
MA Hedge Fund Strategies Limited	4	46,856	0.9
合計	1,702,868	2,847,275	52.7

(注)比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜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	143,632	146,936	298,691
グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	76,629	107,663	335,286
新興国株式インデックス　マザーファンド	11,025	14,488	71,930
国内株式インデックス　マザーファンド	215,887	127,899	386,730
外国株式インデックス　マザーファンド	25,088	29,143	206,859
グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	135,882	156,522	107,170
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	207,870	181,630	259,767
コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	74,724	54,352	68,783
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	37,500	38,162	64,155
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	34,192	36,726	69,541
米国株式ＬＳマザーファンド	88,334	66,793	84,272
日本債券ツイン戦略マザーファンド	61,139	－	－
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	28,048	20,385	23,318
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	35,469	26,303	23,323
世界債券総合インデックスマザーファンド	81,659	318,030	392,418
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	－	9,524	63,737

(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	60,803,527千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	40,061,173千口
新興国株式インデックス マザーファンド	45,973,691千口
国内株式インデックス マザーファンド	233,103,107千口
外国株式インデックス マザーファンド	114,681,464千口
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	43,639,818千口
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	21,536,876千口
コモディティLSアルファ・マザーファンド	14,434,093千口
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	9,412,266千口
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	9,375,233千口
米国株式LSマザーファンド	15,903,410千口
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	17,508,251千口
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	9,181,619千口
世界債券総合インデックスマザーファンド	105,249,450千口
日本株式エクセレント・フォーカス マザーファンド	7,386,247千口

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	2,514,637	46.1
投資証券	332,638	6.1
Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	298,691	5.5
グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド	335,286	6.1
新興国株式インデックス　マザーファンド	71,930	1.3
国内株式インデックス　マザーファンド	386,730	7.1
外国株式インデックス　マザーファンド	206,859	3.8
グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド	107,170	2.0
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	259,767	4.8
コモディティＬＳアルファ・マザーファンド	68,783	1.3
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	64,155	1.2
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド	69,541	1.3
米国株式ＬＳマザーファンド	84,272	1.5
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）	23,318	0.4
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	23,323	0.4
世界債券総合インデックスマザーファンド	392,418	7.2
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド	63,737	1.2
コール・ローン等、その他	151,932	2.7
投資信託財産総額	5,455,187	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(124,761,176千円)の投資信託財産総額(125,057,153千円)に対する比率は99.8%です。

(注2)新興国株式インデックス　マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(228,137,809千円)の投資信託財産総額(229,244,410千円)に対する比率は99.5%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(814,502,885千円)の投資信託財産総額(819,822,610千円)に対する比率は99.4%です。

(注4)グローバル・コモディティ(米ドル建て)　マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(29,675,793千円)の投資信託財産総額(29,989,865千円)に対する比率は99.0%です。

(注5)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(31,184,097千円)の投資信託財産総額(31,257,128千円)に対する比率は99.8%です。

(注6)外国株式ESGリーダーズ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(17,744,496千円)の投資信託財産総額(17,751,656千円)に対する比率は100.0%です。

(注7)米国株式LSマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(19,775,387千円)の投資信託財産総額(20,751,590千円)に対する比率は95.3%です。

(注8)GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)において、当期末における外貨建純資産(3,117,543千円)の投資信託財産総額(20,574,223千円)に対する比率は15.2%です。

(注9)世界債券総合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(129,726,726千円)の投資信託財産総額(129,913,436千円)に対する比率は99.9%です。

(注10)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＝161.55円
1ブラジルレアル＝29.7844円
1ユーロ＝174.70円
1スウェーデンクローナ＝15.32円
1トルコリラ＝4.9096円
1ポーランドズロチ＝41.0377円
1ニュージーランドドル＝98.98円
1マレーシアリンギット＝34.3007円
1インドネシアルピア＝0.01円
1オフショア人民元＝22.1531円
1カタールリアル＝44.38円
1サウジアラビアリアル＝43.14円
1カナダドル＝118.49円
1チリペソ＝0.173289円
1イギリスポンド＝206.57円
1ノルウェークローネ＝15.24円
1チェココルナ＝6.9106円
1ロシアルーブル＝1.85円
1香港ドル＝20.68円
1タイバーツ＝4.43円
1韓国ウォン＝0.1167円
1インドルピー＝1.94円
1南アフリカランド＝8.89円
1クウェート・ディナール＝528.98円
1メキシコペソ＝9.026円
1コロンビアペソ＝0.040212円
1スイスフラン＝179.88円
1デンマーククローネ＝23.42円
1ハンガリーフォリント＝0.443073円
1オーストラリアドル＝108.77円
1シンガポールドル＝119.59円
1フィリピンペソ＝2.7637円
1新台湾ドル＝4.9607円
1イスラエルシェケル＝43.8407円
1アラブ首長国連邦ディルハム＝44.06円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年7月10日現在
(A)資産	**5,455,187,174円**
コール・ローン等	150,013,209
投資信託受益証券(評価額)	2,514,637,475
投資証券(評価額)	332,638,458
Ｊ－ＲＥＩＴインデックス　マザーファンド(評価額)	298,691,919
グローバルＲＥＩＴインデックス　マザーファンド(評価額)	335,286,375
新興国株式インデックス　マザーファンド(評価額)	71,930,355
国内株式インデックス　マザーファンド(評価額)	386,730,204
外国株式インデックス　マザーファンド(評価額)	206,859,756
グローバル・コモディティ（米ドル建て）　マザーファンド(評価額)	107,170,892
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）(評価額)	259,767,294
コモディティＬＳアルファ・マザーファンド(評価額)	68,783,135
日本株式ＥＳＧセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド(評価額)	64,155,140
外国株式ＥＳＧリーダーズインデックスマザーファンド(評価額)	69,541,510
米国株式ＬＳマザーファンド(評価額)	84,272,800
ＧＢＣＡマザーファンド（ミドルリスク型）(評価額)	23,318,836
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド(評価額)	23,323,486
世界債券総合インデックスマザーファンド(評価額)	392,418,375
日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド(評価額)	63,737,679
未収入金	1,910,000
未収利息	276
(B)負債	**53,090,592**
未払解約金	14,996,758
未払信託報酬	37,956,370
その他未払費用	137,464
(C)純資産総額(A-B)	**5,402,096,582**
元本	3,340,791,727
次期繰越損益金	2,061,304,855
(D)受益権総口数	**3,340,791,727口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**16,170円**

■損益の状況

項目	当期 自　2023年7月11日 至　2024年7月10日
(A)配当等収益	**2,439,953円**
受取配当金	2,470,001
受取利息	34,227
支払利息	△64,275
(B)有価証券売買損益	**868,626,515**
売買益	958,191,597
売買損	△89,565,082
(C)信託報酬等	**△71,879,624**
(D)当期損益金(A+B+C)	**799,186,844**
(E)前期繰越損益金	**320,571,073**
(F)追加信託差損益金	**941,546,938**
(配当等相当額)	(595,875,075)
(売買損益相当額)	(345,671,863)
(G)計(D+E+F)	**2,061,304,855**
(H)収益分配金	**0**
次期繰越損益金(G+H)	**2,061,304,855**
追加信託差損益金	941,546,938
(配当等相当額)	(596,644,776)
(売買損益相当額)	(344,902,162)
分配準備積立金	1,119,757,917

(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2,921,799,392円、期中追加設定元本額は1,049,090,537円、期中一部解約元本額は630,098,202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)	50,868,101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)	748,318,743円
(C) 収益調整金額	941,546,938円
(D) 分配準備積立金額	320,571,073円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	2,061,304,855円
(F) 期末残存口数	3,340,791,727口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	6,170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

投資対象とする投資信託証券を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(変更日:2023年10月11日)
投資対象とする投資信託証券を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
投資対象とする投資信託証券を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
品貸料の一部を信託報酬として収受可能とするため、投資信託約款に所要の変更を行いました。
(変更日:2024年4月11日)

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

組入投資信託証券の内容

■国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の金融商品取引所上場株式
運用の基本方針等	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体(TOPIX(東証株価指数)配当込み)の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行ないます。

●損益の状況

項目	第5期 自 2022年10月26日 至 2023年10月25日
(A)配当等収益	△86,712円
受取利息	532
支払利息	△87,244
(B)有価証券売買損益	7,523,114,646
売買益	8,365,284,128
売買損	△842,169,482
(C)信託報酬等	△193,281,464
(D)当期損益金(A+B+C)	7,329,746,470
(E)前期繰越損益金	6,405,554,909
(F)追加信託差損益金	△409,439,571
(配当等相当額)	(2,247,520,058)
(売買損益相当額)	(△2,656,959,629)
(G)計 (D+E+F)	13,325,861,808
(H)収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	13,325,861,808
追加信託差損益金	△409,439,571
(配当等相当額)	(2,251,683,622)
(売買損益相当額)	(△2,661,123,193)
分配準備積立金	13,735,301,379

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第4期末	第5期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
アクティブバリュー マザーファンド	6,739,222	6,327,486	38,895,695

下記は、アクティブバリュー マザーファンド全体の内容です。

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	第4期末 株数(千株)	第5期末 株数(千株)	第5期末 評価額(千円)
建設業(4.5%)			
熊谷組	183.7	150	548,250
五洋建設	－	382.8	322,700
大和ハウス工業	208.6	188.5	759,843
きんでん	－	124.4	263,292
日揮ホールディングス	156.6	204.7	377,159
食料品(2.6%)			
アサヒグループホールディングス	76.6	84	449,988
アリアケジャパン	14.5	70.2	327,342
東洋水産	－	79.8	505,852
パルプ・紙(0.9%)			
レンゴー	918.9	476.3	469,679
化学(7.0%)			
クレハ	27.5	－	－
エア・ウォーター	493.2	290.3	534,732
カネカ	52.4	－	－
三菱瓦斯化学	159.2	254.2	507,637
ＫＨネオケム	315.7	214.6	477,485
ＡＤＥＫＡ	－	197.4	503,764
エスケー化研	－	8.2	57,646
富士フイルムホールディングス	79	45.3	378,119
ライオン	576.8	421.6	605,206
上村工業	－	35.2	285,824
ＪＳＰ	84.8	92.9	172,979
医薬品(2.5%)			
武田薬品工業	－	175.6	764,211
小野薬品工業	263	－	－
久光製薬	－	83.3	407,836
参天製薬	206.1	－	－
ツムラ	144.6	－	－
鳥居薬品	68.6	16	59,200
石油・石炭製品(2.5%)			
出光興産	－	222.3	748,039
ＥＮＥＯＳホールディングス	1,359.7	893.1	492,723
ゴム製品(1.3%)			
横浜ゴム	－	239.8	670,840
ガラス・土石製品(3.1%)			
日東紡績	－	242.3	891,664
ＡＧＣ	115.8	97.1	492,685
東洋炭素	77	34.2	173,394
鉄鋼(0.9%)			
日本製鉄	－	135.8	435,510

銘柄	第4期末 株数(千株)	第5期末 株数(千株)	第5期末 評価額(千円)
非鉄金属(1.2%)			
住友金属鉱山	89.3	89.5	368,471
住友電気工業	194.9	146.9	234,305
金属製品(1.2%)			
ＳＵＭＣＯ	150.9	192	370,080
東プレ	－	131.5	210,268
機械(8.1%)			
芝浦機械	215.6	－	－
ＮＩＴＴＯＫＵ	－	185.3	422,484
ナブテスコ	145.7	98.3	265,164
三井海洋開発	－	217.5	360,180
小松製作所	100.1	－	－
ＴＯＷＡ	－	121.3	619,843
ローツェ	－	25.5	302,940
ダイキン工業	20.9	－	－
オルガノ	102.4	－	－
タダノ	260.1	216	245,484
アマノ	229.9	172.3	528,961
ＴＨＫ	131.1	170.4	463,232
マキタ	－	138.1	498,264
ＩＨＩ	137.8	121.4	348,600
電気機器(14.1%)			
日立製作所	210.8	120.7	1,059,625
富士電機	153.6	－	－
マブチモーター	211.6	61.4	265,923
Ｉ－ＰＥＸ	－	148.8	223,944
ルネサスエレクトロニクス	－	117.7	256,762
アルバック	－	121.3	655,990
アンリツ	120.8	－	－
ソニーグループ	111.9	138	1,738,800
ＴＤＫ	108.6	150.1	848,965
日本光電工業	47	－	－
山一電機	－	183	319,518
京セラ	－	72.1	529,718
太陽誘電	－	159.5	557,931
村田製作所	59.1	－	－
市光工業	680.5	567.2	296,078
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	25.4	40.2	301,017
輸送用機器(10.1%)			
デンソー	－	304.1	701,710
トヨタ自動車	744.4	616.3	1,627,032
ＮＯＫ	233.6	－	－

銘柄	第4期末 株数（千株）	第5期末 株数（千株）	第5期末 評価額（千円）
カヤバ	－	64.2	281,196
太平洋工業	257.1	256.8	341,287
マツダ	－	182.8	278,404
本田技研工業	380.3	816.9	1,323,786
豊田合成	－	163.3	483,694
精密機器(1.6%)			
テルモ	78.4	－	－
オリンパス	249.4	275.6	530,943
A&Dホロンホールディングス	－	172.9	263,499
その他製品(0.5%)			
タカラトミー	110.6	131	267,109
電気・ガス業(1.0%)			
中部電力	229.2	281	500,039
陸運業(2.0%)			
東日本旅客鉄道	66.4	38.2	294,140
西日本鉄道	－	131	313,810
ヤマトホールディングス	243.3	162.8	391,127
セイノーホールディングス	167.2	－	－
空運業(0.5%)			
日本航空	177	93.2	253,550
倉庫・運輸関連業(1.0%)			
上組	212.1	164.5	497,283
情報・通信業(6.6%)			
ＮＥＣネッツエスアイ	512.3	89.7	175,453
ネクソン	74.5	－	－
ウイングアーク１ｓｔ	－	260.2	695,254
ＢＩＰＲＯＧＹ	229	109.9	392,672
日本電信電話	237.4	4,435.7	775,360
ソフトバンクグループ	124.4	201.2	1,268,968
卸売業(6.0%)			
伊藤忠商事	237	158.2	851,432
住友商事	－	182.2	537,763
三菱商事	216.8	153.3	1,075,552
岩谷産業	42.6	18.9	133,963
ミスミグループ本社	－	172.5	403,477
小売業(4.1%)			
くら寿司	124.4	－	－
ジンズホールディングス	－	89.4	387,102
Ｊ．フロント　リテイリング	371.4	220.5	309,802
ウエルシアホールディングス	70	－	－
セブン&アイ・ホールディングス	－	44.6	240,706
パン・パシフィック・インターナショナルホ	144.5	112.9	318,829
日本瓦斯	83.2	－	－
ライフコーポレーション	84.6	92.9	326,543
しまむら	－	32	473,120
銀行業(7.9%)			
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,565.7	1,369.6	1,696,249
三井住友フィナンシャルグループ	190.4	233.3	1,680,926
千葉銀行	－	537.3	582,701
証券、商品先物取引業(－%)			
ＳＢＩホールディングス	82.3	－	－
ジャフコ　グループ	185.1	－	－
保険業(2.2%)			
ＳＯＭＰＯホールディングス	59.1	53.9	343,612
第一生命ホールディングス	199.8	241.4	741,098
その他金融業(1.4%)			
アルヒ	68.9	－	－
東京センチュリー	112.2	46.3	264,002
イオンフィナンシャルサービス	359.9	341.1	420,235
不動産業(1.5%)			
東急不動産ホールディングス	1,264	495.3	437,845
三井不動産	199.3	93.8	309,633
サービス業(3.7%)			
ジェイエイシーリクルートメント	230.6	131.2	310,812
綜合警備保障	－	785.8	677,595
セプテーニ・ホールディングス	1,239.6	1,371.6	562,356
りらいあコミュニケーションズ	220.6	－	－
リクルートホールディングス	50.2	6.8	29,233
ダイセキ	152.6	72.4	293,220
合計 株数・金額	20,971	25,374	50,040,302
合計 銘柄数<比率>	86	100	<97.8%>

(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。

組入投資信託証券の内容

■日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	日本の上場株式(これに準ずるものを含みます。)
運用の基本方針等	この投資信託は、主として日本の上場株式(これに準ずるものを含みます。)に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

●損益の状況

項目	第18期 自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日
(A)有価証券売買損益	**815,590,493円**
売買益	989,974,490
売買損	△174,383,997
(B)信託報酬等	**△452,771,952**
(C)当期損益金(A+B)	**362,818,541**
(D)前期繰越損益金	**22,029,351,373**
(E)追加信託差損益金	**60,198,913,094**
(配当等相当額)	(43,607,713,432)
(売買損益相当額)	(16,591,199,662)
(F)計(C+D+E)	**82,591,083,008**
(G)収益分配金	**△1,039,747,598**
次期繰越損益金(F+G)	**81,551,335,410**
追加信託差損益金	60,198,913,094
(配当等相当額)	(43,653,088,184)
(売買損益相当額)	(16,545,824,910)
分配準備積立金	21,352,422,316

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第17期末	第18期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本長期成長株集中投資マザーファンド	19,026,238	21,360,294	135,031,234

下記は、日本長期成長株集中投資マザーファンド全体の内容です。

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	第17期末 株数(千株)	第18期末 株数(千株)	第18期末 評価額(千円)
食料品(3.7%)			
味の素	1,368.2	1,733.7	8,812,397
化学(11.6%)			
信越化学工業	2,048.9	2,282.1	12,457,983
三井化学	1,290.8	1,747.7	7,364,807
ユニ・チャーム	1,384.5	1,641	8,013,003
医薬品(3.3%)			
協和キリン	1,429.7	1,858.1	4,481,737
第一三共	683.8	869.6	3,482,748
機械(4.8%)			
ディスコ	－	94.4	3,108,592
ＳＭＣ	36.2	22.5	1,643,400
ダイキン工業	168.2	－	－
ダイフク	－	2,424.2	6,887,152
電気機器(24.7%)			
イビデン	739.7	1,058.6	8,044,301
日立製作所	－	894.1	8,814,931
富士電機	1,376.3	1,233.1	7,359,140
ニデック	760.6	－	－
ソニーグループ	949.8	1,150	15,369,750
アドバンテスト	592.7	2,030.7	9,838,741
キーエンス	95.7	106.5	6,656,250
浜松ホトニクス	606.4	569.8	3,263,814
精密機器(8.2%)			
テルモ	879.3	1,117.8	5,194,416
オリンパス	3,502.3	3,257.5	6,873,325
ＨＯＹＡ	497.8	183.2	3,112,568
朝日インテック	717.5	1,677.4	4,663,172
その他製品(3.3%)			
アシックス	1,754.6	1,766.8	8,000,070
情報・通信業(13.7%)			
ＳＨＩＦＴ	251.3	291.2	9,985,248
野村総合研究所	1,168.8	878.7	3,587,732
オービック	225.8	353	8,237,255
大塚商会	913.9	476.6	2,916,315
ＮＴＴデータグループ	3,133.7	－	－
カプコン	1,475.8	1,783.5	8,236,203
小売業(12.7%)			
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,855.1	1,821.8	6,126,713
しまむら	334.2	155.9	2,512,328
ニトリホールディングス	548.1	682.2	12,736,674
ファーストリテイリング	－	257.9	9,176,082
保険業(4.3%)			
東京海上ホールディングス	2,998.1	2,939.8	10,265,781
その他金融業(3.8%)			
オリックス	3,114.9	3,469.5	9,206,318
サービス業(5.9%)			
リクルートホールディングス	1,903.5	2,389.2	14,132,118
合計 株数・金額	38,806	43,218	240,561,072
合計 銘柄数＜比率＞	32	33	〈97.1%〉

(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。

組入投資信託証券の内容

■FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	日本の株式
運用の基本方針等	この投資信託は、日本の株式を主要投資対象とし、中長期的にTOPIX（東証株価指数）（配当込み）を上回る投資成果を目指して運用を行います。

●損益の状況

項目	第3期 自 2023年6月7日 至 2024年6月6日
(A)配当等収益	△574円
受取利息	73
支払利息	△647
(B)有価証券売買損益	15,658,397,099
売買益	17,479,403,463
売買損	△1,821,006,364
(C)信託報酬等	△219,533,312
(D)当期損益金(A＋B＋C)	15,438,863,213
(E)前期繰越損益金	4,569,505,179
(F)追加信託差損益金	4,284,132,653
(配当等相当額)	(2,363,176,877)
(売買損益相当額)	(1,920,955,776)
(G)合計(D＋E＋F)	24,292,501,045
次期繰越損益金(G)	24,292,501,045
追加信託差損益金	4,284,132,653
(配当等相当額)	(2,367,341,170)
(売買損益相当額)	(1,916,791,483)
分配準備積立金	20,008,368,392

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第2期末	第3期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本株EVIハイアルファマザーファンド	6,768,428	7,583,340	51,494,670

下記は、日本株EVIハイアルファマザーファンド全体の内容です。

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	第2期末 株数(千株)	第3期末 株数(千株)	第3期末 評価額(千円)
水産・農林業(1.3%)			
ニッスイ	－	1,885	1,646,170
鉱業(1.4%)			
ＩＮＰＥＸ	957	778	1,797,569
建設業(5.2%)			
大成建設	－	359	2,178,053
長谷工コーポレーション	989	－	－
鹿島建設	844	761	2,030,348
積水ハウス	－	627	2,301,090
食料品(1.0%)			
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	－	663	1,269,313
東洋水産	228	－	－
化学(1.9%)			
東ソー	892	－	－
三菱瓦斯化学	－	836	2,432,342
医薬品(2.0%)			
武田薬品工業	391	589	2,475,567
鳥居薬品	98	－	－
石油・石炭製品(2.1%)			
出光興産	－	2,514	2,689,980
ゴム製品(1.2%)			
横浜ゴム	－	418	1,548,690
ガラス・土石製品(2.3%)			
太平洋セメント	－	342	1,356,372
日本特殊陶業	－	330	1,550,670
鉄鋼(2.3%)			
日本製鉄	975	526	1,766,308
大同特殊鋼	227	789	1,193,362
非鉄金属(6.7%)			
住友電気工業	－	1,313	3,300,225
フジクラ	1,320	1,644	5,172,024
機械(7.9%)			
アマダ	1,296	1,313	2,265,581
ＤＭＧ森精機	－	561	2,497,572
小松製作所	－	842	3,818,470
住友重機械工業	401	－	－
荏原製作所	294	－	－
セガサミーホールディングス	765	－	－
ジェイテクト	1,102	－	－
ＴＨＫ	－	464	1,363,928
電気機器(14.0%)			
コニカミノルタ	2,570	3,220	1,530,788
日立製作所	430	392	6,393,520
三菱電機	1,611	－	－
ＪＶＣケンウッド	2,680	3,046	2,780,998
日本電気	351	234	2,778,750
パナソニック　ホールディングス	1,894	－	－
ＴＤＫ	309	343	2,846,900
メイコー	－	190	1,282,500
ローム	128	－	－
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	165	－	－
輸送用機器(10.7%)			
川崎重工業	－	117	655,902
いすゞ自動車	792	－	－
トヨタ自動車	2,461	1,957	6,405,261
アイシン	－	453	2,563,980
本田技研工業	634	2,264	3,800,124
スズキ	534	－	－
豊田合成	376	－	－
その他製品(－)			
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	523	－	－
電気・ガス業(－)			
東北電力	560	－	－
陸運業(－)			
セイノーホールディングス	521	－	－
海運業(2.4%)			
商船三井	－	596	3,074,168
倉庫・運輸関連業(0.3%)			
三菱倉庫	－	80	433,360
情報・通信業(5.2%)			
ＬＩＮＥヤフー	－	5,088	1,912,579
ＴＢＳホールディングス	－	451	1,745,821
ＫＤＤＩ	－	682	2,923,052
卸売業(7.8%)			
円谷フィールズホールディングス	－	698	1,076,316
三菱食品	118	115	586,500
丸紅	817	1,439	4,255,123
豊田通商	298	－	－
住友商事	－	817	3,265,549
三菱商事	181	－	－
トラスコ中山	163	268	621,760
小売業(3.3%)			
Ｊ．フロント　リテイリング	500	－	－
マツキヨココカラ&カンパニー	158	－	－

銘柄		第2期末	第3期末	
		株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
三越伊勢丹ホールディングス		－	1,313	4,167,462
ツルハホールディングス		113	－	－
しまむら		118	－	－
銀行業（13.8%）				
めぶきフィナンシャルグループ		4,645	－	－
ゆうちょ銀行		－	1,956	2,994,636
コンコルディア・フィナンシャルグループ		－	2,860	2,573,428
ひろぎんホールディングス		1,100	1,192	1,436,956
三菱UFJフィナンシャル・グループ		5,097	3,200	5,281,600
りそなホールディングス		－	2,296	2,335,032
三井住友トラスト・ホールディングス		439	－	－
七十七銀行		－	310	1,354,700
山口フィナンシャルグループ		928	826	1,470,280
証券、商品先物取引業（1.4%）				
ＳＢＩホールディングス		－	408	1,701,768
保険業（5.7%）				
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス		494	1,211	3,815,861
第一生命ホールディングス		－	824	3,318,248
その他金融業（－）				
オリックス		514	－	－
合計	株数・金額	43,001	56,400	126,036,558
	銘柄数<比率>	48	51	<98.5%>

（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。

組入投資信託証券の内容

■SMDAM日本グロース株ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運　用　会　社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
主な投資対象･投資地域	日本の株式
運用の基本方針等	この投資信託は、日本の株式を主要投資対象とし、GARP(Growth at a Reasonable Price)戦略に基づき、アクティブ運用することにより中長期的にベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)(配当込み)を上回る投資成果を目指し、信託財産の成長を目指して運用を行います。

●損益の状況

初回決算日を迎えていないため、記載すべき情報はございません。

●組入資産の明細

初回決算日を迎えていないため、記載すべき情報はございません。

組入投資信託証券の内容

■マニュライフFOFs用日本債券ストラテジックファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の公社債
運用の基本方針	ユーロ円債を含む円建て公社債のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的にNOMURA-BPI総合を上回る運用を目指し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

●損益の状況

項目	第5期 自 2023年3月7日 至 2024年3月5日
(A)有価証券売買損益	28,649,152円
売買益	325,402,517
売買損	△296,753,365
(B)信託報酬等	△196,131,353
(C)当期損益金(A+B)	△167,482,201
(D)前期繰越損益金	△2,100,638,647
(E)追加信託差損益金	△1,701,019,868
(配当等相当額)	(1,200,384,384)
(売買損益相当額)	(△2,901,404,252)
(F)計 (C+D+E)	△3,969,140,716
(G)収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	△3,969,140,716
追加信託差損益金	△1,701,019,868
(配当等相当額)	(1,207,348,195)
(売買損益相当額)	(△2,908,368,063)
分配準備積立金	1,548,841,735
繰越損益金	△3,816,962,583

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第4期末	第5期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
マニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド	78,447,941	72,712,809	71,134,941

下記は、マニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

第5期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
国債証券				
第８回利付国債（４０年）	1.4	4,000	3,674	2055/3/20
第９回利付国債（４０年）	0.4	2,000	1,339	2056/3/20
第１０回利付国債（４０年）	0.9	23,000	18,056	2057/3/20
第１１回利付国債（４０年）	0.8	1,000	753	2058/3/20
第１３回利付国債（４０年）	0.5	16,000	10,553	2060/3/20
第１４回利付国債（４０年）	0.7	3,000	2,109	2061/3/20
第１６回利付国債（４０年）	1.3	2,680,000	2,273,712	2063/3/20
第３６１回利付国債（１０年）	0.1	130,000	127,336	2030/12/20
第３７３回利付国債（１０年）	0.6	6,250,000	6,192,687	2033/12/20
第３１回利付国債（３０年）	2.2	3,000	3,435	2039/9/20
第３２回利付国債（３０年）	2.3	250,000	289,712	2040/3/20
第４８回利付国債（３０年）	1.4	7,000	6,863	2045/9/20
第４９回利付国債（３０年）	1.4	54,000	52,852	2045/12/20
第５２回利付国債（３０年）	0.5	1,010,000	810,494	2046/9/20
第５３回利付国債（３０年）	0.6	521,000	426,506	2046/12/20
第５５回利付国債（３０年）	0.8	2,030,000	1,729,499	2047/6/20
第６３回利付国債（３０年）	0.4	6,000	4,485	2049/6/20
第６４回利付国債（３０年）	0.4	34,000	25,316	2049/9/20
第６７回利付国債（３０年）	0.6	21,000	16,313	2050/6/20
第６８回利付国債（３０年）	0.6	1,000	773	2050/9/20
第６９回利付国債（３０年）	0.7	189,000	149,663	2050/12/20
第７２回利付国債（３０年）	0.7	27,000	21,160	2051/9/20
第７５回利付国債（３０年）	1.3	1,340,000	1,220,123	2052/6/20
第７６回利付国債（３０年）	1.4	10,000	9,307	2052/9/20
第７７回利付国債（３０年）	1.6	374,000	364,302	2052/12/20
第７８回利付国債（３０年）	1.4	435,000	403,740	2053/3/20
第８０回利付国債（３０年）	1.8	370,000	376,164	2053/9/20
第８１回利付国債（３０年）	1.6	780,000	755,601	2053/12/20
第１６０回利付国債（２０年）	0.7	19,000	18,384	2037/3/20
第１７０回利付国債（２０年）	0.3	12,000	10,516	2039/9/20
第１７１回利付国債（２０年）	0.3	188,000	163,904	2039/12/20
第１７２回利付国債（２０年）	0.4	950,000	838,194	2040/3/20
第１７４回利付国債（２０年）	0.4	11,000	9,606	2040/9/20
第１７８回利付国債（２０年）	0.5	5,000	4,360	2041/9/20
第１８０回利付国債（２０年）	0.8	63,000	57,556	2042/3/20
第１８１回利付国債（２０年）	0.9	122,000	113,117	2042/6/20
第１８２回利付国債（２０年）	1.1	26,000	24,870	2042/9/20
第１８３回利付国債（２０年）	1.4	26,000	26,096	2042/12/20
第１８６回利付国債（２０年）	1.5	4,080,000	4,133,080	2043/9/20
第２６回利付国債（物価連動・１０年）	0.005	1,430,000	1,635,914	2031/3/10
第２８回利付国債（物価連動・１０年）	0.005	850,000	916,559	2033/3/10
小計		24,353,000	23,248,701	

第5期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)				
第１回関西電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.896	400,000	398,772	2082/3/20
第１回中国電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.84	500,000	471,550	2061/12/23
第１回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.99	500,000	500,250	2080/10/15
日本生命第１回Ａ号利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.52	400,000	401,840	2045/4/30
日本生命第４回Ａ号利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	0.91	600,000	592,680	2046/11/22
日本生命第６回Ａ号利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.05	300,000	296,520	2047/4/19
第１回Ａ号明治安田生命保険	1.08	600,000	592,230	2046/12/15
第５回Ａ号富国生命保険相互会社利払繰延条項・期限前償還条項付	1.07	300,000	280,059	2080/12/16
第３回Ａ号明治安田生命保険相互会社利払繰延条項・期限前償還条	1.11	1,300,000	1,289,509	2047/11/6
第２回アフラック生命保険株式会社期限前償還条項付無担保社債	1.958	300,000	299,580	2053/12/5
第１回アサヒグループホールディングス株式会社利払繰延条項・期	0.97	1,300,000	1,300,260	2080/10/15
第４回サントリーホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	1.174	100,000	100,481	2083/3/22
第２回ヒューリック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	1.28	1,500,000	1,503,930	2055/7/2
第３回ヒューリック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	1.4	900,000	902,547	2057/7/2
第２回森ビル株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.17	500,000	499,920	2056/10/19
第１回東急不動産ホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	1.06	300,000	299,373	2055/12/17
第２回住友化学株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.84	600,000	596,892	2079/12/13
第１回武田薬品工業株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	1.72	2,100,000	2,110,164	2079/6/6
第１３回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	95,795	2029/7/31
第１７回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	0.79	100,000	99,379	2027/6/11
第１８回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	0.9	100,000	97,336	2030/6/11
第９回楽天株式会社無担保社債	0.42	100,000	85,905	2027/6/25
第１２回楽天株式会社無担保社債	0.35	100,000	91,894	2026/6/25
第２１回楽天グループ株式会社無担保社債	0.72	70,000	67,195	2025/6/13
第４回楽天株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.81	400,000	360,920	2055/11/4
第６回楽天株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	3.0	100,000	69,100	2060/11/4
第１回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	0.7	200,000	197,398	2081/6/15

第5期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第2回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	0.97	100,000	93,680	2081/6/15
第4回ＥＮＥＯＳホールディングス株式会社利払繰延条項・期限前	1.328	600,000	601,452	2083/9/20
第1回東海カーボン株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	0.82	200,000	199,326	2049/12/10
第1回日本製鉄株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.71	1,000,000	999,070	2079/9/12
第2回日本製鉄株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.93	400,000	396,328	2079/9/12
第3回DMG森精機株式会社利払繰延条項・任意償還条項付無担保	2.4	100,000	99,171	－
第1回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	0.74	500,000	493,500	2081/10/14
第2回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	0.885	200,000	192,554	2081/10/14
第3回パナソニック株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	1.0	100,000	90,827	2081/10/14
第1回株式会社かんぽ生命保険利払繰延条項・期限前償還条項付無	1.0	300,000	296,010	2049/1/29
第2回株式会社かんぽ生命保険利払繰延条項・期限前償還条項付無	1.05	200,000	192,560	2051/1/28
第2回アイシン精機株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担	0.41	100,000	97,572	2080/2/28
第1回日本生命第1回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	1.05	860,000	857,703	2048/4/27
第1回日本生命第2回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	1.03	700,000	696,451	2048/9/18
第1回日本生命第3回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	0.95	110,000	108,396	2049/4/22
第1回日本生命第5回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	1.05	200,000	194,878	2050/9/23
第1回日本生命第6回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項・期	0.97	200,000	192,564	2051/5/11
第1回明治安田生命第1回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項	0.88	450,000	427,585	2051/8/2
第1回丸紅株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	0.82	300,000	297,450	2081/3/4
第6回三菱商事株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.85	100,000	99,650	2076/9/13
第7回三菱商事株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	0.51	500,000	493,415	2081/9/13
第1回ニプロ株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.6	700,000	697,550	2055/9/28
第7回イオン株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	1.74	700,000	682,661	2050/12/2
第10回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ任意償還条	0.82	500,000	499,975	－
第17回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ任意償還条	1.804	900,000	903,501	－
第19回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ任意償還条	1.963	800,000	806,616	－
第21回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ任意償還条	1.912	300,000	301,527	－

第5期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第4回株式会社三井住友フィナンシャルグループ期限前償還条項付	1.39	400,000	399,712	－
第13回株式会社三井住友フィナンシャルグループ任意償還条項付	1.889	700,000	700,630	－
第3回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担	1.55	300,000	298,680	－
第8回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担	0.98	1,300,000	1,298,128	－
第10回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無	1.232	300,000	299,646	－
第12回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無	0.937	600,000	593,862	－
第13回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無	1.156	300,000	277,386	－
第15回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無	1.785	500,000	498,690	－
第2回東京センチュリー株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付	1.38	1,300,000	1,303,380	2080/7/30
第3回東京センチュリー株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付	1.66	600,000	578,010	2080/7/30
第２４回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	0.93	100,000	99,833	2025/12/1
第２６回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	0.8	200,000	197,986	2026/7/24
第３２回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	1.1	100,000	100,116	2025/12/5
第３４回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	0.95	600,000	597,102	2026/6/5
第３７回ＳＢＩホールディングス株式会社無担保社債	1.0	300,000	300,114	2027/3/5
第1回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	0.62	100,000	99,516	2080/3/13
第2回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保	0.91	900,000	844,470	2080/3/13
第1回三菱ＨＣキャピタル株式会社利払繰延条項・期限前償還条項	0.63	1,000,000	984,250	2081/9/27
第1回株式会社大和証券グループ本社任意償還条項付無担保永久社	1.2	2,000,000	1,985,740	－
第3回野村ホールディングス株式会社任意償還条項付無担保永久社	1.3	700,000	693,735	－
第2回ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス株式	1.24	200,000	199,560	2076/12/25
第2回第一生命ホールディングス株式会社利払繰延条項・任意償還	1.0	100,000	95,800	－
第3回第一生命ホールディングス株式会社利払繰延条項・任意償還	1.124	300,000	285,240	－
第1回東京海上日動火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条	0.96	100,000	98,689	2079/12/24
第2回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条	1.39	2,000,000	2,015,200	2076/2/10
第1回損害保険ジャパン日本興亜株式会社利払繰延条項・期限前償	0.84	1,330,000	1,322,046	2046/8/8
第2回損害保険ジャパン日本興亜株式会社利払繰延条項・期限前償	0.84	300,000	298,206	2076/8/8

第5期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第3回損害保険ジャパン日本興亜株式会社利払繰延条項・期限前償	1.06	300,000	300,150	2077/4/26
第3回株式会社T&Dホールディングス利払繰延条項・期限前償還	0.94	200,000	192,902	2050/2/4
第4回三菱地所株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	1.48	100,000	101,200	2076/2/3
第4回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.5	100,000	95,622	2030/3/18
第7回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.58	200,000	191,368	2030/7/29
第10回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.57	100,000	95,262	2030/12/3
第13回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.52	100,000	93,932	2031/6/3
第16回ソフトバンク株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約	0.52	300,000	280,134	2031/10/10
第19回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.98	150,000	149,713	2028/3/10
第21回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.82	100,000	98,944	2028/7/12
第28回株式会社光通信無担保社債	1.2	100,000	96,464	2030/7/12
第30回株式会社光通信無担保社債	0.98	100,000	94,065	2031/1/31
第31回株式会社光通信無担保社債	1.38	500,000	429,435	2036/2/1
第33回株式会社光通信無担保社債	0.85	100,000	92,340	2031/6/16
第1回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	1.545	800,000	811,912	2057/9/14
第2回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	1.754	200,000	203,884	2059/9/12
第3回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	1.3	800,000	786,832	2080/10/15
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	400,000	399,968	2030/7/16
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	200,000	197,290	2032/10/8
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.68	200,000	192,722	2031/8/29
第2回株式会社レノバ無担保社債	1.39	200,000	195,400	2027/9/3
第1回株式会社JERA利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	2.144	700,000	722,190	2057/12/25
第3回株式会社JERA利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社	2.549	100,000	104,934	2062/12/25
第5回ソフトバンクグループ株式会社利払繰延条項・期限前償還条	2.75	200,000	196,448	2056/6/21
第4回ソフトバンクグループ株式会社利払繰延条項・期限前償還条	3.0	3,800,000	3,764,356	2056/2/4
第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付非	1.365	200,000	200,144	2027/12/14
第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.895	300,000	299,907	2026/12/14
第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上	1.114	400,000	399,036	2028/1/26
第24回ルノー円貨社債	1.54	700,000	701,813	2024/7/5
アフラック	2.108	100,000	100,359	2047/10/23
小計		53,270,000	52,667,907	
合計		77,623,000	75,916,608	

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		第5期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
国内	１０年国債標準物	2,931	－

＜オプションの銘柄別期末残高＞

銘柄別			コールプット別	第5期末	
				買建額(百万円)	売建額(百万円)
国内	債券	債券店頭	コール	53	6
		債券店頭	プット	4	88

＜スワップ及び先渡取引残高＞

種類	第5期末
	取引契約残高（想定元本額）
	百万円
金利スワップ	8,440

組入投資信託証券の内容

■明治安田FOFs用日本債券アクティブ戦略ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	明治安田アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等
運用の基本方針	この投資信託は、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合を中長期的に上回る投資成果を目指し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

●損益の状況

項目	第3期 自 2023年5月16日 至 2024年5月15日
(A)配当等収益	**△31,667円**
受取利息	5,719
支払利息	△37,386
(B)有価証券売買損益	**△1,691,150,295**
売買益	68,911,830
売買損	△1,760,062,125
(C)信託報酬等	**△106,201,065**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△1,797,383,027**
(E)前期繰越損益金	**△449,781,791**
(F)追加信託差損益金	**△2,277,803,437**
(配当等相当額)	(274,344,053)
(売買損益相当額)	(△2,552,147,490)
(G)計 (D+E+F)	**△4,524,968,255**
(H)収益分配金	**0**
次期繰越損益金(G+H)	**△4,524,968,255**
追加信託差損益金	△2,277,803,437
(配当等相当額)	(284,760,805)
(売買損益相当額)	(△2,562,564,242)
分配準備積立金	884,279,553
繰越損益金	△3,131,444,371

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第2期末	第3期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド	58,722,125	67,097,409	63,460,729

下記は、明治安田日本債券アクティブ・マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

第3期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
国債証券				
第４５５回利付国債２年	0.005	498,000	496,003	2025/12/1
第４６０回利付国債２年	0.3	895,000	894,382	2026/5/1
第１５７回利付国債５年	0.2	380,000	376,336	2028/3/20
第１６１回利付国債５年	0.3	381,000	378,317	2028/6/20
第１６７回利付国債５年	0.4	100,000	99,292	2029/3/20
第７回利付国債４０年	1.7	301,000	280,453	2054/3/20
第８回利付国債４０年	1.4	220,000	188,874	2055/3/20
第９回利付国債４０年	0.4	124,000	76,743	2056/3/20
第１０回利付国債４０年	0.9	182,000	132,344	2057/3/20
第１１回利付国債４０年	0.8	167,000	116,016	2058/3/20
第１２回利付国債４０年	0.5	185,000	113,147	2059/3/20
第１３回利付国債４０年	0.5	41,000	24,682	2060/3/20
第１６回利付国債４０年	1.3	2,785,000	2,153,974	2063/3/20
第３５８回利付国債１０年	0.1	380,000	369,584	2030/3/20
第３６０回利付国債１０年	0.1	200,000	193,648	2030/9/20
第３６１回利付国債１０年	0.1	7,000	6,758	2030/12/20
第３６２回利付国債１０年	0.1	2,116,000	2,037,073	2031/3/20
第３６４回利付国債１０年	0.1	6,185,000	5,915,272	2031/9/20
第３７２回利付国債１０年	0.8	400,000	396,720	2033/9/20
第３７３回利付国債１０年	0.6	298,000	289,334	2033/12/20
第３７４回利付国債１０年	0.8	1,242,000	1,225,220	2034/3/20
第４５回利付国債３０年	1.5	432,000	412,525	2044/12/20
第４８回利付国債３０年	1.4	390,000	363,417	2045/9/20
第５０回利付国債３０年	0.8	414,000	339,248	2046/3/20
第５１回利付国債３０年	0.3	327,000	237,267	2046/6/20
第５２回利付国債３０年	0.5	188,000	142,573	2046/9/20
第５３回利付国債３０年	0.6	148,000	114,415	2046/12/20
第５４回利付国債３０年	0.8	183,000	147,638	2047/3/20
第５５回利付国債３０年	0.8	352,000	283,029	2047/6/20
第５６回利付国債３０年	0.8	193,000	154,660	2047/9/20
第６０回利付国債３０年	0.9	46,000	37,196	2048/9/20
第６９回利付国債３０年	0.7	384,000	285,196	2050/12/20
第７１回利付国債３０年	0.7	137,000	100,999	2051/6/20
第８０回利付国債３０年	1.8	183,000	174,937	2053/9/20
第８２回利付国債３０年	1.8	753,000	718,143	2054/3/20
第１５３回利付国債２０年	1.3	188,000	192,669	2035/6/20
第１５４回利付国債２０年	1.2	2,000	2,025	2035/9/20
第１５６回利付国債２０年	0.4	20,000	18,398	2036/3/20
第１５９回利付国債２０年	0.6	100,000	93,128	2036/12/20
第１６２回利付国債２０年	0.6	339,000	311,652	2037/9/20
第１６３回利付国債２０年	0.6	330,000	302,085	2037/12/20
第１６４回利付国債２０年	0.5	485,000	435,893	2038/3/20
第１６５回利付国債２０年	0.5	200,000	178,808	2038/6/20
第１６６回利付国債２０年	0.7	344,000	315,038	2038/9/20
第１６７回利付国債２０年	0.5	336,000	297,544	2038/12/20
第１６９回利付国債２０年	0.3	402,000	341,571	2039/6/20
第１７０回利付国債２０年	0.3	175,000	147,785	2039/9/20
第１７１回利付国債２０年	0.3	95,000	79,782	2039/12/20
第１７２回利付国債２０年	0.4	112,000	95,072	2040/3/20
第１７３回利付国債２０年	0.4	738,000	623,049	2040/6/20
第１７４回利付国債２０年	0.4	976,000	819,449	2040/9/20
第１７６回利付国債２０年	0.5	185,000	156,339	2041/3/20
第１７７回利付国債２０年	0.4	180,000	148,609	2041/6/20
第１８１回利付国債２０年	0.9	190,000	168,381	2042/6/20
第１８５回利付国債２０年	1.1	1,885,000	1,704,737	2043/6/20
第１８８回利付国債２０年	1.6	3,147,000	3,075,185	2044/3/20
小計		31,646,000	28,782,640	
地方債証券				
令和６年度第３回静岡県公募公債	0.942	100,000	99,342	2034/3/17
令和６年度第３回埼玉県公募公債（５年）	0.546	200,000	199,328	2029/5/21
令和６年度第１回長野県公募公債（１０年）	1.043	100,000	100,000	2034/5/25
第２５４回共同発行市場公募地方債	0.986	100,000	99,550	2034/5/25
令和６年度第２回大阪市公募公債	0.995	100,000	99,632	2034/5/22
第３３回５年名古屋市公募公債	0.58	100,000	99,828	2029/5/18
小計		700,000	697,680	
特殊債券(除く金融債)				
第１４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	237,204	215,267	2054/10/10
第１９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	658,469	642,132	2058/3/10
小計		895,673	857,399	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第５６２回関西電力（一般担保付）	1.128	200,000	196,184	2034/1/25
第３２８回北陸電力（一般担保付）	0.703	600,000	544,362	2035/12/25
第３３２回北陸電力（一般担保付）	0.52	600,000	527,526	2036/6/25
第３４４回北陸電力（一般担保付）	0.4	200,000	181,140	2034/5/25
第５６３回東北電力（一般担保付）	1.161	300,000	295,275	2034/4/25
第５２４回九州電力（一般担保付）	1.161	100,000	98,296	2034/4/25
第３５３回北海道電力（一般担保付）	0.732	600,000	554,310	2034/12/25
第６６回東京電力パワーグリッド（一般担保付）	1.24	100,000	97,122	2033/7/13
第６９回東京電力パワーグリッド（一般担保付）	1.724	200,000	201,940	2033/10/13
第７２回東京電力パワーグリッド（一般担保付）	1.568	700,000	693,616	2034/4/18
第７３回東京電力パワーグリッド（一般担保付）	2.093	500,000	494,025	2039/4/18
第４回大和ハウス工業無担保社債（劣後特約付）	1.27	600,000	597,308	2059/9/25
第２回アフラック生命保険（劣後特約付）	1.958	300,000	299,604	2053/12/5
第２回不二製油グループ本社無担保社債（劣後特約付）	1.571	200,000	199,296	2054/4/25
第８回中央日本土地建物グループ無担保社債	1.043	100,000	98,919	2029/2/16
第１３回ヒューリック無担保社債	0.569	200,000	199,460	2027/4/16
第２回ヒューリック無担保社債（劣後特約付）	1.28	1,700,000	1,702,126	2055/7/2

第　3　期　末				
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第2回DCMホールディングス無担保社債	0.892	100,000	99,119	2029/3/14
第1回住友化学無担保社債（劣後特約付）	1.3	600,000	547,407	2079/12/13
第2回住友化学無担保社債（劣後特約付）	0.84	300,000	299,041	2079/12/13
第14回野村総合研究所無担保社債	1.223	200,000	197,258	2033/12/7
第1回武田薬品工業無担保社債（劣後特約付）	1.72	700,000	702,019	2079/6/6
第18回楽天グループ無担保社債	1.05	200,000	147,406	2031/12/2
第19回楽天グループ無担保社債	1.3	300,000	205,473	2033/12/2
第2回ＥＮＥＯＳホールディングス無担保社債（劣後特約付）	0.97	100,000	93,114	2081/6/15
第4回ＥＮＥＯＳホールディングス無担保社債（劣後特約付）	1.328	400,000	397,129	2083/9/20
第5回ＥＮＥＯＳホールディングス無担保社債（劣後特約付）	2.195	900,000	895,097	2083/9/20
第71回神戸製鋼所無担保社債	1.417	200,000	198,904	2034/4/25
第3回DMG森精機無担保永久社債（劣後特約	2.4	100,000	98,967	－
第4回DMG森精機無担保永久社債（劣後特約	0.9	700,000	679,080	－
第1回日本ピラー工業無担保社債	1.062	100,000	99,317	2028/12/14
第23回日立製作所無担保社債	1.184	200,000	196,426	2033/12/14
第1回パナソニック無担保社債（劣後特約付）	0.74	300,000	296,191	2081/10/14
第2回パナソニック無担保社債（劣後特約付）	0.885	1,300,000	1,261,443	2081/10/14
第3回パナソニック無担保社債（劣後特約付）	1.0	300,000	276,422	2081/10/14
第3回かんぽ生命無担保社債（劣後特約付）	1.91	900,000	888,710	2053/9/7
第1回ＫＹＢ無担保社債	0.53	200,000	197,580	2026/9/24
第31回マツダ無担保社債	0.867	100,000	99,280	2029/3/7
第21回三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保永久社債（劣	1.912	600,000	597,478	－
第11回三井住友フィナンシャルグループ無担保永久社債（劣後特	1.879	200,000	199,938	－
第15回三井住友フィナンシャルグループ無担保永久社債（劣後特	1.844	800,000	796,023	－
第16回三井住友フィナンシャルグループ無担保永久社債（劣後特	2.248	100,000	98,552	－
第15回みずほフィナンシャルグループ無担保永久社債（劣後特約	1.785	1,100,000	1,090,039	－
第17回みずほフィナンシャルグループ無担保永久社債（劣後特約	1.966	500,000	498,295	－
第18回みずほフィナンシャルグループ無担保永久社債（劣後特約	2.373	400,000	397,045	－
第1回芙蓉総合リース無担保社債（劣後特約付）	1.849	100,000	100,237	2057/12/14
第30回NTTファイナンス無担保社債	1.213	200,000	200,126	2033/9/20
第５８回日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.7	600,000	596,778	2027/3/19
第28回ＳＢＩホールディングス無担保社債	1.0	200,000	197,940	2026/12/23
第35回ＳＢＩホールディングス無担保社債	1.15	600,000	590,832	2028/6/6
第36回ＳＢＩホールディングス無担保社債	1.28	300,000	297,540	2027/9/22
第37回ＳＢＩホールディングス無担保社債	1.0	500,000	496,230	2027/3/5
第６６回アイフル無担保社債	0.87	300,000	297,927	2026/6/12
第６７回アイフル無担保社債	0.9	100,000	99,101	2027/1/26
第1回三菱ＨＣキャピタル無担保社債（劣後特約付）	0.63	500,000	490,304	2081/9/27
第1回大和証券グループ本社無担保永久社債（劣後特約	1.2	600,000	596,681	－

第　3　期　末				
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第3回野村ホールディングス無担保永久社債（劣後特約	1.3	1,300,000	1,283,210	－
第4回損害保険ジャパン無担保社債（劣後特約付）	2.5	400,000	406,599	2083/2/13
第84回三井不動産無担保社債	1.057	200,000	195,870	2033/9/12
第47回東海旅客鉄道無担保社債	2.375	100,000	108,355	2039/12/16
第1回商船三井無担保社債（劣後特約付）	1.6	900,000	904,276	2056/4/27
第1回日本航空無担保社債（劣後特約付）	1.6	500,000	496,514	2058/10/11
第2回ＫＰＰグループホールディングス無担保社債	1.167	200,000	198,486	2029/3/12
第6回日本トランスシティ無担保社債	0.505	200,000	196,926	2028/6/15
第19回ソフトバンク無担保社債	0.98	300,000	297,528	2028/3/10
第21回ソフトバンク無担保社債	0.82	200,000	196,678	2028/7/12
第16回光通信無担保社債	1.78	700,000	713,160	2027/8/10
第18回光通信無担保社債	1.79	1,100,000	1,043,383	2033/3/23
第19回光通信無担保社債	0.8	200,000	194,800	2028/9/21
第38回光通信無担保社債	0.68	200,000	197,532	2027/5/7
第46回光通信無担保社債	1.272	100,000	99,112	2029/3/14
第8回GMOインターネット無担保社債	1.48	300,000	295,278	2028/6/15
第62回電源開発無担保社債	0.805	100,000	90,581	2036/10/20
第17回ＪＥＲＡ無担保社債	0.9	200,000	197,918	2030/4/25
第4回東京電力リニューアブルパワー無担保社債	1.2	400,000	398,464	2030/9/6
第5回東京電力リニューアブルパワー無担保社債	1.431	100,000	98,194	2034/2/28
第50回ソフトバンクグループ無担保社債	2.48	100,000	101,228	2026/4/20
第53回ソフトバンクグループ無担保社債	1.57	364,000	364,123	2024/6/14
第55回ソフトバンクグループ無担保社債	1.64	334,000	335,032	2025/4/25
第57回ソフトバンクグループ無担保社債	1.38	300,000	296,754	2026/9/11
第60回ソフトバンクグループ無担保社債	1.799	200,000	199,476	2027/4/23
第61回ソフトバンクグループ無担保社債	2.441	900,000	897,120	2029/4/25
第9回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債（劣後特約付	1.1	600,000	589,275	2031/12/16
第17回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	1.163	100,000	99,617	2027/7/13
第2回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.839	200,000	196,976	2027/6/9
２０２０第7回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	1.248	800,000	801,320	2026/6/4
第1回ネイバー円貨社債	1.142	200,000	199,796	2027/4/30
第1回フォルヴィア・エス・イー円貨社債	2.48	400,000	399,296	2026/3/13
第24回ルノー円貨社債	1.54	300,000	300,354	2024/7/5
第25回ルノー円貨社債	3.5	200,000	203,990	2025/6/26
パークシャー・ハサウェイユーロ円債２７／０４／２３	0.974	200,000	199,975	2027/4/23
アフラック変動利付ユーロ円債４７／１０／２３	2.108	500,000	499,178	2047/10/23
小　計		36,498,000	35,793,346	
合　計		69,739,673	66,131,067	

組入投資信託証券の内容

■ニッセイ国内債券アクティブプラス(FOFs用)(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	内外の公社債及び内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引
運用の基本方針	この投資信託は、主として内外の公社債への投資を行うとともに、内外の国債先物取引や円金利スワップ等のデリバティブ取引を活用することで、ベンチマークであるNOMURA-BPI(総合)指数を中長期的に上回る投資成果の獲得をめざします。

●損益の状況

項目	第1期 自 2023年4月 5日 至 2024年6月10日
(A)配当等収益	**3,672円**
受取利息	9,090
支払利息	△5,418
(B)有価証券売買損益	**△1,070,677,751**
売買益	12,048,369
売買損	△1,082,726,120
(C)信託報酬等	**△107,059,412**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△1,177,733,491**
(E)追加信託差損益金	**△520,430,539**
(配当等相当額)	(14,785,580)
(売買損益相当額)	(△535,216,119)
(F)合計(D+E)	**△1,698,164,030**
次期繰越損益金(F)	**△1,698,164,030**
追加信託差損益金	△520,430,539
(配当等相当額)	(37,629,866)
(売買損益相当額)	(△558,060,405)
分配準備積立金	188,750,306
繰越欠損金	△1,366,483,797

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第1期末	
	口数	評価額
	千口	千円
ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド	19,103,236	24,723,408
ニッセイ国内債券アクティブプラス（金利戦略型）マザーファンド	26,070,369	24,553,073

下記は、ニッセイ国内公社債クレジット特化型マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

銘柄名	第1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460回 利付国債(2年)	0.3000	600,000	599,376	2026/05/01
第2回 利付国債(40年)	2.2000	60,000	62,349	2049/03/20
第3回 利付国債(40年)	2.2000	50,000	51,656	2050/03/20
第4回 利付国債(40年)	2.2000	70,000	71,876	2051/03/20
第6回 利付国債(40年)	1.9000	55,000	52,602	2053/03/20
第7回 利付国債(40年)	1.7000	105,000	95,383	2054/03/20
第8回 利付国債(40年)	1.4000	120,000	100,358	2055/03/20
第9回 利付国債(40年)	0.4000	205,000	122,997	2056/03/20
第10回 利付国債(40年)	0.9000	190,000	134,029	2057/03/20
第11回 利付国債(40年)	0.8000	145,000	97,451	2058/03/20
第12回 利付国債(40年)	0.5000	160,000	94,331	2059/03/20
第13回 利付国債(40年)	0.5000	145,000	83,824	2060/03/20
第14回 利付国債(40年)	0.7000	150,000	92,509	2061/03/20
第15回 利付国債(40年)	1.0000	425,000	289,884	2062/03/20
第16回 利付国債(40年)	1.3000	180,000	134,818	2063/03/20
第17回 利付国債(40年)	2.2000	60,000	58,329	2064/03/20
第348回 利付国債(10年)	0.1000	100,000	98,869	2027/09/20
第359回 利付国債(10年)	0.1000	264,000	255,507	2030/06/20
第361回 利付国債(10年)	0.1000	179,100	172,446	2030/12/20
第362回 利付国債(10年)	0.1000	1,142,600	1,096,850	2031/03/20
第363回 利付国債(10年)	0.1000	352,000	336,730	2031/06/20
第364回 利付国債(10年)	0.1000	748,000	712,724	2031/09/20
第365回 利付国債(10年)	0.1000	596,000	565,776	2031/12/20
第366回 利付国債(10年)	0.2000	1,801,700	1,717,560	2032/03/20
第370回 利付国債(10年)	0.5000	618,700	597,361	2033/03/20
第374回 利付国債(10年)	0.8000	392,000	383,991	2034/03/20
第32回 利付国債(30年)	2.3000	70,000	77,240	2040/03/20
第35回 利付国債(30年)	2.0000	50,000	52,529	2041/09/20
第36回 利付国債(30年)	2.0000	205,000	214,710	2042/03/20
第38回 利付国債(30年)	1.8000	170,000	171,443	2043/03/20
第42回 利付国債(30年)	1.7000	314,200	308,490	2044/03/20
第45回 利付国債(30年)	1.5000	160,000	150,548	2044/12/20
第46回 利付国債(30年)	1.5000	340,000	319,266	2045/03/20
第48回 利付国債(30年)	1.4000	330,000	302,705	2045/09/20
第50回 利付国債(30年)	0.8000	270,000	217,717	2046/03/20
第51回 利付国債(30年)	0.3000	415,000	296,040	2046/06/20
第53回 利付国債(30年)	0.6000	180,000	136,827	2046/12/20
第56回 利付国債(30年)	0.8000	605,000	476,080	2047/09/20
第59回 利付国債(30年)	0.7000	625,000	473,925	2048/06/20
第63回 利付国債(30年)	0.4000	500,000	342,580	2049/06/20
第67回 利付国債(30年)	0.6000	545,000	386,612	2050/06/20
第70回 利付国債(30年)	0.7000	600,000	431,982	2051/03/20
第73回 利付国債(30年)	0.7000	460,000	327,391	2051/12/20
第75回 利付国債(30年)	1.3000	255,000	212,450	2052/06/20
第78回 利付国債(30年)	1.4000	275,000	233,560	2053/03/20
第79回 利付国債(30年)	1.2000	210,000	169,056	2053/06/20
第80回 利付国債(30年)	1.8000	215,000	200,577	2053/09/20
第82回 利付国債(30年)	1.8000	200,000	186,110	2054/03/20
第152回 利付国債(20年)	1.2000	610,000	614,983	2035/03/20
第153回 利付国債(20年)	1.3000	646,000	656,439	2035/06/20
第156回 利付国債(20年)	0.4000	634,600	578,349	2036/03/20
第157回 利付国債(20年)	0.2000	421,600	372,985	2036/06/20
第158回 利付国債(20年)	0.5000	559,000	510,842	2036/09/20
第159回 利付国債(20年)	0.6000	350,000	322,563	2036/12/20
第162回 利付国債(20年)	0.6000	870,000	791,630	2037/09/20
第164回 利付国債(20年)	0.5000	173,000	153,777	2038/03/20
第165回 利付国債(20年)	0.5000	210,000	185,774	2038/06/20
第166回 利付国債(20年)	0.7000	819,100	742,047	2038/09/20
第168回 利付国債(20年)	0.4000	115,000	98,628	2039/03/20
第170回 利付国債(20年)	0.3000	703,000	586,484	2039/09/20
第173回 利付国債(20年)	0.4000	1,040,000	867,536	2040/06/20
第175回 利付国債(20年)	0.5000	310,000	260,158	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5000	820,000	684,429	2041/03/20
第179回 利付国債(20年)	0.5000	660,000	542,790	2041/12/20
第181回 利付国債(20年)	0.9000	450,000	394,074	2042/06/20
第184回 利付国債(20年)	1.1000	831,100	745,280	2043/03/20
第185回 利付国債(20年)	1.1000	280,000	250,096	2043/06/20
第186回 利付国債(20年)	1.5000	207,000	197,546	2043/09/20
第188回 利付国債(20年)	1.6000	200,000	193,040	2044/03/20
第31回 インドネシア共和国	0.9900	300,000	300,360	2027/05/27
第16回 ポーランド共和国国債	0.9300	500,000	498,859	2026/11/20
小計		27,617,700	24,316,119	
特殊債券(除く金融債券)				
第134回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3900	71,643	66,255	2053/07/10
第181回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5000	180,764	167,423	2057/06/10
第195回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9300	96,870	93,179	2058/08/10
第196回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0200	96,880	94,060	2058/09/10
小計		446,157	420,919	
普通社債券				
第41回 フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債(2023)	0.8200	400,000	399,764	2026/10/16
第32回 ビー・ビー・シー・イー・エス・エー	0.7130	200,000	198,988	2026/07/13
第36回 ビー・ビー・シー・イー・エス・エー	0.8950	200,000	199,166	2026/12/14
第15回 クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付	1.1140	100,000	99,774	2028/01/26

第　1　期　末				
銘　柄　名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第7回　エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー	1.4780	600,000	603,202	2026/09/15
第11回　ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー	1.3520	300,000	300,976	2029/05/25
第12回　ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー	1.3770	200,000	199,375	2027/12/01
第3回　マルハニチロ	0.9510	300,000	297,259	2029/04/25
第9回　五洋建設	0.8020	200,000	197,794	2029/02/28
第4回　大和ハウス工業劣後特約付(サステナビリティリンクボンド)	1.2700	100,000	99,304	2059/09/25
第1回　タケエイ	0.5800	100,000	98,893	2026/09/02
第19回　森永乳業(グリーンボンド)	1.0920	100,000	99,644	2031/06/05
第20回　森永乳業	1.4300	100,000	99,478	2034/06/05
第1回　アサヒグループホールディングス劣後特約付	0.9700	200,000	200,336	2080/10/15
第3回　プレミアムウォーターホールディングス	1.2000	100,000	98,662	2027/03/01
第2回　不二製油グループ本社劣後特約付	1.5710	500,000	497,550	2054/04/25
第1回　あらた	0.7890	200,000	197,082	2028/09/06
第6回　日鉄興和不動産	0.8300	200,000	197,891	2028/07/27
第7回　中央日本土地建物グループ(グリーンボンド)	0.9090	100,000	98,622	2028/08/15
第8回　中央日本土地建物グループ(グリーンボンド)	1.0430	400,000	394,956	2029/02/16
第2回　DCMホールディングス	0.8920	200,000	197,224	2029/03/14
第26回　森ビル(グリーンボンド)	0.3200	200,000	192,648	2029/11/14
第2回　森ビル(グリーンボンド)劣後特約付	1.1700	200,000	198,947	2056/10/19
第28回　東急不動産ホールディングス(グリーンボンド)	0.6940	100,000	99,505	2028/03/01
第5回　マクロミル	0.7000	200,000	198,886	2026/06/05
第63回　住友化学	0.3600	300,000	279,489	2030/10/22
第16回　ダイセル	0.3800	200,000	197,049	2027/12/14
第13回　野村総合研究所	0.9050	300,000	298,426	2030/12/06
第14回　野村総合研究所	1.2230	200,000	198,363	2033/12/07
第2回　ＡＤＥＫＡ	0.6920	200,000	197,435	2029/02/28
第1回　武田薬品工業劣後特約付	1.7200	500,000	501,269	2079/06/06
2 武田薬品劣後FR	1.9340	1,200,000	1,200,000	2084/06/25
第6回　H.U.グループホールディングス	0.7290	200,000	198,311	2027/12/07
第4回　ＥＮＥＯＳホールディングス劣後特約付	1.3280	200,000	197,892	2083/09/20
第5回　ＥＮＥＯＳホールディングス劣後特約付	2.1950	200,000	199,201	2083/09/20
4 日本製鉄劣後FR	1.5340	500,000	500,000	2059/06/13
6 日本製鉄劣後FR	2.3280	300,000	300,000	2064/06/13
第1回　合同製鐵	1.1700	100,000	97,956	2029/03/06
第1回　日本冶金工業	0.6000	200,000	200,043	2024/12/06
第2回　日本冶金工業	0.7000	200,000	193,784	2028/12/01
第1回　テクノプロ・ホールディングス	0.1300	100,000	99,976	2024/10/25
第2回　テクノプロ・ホールディングス	0.2000	100,000	98,714	2026/10/26

第　1　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　ジェイテクト	0.2800	100,000	96,258	2029/11/28
第10回　ミネベアミツミ(グリーンボンド)	0.4200	100,000	98,458	2027/11/25
第1回　日本ピラー工業(グリーンボンド)	1.0620	200,000	198,145	2028/12/14
第38回　ソニーグループ	0.4500	100,000	99,184	2027/12/08
第41回　ソニーグループ	1.0010	300,000	291,388	2034/03/07
第4回　かんぽ生命保険劣後特約付	2.1330	500,000	504,435	2054/04/17
第1回　アイシン精機劣後特約付	0.4000	100,000	99,672	2080/02/28
第8回　SUBARU(グリーンボンド)	1.0590	200,000	198,366	2030/11/29
第3回　ゼンショーホールディングス	0.3400	100,000	99,769	2024/12/13
第3回　シークス	1.2620	100,000	99,746	2029/06/06
第4回　兼松	0.5700	200,000	200,086	2024/12/13
第5回　兼松	0.4200	200,000	195,805	2027/03/03
第83回　三菱商事	1.0540	200,000	195,139	2034/03/21
第7回　三菱商事劣後特約付	0.5100	200,000	197,081	2081/09/13
第35回　阪和興業	0.5400	400,000	391,768	2028/06/01
第13回　ニプロ(ソーシャルボンド)	1.0880	100,000	99,310	2028/10/13
第1回　ニプロ(ソーシャルボンド)劣後特約付	1.6000	300,000	299,486	2055/09/28
第2回　稲畑産業	1.7660	200,000	198,986	2034/06/05
第3回　稲畑産業	1.1410	200,000	199,490	2029/06/05
第101回　クレディセゾン	0.5990	100,000	99,602	2027/04/30
第21回　三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ劣後特約付	1.9120	200,000	198,711	2029/07/15
第20回　三井住友トラスト・ホールディングス劣後特約付	1.1490	100,000	101,940	2033/09/05
第17回　三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	2.0450	300,000	300,369	2029/12/05
第19回　三井住友フィナンシャルグループ劣後特約付	2.4810	200,000	200,560	2034/06/05
第32回　ＮＴＴファイナンス	0.9670	100,000	99,737	2029/06/20
第56回　日産フィナンシャルサービス	0.5200	500,000	496,567	2026/06/19
第58回　日産フィナンシャルサービス	0.7000	100,000	99,292	2027/03/19
第2回　東京センチュリー劣後特約付	1.3800	100,000	99,964	2080/07/30
第27回　ＳＢＩホールディングス	0.8000	200,000	200,049	2024/12/23
第32回　ＳＢＩホールディングス	1.1000	100,000	99,937	2025/12/05
第34回　ＳＢＩホールディングス	0.9500	300,000	297,910	2026/06/05
第37回　ＳＢＩホールディングス	1.0000	100,000	98,720	2027/03/05
第42回　リコーリース	0.3900	200,000	197,789	2027/06/01
第22回　イオンフィナンシャルサービス	0.4400	200,000	197,466	2027/01/04
第35回　三井住友ファイナンス&リース	0.7090	100,000	99,594	2028/02/02
第1回　三菱HCキャピタル劣後特約付	0.6300	100,000	98,109	2081/09/27
第2回　三井住友海上火災保険劣後特約付	1.3900	200,000	200,840	2076/02/10
第4回　三井住友海上火災保険劣後特約付	1.1700	100,000	99,108	2077/12/10
第2回　損害保険ジャパン日本興亜劣後特約付	0.8400	200,000	197,833	2076/08/08
第4回　損害保険ジャパン劣後特約付	2.5000	600,000	611,736	2083/02/13
第25回　NECキャピタルソリューション	0.3400	200,000	198,147	2026/06/05
第5回　三菱地所劣後特約付	0.6600	300,000	298,436	2081/02/03
第48回　京浜急行電鉄	0.8180	200,000	191,806	2033/07/27

第　1　期　末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第1回　富士急行	0.5950	200,000	192,579	2028/12/07
第62回　東京地下鉄(グリーンボンド)	1.6480	200,000	187,694	2044/03/11
第1回　西日本鉄道劣後特約付	0.5900	100,000	99,000	2056/06/22
第2回　西日本鉄道劣後特約付	0.6700	300,000	290,640	2058/06/21
第124回　近鉄グループホールディングス	0.6690	100,000	98,695	2028/07/21
第7回　山九	1.2050	100,000	97,233	2034/02/28
第5回　神奈川中央交通	0.4500	500,000	497,803	2025/12/08
第1回　商船三井劣後特約付	1.6000	300,000	300,450	2056/04/27
第23回　商船三井	0.4900	100,000	99,866	2025/07/18
第14回　川崎汽船	0.7290	200,000	196,151	2028/09/11
第1回　日本航空劣後特約付	1.6000	500,000	496,066	2058/10/11
第13回　日本航空(トランジションボンド)	1.6340	300,000	297,201	2034/05/23
第1回　TREホールディングス(サステナビリティリンクボンド)	1.5000	200,000	198,028	2028/09/06
第1回　KPPグループホールディングス	1.1200	200,000	198,504	2028/03/09
第2回　KPPグループホールディングス	1.1670	200,000	197,857	2029/03/12
第5回　ヤマタネ(グリーンボンド)	1.3500	300,000	302,754	2026/12/11
第4回　ヤマタネ	0.5000	500,000	497,357	2025/12/12
第6回　日本トランスシティ(グリーンボンド)	0.5050	200,000	195,917	2028/06/15
第21回　ソフトバンク	0.8200	100,000	98,843	2028/07/12
第46回　光通信	1.2720	200,000	197,840	2029/03/14
第47回　光通信	1.9340	100,000	99,843	2031/03/14
第48回　光通信	2.0500	100,000	100,356	2031/04/25
第2回　GMOインターネット	0.7900	100,000	99,094	2026/06/24
第562回　関西電力	1.1280	300,000	292,580	2034/01/25
第1回　関西電力劣後特約付	0.8960	100,000	99,124	2082/03/20
第3回　関西電力劣後特約付	1.2590	400,000	383,097	2082/03/20
第3回　東北電力劣後特約付	2.0990	100,000	100,619	2062/09/15
第1回　東北電力劣後特約付	1.5450	400,000	403,532	2057/09/14
第563回　東北電力	1.1610	100,000	97,537	2034/04/25
第1回　九州電力劣後特約付	0.9900	200,000	199,721	2080/10/15
第515回　九州電力	0.6200	300,000	293,379	2030/05/24
第524回　九州電力	1.1610	100,000	97,537	2034/04/25
第1回　沖縄電力劣後特約付	1.7790	100,000	101,322	2052/12/25
第2回　沖縄電力劣後特約付	2.0490	100,000	100,421	2052/12/25
第59回　東京電力パワーグリッド	1.1900	100,000	100,619	2028/01/19
第63回　東京電力パワーグリッド	0.9800	100,000	99,738	2028/04/19
第68回　東京電力パワーグリッド	0.9880	100,000	99,517	2028/10/13
第71回　東京電力パワーグリッド	0.9960	100,000	99,289	2029/04/18
第72回　東京電力パワーグリッド	1.5680	200,000	196,857	2034/04/18
第73回　東京電力パワーグリッド	2.0930	100,000	97,594	2039/04/18
第73回　東京瓦斯	1.6470	100,000	93,532	2044/03/11
第4回　大阪瓦斯劣後特約付	0.6300	100,000	93,800	2080/09/10
第1回　メタウォーター(ブルーボンド)	0.7340	200,000	197,233	2028/12/07
第6回　イチネンホールディングス	0.3600	100,000	99,951	2024/09/13
第7回　イチネンホールディングス	0.5300	100,000	98,977	2026/09/14
第8回　イチネンホールディングス	1.3000	200,000	201,475	2026/12/04
第2回　日鉄住金物産	0.3950	100,000	98,033	2028/03/03
第60回　ソフトバンクグループ	1.7990	500,000	498,380	2027/04/23
第2回　非アフラック生命保険劣後特約付	1.9580	100,000	98,957	2053/12/05
CORNING INC 2024/08/09	0.6980	100,000	99,984	2024/08/09
PayPal Holdings Inc 2026/06/09	0.9720	200,000	200,580	2026/06/09
Berkshire Hathaway Inc. 2026/11/27	0.9550	200,000	200,102	2026/11/27
ING Bank N.V. 2028/12/07	1.0530	200,000	198,638	2028/12/07
MetLife, Inc. 2034/03/07	1.6700	500,000	498,315	2034/03/07
小　計		29,800,000	29,550,889	
合　計		57,863,857	54,287,928	

下記は、ニッセイ国内債券アクティブプラス(金利戦略型)マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

銘柄名	第1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460回 利付国債(2年)	0.3000	1,600,000	1,598,336	2026/5/1
第166回 利付国債(5年)	0.4000	1,600,000	1,587,984	2028/12/20
第167回 利付国債(5年)	0.4000	3,200,000	3,171,040	2029/3/20
第16回 利付国債(40年)	1.3000	400,000	299,596	2063/3/20
第17回 利付国債(40年)	2.2000	400,000	388,864	2064/3/20
第356回 利付国債(10年)	0.1000	2,000,000	1,947,340	2029/9/20
第359回 利付国債(10年)	0.1000	550,000	532,306	2030/6/20
第360回 利付国債(10年)	0.1000	1,700,000	1,641,129	2030/9/20
第362回 利付国債(10年)	0.1000	800,000	767,968	2031/3/20
第364回 利付国債(10年)	0.1000	4,400,000	4,192,496	2031/9/20
第373回 利付国債(10年)	0.6000	240,000	231,448	2033/12/20
第374回 利付国債(10年)	0.8000	3,200,000	3,134,624	2034/3/20
第54回 利付国債(30年)	0.8000	250,000	198,402	2047/3/20
第56回 利付国債(30年)	0.8000	350,000	275,418	2047/9/20
第80回 利付国債(30年)	1.8000	1,000,000	932,920	2053/9/20
第81回 利付国債(30年)	1.6000	1,040,000	923,343	2053/12/20
第82回 利付国債(30年)	1.8000	1,700,000	1,581,935	2054/3/20
第158回 利付国債(20年)	0.5000	250,000	228,462	2036/9/20
第159回 利付国債(20年)	0.6000	800,000	737,288	2036/12/20
第160回 利付国債(20年)	0.7000	600,000	557,814	2037/3/20
第164回 利付国債(20年)	0.5000	500,000	444,445	2038/3/20
第165回 利付国債(20年)	0.5000	800,000	707,712	2038/6/20
第166回 利付国債(20年)	0.7000	300,000	271,779	2038/9/20
第169回 利付国債(20年)	0.3000	50,000	41,974	2039/6/20
第170回 利付国債(20年)	0.3000	800,000	667,408	2039/9/20
第175回 利付国債(20年)	0.5000	500,000	419,610	2040/12/20
第176回 利付国債(20年)	0.5000	800,000	667,736	2041/3/20
第182回 利付国債(20年)	1.1000	150,000	135,466	2042/9/20
第187回 利付国債(20年)	1.3000	500,000	459,560	2043/12/20
第188回 利付国債(20年)	1.6000	1,600,000	1,544,320	2044/3/20
小計		32,080,000	30,288,726	
合計		32,080,000	30,288,726	

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

	銘柄別	第1期末 買建額(百万円)	売建額(百万円)
国内	長期国債	－	7,426
外国	EURO-BOBL FUTURES(FGBM)	1,952	－

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

＜スワップ及び先渡取引残高＞

種類	第1期末 取引契約残高(想定元本額)
	百万円
金利スワップ	21,950

組入投資信託証券の内容

■SMDAM日本債券ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の公社債
運用の基本方針	この投資信託は、デュレーション・コントロールを重視したアクティブ運用により中長期的にNOMURA-BPI総合指数を上回る投資成果を目指して運用を行います。

●損益の状況

項目	第1期 自 2023年4月10日 至 2024年1月29日
(A)配当等収益	**△666円**
受取利息	20
支払利息	△686
(B)有価証券売買損益	**△44,728,353**
売買益	6,659,422
売買損	△51,387,775
(C)信託報酬等	**△55,079,552**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△99,808,571**
(E)追加信託差損益金	**△1,023,791,603**
(配当等相当額)	(△413)
(売買損益相当額)	(△1,023,791,190)
(F)合計(D+E)	**△1,123,600,174**
次期繰越損益金(F)	**△1,123,600,174**
追加信託差損益金	△1,023,791,603
(配当等相当額)	(17,705,502)
(売買損益相当額)	(△1,041,497,105)
分配準備積立金	94,455,371
繰越損益金	△194,263,942

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第1期末	
	口数	評価額
	千口	千円
年金日本債券マザーファンド	47,861,081	58,830,840

下記は、年金日本債券マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

銘柄名	第1期末 利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
国債証券				
453 2年国債	0.0050	1,320,000	1,319,775	2025/10/01
455 2年国債	0.0050	16,830,000	16,820,575	2025/12/01
456 2年国債	0.1000	2,960,000	2,962,545	2026/01/01
161 5年国債	0.3000	650,000	651,833	2028/06/20
162 5年国債	0.3000	3,800,000	3,805,206	2028/09/20
163 5年国債	0.4000	450,000	452,677	2028/09/20
356 10年国債	0.1000	320,000	316,185	2029/09/20
372 10年国債	0.8000	3,360,000	3,393,398	2033/09/20
149 20年国債	1.5000	760,000	815,708	2034/06/20
150 20年国債	1.4000	200,000	212,492	2034/09/20
151 20年国債	1.2000	550,000	572,319	2034/12/20
20 30年国債	2.5000	40,000	47,189	2035/09/20
155 20年国債	1.0000	790,000	799,337	2035/12/20
22 30年国債	2.5000	290,000	342,632	2036/03/20
156 20年国債	0.4000	645,000	606,732	2036/03/20
160 20年国債	0.7000	670,000	644,419	2037/03/20
161 20年国債	0.6000	580,000	548,401	2037/06/20
164 20年国債	0.5000	850,000	782,824	2038/03/20
166 20年国債	0.7000	1,050,000	986,464	2038/09/20
167 20年国債	0.5000	740,000	672,023	2038/12/20
168 20年国債	0.4000	910,000	810,009	2039/03/20
170 20年国債	0.3000	580,000	502,981	2039/09/20
171 20年国債	0.3000	370,000	319,176	2039/12/20
173 20年国債	0.4000	390,000	338,469	2040/06/20
175 20年国債	0.5000	790,000	690,523	2040/12/20
179 20年国債	0.5000	850,000	729,087	2041/12/20
182 20年国債	1.1000	320,000	302,012	2042/09/20
183 20年国債	1.4000	650,000	643,747	2042/12/20
184 20年国債	1.1000	195,000	182,993	2043/03/20
39 30年国債	1.9000	60,000	64,182	2043/06/20
185 20年国債	1.1000	880,000	823,416	2043/06/20
186 20年国債	1.5000	3,250,000	3,250,000	2043/09/20
44 30年国債	1.7000	240,000	246,398	2044/09/20
46 30年国債	1.5000	130,000	128,453	2045/03/20
47 30年国債	1.6000	230,000	230,917	2045/06/20
49 30年国債	1.4000	20,000	19,273	2045/12/20
51 30年国債	0.3000	450,000	339,313	2046/06/20
55 30年国債	0.8000	600,000	501,246	2047/06/20
58 30年国債	0.8000	740,000	611,883	2048/03/20
59 30年国債	0.7000	300,000	241,212	2048/06/20
60 30年国債	0.9000	1,060,000	891,831	2048/09/20
64 30年国債	0.4000	110,000	80,103	2049/09/20
67 30年国債	0.6000	800,000	608,656	2050/06/20
69 30年国債	0.7000	90,000	69,908	2050/12/20
70 30年国債	0.7000	620,000	479,917	2051/03/20
74 30年国債	1.0000	120,000	99,650	2052/03/20
75 30年国債	1.3000	100,000	89,513	2052/06/20
76 30年国債	1.4000	435,000	398,725	2052/09/20
77 30年国債	1.6000	200,000	192,032	2052/12/20
78 30年国債	1.4000	975,000	891,091	2053/03/20
79 30年国債	1.2000	190,000	164,764	2053/06/20
80 30年国債	1.8000	2,320,000	2,324,477	2053/09/20
14 40年国債	0.7000	195,000	134,532	2061/03/20
15 40年国債	1.0000	120,000	91,274	2062/03/20
16 40年国債	1.3000	870,000	724,379	2063/03/20
小計		57,015,000	54,968,895	
地方債証券				
763 東京都公債	0.1500	200,000	199,788	2026/12/18
498 名古屋市債	0.1500	200,000	199,886	2026/12/18
2022-5福岡市公	0.4440	100,000	97,681	2032/10/28
19 東京都30年	0.7250	100,000	76,759	2050/09/20
小計		600,000	574,116	
特殊債券(除く金融債券)				
138 住宅機構RMBS	0.5000	74,279	70,676	2053/11/10
153 住宅機構RMBS	0.3400	164,820	153,513	2055/02/10
160 住宅機構RMBS	0.3700	85,320	79,390	2055/09/10
161 住宅機構RMBS	0.3500	85,370	79,308	2055/10/10
162 住宅機構RMBS	0.3500	86,356	80,181	2055/11/10
164 住宅機構RMBS	0.3300	87,499	80,945	2056/01/10
170 住宅機構RMBS	0.3600	88,615	82,181	2056/07/10
189 住宅機構RMBS	1.0100	95,557	94,534	2058/02/10
191 住宅機構RMBS	0.9500	289,728	286,280	2058/04/10
小計		1,057,544	1,007,012	
普通社債券				
64 アイフル	0.9700	200,000	200,315	2024/06/14
5 サントリー食品	0.0010	100,000	100,060	2024/07/08
12 三菱UFJFG FR	0.5210	200,000	199,947	2025/06/09
32 沖縄電力	0.2200	100,000	100,057	2025/10/24
43 日本郵船	0.2600	100,000	99,303	2026/07/29
23 ポケツトカード	0.2000	200,000	197,879	2026/12/03
65 西日本高速道	0.1000	200,000	198,868	2026/12/18
67 アイフル	0.9000	200,000	199,941	2027/01/26
511 九州電力	0.5100	100,000	100,449	2027/02/25
9 三菱UFJFG FR	0.7700	100,000	99,760	2027/03/05
49 東京電力PG	0.6000	200,000	199,930	2027/04/26

第 1 期 末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
14 LIXIL	0.4750	100,000	99,922	2027/08/27
16 長谷工コーポ	0.3000	100,000	99,120	2027/11/26
38 ソニーG	0.4500	100,000	99,677	2027/12/08
31 いすゞ自動車	0.2700	100,000	98,507	2028/02/04
84 電源開発	0.7540	100,000	100,854	2028/02/18
114 丸紅	0.6140	100,000	100,257	2028/02/24
17 みずほリース	0.7640	300,000	301,937	2028/03/01
18 長谷工コーポ	0.5690	100,000	99,971	2028/03/15
99 中日本高速道	0.4400	100,000	99,977	2028/03/28
16 クボタ	0.4790	100,000	99,836	2028/04/20
1 SOMPOHD	0.4790	400,000	397,702	2028/04/27
103 東日本高速道	0.4340	200,000	199,782	2028/04/28
142 三菱地所	0.4300	200,000	199,405	2028/05/02
29 東急不動産HD	0.4500	100,000	99,177	2028/06/01
37サツポロホールデイング	0.4500	200,000	198,071	2028/06/06
82 三井不動産	0.3600	200,000	198,510	2028/06/06
95 クレデイセゾン	0.4400	200,000	198,224	2028/06/09
213 オリツクス	0.4250	200,000	198,167	2028/06/13
81 ホンダフアイナンス	0.3890	100,000	99,531	2028/06/20
34 沖縄電力	0.3650	200,000	198,641	2028/06/23
10 エア・ウオーター	0.4050	100,000	99,141	2028/07/21
34 東京センチユリー	0.2200	100,000	97,994	2028/07/21
14 西松建設	0.6000	200,000	198,878	2028/07/27
112 住友不動産	0.4900	400,000	398,552	2028/08/09
28 NTTフアイナンス	0.6140	500,000	500,632	2028/09/20
41 大和証券G本社	0.8580	100,000	100,152	2028/11/28
220 オリツクス	0.7230	700,000	700,520	2028/11/29
19 長谷工コーポ	0.8470	100,000	100,776	2028/12/14
85 ホンダフアイナンス	0.6580	700,000	703,700	2028/12/20
115 住友不動産	0.6280	700,000	700,631	2028/12/21
44 丸井グループ	0.6290	100,000	99,590	2029/01/23
99 クレデイセゾン	0.6290	300,000	299,956	2029/01/31
10 三菱UFJFG FR	1.0290	200,000	199,218	2029/03/07
513 東北電力	0.3100	111,000	108,648	2029/10/25
21 アサヒグループHD	0.8700	100,000	100,983	2030/03/08
521 東北電力	0.4500	200,000	196,620	2030/05/24
2 JERA	0.3900	500,000	483,127	2030/10/25
45 丸井グループ	0.8970	300,000	297,982	2031/01/23
61 東京電力PG	1.6000	200,000	205,455	2033/01/19
143 三菱地所	0.9000	200,000	197,965	2033/05/02
448 中国電力	0.9200	300,000	296,677	2033/05/25
516 九州電力	0.9200	100,000	98,892	2033/05/25
385 北海道電力	1.0300	500,000	498,453	2033/05/25
12 日本航空	1.2000	200,000	198,066	2033/06/17
26 NTTフアイナンス	0.8380	300,000	294,162	2033/06/20
34 東京建物	0.8800	100,000	96,567	2033/07/06
30 NTTフアイナンス	1.2130	500,000	505,850	2033/09/20
14野村総合研究所	1.2230	200,000	201,957	2033/12/07
32 レンゴー	1.3440	300,000	300,683	2033/12/13
23 日立製作所	1.1840	400,000	398,628	2033/12/14
2 ヒユーリツク劣後FR	1.2800	500,000	501,442	2055/07/02
1 東北電力劣後FR	1.5450	500,000	508,204	2057/09/14
1 JERA 劣後FR	2.1440	100,000	103,160	2057/12/25
1 横浜冷凍劣後FR	0.7600	100,000	96,337	2058/09/27
1 武田薬品劣後FR	1.7200	200,000	201,146	2079/06/06
2 東京センチユリー劣FR	1.3800	400,000	400,123	2080/07/30
1アサヒグループHD劣FR	0.9700	200,000	199,938	2080/10/15
5 三菱地所劣後FR	0.6600	100,000	99,673	2081/02/03
7 三菱商事劣後FR	0.5100	200,000	197,046	2081/09/13
4 損保ジヤパン劣FR	2.5000	100,000	101,481	2083/02/13
15三井住友FG劣FR	1.8440	400,000	400,588	－(※)
小計		16,411,000	16,373,402	
合計		75,083,544	72,923,425	

※償還年月日欄に(※)の記載がある銘柄は永久劣後債であり、償還期限の定めがありません。一定の場合を除いて償還されずに利払いが継続される債券のことをいいます。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

第 1 期 末			
銘柄別		買建額(百万円)	売建額(百万円)
国内	長期国債	9,653	－

組入投資信託証券の内容

■グローバル株式コンセントレイト･ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	モルガン･スタンレー･インベストメント･マネジメント株式会社
主な投資対象･投資地域	日本を含む世界各国の株式
運用の基本方針等	主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行うことを基本とします。

●損益の状況

項目	第4期 自 2023年4月18日 至 2024年4月15日
(A)配当等収益	△20円
支払利息	△20
(B)有価証券売買損益	5,389,146,901
売買益	5,826,329,000
売買損	△437,182,099
(C)信託報酬等	△227,295,921
(D)当期損益金(A+B+C)	5,161,850,960
(E)前期繰越損益金	4,648,720,935
(F)追加信託差損益金	8,458,349,334
(配当等相当額)	(5,274,743,638)
(売買損益相当額)	(3,183,605,696)
(G)計 (D+E+F)	18,268,921,229
(H)収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	18,268,921,229
追加信託差損益金	8,458,349,334
(配当等相当額)	(5,287,970,214)
(売買損益相当額)	(3,170,379,120)
分配準備積立金	9,810,571,895

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第3期末	第4期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
グローバル･フランチャイズ･マザーファンドⅢ	9,373,802	15,027,913	33,797,776

下記は、グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ全体の内容です。

＜外国株式＞

銘柄		第3期末	第4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		
ABBOTT LABORATORIES		421	669	7,309	1,121,732	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON AND CO		164	324	7,619	1,169,361	ヘルスケア機器・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO		112	162	3,227	495,217	商業・専門サービス
COCA-COLA CO		351	1,089	6,346	973,972	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A		－	181	4,748	728,726	食品・飲料・タバコ
DANAHER CORP		249	237	5,706	875,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EQUIFAX INC		117	186	4,616	708,408	商業・専門サービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC		－	42	1,822	279,631	金融サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO		59	178	4,192	643,439	保険
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN		454	725	9,687	1,486,677	金融サービス
MOODY'S CORP		52	83	3,162	485,373	金融サービス
NIKE INC-CL B		101	－	－	－	耐久消費財・アパレル
OTIS WORLDWIDE CORP		260	415	3,991	612,551	資本財
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		888	512	4,554	698,953	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO		231	367	5,715	877,080	家庭用品・パーソナル用品
ROPER TECHNOLOGIES INC		67	107	5,784	887,738	ソフトウェア・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		99	141	7,974	1,223,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNITEDHEALTH GROUP INC		－	166	7,295	1,119,642	ヘルスケア機器・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES		311	476	13,153	2,018,556	金融サービス
ZOETIS INC		79	115	1,735	266,317	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCENTURE PLC-CL A		212	372	11,741	1,801,834	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC		80	131	2,687	412,423	ヘルスケア機器・サービス
AON PLC-CLASS A		92	229	7,082	1,086,827	保険
AUTOMATIC DATA PROCESSING		138	243	5,927	909,709	商業・専門サービス
CDW CORP		97	180	4,387	673,259	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		－	66	1,108	170,158	金融サービス
HOLOGIC INC		－	224	1,739	266,949	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP		417	440	18,564	2,848,899	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	5,065	8,073	161,886	24,843,050	
	銘柄数＜比率＞	23	27	－	＜73.5%＞	
（ドイツ）				千ユーロ		
SAP SE		582	775	13,258	2,166,413	ソフトウェア・サービス
国小計	株数・金額	582	775	13,258	2,166,413	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜6.4%＞	
（フランス）						
L'OREAL		63	92	3,847	628,663	家庭用品・パーソナル用品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON		31	39	3,097	506,124	耐久消費財・アパレル
PERNOD RICARD SA		173	311	4,403	719,526	食品・飲料・タバコ
国小計	株数・金額	269	444	11,348	1,854,314	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜5.5%＞	

銘柄		第3期末	第4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）	
（オランダ）						
HEINEKEN NV		305	400	3,523	575,771	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		674	608	541	88,438	食品・飲料・タバコ
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		－	597	1,614	263,876	メディア・娯楽
国小計	株数・金額	980	1,605	5,679	928,086	
	銘柄数<比率>	2	3	－	<2.7%>	
（その他）						
RELX PLC		254	413	1,617	264,261	商業・専門サービス
国小計	株数・金額	254	413	1,617	264,261	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.8%>	
ユーロ計	株数・金額	2,086	3,238	31,903	5,213,076	
	銘柄数<比率>	7	8	－	<15.4%>	
（イギリス）				千英ポンド		
EXPERIAN PLC		512	864	2,863	547,336	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		984	1,166	4,898	936,292	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		975	1,586	5,295	1,012,308	商業・専門サービス
HALEON PLC		－	6,687	2,159	412,797	家庭用品・パーソナル用品
小計	株数・金額	2,473	10,305	15,217	2,908,734	
	銘柄数<比率>	3	4	－	<8.6%>	
合計	株数・金額	9,626	21,617	－	32,964,861	
	銘柄数<比率>	33	39	－	<97.5%>	

(注1)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■ブランディワイン･グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン･テンプルトン･ジャパン株式会社
主な投資対象･投資地域	日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券
運用の基本方針等	この投資信託は、MSCIオール･カントリー･ワールド･インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。

●損益の状況

項目	第2期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日
(A)有価証券売買損益	**3,598,323,657円**
売買益	3,650,133,113
売買損	△51,809,456
(B)信託報酬等	**△124,106,900**
(C)当期損益金(A+B)	**3,474,216,757**
(D)前期繰越損益金	**993,002,178**
(E)追加信託差損益金	**2,132,041,565**
(配当等相当額)	(555,629,583)
(売買損益相当額)	(1,576,411,982)
(F)計(C+D+E)	**6,599,260,500**
(G)収益分配金	**0**
次期繰越損益金(F+G)	**6,599,260,500**
追加信託差損益金	2,132,041,565
(配当等相当額)	(561,253,254)
(売買損益相当額)	(1,570,788,311)
分配準備積立金	4,467,218,935

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第1期末	第2期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ブランディワイン･グローバル･オポチュニスティック株式･マザーファンド	14,312,328	20,176,569	27,056,780

下記は、ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド全体の内容です。

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	第1期末	第2期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
食料品(－%)			
森永製菓	30.1	－	－
医薬品(8.6%)			
小野薬品工業	63.5	70.7	207,681
金属製品(－%)			
三和ホールディングス	124.6	－	－
機械(10.2%)			
ナブテスコ	－	89.5	246,975
電気機器(16.1%)			
村田製作所	30.6	21.3	175,597
小糸製作所	37.4	90.2	215,081
輸送用機器(－%)			
ヤマハ発動機	93.8	－	－
倉庫・運輸関連業(4.2%)			
上組	57.5	31.8	102,523
情報・通信業(17.1%)			
日本電信電話	－	2,317.4	415,046
卸売業(11.0%)			
メディパルホールディングス	－	99.4	265,497
小売業(32.8%)			
ネクステージ	－	119.5	256,686
しまむら	－	24.4	371,734
イズミ	32.5	41.3	165,530
合計 株数・金額	470	2,905	2,422,352
合計 銘柄数＜比率＞	8	10	＜8.9%＞

(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。

＜外国株式＞

銘柄	第1期末	第2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)			千ドル		
ALASKA AIR GROUP INC	255	－	－	－	運輸
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	343	575	5,062	747,333	一般消費財・サービス流通・小売り
ALLSTATE CORP	－	214	2,365	349,234	保険
ALPHABET INC-CL A	－	168	2,332	344,324	メディア・娯楽
BAIDU INC - SPON ADR	187	386	5,303	782,854	メディア・娯楽
BANCO DE CHILE-ADR	677	602	1,257	185,611	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	－	709	2,775	409,754	ヘルスケア機器・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	49	57	2,110	311,509	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	6	－	－	－	消費者サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	231	275	1,640	242,205	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CVS HEALTH CORP	261	678	4,748	701,002	ヘルスケア機器・サービス
CITIGROUP INC	274	642	2,772	409,228	銀行
CONOCOPHILLIPS	78	201	2,509	370,422	エネルギー
CROWN HOLDINGS INC	125	239	2,201	325,018	素材
DR HORTON INC	171	－	－	－	耐久消費財・アパレル
DELTA AIR LINES INC	－	907	3,567	526,594	運輸
WALT DISNEY CO/THE	156	300	2,536	374,427	メディア・娯楽
EXELIXIS INC	－	458	1,019	150,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-A	117	－	－	－	メディア・娯楽
FEDEX CORP	94	101	2,608	385,043	運輸

銘柄		第1期末	第2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）	
GENERAL MOTORS CO		304	591	1,991	294,009	自動車・自動車部品
GLOBAL PAYMENTS INC		224	371	4,668	689,128	金融サービス
JPMORGAN CHASE & CO		79	—	—	—	銀行
KROGER CO		—	755	3,457	510,343	生活必需品流通・小売り
MICRON TECHNOLOGY INC		—	476	3,417	504,447	半導体・半導体製造装置
NETEASE INC-ADR		193	—	—	—	メディア・娯楽
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		—	2,725	3,238	478,048	銀行
NEWMONT CORP		275	—	—	—	素材
PFIZER INC		118	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PULTEGROUP INC		197	—	—	—	耐久消費財・アパレル
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		121	—	—	—	保険
SCHWAB (CHARLES) CORP		282	349	2,088	308,347	金融サービス
T-MOBILE US INC		156	242	3,467	511,937	電気通信サービス
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR		195	361	3,307	488,180	半導体・半導体製造装置
TARGET CORP		—	136	1,696	250,492	生活必需品流通・小売り
TERADYNE INC		165	255	2,506	369,966	半導体・半導体製造装置
TRIP.COM GROUP LTD-ADR		—	663	2,362	348,816	消費者サービス
TYSON FOODS INC-CL A		—	410	2,212	326,588	食品・飲料・タバコ
VIATRIS INC		885	1,212	1,191	175,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WAYFAIR INC- CLASS A		217	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
WELLS FARGO & CO		567	796	3,428	506,172	銀行
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		82	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC		186	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		79	79	1,062	156,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC		200	348	2,856	421,720	ヘルスケア機器・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC		80	107	2,210	326,258	保険
AERCAP HOLDINGS NV		308	554	3,412	503,701	資本財
小計	株数・金額	7,949	16,955	93,388	13,786,055	
	銘柄数<比率>	36	34	—	<50.6%>	
(カナダ)				千カナダドル		
BARRICK GOLD CORP		563	—	—	—	素材
CANADIAN NATURAL RESOURCES		138	572	5,008	547,203	エネルギー
MTY FOOD GROUP INC		355	276	1,692	184,928	消費者サービス
ALAMOS GOLD INC-CLASS A		1,310	—	—	—	素材
小計	株数・金額	2,367	848	6,701	732,131	
	銘柄数<比率>	4	2	—	<2.7%>	
(メキシコ)				千メキシカンペソ		
QUALITAS CONTROLADORA SAB CV		2,435	—	—	—	保険
小計	株数・金額	2,435	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>	
(ブラジル)				千ブラジルレアル		
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF		1,982	4,880	13,490	408,330	銀行
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS		—	4,528	11,854	358,807	不動産管理・開発

銘柄		第1期末	第2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）	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA		3,943	－	－	－	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	5,925	9,408	25,344	767,137	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<2.8%>	
(チリ)				千チリアンペソ		
BANCO DE CHILE		－	65,556	609,015	100,859	銀行
小計	株数・金額	－	65,556	609,015	100,859	
	銘柄数<比率>	－	1	－	<0.4%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
DHL GROUP		－	512	2,141	336,187	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,442	1,749	3,626	569,374	電気通信サービス
国小計	株数・金額	1,442	2,261	5,767	905,561	
	銘柄数<比率>	1	2	－	<3.3%>	
(フランス)						
SEB SA		95	162	1,512	237,449	耐久消費財・アパレル
KERING		36	50	2,334	366,612	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA		221	－	－	－	消費者サービス
CREDIT AGRICOLE SA		1,059	－	－	－	銀行
BNP PARIBAS		706	835	5,124	804,616	銀行
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		590	830	4,699	737,930	資本財
国小計	株数・金額	2,710	1,880	13,671	2,146,608	
	銘柄数<比率>	6	4	－	<7.9%>	
(オランダ)						
KONINKLIJKE PHILIPS NV		－	1,076	2,147	337,196	ヘルスケア機器・サービス
AALBERTS NV		－	321	1,165	183,025	資本財
国小計	株数・金額	－	1,397	3,313	520,222	
	銘柄数<比率>	－	2	－	<1.9%>	
(スペイン)						
BANCO SANTANDER SA		10,076	11,250	3,966	622,769	銀行
国小計	株数・金額	10,076	11,250	3,966	622,769	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<2.3%>	
ユーロ計	株数・金額	14,229	16,790	26,719	4,195,162	
	銘柄数<比率>	8	9	－	<15.4%>	
(イギリス)				千ポンド		
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		1,797	2,386	1,076	197,128	耐久消費財・アパレル
BELLWAY PLC		545	－	－	－	耐久消費財・アパレル
BP PLC		－	6,602	3,460	633,822	エネルギー
TESCO PLC		4,117	9,830	2,623	480,619	生活必需品流通・小売り
HALEON PLC		3,646	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品
GSK PLC		1,065	1,977	2,940	538,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	11,172	20,795	10,100	1,850,168	
	銘柄数<比率>	5	4	－	<6.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
NESTLE SA-REG		189	258	2,717	447,698	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	189	258	2,717	447,698	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<1.6%>	

銘柄		第1期末	第2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）	
（スウェーデン）				千スウェーデンクローナ		
AUTOLIV INC-SWED DEP RECEIPT		272	233	24,712	326,455	自動車・自動車部品
HUSQVARNA AB-B SHS		3,038	3,106	26,696	352,659	資本財
小計	株数・金額	3,310	3,339	51,409	679,115	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<2.5%>	
（ノルウェー）				千ノルウェークローネ		
SUBSEA 7 SA		1,485	782	11,229	154,411	エネルギー
DNB BANK ASA		－	973	21,216	291,725	銀行
小計	株数・金額	1,485	1,755	32,446	446,137	
	銘柄数<比率>	1	2	－	<1.6%>	
（ポーランド）				千ポーランドズロチ		
DINO POLSKA SA		149	－	－	－	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	149	－	－	－	
	銘柄数<比率>	1	－	－	<－%>	
（韓国）				千韓国ウォン		
HYUNDAI MOTOR CO		－	136	2,593,520	288,399	自動車・自動車部品
LG CORP		484	669	5,691,940	632,943	資本財
NICE HOLDINGS CO LTD		302	－	－	－	金融サービス
小計	株数・金額	787	805	8,285,460	921,343	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<3.4%>	
（南アフリカ）				千ランド		
AVI LTD		1,971	－	－	－	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	1,971	－	－	－	
	銘柄数<比率>	1	－	－	<－%>	
合計	株数・金額	51,973	136,515	－	23,925,809	
	銘柄数<比率>	64	59	－	<87.8%>	

(注1)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■ニッセイ／サンダース･グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
主な投資対象･投資地域	日本を除く世界各国の株式等
運用の基本方針等	MSCI KOKUSAI Index(円換算ベース･配当込･税引後)をベンチマークとし、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。

●損益の状況

項目	第2期 自 2023年3月7日 至 2024年3月5日
(A)配当等収益	**△49,914円**
受取利息	4,424
支払利息	△54,338
(B)有価証券売買損益	**20,090,405,841**
売買益	20,625,252,037
売買損	△534,846,196
(C)信託報酬等	**△474,171,941**
(D)当期損益金(A+B+C)	**19,616,183,986**
(E)前期繰越損益金	**4,614,626,661**
(分配準備積立金)	(4,614,641,461)
(繰越欠損金)	(△14,800)
(F)追加信託差損益金	**7,922,011,881**
(配当等相当額)	(3,113,029,679)
(売買損益相当額)	(4,808,982,202)
(G)合計(D+E+F)	**32,152,822,528**
次期繰越損益金(G)	**32,152,822,528**
追加信託差損益金	7,922,011,881
(配当等相当額)	(3,113,029,679)
(売買損益相当額)	(4,808,982,202)
分配準備積立金	24,230,860,561
繰越欠損金	△49,914

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第1期末	第2期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式マザーファンド	32,040,481	49,863,286	82,758,097

下記は、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式マザーファンド全体の内容です。

＜外国株式＞

銘柄		第1期末	第2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		
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		－	1,038	7,474	1,124,352	一般消費財・サービス流通・小売り
ALPHABET INC-CL C		1,360	1,733	23,266	3,499,709	メディア・娯楽
APPLE INC		689	1,075	18,823	2,831,393	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC		12	－	－	－	半導体・半導体製造装置
ASTRAZENECA PLC-SPONS ADR		－	1,017	6,591	991,509	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAIDU INC - SPON ADR		20	91	917	138,049	メディア・娯楽
BOOKING HOLDINGS INC		10	17	6,029	906,996	消費者サービス
CITIGROUP INC		503	788	4,427	665,964	銀行
DELTA AIR LINES INC		－	796	3,309	497,754	運輸
DR HORTON INC		164	－	－	－	耐久消費財・アパレル
ELEVANCE HEALTH, INC		171	325	16,396	2,466,398	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP		－	314	8,634	1,298,787	資本財
HALLIBURTON CO		989	1,546	5,438	818,108	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC		385	656	20,619	3,101,562	ヘルスケア機器・サービス
HUMANA INC		－	71	2,494	375,207	ヘルスケア機器・サービス
JOHNSON & JOHNSON		129	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO		394	468	8,736	1,314,162	銀行
KROGER CO		－	1,811	8,941	1,344,950	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP		30	－	－	－	半導体・半導体製造装置
LENNAR CORP-CL A		107	－	－	－	耐久消費財・アパレル
MEDTRONIC PLC		488	761	6,475	974,036	ヘルスケア機器・サービス
META PLATFORMS INC-A		540	780	38,873	5,847,391	メディア・娯楽
MICRON TECHNOLOGY INC		1,629	1,017	9,740	1,465,134	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP		496	769	31,936	4,803,872	ソフトウェア・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP		151	151	6,952	1,045,760	資本財
PEPSICO INC		195	242	4,017	604,361	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO		317	419	6,690	1,006,314	家庭用品・パーソナル用品
RTX CORPORATION		－	642	5,772	868,257	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-GDR 144A		108	176	24,801	3,730,623	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SCHLUMBERGER LTD		－	447	2,210	332,556	エネルギー
SEAGATE TECHNOLOGY		537	982	9,660	1,453,194	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR		1,570	2,525	34,914	5,251,904	半導体・半導体製造装置
THE CIGNA GROUP		317	477	16,088	2,420,097	ヘルスケア機器・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC		210	303	14,614	2,198,260	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO		1,036	1,209	6,747	1,014,948	銀行
小計	株数・金額	12,565	22,655	361,598	54,391,624	
	銘柄数＜比率＞	27	30	－	＜65.3%＞	
（カナダ）				千カナダ・ドル		
SUNCOR ENERGY INC		1,623	3,802	17,679	1,959,043	エネルギー
小計	株数・金額	1,623	3,802	17,679	1,959,043	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜2.4%＞	

銘柄		第1期末	第2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）	
（香港）				千香港ドル		
CHINA CONSTRUCTION BANK-H		18,920	－	－	－	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H		16,300	－	－	－	銀行
小計	株数・金額	35,220	－	－	－	
	銘柄数<比率>	2	－	－	<－>	
（シンガポール）				千シンガポール・ドル		
DBS GROUP HOLDINGS LTD		785	1,228	4,103	459,440	銀行
UNITED OVERSEAS BANK LTD		1,295	2,025	5,700	638,156	銀行
小計	株数・金額	2,080	3,253	9,804	1,097,597	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<1.3%>	
（イギリス）				千イギリス・ポンド		
BAE SYSTEMS PLC		－	1,354	1,706	325,804	資本財
COMPASS GROUP PLC		1,321	2,688	5,820	1,111,406	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC		－	6,208	3,776	721,170	銀行
LLOYDS BANKING GROUP PLC		21,938	45,085	2,132	407,183	銀行
NATWEST GROUP PLC		4,046	13,933	3,459	660,595	銀行
UNILEVER PLC		1,025	1,556	6,010	1,147,707	家庭用品・パーソナル用品
小計	株数・金額	28,330	70,825	22,907	4,373,867	
	銘柄数<比率>	4	6	－	<5.3%>	
（スイス）				千スイス・フラン		
NESTLE SA		411	491	4,518	767,990	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG		632	534	4,816	818,535	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG		227	523	12,217	2,076,398	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONOVA HOLDING AG-REG		－	40	1,128	191,790	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	1,270	1,589	22,681	3,854,715	
	銘柄数<比率>	3	4	－	<4.6%>	
（タイ）				千タイ・バーツ		
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN		4,015	6,167	76,470	321,942	銀行
SCB X PCL-FOREIGN		4,760	7,701	86,636	364,738	銀行
小計	株数・金額	8,775	13,868	163,107	686,680	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<0.8%>	
（オランダ）				千ユーロ		
AIRBUS SE		220	343	5,339	871,740	資本財
HEINEKEN NV		417	626	5,428	886,339	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA		6,402	10,628	13,854	2,262,101	銀行
国小計	株数・金額	7,039	11,597	24,622	4,020,181	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<4.8%>	
（フランス）						
BNP PARIBAS		1,463	2,288	13,103	2,139,388	銀行
ESSILORLUXOTTICA		－	83	1,661	271,257	ヘルスケア機器・サービス
PERNOD-RICARD		－	289	4,477	731,114	食品・飲料・タバコ
PUBLICIS GROUPE		－	325	3,163	516,557	メディア・娯楽
国小計	株数・金額	1,463	2,986	22,406	3,658,316	
	銘柄数<比率>	1	4	－	<4.4%>	

銘柄		第1期末	第2期末			業種
		株数（百株）	株数（百株）	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額（千円）	
（ドイツ）						
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		978	828	9,111	1,487,616	自動車・自動車部品
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		1,421	1,962	8,403	1,371,997	資本財
MERCEDES-BENZ GROUP AG		1,629	750	5,533	903,494	自動車・自動車部品
SIEMENS AG		195	304	5,517	900,784	資本財
国小計	株数・金額	4,223	3,845	28,565	4,663,893	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<5.6%>	
ユーロ計	株数・金額	12,726	18,430	75,594	12,342,391	
	銘柄数<比率>	8	11	－	<14.8%>	
合計	株数・金額	102,590	134,423	－	78,705,919	
	銘柄数<比率>	49	56	－	<94.6%>	

(注1)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託証券＞

銘柄		第1期末	第2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	
SPDR S&P 500 ETF TRUST		18	22	11,542	1,736,165
合計	口数・金額	18	22	－	1,736,165
	銘柄数<比率>	1	1	－	<2.1%>

(注1)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■世界エクイティ･ファンド(適格機関投資家向け)

●ファンドの概要

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
主な投資対象･投資地域	日本を含む世界の金融商品取引所上場株式(預託証券を含みます。)
運用の基本方針等	主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式(預託証券を含みます。)に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

●損益の状況

項目	第1期 自 2022年12月16日 至 2023年 5月22日
(A)配当等収益	△7,853円
受取利息	62
支払利息	△7,915
(B)有価証券売買損益	1,247,347,958
売買益	1,250,982,428
売買損	△3,634,470
(C)信託報酬等	△36,063,226
(D)当期損益金(A+B+C)	1,211,276,879
(E)追加信託差損益金	346,634,541
(配当等相当額)	(△993)
(売買損益相当額)	(346,635,534)
(F)計 (D+E)	1,557,911,420
(G)収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	1,557,911,420
追加信託差損益金	346,634,541
(配当等相当額)	(7,184,236)
(売買損益相当額)	(339,450,305)
分配準備積立金	1,211,276,879

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第1期末	
	口数	評価額
	千口	千円
世界エクイティ・マザーファンド	15,252,037	16,855,026

下記は、世界エクイティ・マザーファンド全体の内容です。

＜外国株式＞

銘柄		第1期末 株数（百株）	第1期末 評価額 外貨建金額	第1期末 評価額 邦貨換算金額（千円）	業種
(アメリカ)			千ドル		
ABBOTT LABORATORIES		265	2,895	398,778	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A		108	3,142	432,802	ソフトウェア・サービス
CHAMPIONX CORP		565	1,536	211,662	エネルギー
BOX INC - CLASS A		929	2,557	352,256	ソフトウェア・サービス
CARLISLE COS INC		67	1,440	198,447	資本財
CHART INDUSTRIES INC		120	1,387	191,145	資本財
COCA-COLA CO/THE		517	3,250	447,694	食品・飲料・タバコ
DANAHER CORP		120	2,742	377,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO		47	1,713	236,021	資本財
ENCOMPASS HEALTH CORP		463	2,862	394,216	ヘルスケア機器・サービス
HDFC BANK LTD-ADR		578	3,849	530,117	銀行
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		300	3,251	447,765	金融サービス
KBR INC		597	3,516	484,354	商業・専門サービス
LINDE PLC		102	3,803	523,792	素材
PROGRESSIVE CORP		199	2,696	371,395	保険
SCHLUMBERGER LTD		693	3,140	432,449	エネルギー
SONY GROUP CORP - SP ADR		310	3,041	418,867	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR		356	3,301	454,732	半導体・半導体製造装置
TENET HEALTHCARE CORP		330	2,412	332,195	ヘルスケア機器・サービス
TRANSUNION		252	1,782	245,456	商業・専門サービス
ELEVANCE HEALTH INC		55	2,547	350,823	ヘルスケア機器・サービス
ADAPTHEALTH CORP		1,317	1,455	200,383	ヘルスケア機器・サービス
MASIMO CORP		139	2,283	314,466	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP		265	8,452	1,164,043	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC		29	2,847	392,175	一般消費財・サービス流通・小売り
PALOMAR HOLDINGS INC		356	1,864	256,768	保険
BOOKING HOLDINGS INC		13	3,669	505,363	消費者サービス
BIO-TECHNE CORP		263	2,208	304,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRACTOR SUPPLY COMPANY		124	2,793	384,714	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額	9,494	82,448	11,354,814	
	銘柄数<比率>	29	—	<67.4%>	
(フランス)			千ユーロ		
SCHNEIDER ELECTRIC SE		155	2,556	380,880	資本財
国小計	株数・金額	155	2,556	380,880	
	銘柄数<比率>	1	—	<2.3%>	
(オランダ)					
KONINKLIJKE PHILIPS NV		769	1,453	216,643	ヘルスケア機器・サービス
国小計	株数・金額	769	1,453	216,643	
	銘柄数<比率>	1	—	<1.3%>	
(スペイン)					
AMADEUS IT GROUP SA		476	3,223	480,308	消費者サービス
国小計	株数・金額	476	3,223	480,308	
	銘柄数<比率>	1	—	<2.8%>	
ユーロ計	株数・金額	1,400	7,233	1,077,833	
	銘柄数<比率>	3	—	<6.4%>	

銘柄		第1期末 株数(百株)	第1期末 評価額 外貨建金額	第1期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	業種
(イギリス)			千ポンド		
COMPASS GROUP PLC		1,693	3,786	650,063	消費者サービス
DIAGEO PLC		760	2,699	463,503	食品・飲料・タバコ
HALEON PLC		8,880	3,019	518,483	家庭用品・パーソナル用品
RENTOKIL INITIAL PLC		3,645	2,325	399,339	商業・専門サービス
小計	株数・金額	14,980	11,831	2,031,390	
	銘柄数<比率>	4	—	<12.1%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
HEXAGON AB-B SHS		2,278	27,463	360,042	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小計	株数・金額	2,278	27,463	360,042	
	銘柄数<比率>	1	—	<2.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
WORLEY LTD		3,119	5,132	470,917	資本財
小計	株数・金額	3,119	5,132	470,917	
	銘柄数<比率>	1	—	<2.8%>	
(香港)			千ホンコンドル		
AIA GROUP LTD		2,832	22,344	393,486	保険
SAMSONITE INTERNATIONAL SA		10,473	23,250	409,433	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	13,305	45,594	802,919	
	銘柄数<比率>	2	—	<4.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
DBS GROUP HOLDINGS LTD		924	2,848	291,962	銀行
小計	株数・金額	924	2,848	291,962	
	銘柄数<比率>	1	—	<1.7%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア		
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT		70,694	35,877,205	333,658	銀行
小計	株数・金額	70,694	35,877,205	333,658	
	銘柄数<比率>	1	—	<2.0%>	
合計	株数・金額	116,196	—	16,723,538	
	銘柄数<比率>	42	—	<99.2%>	

(注1)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

●ファンドの概要

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
主な投資対象・投資地域	世界各国の株式
運用の基本方針等	主として世界各国の金融商品取引所(これに準ずるものを含みます。)に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「Capital International Fund Audited Annual Report 2023 For the year ended 31 December 2023」の情報を基に掲載しています。

Capital Group New Economy Fund (LUX)

●損益の状況(2023年12月31日までの会計期間)

	Capital Group New Economy Fund (LUX)
Income	
Interest on bonds and convertible bonds (net of withholding taxes)	US$10, 347
Dividend income (net of withholding taxes)	3, 194, 796
Other income	–
Securities lending income	27, 803
Interest on bank accounts	1, 602, 218
Interest on swap contracts	–
	4, 835, 164
Expenses	
Management fees	3, 949, 018
Administrative Manager services	314, 973
Taxe d'abonnement	203, 685
Professional services	162, 367
Depository and custody	116, 288
Interest on swap contracts	–
Other	27, 325
Printing and publishing	16, 919
Overdraft interest*	2, 476
	4, 793, 051
Reimbursement of expenses	136, 764
Net investment income/(loss) for the year (a)	**178, 877**
Net realised gain/(loss) on:	
Sale of investments	(12, 247, 679)
Financial futures contracts	–
Foreign currency transaction	(781, 834)
Swap contracts	–
Net realised gain/(loss) for the year (b)	**(13, 029, 513)**
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) on:	
Investments	129, 127, 891
Capital gain tax on investments	–
Financial futures contracts	–
Swap contracts	–
Foreign currency transactions	739, 575
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) for the year (c)	**129, 867, 466**
Result of operations for the year (a+b+c)	**117, 016, 830**
Dividend distributions	**(11, 220)**
Net subscriptions/(redemptions) of shares for the year	33, 468, 752
Total net assets at the beginning of the year	420, 533, 023
Translation difference	–
Total net assets at the end of the period	**US $ 571, 007, 385**

* Mainly due to negative interest rate policy implemented by central banks.

●投資明細表(2023年12月31日現在)

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing				
Equities				
Belgium				
Argenx SE, ADR	USD	3,070	1,167,920	0.21
			1,167,920	0.21
Brazil				
NU Holdings Ltd. 'A'	USD	461,587	3,845,020	0.67
			3,845,020	0.67
Canada				
Brookfield Corp.	USD	19,562	784,827	0.14
Constellation Software, Inc.	CAD	263	652,071	0.11
Shopify, Inc. 'A'	USD	45,259	3,525,676	0.62
			4,962,574	0.87
China				
Shenzhen Inovance Technology Co. Ltd. 'A'	CNY	36,100	321,086	0.06
WuXi AppTec Co. Ltd., Reg. S 'H'	HKD	196,112	2,005,208	0.35
Wuxi Biologics Cayman, Inc., Reg. S	HKD	272,000	1,027,478	0.18
			3,353,772	0.59
Denmark				
Novo Nordisk A/S 'B'	DKK	76,946	7,958,897	1.39
			7,958,897	1.39
Finland				
Neste OYJ	EUR	43,108	1,531,589	0.27
			1,531,589	0.27
France				
Air Liquide SA	EUR	10,658	2,073,314	0.36
EssilorLuxottica SA	EUR	8,281	1,664,446	0.29
Gaztransport Et Technigaz SA	EUR	10,659	1,412,142	0.25
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	5,410	4,388,187	0.77
			9,538,089	1.67
Germany				
Adidas AG	EUR	3,653	742,797	0.13
SAP SE	EUR	14,397	2,214,625	0.39
Siemens AG	EUR	7,732	1,450,292	0.25
			4,407,714	0.77
Hong Kong				
AIA Group Ltd.	HKD	333,600	2,897,451	0.51
			2,897,451	0.51
India				
Bajaj Finserv Ltd.	INR	51,561	1,043,574	0.19
HDFC Bank Ltd., ADR	USD	24,694	1,657,214	0.29
HDFC Bank Ltd.	INR	56,123	1,151,334	0.20
ICICI Bank Ltd.	INR	70,857	847,404	0.15
Jio Financial Services Ltd.	INR	168,885	472,154	0.08
Kotak Mahindra Bank Ltd.	INR	129,603	2,969,608	0.52
Reliance Industries Ltd.	INR	26,137	811,122	0.14
Star Health & Allied Insurance Co. Ltd.	INR	108,467	696,501	0.12
			9,648,911	1.69

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Ireland				
Flutter Entertainment plc	EUR	18,913	3,330,783	0.58
ICON plc	USD	8,280	2,343,820	0.41
Ryanair Holdings plc, ADR	USD	19,034	2,538,374	0.45
			8,212,977	1.44
Israel				
Monday.com Ltd.	USD	4,801	901,676	0.16
			901,676	0.16
Italy				
International Game Technology plc	USD	10,896	298,659	0.05
			298,659	0.05
Japan				
Daiichi Sankyo Co. Ltd.	JPY	24,702	683,858	0.12
GMO Payment Gateway, Inc.	JPY	7,300	504,478	0.09
Hoya Corp.	JPY	2,400	298,486	0.05
Keyence Corp.	JPY	1,800	789,018	0.14
NEC Corp.	JPY	17,700	1,044,457	0.18
Obic Co. Ltd.	JPY	2,000	343,448	0.06
Recruit Holdings Co. Ltd.	JPY	26,000	1,110,026	0.19
Renesas Electronics Corp.	JPY	56,300	1,010,416	0.18
Sony Group Corp.	JPY	3,700	350,592	0.06
			6,134,779	1.07
Korea, Republic Of				
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	5,144	312,857	0.05
SK Hynix, Inc.	KRW	75,624	8,257,020	1.45
			8,569,877	1.50
Netherlands				
Adyen NV, Reg. S	EUR	1,373	1,769,956	0.31
ASML Holding NV	EUR	2,617	1,975,869	0.35
			3,745,825	0.66
Singapore				
Grab Holdings Ltd. 'A'	USD	35,610	120,006	0.02
			120,006	0.02
Spain				
Amadeus IT Group SA 'A'	EUR	32,109	2,302,859	0.40
			2,302,859	0.40
Sweden				
Evolution AB, Reg. S	SEK	23,466	2,808,569	0.49
Nibe Industrier AB 'B'	SEK	145,210	1,026,320	0.18
			3,834,889	0.67
Switzerland				
Bachem Holding AG 'B'	CHF	12,922	1,001,107	0.18
Lonza Group AG	CHF	2,901	1,220,500	0.21
			2,221,607	0.39
Taiwan, Province Of China				
eMemory Technology, Inc.	TWD	20,000	1,585,293	0.28
MediaTek, Inc.	TWD	57,000	1,877,333	0.33
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	USD	65,283	6,789,432	1.19
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	195,000	3,752,869	0.65
			14,004,927	2.45

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
United Kingdom				
AstraZeneca plc	GBP	11,925	1,606,099	0.28
Ocado Group plc	GBP	92,021	884,174	0.16
Rentokil Initial plc	GBP	151,472	860,258	0.15
Sage Group plc (The)	GBP	92,364	1,377,844	0.24
Weir Group plc (The)	GBP	54,963	1,319,682	0.23
			6,048,057	1.06
United States of America				
Abbott Laboratories	USD	40,511	4,459,046	0.78
AbbVie, Inc.	USD	10,523	1,630,749	0.29
Accenture plc 'A'	USD	7,987	2,802,718	0.49
Adobe, Inc.	USD	4,112	2,453,219	0.43
AES Corp. (The)	USD	92,142	1,773,733	0.31
Affirm Holdings, Inc.	USD	48,938	2,404,813	0.42
agilon health, Inc.	USD	414,601	5,203,243	0.91
Air Products and Chemicals, Inc.	USD	7,867	2,153,985	0.38
Airbnb, Inc. 'A'	USD	20,157	2,744,174	0.48
Align Technology, Inc.	USD	1,721	471,554	0.08
Alnylam Pharmaceuticals, Inc.	USD	24,753	4,737,972	0.83
Alphabet, Inc. 'A'	USD	63,424	8,859,699	1.55
Alphabet, Inc. 'C'	USD	52,059	7,336,675	1.28
Amazon.com, Inc.	USD	87,449	13,287,001	2.33
Aon plc 'A'	USD	3,710	1,079,684	0.19
Apple, Inc.	USD	34,715	6,683,679	1.17
Applied Materials, Inc.	USD	9,348	1,515,030	0.27
Aptiv plc	USD	5,179	464,660	0.08
Arch Capital Group Ltd.	USD	10,433	774,859	0.14
Arista Networks, Inc.	USD	23,643	5,568,163	0.98
Arthur J Gallagher & Co.	USD	5,459	1,227,620	0.21
Autodesk, Inc.	USD	1,317	320,663	0.06
Baker Hughes Co.	USD	41,918	1,432,757	0.25
Berkshire Hathaway, Inc. 'B'	USD	6,243	2,226,628	0.39
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	USD	3,590	346,148	0.06
Blackstone, Inc. 'A'	USD	8,981	1,175,792	0.21
Block, Inc. 'A'	USD	21,607	1,671,301	0.29
Booking Holdings, Inc.	USD	420	1,489,832	0.26
Broadcom, Inc.	USD	30,657	34,220,876	5.99
Carrier Global Corp.	USD	31,573	1,813,869	0.32
Catalent, Inc.	USD	73,591	3,306,444	0.58
Cava Group, Inc.	USD	4,535	194,914	0.03
Centene Corp.	USD	11,858	879,982	0.15
Ceridian HCM Holding, Inc.	USD	100,548	6,748,782	1.18
Charter Communications, Inc. 'A'	USD	2,527	982,194	0.17
Chipotle Mexican Grill, Inc.	USD	1,550	3,544,788	0.62
Cloudflare, Inc. 'A'	USD	11,342	944,335	0.17
CME Group, Inc.	USD	5,368	1,130,501	0.20
Comcast Corp. 'A'	USD	19,915	873,273	0.15
Copart, Inc.	USD	50,138	2,456,762	0.43
Corebridge Financial, Inc.	USD	33,907	734,426	0.13
Corteva, Inc.	USD	21,148	1,013,412	0.18
Costco Wholesale Corp.	USD	1,712	1,130,057	0.20
CSX Corp.	USD	35,041	1,214,871	0.21

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Datadog, Inc. 'A'	USD	6,205	753,163	0.13
Dexcom, Inc.	USD	16,256	2,017,207	0.35
Discover Financial Services	USD	14,911	1,675,996	0.29
Dollar General Corp.	USD	11,829	1,608,153	0.28
Dollar Tree, Inc.	USD	14,461	2,054,185	0.36
DoorDash, Inc. 'A'	USD	3,812	376,969	0.07
DoubleVerify Holdings, Inc.	USD	26,803	985,814	0.17
Eli Lilly & Co.	USD	17,714	10,325,845	1.81
EPAM Systems, Inc.	USD	7,071	2,102,491	0.37
Equinix, Inc., REIT	USD	320	257,725	0.05
Exact Sciences Corp.	USD	26,393	1,952,554	0.34
Fiserv, Inc.	USD	35,045	4,655,378	0.82
Floor & Decor Holdings, Inc. 'A'	USD	25,628	2,859,060	0.50
GE HealthCare Technologies, Inc.	USD	23,256	1,798,154	0.31
Generac Holdings, Inc.	USD	7,616	984,292	0.17
Gilead Sciences, Inc.	USD	10,761	871,749	0.15
Globant SA	USD	3,820	909,084	0.16
Halliburton Co.	USD	75,834	2,741,399	0.48
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	USD	14,078	2,563,463	0.45
Home Depot, Inc. (The)	USD	6,232	2,159,700	0.38
HubSpot, Inc.	USD	1,133	657,752	0.12
Humana, Inc.	USD	4,620	2,115,082	0.37
Illumina, Inc.	USD	5,850	814,554	0.14
Insight Enterprises, Inc.	USD	21,548	3,818,090	0.67
Insulet Corp.	USD	17,033	3,695,820	0.65
Intercontinental Exchange, Inc.	USD	9,378	1,204,417	0.21
IQVIA Holdings, Inc.	USD	3,221	745,275	0.13
iRhythm Technologies, Inc.	USD	14,985	1,603,994	0.28
Janus Henderson Group plc	USD	22,271	671,471	0.12
JPMorgan Chase & Co.	USD	5,657	962,256	0.17
KKR & Co., Inc.	USD	51,716	4,284,671	0.75
Klaviyo, Inc. 'A'	USD	12,683	352,334	0.06
Kroger Co. (The)	USD	30,619	1,399,594	0.24
Light & Wonder, Inc.	USD	5,623	461,704	0.08
Linde plc	USD	5,356	2,199,763	0.39
Live Nation Entertainment, Inc.	USD	10,127	947,887	0.17
LPL Financial Holdings, Inc.	USD	2,881	655,773	0.11
Maplebear, Inc.	USD	24,005	563,397	0.10
Marsh & McLennan Cos., Inc.	USD	8,608	1,630,958	0.29
Marvell Technology, Inc.	USD	29,724	1,792,654	0.31
Mastercard, Inc. 'A'	USD	23,216	9,901,856	1.73
MercadoLibre, Inc.	USD	5,825	9,154,220	1.60
Meta Platforms, Inc. 'A'	USD	30,329	10,735,253	1.88
Micron Technology, Inc.	USD	99,391	8,482,028	1.49
Microsoft Corp.	USD	96,518	36,294,629	6.36
Molina Healthcare, Inc.	USD	15,889	5,740,855	1.01
MongoDB, Inc.	USD	5,102	2,085,953	0.37
Monster Beverage Corp.	USD	15,950	918,879	0.16
Morgan Stanley	USD	7,790	726,417	0.13
Motorola Solutions, Inc.	USD	13,025	4,077,997	0.71
MSCI, Inc.	USD	1,368	773,809	0.14
Netflix, Inc.	USD	5,664	2,757,688	0.48

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
New York Times Co. (The) 'A'	USD	20,937	1,025,704	0.18
NextEra Energy, Inc.	USD	19,024	1,155,518	0.20
Noble Corp. plc	USD	48,120	2,317,459	0.41
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd.	USD	39,132	784,205	0.14
NVIDIA Corp.	USD	16,080	7,963,138	1.39
Old Dominion Freight Line, Inc.	USD	1,310	530,982	0.09
ON Semiconductor Corp.	USD	9,156	764,801	0.13
O'Reilly Automotive, Inc.	USD	1,136	1,079,291	0.19
Palo Alto Networks, Inc.	USD	11,974	3,530,893	0.62
Penumbra, Inc.	USD	1,255	315,683	0.06
Performance Food Group Co.	USD	30,101	2,081,484	0.36
PG&E Corp.	USD	137,440	2,478,043	0.43
Qorvo, Inc.	USD	3,006	338,506	0.06
Quanta Services, Inc.	USD	10,105	2,180,659	0.38
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	USD	1,695	1,488,702	0.26
RenaissanceRe Holdings Ltd.	USD	16,004	3,136,784	0.55
Revance Therapeutics, Inc.	USD	94,473	830,418	0.15
RingCentral, Inc. 'A'	USD	16,870	572,736	0.10
Saia, Inc.	USD	1,154	505,706	0.09
Salesforce, Inc.	USD	34,025	8,953,338	1.57
Schlumberger NV	USD	30,892	1,607,620	0.28
Seagate Technology Holdings plc	USD	24,969	2,131,604	0.37
ServiceNow, Inc.	USD	5,302	3,745,810	0.66
Smartsheet, Inc. 'A'	USD	46,027	2,201,011	0.39
Snowflake, Inc. 'A'	USD	4,204	836,596	0.15
Stryker Corp.	USD	12,521	3,749,539	0.66
Synopsys, Inc.	USD	2,412	1,241,963	0.22
Take-Two Interactive Software, Inc.	USD	4,764	766,766	0.13
Target Corp.	USD	3,086	439,508	0.08
TE Connectivity Ltd.	USD	5,604	787,362	0.14
TechnipFMC plc	USD	66,571	1,340,740	0.23
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	20,611	10,940,113	1.92
T-Mobile US, Inc.	USD	9,408	1,508,385	0.26
Tractor Supply Co.	USD	5,547	1,192,771	0.21
Tradeweb Markets, Inc. 'A'	USD	5,050	458,944	0.08
TransDigm Group, Inc.	USD	8,488	8,586,461	1.50
Transocean Ltd.	USD	381,525	2,422,684	0.42
Union Pacific Corp.	USD	2,514	617,489	0.11
United Rentals, Inc.	USD	2,986	1,712,232	0.30
UnitedHealth Group, Inc.	USD	27,695	14,580,587	2.55
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	USD	16,977	6,907,771	1.21
Viper Energy, Inc.	USD	69,437	2,178,933	0.38
Visa, Inc. 'A'	USD	23,248	6,052,617	1.06
Warner Music Group Corp. 'A'	USD	27,604	987,947	0.17
Weatherford International plc	USD	15,311	1,497,875	0.26
Wolfspeed, Inc.	USD	43,001	1,870,973	0.33
XPO, Inc.	USD	7,271	636,867	0.11
Yum! Brands, Inc.	USD	9,404	1,228,727	0.22
Zeta Global Holdings Corp. 'A'	USD	46,740	412,247	0.07
Zillow Group, Inc. 'C'	USD	963	55,719	0.01
Zoetis, Inc.	USD	8,523	1,682,184	0.29
			439,778,389	77.02

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Total Equities			**545,486,464**	**95.53**
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			**545,486,464**	**95.53**
Recently issued securities				
Convertible Bonds				
United States of America				
Rivian Automotive, Inc., 144A 4.625% 15/03/2029	USD	162,000	228,258	0.04
Rivian Automotive, Inc., 144A 3.625% 15/10/2030	USD	906,000	1,117,189	0.19
			1,345,447	0.23
Total Convertible Bonds			**1,345,447**	**0.23**
Total Recently issued securities			**1,345,447**	**0.23**
Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings				
Collective Investment Schemes - UCITS				
Luxembourg				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	9,056,153	9,056,153	1.59
			9,056,153	1.59
Total Collective Investment Schemes - UCITS			**9,056,153**	**1.59**
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			**9,056,153**	**1.59**
Total Investments			**555,888,064**	**97.35**
Cash			**14,875,519**	**2.61**
Other assets/(liabilities)			**243,802**	**0.04**
Total net assets			**571,007,385**	**100.00**

組入投資信託証券の内容

■フィデリティ外国債券アクティブ･セレクト･ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フィデリティ投信株式会社
主な投資対象･投資地域	世界各国の投資適格債券(除く日本円)
運用の基本方針等	この投資信託は、世界各国の投資適格債券(除く日本円)を主要な投資対象とし、利息等収入の確保と値上がり益の追求による投資信託財産の長期的な成長を図ることを目的として運用を行ないます。

●損益の状況

項目	第3期 自 2023年5月 2日 至 2024年4月30日
(A)有価証券売買損益	**3,799,258,796円**
売買益	3,874,491,441
売買損	△75,232,645
(B)信託報酬等	**△121,029,722**
(C)当期損益金(A+B)	**3,678,229,074**
(D)前期繰越損益金	**640,703,196**
(E)追加信託差損益金	**2,533,441,047**
(配当等相当額)	(1,224,636,608)
(売買損益相当額)	(1,308,804,439)
(F)合計(C+D+E)	**6,852,373,317**
次期繰越損益金(F)	**6,852,373,317**
追加信託差損益金	2,533,441,047
(配当等相当額)	(1,289,395,803)
(売買損益相当額)	(1,244,045,244)
分配準備積立金	4,318,932,270

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第2期末	第3期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
フィデリティ･外国債券･マザーファンド	5,180,256	12,029,334	39,900,100

下記は、フィデリティ・外国債券・マザーファンド全体の内容です。

＜外国(外貨建)公社債＞

銘柄	第3期末 利率(%)	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額(千円)	償還年月日
(アメリカ)		千アメリカ・ドル	千アメリカ・ドル		
国債証券					
USTN 4.5% 11/30/24	4.5000	7,810	7,771	1,219,384	2024/11/30
USTN 4.25% 03/15/27	4.2500	2,870	2,826	443,404	2027/03/15
USTN 4.875% 10/31/28	4.8750	41,420	41,719	6,545,719	2028/10/31
USTN 4% 01/31/29	4.0000	54,990	53,430	8,383,242	2029/01/31
USTN 4.25% 02/28/29	4.2500	20,000	19,648	3,082,833	2029/02/28
USTN 4% 02/28/30	4.0000	24,650	23,828	3,738,678	2030/02/28
USTN 4% 01/31/31	4.0000	11,420	10,997	1,725,573	2031/01/31
USTN 4.25% 02/28/31	4.2500	24,990	24,423	3,832,082	2031/02/28
USTN 4% 02/15/34	4.0000	90,870	86,481	13,569,008	2034/02/15
USTB 3.375% 08/15/42	3.3750	5,660	4,649	729,518	2042/08/15
USTB 3.875% 02/15/43	3.8750	4,470	3,931	616,901	2043/02/15
USTB 1.875% 11/15/51	1.8750	5,500	3,075	482,509	2051/11/15
USTB 3% 08/15/52	3.0000	3,480	2,532	397,283	2052/08/15
USTB 4% 11/15/52	4.0000	11,155	9,850	1,545,583	2052/11/15
USTB 3.625% 02/15/53	3.6250	13,185	10,857	1,703,616	2053/02/15
USTB 3.625% 05/15/53	3.6250	7,480	6,160	966,528	2053/05/15
USTB 4.125% 08/15/53	4.1250	730	658	103,332	2053/08/15
USTB 4.75% 11/15/53	4.7500	6,240	6,253	981,190	2053/11/15
特殊債券					
KFW (UNGTD) 4% 03/15/29	4.0000	2,278	2,204	345,816	2029/03/15
UMBS 15YR 2.5% 05/39 #TBA	2.5000	12,425	11,068	1,736,715	2039/05/01
GNII II 3% 05/54 #TBA	3.0000	19,850	16,991	2,665,950	2054/05/01
UMBS 30YR 5% 05/54 #TBA	5.0000	5,250	4,999	784,400	2054/05/01
GNII II 2.5% 05/54 #TBA	2.5000	4,650	3,837	602,177	2054/05/01
GNII II 3.5% 05/54 #TBA	3.5000	21,285	18,863	2,959,634	2054/05/01
UMBS 30YR 2% 05/54 #TBA	2.0000	7,450	5,670	889,665	2054/05/01
UMBS 30YR 2.5% 05/54 #TBA	2.5000	11,775	9,385	1,472,640	2054/05/01
UMBS 30YR 3% 05/54 #TBA	3.0000	25,925	21,564	3,383,416	2054/05/01
ELECTRICI 9.125%/VAR PERP 144A	9.1250	771	837	131,353	2049/12/31
社債券					
VENTAS RLTY LDP 3.75% 05/01/24	3.7500	1,025	1,025	160,822	2024/05/01
ENERGY TRAN LP VAR 5/15/24	3.9000	2,550	2,547	399,750	2024/05/15
CARDINAL HEALTH 3.079% 6/15/24	3.0790	1,277	1,272	199,642	2024/06/15
BPCE 4.625% 07/11/24 RGS	4.6250	450	448	70,317	2024/07/11
FISERV INC 2.75% 07/01/24	2.7500	7,995	7,954	1,248,118	2024/07/01
EDP FINANCE 3.625% 7/24 144A	3.6250	775	770	120,949	2024/07/15
CVS HEALTH CORP 2.625% 8/15/24	2.6250	420	416	65,287	2024/08/15
DR HORTON INC 2.5% 10/15/24	2.5000	2,403	2,369	371,774	2024/10/15
ALLEGION US HLD 3.2% 10/01/24	3.2000	3,866	3,817	598,956	2024/10/01
EQUINIX INC 2.625% 11/18/24	2.6250	5,000	4,910	770,402	2024/11/18
GE HEALTHCARE 5.55% 11/15/24	5.5500	3,600	3,592	563,687	2024/11/15
BECTON DICKINS 3.734% 12/15/24	3.7340	4,762	4,701	737,661	2024/12/15
DAIMLER AMR 1.625% 12/24 144A	1.6250	3,800	3,704	581,242	2024/12/13
OWENS CORNING N 4.2% 12/01/24	4.2000	5,487	5,433	852,516	2024/12/01
HCA INC 5.375% 02/01/25	5.3750	2,500	2,489	390,626	2025/02/01
NEXTERA ENE CA 6.051% 03/01/25	6.0510	1,740	1,743	273,557	2025/03/01
WRKCO INC 3.75% 03/15/25	3.7500	2,000	1,965	308,437	2025/03/15
HSBC HLD P 0.976%/VAR 05/24/25	0.9760	1,925	1,918	301,053	2025/05/24
WELLTOWER OP 4% 06/01/25	4.0000	3,428	3,364	527,935	2025/06/01
JPMORGAN CHASE 0.824/VAR 6/25	0.8240	2,350	2,338	366,982	2025/06/01
DCP MIDSTREAM 5.375% 07/15/25	5.3750	695	690	108,377	2025/07/15
MORGAN STANL BK 5.479% 7/16/25	5.4790	580	580	91,054	2025/07/16
DNB B 0.856%/VAR 09/30/25 144A	0.8560	3,185	3,117	489,092	2025/09/30
GE HEALTHCARE 5.6% 11/15/25	5.6000	1,500	1,498	235,147	2025/11/15
STAN 1.822%/VAR 11/23/25 144A	1.8220	1,875	1,828	286,868	2025/11/23
CARRIER GBL 5.8% 11/30/25	5.8000	1,012	1,014	159,179	2025/11/30
SOCGEN 2.226/VAR 01/21/26 144A	2.2260	2,235	2,170	340,530	2026/01/21
SOCGEN SOFR+105 01/21/26 RGS	6.3848	1,000	1,000	156,967	2026/01/21
HCA INC 5.875% 02/15/26	5.8750	675	676	106,065	2026/02/15
MSTDW SOFR+95 02/18/26	6.2946	1,000	1,003	157,383	2026/02/18
DEERECAP FRN 5.145%/VAR 03/03/26	5.9236	3,150	3,165	496,617	2026/03/03
HYUNDAI CAP AMR 5.5% 3/26 REGS	5.5000	500	497	78,002	2026/03/30
LENNAR CORP 5.25% 06/01/26	5.2500	200	198	31,187	2026/06/01
SWEDBANK AB 5.472% 6/15/26 RGS	5.4720	800	797	125,172	2026/06/15
BPCM PARIS 5.896% 7/13/26 144A	5.8960	2,975	2,994	469,802	2026/07/13
AIR LEASE CORP 1.875% 08/15/26	1.8750	1,693	1,553	243,746	2026/08/15
DANSKE 6.259%/VAR 9/22/26 144A	6.2590	1,900	1,909	299,546	2026/09/22
AERCAP IRELAND 2.45% 10/29/26	2.4500	4,050	3,746	587,799	2026/10/29
AIB 7.583%/VAR 10/14/26 144A	7.5830	1,175	1,199	188,188	2026/10/14
WF BA FRN VAR SOFR 12/11/26	6.4154	2,567	2,600	408,042	2026/12/11
WELLS FARGO BA 5.254% 12/11/26	5.2540	3,286	3,274	513,784	2026/12/11
JPMC BANK 5.11% 12/08/26	5.1100	1,844	1,832	287,573	2026/12/08
JPMC BANK FRN VAR 12/08/26	6.3454	2,575	2,607	409,120	2026/12/08
ELI LILLY & CO 4.5% 02/09/27	4.5000	2,600	2,566	402,669	2027/02/09
BRISTOL-MYERS 4.9% 02/22/27	4.9000	1,404	1,394	218,796	2027/02/22
AMER HONDA FIN 4.9% 03/12/27	4.9000	4,167	4,132	648,369	2027/03/12
NORDEA BANK ABP 5% 03/27 144A	5.0000	2,193	2,169	340,461	2027/03/19
STANDARD CHART FRN 7/6/27 144A	7.2847	1,615	1,644	258,030	2027/07/06
LLOYD BK FRN SFRIX+156 8/07/27	6.9051	910	922	144,757	2027/08/07
BANK IRE 2.029/VAR 9/27 144A	2.0290	875	796	124,934	2027/09/30
DBSW SOFR+121.9 11/16/27	6.5634	2,050	2,034	319,187	2027/11/16
DEUTSCHE B 2.311%/VAR 11/16/27	2.3110	1,785	1,625	255,098	2027/11/16
SOCIETE GE 2.797%/VAR 1/19/28 144A	2.7970	1,330	1,221	191,623	2028/01/19
NATIONWIDE B FRN 2/16/28 144A	6.6344	4,925	4,929	773,512	2028/02/16
PFIZER 4.45% 05/19/28	4.4500	790	768	120,583	2028/05/19
HCA INC 5.2% 06/01/28	5.2000	475	467	73,399	2028/06/01
TARGA RES LP/FI 6.875% 1/15/29	6.8750	953	972	152,647	2029/01/15
AERCAP IRELAND 5.1% 01/19/29	5.1000	1,559	1,523	239,110	2029/01/19
US BANCORP DEL 4.653%/VAR 2/29	4.6530	1,431	1,381	216,739	2029/02/01
ELI LILLY & CO 4.5% 02/09/29	4.5000	1,562	1,528	239,786	2029/02/09
IQVIA INC 6.25% 02/01/29	6.2500	875	891	139,805	2029/02/01
HCA INC 3.375% 03/15/29	3.3750	775	699	109,798	2029/03/15
CAMPBELL SOUP C 5.2% 03/21/29	5.2000	507	501	78,687	2029/03/21
BANK IRE GR 5.601/VR 3/30 144A	5.6010	1,667	1,637	256,886	2030/03/20
MSCI INC 3.625% 09/01/30 144A	3.6250	2,530	2,206	346,194	2030/09/01
BAYER US FIN 6.375% 11/30 144A	6.3750	675	679	106,611	2030/11/21

第	3	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)	
AIR LEASE CORP 3.125% 12/01/30	3.1250	225	193	30,371	2030/12/01
HYUNDAI CAP 5.4% 1/8/31 RGS	5.4000	485	475	74,576	2031/01/08
AERCAP IRELAND 3.3% 01/30/32	3.3000	1,125	944	148,196	2032/01/30
ASHTEAD CAPI 5.5% 8/11/32 144A	5.5000	952	915	143,719	2032/08/11
SOCGEN 3.337/VAR 1/21/33 144A	3.3370	2,150	1,766	277,140	2033/01/21
ASHTEAD CAP 5.55% 5/30/33 144A	5.5500	1,164	1,118	175,485	2033/05/30
BARCLAYSPLC 7.437%/VAR 11/33	7.4370	1,480	1,604	251,819	2033/11/02
TOYOTA CREDIT 4.8% 01/05/34	4.8000	1,354	1,292	202,861	2034/01/05
AERCAP IRELAND 5.3% 01/19/34	5.3000	2,800	2,678	420,227	2034/01/19
CHARTER COM/CAP 6.65% 02/01/34	6.6500	2,220	2,201	345,486	2034/02/01
LSEG US 5.297% 3/28/34 144A	5.2970	1,546	1,508	236,745	2034/03/28
HSBC HOLD 7.399%/VAR 11/30/34	7.3990	1,068	1,143	179,354	2034/11/13
ABN A 3.324%/VAR 03/13/37 144A	3.3240	800	643	100,982	2037/03/13
GS GRP INC MTN 6.25% 2/01/41	6.2500	150	157	24,642	2041/02/01
AERCAP LTD/TR 3.85% 10/29/41	3.8500	1,000	759	119,112	2041/10/29
MAGALLANES INC 5.05% 03/15/42	5.0500	548	445	69,834	2042/03/15
WILLIS NORTH AM 3.875% 9/15/49	3.8750	4,300	3,071	481,990	2049/09/15
AON CORP / AON 3.9% 02/28/52	3.9000	946	689	108,179	2052/02/28
CCO LLC/CAPITL 6.834% 10/23/5	6.8340	1,382	1,271	199,553	2055/10/23
MAGALLANES INC 5.391% 03/15/62	5.3910	960	749	117,521	2062/03/15
小計	－	610,712	571,591	89,682,633	－
(カナダ)		千カナダ・ドル	千カナダ・ドル		
国債証券					
CANADA GOVT 2.25% 6/1/25	2.2500	3,420	3,336	382,900	2025/06/01
CANADA GOVT .5% 12/01/30	0.5000	5,925	4,812	552,326	2030/12/01
CANADA GOVT 2% 12/01/51	2.0000	2,150	1,531	175,805	2051/12/01
小計	－	11,495	9,680	1,111,032	－
(オーストラリア)		千オーストラリア・ドル	千オーストラリア・ドル		
国債証券					
AUSTRALIA GOVT 0.5% 9/26 RGS	0.5000	1,770	1,625	167,332	2026/09/21
AUSTRALIA GOVT 1.25% 05/21/32	1.2500	5,300	4,171	429,505	2032/05/21
AUSTRALIA GOVT 3% 3/21/47 RGS	3.0000	2,300	1,722	177,300	2047/03/21
AUSTRALIA GOVT 1.75% 06/51 RGS	1.7500	4,587	2,464	253,754	2051/06/21
社債券					
BARCLAY 3.382%/VAR 5/20/32 RGS	3.3820	1,250	1,005	103,512	2032/05/20
小計	－	15,207	10,988	1,131,404	－
(ニュージーランド)		千ニュージーランド・ドル	千ニュージーランド・ドル		
国債証券					
NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/24	0.5000	11,000	10,980	1,027,887	2024/05/15
NEW ZEALAND GOV .5% 05/15/26	0.5000	8,750	8,001	748,989	2026/05/15
NEW ZEALAND GOV .25% 05/15/28	0.2500	4,850	4,050	379,187	2028/05/15
小計	－	24,600	23,032	2,156,065	－
(イギリス)		千イギリス・ポンド	千イギリス・ポンド		
国債証券					
UK GILT 1.25% 07/22/27 RGS	1.2500	15,330	13,935	2,745,588	2027/07/22
UK GILT .875% 07/31/33 RGS	0.8750	29,385	21,847	4,304,443	2033/07/31
UK GILT .625% 10/22/50 REGS	0.6250	3,200	1,243	244,910	2050/10/22
UK GILT 1.25% 07/31/51 RGS	1.2500	4,125	1,949	384,101	2051/07/31
UK GILT 1.75% 07/22/57 RGS	1.7500	5,225	2,681	528,241	2057/07/22
社債券					
DANSKE(UNG) 4.625/VAR 4/27 RGS	4.6250	1,625	1,602	315,726	2027/04/13

第	3	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)	
DIRECT LINE IN 4% 06/05/32 RGS	4.0000	3,200	2,625	517,257	2032/06/05
HSBC HLD 8.201%/VAR 11/34 RGS	8.2010	1,176	1,268	249,895	2034/11/16
小計	－	63,266	47,153	9,290,164	－
(ノルウェー)		千ノルウェー・クローネ	千ノルウェー・クローネ		
国債証券					
NORWAY GOVERNMENT BOND 2% 04/2	2.0000	18,275	17,057	243,235	2028/04/26
小計	－	18,275	17,057	243,235	－
(スウェーデン)		千スウェーデン・クローナ	千スウェーデン・クローナ		
国債証券					
SWEDEN GOVT 1.375% 06/23/71 RE	1.3750	7,415	4,645	66,610	2071/06/23
小計	－	7,415	4,645	66,610	－
(メキシコ)		千メキシコ・ペソ	千メキシコ・ペソ		
国債証券					
MEXICO UNITED 5.75% 03/05/26	5.7500	86,850	79,631	734,086	2026/03/05
MEXICO GOVT 7.75% 5/29/31	7.7500	72,800	64,522	594,801	2031/05/29
小計	－	159,650	144,154	1,328,888	－
(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					
INDONESIA GOVT 7% 5/15/27	7.0000	28,776,000	28,715,858	278,543	2027/05/15
小計	－	28,776,000	28,715,858	278,543	－
(チェコ)		千チェコ・コルナ	千チェコ・コルナ		
国債証券					
CZECH REPUBLIC .25% 02/10/27	0.2500	55,280	49,612	331,617	2027/02/10
小計	－	55,280	49,612	331,617	－
(韓国)		千韓国・ウォン	千韓国・ウォン		
国債証券					
KOREA REPUBLIC OF 2.625% 06/10	2.6250	2,320,200	2,232,102	254,682	2028/06/10
KOREA GOVT 1.5% 12/10/30	1.5000	15,016,960	13,164,317	1,502,048	2030/12/10
KOREA GOVT 4% 12/10/31	4.0000	7,000,000	7,155,750	816,471	2031/12/10
小計	－	24,337,160	22,552,169	2,573,202	－
(中国)		千オフショア・人民元	千オフショア・人民元		
国債証券					
CHINA GOVT 1.99% 04/09/25	1.9900	49,170	49,318	1,066,891	2025/04/09
CHINA GOVT 3.27% 11/19/30	3.2700	37,000	39,495	854,405	2030/11/19
CHINA GOVT 3.02% 05/27/31	3.0200	78,000	81,985	1,773,590	2031/05/27
CHINA GOVT 2.89% 11/18/31	2.8900	56,640	58,985	1,276,026	2031/11/18
CHINA GOVT 2.8% 11/15/32	2.8000	144,390	149,564	3,235,523	2032/11/15
小計	－	365,200	379,349	8,206,437	－
(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					
POLAND GOVT .25% 10/25/26	0.2500	6,675	5,906	230,135	2026/10/25
POLAND GOVT 1.25% 10/25/30	1.2500	7,450	5,728	223,190	2030/10/25
小計	－	14,125	11,635	453,325	－
(アイルランド)		千ユーロ	千ユーロ		
社債券					
PTSB EUAMDB01+350 4/25/28 RGS	6.6250	2,004	2,117	355,948	2028/04/25
ESB FIN LTD 4% 10/03/28 REGS	4.0000	4,395	4,453	748,685	2028/10/03
FLUTTER TREASURY 5% 04/29 RGS	5.0000	1,422	1,443	242,652	2029/04/29
AIB GROUP PLC 4.625% 07/23/29 RGS	4.6250	525	537	90,413	2029/07/23

銘柄	利率(%)	額面金額	第3期末 評価額 外貨建金額	第3期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	償還年月日
(オランダ)					
社債券					
TOYOTA MTR FIN 3.125% 1/27 RGS	3.1250	4,600	4,552	765,401	2027/01/11
ING GROEP NV 4.5%/VAR 5/29 RGS	4.5000	1,100	1,125	189,257	2029/05/23
DIGITAL DUTC 1.5% 03/15/30 RGS	1.5000	540	466	78,451	2030/03/15
ENBW INTL FIN 3.85% 05/30 RGS	3.8500	4,298	4,355	732,247	2030/05/23
DIGITAL DUT 1.25% 02/01/31 RGS	1.2500	2,450	2,008	337,617	2031/02/01
ABN AMRO BANK 3.875% 1/32 RGS	3.8750	1,500	1,499	252,041	2032/01/15
PROSUS NV 1.985% 07/13/33 RGS	1.9850	1,475	1,144	192,422	2033/07/13
ABN AMRO BANK 5.5% 9/21/33 RGS	5.5000	1,300	1,347	226,528	2033/09/21
ING GROEP 5.25%/VAR 11/33 RGS	5.2500	800	875	147,243	2033/11/14
ING GROEP 4.75%/VAR 05/34 RGS	4.7500	1,000	1,063	178,719	2034/05/23
ENBW INTL FIN 4.3% 05/34 RGS	4.3000	3,204	3,312	556,819	2034/05/23
ASR NEDERLA 7%/VAR 12/7/43 RGS	7.0000	971	1,087	182,773	2043/12/07
VOLKSWA 4.375%/VAR PERP RGS	4.3750	1,900	1,733	291,398	2049/12/31
VWIF 3.748%/VAR PERP RGS	3.7480	500	468	78,814	2049/12/31
(フランス)					
特殊債券					
EDF 4.625% 01/25/43 RGS	4.6250	800	812	136,575	2043/01/25
社債券					
SOCGEN 4.875%/VAR 11/21/31 RGS	4.8750	2,200	2,279	383,182	2031/11/21
BPCE SA 5.125%/VAR 1/25/35 RGS	5.1250	400	409	68,914	2035/01/25
TOTALENERGI 3.25%/VAR PERP RGS	3.2500	2,612	2,226	374,344	2049/12/31
(ドイツ)					
国債証券					
GERMANY GOVT 1.3% 10/15/27 RGS	1.3000	6,580	6,291	1,057,732	2027/10/15
GERMANY GOVT 2.4% 10/19/28 RGS	2.4000	28,510	28,290	4,756,194	2028/10/19
GERMANY GOVT 2.1% 04/12/29 RGS	2.1000	2,840	2,781	467,582	2029/04/12
GERMANY GOVT 2.3% 02/15/33 RGS	2.3000	68,297	67,274	11,310,231	2033/02/15
GERMANY GOVT 3.25% 7/04/42	3.2500	4,970	5,352	899,852	2042/07/04
GERMANY GOVT 0% 08/15/52 REGS	0.0000	5,576	2,678	450,288	2052/08/15
GERMANY GOVT 1.8% 08/15/53 RGS	1.8000	11,750	9,711	1,632,617	2053/08/15
(スペイン)					
新株予約権付社債					
CELLNEX CONV .75% 11/20/31 RGS	0.7500	900	744	125,227	2031/11/20
社債券					
BANCO SAN EUSA1+0 01/09/28 EGS	3.5000	5,000	4,956	833,261	2028/01/09
BANCOSAN 4.875% 10/18/31 RGS	4.8750	1,700	1,786	300,414	2031/10/18
BANCOSAN 3.75% 01/09/34 RGS	3.7500	3,400	3,394	570,664	2034/01/09
CAIXABK 6.125/VAR 05/30/34 RGS	6.1250	900	949	159,549	2034/05/30
(その他)					
特殊債券					
EUROPEAN UNION 2.5% 10/04/52 R	2.5000	2,552	2,148	361,150	2052/10/04
社債券					
CREDIT SUISSE 2.125% 10/13/26 RGS	2.1250	904	878	147,735	2026/10/13
UBS GROUP AG 4.625% 03/17/28 REGS	4.6250	1,186	1,208	203,242	2028/03/17
CARRIER GBL 4.125% 05/29/28	4.1250	1,406	1,420	238,754	2028/05/29
SWEDBANK AB 4.125% 11/28 RGS	4.1250	1,124	1,151	193,594	2028/11/13
TORONTO 3.563% 04/16/31 REGS	3.5630	1,450	1,435	241,416	2031/04/16
LLOYDS BNK 4.75%/VAR 09/31 RGS	4.7500	760	791	133,041	2031/09/21
HSBC 4.787O/VAR 03/10/32 RGS	4.7870	947	989	166,286	2032/03/10
UBS GROUP 4.75%/VAR 3/32 RGS	4.7500	993	1,033	173,756	2032/03/17
MSTDW 2.95%/VAR 05/07/32	2.9500	1,772	1,676	281,875	2032/05/07
CARRIER GBL 4.5% 11/29/32	4.5000	2,794	2,896	486,966	2032/11/29
ANZ BKG GR 5.101%/VAR 2/33 RGS	5.1010	1,952	1,997	335,819	2033/02/03
HSBC HOLD 4.856%/VAR 05/33 RGS	4.8560	730	769	129,364	2033/05/23
UBS GROUP 4.125%/VAR 06/33 RGS	4.1250	1,590	1,593	267,904	2033/06/09
BARCLAYS 4.347%/VAR 05/35 RGS	4.3740	2,227	2,227	374,403	2035/05/08
ユーロ計	－	202,806	195,749	32,909,383	－
合計	－	－	－	149,762,545	－

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

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

	銘柄別	第3期末 買建額(百万円)	第3期末 売建額(百万円)
外国	US 10YR NOTE FUT	84	－
	LONG GILT FUT	1,425	－
	EURO BUND FUTURE	－	65
	EURO BOBL FUT	－	176

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

＜スワップ及び先渡取引残高＞

種類	第3期末 取引契約残高(想定元本額) 買建(百万円)	第3期末 取引契約残高(想定元本額) 売建(百万円)
直物為替先渡取引(NDF)	578	938

組入投資信託証券の内容

■ウエスタン･グローバル債券ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン･テンプルトン･ジャパン株式会社
主な投資対象･投資地域	日本を除く世界の公社債
運用の基本方針	この投資信託は、主に日本を除く世界の公社債に投資を行い、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

●損益の状況

項目	第5期 自 2022年10月12日 至 2023年10月10日
(A)有価証券売買損益	**1,102,024,430円**
売買益	1,151,685,986
売買損	△49,661,556
(B)信託報酬等	**△64,186,759**
(C)当期損益金(A+B)	**1,037,837,671**
(D)前期繰越損益金	**1,262,429,844**
(E)追加信託差損益金	**3,244,638,997**
(配当等相当額)	(2,498,342,177)
(売買損益相当額)	(746,296,820)
(F)計 (C+D+E)	**5,544,906,512**
(G)収益分配金	**0**
次期繰越損益金(F+G)	**5,544,906,512**
追加信託差損益金	3,244,638,997
(配当等相当額)	(2,518,412,971)
(売買損益相当額)	(726,226,026)
分配準備積立金	2,300,267,515

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第4期末	第5期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ウエスタン･グローバル債券マザーファンド	14,367,949	19,211,702	25,096,247

下記は、ウエスタン・グローバル債券マザーファンド全体の内容です。

＜外国(外貨建)公社債＞

第	5	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)	
(アメリカ)		千ドル	千ドル		
国債証券					
COLOMBIA GOVT	5.625	260	176	26,177	2044/2/26
FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.0	690	494	73,446	2045/1/27
REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0	260	160	23,922	2045/6/15
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	910	776	115,367	2028/10/12
TSY INFL IX N/B	1.375	4,040	3,682	547,263	2033/7/15
UNITED MEXICAN STATES	4.6	1,100	783	116,442	2046/1/23
US TREASURY NOTE	1.5	2,550	2,511	373,157	2024/2/29
US TREASURY NOTE	0.375	3,490	3,154	468,778	2025/12/31
US TREASURY NOTE	0.375	16,710	15,040	2,234,989	2026/1/31
US TREASURY NOTE	0.75	5,280	4,754	706,514	2026/4/30
US TREASURY NOTE	2.5	190	176	26,153	2027/3/31
US TREASURY NOTE	2.625	7,340	6,802	1,010,794	2027/5/31
US TREASURY NOTE	3.875	2,730	2,634	391,542	2027/11/30
US TREASURY NOTE	1.375	3,750	3,179	472,443	2028/10/31
US TREASURY NOTE	1.125	1,020	563	83,696	2040/5/15
US TREASURY NOTE	2.0	270	169	25,138	2041/11/15
US TREASURY NOTE	2.875	180	125	18,652	2045/8/15
US TREASURY NOTE	1.375	6,900	3,203	475,982	2050/8/15
US TREASURY NOTE	4.0	380	323	48,006	2052/11/15
US TREASURY NOTE	3.625	40	31	4,713	2053/2/15
US TREASURY NOTE	3.625	940	745	110,830	2053/5/15
特殊債券(除く金融債)					
DELTA AIR LINES	4.5	45	43	6,512	2025/10/20
DELTA AIR LINES	4.75	60	56	8,428	2028/10/20
FHLMC #G67721	4.5	20	18	2,782	2049/4/1
FHLMC #Q59799	5.0	14	13	2,050	2048/11/1
FNMA #AL9546	3.5	38	34	5,060	2046/11/1
FNMA #AS9760	4.5	50	47	7,020	2047/6/1
FNMA #BK5659	2.0	250	189	28,173	2050/10/1
FNMA #BK7700	4.5	71	66	9,949	2048/10/1
FNMA #BM4897	3.5	35	30	4,594	2046/12/1
FNMA #BP2319	3.0	53	44	6,622	2050/2/1
FNMA #BQ3331	2.0	76	58	8,635	2050/8/1
FNMA #BQ4926	2.0	73	55	8,304	2050/10/1
FNMA #BR0663	2.0	79	60	9,008	2051/2/1
FNMA #BR2664	2.0	70	54	8,031	2051/2/1
FNMA #BR4052	2.0	76	57	8,596	2051/2/1
FNMA #BR9104	2.5	70	56	8,417	2051/5/1
FNMA #BR9750	2.0	248	189	28,113	2051/4/1
FNMA #BT5574	2.5	81	64	9,538	2051/8/1
FNMA #BU1030	2.0	84	65	9,665	2051/11/1
FNMA #BU1421	3.0	88	73	10,952	2052/1/1
FNMA #CA2047	4.5	44	41	6,196	2048/7/1
FNMA #CA2472	4.0	28	25	3,829	2048/10/1
FNMA #CA2482	4.5	42	39	5,833	2048/10/1
FNMA #CA2652	5.0	53	51	7,639	2048/11/1
FNMA #CA5371	4.0	55	49	7,377	2050/3/1
FNMA #CA7531	3.0	72	61	9,075	2050/10/1

第	5	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)	
FNMA #CA9121	2.5	74	59	8,808	2051/2/1
FNMA #CA9220	2.0	80	61	9,151	2051/2/1
FNMA #CB1666	2.5	172	137	20,436	2051/9/1
FNMA #CB3044	2.5	91	72	10,801	2052/3/1
FNMA #CB3234	3.0	90	74	11,090	2052/4/1
FNMA #CB3320	4.0	90	80	11,968	2052/4/1
FNMA #CB5316	6.0	179	175	26,122	2052/12/1
FNMA #CB5892	4.5	96	87	13,030	2053/3/1
FNMA #CB6030	4.5	98	90	13,424	2053/4/1
FNMA #FM1468	5.0	15	15	2,255	2049/8/1
FNMA #FM1727	5.0	23	22	3,328	2049/9/1
FNMA #FM2256	4.5	73	68	10,147	2044/10/1
FNMA #FM3773	3.5	443	386	57,451	2048/11/1
FNMA #FM4899	2.5	52	41	6,157	2050/11/1
FNMA #FM6117	3.0	159	133	19,894	2051/4/1
FNMA #FM6184	2.0	146	112	16,771	2051/3/1
FNMA #FM6448	2.0	83	63	9,474	2051/3/1
FNMA #FM6460	2.5	75	60	8,955	2051/3/1
FNMA #FM7786	4.0	155	139	20,730	2049/1/1
FNMA #FM7900	2.5	80	64	9,568	2051/7/1
FNMA #FM7910	2.5	82	66	9,820	2051/7/1
FNMA #FM8576	3.0	745	630	93,633	2050/2/1
FNMA #FM8786	2.5	168	134	19,924	2051/10/1
FNMA #FM8864	2.5	81	64	9,624	2051/10/1
FNMA #FM9195	2.5	85	67	10,002	2051/10/1
FNMA #FM9464	3.0	81	68	10,123	2051/11/1
FNMA #FS0028	2.5	86	68	10,197	2051/9/1
FNMA #FS0424	2.5	86	69	10,281	2052/1/1
FNMA #FS0439	2.5	86	69	10,255	2052/1/1
FNMA #FS0523	2.5	89	71	10,597	2052/2/1
FNMA #FS0549	2.5	179	142	21,231	2052/2/1
FNMA #FS0751	3.0	87	72	10,703	2052/3/1
FNMA #FS0957	3.0	89	74	11,019	2052/3/1
FNMA #FS0965	2.0	88	67	10,076	2051/11/1
FNMA #FS1107	2.5	84	67	10,061	2051/12/1
FNMA #FS1118	3.5	85	73	10,891	2052/3/1
FNMA #FS1171	3.0	258	212	31,619	2052/1/1
FNMA #FS1289	3.0	86	72	10,831	2052/3/1
FNMA #FS1374	3.0	90	74	11,030	2052/3/1
FNMA #FS1556	3.5	90	78	11,591	2052/5/1
FNMA #FS1603	3.5	89	77	11,468	2052/5/1
FNMA #FS2442	4.0	93	82	12,297	2052/7/1
FNMA #FS2768	2.0	557	424	63,143	2052/1/1
FNMA #FS2914	4.5	93	85	12,724	2052/9/1
FNMA #FS3339	3.5	186	159	23,712	2052/6/1
FNMA #FS3941	5.0	96	90	13,510	2053/2/1
FNMA #FS4269	2.0	95	73	10,961	2051/10/1
FNMA #FS4270	2.0	95	73	10,881	2052/3/1
FNMA #FS4454	6.0	93	91	13,633	2053/4/1

第	5	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)	
FNMA #FS4979	5.5	96	92	13,760	2053/5/1
FNMA #FS5059	3.5	192	168	25,019	2048/11/1
FNMA #FS5155	5.0	290	273	40,685	2053/7/1
FNMA #FS5437	5.5	198	190	28,253	2053/6/1
FNMA #MA4031	4.5	22	20	3,082	2050/5/1
FNMA #MA4237	2.0	459	350	52,040	2051/1/1
FNMA #MA4325	2.0	83	63	9,390	2051/5/1
FNMA #MA4422	2.0	82	66	9,923	2041/9/1
FNMA 30YR NOV FWD	6.0	1,200	1,177	174,956	2050/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	6.5	1,100	1,099	163,429	2050/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	2.5	900	711	105,742	2051/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	3.0	100	82	12,247	2051/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	3.5	600	513	76,348	2051/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	4.0	400	354	52,649	2051/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	5.0	700	656	97,602	2051/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	5.5	1,000	961	142,806	2051/11/1
FNR 2012-118 VZ	3.0	130	113	16,876	2042/11/25
G2SF 30YR OCT FWD	6.0	900	888	131,969	2050/10/1
G2SF 30YR OCT FWD	6.5	400	401	59,672	2050/10/1
G2SF 30YR OCT FWD	5.0	700	660	98,220	2051/10/1
G2SF 30YR OCT FWD	5.5	800	773	114,997	2051/10/1
G2SF 30YR OCT FWD	4.5	200	183	27,322	2051/10/1
GNMA #783669	3.0	48	42	6,298	2042/9/15
GNMA #784571	3.5	61	55	8,195	2048/6/15
GNMA #AA5649	3.0	17	15	2,250	2042/9/15
GNMA #AB9109	3.0	14	12	1,809	2042/10/15
GNMA #AB9207	3.0	12	10	1,565	2042/11/15
GNMA #BS8439	3.5	40	35	5,326	2050/5/15
GNMA II 30YR OCT FWD	3.0	600	506	75,308	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	3.5	300	261	38,923	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	4.0	400	358	53,337	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	2.5	200	163	24,271	2051/10/1
GNMA2 #784825	3.5	11	9	1,436	2049/10/20
GNMA2 #784905	3.0	59	50	7,556	2050/1/20
GNMA2 #785218	2.0	74	58	8,689	2050/12/20
GNMA2 #785219	2.0	72	56	8,407	2050/12/20
GNMA2 #785220	2.0	77	60	9,042	2050/12/20
GNMA2 #785221	2.0	75	59	8,771	2050/12/20
GNMA2 #785558	2.5	81	65	9,719	2051/7/20
GNMA2 #785657	2.5	84	68	10,135	2051/10/20
GNMA2 #785791	2.5	169	136	20,248	2051/12/20
GNMA2 #786095	3.0	92	76	11,302	2052/4/20
GNMA2 #786134	3.0	82	68	10,157	2052/4/20
GNMA2 #786335	4.5	93	86	12,872	2052/9/20
GNMA2 #786474	5.0	95	90	13,508	2053/1/20
GNMA2 #786583	3.0	191	162	24,109	2052/3/20
GNMA2 #786843	3.0	98	82	12,248	2052/3/20
GNMA2 #BS8420	4.0	30	27	4,125	2050/4/20
GNMA2 #BS8546	2.5	71	56	8,438	2050/12/20
GNMA2 #BZ4350	2.5	92	74	11,016	2051/3/20
GNMA2 #CD8312	2.5	73	59	8,781	2051/5/20
GNMA2 #MA1995	3.5	27	24	3,593	2044/6/20
GNMA2 #MA3875	4.0	174	158	23,574	2046/8/20

第	5	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)	
GNMA2 #MA4068	3.0	17	15	2,269	2046/11/20
GNMA2 #MA4836	3.0	5	4	686	2047/11/20
GNMA2 #MA4838	4.0	14	12	1,898	2047/11/20
GNMA2 #MA4901	4.0	13	12	1,878	2047/12/20
GNMA2 #MA5019	3.5	16	14	2,133	2048/2/20
GNMA2 #MA5078	4.0	92	84	12,551	2048/3/20
GNMA2 #MA5137	4.0	10	9	1,395	2048/4/20
GNMA2 #MA5193	4.5	55	52	7,756	2048/5/20
GNMA2 #MA5194	5.0	18	18	2,694	2048/5/20
GNMA2 #MA5265	4.5	99	92	13,740	2048/6/20
GNMA2 #MA5331	4.5	9	8	1,265	2048/7/20
GNMA2 #MA5398	4.0	83	76	11,322	2048/8/20
GNMA2 #MA5465	3.5	141	125	18,628	2048/9/20
GNMA2 #MA5467	4.5	19	17	2,661	2048/9/20
GNMA2 #MA5594	3.5	80	71	10,567	2048/11/20
GNMA2 #MA5597	5.0	15	14	2,175	2048/11/20
GNMA2 #MA5653	5.0	46	44	6,618	2048/12/20
GNMA2 #MA5711	4.5	90	84	12,587	2049/1/20
GNMA2 #MA5712	5.0	14	13	2,069	2049/1/20
GNMA2 #MA5764	4.5	91	85	12,659	2049/2/20
GNMA2 #MA5818	4.5	75	70	10,463	2049/3/20
GNMA2 #MA5878	5.0	18	18	2,685	2049/4/20
GNMA2 #MA5929	3.0	48	41	6,124	2049/5/20
GNMA2 #MA6287	5.0	16	15	2,367	2049/11/20
GNMA2 #MA6413	5.0	18	17	2,644	2050/1/20
GNMA2 #MA6477	4.5	16	15	2,254	2050/2/20
GNMA2 #MA6544	4.5	17	16	2,472	2050/3/20
GNMA2 #MA7194	3.0	306	260	38,650	2051/2/20
GNMA2 #MA7312	2.5	7	5	858	2051/4/20
GNMA2 #MA7589	2.5	164	134	19,984	2051/9/20
GNMA2 #MA7590	3.0	77	65	9,706	2051/9/20
GNMA2 #MA7768	3.0	254	215	31,963	2051/12/20
GNMA2 #MA7937	3.0	79	67	9,997	2052/3/20
GNMA2 #MA7989	3.5	274	239	35,591	2052/4/20
GNMA2 #MA8197	2.5	89	73	10,882	2052/8/20
GNMA2 #MA8268	4.5	94	87	12,974	2052/9/20
GNMA2 #MA8424	3.0	93	79	11,766	2052/11/20
GNMA2 #MA8429	5.5	188	182	27,192	2052/11/20
GNMA2 #MA8486	3.0	92	78	11,625	2052/12/20
GNMA2 #MA8487	3.5	192	167	24,956	2052/12/20
GNMA2 #MA8490	5.0	479	453	67,316	2052/12/20
GNMA2 #MA8569	5.0	290	274	40,809	2053/1/20
GNMA2 #MA8642	2.5	94	77	11,513	2053/2/20
GNMA2 #MA8725	5.0	97	92	13,717	2053/3/20
GNMA2 #MA8796	3.0	94	80	11,888	2053/4/20
GNR 2020-H04 FP	5.29361	115	114	16,990	2069/6/20
GNR 2020-H13 FA	5.00022	63	61	9,143	2070/7/20
MILEAGE PLUS HLDINGS LLC	6.5	52	51	7,700	2027/6/20
QB3535	2.0	292	223	33,145	2050/9/1
QB4985	2.0	74	56	8,453	2050/11/1
QB6998	2.0	73	56	8,339	2050/12/1
QB9057	2.0	78	59	8,848	2051/2/1
QB9290	2.0	81	62	9,317	2051/3/1

第	5	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)	
QC5830	2.5	84	67	10,058	2051/8/1
QC9443	2.5	88	69	10,384	2051/10/1
QC9511	2.0	86	66	9,851	2051/10/1
QK1354	2.0	87	70	10,444	2042/2/1
RA3913	2.5	357	286	42,636	2050/11/1
RA4414	2.5	72	57	8,552	2051/1/1
RA4703	2.0	78	59	8,893	2051/2/1
RA7183	4.0	87	77	11,571	2052/4/1
RA7185	4.0	178	158	23,501	2052/4/1
RA7186	4.0	177	157	23,424	2052/4/1
RA8790	5.0	98	92	13,678	2053/4/1
RB5131	2.0	84	67	10,089	2041/10/1
SD0573	2.0	70	54	8,165	2051/4/1
SD0857	2.5	270	214	31,904	2052/1/1
SD0958	3.5	87	75	11,232	2052/4/1
SD1143	4.5	162	150	22,424	2050/9/1
SD1218	4.0	506	455	67,658	2049/7/1
SD1340	3.0	454	380	56,517	2052/3/1
SD1749	2.5	93	74	11,069	2052/4/1
SD1775	4.5	93	85	12,748	2052/11/1
SD1807	4.5	94	86	12,847	2052/7/1
SD1936	3.5	187	160	23,826	2052/6/1
SD2245	5.5	95	92	13,717	2052/12/1
SD2394	4.5	94	86	12,836	2052/11/1
SD2395	5.0	92	86	12,844	2053/1/1
SD2443	4.5	96	88	13,112	2052/10/1
SD2452	6.5	91	92	13,691	2053/2/1
SD2578	6.0	94	92	13,722	2053/3/1
SD2591	5.0	95	89	13,336	2053/3/1
SD2688	5.5	95	92	13,723	2053/4/1
SD2756	5.5	96	92	13,799	2053/5/1
SD2762	5.5	96	93	13,851	2053/5/1
SD2792	4.5	93	87	12,959	2047/3/1
SD2892	5.5	94	91	13,531	2053/5/1
SD2919	5.5	195	187	27,909	2053/4/1
SD2981	6.5	186	186	27,698	2053/5/1
SD3171	5.5	95	91	13,638	2053/6/1
SD7525	2.5	138	110	16,483	2050/10/1
SD7548	2.5	342	274	40,752	2051/11/1
SD7552	2.5	439	349	51,865	2052/1/1
SD7554	2.5	357	286	42,541	2052/4/1
SD7560	4.0	190	170	25,295	2053/2/1
SD8121	2.0	612	466	69,335	2051/1/1
SD8146	2.0	410	312	46,407	2051/5/1
SD8214	3.5	183	156	23,322	2052/5/1
UMBS 30YR NOV FWD	1.5	200	143	21,309	2051/11/1
UMBS 30YR NOV FWD	2.0	200	151	22,544	2051/11/1
普通社債券（含む投資法人債券）					
3M COMPANY	3.7	160	109	16,248	2050/4/15
ABBVIE INC	4.875	10	8	1,251	2048/11/14
ABBVIE INC	4.25	480	368	54,706	2049/11/21

第	5	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)	
AMERICAN INTL GROUP	2.5	28	26	3,924	2025/6/30
AMERICAN TRANSMISSION SY	2.65	40	31	4,624	2032/1/15
ANHEUSER-BUSCH	4.9	100	84	12,614	2046/2/1
ANHEUSER-BUSCH	4.6	8	6	969	2048/4/15
ANHEUSER-BUSCH	5.55	300	278	41,414	2049/1/23
AT&T INC	4.5	405	295	43,932	2048/3/9
BANK OF AMERICA CORP FRN	3.419	440	391	58,218	2028/12/20
BANK OF AMERICA CORP FRN	4.571	210	183	27,201	2033/4/27
BAUSCH HEALTH COS INC	6.25	50	18	2,821	2029/2/15
BAUSCH HEALTH COS INC	7.25	20	7	1,096	2029/5/30
BNP PARIBAS FRN	5.198	280	263	39,105	2030/1/10
BOEING CO	5.15	170	160	23,819	2030/5/1
BOEING CO	3.3	150	110	16,372	2035/3/1
BOEING CO	5.805	430	380	56,542	2050/5/1
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2.9	20	19	2,906	2024/7/26
BROADCOM INC-144A 351115	3.137	70	50	7,439	2035/11/15
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	4.5	210	170	25,271	2030/8/15
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	4.5	360	278	41,350	2032/5/1
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	4.5	200	149	22,146	2033/6/1
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	4.25	250	182	27,045	2034/1/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.908	60	58	8,713	2025/7/23
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	4.2	170	155	23,060	2028/3/15
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	3.5	20	12	1,814	2041/6/1
CHARTER COMM OPT LLC/CAP	5.25	270	195	29,042	2053/4/1
CHENIERE ENERGY INC	4.625	40	36	5,426	2028/10/15
CIGNA CORP	4.375	130	121	18,118	2028/10/15
CIGNA CORP	4.8	290	249	37,064	2038/8/15
CIGNA CORP	4.9	110	89	13,353	2048/12/15
CITIGROUP INC	8.125	570	648	96,401	2039/7/15
CITIGROUP INC	4.65	180	139	20,661	2045/7/30
CITIGROUP INC FRN	3.785	580	475	70,589	2033/3/17
COCA-COLA CO	2.5	20	13	1,962	2040/6/1
COCA-COLA CO	2.6	10	5	872	2050/6/1
COMCAST CORP	4.15	390	365	54,346	2028/10/15
COMCAST CORP	4.0	210	151	22,503	2048/3/1
COMCAST CORP	2.987	50	26	3,944	2063/11/1
CSC HOLDINGS LLC	4.125	890	627	93,228	2030/12/1
CVS HEALTH CORP	4.3	116	108	16,193	2028/3/25
CVS HEALTH CORP	3.75	110	96	14,288	2030/4/1
CVS HEALTH CORP	5.05	650	525	78,141	2048/3/25
DANSKE BANK A/S	5.375	200	199	29,622	2024/1/12
DELTA AIR LINES	7.0	700	706	104,911	2025/5/1
DEVON ENERGY CORPORATION	5.85	430	427	63,531	2025/12/15
DEVON ENERGY CORPORATION	5.6	90	76	11,418	2041/7/15
DEVON ENERGY CORPORATION	4.75	10	7	1,140	2042/5/15
DIAMONDBACK ENERGY INC	3.5	70	61	9,139	2029/12/1
DISH NETWORK CORP	2.375	340	327	48,599	2024/3/15
ECOPETROL SA	5.375	780	743	110,546	2026/6/26
ENERGY TRANSFER LP	5.95	130	111	16,523	2043/10/1
ENERGY TRANSFER OPERATNG	3.75	270	231	34,474	2030/5/15
ENTERPRISE PRODUCTS OPER	5.1	410	352	52,319	2045/2/15
FIRST QUANTUM MINERALS L	8.625	400	383	57,032	2031/6/1
FORD MOTOR COMPANY	3.25	340	253	37,621	2032/2/12

第	5	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)	
FREEPORT-MCMORAN INC	4.625	70	62	9,235	2030/8/1
FREEPORT-MCMORAN INC	5.45	50	41	6,179	2043/3/15
GALAXY PIPELINE ASSETS	2.625	680	519	77,173	2036/3/31
GENERAL MOTORS	6.6	60	56	8,441	2036/4/1
GENERAL MOTORS	6.75	60	54	8,066	2046/4/1
GOLDMAN SACHS GROUP	3.5	340	314	46,786	2026/11/16
GOLDMAN SACHS GROUP	6.75	320	315	46,906	2037/10/1
GOLDMAN SACHS GROUP FRN	2.615	80	61	9,103	2032/4/22
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5.15	1,150	952	141,486	2045/5/22
GSK CONSUMER HEALTHCARE	3.625	510	428	63,740	2032/3/24
HCA INC	5.375	10	9	1,469	2025/2/1
HCA INC	5.25	420	410	60,956	2026/6/15
HCA INC	5.625	10	9	1,440	2028/9/1
HCA INC	5.875	70	68	10,146	2029/2/1
HCA INC	3.5	100	83	12,441	2030/9/1
HOME DEPOT INC	2.7	70	58	8,767	2030/4/15
HOME DEPOT INC	3.625	110	75	11,194	2052/4/15
HSBC HOLDINGS PLC	4.25	640	613	91,150	2025/8/18
HSBC HOLDINGS PLC FRN	3.803	200	197	29,363	2025/3/11
HUMANA INC	2.15	20	14	2,211	2032/2/3
JPMORGAN CHASE & CO FRN	0.969	150	144	21,411	2025/6/23
JPMORGAN CHASE & CO FRN	4.452	500	461	68,584	2029/12/5
JPMORGAN CHASE & CO FRN	2.58	1,080	838	124,627	2032/4/22
KRAFT HEINZ FOODS CO	4.25	10	8	1,333	2031/3/1
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.0	30	25	3,732	2042/6/4
KRAFT HEINZ FOODS CO	5.2	110	93	13,860	2045/7/15
KRAFT HEINZ FOODS CO	4.875	30	24	3,571	2049/10/1
MCDONALD'S CORP	4.2	30	22	3,331	2050/4/1
MORGAN STANLEY	3.95	130	119	17,820	2027/4/23
MORGAN STANLEY FRN	3.622	410	348	51,739	2031/4/1
MPLX LP	5.5	20	16	2,430	2049/2/15
NGPL PIPECO LLC	4.875	170	159	23,725	2027/8/15
NORTHROP GRUMMAN CORP	5.25	50	44	6,591	2050/5/1
OCCIDENTAL PETROLEUM	4.4	300	212	31,616	2046/4/15
OCCIDENTAL PETROLEUM	4.4	280	184	27,369	2049/8/15
PETROBRAS GLOBAL FINANCE	6.25	1,270	1,267	188,332	2024/3/17
RAYTHEON TECH CORP	2.25	50	39	5,897	2030/7/1
SANDS CHINA LTD	3.1	660	531	79,008	2029/3/8
SOUTHWESTERN ENERGY CO	4.75	10	8	1,251	2032/2/1
SPIRIT LOYALTY KY LTD/IP	8.0	47	47	7,079	2025/9/20
SUNOCO LOGISTICS PARTNER	5.35	90	71	10,580	2045/5/15
SUZANO AUSTRIA GMBH	3.125	1,000	748	111,237	2032/1/15
T-MOBILE USA INC	2.25	20	18	2,734	2026/2/15
T-MOBILE USA INC	2.625	50	42	6,249	2029/2/15
T-MOBILE USA INC	2.875	530	424	63,152	2031/2/15
T-MOBILE USA INC	3.5	50	41	6,176	2031/4/15
T-MOBILE USA INC	2.7	140	107	15,985	2032/3/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	6.5	20	19	2,934	2027/7/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	6.875	30	29	4,440	2029/1/15
TARGA RESOURCES PARTNERS	4.0	10	8	1,221	2032/1/15
TEVA PHARMACEUTICALS NE	3.15	420	371	55,150	2026/10/1
TEVA PHARMACEUTICALS NE	5.125	400	357	53,101	2029/5/9
TIME WARNER ENT	8.375	260	273	40,581	2033/7/15

第	5	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)	
UNITED AIRLINES INC	4.625	600	513	76,284	2029/4/15
UNITEDHEALTH GROUP INC	3.5	100	74	11,081	2039/8/15
VERIZON COMMUNICATIONS	4.329	650	606	90,085	2028/9/21
VERIZON COMMUNICATIONS	3.4	90	61	9,092	2041/3/22
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	5.5	430	377	56,097	2029/5/15
VISA INC	2.7	120	81	12,098	2040/4/15
VOC ESCROW LTD	5.0	280	252	37,499	2028/2/15
WELLS FARGO & COMPAN FRN	0.805	160	154	22,947	2025/5/19
WELLS FARGO & COMPAN FRN	2.879	390	320	47,648	2030/10/30
WELLS FARGO & COMPAN FRN	5.013	1,120	896	133,278	2051/4/4
WELLS FARGO & COMPANY	4.3	340	317	47,176	2027/7/22
WELLS FARGO & COMPANY	3.9	20	14	2,080	2045/5/1
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	4.05	980	846	125,817	2030/2/1
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	5.25	240	179	26,695	2050/2/1
WYNN MACAU LTD	5.625	200	168	25,074	2028/8/26
小計				16,107,204	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CANADIAN GOVT	1.25	740	614	67,239	2030/6/1
CANADIAN GOVT	5.75	1,680	1,886	206,528	2033/6/1
地方債証券					
ONTARIO (PROVINCE OF)	3.45	590	466	51,047	2045/6/2
PROVINCE OF QUEBEC	3.5	620	493	54,008	2045/12/1
小計				378,824	
(メキシコ)		千メキシカンペソ	千メキシカンペソ		
国債証券					
MEXICAN BONOS DESARR FIX	7.75	72,820	59,660	486,874	2042/11/13
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BUNDES REPUBLIC DE	0.5	600	568	89,267	2026/2/15
BUNDES REPUBLIC DE	2.1	690	668	105,125	2029/11/15
BUNDES REPUBLIC DE	—	300	247	38,943	2031/2/15
BUNDES REPUBLIC DE	1.7	3,180	2,931	460,786	2032/8/15
普通社債券(含む投資法人債券)					
MUNICH RE FRN	3.25	500	452	71,059	2049/5/26
VOLKSWAGEN FIN SERV	1.5	540	526	82,756	2024/10/1
(イタリア)					
国債証券					
BUONI POLIENNALI	3.25	1,750	1,308	205,702	2046/9/1
普通社債券(含む投資法人債券)					
INTESA SANPAOLO SPA	1.0	560	547	85,981	2024/7/4
UNICREDIT SPA FRN	4.875	900	894	140,601	2029/2/20
(フランス)					
国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	—	1,300	1,041	163,645	2030/11/25
FRANCE O.A.T.	1.5	370	226	35,642	2050/5/25
FRANCE O.A.T.	4.0	280	285	44,852	2060/4/25
普通社債券(含む投資法人債券)					
BNP PARIBAS FRN	0.5	300	260	40,905	2028/5/30
CREDIT AGRICOLE FRN	1.875	1,600	1,497	235,406	2027/4/22

銘柄	利率(%)	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額(千円)	償還年月日
(オランダ)					
普通社債券(含む投資法人債券)					
ABN AMRO BANK NV	1.0	310	296	46,657	2025/4/16
ABN AMRO BANK NV	4.5	300	291	45,749	2034/11/21
ING GROEP NV FRN	2.5	600	592	93,104	2029/2/15
VOLKSWAGEN FIN SERV	3.75	300	292	45,929	2027/9/28
(スペイン)					
国債証券					
SPAIN GOVT	5.15	590	648	101,861	2044/10/31
SPANISH GOVT 2.7 10/31/4	2.7	710	521	81,958	2048/10/31
普通社債券(含む投資法人債券)					
BANCO SANTANDER SA FRN	5.75	300	296	46,529	2033/8/23
CELLNEX FINANCE CO SA	2.0	800	618	97,228	2032/9/15
(ベルギー)					
国債証券					
BELGIUM GOVT	3.75	760	741	116,536	2045/6/22
(ルクセンブルク)					
普通社債券(含む投資法人債券)					
HOLCIM FINANCE LUX SA	1.75	530	461	72,563	2029/8/29
(その他)					
国債証券					
UNITED MEXICAN STATES	2.875	590	413	64,956	2039/4/8
普通社債券(含む投資法人債券)					
ABBVIE INC	1.5	100	99	15,673	2023/11/15
ANGLO AMERICAN CAPITAL	1.625	600	573	90,183	2025/9/18
BANK OF AMERICA CORP FRN	1.776	660	618	97,223	2027/5/4
CREDIT SUISSE GROUP FRN	3.25	460	449	70,596	2026/4/2
CREDIT SUISSE GROUP FRN	2.125	1,200	1,139	179,063	2026/10/13
CREDIT SUISSE GROUP FRN	1.0	140	126	19,814	2027/6/24
DANSKE BANK A/S FRN	1.375	950	897	141,029	2030/2/12
GENERAL ELECTRIC CO	4.125	610	596	93,717	2035/9/19
HSBC HOLDINGS PLC FRN	3.019	320	307	48,258	2027/6/15
LLOYDS BANKING GROUP FRN	3.5	1,180	1,161	182,591	2026/4/1
MCDONALD'S CORP	1.875	1,100	1,028	161,630	2027/5/26
MORGAN STANLEY FRN	4.656	350	349	54,970	2029/3/2
NETFLIX INC	3.625	700	663	104,307	2030/6/15
STANDARD CHARTERED P FRN	2.5	1,280	1,206	189,657	2030/9/9
TORONTO-DOMINION BANK	2.551	1,020	955	150,186	2027/8/3
ユーロ計				4,212,656	
(イギリス)		千ポンド	千ポンド		
国債証券					
UK TREASURY	4.5	70	69	12,677	2034/9/7
UK TREASURY	4.75	1,040	1,037	188,806	2038/12/7
UK TREASURY	3.25	860	672	122,381	2044/1/22
UK TREASURY	2.5	280	163	29,813	2065/7/22
UK TREASURY INFL	0.125	570	508	92,521	2068/3/22
普通社債券(含む投資法人債券)					
AVIVA PLC FRN	6.125	20	19	3,607	2036/11/14
BNP PARIBAS FRN	2.0	700	607	110,583	2031/5/24
ENEL FINANCE INTL NV	2.875	370	317	57,713	2029/4/11
NATWEST GROUP PLC FRN	2.105	200	169	30,903	2031/11/28
ROYAL BANK OF CANADA	3.625	710	658	119,786	2027/6/14
小計				768,795	
(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					
POLAND GOVT	1.75	11,590	8,416	289,741	2032/4/25
(オーストラリア)		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券					
AUSTRALIAN GOVT	1.75	1,440	765	73,081	2051/6/21
(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					
INDONESIA GOVERNMENT	8.375	21,485,000	23,691,457	222,699	2039/4/15
(中国)		千元	千元		
国債証券					
CHINA GOVERNMENT BOND	3.38	1,000	1,018	20,753	2026/7/4
CHINA GOVERNMENT BOND	3.85	1,000	1,035	21,090	2026/12/12
CHINA GOVERNMENT BOND	4.29	4,500	4,828	98,362	2029/5/22
CHINA GOVERNMENT BOND	3.6	1,000	1,043	21,250	2030/5/21
CHINA GOVERNMENT BOND	2.82	10,000	9,925	202,182	2032/8/12
CHINA GOVERNMENT BOND	4.0	13,500	14,493	295,226	2035/11/30
普通社債券(含む投資法人債券)					
AGRICUL DEV BANK CHINA	3.4	14,000	14,076	286,735	2024/11/6
AGRICUL DEV BANK CHINA	3.8	11,390	11,830	240,980	2030/10/27
CHINA DEVELOPMENT BANK	4.2	8,000	8,324	169,561	2027/1/19
CHINA DEVELOPMENT BANK	4.3	8,000	8,611	175,415	2032/8/2
EXPORT-IMPORT BANK CHINA	4.4	6,000	6,050	123,257	2024/5/14
EXPORT-IMPORT BANK CHINA	4.15	3,000	3,123	63,617	2027/6/18
小計				1,718,435	
(南アフリカ)		千ランド	千ランド		
国債証券					
SOUTH AFRICA GOVT	6.5	59,597	33,642	258,714	2041/2/28
合計				24,517,027	

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

<売付債券>

銘柄	利率(%)	額面金額	評価額 外貨建金額	評価額 邦貨換算金額(千円)	償還年月日
(アメリカ)		千ドル	千ドル		
FNMA 30YR NOV FWD	5.5	300	288	42,842	2051/11/1
FNMA 30YR NOV FWD	5.0	300	281	41,829	2051/11/1
G2SF 30YR OCT FWD	5.0	500	472	70,157	2051/10/1
GNMA II 30YR OCT FWD	3.0	600	506	75,308	2051/10/1
UMBS 30YR NOV FWD	2.0	200	151	22,544	2051/11/1
合計				252,682	

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

＜外国投資信託証券＞

銘柄		第4期末	第5期末		
		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）				千ドル	
LMQI-LMWA INDIA BOND-LM USD		－	1,833	247	36,834
WA CHINA BOND FUND L.L.C.		547,626	438,377	4,656	692,012
合計	口数・金額	547,626	440,211	4,904	728,847
	銘柄数＜比率＞	1	2	－	＜2.9%＞

(注1)邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(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		第5期末	
		買建額（百万円）	売建額（百万円）
外国	CA 10YR 0312	149	－
	US 5YR 0312	4,702	－
	UK 10YR 0312	1,121	－
	BTP10YR 1312	171	－
	OAT10YR 1312	503	－
	EB 5YR 0312	1,682	－
	EB 10YR 0312	1,726	－
	US 2YR 0312	5,100	－
	US 10YR 0312	－	3,221
	EB 30YR 2312	－	19
	US 20YR 0312	366	－
	USUL10YR2312	－	1,186
	AU 10YR 0312	138	－
	3M SOFR 2412	4,011	－

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

＜オプションの銘柄別期末残高＞

銘柄別			コールプット別	第5期末	
				買建額（百万円）	売建額（百万円）
外国	債券	RXX3 C 1027	コール	0.961819	－
		RXX3 P 1027	プット	－	10

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

＜スワップ及び先渡取引残高＞

種類	第5期末
	取引契約残高（想定元本額）
	百万円
直物為替先渡取引	2,184

組入投資信託証券の内容

■BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund－クラスS-JPY

●ファンドの概要

管　理　会　社	ブルーベイ・ファンズ・マネジメント・カンパニー・エスエー
主な投資対象・投資地域	わが国を含む世界の投資適格債券
運用の基本方針	主としてわが国を含む世界の投資適格債券に投資するとともに、デリバティブ取引及び為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「BlueBay Funds Société d'Investissement à Capital Variable Annual Report including Audited Financial Statements for the year ended 30 June 2023」の情報を基に掲載しています。

BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

●損益の状況(2023年6月30日までの会計期間)

	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund EUR	BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund USD	BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund USD
INCOME			
Dividends, net of withholding taxes	–	–	–
Interest income on investments, net of withholding taxes	33,703,563	10,071,272	67,482,222
Interest income on reverse repurchase agreements	–	–	171,638
Interest income on swap agreements	482,076	23,596	165,958
Bank interest	3,635,084	253,419	3,185,302
Other income	3,156	26,236	1,034,254
Total Income	**37,823,879**	**10,374,523**	**72,039,374**
EXPENSES			
Management fees	7,156,492	1,832,589	6,682,306
Performance fees	–	286	–
Taxe d'abonnement	286,967	13,915	420,706
Directors' fees	6,759	7,373	7,373
Administration fees	599,178	57,594	589,670
Depositary fees	162,501	–	176,117
Professional fees	23,419	18,322	44,643
Transaction expenses	184,882	142	137,027
Interest expense on investments	–	–	–
Interest expense on repurchase agreements	–	–	–
Interest expense on swap agreements	9,906,221	106,069	4,443,784
Bank interest charges	3,898	–	–
Other expenses	124,046	19,638	242,607
Total Expenses	**18,454,363**	**2,055,928**	**12,744,233**
Expense (payment)/reimbursement of expense cap	(235,295)	(80,510)	122,458
NET INVESTMENT INCOME	**19,134,221**	**8,238,085**	**59,417,599**
Net realised appreciation/(depreciation) on:			
- Investments	(86,264,184)	(26,592,381)	(85,603,730)
- Forward foreign exchange contracts	(18,700,547)	(6,151,031)	18,730,887
- Futures contracts	68,323,857	–	6,384,496
- Swap agreements	(4,634,246)	(286,196)	(2,918,309)
- Options	–	(88,017)	–
- Foreign exchange transactions	(5,686,856)	(14,351)	(1,302,568)
NET INVESTMENT INCOME AND REALISED APPRECIATION/(DEPRECIATION)	**(27,827,755)**	**(24,893,891)**	**(5,291,625)**

	BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund EUR	BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund USD	BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund USD
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) on:			
- Investments	77,846,939	23,408,123	57,442,099
- Forward foreign exchange contracts	(14,292,572)	(388,624)	(3,492,980)
- Futures contracts	(16,236,243)	–	(7,070,635)
- Swap agreements	(9,356,435)	(660,906)	(7,261,763)
- Options	–	24	–
- Foreign exchange transactions	(1,144,129)	8,295	68,004
RESULT OF OPERATIONS FOR THE YEAR/PERIOD	**8,989,805**	**(2,526,979)**	**34,393,100**
CAPITAL TRANSACTIONS			
Received on subscription of shares	235,485,390	17,026,251	1,415,600,188
Paid on redemption of shares	(714,982,671)	(106,837,994)	(501,959,961)
Dividends paid	(2,760,614)	(50,476)	(22,989,258)
Dividends reinvested	19,913,498	39,061	3,646
TOTAL INCREASE/(DECREASE) IN NET ASSETS FOR THE YEAR/PERIOD	**(453,354,592)**	**(92,350,137)**	**925,047,715**
Currency translation adjustment	–	–	–
Net assets at the beginning of the year/period	1,350,267,218	172,450,285	971,562,565
TOTAL NET ASSETS AT THE END OF THE YEAR/PERIOD	**896,912,626**	**80,100,148**	**1,896,610,280**

●投資明細表(2023年6月30日現在)

銘柄	利率	満期日	通貨	額面(単位：千)	時価 €	純資産比率 %
Transferable securities admitted to an official exchange listing						
BONDS						
CANADA						
Magna International Inc	4.38%	17/03/32	EUR	4,753	4,809,875	0.54
DENMARK						
Danske Bank, VRB	4.75%	21/06/30	EUR	3,770	3,757,992	0.42
Danske Bank, VRB	4.13%	10/01/31	EUR	6,800	6,739,280	0.75
Orsted AS	3.63%	01/03/26	EUR	6,280	6,241,487	0.70
TDC Net	5.06%	31/05/28	EUR	5,066	4,978,177	0.56
TDC Net	5.62%	06/02/30	EUR	5,157	5,063,413	0.56
					26,780,349	2.99
ESTONIA						
Estonia Government International Bond	4.00%	12/10/32	EUR	3,720	3,834,291	0.43
FINLAND						
Fortum Oyj	4.50%	26/05/33	EUR	4,192	4,233,091	0.47
Nordea Bank Abp, VRB	3.63%	10/02/26	EUR	6,386	6,299,015	0.70
					10,532,106	1.17
FRANCE						
Atos SE	1.00%	12/11/29	EUR	5,000	3,261,390	0.36
Banque Federative du Credit Mutuel SA	3.88%	26/01/28	EUR	4,500	4,377,960	0.49
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.38%	02/05/30	EUR	7,600	7,549,207	0.84
Banque Federative du Credit Mutuel SA	4.13%	14/06/33	EUR	7,400	7,369,826	0.82
BNP Paribas SA	1.38%	28/05/29	EUR	14,400	12,173,952	1.36
BNP Paribas SA	4.13%	24/05/33	EUR	8,600	8,611,298	0.96
BNP Paribas SA, VRB	9.25%	31/12/49†	USD	3,133	2,976,698	0.33
BNP Paribas SA, VRB	3.88%	23/02/29	EUR	7,900	7,787,278	0.87
BNP Paribas SA 144A, VRB	7.75%	31/12/49†	USD	3,926	3,469,290	0.39
BPCE SA	4.50%	13/01/33	EUR	12,500	12,558,533	1.40
BPCE SA, VRB	4.75%	14/06/34	EUR	3,300	3,312,074	0.37
Credit Agricole SA	3.88%	20/04/31	EUR	7,600	7,512,224	0.84
Electricite de France SA	4.63%	25/01/43	EUR	7,300	7,017,105	0.78
Electricite de France SA, VRB	7.50%	31/12/49†	EUR	6,000	6,108,253	0.68
Electricite de France SA, VRB	3.38%	31/12/49†	EUR	2,400	1,851,195	0.21
Electricite de France SA, VRB	4.00%	31/12/49†	EUR	3,400	3,306,331	0.37
Electricite de France SA, VRB	5.00%	31/12/49†	EUR	6,800	6,435,212	0.72
Holding d'Infrastructures de Transport SASU	4.25%	18/03/30	EUR	8,500	8,420,378	0.94
iliad SA	0.75%	11/02/24	EUR	18,100	17,699,698	1.97
Lagardere SA	1.75%	07/10/27	EUR	6,500	6,369,803	0.71
Societe Generale SA	4.13%	02/06/27	EUR	8,000	7,930,227	0.88
Societe Generale SA, VRB	7.88%	31/12/49†	EUR	5,400	5,185,373	0.58
TDF Infrastructure SASU	1.75%	01/12/29	EUR	4,100	3,315,014	0.37
TotalEnergies SE, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	4,738	4,507,059	0.50
					159,105,378	17.74
GERMANY						
Bayer AG	4.25%	26/08/29	EUR	2,891	2,916,588	0.32
Bayer AG	4.63%	26/05/33	EUR	2,451	2,491,310	0.28
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.50%	15/08/27	EUR	2,500	2,294,717	0.26
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.25%	15/02/29	EUR	3,583	3,170,027	0.35

銘柄	利率	満期日	通貨	額面（単位：千）	時価 €	純資産比率 %
Transferable securities admitted to an official exchange listing (continued)						
BONDS (continued)						
GERMANY (continued)						
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	15/08/30	EUR	23,875	20,178,571	2.25
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.70%	15/08/32	EUR	7,100	6,716,510	0.75
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	4.25%	04/07/39	EUR	2,462	3,025,683	0.34
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.25%	15/08/48	EUR	4,537	3,606,572	0.40
Commerzbank AG, VRB	6.13%	31/12/49†	EUR	3,800	3,479,709	0.39
Commerzbank AG, VRB	6.50%	31/12/49†	EUR	2,600	2,270,968	0.25
Deutsche Bank AG, VRB	10.00%	31/12/49†	EUR	2,600	2,586,957	0.29
Deutsche Bank AG, VRB	1.75%	19/11/30	EUR	7,100	5,617,274	0.63
					58,354,886	6.51
IRELAND						
Johnson Controls International Plc	4.25%	23/05/35	EUR	4,192	4,229,811	0.47
Vodafone International Financing DAC	4.00%	10/02/43	EUR	7,860	7,427,975	0.83
					11,657,786	1.30
ITALY						
ASTM SpA	1.00%	25/11/26	EUR	1,711	1,526,325	0.17
ASTM SpA	1.50%	25/01/30	EUR	3,093	2,516,997	0.28
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	04/12/28	EUR	4,893	4,282,326	0.48
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	15/01/30	EUR	6,593	5,540,435	0.62
Intesa Sanpaolo SpA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	756	604,274	0.06
					14,470,357	1.61
JAPAN						
East Japan Railway Co	4.11%	22/02/43	EUR	4,260	4,312,495	0.48
LUXEMBOURG						
Eurofins Scientific SE, VRB	6.75%	31/12/49†	EUR	4,389	4,393,722	0.49
MEXICO						
Mexican Bonos	7.75%	29/05/31	MXN	175,960	8,908,955	0.99
Mexican Bonos	7.50%	26/05/33	MXN	152,100	7,500,820	0.84
Mexico Government International Bond	4.00%	15/03/15^	EUR	28,229	20,915,057	2.33
					37,324,832	4.16
NETHERLANDS						
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	2.63%	31/12/49†	EUR	3,600	2,997,684	0.33
Abertis Infraestructuras Finance BV, VRB	3.25%	31/12/49†	EUR	4,600	4,146,753	0.46
ABN AMRO Bank NV	3.75%	20/04/25	EUR	15,900	15,766,113	1.76
ABN AMRO Bank NV	3.63%	10/01/26	EUR	5,200	5,139,650	0.57
American Medical Systems Europe BV	0.75%	08/03/25	EUR	12,153	11,504,567	1.28
Coloplast Finance BV, FRB	4.14%	19/05/24	EUR	15,349	15,412,501	1.72
Cooperatieve Rabobank UA, VRB	4.88%	31/12/49†	EUR	1,800	1,514,003	0.17
ING Groep NV, VRB	4.75%	23/05/34	EUR	7,800	7,819,256	0.87
JAB Holdings BV	5.00%	12/06/33	EUR	7,300	7,417,947	0.83
Prosus NV	1.29%	13/07/29	EUR	3,352	2,562,608	0.29
Prosus NV	1.99%	13/07/33	EUR	4,025	2,771,300	0.31
Upjohn Finance BV	1.91%	23/06/32	EUR	6,392	4,925,747	0.55

銘柄	利率	満期日	通貨	額面（単位：千）	時価 €	純資産比率 %
Transferable securities admitted to an official exchange listing (continued)						
BONDS (continued)						
NETHERLANDS (continued)						
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	2.50%	31/12/49†	EUR	4,100	3,497,452	0.39
Wintershall Dea Finance 2 BV, VRB	3.00%	31/12/49†	EUR	4,900	3,850,679	0.43
Wintershall Dea Finance BV	1.33%	25/09/28	EUR	5,600	4,717,491	0.53
Wintershall Dea Finance BV	1.82%	25/09/31	EUR	2,100	1,644,871	0.18
					95,688,622	10.67
ROMANIA						
Romanian Government International Bond	1.75%	13/07/30	EUR	6,318	4,830,154	0.54
Romanian Government International Bond	2.12%	16/07/31	EUR	3,623	2,755,243	0.31
Romanian Government International Bond	2.00%	28/01/32	EUR	2,300	1,692,188	0.19
Romanian Government International Bond	2.00%	14/04/33	EUR	5,186	3,672,973	0.41
Romanian Government International Bond	3.88%	29/10/35	EUR	1,935	1,535,255	0.17
Romanian Government International Bond	2.63%	02/12/40	EUR	12,785	7,806,895	0.87
Romanian Government International Bond	2.75%	14/04/41	EUR	6,419	3,949,639	0.44
Romanian Government International Bond	2.88%	13/04/42	EUR	12,311	7,586,854	0.85
Romanian Government International Bond	4.63%	03/04/49	EUR	3,413	2,639,272	0.29
Romanian Government International Bond	3.38%	28/01/50	EUR	1,491	937,748	0.10
					37,406,221	4.17
SOUTH AFRICA						
Republic of South Africa Government Bond	8.50%	31/01/37	ZAR	666,623	24,745,059	2.76
SPAIN						
Banco de Sabadell SA, VRB	5.75%	31/12/49†	EUR	5,600	4,728,624	0.53
CaixaBank SA, VRB	5.88%	31/12/49†	EUR	3,600	3,228,642	0.36
FCC Servicios Medio Ambiente Holding SAU	0.82%	04/12/23	EUR	11,296	11,136,789	1.24
Werfen SA/Spain	4.63%	06/06/28	EUR	5,900	5,835,653	0.65
					24,929,708	2.78
SWEDEN						
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	1.00%	12/08/27	EUR	1,313	858,115	0.09
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, VRB	2.62%	31/12/49†	EUR	7,128	1,433,439	0.16
					2,291,554	0.25
SWITZERLAND						
UBS Group AG, VRB	3.25%	02/04/26	EUR	10,993	10,596,946	1.18
UBS Group AG, VRB	7.75%	01/03/29	EUR	3,470	3,849,670	0.43
					14,446,616	1.61

銘柄	利率	満期日	通貨	額面（単位：千）	時価 €	純資産比率 %
Transferable securities admitted to an official exchange listing (continued)						
BONDS (continued)						
UNITED KINGDOM						
Barclays Plc, VRB	9.25%	31/12/49†	GBP	3,140	3,322,414	0.37
Barclays Plc, VRB	8.41%	14/11/32	GBP	2,314	2,677,073	0.30
Barclays Plc, VRB	5.26%	29/01/34	EUR	7,052	7,052,988	0.79
Barclays Plc, VRB	6.38%	31/12/49†	GBP	5,028	5,082,958	0.57
HSBC Holdings Plc	4.79%	10/03/32	EUR	3,440	3,456,413	0.38
HSBC Holdings Plc, VRB	4.86%	23/05/33	EUR	6,940	6,986,283	0.78
HSBC Holdings Plc, VRB	5.40%	11/08/33	USD	2,761	2,474,237	0.27
HSBC Holdings Plc, VRB	8.20%	16/11/34	GBP	2,126	2,512,978	0.28
Nationwide Building Society, VRB	5.75%	31/12/49†	GBP	1,165	1,167,196	0.13
NatWest Group Plc, VRB	6.00%	31/12/49†	USD	794	670,811	0.07
Vodafone Group Plc, VRB	8.00%	30/08/86	GBP	5,193	5,982,413	0.67
					41,385,764	4.61
UNITED STATES						
AT&T Inc	3.55%	18/11/25	EUR	10,812	10,683,129	1.19
Bank of America Corp, FRB	4.59%	22/09/26	EUR	11,255	11,231,413	1.25
Becton Dickinson & Co	0.00%	13/08/23	EUR	7,800	7,768,890	0.87
Berry Global Inc	1.00%	15/01/25	EUR	4,403	4,194,805	0.47
DAE Funding LLC	1.55%	01/08/24	USD	9,755	8,487,367	0.95
Global Payments Inc	4.88%	17/03/31	EUR	7,209	7,188,145	0.80
Global Payments Inc	5.95%	15/08/52	USD	3,060	2,695,893	0.30
Goldman Sachs Group Inc, FRB	3.75%	30/04/24	EUR	26,146	26,158,609	2.92
Morgan Stanley, VRB	4.66%	02/03/29	EUR	6,338	6,375,521	0.71
Morgan Stanley, VRB	2.95%	07/05/32	EUR	6,706	6,066,711	0.68
Utah Acquisition Sub Inc	2.25%	22/11/24	EUR	5,939	5,757,949	0.64
Utah Acquisition Sub Inc	3.13%	22/11/28	EUR	2,280	2,107,802	0.23
Visa Inc	1.50%	15/06/26	EUR	17,042	16,000,369	1.78
					114,716,603	12.79
TOTAL BONDS					**691,186,224**	**77.06**
Total Transferable securities admitted to an official exchange listing					**691,186,224**	**77.06**
Transferable securities dealt in on other regulated markets						
BONDS						
CAYMAN ISLANDS						
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	2.13%	21/02/26	USD	12,837	10,469,076	1.17
Avolon Holdings Funding Ltd 144A	4.25%	15/04/26	USD	6,541	5,587,910	0.62
					16,056,986	1.79
FRANCE						
Electricite de France SA, VRB	9.13%	31/12/49†	USD	2,200	2,067,811	0.23
Electricite de France SA 144A	6.25%	23/05/33	USD	2,210	2,060,044	0.23
Electricite de France SA 144A	6.90%	23/05/53	USD	3,080	2,938,566	0.33
Societe Generale SA, VRB	9.38%	31/12/49†	USD	3,087	2,776,325	0.31
					9,842,746	1.10
GERMANY						
Robert Bosch GmbH	4.00%	02/06/35	EUR	4,500	4,572,653	0.51
Robert Bosch GmbH	4.38%	02/06/43	EUR	5,300	5,448,588	0.61
					10,021,241	1.12

銘柄	利率	滿期日	通貨	額面（單位：千）	時価 €	純資産比率 %
Transferable securities dealt in on other regulated markets (continued)						
BONDS (continued)						
ICELAND						
Iceland Rikisbref	4.50%	17/02/42	ISK	2,628,485	14,852,633	1.66
ITALY						
Intesa Sanpaolo SpA	5.63%	08/03/33	EUR	6,260	6,253,460	0.70
Intesa Sanpaolo SpA 144A, VRB	8.25%	21/11/33	USD	6,113	5,890,640	0.65
					12,144,100	1.35
JAPAN						
Nissan Motor Co Ltd 144A	4.81%	17/09/30	USD	3,455	2,778,696	0.31
LUXEMBOURG						
Bevco Lux Sarl	1.00%	16/01/30	EUR	2,512	1,960,350	0.22
ROMANIA						
Romanian Government International Bond	6.63%	17/02/28	USD	3,240	3,061,609	0.34
Romanian Government International Bond	2.88%	26/05/28	EUR	2,256	2,025,184	0.23
Romanian Government International Bond	3.38%	08/02/38	EUR	1,591	1,146,235	0.13
					6,233,028	0.70
SWITZERLAND						
Credit Suisse AG [#]	6.50%	08/08/23	USD	12,325	11,264,642	1.25
Credit Suisse Group AG, FTB [±,#]	9.75%	31/12/49†	USD	3,540	159,532	0.02
UBS Group AG 144A, VRB	9.02%	15/11/33	USD	2,200	2,417,959	0.27
					13,842,133	1.54
UNITED STATES						
Amgen Inc	5.60%	02/03/43	USD	4,290	3,951,072	0.44
Amgen Inc	5.65%	02/03/53	USD	4,870	4,527,787	0.50
Amgen Inc	5.75%	02/03/63	USD	4,290	3,999,364	0.45
Bank of America Corp, VRB	5.29%	25/04/34	USD	5,490	4,989,201	0.56
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.50%	01/06/41	USD	4,710	2,925,494	0.33
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	3.85%	01/04/61	USD	3,811	2,131,970	0.24
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital	4.40%	01/12/61	USD	6,137	3,797,028	0.42
Intel Corp	5.63%	10/02/43	USD	1,715	1,601,578	0.18
Intel Corp	5.70%	10/02/53	USD	4,400	4,110,484	0.46
Micron Technology Inc	5.88%	09/02/33	USD	5,763	5,268,576	0.59
Nasdaq Inc	5.55%	15/02/34	USD	1,800	1,657,383	0.18
Utah Acquisition Sub Inc	5.25%	15/06/46	USD	4,493	3,257,336	0.36
Viatris Inc	4.00%	22/06/50	USD	1,251	761,141	0.08
Warnermedia Holdings Inc	5.05%	15/03/42	USD	2,983	2,296,138	0.26
Warnermedia Holdings Inc	5.14%	15/03/52	USD	4,133	3,091,349	0.34
Warnermedia Holdings Inc	5.39%	15/03/62	USD	3,736	2,788,357	0.31
					51,154,258	5.70
TOTAL BONDS					**138,886,171**	**15.49**

	時価 €	純資產比率 %
Total Investments *(Cost EUR 904,851,385)*	**830,072,395**	**92.55**
Other assets less liabilities	**66,840,231**	**7.45**
Total Net Assets	**896,912,626**	**100.00**

Glossary:
FTB - Flat Trading Bond
FRB - Floating Rate Bond
VRB - Variable Rate Bond
± Defaulted Security
† Perpetual maturity
^ Maturity date is on 15 March 2115
# Investment represents a claim valued at fair value

Forward Foreign Exchange Contracts

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Forward Foreign Exchange Contracts

Currency Bought	Amount Currency Bought	Currency Sold	Amount Currency Sold	Maturity Date	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
EUR	29,438,931	ZAR	(588,367,979)	20/07/23	958,821
USD	15,310,000	CNY	(107,418,004)	20/07/23	428,408
EUR	10,572,499	SEK	(119,941,297)	20/07/23	395,057
USD	23,080,432	PHP	(1,256,971,860)	20/07/23	327,356
PHP	1,249,947,292	USD	(22,250,000)	20/07/23	316,912
INR	2,672,932,765	USD	(32,372,935)	20/07/23	167,889
USD	6,200,000	ILS	(22,330,078)	20/07/23	165,110
EUR	1,482,125	JPY	(216,906,667)	20/07/23	104,339
GBP	7,729,400	EUR	(8,913,031)	20/07/23	88,071
USD	1,130,000	JPY	(149,344,077)	20/07/23	86,311
USD	22,040,098	EUR	(20,138,186)	20/07/23	47,846
MXN	12,512,775	USD	(680,000)	20/07/23	43,339
EUR	9,659,732	USD	(10,500,000)	20/07/23	43,018
HUF	399,524,125	EUR	(1,030,000)	20/07/23	35,596

Forward Foreign Exchange Contracts (continued)

Currency Bought	Amount Currency Bought	Currency Sold	Amount Currency Sold	Maturity Date	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
CHF	21,211,328	EUR	(21,715,075)	20/07/23	34,691
MXN	31,750,000	EUR	(1,657,770)	20/07/23	32,488
CLP	933,346,100	USD	(1,130,000)	20/07/23	28,529
GBP	909,692	USD	(1,130,000)	20/07/23	24,420
ZAR	30,581,561	EUR	(1,478,622)	20/07/23	1,687
		Total Unrealised Appreciation			**3,329,888**
JPY	4,738,290,816	USD	(35,450,739)	20/07/23	(2,371,012)
EUR	59,500,099	GBP	(52,256,546)	20/07/23	(1,354,113)
EUR	15,676,068	MXN	(318,433,464)	20/07/23	(1,276,200)
EUR	207,403,624	USD	(227,666,652)	20/07/23	(1,111,154)
USD	16,710,000	MXN	(301,977,853)	20/07/23	(771,916)
EUR	15,660,000	HUF	(6,105,042,238)	20/07/23	(623,150)
ILS	62,159,638	USD	(17,321,637)	20/07/23	(517,190)
SEK	119,941,297	EUR	(10,642,986)	20/07/23	(465,544)
USD	20,383,153	GBP	(16,305,479)	20/07/23	(319,714)
EUR	21,440,090	CHF	(21,211,328)	20/07/23	(309,676)
USD	21,329,064	CLP	(17,391,720,895)	20/07/23	(281,612)
AUD	25,554,364	USD	(17,290,000)	20/07/23	(248,966)
JPY	336,049,815	EUR	(2,372,576)	20/07/23	(237,995)
USD	17,380,000	AUD	(26,328,049)	20/07/23	(140,505)
EUR	3,655,349	CAD	(5,410,000)	20/07/23	(90,032)
CNY	107,989,763	USD	(14,990,000)	20/07/23	(62,971)
USD	915,635	BRL	(4,644,743)	02/08/23	(38,509)
USD	12,260,000	EUR	(11,265,690)	20/07/23	(37,031)
MXN	107,909,550	USD	(6,300,000)	20/07/23	(25,307)
USD	1,800,000	INR	(148,280,400)	20/07/23	(5,542)
		Total Unrealised Depreciation			**(10,288,139)**

Hedge Share Class Forward Foreign Exchange Contracts

Currency Bought	Amount Currency Bought	Currency Sold	Amount Currency Sold	Share Class	Maturity Date	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
EUR	7,775,087	JPY	(1,187,833,847)	S - JPY	20/07/23	229,991
EUR	64,039	NOK	(745,437)	I - NOK	20/07/23	277
USD	299,161	EUR	(273,743)	B - USD	20/07/23	252
EUR	11,380	USD	(12,375)	C - USD	20/07/23	46
NOK	1,618	EUR	(138)	I - NOK	20/07/23	1
EUR	742	USD	(810)	R - USD (AIDiv)	20/07/23	1
EUR	2	USD	(2)	S - USD	20/07/23	0
JPY	18	EUR	–	S - JPY	20/07/23	0
EUR	195	CHF	(190)	B - CHF	20/07/23	0
EUR	36	CHF	(35)	Q - CHF	20/07/23	0
EUR	1	USD	(1)	M - USD	20/07/23	0
USD	1,504	EUR	(1,377)	M - USD	20/07/23	0
EUR	34	CHF	(33)	M - CHF	20/07/23	0
EUR	35	CHF	(34)	S - CHF (AIDiv)	20/07/23	0
		Total Unrealised Appreciation				**230,568**

Hedge Share Class Forward Foreign Exchange Contracts (continued)

Currency Bought	Amount Currency Bought	Currency Sold	Amount Currency Sold	Share Class	Maturity Date	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
JPY	36,169,698,342	EUR	(237,345,900)	S - JPY	20/07/23	(7,596,738)
USD	56,361,702	EUR	(51,758,697)	I - USD	20/07/23	(138,279)
USD	23,686,194	EUR	(21,751,765)	S - USD	20/07/23	(58,111)
NOK	15,837,564	EUR	(1,377,398)	I - NOK	20/07/23	(22,711)
GBP	3,190,657	EUR	(3,726,041)	C - GBP	20/07/23	(10,433)
USD	4,232,724	EUR	(3,887,042)	R - USD	20/07/23	(10,385)
USD	2,760,119	EUR	(2,534,702)	C - USD	20/07/23	(6,772)
USD	2,582,975	EUR	(2,372,026)	B - USD	20/07/23	(6,337)
USD	2,171,352	EUR	(1,994,020)	M - USD	20/07/23	(5,327)
CHF	3,205,214	EUR	(3,288,988)	I - CHF	20/07/23	(2,411)
GBP	687,416	EUR	(802,764)	S - GBP	20/07/23	(2,249)
EUR	297,218	NOK	(3,495,760)	I - NOK	20/07/23	(1,797)
GBP	438,121	EUR	(511,637)	D - GBP (QIDiv)	20/07/23	(1,433)
GBP	401,125	EUR	(468,433)	C - GBP (AIDiv)	20/07/23	(1,312)
USD	531,262	EUR	(487,874)	I - USD (AIDiv)	20/07/23	(1,303)
USD	366,346	EUR	(336,427)	C - USD (AIDiv)	20/07/23	(899)
USD	247,232	EUR	(227,040)	Q - USD	20/07/23	(607)
GBP	146,394	EUR	(170,959)	X - GBP	20/07/23	(479)
USD	161,346	EUR	(148,169)	R - USD (AIDiv)	20/07/23	(396)
CHF	516,338	EUR	(529,834)	S - CHF	20/07/23	(388)
GBP	114,988	EUR	(134,283)	B - GBP	20/07/23	(376)
CHF	491,252	EUR	(504,024)	B - CHF	20/07/23	(302)
EUR	147,503	USD	(161,292)	I - USD	20/07/23	(221)
EUR	62,847	USD	(68,722)	S - USD	20/07/23	(94)
USD	35,808	EUR	(32,884)	X - USD	20/07/23	(88)
GBP	9,973	EUR	(11,647)	Q - GBP (AIDiv)	20/07/23	(32)
GBP	9,510	EUR	(11,106)	S - GBP (AIDiv)	20/07/23	(31)
EUR	2,616	GBP	(2,263)	D - GBP (QIDiv)	20/07/23	(20)
EUR	12,264	USD	(13,410)	R - USD	20/07/23	(18)
EUR	7,390	USD	(8,081)	C - USD	20/07/23	(11)
EUR	6,854	USD	(7,495)	B - USD	20/07/23	(10)
CHF	10,589	EUR	(10,866)	Q - CHF	20/07/23	(8)
CHF	9,940	EUR	(10,200)	M - CHF	20/07/23	(8)
EUR	5,254	USD	(5,745)	M - USD	20/07/23	(8)
CHF	10,453	EUR	(10,726)	S - CHF (AIDiv)	20/07/23	(8)
EUR	3,838	CHF	(3,749)	B - CHF	20/07/23	(6)
EUR	1,410	USD	(1,541)	I - USD (AIDiv)	20/07/23	(2)
EUR	656	USD	(717)	Q - USD	20/07/23	(1)
EUR	972	USD	(1,063)	C - USD (AIDiv)	20/07/23	(1)
EUR	428	USD	(468)	R - USD (AIDiv)	20/07/23	(1)
EUR	1,743	CHF	(1,700)	S - CHF	20/07/23	0
EUR	942	GBP	(809)	X - GBP	20/07/23	0
EUR	277	USD	(302)	X - USD	20/07/23	0
EUR	10,685	CHF	(10,421)	I - CHF	20/07/23	0
		Total Unrealised Depreciation				**(7,869,613)**

Futures Contracts

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Number of Contracts	Description	Maturity	Currency	Commitment EUR	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
(1,755)	Euro-Bobl September Futures 23	07/09/23	EUR	172,644,615	2,879,446
(1,436)	Euro-Bund September Futures 23	07/09/23	EUR	136,101,208	1,672,537
(1,146)	Euro-Schatz September Futures 23	07/09/23	EUR	113,810,406	1,002,750
(362)	US 10YR Ultra September Futures 23	20/09/23	USD	32,278,471	461,987
(113)	US 5YR Note (CBT) September Futures 23	29/09/23	USD	10,197,253	202,386
(78)	Long Gilt September Futures 23	27/09/23	GBP	5,893,291	189,566
(58)	US 2YR Note (CBT) September Futures 23	29/09/23	USD	10,575,132	154,503
(412)	US Long Bond (CBT) September Futures 23	20/09/23	USD	40,648,889	105,380
		Total Unrealised Appreciation			**6,668,555**
3,261	3M ICE Sonia December Futures 23	19/03/24	GBP	3,800,066,315	(7,198,696)
(206)	JPN 10Y Bond (Ose) September Futures 23	12/09/23	JPY	129,709,140	(683,435)
(165)	Euro-Buxl 30Y Bond September Futures 23	07/09/23	EUR	13,191,750	(349,553)
208	US 10YR Note (CBT) September Futures 23	20/09/23	USD	18,773,144	(87,622)
(27)	US Ultra Bond (CBT) September Futures 23	20/09/23	USD	2,236,982	(42,883)
		Total Unrealised Depreciation			**(8,362,189)**

Interest Rate Swap Agreements

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Currency	Nominal ('000)	Maturity	Sub-Fund Receives	Fixed Rate %	Floating Rate Index	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
EUR	10,900	13/02/73	Floating	1.94	EURIBOR 6 MONTH	837,297
BRL	39,100	04/01/27	Fixed	12.98	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	470,398
BRL	17,151	04/01/27	Fixed	13.41	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	238,493
BRL	19,916	04/01/27	Fixed	12.93	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	232,693
CZK	268,399	20/07/28	Fixed	4.79	PRIBOR 6 MONTH	175,166
CZK	258,076	20/07/28	Fixed	4.79	PRIBOR 6 MONTH	167,552
BRL	33,520	04/01/27	Fixed	11.33	BRAZIL CETIP INTERBANK DEPOSIT RATE	128,987
CZK	30,824	20/07/28	Fixed	4.85	PRIBOR 6 MONTH	23,791
					Total Unrealised Appreciation	**2,274,377**
JPY	6,300,000	20/07/33	Floating	0.73	JPY-TONA-OIS-COMPOUND	(597,168)
KRW	19,588,866	20/07/28	Fixed	3.26	KRW CD 3M	(148,716)
KRW	10,011,134	20/07/28	Fixed	3.25	KRW CD 3M	(77,904)
KRW	11,835,017	20/07/28	Fixed	3.37	KRW CD 3M	(46,027)
KRW	3,164,983	20/07/28	Fixed	3.39	KRW CD 3M	(11,107)
					Total Unrealised Depreciation	**(880,922)**

Credit Default Swap Agreements

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Protection Position	Security Description	Rate %	Maturity	Currency	Nominal	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
FRANCE						
Buy	Valeo SA	1.00	20/06/28	EUR	4,750,000	293,470
UNITED KINGDOM						
Buy	British Telecommunications Plc	1.00	20/06/28	EUR	10,490,000	35,649
Buy	Marks & Spencer Plc	1.00	20/06/28	EUR	4,500,000	196,924
						232,573
UNITED STATES						
Buy	Avnet Inc	1.00	20/06/28	USD	7,576,000	60,461
Buy	Eastman Chemical Co	1.00	20/06/28	USD	18,450,000	10,631
						71,092
	Total Unrealised Appreciation					**597,135**
FRANCE						
Buy	WPP Finance SA	1.00	20/06/28	EUR	10,370,000	(61,196)
GERMANY						
Buy	Bertelsmann SE & Co KGaA	1.00	20/06/28	EUR	10,370,000	(324,950)
NETHERLANDS						
Buy	Stellantis NV	5.00	20/06/28	EUR	5,200,000	(814,401)
	Total Unrealised Depreciation					**(1,200,547)**

Credit Default Index Swap Agreements

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Protection Position	Index Description	Rate %	Maturity	Currency	Nominal	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
UNITED STATES						
Buy	CDX North America High Yield Index	5.00	20/06/28	USD	14,000,000	(352,330)
Buy	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/28	USD	30,200,000	(413,129)
Buy	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/28	USD	48,060,000	(657,450)
Buy	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/28	USD	107,476,000	(1,470,248)
Buy	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/28	USD	139,836,000	(1,912,926)
Buy	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/28	USD	161,214,000	(2,205,372)
Buy	CDX North America Investment Grade Index	1.00	20/06/28	USD	176,391,000	(2,412,990)
Buy	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/06/28	EUR	18,900,000	(748,422)
Buy	iTraxx Europe Crossover Index	5.00	20/06/28	EUR	23,300,000	(922,658)
Buy	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	13,284,000	(156,597)
Buy	iTraxx Europe Index	1.00	20/06/28	EUR	84,486,000	(995,954)
						(12,248,076)
	Total Unrealised Depreciation					**(12,248,076)**

Inflation Swap Agreements

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund

Currency	Nominal ('000)	Maturity	Sub-Fund Receives	Fixed Rate %	Floating Rate Index	Unrealised Appreciation/ (Depreciation) EUR
USD	8,172	15/06/43	Floating	2.45	USD-CPI-U	222,808
USD	8,328	15/06/43	Floating	2.49	USD-CPI-U	187,844
					Total Unrealised Appreciation	**410,652**
EUR	6,373	15/06/43	Fixed	2.61	EUR-EXT-CPI	(195,876)
EUR	6,627	15/06/43	Fixed	2.66	EUR-EXT-CPI	(144,161)
					Total Unrealised Depreciation	**(340,037)**

組入投資信託証券の内容

■FOFs用 ピクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券
運用の基本方針等	この投資信託は、主として円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」(世界の株式、債券、為替等の多様な資産に対して、様々な投資手法を組み合わせることにより、中長期における収益の獲得を目指して運用を行うルクセンブルク籍投資信託証券)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。

●損益の状況

項目	第8期 自 2022年10月12日 至 2023年10月10日
(A)配当等収益	△20,133円
受取利息	165
支払利息	△20,298
(B)有価証券売買損益	215,964,150
売買益	301,738,385
売買損	△85,774,235
(C)信託報酬等	△11,310,303
(D)当期損益金(A+B+C)	204,633,714
(E)前期繰越損益金	△445,921,961
(F)追加信託差損益金	515,881,147
(配当等相当額)	(489,442,205)
(売買損益相当額)	(26,438,942)
(G)計 (D+E+F)	274,592,900
(H)収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	274,592,900
追加信託差損益金	515,881,147
(配当等相当額)	(489,441,989)
(売買損益相当額)	(26,439,158)
分配準備積立金	441,564,071
繰越損益金	△682,852,318

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第7期末	第8期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	19,928,015	11,589,081	11,859,106

下記は、ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

第 8 期 末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)				
ＳＩＧＮＵＭ　ＧＥＮＥＶＡ１　０％　１２／１５／２５	0	25,815,000	26,825,657	2025/12/15
合計		25,815,000	26,825,657	

組入投資信託証券の内容

■ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運　用　会　社	野村アセットマネジメント株式会社
主な投資対象･投資地域	わが国の株式及び株価指数先物取引の売建て
運用の基本方針等	この投資信託は、わが国の株式に投資を行うとともに、TOPIX(東証株価指数)を対象とする株価指数先物取引の売建てにより、投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行います。

●損益の状況

項目	第5期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
(A)配当等収益	△740,426円
受取利息	190
支払利息	△740,616
(B)有価証券売買損益	3,065,202,300
売買益	3,633,470,764
売買損	△568,268,464
(C)先物取引等取引損益	△4,190,848,809
取引益	198,427,758
取引損	△4,389,276,567
(D)信託報酬等	△120,365,275
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△1,246,752,210
(F)前期繰越損益金	△1,717,546,844
(G)追加信託差損益金	412,861,901
(配当等相当額)	(431,173,297)
(売買損益相当額)	(△18,311,396)
(H)計 (E+F+G)	△2,551,437,153
次期繰越損益金(H)	△2,551,437,153
追加信託差損益金	412,861,901
(配当等相当額)	(431,625,721)
(売買損益相当額)	(△18,763,820)
分配準備積立金	921,549,722
繰越損益金	△3,885,848,776

●組入資産の明細

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		第5期末 買建額(百万円)	第5期末 売建額(百万円)
国内	TOPIX	－	16,488

＜親投資信託残高＞

	第4期末 口数	第5期末 口数	第5期末 評価額
	千口	千口	千円
野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド	7,890,199	4,453,682	7,951,159
日本成長株投資マザーファンド	8,440,244	5,254,653	8,042,772

下記は、日本成長株投資マザーファンド全体の内容です。

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	第4期末 株数(千株)	第5期末 株数(千株)	第5期末 評価額(千円)
鉱業(1.1%)			
ＩＮＰＥＸ	84.1	42.2	82,100
建設業(2.6%)			
ショーボンドホールディングス	16.8	16.7	101,369
大和ハウス工業	52.1	22.7	94,205
食料品(1.0%)			
キッコーマン	—	8.5	74,851
東洋水産	19.6	—	—
パルプ・紙(0.4%)			
レンゴー	109.5	31.5	29,232
化学(13.8%)			
日産化学	20.1	15	82,680
信越化学工業	30.1	65.8	371,112
日油	27.8	14	96,586
富士フイルムホールディングス	16.4	—	—
資生堂	—	18.6	75,757
ミルボン	17.3	20.9	75,804
ニフコ	35.6	18.5	65,194
ユニ・チャーム	79.7	59.6	294,304
医薬品(5.7%)			
日本新薬	12.4	—	—
中外製薬	125.6	36.6	199,470
参天製薬	102.7	58	80,040
ＪＣＲファーマ	42.2	35.5	40,505
第一三共	17.9	29.6	115,765
ゴム製品(0.8%)			
横浜ゴム	—	19	61,161
機械(8.1%)			
三浦工業	43.4	30.2	84,801
ディスコ	0.8	1.5	50,430
ＳＭＣ	4.8	2.4	184,704
ダイキン工業	18.9	9.8	224,714
ダイフク	19.4	26	75,205
電気機器(17.0%)			
日立製作所	17.2	16.3	161,907
ニデック	25.8	—	—
ルネサスエレクトロニクス	—	48	123,816
ソニーグループ	—	9.5	124,972
キーエンス	8.9	5.4	337,932
シスメックス	26.6	23.2	183,999
太陽誘電	10.2	—	—
村田製作所	29.7	50.2	142,216
東京エレクトロン	2.4	9.1	229,820
輸送用機器(1.0%)			
本田技研工業	27.3	—	—
シマノ	10.1	3.4	75,038
精密機器(2.5%)			
テルモ	35.9	12.4	58,738
ＨＯＹＡ	17	5.2	89,726
朝日インテック	37.9	16.5	47,025
メニコン	11.4	—	—
その他製品(2.0%)			
パンダイナムコホールディングス	12.3	28.8	81,518
ピジョン	82.5	45.5	74,506
陸運業(0.8%)			
ＳＧホールディングス	60.1	30.1	60,756
倉庫・運輸関連業(0.4%)			
トランコム	5	4.4	32,296
情報・通信業(17.0%)			
システナ	159.3	—	—
GMOペイメントゲートウェイ	30.5	37.9	350,764
インターネットイニシアティブ	—	22.1	61,161
ラクス	38.5	50.2	128,110
オービック	13.9	8.1	190,107
トレンドマイクロ	6.5	1	8,102
大塚商会	12.8	7.6	45,273
ネットワンシステムズ	29.1	—	—
日本電信電話	80.8	1,682.2	284,796
ＫＤＤＩ	41.7	39.5	175,143
カプコン	—	14.6	67,087
卸売業(3.5%)			
神戸物産	—	18.7	75,903
伊藤忠商事	57.3	33.5	195,439
小売業(7.2%)			
ＭｏｎｏｔａＲＯ	126.8	82.1	126,639
コスモス薬品	4	1.9	29,763
パン・パシフィック・インターナショナルホ	25.9	19.6	65,777
ニトリホールディングス	14.5	5.8	106,401
ファーストリテイリング	5.1	6.1	227,774
銀行業(0.6%)			
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	101.9	41.3	49,043
保険業(1.8%)			
東京海上ホールディングス	94.2	40.2	141,544
その他金融業(1.7%)			
芙蓉総合リース	—	4.8	56,688
イー・ギャランティ	42.9	40.9	77,219
不動産業(0.4%)			
カチタス	29	14.3	30,730
サービス業(10.6%)			
日本M&Aセンターホールディングス	126.9	82.1	61,673
エス・エム・エス	33.3	33.1	92,084
エムスリー	119.7	122.2	279,960
リクルートホールディングス	55.8	35.1	207,756
インソース	—	81.7	70,262
ジャパンエレベーターサービスホールディン	28.5	15.6	36,270
リログループ	32.1	—	—
M&A総研ホールディングス	—	15.4	67,760
合計 株数・金額	2,628	3,448	7,693,498
合計 銘柄数＜比率＞	64	65	＜95.7%＞

(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。

下記は、野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド全体の内容です。

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	第4期末	第5期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
水産・農林業(0.8%)			
マルハニチロ	11.1	17.9	48,688
ホクト	19.5	14.4	24,868
建設業(6.4%)			
ショーボンドホールディングス	15.9	—	—
西松建設	31.8	19.1	72,942
大和ハウス工業	48.6	28.2	117,030
積水ハウス	57.2	35.8	107,292
関電工	67.7	31.7	42,731
きんでん	57.1	26.7	62,104
エクシオグループ	24.8	19.7	60,301
九電工	18	4.3	21,276
インフロニア・ホールディングス	58.7	61.1	85,387
食料品(13.4%)			
森永製菓	23.9	17.2	86,963
江崎グリコ	33.6	20	81,720
山崎製パン	49.4	29.1	91,839
カルビー	34.5	29.4	81,555
森永乳業	—	22.7	59,666
ヤクルト本社	—	24.3	76,326
明治ホールディングス	13.4	30	99,240
伊藤ハム米久ホールディングス	52.5	6.5	24,537
サッポロホールディングス	—	2.1	12,631
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	20.7	19.5	40,033
サントリー食品インターナショナル	29.3	5.5	25,888
伊藤園	15.7	—	—
味の素	30.4	22.4	122,438
キユーピー	50.2	37.4	91,480
ハウス食品グループ本社	22.8	17	51,765
カゴメ	17.5	12.5	38,525
ニチレイ	14.5	28.7	99,474
東洋水産	23.4	—	—
日清食品ホールディングス	13	6.9	98,946
日本たばこ産業	60	—	—
パルプ・紙(2.0%)			
日本製紙	—	37.1	47,376
大王製紙	64	34.6	38,838
レンゴー	139.2	97.2	90,201
化学(7.1%)			
エア・ウォーター	29.5	25	46,375
積水化学工業	—	48.2	97,580
日油	6.1	8.2	56,571
花王	10.2	22.6	132,255

銘柄	第4期末	第5期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
富士フイルムホールディングス	4.5	—	—
ライオン	—	36.4	47,957
ポーラ・オルビスホールディングス	11.6	40.5	64,536
小林製薬	5.9	2.9	18,937
エフピコ	28	15	43,290
ユニ・チャーム	31.4	24.4	120,487
医薬品(1.1%)			
科研製薬	18.4	—	—
参天製薬	—	72.4	99,912
ツムラ	4.7	—	—
機械(0.7%)			
平和	41.4	30.9	63,283
ＳＡＮＫＹＯ	23.1	—	—
セガサミーホールディングス	14.9	—	—
電気機器(7.4%)			
日立製作所	—	10.5	104,296
東芝	35	—	—
日本電気	17.1	14.8	121,108
ソニーグループ	—	2.9	38,149
ヒロセ電機	3.8	3.1	50,406
アズビル	28.2	7.9	37,185
日本光電工業	37	23.5	88,289
京セラ	23.8	10.3	84,418
村田製作所	—	15.6	44,194
キヤノン	62.3	23.1	85,031
その他製品(0.8%)			
大日本印刷	6	—	—
リンテック	25.1	—	—
コクヨ	52.1	30.7	69,919
電気・ガス業(4.0%)			
電源開発	60.9	41.2	92,185
東京瓦斯	56.1	31.6	105,733
大阪瓦斯	65.3	36.8	107,492
東邦瓦斯	33	17.8	48,051
陸運業(5.3%)			
相鉄ホールディングス	—	11.1	29,931
東急	—	18.2	30,576
東日本旅客鉄道	—	3.9	31,211
西日本鉄道	6.9	—	—
近鉄グループホールディングス	30.7	13.3	57,682
阪急阪神ホールディングス	18.9	22.4	99,769
南海電気鉄道	25.8	17.3	48,578
名古屋鉄道	38.7	27	59,251

銘柄	第4期末 株数（千株）	第5期末 株数（千株）	第5期末 評価額（千円）
ヤマトホールディングス	－	6.6	17,483
九州旅客鉄道	33.9	30.5	93,970
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
上組	8.1	4.6	15,078
情報・通信業(16.2%)			
ＮＥＣネッツエスアイ	48.6	42.2	95,372
ＴＩＳ	36	32.1	97,455
グリー	80.6	－	－
インターネットイニシアティブ	48.4	34.5	95,478
フジ・メディア・ホールディングス	113.8	48	79,440
オービック	5.8	－	－
トレンドマイクロ	13.4	－	－
日本オラクル	10	7.2	83,016
伊藤忠テクノソリューションズ	39.1	－	－
大塚商会	29.5	16.5	98,290
ＢＩＰＲＯＧＹ	－	22.6	95,688
日本テレビホールディングス	117.1	49.9	75,598
スカパーＪＳＡＴホールディングス	147.5	76.9	50,215
日本電信電話	85.1	1,329.1	225,016
ＫＤＤＩ	62.1	40.1	177,803
ソフトバンク	146.5	93.8	160,913
東宝	11.6	－	－
ＳＣＳＫ	59.8	34.8	95,230
卸売業(4.0%)			
アルフレッサ　ホールディングス	78.5	28.1	67,454
シップヘルスケアホールディングス	45.1	7.2	15,998
メディパルホールディングス	72.1	27.1	61,191
伊藤忠商事	55.2	－	－
キヤノンマーケティングジャパン	26.6	16.5	66,759
岩谷産業	22	8.9	56,630
ＰＡＬＴＡＣ	9.9	6.5	29,152
スズケン	34.6	11	53,130
小売業(14.3%)			
ローソン	25.2	13.3	94,709
エービーシー・マート	17.9	6.5	16,474
エディオン	17.4	34.8	52,339
ビックカメラ	－	21.9	28,886
すかいらーくホールディングス	80.8	44.9	92,381
コスモス薬品	2.7	－	－
セブン&アイ・ホールディングス	32.2	18.4	101,016
ツルハホールディングス	－	3.9	48,633
パン・パシフィック・インターナショナルホ	60.9	32.6	109,405
ゼンショーホールディングス	31.6	4.2	30,496
スギホールディングス	13.5	7.9	48,411
しまむら	6.7	－	－
ヤオコー	14.2	8.6	69,462
ケーズホールディングス	67.5	51.5	67,825
アインホールディングス	10.1	－	－
ヤマダホールディングス	211.8	195.4	83,650
ニトリホールディングス	7.9	6	110,070
吉野家ホールディングス	50.6	26.8	83,991
ファーストリテイリング	－	3.7	138,158
サンドラッグ	31.4	20.4	88,556
銀行業(11.5%)			
しずおかフィナンシャルグループ	－	31.8	36,140
九州フィナンシャルグループ	－	72.1	55,163
ひろぎんホールディングス	101.1	100.2	88,817
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	－	45.2	53,675
三井住友トラスト・ホールディングス	19.9	19.5	102,492
三井住友フィナンシャルグループ	－	31.8	213,155
群馬銀行	－	81.7	55,752
八十二銀行	－	87	66,955
セブン銀行	340.6	303.5	88,895
みずほフィナンシャルグループ	129.2	74.2	174,370
山口フィナンシャルグループ	33.1	62.5	77,656
保険業(2.6%)			
ＳＯＭＰＯホールディングス	28.1	－	－
ＭＳ&ＡＤインシュアランスグループホール	39.8	21.6	117,504
東京海上ホールディングス	83.8	32.4	114,080
不動産業(0.7%)			
大東建託	9.9	2.3	36,788
ヒューリック	－	15.5	22,963
サービス業(1.5%)			
綜合警備保障	－	113	90,433
日本郵政	170.8	－	－
セコム	－	3.8	38,722
合計 株数・金額	5,054	5,042	8,831,120
合計 銘柄数<比率>	116	119	<99.4%>

(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。

組入投資信託証券の内容

■ウエスタン･カレンシー･アルファ･ファンドS(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン･テンプルトン･ジャパン株式会社
主な投資対象･投資地域	日本の公社債及び為替予約取引等
運用の基本方針等	この投資信託は、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング･ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。

●損益の状況

項目	第2期 自 2022年11月17日 至 2023年11月16日
(A)有価証券売買損益	**△1,906,164,579円**
売買益	184,505,136
売買損	△2,090,669,715
(B)信託報酬等	**△105,450,243**
(C)当期損益金(A+B)	**△2,011,614,822**
(D)前期繰越損益金	**△1,348,617,518**
(E)追加信託差損益金	**△885,117,074**
(配当等相当額)	(△1,622,951)
(売買損益相当額)	(△883,494,123)
(F)計 (C+D+E)	**△4,245,349,414**
次期繰越損益金(F)	**△4,245,349,414**
追加信託差損益金	△885,117,074
(配当等相当額)	(△2,412,488)
(売買損益相当額)	(△882,704,586)
繰越損益金	△3,360,232,340

●組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	第1期末	第2期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ウエスタン･カレンシー･アルファ･マザーファンド	21,481,305	26,185,019	22,964,262

下記は、ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド全体の内容です。

＜国内(邦貨建)公社債＞

第	2	期	末	
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
国債証券				
第１１６１回国庫短期証券	－	6,050,000	6,050,679	2023/12/11
第１１７７回国庫短期証券	－	2,100,000	2,100,031	2023/11/20
第１１７９回国庫短期証券	－	3,700,000	3,700,427	2023/12/4
第１１８２回国庫短期証券	－	3,500,000	3,500,475	2023/12/18
第１１８４回国庫短期証券	－	6,480,000	6,481,272	2023/12/25
第１１８５回国庫短期証券	－	7,000,000	7,002,454	2024/1/9
合計		28,830,000	28,835,341	

組入投資信託証券の内容

■MA Hedge Fund Strategies Limited

●ファンドの概要

運　用　会　社	UBS Asset Management(Americas)LLC
主な投資対象･投資地域	主として世界各国(日本を含みます。)の企業の株式
運用の基本方針等	主として、公表された合併や買収案件等において、合併案件の公表買収価格と買収先企業または買収元企業の案件成立前の株価の差異を捉える等、収益を積み上げることを目指して運用を行います。

以下の「損益の状況」は「MA Hedge Fund Strategies Limited Audited financial statements Year ended December 29, 2023」の情報を基に、「投資明細表」は当該ファンドの運用会社からの情報を基に掲載しています。

MA Hedge Fund Strategies Limited

●損益の状況(2023年12月29日までの会計期間)

Realized and unrealized gains (losses) on investments in securities, derivative contracts and foreign currency		
Net realized gain on investments in securities and foreign currency	$	12,500,516
Net realized loss on derivative contracts and foreign currency		(20,395,639)
Net change in unrealized appreciation/depreciation on investments in securities and foreign currency		(3,615,543)
Net change in unrealized appreciation/depreciation on derivative contracts and foreign currency		(2,540,520)
Net loss on investments in securities, derivative contracts and foreign currency		(14,051,186)
Investment income		
Interest		3,509,749
Dividends (net of withholding tax of $361,592)		1,714,406
Total investment income		5,224,155
Expenses		
Interest		547,430
Dividends		354,085
Management fees		751,988
Administration fees		68,943
Other		187,161
Total expenses		1,909,607
Net investment income		3,314,548
Net change in net assets resulting from operations	$	(10,736,638)

●投資明細表(2023年12月29日現在)

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
Bond													
CONVERTIBLE CORP													
	314,000	US848577AB85	SPIRIT AIRLINES INC 1.000% 05/15/26 CVT	USD	258,424.57	258,424.57	69.8000	1.0000	219,172.00	219,172.00	-39,252.57	0.00	-39,252.57
	75,000	US848637AF14	SPLUNK INC 1.125% 06/15/27 CVT	USD	70,640.63	70,640.63	97.3500	1.0000	73,012.50	73,012.50	2,371.87	0.00	2,371.87
			Subtotal - CONVERTIBLE CORP			329,065.20				292,184.50	-36,880.70	0.00	-36,880.70
CORP													
	-76,000	US099724AJ55	BORGWARNER INC 3.375% 03/15/25	USD	-82,371.84	-82,371.84	97.9139	1.0000	-74,414.59	-74,414.59	7,957.25	0.00	7,957.25
	-408,000	US13645RBG83	CANADIAN PACIFIC RAILWAY 3.000% 12/02/41	USD	-333,495.63	-333,495.63	89.6802	1.0000	-365,895.02	-365,895.02	-32,399.39	0.00	-32,399.39
	26,000	US20752TAA25	CONNECT FINCO SARL/CONNE 6.750% 10/01/26 SR:144A	USD	27,300.00	27,300.00	99.5025	1.0000	25,870.66	25,870.66	-1,429.34	0.00	-1,429.34
	-84,000	US45866FAJ30	INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.750% 09/21/28	USD	-77,840.28	-77,840.28	97.3114	1.0000	-81,741.56	-81,741.56	-3,901.28	0.00	-3,901.28
	68,000	US45866FAU84	INTERCONTINENTALEXCHANGE 4.000% 09/15/27	USD	64,542.90	64,542.90	98.3195	1.0000	66,857.27	66,857.27	2,314.37	0.00	2,314.37
	793,000	US69327RAJ05	PDC ENERGY INC 5.750% 05/15/26	USD	798,658.01	798,658.01	99.8889	1.0000	792,118.74	792,118.74	-6,539.27	0.00	-6,539.27
	2,020,000	US92047WAD39	VALVOLINE INC 4.250% 02/15/30 SR:144A	USD	1,978,644.15	1,978,644.15	99.3274	1.0000	2,006,413.10	2,006,413.10	27,768.95	0.00	27,768.95
			Subtotal - CORP			2,375,437.31				2,369,208.60	-6,228.71	0.00	-6,228.71
GOVT													
	320,300	US912810TM09	US TREASURY N/B 4.000% 11/15/42	USD	332,144.11	332,144.11	97.5605	1.0000	312,486.44	312,486.44	-19,657.67	0.00	-19,657.67
	43,500	US91282CHV63	US TREASURY N/B 5.000% 08/31/25	USD	43,439.05	43,439.05	100.9473	1.0000	43,912.07	43,912.07	473.02	0.00	473.02
			Subtotal - GOVT			375,583.16				356,398.51	-19,184.65	0.00	-19,184.65
			Subtotal - Bond			3,080,085.67				3,017,791.61	-62,294.06	0.00	-62,294.06
Equity													
ADR													
	3,531	RYAAY US	RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	USD	278,141.03	278,141.03	133.3600	1.0000	470,894.16	470,894.16	192,753.13	0.00	192,753.13
			Subtotal - ADR			278,141.03				470,894.16	192,753.13	0.00	192,753.13
COMMON STOCK													
	370,728	AABA_ESCROW	AABA_ESCROW	USD	1,293,361.10	1,293,361.10	2.4350	1.0000	902,722.79	902,722.79	-390,638.31	0.00	-390,638.31
	802	AACT US	ARES ACQUISITION CORP II	USD	8,020.00	8,020.00	10.4400	1.0000	8,372.88	8,372.88	352.88	0.00	352.88
	1,206	ACEL US	ACCEL ENTERTAINMENT INC	USD	12,795.66	12,795.66	10.2700	1.0000	12,385.62	12,385.62	-410.04	0.00	-410.04
	24,951	ACI US	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	USD	565,041.37	565,041.37	23.0000	1.0000	573,873.00	573,873.00	8,831.63	0.00	8,831.63
	83,889	ADE NO	ADEVINTA ASA	NOK	9,360,940.24	876,290.72	112.4000	10.1724	9,429,123.60	926,932.06	6,702.75	43,938.59	50,641.34
	692	AMC US	AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	USD	14,842.10	14,842.10	6.1200	1.0000	4,235.04	4,235.04	-10,607.06	0.00	-10,607.06
	735	AOGO US	AROGO CAPITAL ACQUISITION -A	USD	7,327.95	7,327.95	10.7600	1.0000	7,908.60	7,908.60	580.65	0.00	580.65
	882	APCA US	AP ACQUISITION CORP-A	USD	8,899.38	8,899.38	11.1300	1.0000	9,816.66	9,816.66	917.28	0.00	917.28
	882	APXI US	APX ACQUISITION CORP I	USD	8,881.74	8,881.74	11.1800	1.0000	9,860.76	9,860.76	979.02	0.00	979.02
	-72,415	ATCOA SS	ATLAS COPCO AB-A SHS	SEK	-8,860,842.61	-834,021.62	173.5500	10.0734	-12,567,623.25	-1,247,604.88	-367,977.12	-45,606.14	-413,583.26
	82,736	ATCOB SS	ATLAS COPCO AB-B SHS	SEK	9,020,674.54	848,322.65	149.4000	10.0734	12,360,758.40	1,227,069.13	331,574.62	47,171.86	378,746.48
	255	BHAC US	FOCUS IMPACT BH3 ACQUISITION	USD	2,534.70	2,534.70	10.4600	1.0000	2,667.30	2,667.30	132.60	0.00	132.60
	882	BRKH US	BURTECH ACQUISITION CORP-A	USD	8,802.36	8,802.36	10.7300	1.0000	9,463.86	9,463.86	661.50	0.00	661.50
	28,447	CERE US	CEREVEL THERAPEUTICS HOLDING	USD	1,177,400.19	1,177,400.19	42.4000	1.0000	1,206,152.80	1,206,152.80	28,752.61	0.00	28,752.61

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
	1,176	CFFS US	CF ACQUISITION CORP VII-CL A	USD	11,712.96	11,712.96	10.8450	1.0000	12,753.72	12,753.72	1,040.76	0.00	1,040.76
	1,445	CHEA US	CHENGHE ACQUISITION CO-A	USD	14,450.00	14,450.00	11.0000	1.0000	15,895.00	15,895.00	1,445.00	0.00	1,445.00
	45,489	CHR DC	CHR HANSEN HOLDING A/S	DKK	22,547,702.68	3,264,318.25	566.2000	6.7535	25,755,871.80	3,813,707.11	475,037.99	74,350.87	549,388.86
	15,078	CPRI US	CAPRI HOLDINGS LTD	USD	789,467.05	789,467.05	50.2400	1.0000	757,518.72	757,518.72	-31,948.33	0.00	-31,948.33
	292	CRC US	CALIFORNIA RESOURCES CORP	USD	12,806.17	12,806.17	54.6800	1.0000	15,966.56	15,966.56	3,160.39	0.00	3,160.39
	735	CSLM US	CSLM ACQUISITION CORP	USD	7,247.10	7,247.10	10.8900	1.0000	8,004.15	8,004.15	757.05	0.00	757.05
	760	CSTA US	CONSTELLATION ACQUISITION-A	USD	7,508.80	7,508.80	11.0500	1.0000	8,398.00	8,398.00	889.20	0.00	889.20
	2,991	CVII US	CHURCHILL CAPITAL CORP VII-A	USD	29,550.00	29,550.00	10.5000	1.0000	31,405.50	31,405.50	1,855.50	0.00	1,855.50
	-44,114	CVX US	CHEVRON CORP	USD	-6,475,655.24	-6,475,655.24	149.1600	1.0000	-6,580,044.24	-6,580,044.24	-104,389.00	0.00	-104,389.00
	756	DSAQ US	DIRECT SELLING ACQUISITION-A	USD	7,578.90	7,578.90	10.8899	1.0000	8,232.76	8,232.76	653.86	0.00	653.86
	4,501	EVLV US	EVOLV TECHNOLOGIES HOLDINGS	USD	14,763.28	14,763.28	4.7200	1.0000	21,244.72	21,244.72	6,481.44	0.00	6,481.44
	750	FEXD US	FINTECH ECOSYSTEM DEVELOPM-A	USD	7,545.00	7,545.00	10.7948	1.0000	8,096.10	8,096.10	551.10	0.00	551.10
	1,200	FIAC US	FOCUS IMPACT ACQUISITION-A	USD	11,934.00	11,934.00	10.8900	1.0000	13,068.00	13,068.00	1,134.00	0.00	1,134.00
	675	FNVT US	FINNOVATE ACQUISITION CORP-A	USD	6,723.00	6,723.00	11.0700	1.0000	7,472.25	7,472.25	749.25	0.00	749.25
	1,529	GAQ US	GENERATION ASIA I ACQUISIT-A	USD	15,496.42	15,496.42	10.8700	1.0000	16,620.23	16,620.23	1,123.81	0.00	1,123.81
	7,350	GHIX US	GORES HOLDING IX INC-CL A	USD	71,148.00	71,148.00	10.5000	1.0000	77,175.00	77,175.00	6,027.00	0.00	6,027.00
	32,762	GLIBA_ESCROW	GLIBA_ESCROW	USD	0.00	0.00	0.1250	1.0000	4,095.25	4,095.25	4,095.25	0.00	4,095.25
	588	HCMA US	HCM ACQUISITION CORP-A	USD	5,909.40	5,909.40	11.1800	1.0000	6,573.84	6,573.84	664.44	0.00	664.44
	4,488	HEIA NA	HEINEKEN NV	EUR	405,584.13	421,644.87	91.9400	1.1039	412,626.72	455,498.64	7,774.31	26,079.46	33,853.77
	-4,572	HEIO NA	HEINEKEN HOLDING NV	EUR	-336,715.95	-350,522.92	76.6000	1.1039	-350,215.20	-386,602.55	-14,901.86	-21,177.77	-36,079.63
	43,051	HES US	HESS CORP	USD	6,221,456.98	6,221,456.98	144.1600	1.0000	6,206,232.16	6,206,232.16	-15,224.82	0.00	-15,224.82
	488	HYAC US	HAYMAKER ACQUISITION CORP 4	USD	4,880.00	4,880.00	10.2700	1.0000	5,011.76	5,011.76	131.76	0.00	131.76
	31,585	IMGN US	IMMUNOGEN INC	USD	925,628.23	925,628.23	29.6500	1.0000	936,495.25	936,495.25	10,867.02	0.00	10,867.02
	35,322	INDUA SS	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	SEK	9,165,938.57	859,231.66	328.9000	10.0734	11,617,405.80	1,153,275.55	243,360.43	50,683.46	294,043.89
	-35,321	INDUC SS	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	SEK	-9,092,839.22	-852,361.95	328.3000	10.0734	-11,595,884.30	-1,151,139.06	-248,480.68	-50,296.43	-298,777.11
	975	IPXX US	INFLECTION POINT ACQUIS-CL A	USD	9,750.00	9,750.00	10.3300	1.0000	10,071.75	10,071.75	321.75	0.00	321.75
	735	IVCB US	INVESTCORP EUROPE ACQUISI-A	USD	7,350.00	7,350.00	11.0200	1.0000	8,099.70	8,099.70	749.70	0.00	749.70
	-4,344	KIM US	KIMCO REALTY CORP	USD	-73,600.00	-73,600.00	21.3100	1.0000	-92,570.64	-92,570.64	-18,970.64	0.00	-18,970.64
	1,760	KRTX US	KARUNA THERAPEUTICS INC	USD	557,498.69	557,498.69	316.5100	1.0000	557,057.60	557,057.60	-441.09	0.00	-441.09
	1,500	LCW US	LEARN CW INVESTMENT CORP-A	USD	16,020.00	16,020.00	10.8400	1.0000	16,260.00	16,260.00	240.00	0.00	240.00
	1,029	MNTN US	EVEREST CONSOLIDATOR ACQUISI	USD	10,290.00	10,290.00	10.9400	1.0000	11,257.26	11,257.26	967.26	0.00	967.26
	578	NFYS US	ENPHYS ACQUISITION CORP	USD	5,780.00	5,780.00	10.6700	1.0000	6,167.26	6,167.26	387.26	0.00	387.26
	5,572	NPAB US	NEW PROVIDENCE ACQUISITION-A	USD	55,218.52	55,218.52	10.6300	1.0000	59,230.36	59,230.36	4,011.84	0.00	4,011.84
	1,156	NUBI US	NUBIA BRAND INTERNATION-CL A	USD	11,560.00	11,560.00	7.7000	1.0000	8,901.20	8,901.20	-2,658.80	0.00	-2,658.80
	-69,833	NZYMB DC	NOVOZYMES A/S-B SHARES	DKK	-22,794,617.75	-3,300,349.83	371.1000	6.7535	-25,915,026.30	-3,837,273.36	-462,043.12	-74,880.41	-536,923.53
	-34,416	O US	REALTY INCOME CORP	USD	-1,801,651.04	-1,801,651.04	57.4200	1.0000	-1,976,166.72	-1,976,166.72	-174,515.68	0.00	-174,515.68
	331,044	O2D GR	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	EUR	778,773.95	845,877.24	2.3520	1.1039	778,615.49	859,513.63	-174.94	13,811.33	13,636.39
	261	OSI US	OSIRIS ACQUISITION CORP-A	USD	2,610.00	2,610.00	10.4000	1.0000	2,714.40	2,714.40	104.40	0.00	104.40
	597	PACE NA	PEGASUS ACQUISITION CO EUR-A	EUR	0.00	0.00	0.0000	1.1039	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	750	PHYT US	PYROPHYTE ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	11.0000	1.0000	8,250.00	8,250.00	750.00	0.00	750.00
	1,156	PLAO US	PATRIA LATIN AMERICAN OPPORT	USD	12,727.56	12,727.56	11.1000	1.0000	12,831.60	12,831.60	104.04	0.00	104.04
	750	PLMI US	PLUM ACQUISITION CORP I-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.8500	1.0000	8,137.50	8,137.50	637.50	0.00	637.50
	39,209	PXD US	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	USD	9,725,970.09	9,725,970.09	224.8800	1.0000	8,817,319.92	8,817,319.92	-908,650.17	0.00	-908,650.17
	750	RCFA US	RCF ACQUISITION CORP-A	USD	7,432.50	7,432.50	10.9800	1.0000	8,235.00	8,235.00	802.50	0.00	802.50
	1,734	RENE US	CARTESIAN GROWTH CORP II- A	USD	18,796.56	18,796.56	10.9400	1.0000	18,969.96	18,969.96	173.40	0.00	173.40
	1,496	ROSS US	ROSS ACQUISITION CORP II -A	USD	14,960.00	14,960.00	10.8900	1.0000	16,291.44	16,291.44	1,331.44	0.00	1,331.44
	7,189	RPT US	RPT REALTY	USD	81,233.91	81,233.91	12.8300	1.0000	92,234.87	92,234.87	11,000.96	0.00	11,000.96
	1,500	RRAC US	RIGEL RESOURCE ACQUISIT-CL A	USD	14,865.00	14,865.00	10.9600	1.0000	16,440.00	16,440.00	1,575.00	0.00	1,575.00
	-6,174	SAVE US	SPIRIT AIRLINES INC	USD	-69,026.30	-69,026.30	16.3900	1.0000	-101,191.86	-101,191.86	-32,165.56	0.00	-32,165.56
	1,284	SBXC US	SILVERBOX CORP III-A	USD	12,840.00	12,840.00	10.3400	1.0000	13,276.56	13,276.56	436.56	0.00	436.56
	8,085	SCRM US	SCREAMING EAGLE ACQ -CLASS A	USD	80,850.00	80,850.00	10.6000	1.0000	85,701.00	85,701.00	4,851.00	0.00	4,851.00
	2,890	SKGR US	SK GROWTH OPPORTUNITIES CO-A	USD	31,139.75	31,139.75	10.8200	1.0000	31,269.80	31,269.80	130.05	0.00	130.05
	862	SLAM US	SLAM CORP-A	USD	8,462.50	8,462.50	10.8500	1.0000	9,352.70	9,352.70	890.20	0.00	890.20

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
	60,692	SPLK US	SPLUNK INC	USD	9,041,167.23	9,041,167.23	152.3500	1.0000	9,246,426.20	9,246,426.20	205,258.97	0.00	205,258.97
	45,174	SRC US	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	USD	1,802,501.22	1,802,501.22	43.6900	1.0000	1,973,652.06	1,973,652.06	171,150.84	0.00	171,150.84
	750	SZZL US	SIZZLE ACQUISITION CORP	USD	8,152.50	8,152.50	11.0099	1.0000	8,257.42	8,257.42	104.92	0.00	104.92
	735	TGVC US	TG VENTURE ACQUISITION CORP	USD	7,298.55	7,298.55	10.8400	1.0000	7,967.40	7,967.40	668.85	0.00	668.85
	-3,150,471	TIT IM	TELECOM ITALIA SPA	EUR	-862,092.77	-940,575.27	0.2942	1.1039	-926,868.56	-1,023,170.25	-71,506.02	-11,088.96	-82,594.98
	3,150,416	TITR IM	TELECOM ITALIA-RSP	EUR	854,041.74	931,743.70	0.3029	1.1039	954,261.06	1,053,408.77	110,632.14	11,032.93	121,665.07
	735	TLGY US	TLGY ACQUISITION CORP - A	USD	8,099.70	8,099.70	11.0800	1.0000	8,143.80	8,143.80	44.10	0.00	44.10
	379	TRIS US	TRISTAR ACQUISITION I CORP-A	USD	3,790.00	3,790.00	10.7850	1.0000	4,087.52	4,087.52	297.52	0.00	297.52
	825	VSAC US	VISION SENSING ACQUISITION-A	USD	8,250.00	8,250.00	11.0500	1.0000	9,116.25	9,116.25	866.25	0.00	866.25
	9,502	VTSO GR Equity_ 1/3/2024 12:00:00 AM	VITESCO TECHNOLOGIES GROUP A	EUR	874,659.10	955,477.60	93.9700	1.1039	892,902.94	985,675.56	20,139.37	10,058.59	30,197.96
	588	WEL US	INTEGRATED WELLNESS ACQ - A	USD	5,880.00	5,880.00	11.2200	1.0000	6,597.36	6,597.36	717.36	0.00	717.36
	23,087	X US	UNITED STATES STEEL CORP	USD	1,130,147.91	1,130,147.91	48.6500	1.0000	1,123,182.55	1,123,182.55	-6,965.36	0.00	-6,965.36
	-91,098	XOM US	EXXON MOBIL CORP	USD	-10,025,767.66	-10,025,767.66	99.9800	1.0000	-9,107,978.04	-9,107,978.04	917,789.62	0.00	917,789.62
			Subtotal - COMMON STOCK			18,268,728.89				18,084,557.57	-258,248.70	74,077.38	-184,171.32
CONTINGENT RIGHT													
	10,910	ABMD US_Dummy CVR_35 USD Cash	ABMD US_Dummy CVR_35 USD Cash	USD	0.00	0.00	2.1250	1.0000	23,183.92	23,183.92	23,183.92	0.00	23,183.92
	15,790	ACHN_CVR	ACHILLION PHARMACEUTICALS INC	USD	0.00	0.00	0.8250	1.0000	13,026.75	13,026.75	13,026.75	0.00	13,026.75
	31,990	BMY-R_CVR	BRISTOL-MYERS SQUIBB-CVR	USD	76,232.78	76,232.78	1.4250	1.0000	45,585.79	45,585.79	-30,646.99	0.00	-30,646.99
	59,797	IGYB_CVR	IGYB_CVR	EUR	0.00	0.00	0.7800	1.1039	46,641.66	51,487.73	51,487.73	0.00	51,487.73
			Subtotal - CONTINGENT RIGHT			76,232.78				133,284.19	57,051.41	0.00	57,051.41
ETF													
	-827	IGV US	ISHARES EXPANDED TECH-SOFTWA	USD	-308,870.13	-308,870.13	405.6400	1.0000	-335,464.28	-335,464.28	-26,594.15	0.00	-26,594.15
	-507	XBI US	SPDR S&P BIOTECH ETF	USD	-40,135.83	-40,135.83	89.2900	1.0000	-45,270.03	-45,270.03	-5,134.20	0.00	-5,134.20
	-1,625	XOP US	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	USD	-214,921.34	-214,921.34	136.9100	1.0000	-222,478.75	-222,478.75	-7,557.41	0.00	-7,557.41
			Subtotal - ETF			-563,927.30				-603,213.06	-39,285.76	0.00	-39,285.76
FUND													
	6,056,035	MPFXX US	MSILF PRIME PORTFOLIO-INST	USD	6,057,818.39	6,057,818.39	1.0005	1.0000	6,059,063.25	6,059,063.25	1,244.86	0.00	1,244.86
			Subtotal - FUND			6,057,818.39				6,059,063.25	1,244.86	0.00	1,244.86
PRIVATE EQUITY													
	4	LNZA144	LNZA144	USD	0.00	0.00	0.0000	1.0000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
			Subtotal - PRIVATE EQUITY			0.00				0.00	0.00	0.00	0.00
UNIT													
	488	ALCYU US	ALCHEMY INVESTMENTS ACQUISIT	USD	4,880.00	4,880.00	10.4900	1.0000	5,119.12	5,119.12	239.12	0.00	239.12
	1,625	ANSCU US	AGRICULTURE & NATURAL SOLUTI	USD	16,250.00	16,250.00	10.1500	1.0000	16,493.75	16,493.75	243.75	0.00	243.75
	1,884	CLBR/U US	COLOMBIER ACQUIS CORP II	USD	18,840.00	18,840.00	10.0800	1.0000	18,990.72	18,990.72	150.72	0.00	150.72
	1,138	NETDU US	NABORS ENERGY TRANSITION COR	USD	11,380.00	11,380.00	10.4800	1.0000	11,926.24	11,926.24	546.24	0.00	546.24
	1	PACEU NA	PEGASUS ACQUISITION CO-UNIT	EUR	0.00	0.00	0.0000	1.1039	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	325	SPKLU US	SPARK I ACQUISITION CORP	USD	3,250.00	3,250.00	10.2000	1.0000	3,315.00	3,315.00	65.00	0.00	65.00
			Subtotal - UNIT			54,600.00				55,844.83	1,244.83	0.00	1,244.83
			Subtotal - Equity			24,171,593.79				24,200,430.94	-45,240.23	74,077.38	28,837.15

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
Forward													
FX FORWARD													
	15,235,398,348	JPY.FWD	JPY per USD @ 141.3167 : 01/31/2024	JPY	15,235,398,348.00	107,810,343.05	1.0000	140.3155	15,235,398,348.00	108,579,552.12	0.00	769,209.07	769,209.07
	-107,810,343	USD.FWD	JPY per USD @ 141.3167 : 01/31/2024	USD	-107,810,343.05	-107,810,343.05	1.0000	1.0000	-107,810,343.05	-107,810,343.05	0.00	0.00	0.00
			Subtotal - FX FORWARD			0.00				769,209.07	0.00	769,209.07	769,209.07
			Subtotal - Forward			0.00				769,209.07	0.00	769,209.07	769,209.07
Medium													
CASH AND EQUIVALENTS													
	-83,480	AUD	Australian Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	AUD	-83,479.62	-54,921.24	1.0000	0.6812	-83,479.62	-56,866.32	0.00	-1,945.08	-1,945.08
	-263	AUD	Australian Dollar - 74991 CITI CFD - OnHand	AUD	-262.71	-3,000.76	1.0000	0.6812	-262.71	-178.96	0.00	2,821.80	2,821.80
	78,025	AUD	Australian Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	AUD	78,025.35	50,884.39	1.0000	0.6812	78,025.35	53,150.87	0.00	2,266.48	2,266.48
	0	AUD	Australian Dollar - 74991 FBCO CFD - OnHand	AUD	0.39	0.30	1.0000	0.6812	0.39	0.27	0.00	-0.03	-0.03
	0	AUD	Australian Dollar - 74991 JPHQ CFD - OnHand	AUD	0.00	102.21	1.0000	0.6812	0.00	0.00	0.00	-102.21	-102.21
	-21,929	AUD	Australian Dollar - 74991 MSCO CFD - OnHand	AUD	-21,928.82	-14,415.82	1.0000	0.6812	-21,928.82	-14,937.91	0.00	-522.09	-522.09
	-421	AUD	Australian Dollar - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	AUD	-421.32	-306.61	1.0000	0.6812	-421.32	-287.00	0.00	19.61	19.61
	462	AUD	Australian Dollar - 74991-GSCO-INTL - OnHand	AUD	462.00	329.73	1.0000	0.6812	462.00	314.71	0.00	-15.02	-15.02
	3	CAD	Canadian Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	CAD	2.62	1.92	1.0000	1.3243	2.62	1.98	0.00	0.06	0.06
	680	CAD	Canadian Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	CAD	679.82	503.58	1.0000	1.3243	679.82	513.34	0.00	9.76	9.76
	-683	CAD	Canadian Dollar - 74991-MSCO-DOMESTIC - OnHand	CAD	-682.85	-547.27	1.0000	1.3243	-682.85	-515.63	0.00	31.64	31.64
	-107	CHF	Swiss Franc - 74991 BARC INTL - OnHand	CHF	-106.82	-111.83	1.0000	1.1885	-106.82	-126.96	0.00	-15.13	-15.13
	107	CHF	Swiss Franc - 74991 CITI INTL - OnHand	CHF	106.91	-1,221.26	1.0000	1.1885	106.91	127.06	0.00	1,348.32	1,348.32
	-509,450	DKK	Danish krone - 74991 BARC INTL - OnHand	DKK	-509,449.93	-73,749.70	1.0000	6.7535	-509,449.93	-75,434.95	0.00	-1,685.25	-1,685.25
	420,269	DKK	Danish krone - 74991 CITI INTL - OnHand	DKK	420,268.63	62,604.25	1.0000	6.7535	420,268.63	62,229.75	0.00	-374.50	-374.50
	-636	EUR	Euro - 74991 BARC INTL - OnHand	EUR	-635.99	-691.58	1.0000	1.1039	-635.99	-702.07	0.00	-10.49	-10.49
	-0	EUR	Euro - 74991 CITI CFD - OnHand	EUR	-0.02	-0.02	1.0000	1.1039	-0.02	-0.02	0.00	0.00	0.00
	-1,767,649	EUR	Euro - 74991 CITI INTL - OnHand	EUR	-1,767,649.14	-1,918,387.00	1.0000	1.1039	-1,767,649.14	-1,951,307.89	0.00	-32,920.89	-32,920.89
	-0	EUR	Euro - 74991 FBCO INTL - OnHand	EUR	-0.38	72.58	1.0000	1.1039	-0.38	-0.42	0.00	-73.00	-73.00
	-59,691	EUR	Euro - 74991 JPHQ CFD - OnHand	EUR	-59,690.91	-66,286.75	1.0000	1.1039	-59,690.91	-65,892.80	0.00	393.95	393.95
	914	EUR	Euro - 74991 JPHQ INTL - OnHand	EUR	914.12	980.42	1.0000	1.1039	914.12	1,009.10	0.00	28.68	28.68
	793	EUR	Euro - 74991 MSCO CFD - OnHand	EUR	792.63	880.22	1.0000	1.1039	792.63	874.98	0.00	-5.24	-5.24
	-377	EUR	Euro - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	EUR	-377.25	-408.12	1.0000	1.1039	-377.25	-416.44	0.00	-8.32	-8.32
	-10,254	EUR	Euro - 74991-GSCO-INTL - OnHand	EUR	-10,254.21	-11,455.44	1.0000	1.1039	-10,254.21	-11,319.62	0.00	135.82	135.82
	-7,851	GBP	Pound Sterling - 74991 BARC INTL - OnHand	GBP	-7,851.10	-9,820.72	1.0000	1.2731	-7,851.10	-9,995.24	0.00	-174.52	-174.52
	-0	GBP	Pound Sterling - 74991 CITI CFD - OnHand	GBP	-0.05	-0.06	1.0000	1.2731	-0.05	-0.06	0.00	0.00	0.00
	12,980	GBP	Pound Sterling - 74991 CITI INTL - OnHand	GBP	12,980.14	16,329.88	1.0000	1.2731	12,980.14	16,525.01	0.00	195.13	195.13

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
	0	GBP	Pound Sterling - 74991 FBCO CFD - OnHand	GBP	0.05	0.07	1.0000	1.2731	0.05	0.06	0.00	-0.01	-0.01
	8,314	GBP	Pound Sterling - 74991 JPHQ CFD - OnHand	GBP	8,314.09	10,599.80	1.0000	1.2731	8,314.09	10,584.66	0.00	-15.14	-15.14
	227	GBP	Pound Sterling - 74991 JPHQ INTL - OnHand	GBP	226.81	281.79	1.0000	1.2731	226.81	288.75	0.00	6.96	6.96
	275	GBP	Pound Sterling - 74991 MSCO CFD - OnHand	GBP	275.16	351.94	1.0000	1.2731	275.16	350.31	0.00	-1.63	-1.63
	-783	GBP	Pound Sterling - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	GBP	-783.02	-976.32	1.0000	1.2731	-783.02	-996.87	0.00	-20.55	-20.55
	-9,844	GBP	Pound Sterling - 74991-GSCO-INTL - OnHand	GBP	-9,843.85	-12,830.00	1.0000	1.2731	-9,843.85	-12,532.21	0.00	297.79	297.79
	-1	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	HKD	-1.43	-0.18	1.0000	7.8115	-1.43	-0.18	0.00	0.00	0.00
	-3	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	HKD	-2.53	-0.32	1.0000	7.8115	-2.53	-0.32	0.00	0.00	0.00
	-1	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 FBCO CFD - OnHand	HKD	-0.68	-0.09	1.0000	7.8115	-0.68	-0.09	0.00	0.00	0.00
	-28,025,906	JPY	Japanese yen - 74991 BARC INTL - OnHand	JPY	-28,025,905.68	-206,842.40	1.0000	141.0400	-28,025,905.68	-198,708.92	0.00	8,133.48	8,133.48
	-229,432	JPY	Japanese yen - 74991 CITI INTL - OnHand	JPY	-229,432.27	-1,656.05	1.0000	141.0400	-229,432.27	-1,626.72	0.00	29.33	29.33
	2	JPY	Japanese yen - 74991 FBCO INTL - OnHand	JPY	2.48	-21.80	1.0000	141.0400	2.48	0.02	0.00	21.82	21.82
	-0	JPY	Japanese yen - 74991 JPHQ CFD - OnHand	JPY	-0.01	2.79	1.0000	141.0400	-0.01	0.00	0.00	-2.79	-2.79
	2,859,046	JPY	Japanese yen - 74991 JPHQ INTL - OnHand	JPY	2,859,045.80	19,913.95	1.0000	141.0400	2,859,045.80	20,271.17	0.00	357.22	357.22
	40,748,176	JPY	Japanese yen - 74991-CAYM-FX - OnHand	JPY	40,748,175.62	6,025,089.72	1.0000	141.0400	40,748,175.62	288,912.20	0.00	-5,736,177.52	-5,736,177.52
	-394,551	JPY	Japanese yen - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	JPY	-394,550.68	-3,235.62	1.0000	141.0400	-394,550.68	-2,797.44	0.00	438.18	438.18
	622,199	JPY	Japanese yen - 74991-GSCO-INTL - OnHand	JPY	622,199.00	4,844.65	1.0000	141.0400	622,199.00	4,411.51	0.00	-433.14	-433.14
	-21,209	NOK	Norwegian Krone - 74991 BARC INTL - OnHand	NOK	-21,208.89	-1,965.53	1.0000	10.1724	-21,208.89	-2,084.94	0.00	-119.41	-119.41
	-9,363,627	NOK	Norwegian Krone - 74991 CITI INTL - OnHand	NOK	-9,363,627.02	-879,374.60	1.0000	10.1724	-9,363,627.02	-920,493.40	0.00	-41,118.80	-41,118.80
	119	NZD	New Zealand Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	NZD	118.56	72.54	1.0000	0.6319	118.56	74.92	0.00	2.38	2.38
	-121	NZD	New Zealand Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	NZD	-121.08	-73.49	1.0000	0.6319	-121.08	-76.51	0.00	-3.02	-3.02
	-49	PLN	Polish zlot - 74991 BARC INTL - OnHand	PLN	-48.50	-11.55	1.0000	3.9360	-48.50	-12.32	0.00	-0.77	-0.77
	50	PLN	Polish zlot - 74991 CITI INTL - OnHand	PLN	49.83	11.87	1.0000	3.9360	49.83	12.66	0.00	0.79	0.79
	0	PLN	Polish zlot - 74991 FBCO CFD - OnHand	PLN	0.21	0.06	1.0000	3.9360	0.21	0.05	0.00	-0.01	-0.01
	-2,585,733	SEK	Swedish Krona - 74991 BARC INTL - OnHand	SEK	-2,585,733.19	-243,407.29	1.0000	10.0734	-2,585,733.19	-256,689.22	0.00	-13,281.93	-13,281.93
	2,867,119	SEK	Swedish Krona - 74991 CITI INTL - OnHand	SEK	2,867,118.91	263,961.80	1.0000	10.0734	2,867,118.91	284,622.76	0.00	20,660.96	20,660.96
	1,581,730	USD	U.S. Dollars - 74991 BARC INTL - OnHand	USD	1,581,729.97	1,581,729.97	1.0000	1.0000	1,581,729.97	1,581,729.97	0.00	0.00	0.00
	-916	USD	U.S. Dollars - 74991 CITI CFD - OnHand	USD	-916.42	-916.42	1.0000	1.0000	-916.42	-916.42	0.00	0.00	0.00
	50,782,629	USD	U.S. Dollars - 74991 CITI DOMESTIC - OnHand	USD	50,782,629.43	50,782,629.43	1.0000	1.0000	50,782,629.43	50,782,629.43	0.00	0.00	0.00
	4,224,485	USD	U.S. Dollars - 74991 CITI INTL - OnHand	USD	4,224,485.08	4,224,485.08	1.0000	1.0000	4,224,485.08	4,224,485.08	0.00	0.00	0.00
	0	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO CFD - OnHand	USD	0.22	0.22	1.0000	1.0000	0.22	0.22	0.00	0.00	0.00
	-0	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO DOMESTIC - OnHand	USD	-0.01	-0.01	1.0000	1.0000	-0.01	-0.01	0.00	0.00	0.00

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
	2	USD	U.S. Dollars - 74991 FBCO INTL - OnHand	USD	1.70	1.70	1.0000	1.0000	1.70	1.70	0.00	0.00	0.00
	-2,585	USD	U.S. Dollars - 74991 GSCO CFD - OnHand	USD	-2,584.68	-2,584.68	1.0000	1.0000	-2,584.68	-2,584.68	0.00	0.00	0.00
	-64,813	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ CFD - OnHand	USD	-64,812.71	-64,812.71	1.0000	1.0000	-64,812.71	-64,812.71	0.00	0.00	0.00
	2,366,052	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ DOMESTIC - OnHand	USD	2,366,051.54	2,366,051.54	1.0000	1.0000	2,366,051.54	2,366,051.54	0.00	0.00	0.00
	614,642	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ INTL - OnHand	USD	614,642.12	614,642.12	1.0000	1.0000	614,642.12	614,642.12	0.00	0.00	0.00
	392,469	USD	U.S. Dollars - 74991 JPHQ OTC Collateral - OnHand	USD	392,469.45	392,469.45	1.0000	1.0000	392,469.45	392,469.45	0.00	0.00	0.00
	0	USD	U.S. Dollars - 74991 MSCO CFD - OnHand	USD	0.01	0.01	1.0000	1.0000	0.01	0.01	0.00	0.00	0.00
	353,709	USD	U.S. Dollars - 74991 MSCO Collateral - OnHand	USD	353,708.77	353,708.77	1.0000	1.0000	353,708.77	353,708.77	0.00	0.00	0.00
	383,942	USD	U.S. Dollars - 74991-CAYM-FX - OnHand	USD	383,942.08	383,942.08	1.0000	1.0000	383,942.08	383,942.08	0.00	0.00	0.00
	10,006,864	USD	U.S. Dollars - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	USD	10,006,863.96	10,006,863.96	1.0000	1.0000	10,006,863.96	10,006,863.96	0.00	0.00	0.00
	910,855	USD	U.S. Dollars - 74991-GSCO-INTL - OnHand	USD	910,854.55	910,854.55	1.0000	1.0000	910,854.55	910,854.55	0.00	0.00	0.00
	12,056,747	USD	U.S. Dollars - 74991-MSCO-DOMESTIC - OnHand	USD	12,056,747.09	12,056,747.09	1.0000	1.0000	12,056,747.09	12,056,747.09	0.00	0.00	0.00
	0	USD	U.S. Dollars - MUFG Cayman - OnHand	USD	0.00	0.00	1.0000	1.0000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	1,967	ZAR	South African rand - 74991 BARC INTL - OnHand	ZAR	1,967.14	110.90	1.0000	18.3621	1,967.14	107.13	0.00	-3.77	-3.77
	39,567	ZAR	South African rand - 74991 CITI INTL - OnHand	ZAR	39,566.54	2,249.61	1.0000	18.3621	39,566.54	2,154.79	0.00	-94.82	-94.82
	-0	ZAR	South African rand - 74991 JPHQ CFD - OnHand	ZAR	-0.03	-314.82	1.0000	18.3621	-0.03	-0.01	0.00	314.81	314.81
	-8,627	ZAR	South African rand - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	ZAR	-8,627.05	-509.98	1.0000	18.3621	-8,627.05	-469.83	0.00	40.15	40.15
	-33,222	ZAR	South African rand - 74991-GSCO-INTL - OnHand	ZAR	-33,221.81	-2,286.01	1.0000	18.3621	-33,221.81	-1,809.26	0.00	476.75	476.75
			Subtotal - CASH AND EQUIVALENTS			86,557,162.89				80,766,069.68	0.00	-5,791,093.21	-5,791,093.21
			Subtotal - Medium			86,557,162.89				80,766,069.68	0.00	-5,791,093.21	-5,791,093.21
Option													
EQUITY WRT													
	401	AACT/WS US	ARES ACQUISITION CORP II-28	USD	0.00	0.00	0.1521	1.0000	60.99	60.99	60.99	0.00	60.99
	380	AENTW US	ADARA ACQUISITION CL A -CW26	USD	36.00	36.00	0.0075	1.0000	2.86	2.86	-33.14	0.00	-33.14
	354	AEON/WS US	PRIVETERRA ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0999	1.0000	35.36	35.36	35.36	0.00	35.36
	750	ALTUW US	ALTITUDE ACQ CL A -CW27	USD	50.70	50.70	0.0230	1.0000	17.25	17.25	-33.45	0.00	-33.45
	450	APACW US	STONEBRIDGE ACQUISITION-CW23	USD	20.25	20.25	0.0308	1.0000	13.86	13.86	-6.39	0.00	-6.39
	297	APXIW US	APX ACQUISITION CORP I -23	USD	29.70	29.70	0.0500	1.0000	14.85	14.85	-14.85	0.00	-14.85
	231	BHACW US	CRIXUS BH3 ACQUISITION -CW26	USD	33.50	33.50	0.0600	1.0000	13.86	13.86	-19.64	0.00	-19.64
	161	BLUA/WS US	BLUERIVER ACQUISIT A -CW26	USD	12.77	12.77	0.0397	1.0000	6.39	6.39	-6.38	0.00	-6.38
	750	BURUW US	TAILWIND ACQUISITION -CW27	USD	180.68	180.68	0.0011	1.0000	0.83	0.83	-179.85	0.00	-179.85
	231	CCTSW US	CACTUS ACQUISITION CORP-CW23	USD	30.03	30.03	0.0300	1.0000	6.93	6.93	-23.10	0.00	-23.10
	392	CFFSW US	CF ACQUISITION VII A -CW27	USD	46.06	46.06	0.0290	1.0000	11.37	11.37	-34.69	0.00	-34.69
	722	CHEAW US	CHENGHE ACQUISITION -A-CW27	USD	0.00	0.00	0.0583	1.0000	42.09	42.09	42.09	0.00	42.09
	1,500	CONXW US	CONX CORP-CLASS A -CW27	USD	145.80	145.80	0.3060	1.0000	459.00	459.00	313.20	0.00	313.20
	356	COOLW US	CORNER GROWTH ACQ CL A -CW27	USD	20.54	20.54	0.0620	1.0000	22.07	22.07	1.53	0.00	1.53
	489	CRCQW US	CALIFORNIA RESOURCES -CW27	USD	6,491.11	6,491.11	19.3800	1.0000	9,476.82	9,476.82	2,985.71	0.00	2,985.71
	5	CRGOW US	FREIGHTOS LTD-CW28	USD	2.88	2.88	0.1000	1.0000	0.50	0.50	-2.38	0.00	-2.38

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
	223	CSLMW US	CONSILIUM ACQUISITION -27	USD	26.20	26.20	0.0446	1.0000	9.95	9.95	-16.25	0.00	-16.25
	455	CSTA/WS US	CONSTELLATION ACQ A -CW27	USD	40.95	40.95	0.0190	1.0000	8.65	8.65	-32.30	0.00	-32.30
	628	CVII/WS US	CHURCHILL CAPITAL VII -CW28	USD	35.51	35.51	0.1301	1.0000	81.71	81.71	46.20	0.00	46.20
	498	DHCAW US	DHC ACQUISITION CORP A -CW27	USD	109.56	109.56	0.0200	1.0000	9.96	9.96	-99.60	0.00	-99.60
	273	DISAW US	DISRUPTIVE ACQ CL A -CW26	USD	223.83	223.83	0.0252	1.0000	6.88	6.88	-216.95	0.00	-216.95
	195	DPCSW US	DP CAP ACQUISITION A -CW23	USD	36.08	36.08	0.0200	1.0000	3.90	3.90	-32.18	0.00	-32.18
	2,250	EVLVW US	NEWHOLD INVESTMENT A -CW25	USD	1,378.13	1,378.13	0.7601	1.0000	1,710.23	1,710.23	332.10	0.00	332.10
	578	FGAA-WU CN	FG ACQUISITION CORP-CW30	USD	820.76	820.76	1.1000	1.0000	635.80	635.80	-184.96	0.00	-184.96
	106	FICVW US	FRONTIER INVESTMENT A -CW23	USD	0.00	0.00	0.0540	1.0000	5.72	5.72	5.72	0.00	5.72
	423	FNVTW US	FINNOVATE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.0070	1.0000	2.96	2.96	2.96	0.00	2.96
	538	GAMCW US	GOLDEN ARROW MERGER A -CW26	USD	62.35	62.35	0.1393	1.0000	74.94	74.94	12.59	0.00	12.59
	2,764	GAQ/WS US	GENERATION ASIA I ACQ -CW23	USD	414.60	414.60	0.0300	1.0000	82.92	82.92	-331.68	0.00	-331.68
	424	GETRW US	INTERPRIVATE II ACQU -CW28	USD	0.00	0.00	0.0035	1.0000	1.49	1.49	1.49	0.00	1.49
	825	GFJW GR	GFJ ESG ACQUISITION I SE-CW	EUR	412.50	411.47	0.0010	1.1039	0.83	0.92	-454.44	43.89	-410.55
	2,450	GHIXW US	GORES HOLDING IX -CW24	USD	943.25	943.25	0.1180	1.0000	289.10	289.10	-654.15	0.00	-654.15
	600	GIAFW US	GIGCAPITAL5 INC -CW28	USD	0.00	0.00	0.0065	1.0000	3.90	3.90	3.90	0.00	3.90
	244	HYAC/WS US	HAYMAKER ACQUISITION CORP-28	USD	0.00	0.00	0.1567	1.0000	38.23	38.23	38.23	0.00	38.23
	375	IFIN/WS US	INFINT ACQUISITION CORP-CW27	USD	0.00	0.00	0.0081	1.0000	3.04	3.04	3.04	0.00	3.04
	191	INTEW US	INTEGRAL ACQUISITION -CW28	USD	0.00	0.00	0.0701	1.0000	13.39	13.39	13.39	0.00	13.39
	487	IPXXW US	INFLECTION POINT ACQUIS-C-28	USD	0.00	0.00	0.0900	1.0000	43.83	43.83	43.83	0.00	43.83
	722	IVCAW US	INVESTCORP INDIA ACQUISI -27	USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	21.66	21.66	21.66	0.00	21.66
	641	JTAIW US	OXBRIDGE ACQUISITION -CW23	USD	27.11	27.11	0.0400	1.0000	25.64	25.64	-1.47	0.00	-1.47
	562	JWSM/WS US	JAWS MUSTANG ACQ C -CW26	USD	0.00	0.00	0.0397	1.0000	22.31	22.31	22.31	0.00	22.31
	1,439	KCGI/WS US	KENSINGTON CAPITAL ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.1000	1.0000	143.90	143.90	143.90	0.00	143.90
	562	KWACW US	KINGSWOOD ACQ CL A -CW27	USD	115.21	115.21	0.1000	1.0000	56.20	56.20	-59.01	0.00	-59.01
	373	LCAHW US	LANDCADIA HOLDINGS IV -CW28	USD	0.00	0.00	0.0649	1.0000	24.21	24.21	24.21	0.00	24.21
	750	LCW/WS US	LEARN CW INVESTMENT A -CW28	USD	0.00	0.00	0.0200	1.0000	15.00	15.00	15.00	0.00	15.00
	606	LGSTW US	SEMPER PARATUS ACQU -CW26	USD	0.00	0.00	0.0400	1.0000	24.24	24.24	24.24	0.00	24.24
	78	MAQCW US	MAQUIA CAPITAL ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0185	1.0000	1.44	1.44	1.44	0.00	1.44
	442	MCAAW US	MOUNTAIN & CO I ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.0311	1.0000	13.75	13.75	13.75	0.00	13.75
	106	MITAW US	COLISEUM ACQUISITION A -CW28	USD	0.00	0.00	0.0400	1.0000	4.24	4.24	4.24	0.00	4.24
	525	MLECW US	MOOLEC SCIENCE SA	USD	131.30	131.30	0.0220	1.0000	11.55	11.55	-119.75	0.00	-119.75
	370	MNTN/WS US	EVEREST CONSOLIDATOR -CW23	USD	0.00	0.00	0.1300	1.0000	48.10	48.10	48.10	0.00	48.10
	473	MSAIW US	SPORTSMAP TECH ACQ -CW27	USD	0.00	0.00	0.0460	1.0000	21.76	21.76	21.76	0.00	21.76
	569	NETDW US	NABORS ENERGY TRANSITI-CW	USD	0.00	0.00	0.1300	1.0000	73.97	73.97	73.97	0.00	73.97
	750	NIRWQ US	KLUDEIN I ACQUISITION-CW27	USD	292.50	292.50	0.0009	1.0000	0.68	0.68	-291.82	0.00	-291.82
	2,227	NPABW US	NEW PROVIDENCE ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0495	1.0000	110.24	110.24	110.24	0.00	110.24
	578	NUBIW US	NUBIA BRAND INTERN -CW27	USD	0.00	0.00	0.0470	1.0000	27.17	27.17	27.17	0.00	27.17
	268	NVNIW US	NVNI GROUP LTD-28	USD	56.28	56.28	0.0365	1.0000	9.78	9.78	-46.50	0.00	-46.50
	156	OPTXW US	OMNILIT ACQUISITION CL A -23	USD	0.00	0.00	0.1109	1.0000	17.30	17.30	17.30	0.00	17.30
	750	OTECW US	OCEANTECH ACQUISITIONS- CW A	USD	0.00	0.00	0.0235	1.0000	17.63	17.63	17.63	0.00	17.63
	340	OXUSW US	OXUS ACQUISITION CORP -CW23	USD	0.00	0.00	0.0500	1.0000	17.00	17.00	17.00	0.00	17.00
	156	PBAXW US	PHOENIX BIOTECH ACQ -CW26	USD	0.00	0.00	0.0235	1.0000	3.67	3.67	3.67	0.00	3.67
	231	PEPLW US	PEPPERLIME HEALTH ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.0301	1.0000	6.95	6.95	6.95	0.00	6.95
	578	PLAOW US	PATRIA LATIN AMERICAN-CW27	USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	17.34	17.34	17.34	0.00	17.34
	253	PMGMW US	PRIVETERRA ACQ CL A -CW25	USD	73.40	73.40	0.0175	1.0000	4.43	4.43	-68.97	0.00	-68.97
	919	PUCKW US	GOAL ACQUISITIONS CORP-CW	USD	0.00	0.00	0.0037	1.0000	3.40	3.40	3.40	0.00	3.40
	307	PWUPW US	POWERUP ACQUISITION -CW27	USD	0.00	0.00	0.0600	1.0000	18.42	18.42	18.42	0.00	18.42
	231	RCVRW GR	SMG EUROPEAN RECOVERY-CW27	EUR	4.62	4.96	0.0010	1.1039	0.23	0.25	-4.85	0.14	-4.71
	223	RDZNW US	VAHANNA TECH EDGE -CW24	USD	0.00	0.00	0.0699	1.0000	15.59	15.59	15.59	0.00	15.59
	578	RENEW US	CARTESIAN GROWTH CORP II -28	USD	0.00	0.00	0.1300	1.0000	75.14	75.14	75.14	0.00	75.14
	735	RMCOW US	AMERICAN ACQ -CL A -CW26	USD	137.89	137.89	0.0323	1.0000	23.74	23.74	-114.15	0.00	-114.15
	600	RMGCW US	RMG ACQUISITION CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0650	1.0000	39.00	39.00	39.00	0.00	39.00

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額(現地通貨)	簿価金額($)	評価単価($)	為替レート	評価金額(現地通貨)	評価金額($)	評価損益($)	為替評価損益($)	評価損益計($)
	231	ROSEW US Equity_ 11/21/2023 12:00:00 AM	ROSE HILL ACQUISITION -CW24	USD	0.00	0.00	0.0190	1.0000	4.39	4.39	4.39	0.00	4.39
	429	SBXC/WS US	SILVERBOX CORP III-28	USD	0.00	0.00	0.0800	1.0000	34.32	34.32	34.32	0.00	34.32
	2,695	SCRMW US	SCREAMING EAGLE ACQ CL A -27	USD	0.00	0.00	0.4501	1.0000	1,213.02	1,213.02	1,213.02	0.00	1,213.02
	231	SEDA/WS US	SDCL EDGE ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.0315	1.0000	7.27	7.27	7.27	0.00	7.27
	381	SEPAW US	MERCURY ECOMMERCE ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.0750	1.0000	28.58	28.58	28.58	0.00	28.58
	750	SFRTW US	PROPTECH INV CORP 2 -CW27	USD	374.25	374.25	0.0000	1.0000	0.00	0.00	-374.25	0.00	-374.25
	1,445	SKGRW US	SK GROWTH OPPORTUNITIES -29	USD	0.00	0.00	0.0700	1.0000	101.15	101.15	101.15	0.00	101.15
	416	SLACW US	SOCIAL LEVERAGE ACQ A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0192	1.0000	7.99	7.99	7.99	0.00	7.99
	750	SPECW US	PERCEPTION CAPITAL II -CW28	USD	0.00	0.00	0.0060	1.0000	4.50	4.50	4.50	0.00	4.50
	937	SUAC/WS US Equity_ 12/12/2023 12:00:00 AM	SHOULDERUP TECHNOLOGY -CW23	USD	0.00	0.00	0.0250	1.0000	23.43	23.43	23.43	0.00	23.43
	156	SWSSW US	SPRINGWATER SPECIAL SIT-CW26	USD	0.00	0.00	0.0750	1.0000	11.70	11.70	11.70	0.00	11.70
	649	TGVCW US	TG VENTURE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.0148	1.0000	9.61	9.61	9.61	0.00	9.61
	45	TRIS/WS US	TRISTAR ACQ I CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.0236	1.0000	1.06	1.06	1.06	0.00	1.06
	350	TRONW US	CORNER GROWTH ACQUISITI-CW23	USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	10.50	10.50	10.50	0.00	10.50
	600	USCTW US	TKB CRITICAL TECHNOLOG -CW23	USD	0.00	0.00	0.0250	1.0000	15.00	15.00	15.00	0.00	15.00
	618	VSACW US	VISION SENSING ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.0060	1.0000	3.71	3.71	3.71	0.00	3.71
	60	WINVW US	WINVEST ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.0075	1.0000	0.45	0.45	0.45	0.00	0.45
	486	WRACW US	WILLIAMS ROWLAND ACQ -CW22	USD	0.00	0.00	0.0000	1.0000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
			Subtotal - EQUITY WRT			12,815.61				15,604.93	2,745.29	44.03	2,789.32
			Subtotal - Option			12,815.61				15,604.93	2,745.29	44.03	2,789.32
Swap													
EQUITY SWAP													
	35,733	ESW_APPS SM	ESW_APPLUS SERVICES SA	EUR	0.00	0.00	10.0000	1.1039	1,518.61	1,676.39	1,676.39	0.00	1,676.39
	6,918	ESW_BIO3 GR	ESW_BIOTEST AG	EUR	0.00	0.00	31.0000	1.1039	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	3,039	ESW_BMG1624R1079	ESW_BROOKFIELD PROP PFD LP 6.250% 07/26/81	USD	0.00	0.00	12.4300	1.0000	-1,154.82	-1,154.82	-1,154.82	0.00	-1,154.82
	29,776	ESW_DPH LN	ESW_DECHRA PHARMACEUTICALS PLC	GBP	0.00	0.00	38.5800	1.2731	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	491	ESW_FNWR LN	ESW_FINANCIALS ACQUISITION CORP	GBP	0.00	0.00	0.0300	1.2731	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-18,835	ESW_GRF SM_USD	ESW_GRIFOLS SA	USD	0.00	0.00	17.0608	1.0000	-26,457.14	-24,694.09	-26,457.14	1,763.05	-24,694.09
	26,463	ESW_GRFS US	ESW_GRIFOLS SA	USD	0.00	0.00	11.5600	1.0000	33,872.64	33,872.64	33,872.64	0.00	33,872.64
	144,661	ESW_NETW LN	ESW_NETWORK INTERNATIONAL HOLDINGS PLC	GBP	0.00	0.00	3.8980	1.2731	-2,454.54	-3,124.87	-3,124.87	0.00	-3,124.87
	-18,798	ESW_RYA ID_USD	ESW_RYANAIR HOLDINGS PLC	USD	0.00	0.00	21.0569	1.0000	7,032.47	7,032.47	4,638.17	2,394.30	7,032.47
	-33,938	ESW_SKG ID_USD	ESW_SMURFIT KAPPA GROUP PLC	USD	0.00	0.00	39.6079	1.0000	-35,644.13	-35,644.13	-15,205.62	-20,438.51	-35,644.13
	-849	ESW_SPY US	ESW_SPDR S&P 500 ETF TRUST	USD	0.00	0.00	475.3100	1.0000	-13,762.29	-13,762.29	-13,762.29	0.00	-13,762.29
	2,166	ESW_UNO1 GR	ESW_UNIPER SE	EUR	0.00	0.00	58.0000	1.1039	8,339.10	9,205.53	9,205.53	0.00	9,205.53
	33,938	ESW_WRK US	ESW_WESTROCK CO	USD	0.00	0.00	41.5200	1.0000	-5,815.67	-5,815.67	-5,815.67	0.00	-5,815.67
			Subtotal - EQUITY SWAP			0.00				-32,408.84	-16,127.68	-16,281.16	-32,408.84
			Subtotal - Swap			0.00				-32,408.84	-16,127.68	-16,281.16	-32,408.84
			Report Totals:			113,821,657.96				108,736,697.39	-120,916.68	-4,964,043.89	-5,084,960.57

組入投資信託証券の内容

■MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

●ファンドの概要

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
主な投資対象･投資地域	世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物
運用の基本方針等	この投資信託は、世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉し、各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング･ショート戦略等によりポートフォリオを構築することにより、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

以下の「損益の状況」は「MANAGED FUND / GRAHAM QUANT MACRO FUND LIMITED ANNUAL REPORT AND AUDITED FINANCIAL STATEMENTS For the period from 1 June 2022 to 31 May 2023」の情報を基に、「組入銘柄」は当該ファンドの運用会社からの情報を基に掲載しています。

MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited

●損益の状況(2023年5月31日までの会計期間)

(単位:円)

	31 May 2023	*31 May 2022*
Gross dividend income	-	-
Interest income	1,521,233.00	6,517.00
Net change in fair value on financial assets and financial liabilities at fair value through profit or loss	3,685,957.00	1,071,524,990.00
Total investment income/(loss)	5,207,190.00	1,071,531,507.00
Administrative and custodian fees	(42,104,813.00)	(28,884,441.00)
Management and performance fees	(49,922,185.00)	(135,133,988.00)
Dividend expenses	-	-
Interest expenses	-	-
Other expenses	(32,962,920.00)	(27,900,491.00)
Total expenses	(124,989,918.00)	(191,918,920.00)
Finance costs	(16,192,567.00)	(8,469,770.00)
(Loss)/profit before taxation	(135,975,295.00)	871,142,818.00
Taxation	-	-
(Decrease)/increase in net assets from operations attributable to holders of redeemable participating preference shares	(135,975,295.00)	871,142,818.00

Continuing operations: All items dealt with in arriving at the (decrease)/increase in net assets from operations attributable to holders of redeemable participating preference shares for the periods ended 31 May 2023 and 31 May 2022 relate to continuing operations.

●組入銘柄(2023年5月31日現在)

組入ロング上位10銘柄

	銘柄名	種別	通貨	組入比率
1	CANADIAN DO 0623	FX	USD	14.8%
2	AUSTRALIAN 0623	FX	USD	12.1%
3	FTSE 100 IN 0623	INDEX	GBP	11.6%
4	CHF CURRENCY FU 0623	FX	USD	11.6%
5	DAX INDEX 0623	INDEX	EUR	11.3%
6	EURO STOXX 0623	INDEX	EUR	10.5%
7	NIKKEI 225 0623	INDEX	JPY	9.3%
8	JAPANESE YE 0623	FX	USD	7.7%
9	EURO FX 0623	FX	USD	7.6%
10	BRITISH POU 0623	FX	GBP	7.4%

組入ショート上位10銘柄

	銘柄名	種別	通貨	組入比率
1	CANADIAN DO 0623	FX	CAD	△14.8%
2	AUSTRALIAN 0623	FX	AUD	△11.7%
3	CHF CURRENCY FU 0623	FX	CHF	△11.4%
4	US 2 YR NOTE FU 0923	GOVERNMENT	USD	△8.3%
5	JAPANESE YE 0623	FX	JPY	△7.6%
6	BRITISH POU 0623	FX	USD	△7.4%
7	EURO FX 0623	FX	EUR	△7.4%
8	DOW JONES M 0623	INDEX	USD	△6.8%
9	EURO SCHATZ 0623	GOVERNMENT	EUR	△6.7%
10	3MO EURO EURIBO 0624	FUTURES	EUR	△6.2%

※組入比率は対純資産総額比です。(キャッシュを除いた上位10ポジションを記載しています。)

国内株式インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第24期（決算日　2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【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。
・－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。

<409880>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	14,548	4.5	97.0	1.7	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	18,273	25.6	98.5	1.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	18,688	2.3	98.3	1.9	497,213
第23期(2023年5月29日)	21,924	15.5	21,591	15.5	98.5	1.5	560,044
第24期(2024年5月29日)	28,463	29.8	28,021	29.8	98.2	1.7	664,653

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2023年 5月29日	21,924	－	21,591	－	98.5	1.5
5月末	21,620	△1.4	21,303	△1.3	98.6	1.4
6月末	23,253	6.1	22,911	6.1	98.7	1.2
7月末	23,600	7.6	23,253	7.7	99.2	0.8
8月末	23,701	8.1	23,354	8.2	99.5	0.5
9月末	23,825	8.7	23,473	8.7	98.6	1.0
10月末	23,113	5.4	22,770	5.5	98.6	1.3
11月末	24,363	11.1	24,005	11.2	98.7	1.3
12月末	24,310	10.9	23,951	10.9	98.8	1.2
2024年 1月末	26,208	19.5	25,822	19.6	99.3	0.6
2月末	27,498	25.4	27,094	25.5	99.2	0.7
3月末	28,717	31.0	28,295	31.1	98.2	1.7
4月末	28,461	29.8	28,037	29.9	98.0	2.0
(当期末)						
2024年 5月29日	28,463	29.8	28,021	29.8	98.2	1.7

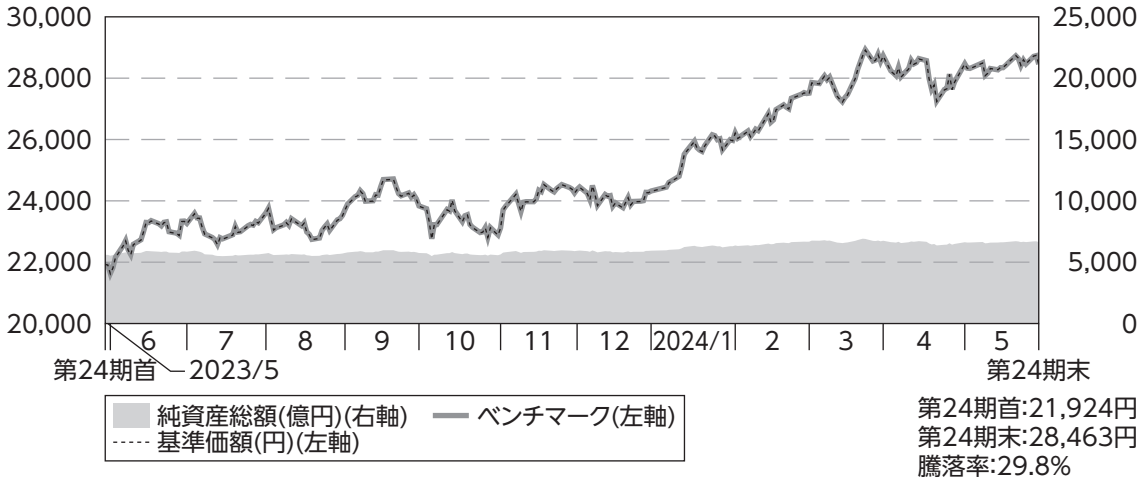
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。
TOPIX（東証株価指数）とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

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

投資環境

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

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。
（1）先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。
　なお、ヘッジ目的で、株価指数先物取引を適宜活用しています。
（2）TOPIX構成銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、ベンチマークの個別銘柄構成比率に極力合わせたポートフォリオを組成しました。

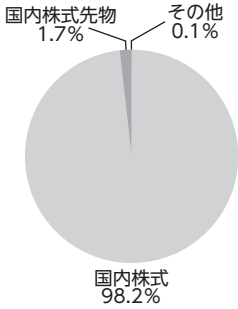
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

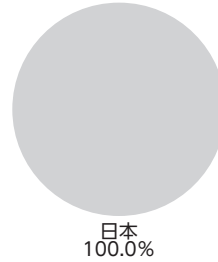
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	4.7%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.5%
3	ソニーグループ	日本	2.2%
4	日立製作所	日本	2.0%
5	東京エレクトロン	日本	1.9%
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.8%
7	キーエンス	日本	1.8%
8	東証株価指数先物 2406	日本	1.7%
9	三菱商事	日本	1.7%
10	三井物産	日本	1.6%
組入銘柄数		2,066	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

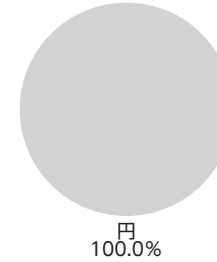
○資産別配分



○国別配分



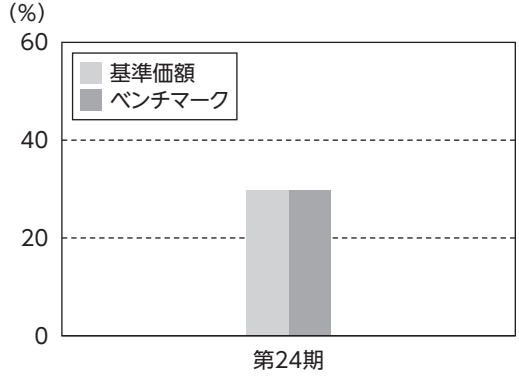
○通貨別配分



（注1）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
その他は未収・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1.7%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年5月30日~2024年5月29日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	(−)	(−)	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
（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)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	−	−	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(−)	(−)	
（新株予約権証券）	(−)	(−)	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
（オプション証券等）	(−)	(−)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(−)	(−)	
（公社債）	(−)	(−)	
（投資信託証券）	(−)	(−)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(−)	(−)	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）	(−)	(−)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.000	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（24,889円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株　式＞

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	16,352 (82,719)	35,599,639 (12,513)	37,136	79,516,813

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜新株予約権証券＞

	当期			
	買付		売付	
	証券数	金額	証券数	金額
	証券	千円	証券	千円
国内	－ (32,800)	－ (－)	－ (32,800)	－ (－)

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種類別		当期			
		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	株式先物取引	百万円 83,811	百万円 81,904	百万円 －	百万円 －

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項目	当期
(a)当期中の株式売買金額	115,116,452千円
(b)当期中の平均組入株式時価総額	596,954,255千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.19

(注1)(b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2)(c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※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	87	87	100.0	87	87	100.0
コール・ローン	1,043,710	93,646	9.0	1,041,040	93,040	8.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
株式	69百万円	195百万円	2,119百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。
(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

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

組入資産の明細

＜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	9.5	9.8	36,309
ニッスイ	250.3	236.4	205,762
マルハニチロ	37.1	35.1	111,407
雪国まいたけ	21.3	20.1	19,396
カネコ種苗	7.7	6.7	9,500
サカタのタネ	28.5	26.9	89,980
ホクト	22.3	18.9	34,435
ホクリヨウ	2.8	1.3	1,289
鉱業(0.4%)			
住石ホールディングス	30.3	30.1	41,538
日鉄鉱業	10	9.5	49,020
三井松島ホールディングス	11.3	14	64,400
ＩＮＰＥＸ	925.6	794	1,932,199
石油資源開発	29	27.4	183,032
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	11.3	10.7	40,285
建設業(2.0%)			
ショーボンドホールディングス	34.1	32.2	192,266
ミライト・ワン	82.8	71.4	133,196
タマホーム	15.7	14.9	67,348
サンヨーホームズ	2.4	0.9	654
日本アクア	8.1	3.3	2,861
ファーストコーポレーション	5	2.3	1,796
ベステラ	4.2	1.9	1,797
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	42.6	－	－
キャンディル	3.5	1.4	837
ダイセキ環境ソリューション	3.9	1.6	1,585
第一カッター興業	6.4	6.8	9,853
安藤・間	145	137	154,262
東急建設	71.3	74.1	56,390
コムシスホールディングス	84.7	75.5	235,258
ビーアールホールディングス	39.7	34.7	12,249
高松コンストラクショングループ	16.3	17.6	49,878
東建コーポレーション	7.2	5.9	62,835
ソネック	2.1	0.8	740
ヤマウラ	12.7	12	15,456
オリエンタル白石	89.9	87.5	31,062
大成建設	163.8	151.5	918,696
大林組	626.1	591.4	1,086,697
清水建設	526.3	468.9	409,302
飛島建設	19.3	17	25,109
長谷工コーポレーション	180.7	151.7	266,461
松井建設	16.3	15.4	12,073
錢高組	1.7	0.8	3,496
鹿島建設	388.2	366.7	964,237
不動テトラ	12.1	11.4	28,944
大末建設	5	2.2	3,817
鉄建建設	12.6	11.9	30,940
西松建設	29.7	31.5	137,340
三井住友建設	141.2	123.1	47,393
大豊建設	7.2	5.7	19,380
佐田建設	8.7	3.5	2,625
ナカノフドー建設	9.7	3.9	1,969
奥村組	28.4	26.8	130,248
東鉄工業	24.1	20.5	62,320
イチケン	3.1	1.4	3,570
富士ピー・エス	6.1	2.4	1,058
淺沼組	14	12.2	43,920
戸田建設	215.4	223.8	241,144
熊谷組	29.3	27.3	98,553
北野建設	2.6	1	3,600
植木組	3.9	1.6	2,620
矢作建設工業	23.8	22.5	34,290
ピーエス三菱	22.2	21	21,273
日本ハウスホールディングス	34.7	35.3	10,872
新日本建設	24.6	23.2	35,124
東亜道路工業	7	32.9	39,348
日本道路	3.5	19.4	33,853
東亜建設工業	15	51.1	47,625
日本国土開発	52.5	47	22,607
若築建設	7.8	5.7	19,579
東洋建設	56.7	41.7	57,796
五洋建設	248.2	234.5	148,461
世紀東急工業	22.5	21.2	35,340
福田組	6.6	6.2	32,984
住友林業	134.3	142.9	764,086
日本基礎技術	8.2	3.3	1,844
巴コーポレーション	15.2	6.9	5,520
大和ハウス工業	489.2	457.3	1,858,467
ライト工業	32.4	32.9	65,207
積水ハウス	548.4	501.6	1,755,600
日特建設	16.7	15.8	17,079

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
北陸電気工事	12	11.3	13,311
ユアテック	38.6	36.4	58,713
日本リーテック	15.4	12.9	14,577
四電工	7.3	6.9	24,460
中電工	27.2	25.7	82,368
関電工	95.9	103.6	182,336
きんでん	123.2	115	372,025
東京エネシス	17.4	15.4	20,682
トーエネック	5.8	5.5	27,995
住友電設	16.7	15.7	54,793
日本電設工業	28.8	31	60,016
エクシオグループ	80.6	161.6	257,105
新日本空調	9.7	10.7	47,026
九電工	42.6	35.7	232,764
三機工業	38.8	35.7	76,933
日揮ホールディングス	173.2	163.6	206,381
中外炉工業	5.7	5.4	16,983
ヤマト	11.3	4.6	5,106
太平電業	10.9	10.3	51,448
高砂熱学工業	42.2	44.3	286,178
三晃金属工業	1.7	0.7	3,136
朝日工業社	7.3	15.4	21,128
明星工業	30.1	32	40,992
大氣社	20.2	19.1	98,747
ダイダン	11.5	21.7	71,176
日比谷総合設備	15	12	36,540
フィル・カンパニー	3.1	2.6	1,591
テスホールディングス	18.9	35.6	14,240
インフロニア・ホールディングス	183.5	190.6	258,548
東洋エンジニアリング	23.2	24.3	23,157
レイズネクスト	25.3	23.9	42,064
食料品(3.1%)			
ニップン	47.4	49.7	111,974
日清製粉グループ本社	162.5	153.5	266,015
日東富士製粉	3.1	3	18,660
昭和産業	15.3	16.1	50,151
鳥越製粉	10.9	4.9	3,283
中部飼料	24.3	23	34,408
フィード・ワン	25.7	24.3	21,748
東洋精糖	2.5	1	1,666
日本甜菜製糖	10.2	9.7	18,837
DM三井製糖ホールディングス	17.4	16.5	51,810
塩水港精糖	16.4	7.2	1,987
ウェルネオシュガー	9.1	8.3	19,173
森永製菓	32.1	70.7	172,790
中村屋	4.4	4.1	13,222
江崎グリコ	50.3	47.5	187,102
名糖産業	6.9	6.5	11,700
井村屋グループ	9.6	9.9	25,066
不二家	12	11.4	28,283
山崎製パン	117.6	111.1	371,518
第一屋製パン	2.6	1	583
モロゾフ	5.7	5.4	22,653
亀田製菓	11.2	9.5	37,240
寿スピリッツ	18.7	78.5	133,293
カルビー	80.5	76	231,040
森永乳業	31.9	58	181,308
六甲バター	12.9	12.2	17,116
ヤクルト本社	125.6	237.3	672,270
明治ホールディングス	217.9	203.5	701,871
雪印メグミルク	42.5	40.2	100,379
プリマハム	23.6	22.3	51,914
日本ハム	68.7	71.4	341,720
林兼産業	4.2	1.8	919
丸大食品	17.7	16.7	27,404
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	19.4	18.3	51,880
柿安本店	6.9	6.5	16,438
伊藤ハム米久ホールディングス	134.3	25.4	104,521
サッポロホールディングス	57.9	54.7	282,908
アサヒグループホールディングス	406.1	383.6	2,183,834
キリンホールディングス	793.1	691.6	1,481,753
宝ホールディングス	120	111.9	117,439
オエノンホールディングス	52.5	49.6	17,608
養命酒製造	5.8	5.5	12,331
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	137.7	130.1	231,187
ライフドリンク　カンパニー	－	3.3	17,490
サントリー食品インターナショナル	123.8	116.9	664,576
ダイドーグループホールディングス	10	18.8	47,752
伊藤園	59.6	56.3	204,763
キーコーヒー	19.7	18.6	37,665
ユニカフェ	4.5	1.8	1,639
ジャパンフーズ	2.1	0.9	1,790
日清オイリオグループ	24.8	23.4	111,969
不二製油グループ本社	40.9	38.7	93,905
かどや製油	1.6	0.7	2,537
Ｊ－オイルミルズ	17.9	19	36,157
キッコーマン	116.5	550.1	981,653
味の素	424.4	394.5	2,284,155
ブルドックソース	9.3	8.8	17,001

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
キユーピー	94.5	89.2	271,614
ハウス食品グループ本社	53.8	57.2	164,049
カゴメ	81.9	71.4	254,255
焼津水産化学工業	5.4	－	－
アリアケジャパン	15.3	16.6	84,826
ピエトロ	2	0.8	1,428
エバラ食品工業	4.7	4	11,320
やまみ	1.3	0.8	2,404
ニチレイ	80.5	76.1	267,034
東洋水産	88.8	83.9	932,548
イートアンドホールディングス	7.5	7.9	15,958
大冷	1.7	0.8	1,528
ヨシムラ・フード・ホールディングス	11.1	7.6	11,248
日清食品ホールディングス	61.8	175.1	692,520
永谷園ホールディングス	8.6	8.1	17,739
一正蒲鉾	5.9	2.4	1,826
フジッコ	18.1	17.1	31,327
ロック・フィールド	19.7	20.3	29,658
日本たばこ産業	1,157	1,008.9	4,450,257
ケンコーマヨネーズ	12.1	11.4	20,873
わらべや日洋ホールディングス	12.9	11.1	25,585
なとり	11	10.4	21,860
イフジ産業	2.3	1.1	1,467
ファーマフーズ	25.2	23.7	20,026
ユーグレナ	113.6	103.3	56,298
紀文食品	13.7	14.4	16,718
ビックルスホールディングス	10.3	9.7	11,242
ミヨシ油脂	4.8	2.1	2,793
理研ビタミン	15.2	14.3	36,193
繊維製品(0.4%)			
片倉工業	16.8	15.8	31,236
グンゼ	12.8	12.1	62,678
東洋紡	77.8	73.3	80,043
ユニチカ	56.5	57.2	12,927
富士紡ホールディングス	7.2	7.5	34,237
倉敷紡績	13.6	12.1	54,692
シキボウ	7.7	10.1	10,867
日本毛織	47.7	43.6	56,810
トーア紡コーポレーション	5.4	2.2	952
帝国繊維	20.5	19.2	44,620
帝人	172.2	162.5	246,837
東レ	1,198.7	1,132.2	889,909
住江織物	3	1.2	3,010
日本フエルト	9	4	1,848
イチカワ	2.2	0.9	1,529

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

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
多木化学	6.9	6.6	25,971
テイカ	12	14.4	22,809
石原産業	32.3	28	44,940
片倉コープアグリ	2.8	1.3	1,487
日本曹達	19.2	19.9	100,495
東ソー	238.7	225.5	443,220
トクヤマ	57.7	54.5	165,680
セントラル硝子	28.7	18	62,460
東亞合成	89.7	81.2	123,180
大阪ソーダ	10.7	11.8	101,244
関東電化工業	34.6	32.7	28,972
デンカ	65	61.4	134,865
信越化学工業	1,486.2	1,514.6	8,919,479
日本カーバイド工業	5.3	8	14,384
堺化学工業	13.6	12.9	35,900
第一稀元素化学工業	16.3	18.5	15,577
エア・ウォーター	168.7	159.4	357,295
日本酸素ホールディングス	173.5	163.9	737,550
日本化学工業	6	6.2	14,570
東邦アセチレン	2.9	5.9	2,124
日本パーカライジング	88.5	75.3	89,456
高圧ガス工業	26	24.5	21,805
チタン工業	1.7	0.7	710
四国化成ホールディングス	21.2	21.5	42,978
戸田工業	4.1	3.8	6,916
ステラ　ケミファ	10.6	9.2	39,974
保土谷化学工業	5.1	5.3	26,500
日本触媒	27.2	98.4	158,079
大日精化工業	12.4	11.7	35,919
カネカ	40.9	42.7	175,667
三菱瓦斯化学	133.5	123.3	363,796
三井化学	147.4	139.3	648,998
ＪＳＲ	166.9	－	－
東京応化工業	31.3	80.6	338,842
大阪有機化学工業	13.5	14.1	49,068
三菱ケミカルグループ	1,206.6	1,234.7	1,005,416
ＫＨネオケム	29.8	25.8	57,998
ダイセル	262.9	217.1	338,133
住友ベークライト	26.5	47.3	197,714
積水化学工業	365.7	339.4	760,256
日本ゼオン	107.2	115.8	165,072
アイカ工業	45.1	42.6	145,095
ＵＢＥ	92.2	80.4	232,637
積水樹脂	26	25.2	59,824
タキロンシーアイ	39.1	43.1	30,816

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
旭有機材	11.9	11.2	52,304
ニチバン	11.1	9.2	16,136
リケンテクノス	38.5	31.7	32,143
大倉工業	8.3	7.8	22,971
積水化成品工業	25.1	23.7	10,546
群栄化学工業	4.2	4	12,560
タイガースポリマー	6.3	2.6	2,142
ミライアル	4.3	1.9	2,922
ダイキアクシス	5.1	2.3	1,669
ダイキョーニシカワ	39.5	37.3	25,737
竹本容器	4.7	2.1	1,776
森六ホールディングス	9.1	8.8	23,795
恵和	11.6	12.2	18,043
日本化薬	136.6	129	160,863
カーリットホールディングス	16.1	18.2	21,712
日本精化	10.2	11.2	29,265
扶桑化学工業	16.6	17.9	70,078
トリケミカル研究所	23.9	20.5	89,277
ＡＤＥＫＡ	62.3	58.9	188,480
日油	55.3	152.9	312,068
新日本理化	19.2	7.7	1,386
ハリマ化成グループ	9.7	11.8	10,266
花王	435.4	381.9	2,631,672
第一工業製薬	6.4	6.7	25,359
石原ケミカル	8.2	7.6	13,877
日華化学	5.6	2.2	2,387
ニイタカ	2.5	1.1	2,060
三洋化成工業	11	10.4	41,444
有機合成薬品工業	10.3	4.5	1,381
大日本塗料	21.8	18.7	22,440
日本ペイントホールディングス	791.2	896.8	930,878
関西ペイント	163.8	146	331,712
神東塗料	11.6	4.7	587
中国塗料	29.4	34.7	71,169
日本特殊塗料	8.8	4	5,132
藤倉化成	24	19.5	10,218
太陽ホールディングス	27.2	29.4	91,581
ＤＩＣ	69.9	66	212,586
サカタインクス	39.8	37.6	68,319
ａｒｔｉｅｎｃｅ	35	36.8	123,280
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	15.9	－	－
富士フイルムホールディングス	343.5	941.2	3,349,730
資生堂	373.8	353.1	1,761,615
ライオン	214.8	215.2	269,645
高砂香料工業	12.1	12.7	45,783

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
マンダム	38.7	36.5	43,362
ミルボン	26.5	23	76,475
ファンケル	78.3	74	143,412
コーセー	36.4	34.4	334,230
コタ	16.5	17.1	24,333
シーボン	1.8	0.8	1,113
ポーラ・オルビスホールディングス	91.8	86.7	113,663
ノエビアホールディングス	16	15.1	80,030
アジュバンホールディングス	3.4	1.4	1,184
新日本製薬	10.2	9.6	15,840
Ｉ－ｎｅ	－	4.5	6,579
アクシージア	9.1	11.1	10,656
エステー	13.8	13.1	19,938
アグロ　カネショウ	7.2	6.8	7,527
コニシ	29.9	48.8	59,243
長谷川香料	34.2	32.3	96,447
星光ＰＭＣ	7.1	－	－
小林製薬	52.1	49.2	265,729
荒川化学工業	15.2	14.3	15,658
メック	14.7	13.9	60,117
日本高純度化学	4.5	3.8	12,445
タカラバイオ	48.2	45.6	45,736
ＪＣＵ	20	18.7	68,068
新田ゼラチン	8.6	3.8	2,994
ＯＡＴアグリオ	5.7	6.3	9,387
デクセリアルズ	51.7	42.2	276,916
アース製薬	16.2	15.4	71,302
北興化学工業	18	17	25,721
大成ラミック	5.6	4.9	13,695
クミアイ化学工業	71.1	67.2	51,206
日本農薬	32.8	31	22,382
アキレス	11.3	10.7	16,980
有沢製作所	29.1	29.6	44,577
日東電工	130	108.6	1,316,775
レック	25.5	21.7	25,714
三光合成	22.5	21.3	14,398
きもと	20.5	9.3	1,962
藤森工業	14.1	13.4	56,682
前澤化成工業	11.6	10.9	19,707
未来工業	6.4	6.1	24,217
ウェーブロックホールディングス	4.2	2.1	1,325
ＪＳＰ	12.6	11.9	25,501
エフピコ	33.9	32	77,184
天馬	15.2	12.3	30,085
信越ポリマー	33.1	36.5	54,458
東リ	31.2	12.4	4,873
ニフコ	64.6	50.6	178,365
バルカー	15	14.1	51,324
ユニ・チャーム	373	352.3	1,734,020
ショーエイコーポレーション	4	1.8	1,054
医薬品(4.3%)			
協和キリン	216.3	204.3	522,803
武田薬品工業	1,584.3	1,496.7	6,155,927
アステラス製薬	1,691.2	1,483.4	2,277,760
住友ファーマ	132.8	125.4	35,739
塩野義製薬	225.7	213.2	1,490,268
わかもと製薬	13	5.9	1,492
日本新薬	42.2	44.3	123,552
中外製薬	560.4	529.4	2,479,709
科研製薬	30.7	29	104,951
エーザイ	217.8	205.7	1,371,196
ロート製薬	173.4	163.8	438,410
小野薬品工業	345.4	345.9	762,363
久光製薬	39.8	37.6	138,067
持田製薬	20.6	19.3	56,452
参天製薬	326.2	298.4	481,766
扶桑薬品工業	5.7	6	13,452
日本ケミファ	1.4	0.6	937
ツムラ	56.4	53.2	200,510
キッセイ薬品工業	27.7	28	84,980
生化学工業	34.1	28.7	22,242
栄研化学	29.1	30.3	62,448
鳥居薬品	9.6	9.1	33,351
ＪＣＲファーマ	60.6	57.2	30,659
東和薬品	27.5	26	74,412
富士製薬工業	13.2	12.5	18,212
ゼリア新薬工業	24.8	23.4	45,372
ネクセラファーマ	61.5	74	103,082
第一三共	1,559.6	1,473.3	8,032,431
杏林製薬	38.8	36.7	62,500
大幸薬品	32.5	35.1	12,706
ダイト	12.5	12.9	28,457
大塚ホールディングス	409.6	351.7	2,146,073
大正製薬ホールディングス	39.8	－	－
ペプチドリーム	86.8	82	161,499
セルソース	－	6.2	8,035
あすか製薬ホールディングス	18.4	17.3	40,187
サワイグループホールディングス	40.9	38.7	224,073
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	161.5	171.6	22,651

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
ニチレキ	21.2	22	53,658
ユシロ化学工業	9.3	8.8	14,625
ビーピー・カストロール	5.4	2.2	2,145
富士石油	36.5	49.3	24,699
ＭＯＲＥＳＣＯ	4.5	2	2,742
出光興産	198.8	878.1	910,589
ＥＮＥＯＳホールディングス	3,036.7	2,677.3	2,142,375
コスモエネルギーホールディングス	70.8	50.1	381,812
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	101.9	85.5	335,331
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	102.9	97.2	259,815
ブリヂストン	571.7	495	3,369,960
住友ゴム工業	175.6	165.9	286,343
藤倉コンポジット	9.9	14.6	19,578
オカモト	9.9	8	37,520
フコク	9.4	8.9	18,351
ニッタ	18.2	17.2	69,574
住友理工	34.7	26.2	32,592
三ツ星ベルト	26.1	19.6	85,064
バンドー化学	28.4	25.1	45,029
ガラス・土石製品(0.7%)			
日東紡績	20.3	21.4	154,722
ＡＧＣ	182.2	150.8	818,391
日本板硝子	91.3	80.7	36,879
石塚硝子	2.3	1	2,860
日本山村硝子	5.4	2.2	3,764
日本電気硝子	73.2	69.1	248,967
オハラ	8.7	8.1	10,635
住友大阪セメント	25.3	28.2	108,823
太平洋セメント	114.1	100	392,700
日本ヒューム	16	14.9	15,823
日本コンクリート工業	35.4	33	11,715
三谷セキサン	7.5	7.1	36,423
アジアパイルホールディングス	28.3	24.1	23,401
東海カーボン	150.3	156.1	153,571
日本カーボン	10.3	9	49,230
東洋炭素	11.3	11.9	81,872
ノリタケカンパニーリミテド	9	18.7	73,023
ＴＯＴＯ	118.2	111.6	429,771
日本碍子	208.3	196.7	409,824
日本特殊陶業	136.4	141.6	656,316
ＭＡＲＵＷＡ	6.6	6.2	223,200
品川リフラクトリーズ	5.1	20.9	40,566
黒崎播磨	3.7	13.8	41,303
ヨータイ	12.1	10.5	18,532

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
東京窯業	13.4	6.2	2,672
ニッカトー	6.6	2.7	1,514
フジミインコーポレーテッド	14.3	45.5	136,500
クニミネ工業	4.3	1.7	1,929
エーアンドエーマテリアル	2.7	1.2	1,693
ニチアス	45.3	42.8	199,662
ニチハ	22.5	21.2	73,988
鉄鋼(0.9%)			
日本製鉄	824.7	779.2	2,609,540
神戸製鋼所	370.4	349.9	696,825
中山製鋼所	38	39.8	37,690
合同製鐵	9.2	9.7	50,537
ＪＦＥホールディングス	492.2	483.9	1,114,179
東京製鐵	51.8	48.9	77,115
共英製鋼	21	19.8	41,778
大和工業	30.4	32.8	270,403
東京鐵鋼	8.8	7.7	38,346
大阪製鐵	8.5	8	18,680
淀川製鋼所	20.9	19.8	109,890
中部鋼鈑	15.1	11.4	31,042
丸一鋼管	56.1	53	197,425
モリ工業	3.3	3.8	19,684
大同特殊鋼	23.2	109.6	172,291
日本高周波鋼業	5	2.3	1,014
日本冶金工業	13.5	12.7	61,277
山陽特殊製鋼	18.2	17.2	37,186
愛知製鋼	10.6	10	36,450
日本金属	3.1	1.5	1,143
大平洋金属	13.1	14.8	18,840
新日本電工	117.9	86.6	24,334
栗本鐵工所	8.8	8.1	38,961
虹技	1.8	0.8	932
三菱製鋼	11.6	12.9	19,195
日亜鋼業	14.7	5.9	1,805
日本精線	2.5	13.8	17,553
エンビプロ・ホールディングス	9.9	15	7,485
シンニッタン	15.6	7.3	1,686
新家工業	3.1	1.3	6,422
非鉄金属(0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	26.3	22	28,490
日本軽金属ホールディングス	49.7	50.8	96,012
三井金属鉱業	53.6	50.6	259,578
東邦亜鉛	10.9	－	－
三菱マテリアル	122.9	124.4	382,903
住友金属鉱山	213.6	201.7	1,042,183

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ＤＯＷＡホールディングス	41.4	43	250,475
古河機械金属	27.1	23	44,160
大阪チタニウムテクノロジーズ	27.1	30.2	83,110
東邦チタニウム	33.4	36	44,172
ＵＡＣＪ	25.8	24.4	107,970
ＣＫサンエツ	4.5	4.2	15,477
古河電気工業	61.4	57.9	247,175
住友電気工業	636	650.8	1,665,397
フジクラ	197.6	205.2	672,645
ＳＷＣＣ	20.6	19.4	92,053
タツタ電線	37.6	31.9	22,808
カナレ電気	2.3	1	1,555
平河ヒューテック	10.7	11.1	14,940
リョービ	19.7	18.5	45,750
アーレスティ	16	6.3	4,328
ＡＲＥホールディングス	74.5	65.4	132,042
金属製品(0.5%)			
稲葉製作所	9.6	9.7	18,032
宮地エンジニアリンググループ	5.1	8.7	38,584
トーカロ	50.6	50.2	97,588
アルファＣｏ	5.2	2.1	2,851
ＳＵＭＣＯ	350.6	309.1	729,476
川田テクノロジーズ	4.3	12.3	33,173
ＲＳ Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	12.3	11.6	35,728
ジェイテックコーポレーション	1.9	1	1,727
信和	7.9	3.7	2,723
東洋製罐グループホールディングス	121.9	99.8	257,583
ホッカンホールディングス	9.9	8.5	13,846
コロナ	10.3	9.7	8,836
横河ブリッジホールディングス	23.1	27.2	73,440
駒井ハルテック	2.3	1	1,789
高田機工	1.2	0.4	1,428
三和ホールディングス	169.6	174.8	501,763
文化シヤッター	53	45.5	79,261
三協立山	21.1	21.9	18,417
アルインコ	14	13.3	14,364
東洋シヤッター	3.3	1.3	1,151
ＬＩＸＩＬ	268.3	271.7	461,890
日本フイルコン	9.3	3.8	2,059
ノーリツ	27.1	27.6	47,941
長府製作所	18.6	17.3	37,748
リンナイ	100.2	83.2	308,921
ダイニチ工業	7.1	2.9	1,945
日東精工	26.7	25.2	14,641
三洋工業	1.6	0.7	2,138
岡部	29.6	31.1	23,915
ジーテクト	20.5	22.2	42,468
東プレ	32.5	30.7	68,092
高周波熱錬	28.4	25.8	27,864
東京製綱	10.9	11.3	14,690
サンコール	12.7	17.1	7,524
モリテック　スチール	10.5	5.1	1,183
パイオラックス	25.4	21.6	47,757
エイチワン	19	17.9	15,197
日本発條	162.9	153.9	267,093
中央発條	13.6	12.9	12,912
アドバネクス	1.7	0.7	756
立川ブラインド工業	8.3	7.9	10,625
三益半導体工業	14.2	15.7	58,011
機械(5.6%)			
日本ドライケミカル	3.4	1.4	3,642
日本製鋼所	49.7	46.9	222,446
三浦工業	75.3	71.1	214,295
タクマ	55.5	57.6	95,961
ツガミ	40.2	37.9	54,765
オークマ	18	14.9	100,694
芝浦機械	18	17	57,800
アマダ	287.8	258.1	456,191
アイダエンジニアリング	37.2	39.5	34,997
ＴＡＫＩＳＡＷＡ	3.8	－	－
ＦＵＪＩ	78.4	80.2	199,938
牧野フライス製作所	20	18.8	123,328
オーエスジー	86.1	75.1	145,956
ダイジェット工業	1.6	0.6	501
旭ダイヤモンド工業	50.5	39.3	34,308
ＤＭＧ森精機	109.4	105.7	475,544
ソディック	49.8	41.5	29,548
ディスコ	86.8	82	5,143,860
日東工器	8.8	8.3	19,065
日進工具	15.1	15.8	14,994
パンチ工業	12.8	5.6	2,587
冨士ダイス	6.7	11.1	8,569
豊和工業	7.8	3.1	2,495
リケンＮＰＲ	－	18.5	49,580
東洋機械金属	9.8	4.7	3,384
エンシュウ	3.2	1.4	950
島精機製作所	28.8	27.1	39,972
オプトラン	26.7	28	58,408
ＮＣホールディングス	2.9	1.3	1,922
イワキポンプ	12.1	11.4	27,474

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
フリュー	19	16.1	16,067
ヤマシンフィルタ	43.2	40.6	14,331
日阪製作所	17.6	18.6	18,786
やまびこ	29.5	27.8	59,797
野村マイクロ・サイエンス	6.1	23.1	107,530
平田機工	8.6	8.1	55,728
ＰＥＧＡＳＵＳ	20	18.9	9,544
マルマエ	7.9	7.4	15,503
タツモ	9.9	10.3	35,792
ナブテスコ	113.2	106.9	274,198
三井海洋開発	22.6	21.6	58,212
レオン自動機	19	19.7	30,672
ＳＭＣ	58.5	51	4,027,470
ホソカワミクロン	12.7	11.9	50,991
ユニオンツール	7.9	7.5	41,175
瑞光	－	12.3	12,890
オイレス工業	25.2	23.1	49,988
日精エー・エス・ビー機械	7.2	6.8	34,476
サトーホールディングス	25.7	24.2	50,892
技研製作所	17	16	29,408
日本エアーテック	9.2	8	9,256
カワタ	4.1	1.8	1,578
日精樹脂工業	13.5	12.7	12,788
オカダアイヨン	4.3	1.9	4,731
ワイエイシイホールディングス	6	7.2	16,358
小松製作所	844.8	798.3	3,620,290
住友重機械工業	106.7	100.8	420,840
日立建機	71.8	67.8	286,522
日工	26.9	25.3	17,963
巴工業	7.8	6.7	27,537
井関農機	17	16	16,048
ＴＯＷＡ	18.4	19	238,640
丸山製作所	2.4	1	2,310
北川鉄工所	7.2	6.7	9,125
ローツェ	9.4	8.9	267,445
タカキタ	4.1	1.9	864
クボタ	954.1	890.4	1,967,338
荏原実業	8.7	9	30,555
三菱化工機	5.9	6	24,390
月島ホールディングス	24.5	23.1	31,739
帝国電機製作所	12.7	11.7	26,722
新東工業	36.6	34.5	36,880
澁谷工業	17	16	60,400
アイチ　コーポレーション	25.3	23.7	26,378
小森コーポレーション	41.9	42	52,374

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
鶴見製作所	13.8	13	52,455
日本ギア工業	4.9	2.2	1,185
酒井重工業	2.3	3	16,980
荏原製作所	73.8	69.9	822,373
石井鐵工所	1.6	0.7	1,933
酉島製作所	15.6	14.7	47,554
北越工業	18.2	17.1	36,594
ダイキン工業	215.2	203.3	4,664,718
オルガノ	24.8	20.5	173,430
トーヨーカネツ	6.9	5.8	22,127
栗田工業	100.9	95.3	626,788
椿本チエイン	25.6	24	140,160
大同工業	5.8	2.5	2,027
木村化工機	14	13.1	8,999
アネスト岩田	30.7	26.3	34,952
ダイフク	278.9	287.4	799,977
サムコ	4.8	4.6	20,516
加藤製作所	6.7	2.9	3,784
油研工業	2.2	1	2,340
タダノ	95.2	98	105,448
フジテック	63.2	39.8	165,767
ＣＫＤ	49.9	47.1	142,006
平和	60	50.4	100,598
理想科学工業	16.1	13.6	41,820
ＳＡＮＫＹＯ	35.4	164	244,770
日本金銭機械	19.9	20.6	24,781
マースグループホールディングス	10.6	8.6	28,595
フクシマガリレイ	13.3	11.1	65,934
オーイズミ	5.4	2.2	765
ダイコク電機	9.9	8.4	29,820
竹内製作所	32.7	30.9	186,636
アマノ	51.2	48.3	179,434
ＪＵＫＩ	28.1	26.4	13,041
ジャノメ	18.4	17.3	11,625
マックス	22.2	24	86,160
グローリー	43.3	40.9	107,996
新晃工業	18.2	17.2	68,800
大和冷機工業	27.7	26.1	37,218
セガサミーホールディングス	144.9	152.1	321,539
日本ピストンリング	4.8	－	－
リケン	7.1	－	－
ＴＰＲ	20.7	21.6	49,053
ツバキ・ナカシマ	44.5	34.1	26,359
ホシザキ	116.1	100.5	553,554
大豊工業	15.7	14.8	11,840

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
日本精工	331.3	315.3	239,123
ＮＴＮ	355.4	369.4	111,484
ジェイテクト	160.5	151.6	174,870
不二越	13.3	12.6	42,966
日本トムソン	44.3	46.4	27,608
ＴＨＫ	104	98.3	295,686
ユーシン精機	14.4	13.5	9,504
前澤給装工業	12.7	12.2	16,287
イーグル工業	20	18.8	33,952
前澤工業	8.1	3.6	4,906
日本ピラー工業	16.7	15.8	80,264
キッツ	66.5	57	62,016
マキタ	224.3	194.2	901,670
三井Ｅ＆Ｓ	83.9	84.5	117,032
日立造船	147.9	150.3	164,728
三菱重工業	315.3	2,978.2	3,895,485
ＩＨＩ	113.6	126.8	485,770
スター精密	34.1	31.3	64,665
電気機器(17.5%)			
日清紡ホールディングス	146.8	128	137,024
イビデン	103.5	88.9	558,558
コニカミノルタ	403.5	380.7	173,104
ブラザー工業	241.1	227.6	661,974
ミネベアミツミ	313.7	296.3	956,752
日立製作所	876.7	818.5	12,977,317
東芝	346.9	－	－
三菱電機	1,863.3	1,895.5	5,115,006
富士電機	109.6	103.6	980,159
東洋電機製造	4.5	2	2,164
安川電機	213.6	185	1,106,670
シンフォニアテクノロジー	19.9	18.8	67,868
明電舎	27.4	31.6	130,666
オリジン	3.1	1.3	1,690
山洋電気	7.8	7.4	52,614
デンヨー	13.7	13	33,488
ＰＨＣホールディングス	25.4	32	35,136
KOKUSAI ELECTRIC	－	88.1	366,936
ソシオネクスト	24.7	124	554,652
東芝テック	26.9	21.8	68,125
芝浦メカトロニクス	3.5	9.7	67,512
マブチモーター	44.9	83.8	200,784
ニデック	438.7	376	2,947,840
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	14	11.3	4,327
トレックス・セミコンダクター	8.7	8.9	15,601
東光高岳	11.1	10.4	21,777
ダブル・スコープ	58.9	48.8	21,862
ダイヘン	16.3	16.1	137,977
ヤーマン	31.5	33.3	30,769
ＪＶＣケンウッド	165	134.7	113,282
ミマキエンジニアリング	17.6	16.3	27,742
Ｉ－ＰＥＸ	10.3	11.9	23,466
大崎電気工業	42.8	37.3	24,729
オムロン	165.2	130	682,500
日東工業	24.3	23	82,340
ＩＤＥＣ	26.6	25.1	66,991
正興電機製作所	5.7	2.1	3,183
不二電機工業	3.2	1.3	1,452
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	59.3	66.5	205,485
サクサホールディングス	2.9	1.3	3,519
メルコホールディングス	4.6	5.4	18,495
テクノメディカ	4.6	4.3	7,559
日本電気	255	223.7	2,592,683
富士通	179.6	1,567.1	3,526,758
沖電気工業	81.5	77	79,618
岩崎通信機	6.1	2.7	1,803
電気興業	7.3	6.9	14,317
サンケン電気	16.8	15.8	83,187
ナカヨ	2.2	0.9	1,033
アイホン	10.9	9.2	26,716
ルネサスエレクトロニクス	1,176.5	1,061.7	3,112,904
セイコーエプソン	231.3	218.5	541,115
ワコム	137.6	124.4	86,706
アルバック	42.8	37.3	414,962
アクセル	5.5	7.8	9,820
ＥＩＺＯ	13.2	12.5	60,625
日本信号	41.1	38.8	38,062
京三製作所	37.8	35.7	20,777
能美防災	24.6	23.1	51,489
ホーチキ	13.7	12.8	27,520
星和電機	6.4	2.9	1,624
エレコム	43.4	40.8	62,628
パナソニック　ホールディングス	2,129.5	2,011.8	2,698,829
シャープ	217.1	287.1	268,610
アンリツ	127	119.9	140,223
富士通ゼネラル	51.1	48.3	104,376
ソニーグループ	1,262.7	1,192.8	14,904,036
ＴＤＫ	285.5	269.7	2,076,959
帝国通信工業	8.4	7.6	14,789
タムラ製作所	77.4	67.8	46,239
アルプスアルパイン	161.3	152.2	222,440

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
池上通信機	4.4	1.8	1,351
日本電波工業	21.9	20.6	22,248
鈴木	10.1	9.2	13,027
メイコー	19.8	16.9	119,821
日本トリム	4.2	3.9	12,499
ローランド　ディー．ジー．	10	9.5	50,730
フォスター電機	16.7	12.6	20,172
ＳＭＫ	4.3	4.5	10,764
ヨコオ	14.6	15.2	30,476
ホシデン	42.3	38.8	75,660
ヒロセ電機	29.8	25.1	435,234
日本航空電子工業	37	40.7	98,046
ＴＯＡ	20.5	19.4	20,467
マクセル	36.8	37.7	61,375
古野電気	23.8	22.2	44,955
スミダコーポレーション	16.8	23	26,243
アイコム	6.9	6.6	19,747
リオン	7.6	7.1	20,959
横河電機	197.2	186.3	754,142
新電元工業	6.9	6.5	19,149
アズビル	124.7	116	506,920
東亜ディーケーケー	7	2.9	2,447
日本光電工業	82.6	72.4	329,130
チノー	7.4	7	18,165
共和電業	13	5.2	2,303
日本電子材料	11.8	10.4	38,376
堀場製作所	39.7	32.2	400,890
アドバンテスト	140.6	483.1	2,736,761
小野測器	6	2.6	1,739
エスペック	14.5	13.6	43,248
キーエンス	178.6	168.7	11,810,687
日置電機	9.4	8	56,080
シスメックス	154	436.6	1,135,814
日本マイクロニクス	29.6	30.3	185,133
メガチップス	14.8	13.4	54,873
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	9.8	10.6	44,202
澤藤電機	2	0.8	975
原田工業	6.6	2.8	1,618
コーセル	21.8	18.2	25,006
イリソ電子工業	16.5	15.6	47,112
オプテックスグループ	32.9	31	52,111
千代田インテグレ	6.4	6.7	18,632
レーザーテック	81.8	77.3	3,223,410
スタンレー電気	127.2	108	304,236
ウシオ電機	90.9	74.7	153,695
岡谷電機産業	12.1	5.1	1,224
ヘリオス　テクノ　ホールディング	13.3	6	2,910
エノモト	3.8	1.7	2,499
日本セラミック	18.3	13.8	34,651
遠藤照明	6.5	2.7	4,268
古河電池	13.5	12.6	14,830
双信電機	6.6	3.5	1,676
山一電機	15.8	15.2	53,808
図研	15.6	14.7	55,566
日本電子	44.8	42.3	276,642
カシオ計算機	133	121.8	141,897
ファナック	876	822.2	3,713,055
日本シイエムケイ	38.7	39.9	22,423
エンプラス	5.3	4.9	34,398
大真空	22.3	25.4	17,475
ローム	82.5	311.9	630,038
浜松ホトニクス	143.3	135.4	629,339
三井ハイテック	18.5	15	105,390
新光電気工業	63.2	59.7	333,902
京セラ	277.3	1,047.8	1,876,085
太陽誘電	87	82.2	266,081
村田製作所	541.4	1,534.2	4,518,219
双葉電子工業	34.8	32.6	16,626
北陸電気工業	5.5	2.2	3,020
ニチコン	36.7	44.4	50,660
日本ケミコン	17.9	18.1	28,073
ＫＯＡ	27.2	25.7	37,599
市光工業	26.5	30.8	16,693
小糸製作所	214.8	174.8	375,732
ミツバ	33.5	31.6	32,958
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	30.5	57.7	873,578
キヤノン電子	19.9	18.7	41,831
キヤノン	979.3	841	3,780,295
リコー	447.5	422.8	582,618
象印マホービン	53.5	45.9	67,197
ＭＵＴＯＨホールディングス	2.1	0.9	2,208
東京エレクトロン	377.8	356.9	12,627,122
イノテック	12.1	11.3	19,074
輸送用機器(8.9%)			
トヨタ紡織	75.2	71	160,815
芦森工業	2.6	1.2	2,904
ユニプレス	32.1	30.3	44,450
豊田自動織機	130.5	143.8	2,129,678
モリタホールディングス	31.4	29.6	51,800
三櫻工業	27.4	25.8	25,774

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

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

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ニホンフラッシュ	16.7	15.8	14,220
前田工繊	15.1	14.6	45,552
永大産業	14.8	6.6	1,584
アートネイチャー	18.4	15.2	12,160
フルヤ金属	－	5.3	68,423
バンダイナムコホールディングス	489	461.9	1,335,583
アイフィスジャパン	3.8	1.5	862
ＳＨＯＥＩ	40.3	47.4	95,084
フランスベッドホールディングス	22.1	21.8	25,026
パイロットコーポレーション	27.9	23.7	101,554
萩原工業	11.9	11.3	16,916
フジシールインターナショナル	36.1	34.1	79,316
タカラトミー	82.4	76.7	213,149
広済堂ホールディングス	9.3	49	28,469
エステールホールディングス	3.2	1.3	833
タカノ	5.1	2.1	1,944
プロネクサス	14.8	17.5	21,192
ホクシン	10.6	4.3	498
ウッドワン	4.6	2	1,852
大建工業	10.8	－	－
ＴＯＰＰＡＮホールディングス	233.4	207.3	819,871
大日本印刷	195.1	174.8	833,271
共同印刷	5	4.7	16,450
ＮＩＳＳＨＡ	33.9	28.9	54,592
光村印刷	1.2	0.5	779
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	11.4	10	26,140
アシックス	164.8	143.7	1,243,723
ツツミ	3.1	3.9	8,595
ローランド	13.1	12.4	49,600
小松ウオール工業	6.6	6.9	22,080
ヤマハ	112.5	106.3	366,735
河合楽器製作所	4.8	5.1	15,784
クリナップ	20	16.5	11,484
ピジョン	113.7	107.4	160,777
キングジム	15.7	14.9	13,261
リンテック	35.8	33.8	110,019
イトーキ	36.6	34.4	52,494
任天堂	1,127	1,064.6	8,803,177
三菱鉛筆	25.3	23.9	54,037
タカラスタンダード	32.9	35.3	58,951
コクヨ	85.9	69	179,986
ナカバヤシ	19.2	18.2	9,518
グローブライド	14.4	15.1	30,366
オカムラ	53.7	50.8	112,166
美津濃	17.7	16.8	131,880

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
電気・ガス業(1.6%)			
東京電力ホールディングス	1,609	1,520	1,407,976
中部電力	657.8	621.3	1,311,253
関西電力	689.3	651.1	1,833,172
中国電力	284.3	292.9	329,805
北陸電力	168.5	172.4	200,070
東北電力	436.4	443.9	686,935
四国電力	152.4	157	233,616
九州電力	411.5	388.7	730,950
北海道電力	172.5	162.9	272,857
沖縄電力	41.8	43.1	48,315
電源開発	134.4	138.5	360,792
エフオン	11.6	12.3	4,846
イーレックス	31.7	30	20,220
レノバ	47.5	45	45,720
東京瓦斯	377.4	328.3	1,119,831
大阪瓦斯	361.6	336	1,135,680
東邦瓦斯	70.3	73	281,415
北海道瓦斯	10.7	10.1	35,097
広島ガス	37.7	35.6	13,314
西部ガスホールディングス	16.8	17.6	33,387
静岡ガス	40.7	33.6	31,718
メタウォーター	22.3	20.2	39,349
陸運業(2.3%)			
ＳＢＳホールディングス	15.9	15	37,620
東武鉄道	196.1	185.2	502,632
相鉄ホールディングス	59	60.3	147,282
東急	500.5	472.8	862,150
京浜急行電鉄	202.5	208.7	240,005
小田急電鉄	270.6	278.8	451,795
京王電鉄	94.4	81.1	303,395
京成電鉄	115.1	108.7	591,762
富士急行	22	20.8	62,608
東日本旅客鉄道	302.7	929.3	2,598,787
西日本旅客鉄道	228	400	1,241,600
東海旅客鉄道	137.5	649.5	2,237,527
西武ホールディングス	215.9	204	479,910
鴻池運輸	30.4	28.7	62,996
西日本鉄道	47.7	45	109,530
ハマキョウレックス	14	14.4	56,664
サカイ引越センター	8.5	18.7	42,748
近鉄グループホールディングス	178.2	168.3	552,865
阪急阪神ホールディングス	237.6	224.5	909,225
南海電気鉄道	85.2	75.1	195,973
京阪ホールディングス	98.2	92.8	269,398

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

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

国内株式インデックス マザーファンド －第24期－

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

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

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ＩＰＳ	5.9	4.9	10,255
ＦＩＧ	17	6.5	2,119
システムサポート	7.1	6.6	12,309
イーソル	11.7	12.2	11,016
アルテリア・ネットワークス	16.8	－	－
東海ソフト	2.3	0.9	1,215
ウイングアーク１ｓｔ	18.6	17.6	48,998
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4.9	5.7	5,187
サーバーワークス	3.7	3.5	10,262
東名	1.2	0.6	1,401
ヴィッツ	1.6	0.6	468
トビラシステムズ	3.7	1.6	1,236
Ｓａｎｓａｎ	58.7	55.5	88,966
Ｌｉｎｋ－Ｕグループ	3.5	1.1	694
ギフティ	19.6	14.8	15,554
メドレー	24.1	22.7	69,916
ベース	6.1	5.9	16,974
ＪＭＤＣ	29.4	28.8	74,217
フォーカスシステムズ	13.3	11.3	12,113
クレスコ	13.9	13.9	31,997
フジ・メディア・ホールディングス	172.1	162.4	269,665
オービック	59.8	56.5	1,144,972
ジャストシステム	25.8	24.3	61,649
ＴＤＣソフト	15.3	31.7	32,777
ＬＩＮＥヤフー	2,548.4	2,407.8	863,918
トレンドマイクロ	103.4	80	570,640
ＩＤホールディングス	12.3	11.4	15,732
日本オラクル	34.3	32.4	387,018
アルファシステムズ	5.7	4.4	11,932
フューチャー	44.7	36.1	53,644
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11.1	9.1	17,089
ＳＢテクノロジー	7.7	7.1	20,909
トーセ	4.3	1.6	1,099
オービックビジネスコンサルタント	35.3	23.8	151,320
伊藤忠テクノソリューションズ	96.2	－	－
アイティフォー	23.8	21.7	28,253
東計電算	2.5	4.7	16,873
エックスネット	2.2	0.8	1,182
大塚商会	101.5	167.7	486,497
サイボウズ	24.8	23.3	35,579
電通総研	21.8	20.6	104,854
ＡＣＣＥＳＳ	21.5	17.6	24,816
デジタルガレージ	31.8	27	63,045
ＥＭシステムズ	30.2	28.2	17,653
ウェザーニューズ	5.6	5.2	23,478

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ＣＩＪ	30.2	42.2	18,399
ビジネスエンジニアリング	3	3.5	11,532
日本エンタープライズ	16.2	5.9	772
WOWOW	13.7	12.7	13,106
スカラ	16.9	15.7	11,068
インテリジェント　ウェイブ	7.7	3	3,129
ＡＮＹＣＯＬＯＲ	－	23.9	50,859
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	15.4	17	8,789
ネットワンシステムズ	66.8	67.9	196,910
システムソフト	65.7	59.1	3,605
アルゴグラフィックス	16.5	15.5	60,527
マーベラス	29.4	27.5	16,225
エイベックス	30.6	28.8	34,070
ＢＩＰＲＯＧＹ	66	55.3	225,347
都築電気	9.6	8.9	19,580
ＴＢＳホールディングス	91.7	85	287,895
日本テレビホールディングス	158.7	149.7	308,831
朝日放送グループホールディングス	17.1	15.9	10,287
テレビ朝日ホールディングス	43.6	41.1	78,007
スカパーＪＳＡＴホールディングス	159.3	131.4	114,975
テレビ東京ホールディングス	13	12.2	36,356
日本ＢＳ放送	5.3	2	1,770
ビジョン	23.7	25.5	29,503
スマートバリュー	4	1.6	640
U-NEXT　HOLDINGS	20.1	19	82,555
ワイヤレスゲート	7.2	2.5	562
日本通信	－	166.6	29,821
クロップス	2.5	0.7	747
日本電信電話	2,294	50,303.7	7,646,162
ＫＤＤＩ	1,383.4	1,306.8	5,587,876
ソフトバンク	2,876.1	2,699.1	5,059,462
光通信	21.1	17	420,580
エムティーアイ	12.7	11.6	9,883
GMOインターネットグループ	66.2	62.2	152,980
ファイバーゲート	9.8	9.1	11,274
アイドママーケティングコミュニケーション	4	1.6	368
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	94.7	89.4	284,023
学研ホールディングス	30.1	30.4	29,305
ゼンリン	30.9	28.9	24,189
昭文社ホールディングス	6.8	2.4	849
インプレスホールディングス	13.4	5.7	900
アイネット	11	10.2	22,868
松竹	10.3	8.8	80,792
東宝	112.1	94.1	455,444
東映	4.9	27.9	94,860

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

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

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

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
リックス	3	3.9	11,836
丸文	16.9	15.9	19,286
ハピネット	16.1	15.2	52,212
橋本総業ホールディングス	7.5	7.1	9,116
日本ライフライン	55.4	52	58,240
タカショー	16.5	15.6	7,612
ＩＤＯＭ	57.1	47.2	61,029
進和	11.6	10.9	29,669
エスケイジャパン	3.6	1.5	1,267
ダイトロン	7.5	7	21,630
シークス	26.9	25.4	32,715
田中商事	4.2	1.7	1,309
オーハシテクニカ	9.2	9.4	15,472
白銅	6.8	5	14,800
ダイコー通産	1.5	0.6	780
伊藤忠商事	1,163.7	1,199.2	8,739,769
丸紅	1,473.8	1,479.8	4,578,501
高島	2.3	4	4,180
長瀬産業	86.6	81.8	249,162
蝶理	10.1	11.2	39,592
豊田通商	165.4	156.3	1,497,822
三共生興	27.2	24.7	17,981
兼松	73.3	74.6	193,139
ツカモトコーポレーション	2.1	0.8	936
三井物産	1,340.3	1,336.3	10,777,259
日本紙パルプ商事	10	8.5	50,235
カメイ	20.1	19	38,380
東都水産	0.8	0.5	3,215
ＯＵＧホールディングス	2.2	0.9	2,374
スターゼン	14.4	12.3	33,689
山善	50.9	54.1	72,115
椿本興業	3	11.1	23,509
住友商事	1,169.6	1,079.7	4,370,625
内田洋行	7.7	7.2	49,680
三菱商事	1,168.1	3,425.6	11,499,739
第一実業	6.7	16.8	38,690
キヤノンマーケティングジャパン	43.8	41.3	180,068
西華産業	7.4	7	27,055
佐藤商事	13.1	12.4	20,249
菱洋エレクトロ	16.1	－	－
東京産業	17.3	16.3	10,366
ユアサ商事	17	13.9	74,643
神鋼商事	4.7	4.5	31,275
トルク	8	4.3	1,014
阪和興業	33.9	32	212,480

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
正栄食品工業	12.6	11.9	52,419
カナデン	12.6	13.4	21,252
ＲＹＯＤＥＮ	15.3	14.4	36,172
岩谷産業	43	40.6	365,481
ナイス	4	1.8	3,245
ニチモウ	1.8	1.9	3,872
極東貿易	11.3	10.7	18,147
アステナホールディングス	32.7	33.6	16,228
三愛オブリ	50	41.6	85,072
稲畑産業	38.1	35.3	116,666
ＧＳＩクレオス	11	9.6	20,592
明和産業	25.2	21.1	15,213
クワザワホールディングス	4.8	2.1	1,915
ワキタ	34.8	29.5	46,197
東邦ホールディングス	47	49.1	187,954
サンゲツ	47.4	41.1	120,505
ミツウロコグループホールディングス	24.1	22.8	28,773
シナネンホールディングス	6.1	4.9	22,760
伊藤忠エネクス	46.8	44.2	67,184
サンリオ	53.5	144.9	339,210
サンワテクノス	9.7	9.1	20,384
リョーサン	20	－	－
新光商事	25.4	24	22,416
トーホー	8.1	7	21,105
三信電気	7.6	7.2	15,120
東陽テクニカ	19.2	18	26,910
モスフードサービス	27.8	26.2	89,080
加賀電子	15.3	16.3	93,562
ソーダニッカ	10.8	15.8	16,384
立花エレテック	13.8	11.8	34,680
フォーバル	7.4	7	8,897
ＰＡＬＴＡＣ	29.7	24	99,048
三谷産業	33.1	31.2	11,013
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	4.8	4.5	18,292
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.2	0.5	1,346
コーア商事ホールディングス	10.6	12.5	9,087
ＫＰＰグループホールディングス	44.1	46.2	37,422
ヤマタネ	8.4	7.9	21,416
丸紅建材リース	1.3	0.5	1,530
泉州電業	9.5	11.1	63,270
トラスコ中山	39.7	37.5	91,087
オートバックスセブン	65.7	62.1	94,112
モリト	13.6	12.8	18,688
加藤産業	23.4	22.1	89,505
北恵	3.3	1.5	1,282

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
イエローハット	33.3	28.3	56,996
ＪＫホールディングス	14.5	13.7	13,987
日伝	11.2	12	37,620
北沢産業	7.9	3.6	1,263
杉本商事	8.4	8.6	20,261
因幡電機産業	49	46.3	172,004
東テク	6.3	17.9	46,092
ミスミグループ本社	285	269.4	744,891
アルテック	8.3	3.2	864
タキヒヨー	3.6	1.4	1,562
蔵王産業	2.4	1.1	2,776
スズケン	55.3	63.7	293,147
ジェコス	11.3	10.7	10,507
グローセル	17.8	－	－
小売業(4.0%)			
ローソン	46.9	－	－
サンエー	14.5	13.7	64,253
カワチ薬品	15	14.1	39,804
エービーシー・マート	27.6	78.2	227,601
ハードオフコーポレーション	6.3	7.3	14,709
アスクル	39.3	43.2	93,873
ゲオホールディングス	18.8	20.2	34,218
アダストリア	23	21.6	74,412
くら寿司	22.3	21	98,700
キャンドゥ	6.9	6.5	18,726
ＩＫホールディングス	6	3	1,257
パルグループホールディングス	18.7	35.2	62,409
エディオン	75.1	70.9	108,760
サーラコーポレーション	40.3	37.9	30,395
ワッツ	7.9	3	1,932
ハローズ	8.7	8.2	34,358
あみやき亭	4.7	4.4	26,312
大黒天物産	5.9	5.5	43,120
ハニーズホールディングス	15.2	16	26,224
ファーマライズホールディングス	4	1.9	1,216
アルペン	15.8	14.9	29,427
ハブ	5.5	2.4	1,984
クオールホールディングス	26.3	24.7	35,642
ジンズホールディングス	11.4	13.7	50,142
ビックカメラ	101	107	163,603
ＤＣＭホールディングス	115.7	94.5	141,277
ＭｏｎｏｔａＲＯ	268	253.1	397,367
東京一番フーズ	4.4	2.4	1,233
きちりホールディングス	3.5	1.7	1,564
アークランドサービスホールディングス	15.6	－	－
Ｊ．フロント　リテイリング	235.2	205	301,965
ドトール・日レスホールディングス	33.7	31.8	67,320
マツキヨココカラ&カンパニー	114.6	324.7	697,617
ブロンコビリー	10.3	10.6	41,446
ＺＯＺＯ	125	113.8	401,486
トレジャー・ファクトリー	9.4	11.3	17,142
物語コーポレーション	31.7	29.9	101,660
三越伊勢丹ホールディングス	318.3	300.8	958,950
Ｈａｍｅｅ	7.1	7.5	9,600
マーケットエンタープライズ	1.9	1	741
ウエルシアホールディングス	98.1	92.7	196,941
クリエイトSDホールディングス	31.4	25.4	83,185
丸善ＣＨＩホールディングス	18.8	8	2,664
ミサワ	3.5	1.8	1,112
ティーライフ	2.4	1.1	1,527
チムニー	4.5	1.8	2,322
シュッピン	14.6	16.4	20,647
オイシックス・ラ・大地	25.6	24.3	26,875
ネクステージ	43.3	40.9	101,636
ジョイフル本田	56.4	52.1	108,211
エターナルホスピタリティグループ	7.2	6.7	25,326
ホットランド	14.8	13.8	35,148
すかいらーくホールディングス	258.4	244	517,280
ＳＦＰホールディングス	10.3	8.6	17,372
綿半ホールディングス	15	14.1	22,151
ヨシックスホールディングス	3.1	4.2	11,491
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	62	50.2	43,322
ゴルフダイジェスト・オンライン	9.2	8.7	4,454
ＢＥＥＮＯＳ	8.3	10.8	22,215
あさひ	16.2	16.8	23,671
日本調剤	13.3	12	16,632
コスモス薬品	18.7	15.2	195,472
トーエル	7.2	3.1	2,418
セブン&アイ・ホールディングス	650.9	1,826.5	3,698,662
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	142.1	120.8	125,752
ツルハホールディングス	39.7	37.5	339,750
サンマルクホールディングス	15.5	14.5	30,450
フェリシモ	3.8	1.7	1,555
トリドールホールディングス	47.1	50.1	185,720
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	20.5	21.5	6,407
ウイルプラスホールディングス	2.8	1.5	1,566
ＪＭホールディングス	14.5	13.6	37,726
サツドラホールディングス	7.3	2.8	2,402
アレンザホールディングス	14.6	13.7	15,015

国内株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
串カツ田中ホールディングス	5.4	5	7,905
バロックジャパンリミテッド	12.9	14.3	11,096
クスリのアオキホールディングス	16.9	53.8	164,628
力の源ホールディングス	8.4	10.3	14,172
FOOD & LIFE COMPANIES	100.9	95.3	269,127
メディカルシステムネットワーク	17.7	19.9	12,079
はるやまホールディングス	7.2	3.4	1,975
ノジマ	62	52	86,892
カッパ・クリエイト	29.7	28	45,276
ライトオン	11.1	4.5	1,710
良品計画	206.5	212.6	535,433
パリミキホールディングス	19.9	8.3	2,938
アドヴァングループ	18.5	16.9	17,001
アルビス	6.4	6	15,630
コナカ	16	7	2,072
ハウス　オブ　ローゼ	2.1	1	1,587
Ｇ－７ホールディングス	23.9	19.7	29,766
イオン北海道	28.1	52.9	48,297
コジマ	32.1	34.8	29,719
ヒマラヤ	5.2	2.5	2,275
コーナン商事	25.6	21.9	90,994
エコス	7.3	6.8	15,007
ワタミ	22.8	18.8	16,581
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	381.3	360.3	1,433,273
西松屋チェーン	42.1	35.3	77,342
ゼンショーホールディングス	103.5	90.9	555,944
幸楽苑ホールディングス	12.3	13.2	16,249
ハークスレイ	5.9	2.2	1,702
サイゼリヤ	28.1	26.4	132,264
ＶＴホールディングス	72.7	69.7	33,595
魚力	6.1	6.4	15,104
フジ・コーポレーション	11	8.7	15,251
ユナイテッドアローズ	20.4	21.2	36,146
ハイデイ日高	28.2	26.6	76,076
YU-WA Creation Holdings	11.4	5.7	729
コロワイド	87	76.7	150,830
ピーシーデポコーポレーション	22.2	－	－
壱番屋	15	70.8	78,092
ＰＬＡＮＴ	4.1	1.5	2,329
スギホールディングス	38.1	108	246,834
薬王堂ホールディングス	10.7	8.8	24,068
スクロール	28.6	26.9	27,814
ヨンドシーホールディングス	16.5	17.1	31,977
木曽路	28.8	27.1	66,611

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

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
ケーユーホールディングス	11.4	8.7	10,135
吉野家ホールディングス	74.1	65.8	187,859
松屋フーズホールディングス	9	8.5	44,965
サガミホールディングス	30.7	27	40,716
関西フードマーケット	17.4	12.3	30,381
王将フードサービス	12.5	13.3	112,917
ミニストップ	13.8	13	20,215
アークス	34.8	32.8	94,857
バローホールディングス	36.3	34.2	80,951
ベルク	9.5	8.9	63,635
大庄	8.4	9.8	11,760
ファーストリテイリング	85	100.3	4,054,126
サンドラッグ	71.8	60.3	233,964
サックスバー　ホールディングス	18.5	15.5	11,671
ヤマザワ	3.1	1.5	1,902
やまや	3.2	1.3	3,919
ベルーナ	46.2	43.5	30,711
銀行業(8.0%)			
いよぎんホールディングス	209.2	197.6	282,074
しずおかフィナンシャルグループ	397.3	369	571,765
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	148	139.8	229,551
楽天銀行	－	77	218,603
京都フィナンシャルグループ	－	210.4	567,448
島根銀行	4.7	1.6	897
じもとホールディングス	12.1	4.9	1,803
めぶきフィナンシャルグループ	872.3	769.6	469,994
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22.5	21.3	99,790
九州フィナンシャルグループ	309.3	321.4	326,863
ゆうちょ銀行	492.6	1,824.9	2,789,359
富山第一銀行	58.4	52.7	58,338
コンコルディア・フィナンシャルグループ	968.9	891.1	834,871
西日本フィナンシャルホールディングス	109.1	93.2	193,390
三十三フィナンシャルグループ	15.7	14.9	30,857
第四北越フィナンシャルグループ	27.6	26.1	127,368
ひろぎんホールディングス	229.4	236.4	291,717
おきなわフィナンシャルグループ	16.7	14.2	36,877
十六フィナンシャルグループ	22.8	21.5	99,007
北國フィナンシャルホールディングス	19.8	17.5	90,825
プロクレアホールディングス	21.5	19	34,200
あいちフィナンシャルグループ	24.6	34.1	88,012
ＳＢＩ新生銀行	41.1	－	－
あおぞら銀行	110.5	119.3	281,488
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	11,009.9	10,113.5	16,555,799
りそなホールディングス	2,222	1,920.6	1,966,694
三井住友トラスト・ホールディングス	319.5	596.3	2,119,250
三井住友フィナンシャルグループ	1,284.7	1,180.7	11,854,228
千葉銀行	489.9	462.8	662,729
群馬銀行	341.1	322.3	336,320
武蔵野銀行	22.6	23.2	73,080
千葉興業銀行	32	35.3	34,099
筑波銀行	77.1	72.9	23,036
七十七銀行	56.3	48.3	222,904
秋田銀行	11.8	11.1	27,128
山形銀行	19.5	18.4	20,497
岩手銀行	12	10.5	28,087
東邦銀行	139.1	131.4	44,281
東北銀行	6.7	2.7	3,272
ふくおかフィナンシャルグループ	140.3	144.6	638,119
スルガ銀行	155	146.4	151,670
八十二銀行	360.6	356.4	379,744
山梨中央銀行	18.1	18.6	36,009
大垣共立銀行	33.5	31.7	70,183
福井銀行	15.7	14.8	28,682
清水銀行	7	6.6	10,513
富山銀行	2.1	0.9	1,634
滋賀銀行	29.2	27.6	117,162
南都銀行	26.5	25	87,875
百五銀行	165.4	156.2	104,341
京都銀行	55.7	－	－
紀陽銀行	62.9	59.4	110,305
ほくほくフィナンシャルグループ	111.7	102.8	223,692
山陰合同銀行	110	103.9	148,577
鳥取銀行	4.4	1.9	2,593
百十四銀行	16	16.3	53,708
四国銀行	27.9	24.3	27,191
阿波銀行	24.7	23.3	65,076
大分銀行	10.6	10	33,950
宮崎銀行	11.5	10	33,700
佐賀銀行	10.3	9.7	25,520
琉球銀行	40.3	35.3	42,889
セブン銀行	629.8	520.5	136,683
みずほフィナンシャルグループ	2,542.5	2,241.6	7,020,691
高知銀行	4.7	1.9	1,683
山口フィナンシャルグループ	194.1	162.8	298,086
長野銀行	4.2	－	－
名古屋銀行	11.6	10.6	77,592
北洋銀行	266.4	251.6	137,625
大光銀行	4.1	1.8	3,110
愛媛銀行	23.7	22.4	27,036
トマト銀行	4.5	2	2,400

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
京葉銀行	80.5	68.4	56,703
栃木銀行	80.5	82.9	31,336
北日本銀行	6.2	5.4	13,581
東和銀行	32.3	30.5	20,923
福島銀行	14.4	5.8	1,560
大東銀行	5.3	2.4	1,723
トモニホールディングス	142.1	157.2	62,880
フィデアホールディングス	18.2	17.2	27,709
池田泉州ホールディングス	225.1	230.3	93,962
証券、商品先物取引業(0.9%)			
ＦＰＧ	59.6	61.8	124,712
ジャパンインベストメントアドバイザー	14.5	27	35,127
マーキュリアホールディングス	8.3	2.9	2,404
ＳＢＩホールディングス	254.6	266.5	1,039,350
ジャフコ　グループ	58.8	49.5	91,253
大和証券グループ本社	1,257.4	1,286.5	1,521,286
野村ホールディングス	3,238	2,792.8	2,592,276
岡三証券グループ	154.7	145.9	111,029
丸三証券	58.9	55.3	55,853
東洋証券	59	44.3	16,125
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	191.9	197.3	115,223
光世証券	3.5	1.4	834
水戸証券	47.8	49.2	26,125
いちよし証券	32.7	31.2	25,178
松井証券	104.1	81.8	65,440
マネックスグループ	189.8	162.8	127,146
極東証券	22.2	22.8	32,467
岩井コスモホールディングス	20.2	19	41,800
アイザワ証券グループ	25.6	24	47,544
マネーパートナーズグループ	14.9	6	1,506
スパークス・グループ	19.7	18.5	31,857
保険業(3.0%)			
かんぽ生命保険	213.4	169.1	484,556
ＦＰパートナー	－	4.4	17,886
ＳＯＭＰＯホールディングス	301.7	749.5	2,477,847
アニコム　ホールディングス	59.7	56.4	33,558
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	357.8	1,115.5	3,698,998
第一生命ホールディングス	858.9	780.8	3,245,785
東京海上ホールディングス	1,737.7	1,621.4	8,692,325
Ｔ＆Ｄホールディングス	471.8	445.9	1,223,772
アドバンスクリエイト	10.2	10.6	10,525
その他金融業(1.2%)			
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	－	2.6	1,560
全国保証	46	43.5	243,469

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
あんしん保証	7.9	4.6	1,002
イントラスト	5.6	2.7	2,141
日本モーゲージサービス	8.2	4.1	1,644
Ｃａｓａ	5.7	2.7	2,286
ＳＢＩアルヒ	22	16.6	13,827
プレミアグループ	29.8	28.3	58,637
ネットプロテクションズホールディングス	59.1	57.7	9,405
クレディセゾン	111.6	105.4	351,087
芙蓉総合リース	16.2	15.3	189,796
みずほリース	26.3	139.5	144,801
東京センチュリー	32.9	124.5	177,288
日本証券金融	70.8	61.4	97,933
アイフル	292.2	245.7	98,280
リコーリース	16.8	15.9	79,818
イオンフィナンシャルサービス	101.2	95.8	125,450
アコム	314.8	297.7	118,008
ジャックス	18.8	17.8	85,796
オリエントコーポレーション	46.2	54.7	56,669
オリックス	1,154.1	996.1	3,330,958
三菱ＨＣキャピタル	685.9	740.5	750,126
九州リースサービス	6.8	2.6	2,886
日本取引所グループ	494.1	428.3	1,574,002
イー・ギャランティ	28.7	27.4	36,524
アサックス	6.7	3.1	2,610
ＮＥＣキャピタルソリューション	8.7	8.3	31,706
不動産業(1.9%)			
ｒｏｂｏｔ　ｈｏｍｅ	－	49.8	8,067
大東建託	64.5	60.9	995,715
いちご	209.6	192.5	72,957
日本駐車場開発	193.5	200.5	38,095
スター・マイカ・ホールディングス	18.6	20.2	11,998
ＳＲＥホールディングス	9.1	7.3	26,280
ＡＤワークスグループ	34.4	14	3,150
ヒューリック	411.5	387.7	558,481
三栄建築設計	9.7	－	－
野村不動産ホールディングス	110.4	92.6	356,047
三重交通グループホールディングス	40.8	36.5	20,184
サムティ	28.8	26.6	68,441
ディア・ライフ	32.4	28.8	24,336
地主	14.3	12.9	29,799
プレサンスコーポレーション	28.7	26.6	45,778
ハウスコム	3.9	1.5	1,452
ＪＰＭＣ	10.4	10	11,850
サンセイランディック	6	2.1	2,091
フージャースホールディングス	27.1	25.6	27,494

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
オープンハウスグループ	64.7	61	265,472
東急不動産ホールディングス	530.9	499.8	512,794
飯田グループホールディングス	154.7	159.4	329,001
イーグランド	3.3	1.2	1,844
ムゲンエステート	11.8	4.1	4,583
And Doホールディングス	10.4	10	11,400
シーアールイー	11.1	9.7	12,532
ケイアイスター不動産	8.9	8.1	27,013
グッドコムアセット	18.4	16.1	10,416
ジェイ・エス・ビー	4.8	8.5	22,975
ロードスターキャピタル	11.2	11	31,471
テンポイノベーション	5.8	2.3	1,932
フェイスネットワーク	5.1	1.9	3,121
霞ヶ関キャピタル	－	6.8	110,908
パーク２４	137.8	108.2	173,065
パラカ	7.1	6.2	12,232
三井不動産	760.4	2,304.3	3,206,433
三菱地所	1,061.9	1,085.7	2,775,049
平和不動産	29	27.1	102,844
東京建物	168.6	145.3	351,626
京阪神ビルディング	31.1	31.4	47,288
住友不動産	318.4	240.3	1,147,432
テーオーシー	34.6	30.3	20,543
東京楽天地	3.3	－	－
レオパレス２１	－	166.2	86,756
スターツコーポレーション	25.9	24	77,040
フジ住宅	27.2	21.7	15,906
空港施設	24.4	24.3	14,482
明和地所	8.6	11.2	10,304
ゴールドクレスト	17.8	13.7	32,099
エスリード	9	8	31,640
日神グループホールディングス	32	27.7	14,043
日本エスコン	39.5	31.1	31,846
MIRARTHホールディングス	88.8	76.3	36,089
ＡＶＡＮＴＩＡ	9.8	3.7	3,041
イオンモール	92.1	86.4	160,531
毎日コムネット	7.3	2.7	2,079
ファースト住建	7.2	2.7	2,802
カチタス	47.9	44.9	71,166
トーセイ	30.3	27.9	60,431
穴吹興産	3.5	1.6	3,515
サンフロンティア不動産	30.6	24.9	48,057
ＦＪネクストホールディングス	20.3	17.9	21,587
インテリックス	3.3	1.3	705
ランドビジネス	5	2	484
サンネクスタグループ	5.8	2.3	2,341
グランディハウス	14.7	14.9	8,493
日本空港ビルデング	62.4	58.8	322,165
サービス業(4.4%)			
明豊ファシリティワークス	7.6	3.2	2,822
日本工営	11.1	－	－
ＬＩＦＵＬＬ	64.1	60.6	9,514
ＭＩＸＩ	41.9	37.3	104,328
ジェイエイシーリクルートメント	16.7	63	41,643
日本M&Aセンターホールディングス	315.2	276.5	202,121
メンバーズ	5.6	6.2	4,929
中広	2.8	1.5	829
ＵＴグループ	27.1	22.6	66,082
アイティメディア	7.2	6.8	11,934
ケアネット	－	35.9	17,914
Ｅ・Ｊホールディングス	10.9	10.3	18,467
オープンアップグループ	55.2	52.2	104,086
コシダカホールディングス	55.2	52.2	42,804
アルトナー	3.7	2.5	5,090
パソナグループ	22.4	21.1	44,710
ＣＤＳ	3.7	1.6	2,800
リンクアンドモチベーション	52.8	49.9	20,958
エス・エム・エス	69.9	60.9	110,959
サニーサイドアップグループ	4.7	2.4	1,598
パーソルホールディングス	205.5	1,765.7	388,454
リニカル	8.5	4.3	1,659
クックパッド	52	49	8,477
アイ・ケイ・ケイホールディングス	7.5	3.1	2,309
学情	8.5	9	15,453
スタジオアリス	9.3	8.8	17,626
シミックホールディングス	9	－	－
エプコ	3.5	1.9	1,539
ＮＪＳ	4.2	3.9	13,318
綜合警備保障	68.2	289.8	271,542
カカクコム	134.8	112.6	209,604
アイロムグループ	6.8	7.1	19,766
セントケア・ホールディング	12.1	12.9	10,461
サイネックス	3	1.3	923
ルネサンス	13.2	13.7	12,645
ディップ	32.2	26.6	68,867
デジタルホールディングス	14.6	9.2	9,227
新日本科学	19.6	15.9	21,003
キャリアデザインセンター	3.2	1.2	1,988
ベネフィット・ワン	85.2	－	－
エムスリー	362.7	342.7	512,850

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ツカダ・グローバルホールディング	9.2	3.7	1,764
アウトソーシング	109.5	－	－
ウェルネット	11.4	5.6	3,477
ワールドホールディングス	8.4	7.9	17,024
ディー・エヌ・エー	73.5	61.8	85,562
博報堂DYホールディングス	234.2	221.2	283,578
ぐるなび	34.6	33.1	9,764
タカミヤ	25.5	24	11,400
ジャパンベストレスキューシステム	9.1	－	－
ファンコミュニケーションズ	36.7	24.9	10,184
ライク	7	6.6	10,434
Ａｏｂａ－ＢＢＴ	6.1	2.8	982
エスプール	53.3	50.6	16,343
ＷＤＢホールディングス	9.5	9	15,462
ティア	9.1	4.4	2,019
ＣＤＧ	1.8	0.8	1,039
アドウェイズ	25.7	24.5	9,261
バリューコマース	14	15.4	17,710
インフォマート	191.6	180.7	52,764
ＪＰホールディングス	53.7	44.9	22,405
エコナックホールディングス	27.9	6.9	869
ＣＬホールディングス	5.4	4.3	5,658
プレステージ・インターナショナル	77.7	81.5	52,730
アミューズ	10.1	10.7	16,863
ドリームインキュベータ	5.7	6	12,798
クイック	14.2	12.2	26,108
ＴＡＣ	8.5	4.1	733
電通グループ	180.4	170.4	698,810
イオンファンタジー	8	6.3	13,494
シーティーエス	20.7	22.2	16,627
ＮＥＸＹＺ．Ｇｒｏｕｐ	4.9	－	－
H. U. グループホールディングス	53.8	50.9	126,104
アルプス技研	16.1	16.5	41,893
日本空調サービス	20.1	18.9	18,389
オリエンタルランド	971.1	917.4	4,007,203
ダスキン	40.9	38.5	137,637
明光ネットワークジャパン	22.8	21.4	15,215
ファルコホールディングス	8.5	7.8	17,784
ラウンドワン	154	163.7	109,024
リゾートトラスト	72.6	75.4	182,430
ビー・エム・エル	22.9	21.4	57,994
りらいあコミュニケーションズ	30.5	－	－
リソー教育	84.5	89.5	23,270
早稲田アカデミー	10.4	9.8	15,003
ユー・エス・エス	188.8	389.1	483,651
東京個別指導学院	22.3	21.2	8,670
サイバーエージェント	405.7	383.3	360,148
楽天グループ	958.6	1,487.6	1,191,121
クリーク・アンド・リバー社	10.9	8.9	14,845
ＳＢＩグローバルアセットマネジメント	30.6	34.3	22,157
テー・オー・ダブリュー	36.9	34.6	12,179
山田コンサルティンググループ	9.5	7.7	14,560
セントラルスポーツ	7	6.6	16,275
フルキャストホールディングス	17.6	16.7	23,229
エン・ジャパン	33.3	28.3	72,815
リソルホールディングス	1.4	0.6	2,898
テクノプロ・ホールディングス	108.7	101.6	264,261
アトラグループ	3.2	1.7	272
インターワークス	4.6	－	－
アイ・アールジャパンホールディングス	9.7	9.2	11,242
ＫｅｅＰｅｒ技研	11.4	10.8	39,960
ファーストロジック	2	2.3	1,145
三機サービス	2.4	1.2	1,482
Ｇｕｎｏｓｙ	15.1	14.1	9,813
デザインワン・ジャパン	5.3	3.6	500
イー・ガーディアン	7.1	8.4	15,472
リブセンス	7.7	3.7	817
ジャパンマテリアル	56.3	53.2	103,686
ベクトル	29	21.4	27,584
ウチヤマホールディングス	7.1	3.2	1,084
チャーム・ケア・コーポレーション	15.6	14.6	21,067
キャリアリンク	6.8	6.5	15,463
ＩＢＪ	11.7	13.7	7,946
アサンテ	9.3	8.7	14,668
バリューＨＲ	16.2	15.3	21,114
M&Aキャピタルパートナーズ	14.9	14.1	29,046
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.8	7.1	7,447
ＥＲＩホールディングス	3.9	1.7	3,921
アビスト	2.3	1	3,305
シグマクシス・ホールディングス	28.1	22.9	30,731
ウィルグループ	15.6	14.7	13,744
エスクロー・エージェント・ジャパン	17.2	8.6	1,195
メドピア	16.4	15.5	8,866
レアジョブ	3	1.5	637
リクルートホールディングス	1,358.6	1,248.4	9,692,577
エラン	24.6	23.2	19,186
土木管理総合試験所	6.9	3.4	1,094
日本郵政	2,405.2	2,037.1	2,954,813
ベルシステム２４ホールディングス	24.8	18.8	29,497
鎌倉新書	21.2	15.2	8,040

国内株式インデックス マザーファンド　－第24期－

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

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

銘柄		当期首(前期末)	当期末	
		株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ダイセキ		37.5	35.5	110,227
ステップ		6.8	6.4	12,179
合計	株数・金額	208,833	270,769	652,736,925
	銘柄数<比率>	2,085	2,065	<98.2%>

(注1)銘柄欄の(　)内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。
(注2)合計欄の<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
国内	TOPIX	11,560	－

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	652,736,925	98.2
コール・ローン等、その他	12,061,145	1.8
投資信託財産総額	664,798,070	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年5月29日現在
(A)資産	664,759,117,889円
コール・ローン等	5,461,229,728
株式(評価額)	652,736,925,880
未収入金	59,807,700
未収配当金	6,150,757,503
未収利息	10,175
差入委託証拠金	350,386,903
(B)負債	105,648,420
未払解約金	105,648,420
(C)純資産総額(A-B)	664,653,469,469
元本	233,518,775,755
次期繰越損益金	431,134,693,714
(D)受益権総口数	233,518,775,755口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,463円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A)配当等収益	14,199,685,901円
受取配当金	14,193,776,372
受取利息	750,267
その他収益金	6,283,209
支払利息	△1,123,947
(B)有価証券売買損益	144,928,997,467
売買益	165,351,440,867
売買損	△20,422,443,400
(C)先物取引等取引損益	1,526,466,050
取引益	1,985,653,300
取引損	△459,187,250
(D)その他費用	△176
(E)当期損益金(A+B+C+D)	160,655,149,242
(F)前期繰越損益金	304,596,966,996
(G)追加信託差損益金	37,563,748,978
(H)解約差損益金	△71,681,171,502
(I)計 (E+F+G+H)	431,134,693,714
次期繰越損益金(I)	431,134,693,714

(注1)(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3)(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は255,447,146,244円、期中追加設定元本額は24,993,586,662円、期中一部解約元本額は46,921,957,151円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

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

お知らせ

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

（変更日：2023年6月28日）

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運 用 報 告 書

第3期（決算日　2024年4月5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2021年4月23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	わが国の金融商品取引所等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

【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。
・－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。

<580037>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
設定日(2021年4月23日)	10,000	－	10,000	－	－	－	－	399
第1期(2022年4月 5日)	10,554	5.5	10,602	6.0	94.6	3.7	1.5	479
第2期(2023年4月 5日)	10,755	1.9	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4	10,692
第3期(2024年4月 5日)	15,261	41.9	15,340	42.0	97.7	1.5	0.7	13,936

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
(当期首)	円	%		%	%	%	%
2023年 4月5日	10,755	－	10,803	－	96.4	2.2	1.4
4月末	11,213	4.3	11,265	4.3	96.6	2.0	1.3
5月末	11,666	8.5	11,722	8.5	97.1	1.6	1.3
6月末	12,550	16.7	12,611	16.7	97.8	0.9	1.2
7月末	12,725	18.3	12,787	18.4	98.0	0.7	1.3
8月末	12,768	18.7	12,829	18.8	98.1	0.6	1.3
9月末	12,807	19.1	12,867	19.1	97.3	1.5	1.2
10月末	12,385	15.2	12,442	15.2	97.1	1.5	1.3
11月末	13,183	22.6	13,248	22.6	97.5	1.5	0.8
12月末	13,112	21.9	13,176	22.0	98.6	0.5	0.8
2024年 1月末	14,221	32.2	14,292	32.3	98.7	0.5	0.8
2月末	14,866	38.2	14,940	38.3	98.6	0.7	0.7
3月末	15,618	45.2	15,698	45.3	97.2	2.1	0.7
(当期末)							
2024年 4月5日	15,261	41.9	15,340	42.0	97.7	1.5	0.7

(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）です。

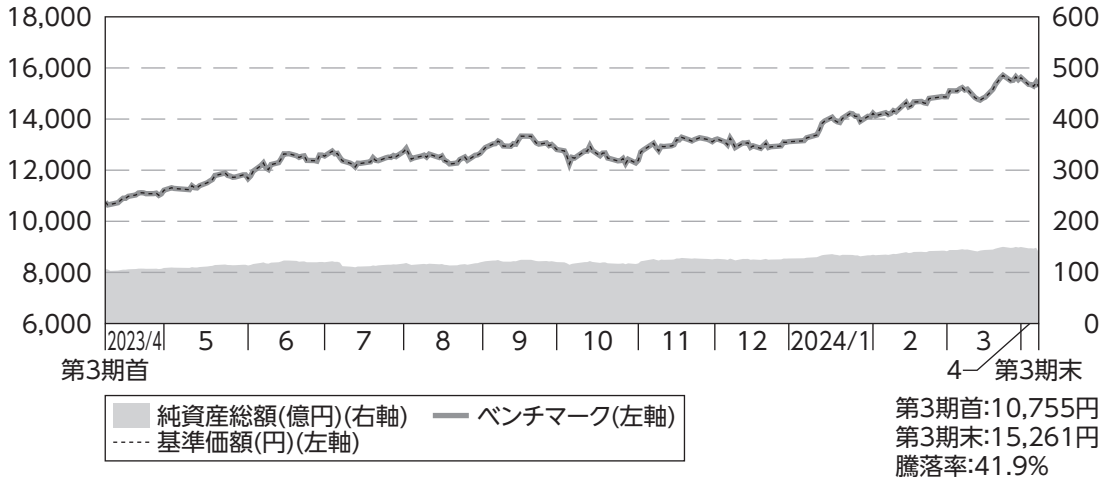
MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、親指数（MSCIジャパンIMI）構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ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MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ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、2023年4月5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ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で上昇しました。

投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。
期初は、米国の債務上限問題が解決したことや、米雇用統計の結果を受けてFRB（米連邦準備理事会）が利上げを見送るといった観測から国内株式市場は上昇しました。その後は、米長期金利の上昇や中東情勢の緊迫化など地政学リスクが懸念され軟調に推移する局面も見られましたが、為替市場で円安・米ドル高が進んだことや、米国株式市場が上昇基調に戻ったこと、海外からの資金流入が続いたことなどにより、国内株式市場は上昇しました。期末にかけては、日銀金融政策決定会合でマイナス金利の解除等が決定されたことを受けて、金融政策における不透明感の後退から日本のデフレ脱却を期待した買戻しが進み、国内株式市場は一段高となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

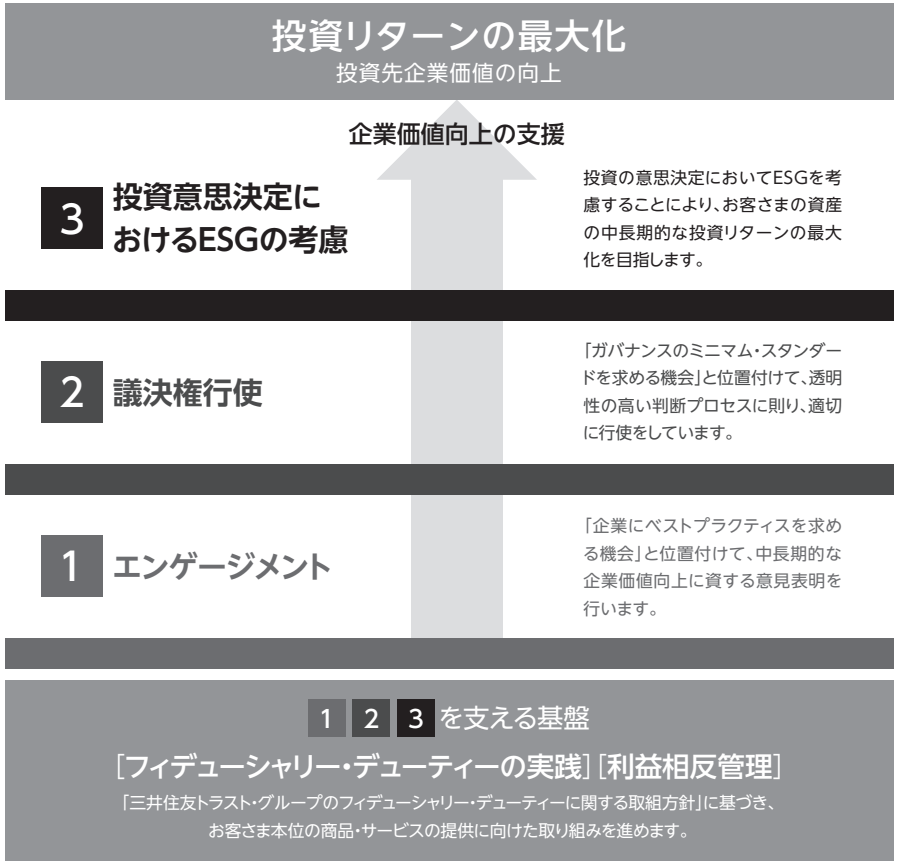
なお、ヘッジ目的で、株価指数先物取引（TOPIX先物）を適宜活用しています。

（2）ポートフォリオ構成

現物株式および投資信託証券については、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。

<当社のスチュワードシップ活動>

当社は「責任ある機関投資家」として、エンゲージメント、議決権行使、投資の意思決定におけるESGの考慮を3つの柱としてスチュワードシップ活動を推進しています。投資先企業の企業価値向上に資するスチュワードシップ活動を行うことを通じ、お客さまからお預かりしている資産の中長期的な投資リターンの最大化というゴールを目指します。そして、その全ての基盤がフィデューシャリー・デューティーの実践です。当社は、スチュワードシップ活動に関する利益相反の適切な管理がフィデューシャリー・デューティーの向上につながると考え、利益相反管理を適切に行っています。



当社の責任ある機関投資家としての取り組みは
スマートフォンで左記コードを読み取るかアドレスを入力することで
ご確認いただけます。
https://www.smtam.jp/institutional/stewardship_initiatives/

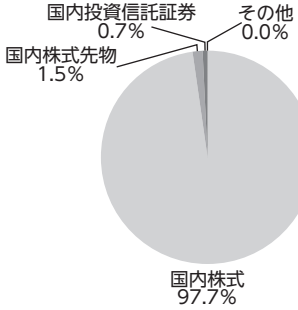
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

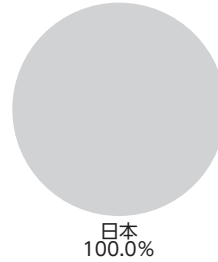
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	9.7%
2	東京エレクトロン	日本	4.4%
3	ソニーグループ	日本	4.1%
4	日立製作所	日本	3.3%
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本	2.8%
6	リクルートホールディングス	日本	2.4%
7	第一三共	日本	2.2%
8	東京海上ホールディングス	日本	2.2%
9	伊藤忠商事	日本	2.0%
10	任天堂	日本	2.0%
組入銘柄数		239	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

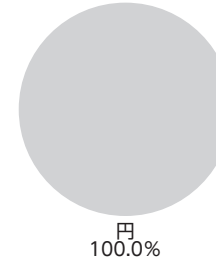
○資産別配分



○国別配分



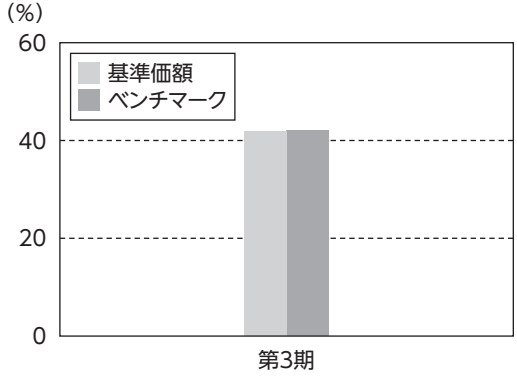
○通貨別配分



（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1.5%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

今後の運用方針

主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投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年4月6日～2024年4月5日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.002%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(0)	(0.001)	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
（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	－	－	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(－)	(－)	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）	(－)	(－)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.002	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（13,092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
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	1,288 (477)	3,643,417 (－)	1,668	4,365,763

(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
		口	千円	口	千円
国内	森ヒルズリート投資法人	12	1,707	14	2,000
	日本プロロジスリート投資法人	14	4,022	92	25,927
	ヒューリックリート投資法人	5	803	52	8,081
	積水ハウス・リート投資法人	29	2,336	33	2,634
	日本ビルファンド投資法人	12	7,138	14	8,245
	ジャパンリアルエステイト投資法人	11	6,130	11	6,056
	日本プライムリアルティ投資法人	3	1,076	34	12,557
	ユナイテッド・アーバン投資法人	21	3,149	30	4,476
	日本ロジスティクスファンド投資法人	7	2,111	7	2,049
	ジャパンエクセレント投資法人	7	904	51	7,076

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)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	百万円	百万円
国内	株式先物取引	1,981	2,043	－	－

(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	8,009,180千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	12,196,456千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.65

(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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	26,035	2,139	8.2	26,050	2,137	8.2

(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	12百万円	15百万円	73百万円

(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)
鉱業(0.6%)			
ＩＮＰＥＸ	37.7	34.2	84,474
建設業(1.7%)			
大林組	23.6	22.9	40,601
清水建設	20	18.3	16,577
住友林業	5.1	－	－
大和ハウス工業	21.8	20.9	93,067
積水ハウス	22.4	21	73,416
高砂熱学工業	1.7	1.5	7,027
大氣社	0.9	0.8	3,572
千代田化工建設	5.7	－	－
食料品(3.1%)			
明治ホールディングス	8	8.3	27,771
サッポロホールディングス	2.3	2.2	13,136
アサヒグループホールディングス	16.6	17	94,061
キリンホールディングス	29.9	27.4	58,225
サントリー食品インターナショナル	5	4.9	25,480
伊藤園	1.9	1.9	7,071
不二製油グループ本社	1.6	－	－
キッコーマン	5.3	23.9	45,457
味の素	16.6	16.5	91,525
キユーピー	3.3	－	－
ハウス食品グループ本社	2.2	－	－
カゴメ	2.7	2.7	9,844
ニチレイ	3.9	3.8	15,424
日清食品ホールディングス	2.2	7.1	29,365
繊維製品(0.4%)			
東洋紡	2.9	2.8	3,077
帝人	6.5	6.3	8,990
東レ	50.3	48.9	35,829
化学(5.8%)			
クラレ	11.6	10	16,240
旭化成	45.5	44.2	48,332
住友化学	54.1	52.5	18,380
東ソー	9.4	9.2	19,780
デンカ	2.7	2.8	6,510
カネカ	1.7	1.6	6,131
三井化学	6.7	6	26,484
ＪＳＲ	6.4	6.5	28,229
東京応化工業	1.2	3.4	14,558
三菱ケミカルグループ	46.5	45.1	41,018
ダイセル	9.3	8.1	11,510
積水化学工業	13.3	13.4	29,714
ＵＢＥ	3.5	3.2	8,788
日本化薬	－	4.8	6,196
花王	16.9	16.4	100,778
日本ペイントホールディングス	30.1	33.4	35,036
関西ペイント	6.4	6.3	13,844
ＤＩＣ	2.8	2.7	8,086
富士フイルムホールディングス	13.1	39.5	131,693
資生堂	－	14.1	58,388
ライオン	8.5	8.8	11,880
小林製薬	1.8	－	－
デクセリアルズ	2	－	－
日東電工	5.2	5.1	70,762
信越ポリマー	1.5	1.5	2,281
ニフコ	2.9	2.7	10,203
ユニ・チャーム	14.6	14.2	64,624
医薬品(4.3%)			
協和キリン	9.8	9.5	25,189
アステラス製薬	66.6	63.8	102,239
塩野義製薬	9.6	8.7	65,928
中外製薬	24.4	－	－
エーザイ	9.1	8.9	54,325
小野薬品工業	13.1	12.8	31,321
参天製薬	12.7	－	－
第一三共	63.6	65.2	303,897
石油・石炭製品(0.5%)			
ＥＮＥＯＳホールディングス	111.4	101.5	73,790
ゴム製品(1.0%)			
ブリヂストン	20.7	20.1	132,157
住友理工	1.3	1.3	1,691
ガラス・土石製品(0.5%)			
太平洋セメント	4.2	4.1	14,358
東海カーボン	－	7.1	7,181
ＴＯＴＯ	5.1	5	21,060
日本特殊陶業	5.6	5.4	26,487
鉄鋼(1.4%)			
日本製鉄	29.3	30.1	108,209
神戸製鋼所	12.2	12.6	24,891
ＪＦＥホールディングス	17.8	20.3	50,354
非鉄金属(0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	2	2	3,670
三井金属鉱業	2	1.9	9,076
三菱マテリアル	4.3	4.4	12,839
住友金属鉱山	9	8.7	44,013

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ＤＯＷＡホールディングス	1.9	1.9	10,655
ＵＡＣＪ	1.1	1.2	5,196
金属製品(0.1%)			
ＬＩＸＩＬ	10.4	10.1	18,488
機械(5.7%)			
三浦工業	3.2	3.1	9,174
アマダ	－	12	20,082
ナブテスコ	4	3.8	9,729
小松製作所	33.6	32.6	145,656
日立建機	3.9	3.8	17,806
クボタ	36.7	35.3	87,614
荏原製作所	3.3	3.3	43,230
ダイキン工業	9	9.3	187,534
栗田工業	3.8	3.7	23,095
ダイフク	11.1	10.7	36,925
グローリー	1.7	1.5	4,167
セガサミーホールディングス	5.7	5.5	10,606
ＮＴＮ	－	15	4,560
日立造船	5.9	5.7	7,033
三菱重工業	11.6	113	150,120
ＩＨＩ	－	5.2	20,155
電気機器(22.8%)			
イビデン	4.1	4	25,308
コニカミノルタ	16.4	16.8	8,736
ブラザー工業	－	8.2	23,054
日立製作所	35.2	32.7	453,385
富士電機	4.6	4.5	44,676
安川電機	8.7	8.5	52,479
明電舎	1.2	－	－
オムロン	6.7	6.2	33,058
日本電気	－	8.7	96,178
富士通	7.1	62	147,839
ルネサスエレクトロニクス	－	51.8	139,704
セイコーエプソン	10.2	10.2	27,075
アルバック	－	1.7	16,804
パナソニック　ホールディングス	80.2	77.8	107,519
シャープ	－	9.2	7,843
アンリツ	4.9	4.8	5,772
ソニーグループ	45.8	44.5	568,710
ＴＤＫ	14.1	13.7	101,612
アルプスアルパイン	7.2	6.6	8,032
日本航空電子工業	1.7	－	－
横河電機	8.3	8	27,792
アズビル	4.2	4.2	18,009
アドバンテスト	6.6	27	163,134
シスメックス	6.1	17.7	44,391
スタンレー電気	4.7	4.5	12,354

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ファナック	35	33.6	142,060
ローム	3.2	－	－
京セラ	11.6	－	－
太陽誘電	4.3	4.4	15,835
村田製作所	20.8	60.7	165,073
リコー	19.9	19.3	25,977
東京エレクトロン	16.2	16.6	618,682
輸送用機器(10.4%)			
川崎重工業	5.5	5.3	24,692
トヨタ自動車	384.9	373.8	1,352,782
マツダ	20.6	－	－
ヤマハ発動機	10.8	31.5	44,730
精密機器(2.0%)			
テルモ	23.4	－	－
島津製作所	8.6	8.3	33,797
ニコン	11	10.5	16,012
ＨＯＹＡ	－	12.4	216,070
ノーリツ鋼機	－	0.6	1,789
その他製品(2.9%)			
前田工繊	0.6	0.6	2,082
大建工業	0.4	－	－
大日本印刷	8.1	7.2	33,048
ＮＩＳＳＨＡ	1.4	1.3	1,882
アシックス	5.9	5.7	39,974
ヤマハ	5.1	4.6	14,871
リンテック	1.4	1.4	4,389
任天堂	40.1	36.6	283,320
コクヨ	3	2.8	7,037
美津濃	0.6	0.6	3,942
電気・ガス業(1.1%)			
東北電力	16.4	16	19,128
九州電力	14.6	14.2	20,334
電源開発	5.3	5.2	13,054
レノバ	1.3	1.4	1,716
東京瓦斯	14.2	13	45,591
大阪瓦斯	13.6	13.2	43,599
東邦瓦斯	2.7	2.6	8,907
西部ガスホールディングス	－	0.9	1,734
陸運業(2.2%)			
東武鉄道	－	6.7	24,086
相鉄ホールディングス	2.8	2.8	7,648
東急	19.3	17.6	32,146
京王電鉄	3.7	3.6	14,803
西日本旅客鉄道	8	15.5	47,476
西武ホールディングス	8.2	8	19,848
西日本鉄道	2.2	2.1	5,233
阪急阪神ホールディングス	8.3	8.1	35,073

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
南海電気鉄道	3.7	3.6	11,088
京阪ホールディングス	3.5	3.4	11,390
名古屋鉄道	－	6.6	13,952
ヤマトホールディングス	－	9.4	20,313
山九	1.9	1.7	8,722
センコーグループホールディングス	3.7	3.9	4,637
九州旅客鉄道	4.9	4.7	16,243
ＳＧホールディングス	10.5	11.3	21,345
NIPPON EXPRESSホールディングス	2.8	－	－
海運業(0.5%)			
日本郵船	17.6	16.2	66,079
空運業(0.1%)			
ＡＮＡホールディングス	－	5.6	17,152
倉庫・運輸関連業(0.0%)			
トランコム	0.3	0.2	1,198
情報・通信業(4.5%)			
ＴＩＳ	8.2	7.8	24,601
ＳＨＩＦＴ	0.5	0.4	8,586
ティーガイア	－	0.6	1,209
オープンドア	0.5	－	－
マネーフォワード	1.6	1.5	9,091
ビジョナル	0.6	－	－
野村総合研究所	14.4	13.6	57,419
メルカリ	3.8	4	7,290
フリー	－	1.5	4,657
ＬＩＮＥヤフー	97	94.2	35,146
伊藤忠テクノソリューションズ	3.5	－	－
サイボウズ	0.9	－	－
ネットワンシステムズ	－	2.9	7,963
ＢＩＰＲＯＧＹ	2.6	2.7	12,117
ビジョン	1.4	－	－
ＫＤＤＩ	58.5	52.8	232,584
ソフトバンク	104.2	101.4	194,789
ＮＴＴデータグループ	22.9	－	－
カプコン	6.3	－	－
ＳＣＳＫ	5.7	5.5	15,457
卸売業(3.4%)			
あらた	0.5	－	－
双日	－	7.9	31,189
ＴＯＫＡＩホールディングス	3.5	3.4	3,257
アズワン	1.1	2	5,224
伊藤忠商事	43.1	41.9	284,542
丸紅	56.1	50.5	131,704
三井物産	52	－	－
キヤノンマーケティングジャパン	1.7	1.6	6,849
サンゲツ	1.5	－	－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
伊藤忠エネクス	－	1.9	3,040
モスフードサービス	0.9	－	－
イエローハット	1.2	－	－
小売業(4.2%)			
ローソン	1.6	1.6	16,536
ゲオホールディングス	0.8	0.8	1,473
アダストリア	－	0.9	3,348
ハローズ	0.3	－	－
大黒天物産	0.2	－	－
ジンズホールディングス	－	0.5	2,065
ＤＣＭホールディングス	4	－	－
Ｊ．フロント　リテイリング	－	8.6	13,626
マツキヨココカラ&カンパニー	4.2	12.1	28,919
ＺＯＺＯ	4.5	4.8	17,601
三越伊勢丹ホールディングス	－	11.9	28,905
オイシックス・ラ・大地	1	0.9	1,077
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1.9	1.9	1,888
イオン北海道	1.5	1.7	1,700
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	－	13.4	51,295
スギホールディングス	1.3	3.7	9,287
日本瓦斯	3.8	3.7	9,632
マックスバリュ東海	0.3	0.3	910
丸井グループ	6.4	5.5	13,648
イオン	23.7	23	79,580
平和堂	1	－	－
ヤオコー	0.7	0.6	5,258
ケーズホールディングス	－	5	7,110
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	0.3	－	－
ヤマダホールディングス	26.3	20.4	9,012
ファーストリテイリング	6.4	6.2	273,792
サンドラッグ	2.6	－	－
銀行業(5.8%)			
しずおかフィナンシャルグループ	16.2	－	－
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	433.8	－	－
りそなホールディングス	78.4	74.9	71,604
三井住友トラスト・ホールディングス	12	23.1	73,943
三井住友フィナンシャルグループ	47.4	44.8	391,596
みずほフィナンシャルグループ	－	85	249,347
証券、商品先物取引業(1.1%)			
大和証券グループ本社	48.4	47	52,569
野村ホールディングス	105.6	105.9	97,713
マネックスグループ	6.3	－	－
保険業(4.2%)			
ＳＯＭＰＯホールディングス	11.4	31.4	99,443

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	15.6	45.3	124,393
第一生命ホールディングス	35.6	－	－
東京海上ホールディングス	66.6	63.5	302,260
Ｔ＆Ｄホールディングス	－	17.3	45,455
その他金融業(1.0%)			
東京センチュリー	1.3	5.2	8,234
オリックス	43.4	41.3	131,623
不動産業(2.9%)			
ヒューリック	13.9	13.5	19,939
野村不動産ホールディングス	4.3	3.9	16,325
東急不動産ホールディングス	－	21.6	25,444
三井不動産	32.9	94.1	149,619
三菱地所	40.9	39.7	110,564
平和不動産	1.1	－	－
東京建物	6.8	6.6	16,559
住友不動産	11.2	10.1	56,640
サービス業(5.2%)			
パーソルホールディングス	－	65.8	13,686
綜合警備保障	2.8	－	－
ディップ	1.3	－	－
エスプール	2.4	－	－
H. U. グループホールディングス	1.9	1.9	4,527
オリエンタルランド	36.5	38.5	180,757
ダスキン	1.5	1.4	4,583
リゾートトラスト	－	2.7	7,042
ビー・エム・エル	－	0.7	2,047
ユー・エス・エス	－	14.5	17,885
サイバーエージェント	15.6	－	－
楽天グループ	－	52.8	45,550
テクノプロ・ホールディングス	3.9	3.8	11,115
リクルートホールディングス	52.3	50.8	338,886
エラン	1.1	1.1	1,006
インソース	1.7	1.8	1,488
カーブスホールディングス	1.9	1.8	1,440
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	0.7	0.8	1,595
乃村工藝社	2.8	2.7	2,424
セコム	－	7.4	79,291
ベネッセホールディングス	2.6	－	－
合計 株数・金額	4,037	4,135	13,621,988
合計 銘柄数<比率>	239	232	<97.7%>

(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。

＜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(%)
森ヒルズリート投資法人		56	54	7,225	0.1
日本プロロジスリート投資法人		78	－	－	－
ヒューリックリート投資法人		47	－	－	－
積水ハウス・リート投資法人		151	147	11,760	0.1
日本ビルファンド投資法人		56	54	32,292	0.2
ジャパンリアルエステイト投資法人		45	45	23,715	0.2
日本プライムリアルティ投資法人		31	－	－	－
ユナイテッド・アーバン投資法人		107	98	14,582	0.1
日本ロジスティクスファンド投資法人		31	31	8,335	0.1
ジャパンエクセレント投資法人		44	－	－	－
合計	口数・金額	646	429	97,910	
	銘柄数＜比率＞	10	6	＜0.7%＞	

(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	
森ヒルズリート投資法人	ユナイテッド・アーバン投資法人
日本ビルファンド投資法人	日本ロジスティクスファンド投資法人

＜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	ミニTOPIX	211	－

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	13,621,988	92.8
投資証券	97,910	0.7
コール・ローン等、その他	959,927	6.5
投資信託財産総額	14,679,825	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年4月5日現在
(A)資産	14,679,215,810円
コール・ローン等	87,768,718
株式(評価額)	13,621,988,430
投資証券(評価額)	97,910,500
未収入金	731,162,504
未収配当金	130,102,872
未収利息	158
差入委託証拠金	10,282,628
(B)負債	742,244,109
未払金	2,240,924
未払解約金	740,003,185
(C)純資産総額(A-B)	13,936,971,701
元本	9,132,250,376
次期繰越損益金	4,804,721,325
(D)受益権総口数	9,132,250,376口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,261円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年4月6日 至 2024年4月5日
(A)配当等収益	284,578,270円
受取配当金	284,599,013
受取利息	4,235
その他収益金	15,371
支払利息	△40,349
(B)有価証券売買損益	4,033,093,741
売買益	4,242,175,519
売買損	△209,081,778
(C)先物取引等取引損益	41,549,052
取引益	55,206,732
取引損	△13,657,680
(D)その他費用	△2
(E)当期損益金(A+B+C+D)	4,359,221,061
(F)前期繰越損益金	750,371,690
(G)追加信託差損益金	530,682,549
(H)解約差損益金	△835,553,975
(I)計(E+F+G+H)	4,804,721,325
次期繰越損益金(I)	4,804,721,325

(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9,942,102,895円、期中追加設定元本額は1,672,392,572円、期中一部解約元本額は2,482,245,091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。

国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	6,937,533,505円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	1,042,820,494円
コア投資戦略ファンド(成長型)	402,453,080円
コア投資戦略ファンド(切替型)	181,262,559円
コア投資戦略ファンド(安定型)	170,318,012円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	148,948,821円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	91,891,240円
FOFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	70,237,154円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド(適格機関投資家専用)	49,303,702円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	37,481,809円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

（変更日：2024年3月20日）

日本株式エクセレント・フォーカス　マザーファンド

運 用 報 告 書

第21期（決算日　2023年11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2002年12月20日から無期限です。
運 用 方 針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが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

【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。
・－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。

＜880006＞

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第17期(2019年12月 2日)	29,267	11.9	2,611.46	5.5	98.8	―	15,502
第18期(2020年11月30日)	36,722	25.5	2,738.72	4.9	98.8	―	19,181
第19期(2021年11月30日)	40,413	10.1	3,073.26	12.2	99.2	―	21,035
第20期(2022年11月30日)	40,389	△0.1	3,249.61	5.7	99.2	―	21,705
第21期(2023年11月30日)	50,271	24.5	3,986.65	22.7	99.0	―	27,108

(注)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2022年11月30日	40,389	―	3,249.61	―	99.2	―
12月末	38,178	△5.5	3,101.25	△4.6	99.5	―
2023年 1月末	40,215	△0.4	3,238.48	△0.3	99.5	―
2月末	39,961	△1.1	3,269.12	0.6	99.4	―
3月末	41,447	2.6	3,324.74	2.3	98.7	―
4月末	42,074	4.2	3,414.45	5.1	98.6	―
5月末	44,990	11.4	3,537.93	8.9	98.4	―
6月末	48,324	19.6	3,805.00	17.1	99.3	―
7月末	49,683	23.0	3,861.80	18.8	99.4	―
8月末	49,847	23.4	3,878.51	19.4	99.5	―
9月末	48,210	19.4	3,898.26	20.0	98.9	―
10月末	46,322	14.7	3,781.64	16.4	98.8	―
(当期末)						
2023年11月30日	50,271	24.5	3,986.65	22.7	99.0	―

(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は買建比率－売建比率です。

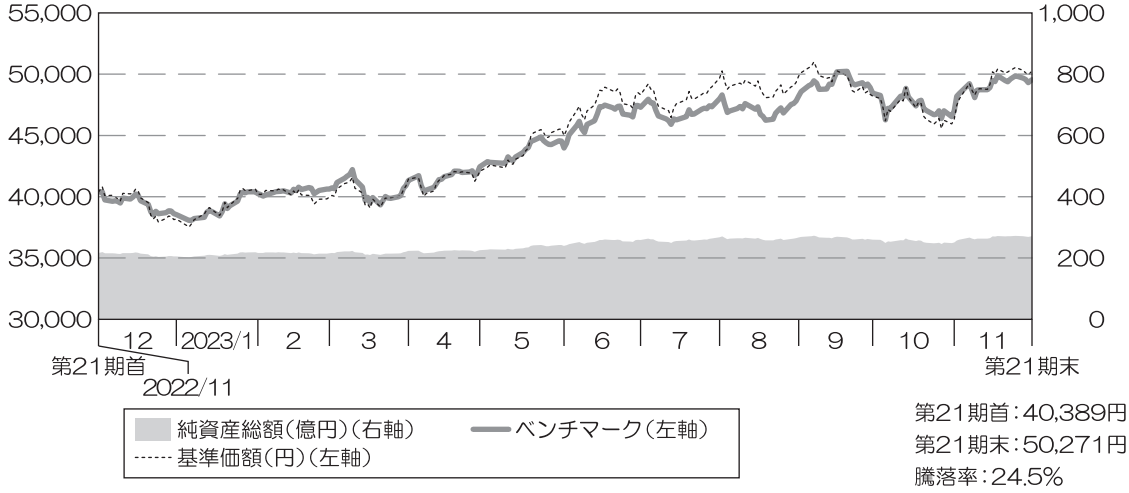
ベンチマークは、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

TOPIX（東証株価指数）とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みＴＯＰＩＸ」という。）の指数値及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など配当込みＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みＴＯＰＩＸに係る標章又は商標に関するすべての権利はＪＰＸが有します。ＪＰＸは、配当込みＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



第21期首：40,389円
第21期末：50,271円
騰落率：24.5%

(注)ベンチマークは、2022年11月30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

当期末の基準価額は、期首比で上昇しました。
国内株式市場は期初は軟調な出足となりましたが、2023年に入り米国のインフレに対する警戒感が後退したことを受け、成長株を中心に見直し買いが入る展開となりました。中国の経済正常化に伴う設備投資需要の回復期待が高まった機械や、2024年以降の市場回復が想定される半導体関連企業が多く属する電気機器などが牽引役となり、基準価額を押し上げました。原油価格の上昇や中東情勢の緊迫化などが上値を押さえる場面もありましたが、為替の円安・ドル高を背景とした外需関連企業の業績拡大期待から、期末にかけて上げ幅を拡大しました。
個別銘柄では、半導体市場の回復期待からディスコや東京エレクトロン、高付加価値セラミック製品の拡販期待が高まるMARUWAなどが基準価額にプラス寄与しました。一方、訪日外国人によるインバウンド需要の回復期待が後退した資生堂、製薬企業向けマーケティング支援事業の成長率鈍化が嫌気されたエムスリーなどが基準価額にマイナスに影響しました。

投資環境

国内株式市場は期初は金融引き締めによる世界景気の悪化懸念から軟調な出足となりましたが、2023年に入り米国のインフレに対する警戒感が後退したほか、中国経済の再開期待が高まり、切り返す展開となりました。3月には欧米金融機関に対する信用不安から急速に上げ幅を縮小する場面も見られましたが、好調な企業業績や積極的な株主還元姿勢などが評価される形で、上げ幅を拡大しました。10月には原油価格の上昇、中東情勢の緊迫化などが上値を押さえる要因となりましたが、円安進行による外需関連企業への業績寄与や、米国での利上げ局面の終了および利下げ期待の高まりが下支え要因となり、底堅く推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

投資行動は、業績動向とバリュエーションに着目した入れ替えを行いました。
業種では電気機器、小売業、機械のウェイトを引き上げた一方、輸送用機器、サービス業のウェイトを引き下げ、非鉄金属のオーバーウェイト幅を縮小しました。
個別銘柄では日立製作所、三井住友フィナンシャルグループ、アドバンテストなどのウェイトを引き上げ、TOTO、住友金属鉱山、エムスリーなどのウェイトを引き下げました。

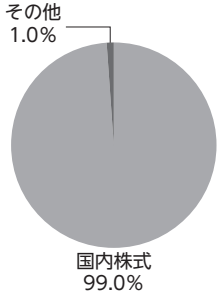
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

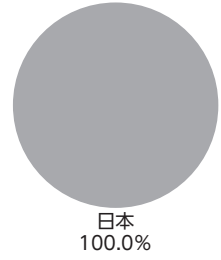
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ＭＡＲＵＷＡ	日本	5.1%
2	ソニーグループ	日本	4.4%
3	ＳＨＩＦＴ	日本	4.1%
4	信越化学工業	日本	3.7%
5	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本	3.7%
6	東京エレクトロン	日本	3.6%
7	ディスコ	日本	3.6%
8	キーエンス	日本	3.5%
9	三菱商事	日本	3.3%
10	三井住友フィナンシャルグループ	日本	3.0%
組入銘柄数		47	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

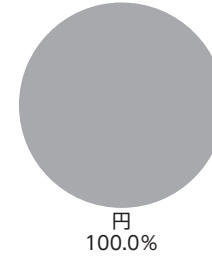
○資産別配分



○国別配分



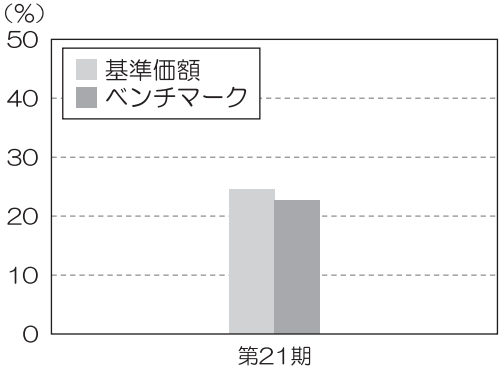
○通貨別配分



(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。



ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)(配当込み)を上回りました。
業種構成要因はマイナスとなりました。電気機器のオーバーウェイトや精密機器のアンダーウェイトなどがプラスに寄与しましたが、非鉄金属のオーバーウェイトや卸売業のアンダーウェイトなどがマイナスに影響しました。
銘柄選択要因はプラスとなりました。ディスコ、MARUWA、東京エレクトロンのオーバーウェイトなどがプラスに寄与しましたが、エーザイ、資生堂、第一三共のオーバーウェイトなどがマイナスに影響しました。

今後の運用方針

個別企業分析に、市場動向分析を積極的に付加し、投資銘柄を厳選することにより、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)(配当込み)に対する超過リターンを目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2022年12月1日～2023年11月30日)		項目の概要
	金額	比率	
(a)売買委託手数料	**17円**	**0.038%**	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(株式)	(17)	(0.038)	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
(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)	(－)	(－)	
(b)有価証券取引税	**－**	**－**	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(株式)	(－)	(－)	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
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(－)	(－)	
(c)その他費用	**0**	**0.000**	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(－)	(－)	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)	(－)	(－)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	**17**	**0.038**	

(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(44,136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
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	2,181 (1,184)	8,365,313 (－)	1,786	7,961,090

(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。

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)期中の株式売買金額	16,326,403千円
(b)期中の平均組入株式時価総額	23,959,196千円
(c)売買高比率(a)/(b)	0.68

(注1)(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2)(c)売買高比率は小数点第3位以下を切り捨てています。

利害関係人※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	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	31,669	3,299	10.4	31,635	3,299	10.4

(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

〈国内株式(上場株式)〉

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
建設業(0.5%)			
大和ハウス工業	79.1	29.7	124,710
化学(5.6%)			
信越化学工業	45.5	192.9	1,005,394
花王	35.6	—	—
資生堂	72.7	50.7	201,076
ユニ・チャーム	—	64.8	308,642
医薬品(4.4%)			
エーザイ	66.6	49.3	378,229
第一三共	181	200.3	801,200
ガラス・土石製品(5.2%)			
ＴＯＴＯ	89.6	—	—
ＭＡＲＵＷＡ	43.3	46.7	1,390,259
鉄鋼(1.7%)			
日本製鉄	—	89.8	310,438
ＪＦＥホールディングス	—	66.9	145,842
非鉄金属(3.1%)			
住友金属鉱山	98.7	44.1	189,277
住友電気工業	310.5	350.4	642,633
機械(12.8%)			
日本製鋼所	174.4	164.7	420,561
ディスコ	7.6	30.1	965,909
ＳＭＣ	6.4	8.6	640,270
ダイキン工業	17.9	13.1	290,230
ダイフク	76.7	210.3	585,264
三菱重工業	35.8	64.6	534,112
電気機器(22.8%)			
イビデン	98.7	81.4	575,579
日立製作所	—	67.9	698,351
富士電機	77.9	88.9	551,268
ソニーグループ	87.7	93.4	1,197,388
アドバンテスト	—	93.6	438,141
キーエンス	14.5	15	950,250
ファナック	1.9	—	—
エンプラス	—	18.8	250,792
村田製作所	64.1	158.9	458,188
東京エレクトロン	16.5	40.9	982,622
輸送用機器(6.8%)			
豊田自動織機	27	—	—
デンソー	62.7	254.9	589,838
川崎重工業	256.2	225.7	759,029
トヨタ自動車	242.1	166	463,887
シマノ	11.5	—	—
精密機器(1.6%)			
ＨＯＹＡ	25	25.4	423,291
陸運業(4.0%)			
東海旅客鉄道	35.4	175.7	623,735
西武ホールディングス	—	249.4	445,054
情報・通信業(7.0%)			
ＳＨＩＦＴ	31	32.1	1,105,524
GMOペイメントゲートウェイ	18.9	24.3	211,580
野村総合研究所	88	122.4	508,204
伊藤忠テクノソリューションズ	71.7	—	—
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	39.5	23	61,272
卸売業(3.3%)			
三菱商事	156	128.7	886,228
小売業(8.2%)			
Ｊ．フロント　リテイリング	—	272.2	368,694
マツキヨココカラ&カンパニー	71.8	272	694,552
三越伊勢丹ホールディングス	305.5	431.6	721,203
良品計画	53.6	—	—
ニトリホールディングス	7.6	12.2	208,132
ファーストリテイリング	3.2	5.7	213,693
銀行業(6.7%)			
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	788.4	797.9	1,001,364
三井住友フィナンシャルグループ	40	111	805,638
保険業(ー%)			
第一生命ホールディングス	46.6	—	—
不動産業(1.5%)			
パーク２４	212.9	227.1	409,347
サービス業(4.8%)			
エムスリー	82	—	—
オリエンタルランド	34.2	117.7	591,442
リクルートホールディングス	144.7	126.7	697,483
合計 株数・金額	4,558	6,137	26,825,830
合計 銘柄数〈比率〉	48	47	〈99.0%〉

(注1)(　)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)〈　〉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
	千円	%
株式	26,825,830	99.0
コール・ローン等、その他	283,864	1.0
投資信託財産総額	27,109,694	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2023年11月30日現在
(A) 資産	27,109,694,560円
コール・ローン等	149,981,360
株式(評価額)	26,825,830,250
未収配当金	133,882,950
(B) 負債	773,313
未払解約金	773,181
未払利息	132
(C) 純資産総額(A-B)	27,108,921,247
元本	5,392,588,600
次期繰越損益金	21,716,332,647
(D) 受益権総口数	5,392,588,600口
1万口当たり基準価額(C/D)	50,271円

■損益の状況

項目	当期 自 2022年12月 1日 至 2023年11月30日
(A) 配当等収益	398,437,169円
受取配当金	398,500,650
受取利息	535
その他収益金	2,000
支払利息	△66,016
(B) 有価証券売買損益	4,895,831,218
売買益	5,751,834,071
売買損	△856,002,853
(C) その他費用	△3
(D) 当期損益金(A+B+C)	5,294,268,384
(E) 前期繰越損益金	16,331,760,412
(F) 追加信託差損益金	1,551,501,770
(G) 解約差損益金	△1,461,197,919
(H) 計 (D+E+F+G)	21,716,332,647
次期繰越損益金(H)	21,716,332,647

(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5,374,168,385円、期中追加設定元本額は437,136,412円、期中一部解約元本額は418,716,197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日本株式エクセレント・フォーカス	5,218,264,491円
日本株式エクセレント・フォーカスファンド	173,109,268円
日本株式エクセレント・フォーカスＶＡ（適格機関投資家専用）	1,214,841円

お知らせ

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

（変更日：2023年6月28日）

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

（変更日：2023年9月1日）

外国株式インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第24期（決算日　2024年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【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。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
第20期(2020年5月29日)	25,857	3.4	27,971	3.6	92.9	4.2	2.5	399,725
第21期(2021年5月31日)	37,583	45.3	40,792	45.8	95.3	2.5	2.2	517,603
第22期(2022年5月30日)	41,948	11.6	45,606	11.8	94.1	3.7	2.3	523,424
第23期(2023年5月29日)	47,791	13.9	52,071	14.2	95.6	2.5	2.0	581,354
第24期(2024年5月29日)	66,749	39.7	72,993	40.2	95.4	2.9	1.7	770,315

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
(当期首)	円	%		%	%	%	%
2023年 5月29日	47,791	－	52,071	－	95.6	2.5	2.0
5月末	47,366	△0.9	51,624	△0.9	95.4	2.7	2.0
6月末	51,092	6.9	55,723	7.0	96.4	1.6	2.0
7月末	51,873	8.5	56,582	8.7	95.9	2.2	2.0
8月末	52,777	10.4	57,565	10.6	95.7	2.3	2.0
9月末	51,507	7.8	56,180	7.9	95.1	3.0	1.9
10月末	49,769	4.1	54,309	4.3	96.0	2.2	1.9
11月末	53,682	12.3	58,567	12.5	95.4	2.7	1.9
12月末	54,634	14.3	59,682	14.6	96.2	1.7	2.0
2024年 1月末	57,975	21.3	63,266	21.5	96.9	1.1	1.9
2月末	60,773	27.2	66,346	27.4	96.8	1.4	1.9
3月末	63,305	32.5	69,156	32.8	95.8	2.3	1.9
4月末	64,150	34.2	70,086	34.6	95.7	2.5	1.8
(当期末)							
2024年 5月29日	66,749	39.7	72,993	40.2	95.4	2.9	1.7

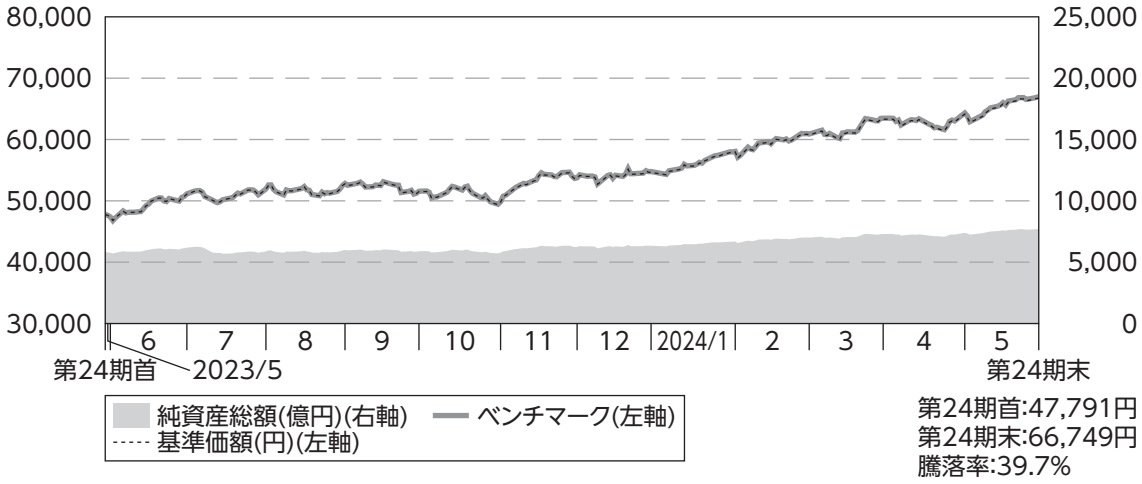
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。
MSCIコクサイ・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIコクサイ・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIコクサイ・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

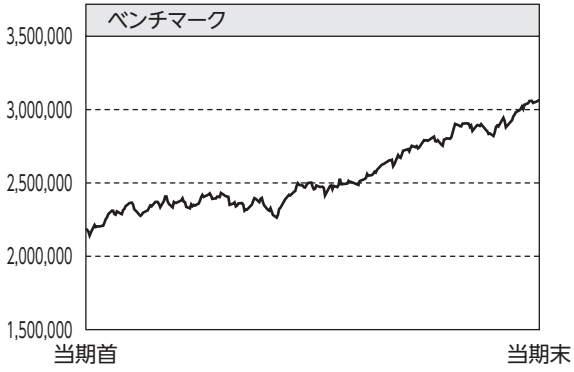


(注)ベンチマークは、2023年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

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

当ファンドのポートフォリオ

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

（1）組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

（2）ポートフォリオ構成

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

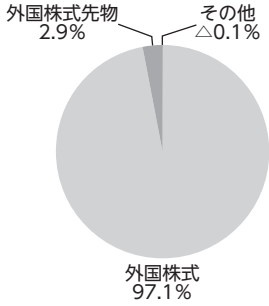
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

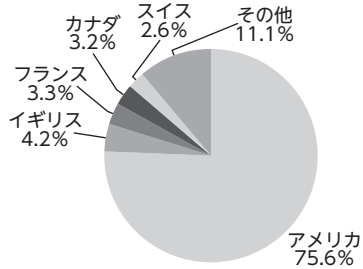
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.8%
2	NVIDIA CORP	アメリカ	4.4%
3	APPLE INC	アメリカ	4.4%
4	AMAZON.COM	アメリカ	2.7%
5	S&P 500 EMIN 2406	アメリカ	2.2%
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	1.7%
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.6%
8	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.4%
9	ELI LILLY & CO	アメリカ	1.0%
10	BROADCOM INC	アメリカ	1.0%
組入銘柄数		1,257	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

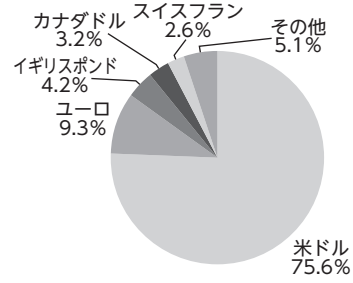
○資産別配分



○国別配分



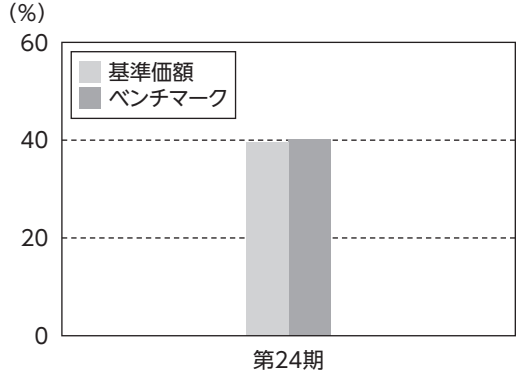
○通貨別配分



（注1）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。
（注2）国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.9%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。
差異の主な要因は、配当課税要因※1および為替評価差要因※2（いずれもマイナス要因）です。

※1 ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異要因です。
※2 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年5月30日～2024年5月29日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	2円	0.003%	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(1)	(0.002)	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
（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	1	0.002	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(1)	(0.002)	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
（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	15	0.027	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(15)	(0.027)	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）	(－)	(－)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	18	0.032	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（54,908円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株　式＞

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 17,741 (5,692)	千米ドル 158,820 (4,161)	百株 28,694 (238)	千米ドル 289,535 (3,463)
	カナダ	2,743 (330)	千カナダドル 13,593 (2,166)	3,897 (132)	千カナダドル 18,413 (2,248)
	ドイツ	1,263 (－)	千ユーロ 6,511 (△291)	3,022	千ユーロ 9,776
	イタリア	2,496 (－)	2,438 (△3)	3,414	3,485
	フランス	1,456 (305)	6,293 (△139)	3,259 (－)	13,369 (0.00001)
	オランダ	1,919 (1,002)	6,054 (1,063)	2,669 (810)	7,687 (1,026)
	スペイン	696 (9,392)	1,015 (△822)	3,967 (9,549)	3,314 (252)
	ベルギー	60 (53)	1,006 (－)	194	1,389
	ルクセンブルク	103	255	728	267
	フィンランド	70 (2,697)	255 (2,299)	1,011	797
	アイルランド	633	938	123 (686)	1,003 (4,928)
	ポルトガル	1,529	1,144	1,461	1,099
	その他	－ (－)	－ (△43)	468	260
	イギリス	17,864 (1,480)	千イギリスポンド 8,494 (4,235)	26,792	千イギリスポンド 12,513
	スイス	706 (304)	千スイスフラン 6,893 (△265)	4,094	千スイスフラン 10,997
	スウェーデン	1,969 (833)	千スウェーデンクローナ 33,715 (－)	5,362 (2,366)	千スウェーデンクローナ 56,592 (26,001)
	ノルウェー	508	千ノルウェークローネ 6,103	869	千ノルウェークローネ 10,138
	デンマーク	363 (1,286)	千デンマーククローネ 16,493 (－)	485	千デンマーククローネ 27,320

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	オーストラリア	2,972 (△298)	千オーストラリアドル 8,414 (－)	4,805 (243)	千オーストラリアドル 11,312 (1,579)
	ニュージーランド	1,216	千ニュージーランドドル 627	1,617	千ニュージーランドドル 817
	香港	3,151	千香港ドル 11,978	7,224	千香港ドル 24,556
	シンガポール	7,810 (△20,309)	千シンガポールドル 2,394 (－)	8,132 (－)	千シンガポールドル 2,557 (17)
	イスラエル	－	千イスラエルシェケル －	1,920	千イスラエルシェケル 2,654

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜新株予約権証券＞

		当期			
		買付		売付	
		証券数	金額	証券数	金額
外国	カナダ	証券 － (1,490)	千カナダドル － (－)	証券 －	千カナダドル －

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は権利付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜投資信託受益証券、投資証券＞

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
PROLOGIS INC	2	263	4	588
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	266	1	240
CROWN CASTLE INC	2	244	3	376
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	－	－	3	239
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9	160	－	－
WELLTOWER INC	11	995	2	234
REALTY INCOME CORP	19	1,061	4	289
SIMON PROPERTY GROUP	2	270	2	242
PUBLIC STORAGE	0.856	242	1	299
SUN COMMUNITIES INC	2	330	1	238
EXTRA SPACE STORAGE INC	6	941	1	234
DIGITAL REALTY TRUST INC	3	551	4	528
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	－	－	50	409
AMERICAN TOWER CORPORATION	1	288	2	549
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	－	－	30	463
NET LEASE OFFICE PROPERTY	－ (1)	－ (－)	1	11
EQUINIX INC	0.382	274	0.448	349
VICI PROPERTIES INC	16	511	8	254
SBA COMMUNICATIONS CORP	1	281	1	242
小計	83 (1)	6,685 (－)	125	5,794
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	－ (－)	－ (△14)	－	－
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	－ (－)	－ (△26)	－	－
小計	－ (－)	－ (△40)	－	－
ユーロ計	－ (－)	－ (△40)	－	－
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	－	－	79	257

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
SEGRO PLC	－	－	25	180
小計	－	－	104	438
オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
GOODMAN GROUP	18	440	17	356
LENDLEASE GROUP	－	－	64	428
小計	18	440	82	784
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	38	1,749	42	1,813
小計	38	1,749	42	1,813
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	－ (－)	－ (△1)	－	－
CAPITALAND ASCENDAS REIT	－ (－)	－ (△3)	－	－
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	－ (－)	－ (△9)	－	－
KEPPEL REIT	－ (22)	－ (17)	22	17
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	－ (－)	－ (△2)	－	－
小計	－ (22)	－ (0.64863)	22	17

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種類別		当期 買建 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額
外国	株式先物取引	百万円 120,506	百万円 115,879	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	91,620,186千円
(b)当期中の平均組入株式時価総額	611,615,494千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.14

(注1)(b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2)(c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※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	当期 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	40,245	－	－	71,737	139	0.2
金銭信託	6	6	100.0	6	6	100.0
コール・ローン	197,704	22,429	11.3	197,491	22,380	11.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国株式＞

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
AMAZON.COM	7,270	7,175	130,700	20,572,194	一般消費財・サービス流通・小売り
ABBOTT LABORATORIES	1,372	1,332	13,589	2,139,023	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	543	543	1,148	180,843	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	716	710	12,059	1,898,208	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,277	1,247	21,401	3,368,620	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	366	348	16,693	2,627,613	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	332	309	8,138	1,280,988	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	174	174	4,625	728,048	素材
ALLSTATE CORP	207	207	3,412	537,094	保険
HONEYWELL INTL INC	526	510	10,163	1,599,744	資本財
AMGEN	424	409	12,295	1,935,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HESS CORP	215	216	3,284	516,993	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	503	450	10,677	1,680,665	金融サービス
AMERICAN ELECTRIC POWER	399	407	3,608	567,994	公益事業
AFLAC	468	431	3,769	593,285	保険
AMERICAN INT'L GROUP	595	545	4,218	664,031	保険
ANALOG DEVICES	400	377	8,822	1,388,608	半導体・半導体製造装置
VALERO ENERGY CORP	307	262	4,298	676,654	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	3,448	3,099	11,947	1,880,478	メディア・娯楽
ANSYS INC	67	67	2,228	350,840	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	12,628	11,339	215,434	33,909,346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS	680	648	14,344	2,257,845	半導体・半導体製造装置
ALBEMARLE CORP	94	84	1,073	168,979	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	438	406	2,473	389,286	食品・飲料・タバコ
AMEREN CORPORATION	208	208	1,488	234,300	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	43	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTODESK INC	174	170	3,583	564,115	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	328	319	7,765	1,222,351	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	14	13	3,830	602,904	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	66	66	1,492	234,980	素材
BALL CORP	256	258	1,746	274,969	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,033	1,012	40,913	6,439,841	金融サービス
BANK NEW YORK CO	612	563	3,280	516,366	金融サービス
BAXTER INTERNATIONAL	400	415	1,407	221,516	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	224	221	5,021	790,432	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	177	177	2,988	470,312	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	3,314	3,222	12,683	1,996,454	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	175	143	1,128	177,588	保険

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
BEST BUY COMPANY INC	152	152	1,108	174,545	一般消費財・サービス流通・小売り
BIO-RAD LABORATORIES-A	18	18	530	83,441	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	217	221	3,010	473,920	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	455	394	1,529	240,711	公益事業
BOEING CO	446	438	7,670	1,207,270	資本財
ROBERT HALF INC	71	71	470	74,097	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	197	197	710	111,900	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,150	1,121	8,428	1,326,588	ヘルスケア機器・サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	83	83	719	113,298	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	128	128	2,017	317,541	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	18	16	2,366	372,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,696	1,552	6,287	989,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	355	435	3,524	554,771	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	63	63	799	125,808	保険
UNITED RENTALS INC	53	53	3,565	561,244	資本財
SEMPRA	245	497	3,748	590,046	公益事業
FEDEX CORP	192	188	4,678	736,439	運輸
VERISIGN INC	77	67	1,149	181,005	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	472	458	6,144	967,116	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	240	240	1,077	169,581	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	114	115	3,236	509,389	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	604	604	166	26,268	メディア・娯楽
CSX CORP	1,692	1,525	5,107	803,905	運輸
COTERRA ENERGY INC	640	545	1,503	236,617	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	158	158	701	110,451	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	129	131	3,222	507,190	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	219	191	1,814	285,611	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	43	34	1,456	229,241	資本財
CATERPILLAR	413	395	13,686	2,154,326	資本財
CHECK POINT SOFTWARE TECH	81	70	1,056	166,317	ソフトウェア・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,328	2,225	44,392	6,987,354	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	193	193	2,015	317,173	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	246	229	7,651	1,204,346	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	112	111	1,285	202,396	保険
CINTAS CORP	74	70	4,721	743,106	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	3,261	3,123	14,456	2,275,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	430	430	728	114,653	素材
CLOROX COMPANY	95	95	1,233	194,119	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,269	3,168	19,589	3,083,371	食品・飲料・タバコ
COPART INC	351	691	3,643	573,509	商業・専門サービス
COGNEX CORP	143	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	622	619	5,694	896,326	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	213	195	4,569	719,235	消費者サービス

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

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)	
MOLINA HEALTHCARE INC	45	45	1,472	231,848	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	190	190	1,598	251,659	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	403	333	990	155,939	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	271	276	2,579	406,026	公益事業
CMS ENERGY CORP	236	236	1,451	228,419	公益事業
COOPER COS INC/THE	41	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	649	666	2,387	375,832	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	116	－	－	－	素材
HEICO CORP-CLASS A	63	57	972	153,112	資本財
MANHATTAN ASSOCIATES INC	－	46	1,059	166,821	ソフトウェア・サービス
CUMMINS INC	113	114	3,186	501,576	資本財
DARLING INGREDIENTS INC	132	132	553	87,144	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	254	229	3,281	516,538	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	548	547	14,173	2,230,978	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	130	125	5,103	803,329	金融サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	399	370	2,474	389,442	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	362	352	5,187	816,486	生活必需品流通・小売り
DEERE&CO	226	205	7,582	1,193,499	資本財
MORGAN STANLEY	1,008	938	9,257	1,457,195	金融サービス
REPUBLIC SERVICES INC	183	164	3,019	475,294	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	321	330	2,749	432,822	不動産管理・開発
DECKERS OUTDOOR CORP	－	21	2,269	357,208	耐久消費財・アパレル
THE WALT DISNEY CO	1,448	1,426	14,609	2,299,532	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	179	163	1,844	290,286	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	106	106	1,955	307,771	資本財
OMNICOM GROUP	165	140	1,309	206,101	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	158	158	1,791	281,929	公益事業
DUKE ENERGY CORP	607	603	6,106	961,133	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	92	92	1,365	214,942	消費者サービス
EBAY	419	419	2,219	349,311	一般消費財・サービス流通・小売り
BANK OF AMERICA CORP	5,744	5,497	21,617	3,402,601	銀行
CITIGROUP	1,530	1,466	9,161	1,441,987	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	88	88	889	140,030	素材
EATON CORP	313	309	10,435	1,642,503	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	213	205	6,084	957,645	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	201	－	－	－	メディア・娯楽
ECOLAB INC	199	203	4,656	733,007	素材
REVVITY INC	105	85	953	150,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	215	197	2,605	410,143	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	793	746	20,146	3,170,987	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	818	128,833	保険
EMERSON ELECTRIC CO	463	440	4,931	776,189	資本財
ATMOS ENERGY CORP	113	113	1,266	199,311	公益事業

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

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

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)	
JUNIPER NETWORKS INC	253	253	871	137,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	188	188	1,384	217,947	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	808	770	25,331	3,987,244	一般消費財・サービス流通・小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	147	147	1,100	173,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	233	233	809	127,467	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	474	474	1,402	220,697	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	25	25	1,270	199,961	資本財
HUMANA INC	99	98	3,428	539,652	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	70	57	910	143,301	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,141	1,141	1,558	245,350	銀行
BIOGEN INC	110	107	2,349	369,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	59	59	1,249	196,702	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	243	228	5,415	852,446	資本財
INTUIT INC	212	214	12,881	2,027,505	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	67	66	3,357	528,529	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	3,252	3,282	10,196	1,604,895	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	193	193	1,836	289,092	素材
INT'L PAPER CO	251	251	1,137	179,022	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	285	285	889	139,969	メディア・娯楽
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	52	52	847	133,392	金融サービス
JABIL INC	－	93	1,109	174,605	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INCYTE CORP	152	152	870	137,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JOHNSON & JOHNSON	2,079	1,853	26,759	4,211,996	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	247	218	2,194	345,417	保険
KLA CORP	114	102	8,092	1,273,763	半導体・半導体製造装置
DEVON ENERGY CORPORATION	502	502	2,458	386,892	エネルギー
KELLANOVA	187	188	1,119	176,245	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	712	712	1,010	159,076	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	263	268	3,471	546,361	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	119	115	8,935	1,406,407	金融サービス
KROGER CO	517	506	2,650	417,146	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	107	102	9,942	1,564,994	半導体・半導体製造装置
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	38	33	1,311	206,388	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	62	1,125	177,154	素材
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	－	109	850	133,897	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	114	114	1,063	167,363	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	418	－	－	－	資本財
LENNAR CORP-CL A	208	188	2,922	460,076	耐久消費財・アパレル
ELI LILLY & CO	633	622	50,268	7,912,227	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BATH & BODY WORKS INC	198	193	938	147,730	一般消費財・サービス流通・小売り
UNITED PARCEL SERVICE B	583	555	7,644	1,203,308	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	237	217	3,229	508,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	189	175	8,047	1,266,707	資本財

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
LOEWS CORP	167	164	1,214	191,095	保険
CARNIVAL CORPORATION	843	718	1,123	176,890	消費者サービス
LOWES COMPANIES	478	443	9,546	1,502,685	一般消費財・サービス流通・小売り
DOMINION ENERGY INC	661	628	3,324	523,327	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	227	227	886	139,606	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	207	180	1,290	203,068	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	580	559	14,189	2,233,406	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	267	251	10,840	1,706,228	金融サービス
EVEREST GROUP LTD	32	32	1,277	201,040	保険
MARKEL GROUP INC	10	10	1,614	254,181	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	484	481	4,193	660,002	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	393	382	7,796	1,227,176	保険
MASCO CORP	194	189	1,277	201,104	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	48	50	2,861	450,367	素材
METLIFE INC	541	489	3,472	546,602	保険
MEDTRONIC PLC	1,052	1,026	8,415	1,324,650	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	614	－	－	－	メディア・娯楽
CVS HEALTH CORP	1,046	990	5,311	835,981	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	2,012	1,956	24,665	3,882,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ON SEMICONDUCTOR CORP	344	320	2,357	371,087	半導体・半導体製造装置
LABORATORY CRP OF AMER	65	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	5,621	5,450	234,549	36,918,069	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	866	853	11,317	1,781,298	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	442	407	4,023	633,338	半導体・半導体製造装置
3 M COMPANY	430	436	4,308	678,183	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	41	－	－	－	耐久消費財・アパレル
ENTEGRIS INC	124	123	1,628	256,253	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES	42	42	901	141,943	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	130	131	4,735	745,413	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	126	114	1,199	188,841	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	437	415	2,233	351,559	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	3,064	3,144	3,672	578,061	自動車・自動車部品
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	67	67	947	149,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	183	151	1,792	282,169	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	314	－	－	－	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	618	861	3,654	575,238	素材
NVR INC	2	2	1,816	285,990	耐久消費財・アパレル
NIKE B	993	944	8,688	1,367,639	耐久消費財・アパレル
NORDSON CORP	41	41	962	151,510	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	190	179	4,006	630,634	運輸
EVERSOURCE ENERGY	274	274	1,559	245,411	公益事業
NISOURCE INC	323	323	902	142,068	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	159	159	1,305	205,444	金融サービス

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
NORTHROP GRUMMAN CORP	115	113	5,148	810,376	資本財
WELLS FARGO & CO	3,049	2,811	16,722	2,632,131	銀行
NUCOR CORP	209	187	3,153	496,351	素材
CHENIERE ENERGY INC	182	180	2,826	444,922	エネルギー
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	295	300	4,111	647,205	金融サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	578	494	3,073	483,776	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	73	147	2,549	401,328	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	51	45	4,382	689,809	一般消費財・サービス流通・小売り
ORACLE CORP	1,284	1,265	15,755	2,479,986	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	421	403	4,359	686,109	資本財
EXELON CORP	813	739	2,718	427,860	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	103	98	5,202	818,911	資本財
PAYCHEX INC	264	241	2,900	456,565	商業・専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	59	52	1,333	209,822	ヘルスケア機器・サービス
PPL CORPORATION	584	584	1,670	262,885	公益事業
PEPSICO INC	1,086	1,055	18,295	2,879,669	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	145	143	1,135	178,733	資本財
PFIZER	4,455	4,327	12,246	1,927,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	203	203	745	117,290	公益事業
CONOCOPHILLIPS	984	927	11,034	1,736,810	エネルギー
PG&E CORP	1,181	1,487	2,710	426,566	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	174	－	－	－	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,421	1,390	6,325	995,704	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	320	315	4,803	756,108	銀行
BROWN & BROWN INC	198	201	1,765	277,838	保険
GARMIN LTD	128	111	1,814	285,524	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	193	174	2,267	356,881	素材
COSTCO WHOLESALE CORP	352	342	27,840	4,382,094	生活必需品流通・小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	179	182	2,125	334,621	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS	86	86	1,205	189,761	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	1,878	1,814	29,598	4,658,869	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	470	452	9,281	1,460,911	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	394	402	3,001	472,424	公益事業
PULTE GROUP INC	167	167	1,896	298,550	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	208	207	2,105	331,390	金融サービス
QUALCOMM	893	871	18,572	2,923,308	半導体・半導体製造装置
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	154	154	1,913	301,128	金融サービス
EXACT SCIENCES CORP	147	122	574	90,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RELIANCE INC	50	41	1,246	196,213	素材
REGENERON PHARMACEUTICALS	86	83	8,103	1,275,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REPLIGEN CORP	43	43	682	107,399	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RESMED INC	111	109	2,262	356,085	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,110	1,173	4,665	734,380	銀行

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
SEAGEN INC	109	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	297	297	3,040	478,591	保険
ROSS STORES INC	280	254	3,499	550,820	一般消費財・サービス流通・小売り
ROLLINS INC	174	254	1,175	185,025	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	81	84	4,507	709,435	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	91	84	2,189	344,597	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	171	184	2,766	435,485	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	104	104	1,149	180,919	素材
ACCENTURE PLC-CL A	498	483	14,396	2,265,952	ソフトウェア・サービス
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,083	1,054	7,123	1,121,313	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	84	77	1,939	305,218	保険
TRAVELERS COS INC/THE	185	171	3,607	567,775	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	469	454	3,416	537,703	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	30	26	10,210	1,607,145	消費者サービス
SCHLUMBERGER	1,117	1,102	5,131	807,722	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,163	1,170	8,289	1,304,713	金融サービス
POOL CORP	33	26	952	149,967	一般消費財・サービス流通・小売り
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	169	152	1,774	279,305	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	116	－	－	－	食品・飲料・タバコ
SEI INVESTMENTS COMPANY	95	95	639	100,592	金融サービス
ELEVANCE HEALTH INC	190	182	9,465	1,489,928	ヘルスケア機器・サービス
CENCORA INC	117	131	2,847	448,228	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	185	185	1,503	236,672	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	193	184	5,559	875,093	素材
CENTENE CORP	453	409	2,976	468,535	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP	90	90	744	117,134	資本財
SNAP-ON INC	40	40	1,077	169,626	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	291	290	3,420	538,446	保険
ADVANCE AUTO PARTS	46	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
EDISON INTL	303	309	2,290	360,591	公益事業
SOUTHERN CO	858	824	6,391	1,006,041	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	1,041	1,063	4,014	631,868	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	186	180	5,909	930,167	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	135	135	358	56,490	運輸
AT&T INC	5,695	5,480	9,464	1,489,638	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,461	1,380	21,951	3,455,140	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	125	125	1,069	168,390	資本財
STATE STREET CORP	290	223	1,650	259,832	金融サービス
STARBUCKS CORP	909	882	6,839	1,076,520	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	137	116	1,560	245,554	素材
STRYKER CORP	268	263	8,950	1,408,833	ヘルスケア機器・サービス
NETFLIX INC	350	336	21,810	3,433,042	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	435	435	1,080	170,086	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	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)	
SYNOPSYS INC	120	118	6,994	1,100,876	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	393	400	2,905	457,297	生活必需品流通・小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	282	270	10,829	1,704,612	ヘルスケア機器・サービス
TELEFLEX INC	39	39	805	126,715	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	921	921	1,544	243,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TERADYNE INC	123	123	1,788	281,579	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS	725	695	13,887	2,185,871	半導体・半導体製造装置
TEXTRON	169	138	1,213	191,041	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	311	300	17,210	2,708,992	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	81	69	580	91,304	保険
TORO CO	88	88	699	110,114	資本財
DAVITA INC	46	46	664	104,633	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	89	78	2,211	348,085	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE IMS HOLDINGS	177	177	989	155,671	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TYLER TECHNOLOGIES INC	33	33	1,599	251,810	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	233	233	1,346	211,958	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	180	－	－	－	公益事業
MARATHON OIL CORP	503	503	1,332	209,660	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	488	467	10,703	1,684,653	運輸
RTX CORP	1,174	1,121	11,838	1,863,446	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	741	714	35,963	5,660,616	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	46	46	818	128,822	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	257	－	－	－	耐久消費財・アパレル
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	485	325	390	61,452	メディア・娯楽
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	206	198	8,882	1,398,056	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VULCAN MATERIALS CO	101	101	2,578	405,880	素材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	597	515	793	124,834	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	1,179	3,477	22,619	3,560,244	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	325	306	6,330	996,352	商業・専門サービス
WATERS CORP	47	47	1,575	248,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WATSCO INC	－	26	1,281	201,748	資本財
WEBSTER FINANCIAL CORP	142	－	－	－	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	57	57	1,888	297,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	78	78	851	134,036	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	30	30	574	90,407	消費者サービス
WESTERN DIGITAL CORP	257	257	1,963	309,078	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WABTEC CORP	129	133	2,244	353,308	資本財
WEYERHAEUSER CO	597	526	1,565	246,460	エクイティ不動産投資信託(REIT)
WHIRLPOOL CORP	37	－	－	－	耐久消費財・アパレル
SKYWORKS SOLUTIONS INC	133	112	1,026	161,642	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	93	67	626	98,643	消費者サービス
NASDAQ INC	289	290	1,747	274,978	金融サービス
CME GROUP INC	282	279	5,837	918,802	金融サービス

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

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

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

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
IQVIA HOLDINGS INC	151	138	3,136	493,725	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIAMONDBACK ENERGY INC	132	132	2,623	412,967	エネルギー
SERVICENOW INC	162	159	11,651	1,833,954	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	240	245	7,556	1,189,330	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	154	164	3,540	557,213	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,403	1,362	21,171	3,332,458	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	497	401	6,721	1,057,992	電気通信サービス
PTC INC	82	97	1,749	275,307	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	368	359	6,165	970,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP-CLASS A	334	334	891	140,329	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	108	98	2,212	348,190	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOWMET AEROSPACE INC	315	282	2,405	378,584	資本財
KEURIG DR PEPPER INC	621	811	2,735	430,594	食品・飲料・タバコ
TWILIO INC - A	128	128	757	119,197	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	833	913	1,398	220,165	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	366	335	3,193	502,642	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	153	－	－	－	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	－	－	－	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	135	－	－	－	メディア・娯楽
HUBBELL INC	44	44	1,772	279,033	資本財
OKTA INC	115	115	1,106	174,116	ソフトウェア・サービス
BLACK KNIGHT INC	115	－	－	－	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	773	773	2,506	394,496	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	118	118	1,049	165,244	食品・飲料・タバコ
AXON ENTERPRISE INC	53	53	1,546	243,461	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	－	810	861	135,569	資本財
BROADCOM INC	331	343	48,541	7,640,458	半導体・半導体製造装置
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	136	136	648	102,152	運輸
ARES MANAGEMENT CORP - A	127	127	1,844	290,350	金融サービス
MONGODB INC	53	53	1,788	281,502	ソフトウェア・サービス
BURLINGTON STORES INC	51	51	1,016	160,036	一般消費財・サービス流通・小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	360	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	112	124	2,536	399,291	ヘルスケア機器・サービス
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	－	－	－	資本財
EVERGY INC	184	184	983	154,878	公益事業
ALLEGION PLC	76	77	929	146,344	資本財
DAYFORCE INC	106	106	577	90,975	商業・専門サービス
STERIS PLC	80	81	1,825	287,340	ヘルスケア機器・サービス
DOCUSIGN INC	149	149	863	135,971	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	50	50	826	130,162	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	230	230	526	82,893	ソフトウェア・サービス
KKR & CO INC	442	448	4,724	743,595	金融サービス
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	43	43	331	52,247	金融サービス

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	165	208	1,295	203,853	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	261	241	3,700	582,417	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	208	196	3,927	618,109	消費者サービス
ARAMARK	166	－	－	－	消費者サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	224	181	3,010	473,779	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOW INC	557	519	3,016	474,863	素材
OVINTIV INC	209	203	1,003	157,963	エネルギー
AMCOR PLC	1,102	1,102	1,084	170,648	素材
PINTEREST INC- CLASS A	457	457	1,899	298,954	メディア・娯楽
FOX CORP - CLASS A	215	215	721	113,599	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	103	103	321	50,623	メディア・娯楽
CLARIVATE PLC	273	－	－	－	商業・専門サービス
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	166	174	6,061	954,114	ソフトウェア・サービス
CHEWY INC - CLASS A	68	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
AVANTOR INC	496	496	1,177	185,280	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DYNATRACE INC	147	220	1,014	159,664	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	202	230	1,703	268,203	ソフトウェア・サービス
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	90	90	1,001	157,709	金融サービス
CARRIER GLOBAL CORP	681	620	4,013	631,742	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	338	307	2,925	460,520	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	1,195	1,443	9,167	1,442,908	運輸
CORTEVA INC	554	568	3,165	498,187	素材
FERGUSON PLC	160	162	3,339	525,659	資本財
BILL HOLDINGS,INC.	74	74	386	60,802	ソフトウェア・サービス
BLACKSTONE INC	569	553	6,707	1,055,687	金融サービス
PAYLOCITY HOLDING CORP	34	34	519	81,776	商業・専門サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	156	156	675	106,272	金融サービス
DATADOG INC - CLASS A	201	207	2,537	399,393	ソフトウェア・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	165	145	1,408	221,749	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VERTIV HOLDINGS CO-A	－	262	2,755	433,683	資本財
INGERSOLL-RAND INC	315	315	2,949	464,296	資本財
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	299	329	2,598	409,018	ヘルスケア機器・サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	42	42	706	111,180	商業・専門サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	269	513	534	84,196	自動車・自動車部品
DRAFTKINGS INC	－	326	1,195	188,165	消費者サービス
UNITY SOFTWARE INC	219	164	313	49,363	ソフトウェア・サービス
AON PLC	166	152	4,258	670,277	保険
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,774	1,774	1,396	219,768	メディア・娯楽
TEXAS PACIFIC LAND CORP	5	15	986	155,320	エネルギー
WOLFSPEED INC	102	－	－	－	半導体・半導体製造装置
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	139	148	780	122,920	ソフトウェア・サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	95	125	3,085	485,700	金融サービス
UIPATH INC - CLASS A	－	284	532	83,871	ソフトウェア・サービス

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

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)	
AIRBNB INC-CLASS A	299	328	4,823	759,295	消費者サービス
CONSTELLATION ENERGY	251	251	5,808	914,197	公益事業
MONDAY.COM LTD	－	16	392	61,751	ソフトウェア・サービス
SOLVENTUM CORP	－	109	653	102,840	ヘルスケア機器・サービス
COREBRIDGE FINANCIAL INC	－	192	574	90,469	金融サービス
APPLOVIN CORP-CLASS A	－	122	1,020	160,610	ソフトウェア・サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	300	300	801	126,142	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROBLOX CORP -CLASS A	280	351	1,157	182,162	メディア・娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	219	－	－	－	メディア・娯楽
VIATRIS INC	897	897	932	146,726	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	175	175	584	91,928	消費者サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	84	84	767	120,810	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	134	134	750	118,157	エネルギー
SNOWFLAKE INC-CLASS A	176	217	3,271	514,911	ソフトウェア・サービス
DOORDASH INC - A	192	192	2,160	340,015	消費者サービス
ARISTA NETWORKS INC	186	207	6,365	1,001,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	318	295	3,412	537,074	金融サービス
GLOBAL-E ONLINE LTD	－	70	214	33,693	一般消費財・サービス流通・小売り
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,252	1,469	3,092	486,782	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	204	204	1,029	161,994	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	106	88	1,215	191,247	商業・専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	655	677	5,306	835,287	半導体・半導体製造装置
APA CORP	233	233	697	109,831	エネルギー
CONFLUENT INC-CLASS A	－	123	366	57,751	ソフトウェア・サービス
LINDE PLC	392	374	16,092	2,533,001	素材
ROBINHOOD MARKETS INC - A	－	319	653	102,822	金融サービス
LUCID GROUP INC	312	－	－	－	自動車・自動車部品
U-HAUL HOLDING CO	66	66	406	64,019	運輸
ASPEN TECHNOLOGY INC	23	23	522	82,168	ソフトウェア・サービス
TOAST INC-CLASS A	203	203	517	81,418	金融サービス
GE VERNOVA INC	－	208	3,716	584,958	資本財
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	1,130	1,130	412	64,925	運輸
CATALENT INC	137	137	741	116,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	361	291	1,261	198,615	金融サービス
VERALTO CORP	－	176	1,780	280,321	商業・専門サービス
SAMSARA INC-CL A	－	132	502	79,071	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	－	135	305	48,064	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	－	153	1,112	175,037	メディア・娯楽
ATLASSIAN CORP-CL A	118	114	1,884	296,680	ソフトウェア・サービス
BUNGE GLOBAL SA	－	116	1,234	194,372	食品・飲料・タバコ
KENVUE INC	－	1,334	2,569	404,380	家庭用品・パーソナル用品
COOPER COS INC/THE	－	168	1,544	243,123	ヘルスケア機器・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	179	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

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)	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	395	395	1,369	215,611	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	736	115,949	ソフトウェア・サービス
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	138	138	1,971	310,335	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	36	36	2,327	366,359	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	85	86	852	134,105	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-C	91	91	471	74,166	メディア・娯楽
LIBERTY GLOBAL LTD-C	－	188	314	49,509	電気通信サービス
LABCORP HOLDINGS INC	－	65	1,284	202,204	ヘルスケア機器・サービス
BIO-TECHNE CORP	129	129	1,030	162,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	41	－	－	－	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC - CLASS A	113	113	1,577	248,239	ソフトウェア・サービス
ETSY INC	102	102	628	98,950	一般消費財・サービス流通・小売り
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	537	502	3,653	575,034	資本財
TRANSUNION	157	157	1,180	185,872	商業・専門サービス
ALCOA CORP	155	－	－	－	素材
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	－	250	509	80,116	生活必需品流通・小売り
BLOCK INC	430	423	2,798	440,502	金融サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	383	341	2,800	440,850	素材
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	153	153	1,113	175,208	食品・飲料・タバコ
WESTROCK CO	213	213	1,138	179,231	素材
KRAFT HEINZ CO/THE	567	689	2,417	380,465	食品・飲料・タバコ
NOVOCURE LTD	79	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
FORTIVE CORP	254	258	1,930	303,885	資本財
MATCH GROUP INC	227	227	667	105,005	メディア・娯楽
WASTE CONNECTIONS INC	197	197	3,220	506,915	商業・専門サービス
ALPHABET INC-CL A	4,742	4,568	80,588	12,684,576	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	974	974	1,793	282,332	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PAYPAL HOLDINGS INC	867	792	4,929	775,857	金融サービス
SEA LTD-ADR	283	283	1,973	310,577	メディア・娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	279	279	1,131	178,030	金融サービス
ZILLOW GROUP INC-C	134	118	469	73,903	不動産管理・開発
ALPHABET INC-CL C	4,339	3,977	70,808	11,145,233	メディア・娯楽
ZSCALER INC	72	72	1,182	186,142	ソフトウェア・サービス
MONSTER BEVERAGE CORP	606	583	3,013	474,352	食品・飲料・タバコ
ROKU INC	91	91	514	81,051	メディア・娯楽
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	87	71	1,952	307,253	メディア・娯楽
VISTRA CORP	317	286	3,042	478,943	公益事業
小計 株数・金額	269,138	263,639	3,524,697	554,787,367	
小計 銘柄数<比率>	601	591	－	<72.0%>	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	363	361	3,395	391,414	素材
BARRICK GOLD CORP	1,337	1,337	3,182	366,838	素材
BANK MONTREAL	544	562	7,378	850,393	銀行

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

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

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

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	126	127	2,841	485,327	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	818	818	1,288	220,136	銀行
FRESENIUS SE&CO KGAA	336	336	984	168,181	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	－	－	－	電気通信サービス
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	44	44	993	169,673	保険
GEA GROUP AG	133	133	517	88,357	資本財
CONTINENTAL AG	81	81	506	86,434	自動車・自動車部品
DHL GROUP	812	748	2,932	500,850	運輸
MERCK KGAA	105	91	1,534	262,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE STAMM	503	449	1,573	268,800	公益事業
SAP SE	825	811	14,377	2,455,564	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	1,866	1,668	2,069	353,419	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	87	87	641	109,616	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	92	92	435	74,340	耐久消費財・アパレル
BAYER	766	784	2,181	372,534	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	144	150	1,238	211,606	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	738	704	3,394	579,768	素材
BEIERSDORF AG	74	74	1,069	182,604	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERG MATERIALS AG	100	107	1,061	181,281	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	169	169	667	114,062	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE-REG	318	301	8,007	1,367,659	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	453	453	293	50,166	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.	111	104	4,782	816,736	保険
RHEINMETALL AG	36	32	1,677	286,430	資本財
VOLKSWAGEN STAMM	24	24	355	60,715	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD	152	153	1,889	322,783	自動車・自動車部品
MERCEDES-BENZ GROUP AG	625	634	4,210	719,176	自動車・自動車部品
NEMETSCHEK SE	54	54	482	82,451	ソフトウェア・サービス
SIEMENS	607	584	10,367	1,770,588	資本財
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,571	1,407	2,204	376,563	金融サービス
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	267	246	2,309	394,366	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	446	76,290	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM	2,566	2,534	5,505	940,317	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	18	18	454	77,662	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INFINEON TECHNOLOGIES	1,053	1,047	4,009	684,738	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	4	4	385	65,910	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	306	52,371	ヘルスケア機器・サービス
BECHTLE AG	76	76	356	60,851	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE	156	141	2,516	429,830	金融サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	117	117	591	100,978	自動車・自動車部品
MTU AERO ENGINES AG	39	39	910	155,498	資本財
SYMRISE AG	100	100	1,073	183,330	素材

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
BRENNTAG SE		125	95	622	106,241	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		160	160	325	55,628	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		987	－	－	－	電気通信サービス
TALANX AG		－	50	367	62,740	保険
LEG IMMOBILIEN SE		52	52	433	73,983	不動産管理・開発
VONOVIA SE		525	525	1,500	256,203	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG		50	50	362	61,883	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG		215	215	1,160	198,242	ヘルスケア機器・サービス
DR ING HC F PORSCHE AG		94	102	773	132,081	自動車・自動車部品
SIEMENS ENERGY AG		368	368	988	168,816	資本財
DAIMLER TRUCK HOLDING AG		334	392	1,552	265,111	資本財
ZALANDO SE		176	176	424	72,494	一般消費財・サービス流通・小売り
SCOUT24 SE		74	75	527	90,159	メディア・娯楽
COVESTRO AG		144	144	715	122,195	素材
HELLOFRESH SE		138	－	－	－	生活必需品流通・小売り
DELIVERY HERO SE		134	134	396	67,652	消費者サービス
国小計	株数・金額	19,947	18,188	103,597	17,693,465	
	銘柄数<比率>	57	55	－	<2.3%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		826	841	1,979	338,159	保険
INTESA SANPAOLO		12,475	11,450	4,129	705,327	銀行
UNICREDIT SPA		1,498	1,162	4,240	724,192	銀行
MEDIOBANCA		539	338	492	84,141	銀行
LEONARDO SPA		－	313	737	125,945	資本財
ENEL		6,308	6,403	4,264	728,400	公益事業
ENI		1,982	1,746	2,543	434,334	エネルギー
SNAM SPA		1,475	1,475	641	109,500	公益事業
TELECOM ITALIA ORD		8,525	8,525	213	36,474	電気通信サービス
TERNA SPA		1,238	958	736	125,780	公益事業
RECORDATI SPA		101	60	293	50,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA		116	116	393	67,192	ヘルスケア機器・サービス
PRYSMIAN SPA		211	211	1,262	215,699	資本財
DIASORIN ITALIA SPA		20	20	204	34,865	ヘルスケア機器・サービス
MONCLER SPA		145	146	891	152,207	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA		484	484	295	50,467	金融サービス
FINECOBANK SPA		415	415	621	106,072	銀行
BANCO BPM SPA		－	777	507	86,651	銀行
POSTE ITALIANE SPA		460	460	579	98,986	保険
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		303	303	301	51,566	電気通信サービス
国小計	株数・金額	37,131	36,213	25,329	4,326,072	
	銘柄数<比率>	18	20	－	<0.6%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD		166	166	597	102,015	資本財

外国株式インデックス マザーファンド －第24期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
AIR LIQUIDE	412	405	7,365	1,257,912	素材
VEOLIA ENVIRONNEMENT	492	497	1,544	263,735	公益事業
LOREAL	191	185	8,265	1,411,583	家庭用品・パーソナル用品
LVMH	220	214	15,973	2,728,058	耐久消費財・アパレル
DASSAULT AVIATION SA	21	21	422	72,138	資本財
THALES SA	85	66	1,091	186,459	資本財
CAPGEMINI SA	134	122	2,570	439,028	ソフトウェア・サービス
PUBLICIS GROUPE	172	172	1,837	313,897	メディア・娯楽
BOLLORE SE	836	317	195	33,468	メディア・娯楽
MICHELIN	553	490	1,800	307,512	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD	166	153	2,136	364,930	食品・飲料・タバコ
RENAULT SA	173	115	599	102,399	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	25	10	89	15,369	食品・飲料・タバコ
SEB SA	22	22	259	44,274	耐久消費財・アパレル
VINCI S.A.	413	393	4,502	769,057	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	426	421	9,808	1,675,160	資本財
VIVENDI SE	612	612	618	105,642	メディア・娯楽
TOTALENERGIES SE	1,959	1,675	11,084	1,893,172	エネルギー
VALEO SA	165	－	－	－	自動車・自動車部品
ORANGE	1,490	1,532	1,627	277,888	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	25	24	5,275	901,019	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA	527	495	1,898	324,268	ソフトウェア・サービス
KERING	59	55	1,832	312,987	耐久消費財・アパレル
CARREFOUR	525	397	603	103,079	生活必需品流通・小売り
SANOFI	900	870	7,714	1,317,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ACCOR	144	144	586	100,198	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	633	530	1,444	246,751	銀行
TELEPERFORMANCE	47	47	493	84,328	商業・専門サービス
EURAZEO SA	33	33	264	45,236	金融サービス
SODEXO	61	61	528	90,194	消費者サービス
AXA SA	1,456	1,442	4,812	821,856	保険
ESSILORLUXOTTICA	226	229	4,731	808,066	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT AGRICOLE SA	994	871	1,387	236,991	銀行
BNP PARIBAS	899	777	5,267	899,680	銀行
SAINT-GOBAIN	400	361	2,954	504,550	資本財
WENDEL	20	－	－	－	金融サービス
DANONE (GROUPE)	515	518	3,045	520,122	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	264	266	5,717	976,536	資本財
ENGIE	1,456	1,463	2,265	386,913	公益事業
ALSTOM	243	243	457	78,181	資本財
IPSEN	35	35	421	72,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARKEMA	43	43	411	70,215	素材
LEGRAND SA	217	193	1,995	340,877	資本財

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
EIFFAGE	59	59	603	103,047	資本財
ADP	23	23	299	51,096	運輸
REXEL SA	－	174	493	84,272	資本財
BUREAU VERITAS SA	250	250	701	119,816	商業・専門サービス
GETLINK	352	211	342	58,547	運輸
EDENRED	201	201	909	155,405	金融サービス
BIOMERIEUX	30	30	286	48,947	ヘルスケア機器・サービス
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	81	81	270	46,140	消費者サービス
WORLDLINE SA	203	203	247	42,329	金融サービス
ALSTOM SA-RTS	－	243	29	5,081	資本財
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	25	25	481	82,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMUNDI SA	46	46	331	56,648	金融サービス
国小計 株数・金額	19,752	18,255	131,500	22,458,929	
国小計 銘柄数<比率>	54	54	－	<2.9%>	
(オランダ)					
AIRBUS SE	465	460	7,303	1,247,405	資本財
ASM INTERNATIONAL NV	39	38	2,568	438,736	半導体・半導体製造装置
RANDSTAD NV	105	106	530	90,672	商業・専門サービス
KONINKLIJKE AHOLD NV	861	709	2,044	349,102	生活必需品流通・小売り
AKZO NOBEL	153	123	792	135,364	素材
WOLTERS KLUWER	206	191	2,865	489,413	商業・専門サービス
QIAGEN N.V.	170	165	654	111,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AEGON	1,487	－	－	－	保険
ASML HOLDING NV	318	310	27,858	4,757,941	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)	2,829	2,908	993	169,706	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV	550	502	1,937	330,908	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS	718	560	1,413	241,435	ヘルスケア機器・サービス
ING GROEP NV-CVA	2,938	2,565	4,196	716,733	銀行
HEINEKEN NV	201	231	2,162	369,364	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	68	95	726	124,034	食品・飲料・タバコ
OCI NV	72	72	185	31,627	素材
FERRARI NV	101	100	3,799	648,977	自動車・自動車部品
ASR NEDERLAND NV	－	119	557	95,220	保険
CNH INDUSTRIAL NV	810	－	－	－	資本財
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	－	63	901	153,899	半導体・半導体製造装置
PROSUS	648	1,125	3,892	664,755	一般消費財・サービス流通・小売り
JDE PEET'S BV	70	70	150	25,727	食品・飲料・タバコ
EXOR NV	78	78	820	140,058	金融サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	512	338	319	54,561	食品・飲料・タバコ
EURONEXT NV	64	64	569	97,335	金融サービス
IMCD NV	46	46	649	110,969	資本財
NN GROUP NV	226	229	984	168,164	保険
ARGENX SE	41	49	1,666	284,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

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

銘柄		当期首(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)	
SYENSQO SA		－	53	497	84,934	素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		676	650	3,818	652,176	食品・飲料・タバコ
国小計	株数・金額	1,475	1,395	9,368	1,600,073	
	銘柄数<比率>	10	11	－	<0.2%>	
(オーストリア)						
OMV AG		125	125	583	99,703	エネルギー
VERBUND AG		64	64	481	82,198	公益事業
VOESTALPINE AG		71	71	192	32,931	素材
ERSTE GROUP BANK AG		253	253	1,142	195,071	銀行
国小計	株数・金額	515	515	2,400	409,905	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.1%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		102	102	574	98,060	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		406	406	640	109,340	エネルギー
ARCELORMITTAL		410	427	1,022	174,604	素材
AROUNDTOWN SA		640	－	－	－	不動産管理・開発
国小計	株数・金額	1,560	935	2,236	382,005	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.0%>	
(フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		200	200	340	58,223	生活必需品流通・小売り
WARTSILA OYJ		419	419	804	137,417	資本財
UPM KYMMENE OYJ		423	423	1,486	253,865	素材
STORA ENSO OYJ R		421	421	578	98,812	素材
SAMPO OYJ-A SHS		386	331	1,342	229,343	保険
FORTUM OYJ		325	325	458	78,384	公益事業
ELISA A		102	102	422	72,207	電気通信サービス
NOKIA OYJ		4,519	3,961	1,414	241,527	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		327	327	648	110,802	エネルギー
KONE OYJ-B		263	263	1,277	218,152	資本財
ORION OYJ-CLASS B		98	101	375	64,087	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METSO CORPORATION		519	519	595	101,629	資本財
NORDEA BANK ABP		－	2,366	2,694	460,125	銀行
国小計	株数・金額	8,008	9,764	12,439	2,124,580	
	銘柄数<比率>	12	13	－	<0.3%>	
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC		123	123	1,115	190,570	資本財
CRH PLC		604	－	－	－	素材
KERRY GROUP PLC-A		130	109	846	144,633	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		195	195	879	150,232	素材
BANK OF IRELAND GROUP PLC		883	883	917	156,752	銀行
AIB GROUP PLC		882	1,458	751	128,388	銀行
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC		125	－	－	－	消費者サービス
国小計	株数・金額	2,946	2,770	4,511	770,576	
	銘柄数<比率>	7	5	－	<0.1%>	

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
(ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		2,257	2,356	875	149,561	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		396	396	793	135,443	エネルギー
JERONIMO MARTINS		249	218	447	76,390	生活必需品流通・小売り
国小計	株数・金額	2,903	2,971	2,116	361,394	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.0%>	
(その他)						
DSM-FIRMENICH AG		137	137	1,460	249,435	素材
AEGON LTD		－	1,018	615	105,200	保険
国小計	株数・金額	137	1,155	2,076	354,636	
	銘柄数<比率>	1	2	－	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	146,311	138,625	406,971	69,506,645	
	銘柄数<比率>	222	218	－	<9.0%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC		298	298	689	138,532	素材
ASHTEAD GROUP PLC		333	333	1,922	385,977	資本財
SEVERN TRENT PLC		174	174	416	83,647	公益事業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		732	732	371	74,545	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC		291	293	875	175,766	資本財
CRH PLC		－	521	3,273	657,175	素材
AVIVA PLC		2,403	1,933	931	186,945	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC		109	109	500	100,432	素材
DIAGEO		1,794	1,746	4,592	922,060	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC		828	399	157	31,541	金融サービス
DCC PLC		66	66	375	75,452	資本財
BAE SYSTEMS PLC		2,401	2,400	3,292	661,016	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO		1,697	1,579	3,761	755,234	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC		310	310	701	140,854	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC		1,901	1,901	1,472	295,590	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		684	684	1,314	263,843	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC		168	－	－	－	素材
ANGLO AMERICAN PLC		1,013	933	2,387	479,323	素材
COMPASS GROUP PLC		1,424	1,297	2,826	567,441	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)		15,754	14,788	10,174	2,042,895	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP		4,907	4,982	1,259	252,872	保険
UNILEVER PLC		2,004	1,933	8,227	1,651,846	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC		505	505	496	99,706	公益事業
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		257	257	679	136,488	食品・飲料・タバコ
PEARSON		553	553	518	104,179	消費者サービス
PERSIMMON PLC		256	256	368	74,083	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL		2,122	2,122	1,623	325,972	保険
RIO TINTO PLC REG		886	880	4,920	988,027	素材
VODAFONE GROUP PLC		20,547	16,457	1,219	244,780	電気通信サービス

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

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
ENDEAVOUR MINING PLC	－	176	308	62,031	素材
WISE PLC - A	－	490	392	78,832	金融サービス
INFORMA PLC	1,105	1,105	922	185,285	メディア・娯楽
HALEON PLC	4,050	5,305	1,718	345,014	家庭用品・パーソナル用品
SHELL PLC-NEW	5,620	5,020	13,960	2,802,933	エネルギー
NATIONAL GRID PLC-RTS	－	832	157	31,617	公益事業
AUTO TRADER GROUP PLC	724	724	530	106,527	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55	55	499	100,303	資本財
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI	－	130	1,932	387,941	消費者サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	－	1,011	627	125,954	資本財
JD SPORTS FASHION PLC	2,068	2,068	264	53,174	一般消費財・サービス流通・小売り
小計 株数・金額	217,441	209,994	154,417	31,003,936	
小計 銘柄数<比率>	76	82	－	<4.0%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SIKA AG-BR	117	122	3,384	583,665	素材
SGS SA	126	129	1,103	190,380	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	2	449	77,604	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM	18	18	912	157,427	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	29	25	1,418	244,617	資本財
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.82	0.82	871	150,335	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.08	0.08	859	148,186	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	7	7	3,130	539,916	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	118	114	5,361	924,771	保険
NOVARTIS	1,717	1,582	14,416	2,486,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	1,221	1,248	6,194	1,068,364	資本財
ROCHE HOLDING AG-BR	22	22	558	96,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING GENUSS	558	540	12,372	2,133,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	156	148	522	90,189	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	448	388	3,095	533,929	素材
CLARIANT AG-REG	173	173	256	44,199	素材
NESTLE SA - REGISTERED	2,183	2,054	18,826	3,246,978	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	43	42	656	113,179	保険
TEMENOS AG - REG	51	51	302	52,182	ソフトウェア・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B	18	18	156	27,025	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONOVA HOLDING AG-REG	38	38	1,120	193,273	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	37	949	163,809	運輸
STRAUMANN HOLDING AG-REG	85	85	999	172,328	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,974	－	－	－	金融サービス
SWATCH GROUP AG(BEARER)	24	24	481	83,057	耐久消費財・アパレル
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	148	25,571	耐久消費財・アパレル
HELVETIA HOLDING AG-REG	－	29	358	61,871	保険
LONZA GROUP AG-REG	57	55	2,741	472,813	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	24	21	1,337	230,607	保険

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	428	73,852	素材
SWISS PRIME SITE-REG	56	56	477	82,274	不動産管理・開発
AVOLTA AG	－	78	277	47,933	一般消費財・サービス流通・小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	18	2,201	379,755	金融サービス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	30	30	735	126,919	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	20	20	476	82,123	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	146	120	1,043	179,983	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	409	409	5,892	1,016,228	耐久消費財・アパレル
JULIUS BAER GROUP LTD	187	152	826	142,497	金融サービス
SWISS RE LTD	244	243	2,720	469,134	保険
BKW AG	17	17	249	43,072	公益事業
SIG GROUP AG	262	262	499	86,181	素材
ALCON INC	383	383	3,104	535,509	ヘルスケア機器・サービス
SANDOZ GROUP AG	－	304	983	169,622	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	24	24	231	39,997	銀行
UBS GROUP AG	2,618	2,496	7,067	1,218,981	金融サービス
VAT GROUP AG	19	19	946	163,278	資本財
小計 株数・金額	14,754	11,671	111,150	19,170,183	
小計 銘柄数<比率>	43	45	－	<2.5%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A	2,070	2,070	41,750	620,416	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	4,065	60,418	金融サービス
SKF AB-B	360	210	4,919	73,102	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,312	1,142	17,001	252,640	銀行
SWEDBANK AB-A	725	714	15,512	230,517	銀行
SCA SV CELLULOSA B	538	559	8,956	133,088	素材
VOLVO AB-A SHS	135	135	3,951	58,719	資本財
VOLVO B	1,142	1,142	32,500	482,960	資本財
HOLMEN AB-B SHARES	53	53	2,408	35,788	素材
TELE2 AB-B SHS	467	467	4,755	70,669	電気通信サービス
ELECTROLUX AB-SER B	212	－	－	－	耐久消費財・アパレル
SAAB AB-B	－	255	6,324	93,976	資本財
SECURITAS B	283	283	3,189	47,393	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	1,404	1,285	36,485	542,174	金融サービス
HENNES & MAURITZ B	552	409	7,698	114,401	一般消費財・サービス流通・小売り
ASSA ABLOY AB-B	759	759	23,461	348,640	資本財
SVENSKA HANDELSBK A	1,207	1,207	11,948	177,547	銀行
ERICSSON (LM) B	2,146	2,146	13,624	202,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANDVIK AB	876	875	20,715	307,839	資本財
TELIA CO AB	2,306	1,237	3,298	49,011	電気通信サービス
SKANSKA B	255	255	4,834	71,845	資本財
BOLIDEN AB	222	222	8,242	122,478	素材
ALFA LAVAL AB	192	189	9,166	136,216	資本財

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
GETINGE AB-B SHS		177	177	3,407	50,628	ヘルスケア機器・サービス
KINNEVIK AB - B		187	－	－	－	金融サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS		567	567	4,037	59,990	不動産管理・開発
INDUTRADE AB		226	226	6,163	91,592	資本財
HUSQVARNA AB-B SHS		387	387	3,390	50,381	資本財
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB		143	143	3,953	58,750	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ATLAS COPCO B		1,276	1,146	19,864	295,184	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS		118	118	4,323	64,240	金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		111	111	4,087	60,740	金融サービス
HEXAGON AB-B SHS		1,470	1,720	20,385	302,922	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAGAX AB-B		174	174	4,910	72,975	不動産管理・開発
EPIROC AB-A		534	534	11,925	177,217	資本財
EPIROC AB-B		288	288	5,876	87,317	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		494	494	13,397	199,087	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB		314	314	10,608	157,647	金融サービス
EVOLUTION AB		150	131	15,084	224,159	消費者サービス
EMBRACER GROUP AB		531	－	－	－	メディア・娯楽
LIFCO AB-B SHS		179	179	5,035	74,822	資本財
INVESTOR AB-A SHS		389	－	－	－	金融サービス
VOLVO CAR AB-B		498	498	1,683	25,021	自動車・自動車部品
BEIJER REF AB		－	268	4,513	67,075	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		1,228	1,228	6,734	100,075	資本財
NORDEA BANK ABP		2,585	－	－	－	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS		140	140	4,227	62,816	資本財
小計	株数・金額	29,476	24,550	438,421	6,514,950	
	銘柄数<比率>	45	42	－	<0.8%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
NORSK HYDRO		1,005	1,005	7,128	106,716	素材
TELENOR ASA		511	511	6,322	94,645	電気通信サービス
KONGSBERG GRUPPEN ASA		86	86	7,707	115,374	資本財
ORKLA		698	391	3,225	48,284	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		734	664	20,040	300,005	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		124	124	4,178	62,545	素材
MOWI ASA		319	319	6,137	91,883	食品・飲料・タバコ
AKER BP ASA		277	293	7,804	116,840	エネルギー
SALMAR ASA		54	54	3,557	53,255	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		185	185	3,408	51,022	保険
ADEVINTA ASA		191	191	2,175	32,567	メディア・娯楽
DNB BANK ASA		717	717	14,840	222,155	銀行
小計	株数・金額	4,907	4,546	86,526	1,295,296	
	銘柄数<比率>	12	12	－	<0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B		68	68	6,508	148,990	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	4	3	3,792	86,818	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	2,610	59,753	運輸
DANSKE BANK A/S	561	486	9,859	225,684	銀行
GENMAB A/S	52	48	9,436	216,001	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVONESIS (NOVOZYMES) B	171	301	12,704	290,800	素材
ROCKWOOL A/S-B SHS	7	7	2,160	49,460	資本財
DSV A/S	142	142	14,856	340,061	運輸
DEMANT A/S	85	85	2,780	63,634	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSYEMS A/S	816	834	16,891	386,647	資本財
NOVO NORDISK A/S-B	1,314	2,530	231,698	5,303,582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B	92	97	8,202	187,754	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S	297	297	4,242	97,111	保険
PANDORA A/S	79	65	7,251	165,977	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S	84	－	－	－	素材
ORSTED A/S	154	129	5,324	121,868	公益事業
小計 株数・金額	3,934	5,097	338,320	7,744,147	
小計 銘柄数<比率>	16	15	－	<1.0%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	121	121	580	60,720	ヘルスケア機器・サービス
WESTPAC BANKING	2,722	2,761	7,355	768,897	銀行
FORTESCUE LTD	1,385	1,373	3,640	380,503	素材
BRAMBLES LTD	1,080	1,080	1,548	161,898	商業・専門サービス
ASX LTD	145	145	920	96,206	金融サービス
BHP GROUP LTD	3,999	3,883	17,505	1,829,836	素材
AMPOL LTD	206	206	731	76,442	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	1,191	124,593	商業・専門サービス
CSL LIMITED	379	376	10,612	1,109,374	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	35	35	661	69,192	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	2,496	2,249	2,825	295,366	運輸
COCHLEAR LIMITED	47	47	1,530	159,989	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,514	1,555	1,611	168,433	公益事業
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,344	1,305	15,702	1,641,332	銀行
RIO TINTO LTD	282	282	3,721	388,972	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	462	462	2,073	216,785	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,666	1,666	1,068	111,669	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	369	307	1,466	153,297	素材
IGO LTD	563	－	－	－	素材
ORICA LTD	382	382	709	74,201	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	347	347	737	77,124	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED	290	282	5,421	566,701	金融サービス
SUNCORP GROUP LIMITED	948	948	1,527	159,649	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,470	2,408	8,255	862,902	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	739	－	－	－	素材

銘柄		当期首(前期末)	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)	
QANTAS AIRWAYS LIMITED		850	850	515	53,932	運輸
QBE INSURANCE GROUP		1,264	1,040	1,845	192,898	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		1,016	736	1,064	111,293	素材
REECE LTD		168	168	425	44,501	資本財
SANTOS		2,654	2,246	1,731	181,038	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD		372	418	1,011	105,724	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		138	138	440	46,056	金融サービス
WESFARMERS LTD		929	907	5,838	610,287	一般消費財・サービス流通・小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		1,470	1,411	3,899	407,621	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,014	920	2,903	303,546	生活必需品流通・小売り
SEEK LTD		280	280	624	65,300	メディア・娯楽
MINERAL RESOURCES LTD		144	144	1,080	112,947	素材
PILBARA MINERALS LTD		2,094	2,094	814	85,181	素材
SEVEN GROUP HOLDINGS LTD		－	126	496	51,924	資本財
AURIZON HOLDINGS LTD		1,195	1,195	440	46,003	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		639	639	743	77,688	食品・飲料・タバコ
XERO LTD		113	113	1,514	158,294	ソフトウェア・サービス
IDP EDUCATION LTD		177	177	292	30,595	消費者サービス
TELSTRA GROUP LTD		3,084	3,084	1,082	113,176	電気通信サービス
LOTTERY CORP LTD/THE		1,820	1,820	904	94,558	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		1,099	1,099	548	57,324	生活必需品流通・小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		2,362	2,384	6,811	712,031	銀行
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,321	2,321	845	88,343	保険
CAR GROUP LTD		－	293	1,003	104,866	メディア・娯楽
SOUTH32 LTD		3,467	3,467	1,355	141,730	素材
COLES GROUP LTD		1,084	1,084	1,779	185,976	生活必需品流通・小売り
WISETECH GLOBAL LTD		138	138	1,356	141,809	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	54,351	51,977	132,772	13,878,745	
	銘柄数<比率>	50	50	－	<1.8%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		824	824	625	60,349	運輸
EBOS GROUP LTD		142	142	515	49,727	ヘルスケア機器・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		399	399	1,105	106,769	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,731	1,329	545	52,631	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		646	646	415	40,112	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		1,105	1,105	682	65,852	公益事業
小計	株数・金額	4,849	4,448	3,888	375,443	
	銘柄数<比率>	6	6	－	<0.0%>	
(香港)				千香港ドル		
HANG LUNG PROPERTIES LTD		1,730	1,730	1,271	25,621	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS		1,375	1,365	9,022	181,806	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		375	375	1,734	34,947	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		944	883	24,406	491,783	金融サービス

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
MTR CORP	1,250	1,250	3,325	66,998	運輸
HANG SENG BANK	594	594	6,700	135,011	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,252	1,252	3,162	63,714	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,120	1,120	5,101	102,797	公益事業
WHARF HOLDINGS	－	840	2,158	43,499	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	9,046	9,046	5,654	113,930	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,740	1,740	6,829	137,614	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,815	2,815	7,150	144,074	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,363	－	－	－	不動産管理・開発
SINO LAND CO	3,154	3,154	2,766	55,736	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,245	1,050	8,064	162,489	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC A	405	445	3,054	61,556	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,070	1,070	10,635	214,311	資本財
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	920	－	－	－	資本財
AIA GROUP LTD	9,312	8,642	53,277	1,073,550	保険
SANDS CHINA LTD	1,980	1,980	3,857	77,719	消費者サービス
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,200	1,200	2,490	50,173	運輸
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	1,387	27,952	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,230	1,230	3,136	63,200	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD	1,570	1,570	1,836	37,013	不動産管理・開発
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,459	－	－	－	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	6,583	6,583	3,732	75,211	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,139	2,289	9,159	184,570	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,644	1,219	3,940	79,400	不動産管理・開発
小計 株数・金額	58,480	54,406	183,855	3,704,685	
小計 銘柄数＜比率＞	27	25	－	＜0.5%＞	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,474	1,474	604	70,502	資本財
DBS GROUP	1,404	1,557	5,573	650,157	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	428	428	255	29,808	不動産管理・開発
SEATRIUM LTD	21,527	1,076	188	21,975	資本財
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	80	80	219	25,637	資本財
SINGAPORE EXCHANGE LTD	660	660	634	74,069	金融サービス
GENTING SINGAPORE LTD	3,150	2,928	266	31,083	消費者サービス
KEPPEL LTD	1,128	1,128	763	89,088	資本財
OCBC BANK	2,571	2,571	3,727	434,902	銀行
SINGAPORE AIRLINES	1,083	1,083	731	85,306	運輸
UNITED OVERSEAS BANK	939	940	2,870	334,902	銀行
UOL GROUP LIMITED	475	－	－	－	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	257	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	6,809	6,221	1,530	178,544	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	－	841	439	51,213	公益事業
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	559	65,215	食品・飲料・タバコ

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

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国新株予約権証券＞

銘柄		当期首(前期末)	当期末		
		証券数(証券)	証券数(証券)	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)
(カナダ)				千カナダドル	
CONSTELLATION SOFTWA WRT		－	1,490	－	－
合計	証券数・金額	－	1,490	－	－
	銘柄数<比率>	－	1	－	<－%>

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

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

銘柄		当期首(前期末)	当期末		
		口数(千口)	口数(千口)	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)
(カナダ)				千カナダドル	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		4	4	213	24,581
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		15	15	264	30,512
小計	口数・金額	20	20	477	55,093
	銘柄数<比率>	2	2	－	<0.0%>
(フランス)				千ユーロ	
KLEPIERRE		17	17	444	75,958
GECINA SA		3	3	310	52,967
COVIVIO(FP)		4	4	243	41,627
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		10	10	828	141,455
国小計	口数・金額	35	35	1,826	312,009
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.0%>
(ベルギー)				千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA		12	12	346	59,153
国小計	口数・金額	12	12	346	59,153
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>
ユーロ計	口数・金額	48	48	2,173	371,163
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.0%>
(イギリス)				千イギリスポンド	
BRITISH LAND CO PLC		79	－	－	－
SEGRO PLC		103	78	703	141,156
LAND SECURITIES GROUP PLC		56	56	363	73,009
小計	口数・金額	239	134	1,066	214,165
	銘柄数<比率>	3	2	－	<0.0%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP		266	266	529	55,334
APA GROUP		83	83	711	74,351
GPT GROUP		167	167	730	76,337
STOCKLAND		207	207	947	99,081
DEXUS		94	94	648	67,764
GOODMAN GROUP		133	135	4,635	484,546
VICINITY CENTERS		305	305	582	60,923
LENDLEASE GROUP		64	－	－	－
SCENTRE GROUP		381	381	1,208	126,341
小計	口数・金額	1,704	1,641	9,994	1,044,682
	銘柄数<比率>	9	8	－	<0.1%>
(香港)				千香港ドル	
LINK REIT		170	166	5,582	112,493

銘柄		当期首(前期末)	当期末		
		口数(千口)	口数(千口)	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)
HKT TRUST AND HKT LTD		315	315	2,920	58,839
小計	口数・金額	485	481	8,502	171,332
	銘柄数<比率>	2	2	－	<0.0%>
(シンガポール)				千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		338	338	666	77,800
CAPITALAND ASCENDAS REIT		284	284	747	87,178
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		283	283	385	44,930
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA		220	220	270	31,568
小計	口数・金額	1,125	1,125	2,069	241,477
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.0%>
合計	口数・金額	4,590	4,377	－	13,373,721
	銘柄数<比率>	60	56	－	<1.7%>

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
外国	S&P 500 EMIN	17,055	－
	S&P/TSE 60	705	－
	SWISS MKT IX	961	－
	DJ EURO STOX	1,927	－
	SPI 200 FUTU	733	－
	FTSE 100	1,262	－

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

投資信託財産の構成

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
株式	734,844,688	95.4
投資信託受益証券	133,190	0.0
投資証券	13,240,531	1.7
コール・ローン等、その他	22,349,399	2.9
投資信託財産総額	770,567,808	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(770,040,412千円)の投資信託財産総額(770,567,808千円)に対する比率は99.9%です。
(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル＝157.40円　1カナダドル＝115.26円　1ユーロ＝170.79円
1イギリスポンド＝200.78円　1スイスフラン＝172.47円　1スウェーデンクローナ＝14.86円
1ノルウェークローネ＝14.97円　1デンマーククローネ＝22.89円　1オーストラリアドル＝104.53円
1ニュージーランドドル＝96.55円　1香港ドル＝20.15円　1シンガポールドル＝116.66円
1イスラエルシェケル＝42.718円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年5月29日現在
(A)資産	771,480,966,257円
コール・ローン等	14,437,511,412
株式(評価額)	734,844,688,186
投資信託受益証券(評価額)	133,190,840
投資証券(評価額)	13,240,531,141
未収入金	1,496,594,709
未収配当金	1,025,901,054
未収利息	967
差入委託証拠金	6,302,547,948
(B)負債	1,165,633,354
未払金	920,358,200
未払解約金	245,275,154
(C)純資産総額(A-B)	770,315,332,903
元本	115,404,015,522
次期繰越損益金	654,911,317,381
(D)受益権総口数	115,404,015,522口
1万口当たり基準価額(C/D)	66,749円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年5月30日 至 2024年5月29日
(A)配当等収益	12,552,332,918円
受取配当金	11,983,530,144
受取利息	329,050,300
その他収益金	240,015,933
支払利息	△263,459
(B)有価証券売買損益	206,372,024,590
売買益	225,476,443,809
売買損	△19,104,419,219
(C)先物取引等取引損益	1,992,957,199
取引益	3,324,302,832
取引損	△1,331,345,633
(D)その他費用	△180,275,014
(E)当期損益金(A+B+C+D)	220,737,039,693
(F)前期繰越損益金	459,709,490,599
(G)追加信託差損益金	54,701,355,337
(H)解約差損益金	△80,236,568,248
(I)計 (E+F+G+H)	654,911,317,381
次期繰越損益金(I)	654,911,317,381

(注1)(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3)(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は121,644,600,809円、期中追加設定元本額は12,271,959,846円、期中一部解約元本額は18,512,545,133円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

DCターゲット・イヤー ファンド2045	102,067,281円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	99,558,131円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	95,628,175円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	92,059,747円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	79,090,167円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	78,612,474円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	76,774,165円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	74,091,314円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	67,997,457円
10資産分散投資ファンド	61,825,769円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	60,868,495円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	56,273,050円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	47,164,856円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	31,423,278円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	29,143,797円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	27,737,963円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	22,197,325円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	19,960,481円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	17,961,616円
グローバル10資産バランスファンド	14,987,386円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,541,807円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	12,895,831円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	12,523,031円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	6,888,530円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	6,183,882円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,530,473円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,456,907円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	5,360,270円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,805,608円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,770,669円
DC世界経済インデックスファンド(株式特化型)	50,271円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2050	24,991円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2045	24,991円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2040	23,954円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2055	21,884円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2035	21,804円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2060	13,729円
DCターゲット・イヤーファンド(ライフステージ対応型)2065	12,139円
DCマイセレクションS50(2024-2026リスク抑制型)	1,502円

お知らせ

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

（変更日：2023年6月28日）

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

運 用 報 告 書

第3期（決算日　2024年6月25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2021年7月8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	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)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

【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。
・－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。

<580038>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
設定日(2021年7月 8日)	10,000	ー	10,000	ー	ー	ー	ー	1,499
第1期(2022年6月27日)	11,016	10.2	11,082	10.8	91.0	6.4	2.4	1,721
第2期(2023年6月26日)	13,134	19.2	13,261	19.7	95.2	2.6	2.0	11,945
第3期(2024年6月25日)	18,360	39.8	18,618	40.4	93.7	4.6	1.7	17,584

(注)株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
(当期首)	円	%		%	%	%	%
2023年 6月26日	13,134	ー	13,261	ー	95.2	2.6	2.0
6月末	13,398	2.0	13,539	2.1	95.1	2.6	2.1
7月末	13,608	3.6	13,756	3.7	94.8	3.0	2.0
8月末	13,950	6.2	14,108	6.4	94.5	3.2	2.1
9月末	13,549	3.2	13,702	3.3	95.8	1.9	2.0
10月末	13,097	△0.3	13,249	△0.1	92.8	5.1	2.0
11月末	14,220	8.3	14,385	8.5	91.4	6.4	2.0
12月末	14,409	9.7	14,596	10.1	94.0	3.7	2.1
2024年 1月末	15,427	17.5	15,614	17.7	95.2	2.7	2.0
2月末	16,158	23.0	16,357	23.3	94.4	3.6	2.0
3月末	16,875	28.5	17,097	28.9	95.0	3.0	2.0
4月末	17,053	29.8	17,279	30.3	94.8	3.4	1.9
5月末	17,460	32.9	17,705	33.5	94.4	3.7	1.9
(当期末)							
2024年 6月25日	18,360	39.8	18,618	40.4	93.7	4.6	1.7

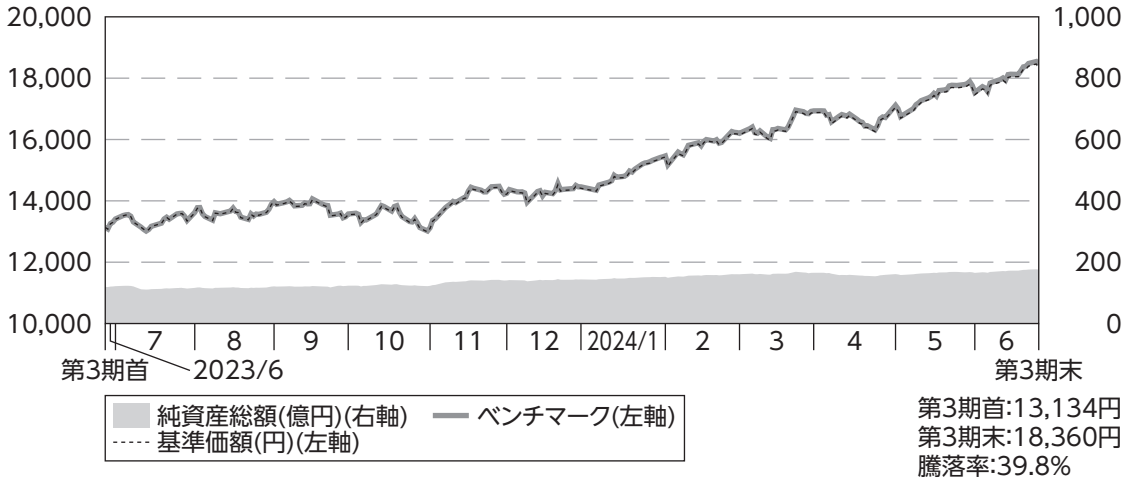
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）です。
MSCIコクサイESGリーダーズ指数は、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にＥＳＧ評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIコクサイESGリーダーズ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MSCIコクサイESGリーダーズ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、2023年6月26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ESGリーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境

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

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

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）組入比率

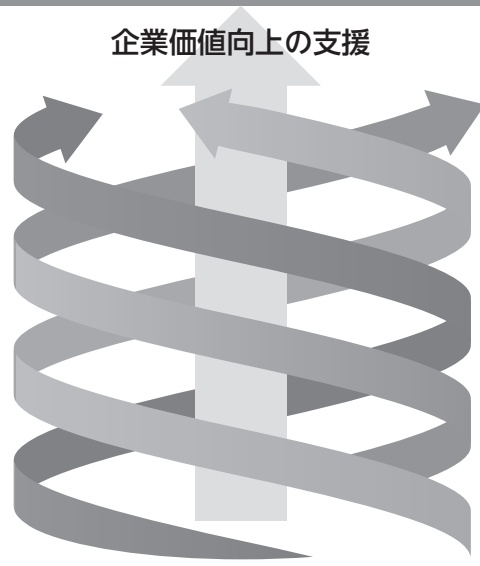
取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む外国株式を高位に組み入れ運用を行いました。なお、先物はヘッジ目的で利用しました。

（2）ポートフォリオ構成

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

<当社のスチュワードシップ活動>
当社は「責任ある機関投資家」として、エンゲージメント、議決権行使、投資の意思決定におけるESGの考慮を3つの柱としてスチュワードシップ活動を推進しています。投資先企業の企業価値向上に資するスチュワードシップ活動を行うことを通じ、お客さまからお預かりしている資産の中長期的な投資リターンの最大化を目指します。そして、その全ての基盤がフィデューシャリー・デューティーの実践です。当社は、スチュワードシップ活動に関する利益相反の適切な管理がフィデューシャリー・デューティーの向上につながると考え、利益相反管理を適切に行っております。

投資リターンの最大化
投資先の企業価値向上



3

投資意思決定におけるESGの考慮

投資の意思決定においてESGを考慮することにより、お客さまの資産の中長期的な投資リターンの最大化を目指します。

1

エンゲージメント

「企業にベストプラクティスを求める機会」と位置付けて、中長期的な企業価値向上に資する意見表明を行います。

2

議決権行使

「ガバナンスのミニマム・スタンダードを求める機会」と位置付けて、透明性の高い判断プロセスに則り、適切に行使をしています。

1 2 3 を支える基盤

[フィデューシャリー・デューティーの実践] [利益相反管理]

「三井住友トラスト・グループのフィデューシャリー・デューティーに関する取組方針」に基づき、お客さま本位の商品・サービスの提供に向けた取り組みを進めます。

当社の責任ある機関投資家としての取り組みは
スマートフォンで左記コードを読み取るかアドレスを入力することで
ご確認いただけます。
https://www.smtam.jp/institutional/stewardship_initiatives/

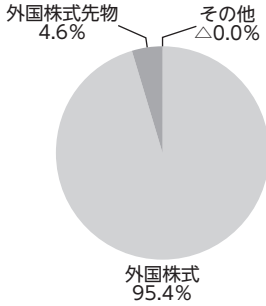
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

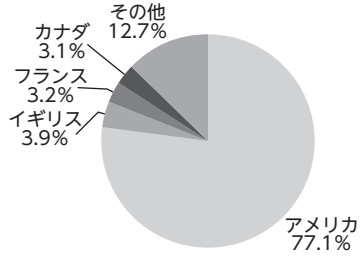
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	9.1%
2	NVIDIA CORP	アメリカ	8.5%
3	S&P 500 EMIN 2409	アメリカ	3.8%
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	3.0%
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	2.7%
6	ELI LILLY & CO	アメリカ	2.1%
7	TESLA INC	アメリカ	1.5%
8	NOVO NORDISK A/S-B	デンマーク	1.3%
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	1.3%
10	ASML HOLDING NV	オランダ	1.2%
組入銘柄数		606	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

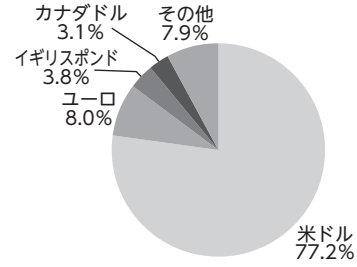
○資産別配分



○国別配分



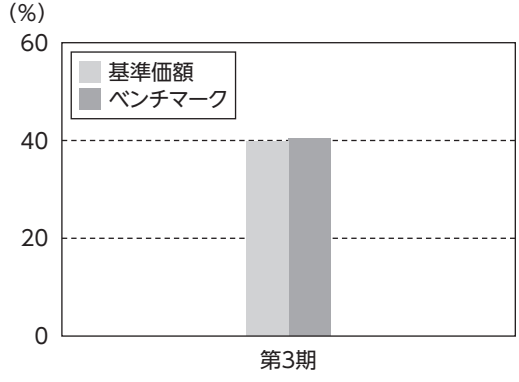
○通貨別配分



（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4.6%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。
差異の主な要因は、配当課税要因※および取引コスト要因（いずれもマイナス要因）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要因です。

今後の運用方針

主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式（預託証券（DR）を含みます。）に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年6月27日~2024年6月25日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.008%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(1)	(0.006)	
（新株予約権証券）	(−)	(−)	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
（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)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	1	0.008	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(1)	(0.008)	
（新株予約権証券）	(−)	(−)	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
（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	13	0.090	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(13)	(0.089)	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）	(−)	(−)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	15	0.106	

（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（14,933円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株　式＞

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 1,294 (765)	千米ドル 15,703 (96)	百株 1,083 (7)	千米ドル 13,377 (103)
	カナダ	137 (4)	千カナダドル 1,059 (84)	117 (4)	千カナダドル 781 (87)
	ドイツ	36 (ー)	千ユーロ 256 (△3)	134	千ユーロ 532
	イタリア	538	228	127	141
	フランス	90	628	175	702
	オランダ	134 (25)	338 (△0.35847)	145	379
	スペイン	232 (394)	152 (10)	53 (386)	88 (10)
	ベルギー	7	47	2	13
	オーストリア	4	13	ー	ー
	ルクセンブルク	4	23	ー	ー
	フィンランド	82	167	53	37
	アイルランド	3	28	3 (22)	22 (107)
	その他	1 (ー)	11 (△1)	ー	ー
	イギリス	1,332 (57)	千イギリスポンド 656 (93)	1,151	千イギリスポンド 493
	スイス	50 (12)	千スイスフラン 507 (△2)	40	千スイスフラン 408
	スウェーデン	146	千スウェーデンクローナ 3,738	191	千スウェーデンクローナ 2,925
	ノルウェー	30	千ノルウェークローネ 788	21	千ノルウェークローネ 551
	デンマーク	40 (51)	千デンマーククローネ 2,074 (ー)	22	千デンマーククローネ 1,894
	オーストラリア	160 (△15)	千オーストラリアドル 877 (ー)	287 (10)	千オーストラリアドル 466 (68)

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	ニュージーランド	ー	千ニュージーランドドル ー	5	千ニュージーランドドル 17
	香港	318	千香港ドル 1,693	637	千香港ドル 1,041
	シンガポール	6	千シンガポールドル 16	13 (ー)	千シンガポールドル 7 (0.70841)
	イスラエル	18	千イスラエルシェケル 53	63	千イスラエルシェケル 190

(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
PROLOGIS INC	0.616	72	0.507	62
CROWN CASTLE INC	0.242	22	0.127	14
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.85	14	ー	ー
WELLTOWER INC	0.545	47	0.195	17
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.21	26	0.127	14
AMERICAN TOWER CORPORATION	0.261	46	0.177	34
EQUINIX INC	0.055	42	0.037	28
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.065	12	0.05	11
小計	2	285	1	184
カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	ー	ー	0.278	12
小計	ー	ー	0.278	12
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	ー (ー)	ー (△0.47933)	0.568	15
COVIVIO(FP)	0.08	3	ー	ー
小計	0.08 (ー)	3 (△0.47933)	0.568	15

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
ベルギー				
WAREHOUSES DE PAUW SCA	0.558	14	―	―
小計	0.558	14	―	―
ユーロ計	0.638 (―)	18 (△0.47933)	0.568	15
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	2	14	―	―
小計	2	14	―	―
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	9	20	19	38
APA GROUP	2	20	―	―
STOCKLAND	4	20	10	49
DEXUS	―	―	2	18
GOODMAN GROUP	1	25	1	43
VICINITY CENTERS	―	―	9	19
LENDLEASE GROUP	―	―	1	11
SCENTRE GROUP	―	―	15	48
小計	18	86	62	229
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
HKT TRUST AND HKT LTD	―	―	11	99
小計	―	―	11	99
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	10 (―)	17 (△0.08525)	11	23
CAPITALAND ASCENDAS REIT	11	31	―	―
KEPPEL REIT	― (0.86)	― (0.70841)	0.86	0.68332
小計	22 (0.86)	48 (0.62316)	12	23

(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 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	株式先物取引	5,776	5,399	－	－

(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	6,018,388千円
(b)当期中の平均組入株式時価総額	13,324,177千円
(c)売買高比率(a)／(b)	0.45

(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	当期 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	3,290	49	1.5	2,716	8	0.3
金銭信託	0.327216	0.327216	100.0	0.327216	0.327216	100.0
コール・ローン	6,702	718	10.7	6,700	718	10.7

(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		
INTL BUSINESS MACHINES CORP	28	29	509	81,344	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	ー	51	822	131,299	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	14	14	746	119,098	ソフトウェア・サービス
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	ー	7	191	30,516	素材
ALLSTATE CORP	7	8	131	20,964	保険
AMGEN	16	17	541	86,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN EXPRESS	19	18	423	67,624	金融サービス
AFLAC	17	17	161	25,842	保険
VALERO ENERGY CORP	11	10	157	25,180	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	130	125	484	77,325	メディア・娯楽
ANSYS INC	2	3	96	15,421	ソフトウェア・サービス
APPLIED MATERIALS	25	26	607	96,854	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	6	6	162	25,988	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	13	12	320	51,213	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	0.57	0.57	170	27,152	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	2	2	57	9,192	素材
BALL CORP	9	9	56	9,049	素材
BANK NEW YORK CO	25	22	136	21,818	金融サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	130	133	549	87,756	電気通信サービス
BEST BUY COMPANY INC	5	5	52	8,452	一般消費財・サービス流通・小売り
YUM BRANDS INC	8	9	120	19,241	消費者サービス
ROBERT HALF INC	3	ー	ー	ー	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	7	ー	ー	ー	自動車・自動車部品
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	3	3	33	5,280	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	4	5	90	14,398	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.65	0.68	98	15,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	64	64	271	43,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	12	18	147	23,542	エネルギー
UNITED RENTALS INC	2	2	139	22,242	資本財
SEMPRA	9	19	147	23,506	公益事業
QUANTA SERVICES INC	4	4	133	21,309	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	19	ー	ー	ー	メディア・娯楽
CSX CORP	62	64	212	33,950	運輸
CAMPBELL SOUP CO (US)	6	6	28	4,500	食品・飲料・タバコ
CATERPILLAR	16	15	523	83,563	資本財
CHURCH & DWIGHT CO INC	7	7	81	13,033	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	9	9	309	49,385	ヘルスケア機器・サービス
CINTAS CORP	2	2	206	33,013	商業・専門サービス
CLOROX COMPANY	3	4	61	9,817	家庭用品・パーソナル用品

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)	
COCA-COLA CO	127	130	832	132,834	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	24	24	245	39,250	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE INC	1	1	53	8,529	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	ー	6	50	8,107	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	14	13	40	6,488	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	10	10	94	15,072	公益事業
CMS ENERGY CORP	9	8	50	8,135	公益事業
COOPER COS INC/THE	1	ー	ー	ー	ヘルスケア機器・サービス
MANHATTAN ASSOCIATES INC	ー	1	47	7,551	ソフトウェア・サービス
CUMMINS INC	4	4	127	20,298	資本財
DARLING INGREDIENTS INC	5	ー	ー	ー	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	ー	9	136	21,812	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	21	22	574	91,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	5	5	220	35,247	金融サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	13	15	227	36,328	生活必需品流通・小売り
DEERE&CO	ー	8	317	50,686	資本財
MORGAN STANLEY	38	38	378	60,377	金融サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	0.81	0.81	79	12,641	耐久消費財・アパレル
THE WALT DISNEY CO	56	57	591	94,344	メディア・娯楽
DOVER CORP	4	4	76	12,239	資本財
OMNICOM GROUP	6	6	56	9,019	メディア・娯楽
DARDEN RESTAURANTS INC	ー	3	58	9,320	消費者サービス
EBAY	16	16	87	13,917	一般消費財・サービス流通・小売り
EATON CORP	12	12	409	65,318	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	8	8	268	42,765	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	8	8	200	31,930	素材
ELECTRONIC ARTS INC	8	7	107	17,171	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	30	30	739	118,032	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	17	ー	ー	ー	資本財
ATMOS ENERGY CORP	4	5	62	9,942	公益事業
EXPEDITORS INTL WASH INC	4	4	52	8,367	運輸
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1	1	46	7,389	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	0.78	0.77	110	17,710	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	1	1	21	3,429	保険
FASTENAL CO	16	ー	ー	ー	資本財
FISERV INC	19	18	279	44,549	金融サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	10	10	23	3,811	金融サービス
DENTSPLY SIRONA INC	8	ー	ー	ー	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL MILLS INC	18	17	121	19,441	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	4	4	70	11,310	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	38	40	285	45,515	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	2	2	109	17,418	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	76	794	9,382	1,497,096	半導体・半導体製造装置
GRACO INC	5	5	41	6,607	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)	
GENERAL ELECTRIC CO	ー	34	557	88,989	資本財
GRAINGER (WW) INC	1	1	126	20,158	資本財
HALLIBURTON CO	26	29	99	15,933	エネルギー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	5	ー	ー	ー	資本財
HASBRO INC	4	ー	ー	ー	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	ー	4	27	4,379	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	27	30	110	17,642	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUNIPER NETWORKS INC	ー	10	36	5,846	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	7	7	51	8,257	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	31	31	1,104	176,301	一般消費財・サービス流通・小売り
HORMEL FOODS CORP	8	8	27	4,337	食品・飲料・タバコ
LENNOX INTERNATIONAL INC	1	1	59	9,431	資本財
HUMANA INC	3	3	135	21,594	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	2	2	35	5,696	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	41	41	53	8,510	銀行
BIOGEN INC	4	4	103	16,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	2	2	44	7,048	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	9	9	230	36,772	資本財
INTUIT INC	8	8	555	88,596	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	2	2	130	20,781	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	129	134	409	65,410	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7	7	75	12,116	素材
INT'L PAPER CO	10	10	50	8,056	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	11	11	34	5,461	メディア・娯楽
EMCOR GROUP INC	ー	1	57	9,113	資本財
JOHNSON & JOHNSON	80	76	1,141	182,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	9	9	99	15,861	保険
KELLANOVA	9	9	54	8,775	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	ー	29	41	6,545	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	10	10	148	23,672	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	4	4	377	60,298	金融サービス
KROGER CO	19	22	114	18,221	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	4	4	422	67,344	半導体・半導体製造装置
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	ー	4	24	3,950	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES,INC	4	4	42	6,838	ソフトウェア・サービス
ELI LILLY & CO	24	25	2,285	364,722	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BATH & BODY WORKS INC	ー	7	29	4,714	一般消費財・サービス流通・小売り
UNITED PARCEL SERVICE B	22	23	327	52,279	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	9	9	123	19,764	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOWES COMPANIES	18	18	415	66,287	一般消費財・サービス流通・小売り
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	7	7	50	8,093	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	22	22	596	95,182	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	10	10	452	72,277	金融サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	19	19	175	27,998	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)	
MARSH & MCLENNAN COS	15	15	332	53,014	保険
MASCO CORP	6	—	—	—	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1	1	101	16,233	素材
MERCK & CO	78	80	1,070	170,739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	218	224	10,040	1,602,108	ソフトウェア・サービス
3 M COMPANY	16	17	178	28,511	資本財
ILLUMINA INC	4	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	—	3	42	6,737	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	6	6	83	13,329	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWMONT CORPORATION	25	36	153	24,483	素材
NVR INC	0.1	0.1	77	12,351	耐久消費財・アパレル
NIKE B	38	38	374	59,707	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	6	—	—	—	運輸
EVERSOURCE ENERGY	11	11	69	11,049	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	5	5	48	7,781	金融サービス
NUCOR CORP	7	7	119	19,087	素材
CHENIERE ENERGY INC	7	7	117	18,827	エネルギー
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	—	12	167	26,669	金融サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	3	6	109	17,446	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	—	1	203	32,502	一般消費財・サービス流通・小売り
EXELON CORP	31	30	108	17,233	公益事業
PAYCHEX INC	10	10	127	20,358	商業・専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	2	2	51	8,170	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	42	43	734	117,144	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	5	4	38	6,114	資本財
ESSENTIAL UTILITIES INC	7	7	29	4,643	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	11	13	201	32,229	銀行
PPG INDUSTRIES INC	7	7	99	15,928	素材
PRICE T ROWE GROUP INC	6	6	78	12,538	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS	3	3	48	7,674	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	72	74	1,262	201,369	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	18	18	391	62,458	保険
PULTE GROUP INC	6	6	78	12,459	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6	6	84	13,473	金融サービス
REPLIGEN CORP	1	1	20	3,215	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
US BANCORP	47	48	198	31,677	銀行
ARCH CAPITAL GROUP LTD	10	12	128	20,462	保険
ROCKWELL AUTOMATION INC	3	3	101	16,205	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	—	7	119	19,107	消費者サービス
ACCENTURE PLC-CL A	19	19	613	97,938	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3	3	83	13,264	保険
TRAVELERS COS INC/THE	6	7	148	23,711	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	18	18	142	22,699	金融サービス

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
BOOKING HOLDINGS INC	1	1	433	69,241	消費者サービス
SCHLUMBERGER	45	43	208	33,296	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	46	47	354	56,629	金融サービス
POOL CORP	1	1	37	5,984	一般消費財・サービス流通・小売り
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	6	7	77	12,287	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	4	—	—	—	食品・飲料・タバコ
ELEVANCE HEALTH INC	7	7	400	63,962	ヘルスケア機器・サービス
CENCORA INC	5	5	129	20,738	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	7	7	59	9,466	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	7	—	—	—	素材
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10	11	131	20,990	保険
ADVANCE AUTO PARTS	1	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
EDISON INTL	11	12	94	15,057	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	40	42	157	25,151	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	6	7	249	39,871	資本財
STATE STREET CORP	10	10	77	12,324	金融サービス
STEEL DYNAMICS INC	5	4	55	8,890	素材
GEN DIGITAL INC	17	17	42	6,754	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	4	5	297	47,516	ソフトウェア・サービス
TELEFLEX INC	1	1	26	4,163	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	28	28	560	89,479	半導体・半導体製造装置
TORO CO	3	3	30	4,879	資本財
DAVITA INC	1	1	19	3,168	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	3	3	93	14,914	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE IMS HOLDINGS	7	7	41	6,564	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UGI CORP	7	—	—	—	公益事業
UNION PACIFIC CORP	19	19	438	69,996	運輸
VF CORP	11	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	—	23	37	5,914	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	12	—	—	—	商業・専門サービス
WATERS CORP	1	1	52	8,308	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	4	—	—	—	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	2	2	82	13,203	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	3	3	36	5,889	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	1	—	—	—	消費者サービス
WESTERN DIGITAL CORP	9	9	74	11,874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEYERHAEUSER CO	21	21	61	9,878	エクイティ不動産投資信託(REIT)
WHIRLPOOL CORP	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	10	12	74	11,910	金融サービス
WILLIAMS COS	38	38	165	26,468	エネルギー
WILLIAMS-SONOMA INC	—	1	59	9,520	一般消費財・サービス流通・小売り
DICK'S SPORTING GOODS INC	—	1	42	6,856	一般消費財・サービス流通・小売り
LKQ CORP	7	7	33	5,270	一般消費財・サービス流通・小売り
CARMAX INC	5	5	39	6,352	一般消費財・サービス流通・小売り

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド　ー第3期ー

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)	
TJX COMPANIES INC	35	36	399	63,788	一般消費財・サービス流通・小売り
CBRE GROUP INC-A	9	9	84	13,530	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC-A	5	ー	ー	ー	電気通信サービス
REGIONS FINL CORP	27	26	51	8,272	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	ー	1	59	9,447	消費者サービス
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1	1	22	3,633	金融サービス
DEXCOM INC	12	12	138	22,070	ヘルスケア機器・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	4	ー	ー	ー	資本財
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3	3	140	22,413	金融サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	7	ー	ー	ー	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	17	18	251	40,195	金融サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	26	26	1,210	193,072	金融サービス
OWENS CORNING	3	2	43	6,967	資本財
AERCAP HOLDINGS NV	ー	6	60	9,692	資本財
FIRST SOLAR INC	ー	3	84	13,465	半導体・半導体製造装置
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	3	3	70	11,271	商業・専門サービス
AECOM	4	ー	ー	ー	資本財
DELTA AIR LINES INC	4	4	22	3,602	運輸
INSULET CORP	2	2	55	8,883	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	7	7	100	15,991	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	3	3	123	19,781	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	7	ー	ー	ー	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	1	1	235	37,631	一般消費財・サービス流通・小売り
ULTA BEAUTY INC	1	1	58	9,265	一般消費財・サービス流通・小売り
INVESCO LTD	8	ー	ー	ー	金融サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	50	50	1,388	221,578	金融サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	6	6	86	13,751	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	14	11	199	31,787	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	4	4	29	4,690	資本財
KINDER MORGAN INC	67	66	133	21,238	エネルギー
XYLEM INC	7	7	104	16,599	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	8	8	78	12,463	素材
SPLUNK INC	4	ー	ー	ー	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	6	6	223	35,622	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2	ー	ー	ー	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	8	8	218	34,798	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP	6	6	81	13,050	エネルギー
LEAR CORP	2	ー	ー	ー	自動車・自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	3	3	53	8,474	金融サービス
TESLA INC	88	91	1,662	265,338	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	2	ー	ー	ー	資本財
ENPHASE ENERGY INC	ー	4	46	7,428	半導体・半導体製造装置
ALLY FINANCIAL INC	10	10	41	6,542	金融サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	2	2	64	10,279	金融サービス

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
APTIV PLC	9	9	69	11,108	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	13	13	188	30,065	エネルギー
IQVIA HOLDINGS INC	ー	5	123	19,744	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SERVICENOW INC	6	6	482	76,941	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	ー	10	325	51,893	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	6	6	143	22,821	ソフトウェア・サービス
PTC INC	3	3	62	9,974	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	14	14	253	40,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KEURIG DR PEPPER INC	28	35	124	19,870	食品・飲料・タバコ
TWILIO INC - A	5	5	30	4,801	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	30	ー	ー	ー	メディア・娯楽
BLACK KNIGHT INC	4	ー	ー	ー	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	32	34	117	18,826	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	4	4	38	6,099	食品・飲料・タバコ
AXON ENTERPRISE INC	2	2	64	10,228	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	ー	27	28	4,508	資本財
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5	5	25	4,118	運輸
BURLINGTON STORES INC	2	2	51	8,165	一般消費財・サービス流通・小売り
ALLEGION PLC	2	2	33	5,345	資本財
DAYFORCE INC	4	4	22	3,629	商業・専門サービス
STERIS PLC	2	2	62	10,020	ヘルスケア機器・サービス
DOCUSIGN INC	6	6	32	5,146	ソフトウェア・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	8	7	173	27,670	消費者サービス
ARAMARK	7	ー	ー	ー	消費者サービス
AMCOR PLC	43	ー	ー	ー	素材
FOX CORP - CLASS A	9	9	31	5,047	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	4	4	15	2,517	メディア・娯楽
CLARIVATE PLC	12	ー	ー	ー	商業・専門サービス
AVANTOR INC	20	20	46	7,492	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CARRIER GLOBAL CORP	24	26	174	27,802	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	12	ー	ー	ー	資本財
FERGUSON PLC	6	6	125	20,044	資本財
PAYLOCITY HOLDING CORP	1	1	17	2,780	商業・専門サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	5	5	61	9,744	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND INC	11	12	115	18,488	資本財
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	ー	13	108	17,299	ヘルスケア機器・サービス
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	19	28	31	5,022	自動車・自動車部品
UIPATH INC - CLASS A	ー	13	16	2,670	ソフトウェア・サービス
SOLVENTUM CORP	ー	4	23	3,814	ヘルスケア機器・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	7	ー	ー	ー	メディア・娯楽
HF SINCLAIR CORP	5	5	27	4,335	エネルギー
DOORDASH INC - A	ー	8	99	15,861	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	26	28	189	30,288	半導体・半導体製造装置
CONFLUENT INC-CLASS A	ー	6	17	2,818	ソフトウェア・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)	
LINDE PLC	15	15	679	108,465	素材
ASPEN TECHNOLOGY INC	ー	0.91	18	2,904	ソフトウェア・サービス
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	ー	66	23	3,762	運輸
CATALENT INC	ー	5	32	5,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	14	14	66	10,553	金融サービス
VERALTO CORP	ー	7	78	12,462	商業・専門サービス
ATLASSIAN CORP-CL A	ー	5	82	13,143	ソフトウェア・サービス
BUNGE GLOBAL SA	ー	4	45	7,335	食品・飲料・タバコ
COOPER COS INC/THE	ー	6	53	8,598	ヘルスケア機器・サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	14	14	51	8,148	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	5	5	73	11,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	1	1	91	14,643	ソフトウェア・サービス
LABCORP HOLDINGS INC	ー	2	51	8,164	ヘルスケア機器・サービス
BIO-TECHNE CORP	4	4	34	5,467	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ETSY INC	ー	3	22	3,606	一般消費財・サービス流通・小売り
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	22	21	147	23,602	資本財
TRANSUNION	5	5	45	7,196	商業・専門サービス
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	ー	10	21	3,467	生活必需品流通・小売り
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	7	6	52	8,303	食品・飲料・タバコ
WESTROCK CO	9	9	49	7,891	素材
FORTIVE CORP	12	11	87	14,001	資本財
ALPHABET INC-CL A	184	187	3,355	535,466	メディア・娯楽
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	37	38	78	12,578	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PAYPAL HOLDINGS INC	ー	31	188	30,156	金融サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	11	11	46	7,450	金融サービス
ALPHABET INC-CL C	166	162	2,932	467,838	メディア・娯楽
ZSCALER INC	2	3	60	9,649	ソフトウェア・サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	ー	2	85	13,591	メディア・娯楽
小計 株数・金額	4,673	5,642	79,411	12,670,880	
小計 銘柄数<比率>	286	291	ー	<72.1%>	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	15	16	147	17,186	素材
BANK MONTREAL	22	22	262	30,668	銀行
BANK NOVA SCOTIA	35	39	248	29,089	銀行
NATIONAL BANK OF CANADA	9	11	124	14,551	銀行
BROOKFIELD CORP	43	41	237	27,750	金融サービス
CGI INC - CL A	ー	6	89	10,430	ソフトウェア・サービス
CAE INC	11	11	30	3,596	資本財
CAMECO CORP	12	12	85	9,956	エネルギー
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	10	13	69	8,142	電気通信サービス
CANADIAN TIRE CORP -CL A	1	1	19	2,310	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17	17	284	33,245	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5	5	28	3,330	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	6	10	42	4,917	ソフトウェア・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)	
RB GLOBAL INC	5	5	60	7,118	商業・専門サービス
FORTIS INC	13	17	91	10,713	公益事業
TELUS CORP	17	17	36	4,298	電気通信サービス
IMPERIAL OIL	ー	6	57	6,728	エネルギー
ENBRIDGE	62	67	323	37,854	エネルギー
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	23	24	188	22,017	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	8	ー	ー	ー	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	18	17	117	13,698	保険
METRO INC	7	7	53	6,221	生活必需品流通・小売り
STANTEC INC	ー	3	41	4,804	資本財
LUNDIN MINING CORP	17	17	26	3,103	素材
THOMSON REUTERS CORP	4	ー	ー	ー	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3	ー	ー	ー	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	57	56	423	49,508	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2	2	27	3,176	素材
KINROSS GOLD CORP	33	33	35	4,124	素材
INTACT FINANCIAL CORP	5	5	135	15,889	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	13	13	98	11,565	素材
KEYERA CORP	5	5	21	2,458	エネルギー
PARKLAND CORP	4	4	15	1,817	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	16	20	100	11,688	エネルギー
DOLLARAMA INC	10	8	105	12,342	一般消費財・サービス流通・小売り
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	21	ー	ー	ー	公益事業
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	ー	12	29	3,461	商業・専門サービス
IVANHOE MINES LTD-CL A	15	15	28	3,359	素材
NUTRIEN LTD	15	14	104	12,204	素材
WSP GLOBAL INC	ー	3	83	9,783	資本財
IA FINANCIAL CORP INC	ー	3	26	3,138	保険
FIRSTSERVICE CORP	1	0.81	16	1,971	不動産管理・開発
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	4	ー	ー	ー	公益事業
THOMSON REUTERS CORP	ー	4	110	12,871	商業・専門サービス
SHOPIFY INC - CLASS A	37	39	343	40,079	ソフトウェア・サービス
HYDRO ONE LTD	11	11	44	5,186	公益事業
小計 株数・金額	630	650	4,419	516,366	
小計 銘柄数<比率>	39	41	ー	<2.9%>	
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	5	5	112	19,227	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	27	39	56	9,740	銀行
GEA GROUP AG	3	3	15	2,720	資本財
DHL GROUP	31	ー	ー	ー	運輸
MERCK KGAA	3	4	76	13,162	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENKEL AG & CO KGAA	3	3	28	4,800	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	2	2	12	2,110	耐久消費財・アパレル
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	5	5	43	7,485	家庭用品・パーソナル用品

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)	
BEIERSDORF AG		3	3	48	8,279	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERG MATERIALS AG		3	3	35	6,032	素材
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		20	20	11	1,990	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.		4	4	200	34,324	保険
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG		10	—	—	—	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		1	—	—	—	自動車・自動車部品
SARTORIUS AG-VORZUG		—	0.83	18	3,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEUTSCHE BOERSE		5	6	118	20,270	金融サービス
MTU AERO ENGINES AG		—	1	39	6,701	資本財
SYMRISE AG		3	3	41	7,151	素材
BRENNTAG SE		5	—	—	—	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG		6	6	12	2,148	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		34	—	—	—	電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN SE		3	3	23	4,068	不動産管理・開発
VONOVIA SE		23	—	—	—	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG		2	2	16	2,745	資本財
ZALANDO SE		8	6	14	2,405	一般消費財・サービス流通・小売り
COVESTRO AG		6	6	32	5,535	素材
HELLOFRESH SE		5	—	—	—	生活必需品流通・小売り
国小計	株数・金額	231	133	957	164,095	
	銘柄数<比率>	25	20	—	<0.9%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		31	35	82	14,196	保険
INTESA SANPAOLO		—	464	164	28,115	銀行
MEDIOBANCA		18	18	25	4,365	銀行
ENEL		254	250	163	28,049	公益事業
TERNA SPA		46	—	—	—	公益事業
PRYSMIAN SPA		6	—	—	—	資本財
MONCLER SPA		6	6	37	6,356	耐久消費財・アパレル
NEXI SPA		14	14	8	1,444	金融サービス
FINECOBANK SPA		18	18	27	4,650	銀行
POSTE ITALIANE SPA		16	16	19	3,329	保険
国小計	株数・金額	413	824	528	90,508	
	銘柄数<比率>	9	8	—	<0.5%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD		5	5	18	3,193	資本財
LOREAL		7	7	336	57,704	家庭用品・パーソナル用品
LVMH		8	8	637	109,135	耐久消費財・アパレル
PUBLICIS GROUPE		—	7	75	12,925	メディア・娯楽
MICHELIN		19	20	76	13,164	自動車・自動車部品
SCHNEIDER ELECTRIC SE		16	17	392	67,311	資本財
TOTALENERGIES SE		73	68	426	73,088	エネルギー
VALEO SA		6	—	—	—	自動車・自動車部品
ORANGE		58	—	—	—	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)	
HERMES INTERNATIONAL		0.98	1	222	38,053	耐久消費財・アパレル
DASSAULT SYSTEMES SA		20	23	81	13,974	ソフトウェア・サービス
KERING		2	2	72	12,439	耐久消費財・アパレル
CARREFOUR		21	21	29	4,968	生活必需品流通・小売り
SOCIETE GENERALE		23	―	―	―	銀行
TELEPERFORMANCE		1	―	―	―	商業・専門サービス
EURAZEO SA		―	1	13	2,262	金融サービス
AXA SA		57	56	173	29,798	保険
CREDIT AGRICOLE SA		37	37	49	8,515	銀行
BNP PARIBAS		33	32	201	34,454	銀行
DANONE (GROUPE)		20	19	116	19,972	食品・飲料・タバコ
EIFFAGE		2	2	26	4,579	資本財
ADP		0.92	0.92	10	1,856	運輸
REXEL SA		―	7	17	3,045	資本財
GETLINK		13	13	21	3,722	運輸
WORLDLINE SA		8	―	―	―	金融サービス
国小計	株数・金額	441	356	3,001	514,167	
	銘柄数<比率>	22	20	―	<2.9%>	
(オランダ)						
KONINKLIJKE AHOLD NV		30	28	79	13,583	生活必需品流通・小売り
AKZO NOBEL		5	5	30	5,304	素材
WOLTERS KLUWER		7	7	116	20,015	商業・専門サービス
QIAGEN N.V.		―	7	27	4,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASML HOLDING NV		12	12	1,204	206,335	半導体・半導体製造装置
KPN (KON.)		98	127	46	7,899	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		21	20	77	13,201	半導体・半導体製造装置
ING GROEP NV-CVA		115	103	164	28,141	銀行
OCI NV		―	5	11	2,035	素材
ASR NEDERLAND NV		―	5	22	3,884	保険
CNH INDUSTRIAL NV		30	―	―	―	資本財
PROSUS		23	45	155	26,614	一般消費財・サービス流通・小売り
JDE PEET'S BV		3	3	6	1,095	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV		8	8	35	6,079	保険
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV		26	26	74	12,815	メディア・娯楽
JUST EAT TAKEAWAY		7	―	―	―	消費者サービス
国小計	株数・金額	390	406	2,053	351,726	
	銘柄数<比率>	13	14	―	<2.0%>	
(スペイン)						
IBERDROLA SA		179	183	226	38,763	公益事業
NATURGY ENERGY GROUP SA		4	―	―	―	公益事業
REPSOL SA		42	42	62	10,715	エネルギー
REDEIA CORP SA		10	10	18	3,109	公益事業
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS		7	7	31	5,366	資本財
BANCO DE SABADELL SA		―	172	31	5,359	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)	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		13	14	89	15,385	消費者サービス
CELLNEX TELECOM SA		－	14	45	7,794	電気通信サービス
国小計	株数・金額	257	445	504	86,494	
	銘柄数<比率>	6	7	－	<0.5%>	
(ベルギー)						
UMICORE		5	5	8	1,426	素材
LOTUS BAKERIES		－	0.01	10	1,716	食品・飲料・タバコ
KBC GROEP NV		8	8	58	10,025	銀行
AGEAS		－	5	22	3,811	保険
国小計	株数・金額	14	19	99	16,979	
	銘柄数<比率>	2	4	－	<0.1%>	
(オーストリア)						
OMV AG		4	4	17	3,043	エネルギー
VERBUND AG		1	1	14	2,540	公益事業
VOESTALPINE AG		－	4	12	2,199	素材
国小計	株数・金額	6	11	45	7,783	
	銘柄数<比率>	2	3	－	<0.0%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC		－	4	18	3,249	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TENARIS SA		17	17	25	4,348	エネルギー
国小計	株数・金額	17	21	44	7,598	
	銘柄数<比率>	1	2	－	<0.0%>	
(フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS		6	6	11	1,993	生活必需品流通・小売り
WARTSILA OYJ		13	13	24	4,228	資本財
UPM KYMMENE OYJ		15	18	59	10,212	素材
STORA ENSO OYJ R		20	20	26	4,469	素材
SAMPO OYJ-A SHS		－	14	57	9,920	保険
ELISA A		5	4	17	2,936	電気通信サービス
NOKIA OYJ		165	160	56	9,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ		12	15	26	4,531	エネルギー
KONE OYJ-B		－	10	50	8,707	資本財
ORION OYJ-CLASS B		－	3	14	2,426	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METSO CORPORATION		21	21	22	3,861	資本財
国小計	株数・金額	261	289	367	62,971	
	銘柄数<比率>	8	11	－	<0.4%>	
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC		5	5	47	8,118	資本財
CRH PLC		22	－	－	－	素材
KERRY GROUP PLC-A		4	4	34	5,945	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		8	8	34	5,990	素材
国小計	株数・金額	40	18	117	20,054	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.1%>	
(ポルトガル)						
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		14	14	27	4,694	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)	
JERONIMO MARTINS		8	8	16	2,873	生活必需品流通・小売り
国小計	株数・金額	22	22	44	7,568	
	銘柄数<比率>	2	2	－	<0.0%>	
(その他)						
DSM-FIRMENICH AG		5	6	68	11,795	素材
国小計	株数・金額	5	6	68	11,795	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	2,101	2,556	7,833	1,341,744	
	銘柄数<比率>	95	95	－	<7.6%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC		10	10	22	4,556	素材
ASHTEAD GROUP PLC		12	14	82	16,607	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		26	26	12	2,516	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC		－	10	32	6,641	資本財
CRH PLC		－	22	132	26,747	素材
AVIVA PLC		－	86	41	8,435	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC		4	4	16	3,418	素材
SCHRODERS PLC		23	23	8	1,788	金融サービス
DCC PLC		2	2	13	2,786	資本財
JOHNSON MATTHEY PLC		4	－	－	－	素材
ANGLO AMERICAN PLC		39	40	100	20,439	素材
HSBC HOLDINGS PLC (GB)		622	599	414	83,897	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP		174	173	39	8,091	保険
UNILEVER PLC		76	79	353	71,518	家庭用品・パーソナル用品
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		13	13	32	6,640	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL		86	84	64	12,994	保険
VODAFONE GROUP PLC		772	746	53	10,926	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		21	23	106	21,549	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		59	58	212	43,052	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC		－	80	36	7,434	商業・専門サービス
ST JAMES'S PLACE PLC		19	－	－	－	金融サービス
SAGE GROUP PLC		32	32	34	6,909	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC		－	11	19	3,852	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC		2,009	2,081	115	23,465	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		91	91	13	2,677	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC		220	215	66	13,469	生活必需品流通・小売り
3I GROUP PLC		30	30	93	18,999	金融サービス
WPP PLC		32	32	24	5,019	メディア・娯楽
ASTRAZENECA		48	49	614	124,451	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC		205	205	29	6,043	電気通信サービス
NATIONAL GRID PLC		113	151	134	27,317	公益事業
INTERTEK GROUP PLC		5	6	29	5,939	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		12	12	13	2,656	耐久消費財・アパレル
KINGFISHER PLC		51	51	12	2,558	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
SAINSBURY (J) PLC		45	45	11	2,383	生活必需品流通・小売り
ADMIRAL GROUP PLC		6	10	26	5,409	保険
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE		2	2	13	2,663	耐久消費財・アパレル
WHITBREAD PLC		ー	5	17	3,513	消費者サービス
ABRDN PLC		68	ー	ー	ー	金融サービス
MONDI PLC		16	14	22	4,464	素材
OCADO GROUP PLC		18	ー	ー	ー	生活必需品流通・小売り
COCA-COLA HBC AG-CDI		9	5	14	2,940	食品・飲料・タバコ
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC		23	23	12	2,468	保険
M&G PLC		ー	71	15	3,042	金融サービス
ENDEAVOUR MINING PLC		6	6	10	2,044	素材
INFORMA PLC		43	43	37	7,651	メディア・娯楽
AUTO TRADER GROUP PLC		28	28	22	4,626	メディア・娯楽
SPIRAX GROUP PLC		2	2	21	4,365	資本財
小計	株数・金額	5,093	5,332	3,205	648,980	
	銘柄数<比率>	41	44	ー	<3.7%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SIKA AG-BR		4	4	122	21,940	素材
SGS SA		4	4	38	6,821	商業・専門サービス
SWISSCOM		0.8	0.76	38	6,884	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG		1	1	54	9,789	資本財
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		0.06	0.06	65	11,739	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG		0.28	0.29	126	22,555	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG		4	4	227	40,602	保険
NOVARTIS		63	62	601	107,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD		47	52	264	47,237	資本財
CLARIANT AG-REG		5	5	8	1,474	素材
BALOISE HOLDING AG - REG		1	1	25	4,538	保険
TEMENOS AG - REG		2	2	12	2,208	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG		1	1	42	7,670	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		1	1	39	7,040	運輸
LONZA GROUP AG-REG		2	2	115	20,645	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		0.92	0.88	57	10,324	保険
SWISS PRIME SITE-REG		ー	2	20	3,728	不動産管理・開発
LOGITECH INTERNATIONAL-REG		5	5	44	7,938	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JULIUS BAER GROUP LTD		7	7	35	6,437	金融サービス
SWISS RE LTD		9	9	105	18,810	保険
SIG GROUP AG		10	10	16	2,975	素材
ALCON INC		ー	15	128	22,947	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG		1	1	13	2,491	銀行
VAT GROUP AG		0.83	0.83	41	7,442	資本財
小計	株数・金額	176	199	2,246	401,784	
	銘柄数<比率>	22	24	ー	<2.3%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A		86	84	1,700	25,882	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)	
SKF AB-B		10	10	217	3,313	資本財
SCA SV CELLULOSA B		15	25	399	6,072	素材
VOLVO AB-A SHS		―	6	175	2,677	資本財
VOLVO B		―	50	1,369	20,840	資本財
HOLMEN AB-B SHARES		2	2	124	1,895	素材
TELE2 AB-B SHS		15	15	162	2,466	電気通信サービス
HENNES & MAURITZ B		18	18	366	5,578	一般消費財・サービス流通・小売り
ASSA ABLOY AB-B		29	30	899	13,687	資本財
SVENSKA HANDELSBK A		46	46	462	7,046	銀行
SANDVIK AB		31	31	688	10,474	資本財
TELIA CO AB		79	79	222	3,393	電気通信サービス
BOLIDEN AB		9	9	335	5,099	素材
ALFA LAVAL AB		10	10	495	7,535	資本財
KINNEVIK AB - B		9	―	―	―	金融サービス
HUSQVARNA AB-B SHS		13	13	123	1,881	資本財
ATLAS COPCO B		45	47	825	12,569	資本財
EPIROC AB-A		19	18	397	6,045	資本財
EPIROC AB-B		10	10	206	3,138	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B		17	17	494	7,523	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB		12	12	394	6,005	金融サービス
EVOLUTION AB		―	5	652	9,927	消費者サービス
BEIJER REF AB		10	―	―	―	資本財
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS		44	44	214	3,259	資本財
NORDEA BANK ABP		98	―	―	―	銀行
小計	株数・金額	637	592	10,927	166,313	
	銘柄数<比率>	22	22	―	<0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
NORSK HYDRO		40	40	266	4,038	素材
TELENOR ASA		21	21	259	3,921	電気通信サービス
ORKLA		21	21	185	2,814	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		28	27	807	12,212	エネルギー
YARA INTERNATIONAL ASA		―	5	169	2,569	素材
MOWI ASA		11	19	365	5,536	食品・飲料・タバコ
AKER BP ASA		10	7	205	3,105	エネルギー
SALMAR ASA		2	2	121	1,836	食品・飲料・タバコ
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		6	6	117	1,772	保険
DNB BANK ASA		27	26	549	8,306	銀行
小計	株数・金額	168	177	3,047	46,115	
	銘柄数<比率>	9	10	―	<0.3%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
A P MOLLER-MAERSK A/S-B		0.18	0.18	210	4,831	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A		0.08	0.08	91	2,104	運輸
GENMAB A/S		2	1	333	7,666	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVONESIS (NOVOZYMES) B		6	12	552	12,690	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)	
ROCKWOOL A/S-B SHS		0.5	0.5	138	3,175	資本財
DSV A/S		5	5	607	13,957	運輸
VESTAS WIND SYSYEMS A/S		29	29	532	12,221	資本財
NOVO NORDISK A/S-B		51	103	10,235	235,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B		3	4	397	9,118	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S		―	11	170	3,903	保険
PANDORA A/S		2	2	246	5,659	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S		2	―	―	―	素材
ORSTED A/S		5	5	218	5,015	公益事業
小計	株数・金額	109	178	13,735	315,359	
	銘柄数<比率>	12	12	―	<1.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		7	7	33	3,580	ヘルスケア機器・サービス
FORTESCUE LTD		49	60	128	13,649	素材
BRAMBLES LTD		42	39	56	6,020	商業・専門サービス
ASX LTD		6	6	39	4,191	金融サービス
COMPUTERSHARE LIMITED		16	16	42	4,560	商業・専門サービス
CSL LIMITED		―	15	448	47,589	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD		2	2	43	4,566	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP		103	105	133	14,189	運輸
COCHLEAR LIMITED		2	2	68	7,321	ヘルスケア機器・サービス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		17	17	86	9,225	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		13	12	61	6,522	素材
IGO LTD		25	―	―	―	素材
ORICA LTD		11	11	20	2,177	素材
BLUESCOPE STEEL LTD		12	12	23	2,533	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED		11	11	230	24,499	金融サービス
SUNCORP GROUP LIMITED		44	44	74	7,879	保険
NEWCREST MINING LIMITED		26	―	―	―	素材
QBE INSURANCE GROUP		43	43	76	8,095	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD		40	40	54	5,767	素材
SONIC HEALTHCARE LTD		14	―	―	―	ヘルスケア機器・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD		59	58	158	16,793	エネルギー
SEEK LTD		8	7	15	1,691	メディア・娯楽
MINERAL RESOURCES LTD		5	5	30	3,284	素材
PILBARA MINERALS LTD		90	90	27	2,971	素材
AURIZON HOLDINGS LTD		46	46	17	1,825	運輸
XERO LTD		5	4	65	6,943	ソフトウェア・サービス
IDP EDUCATION LTD		6	―	―	―	消費者サービス
TELSTRA GROUP LTD		120	―	―	―	電気通信サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI		33	33	17	1,815	生活必需品流通・小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD		92	94	269	28,650	銀行
CAR GROUP LTD		―	11	38	4,112	メディア・娯楽
COLES GROUP LTD		39	38	66	7,018	生活必需品流通・小売り

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
WISETECH GLOBAL LTD		－	5	49	5,297	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	999	846	2,380	252,775	
	銘柄数<比率>	30	28	－	<1.4%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
EBOS GROUP LTD		5	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		57	57	22	2,216	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		23	23	15	1,512	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD		40	40	24	2,404	公益事業
小計	株数・金額	125	120	62	6,133	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.0%>	
(香港)				千香港ドル		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		－	30	128	2,630	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		－	38	979	20,023	金融サービス
MTR CORP		40	40	98	2,003	運輸
HANG SENG BANK		24	24	247	5,067	銀行
HONG KONG & CHINA GAS		300	310	181	3,700	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS -R		115	－	－	－	銀行
SINO LAND CO		100	100	80	1,645	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC A		15	15	104	2,130	不動産管理・開発
AIA GROUP LTD		362	358	1,985	40,575	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		38	－	－	－	不動産管理・開発
WH GROUP LTD		240	－	－	－	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	1,234	915	3,805	77,777	
	銘柄数<比率>	9	8	－	<0.4%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CITY DEVELOPMENTS LTD		13	－	－	－	不動産管理・開発
SINGAPORE EXCHANGE LTD		24	24	22	2,689	金融サービス
KEPPEL LTD		43	43	28	3,317	資本財
UNITED OVERSEAS BANK		38	44	134	15,874	銀行
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		78	78	20	2,447	不動産管理・開発
小計	株数・金額	196	189	206	24,330	
	銘柄数<比率>	5	4	－	<0.1%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK LEUMI LE-ISRAEL		45	－	－	－	銀行
小計	株数・金額	45	－	－	－	
	銘柄数<比率>	1	－	－	<－%>	
合計	株数・金額	16,191	17,398	－	16,468,560	
	銘柄数<比率>	575	582	－	<93.7%>	

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜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	
BOSTON PROPERTIES		0.522	0.522	32	5,179
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		1	1	29	4,698
PROLOGIS INC		2	3	335	53,488
CROWN CASTLE INC		1	1	141	22,526
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		1	2	47	7,637
WELLTOWER INC		1	1	187	29,951
IRON MOUNTAIN INC		0.95	0.95	84	13,504
DIGITAL REALTY TRUST INC		0.95	1	151	24,230
AMERICAN TOWER CORPORATION		1	1	297	47,505
EQUINIX INC		0.284	0.302	227	36,246
SBA COMMUNICATIONS CORP		0.341	0.356	70	11,199
小計	口数・金額	13	14	1,605	256,169
	銘柄数<比率>	11	11	―	<1.5%>
(カナダ)				千カナダドル	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		0.278	―	―	―
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		0.55	0.55	9	1,079
小計	口数・金額	0.828	0.55	9	1,079
	銘柄数<比率>	2	1	―	<0.0%>
(フランス)				千ユーロ	
KLEPIERRE		0.568	―	―	―
GECINA SA		0.121	0.121	11	1,915
COVIVIO(FP)		―	0.08	3	633
小計	口数・金額	0.689	0.201	14	2,549
	銘柄数<比率>	2	2	―	<0.0%>
(ベルギー)				千ユーロ	
WAREHOUSES DE PAUW SCA		―	0.558	14	2,443
小計	口数・金額	―	0.558	14	2,443
	銘柄数<比率>	―	1	―	<0.0%>
ユーロ計	口数・金額	0.689	0.759	29	4,992
	銘柄数<比率>	2	3	―	<0.0%>
(イギリス)				千イギリスポンド	
SEGRO PLC		3	3	32	6,566
LAND SECURITIES GROUP PLC		―	2	14	2,865
小計	口数・金額	3	5	46	9,431
	銘柄数<比率>	1	2	―	<0.1%>
(オーストラリア)				千オーストラリアドル	
MIRVAC GROUP		9	―	―	―

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)
APA GROUP		2	5	44	4,751
GPT GROUP		4	4	20	2,163
STOCKLAND		6	―	―	―
DEXUS		2	―	―	―
GOODMAN GROUP		5	5	181	19,269
VICINITY CENTERS		9	―	―	―
LENDLEASE GROUP		1	―	―	―
SCENTRE GROUP		15	―	―	―
小計	口数・金額	59	15	246	26,183
	銘柄数<比率>	9	3	―	<0.1%>
(香港)				千香港ドル	
HKT TRUST AND HKT LTD		11	―	―	―
小計	口数・金額	11	―	―	―
	銘柄数<比率>	1	―	―	<―%>
(シンガポール)				千シンガポールドル	
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		14	13	25	3,033
CAPITALAND ASCENDAS REIT		―	11	30	3,566
小計	口数・金額	14	25	55	6,599
	銘柄数<比率>	1	2	―	<0.0%>
合計	口数・金額	103	62	―	304,455
	銘柄数<比率>	27	22	―	<1.7%>

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
外国	S&P 500 EMIN	660	―
	DJ EURO STOX	154	―

(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	16,468,560	93.7
投資信託受益証券	4,751	0.0
投資証券	299,704	1.7
コール・ローン等、その他	811,943	4.6
投資信託財産総額	17,584,958	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(17,577,342千円)の投資信託財産総額(17,584,958千円)に対する比率は100.0%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＝159.56円　1カナダドル＝116.84円　1ユーロ＝171.29円
1イギリスポンド＝202.47円　1スイスフラン＝178.84円　1スウェーデンクローナ＝15.22円
1ノルウェークローネ＝15.13円　1デンマーククローネ＝22.96円　1オーストラリアドル＝106.17円
1ニュージーランドドル＝97.65円　1香港ドル＝20.44円　1シンガポールドル＝117.98円
1イスラエルシェケル＝42.7918円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年6月25日現在
(A)資産	17,596,928,187円
コール・ローン等	571,784,403
株式(評価額)	16,468,560,382
投資信託受益証券(評価額)	4,751,347
投資証券(評価額)	299,704,511
未収入金	15,607,557
未収配当金	16,678,072
未収利息	13
差入委託証拠金	219,841,902
(B)負債	12,186,001
未払金	12,183,090
未払解約金	2,911
(C)純資産総額(A-B)	17,584,742,186
元本	9,577,609,205
次期繰越損益金	8,007,132,981
(D)受益権総口数	9,577,609,205口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,360円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年6月27日 至 2024年6月25日
(A)配当等収益	264,907,167円
受取配当金	245,315,288
受取利息	13,121,233
その他収益金	6,476,683
支払利息	△6,037
(B)有価証券売買損益	4,720,982,807
売買益	5,207,178,634
売買損	△486,195,827
(C)先物取引等取引損益	96,044,776
取引益	150,777,490
取引損	△54,732,714
(D)その他費用	△13,379,617
(E)当期損益金(A+B+C+D)	5,068,555,133
(F)前期繰越損益金	2,850,211,790
(G)追加信託差損益金	1,045,614,212
(H)解約差損益金	△957,248,154
(I)計(E+F+G+H)	8,007,132,981
次期繰越損益金(I)	8,007,132,981

(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9,095,211,203円、期中追加設定元本額は2,345,349,058円、期中一部解約元本額は1,862,951,056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。

外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,964,784,153円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	2,650,642,875円
コア投資戦略ファンド(成長型)	345,177,988円
コア投資戦略ファンド(切替型)	150,284,295円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	144,422,799円
コア投資戦略ファンド(安定型)	140,997,633円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	84,973,097円
FOFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	59,599,927円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	36,726,438円

お知らせ

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

(変更日:2023年6月28日)

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2024年3月20日)

世界債券総合インデックスマザーファンド

運 用 報 告 書

第1期（決算日　2024年4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2023年4月21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	ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）を構成する通貨建ての債券等（ベンチマークを構成する債券以外の証券等や上場投資信託証券を含みます。）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

【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。
・－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。

<680074>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
設定日(2023年4月21日)	10,000	－	10,000	－	－	－	－	18,542
第1期(2024年4月26日)	11,578	15.8	11,634	16.3	85.6	－	12.6	122,228

(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。

ベンチマークは、ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）です。
ブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスとは、Bloomberg Finance L.P.及び、その関係会社が開発、算出、公表を行なうインデックスであり、円建て債券を除く世界の投資適格債券市場を示すインデックスです。
「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指数です。

Bloomberg®及びブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックスは、Bloomberg Finance L.P.及び、同インデックスの管理者であるBloomberg Index Services Limitedをはじめとする関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的での使用のために使用許諾されています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

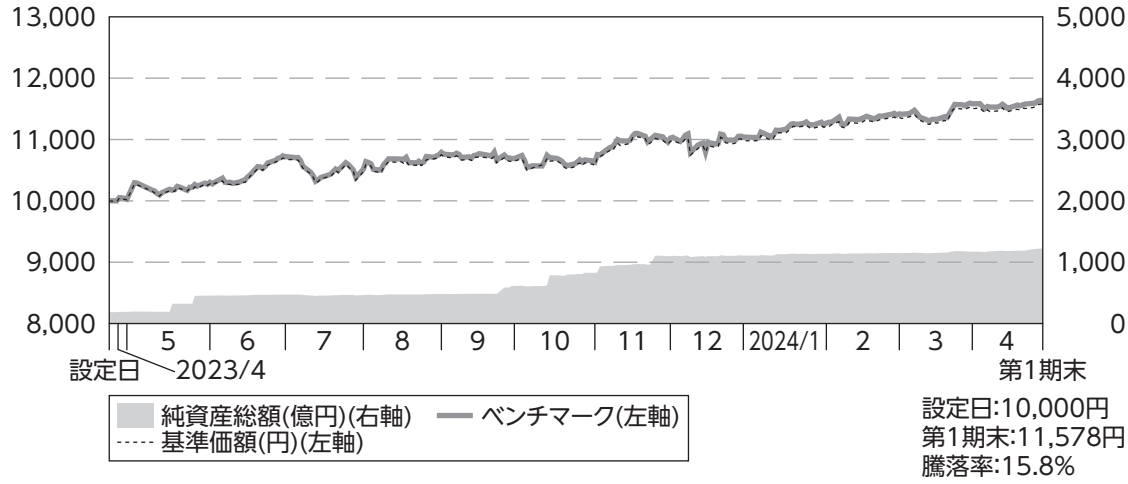
当期中の基準価額と市況の推移

年　月　日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率			
（設　定　日）	円	%		%	%	%	%
2023年 4月21日	10,000	－	10,000	－	－	－	－
4月末	10,017	0.2	10,026	0.3	81.4	－	12.9
5月末	10,276	2.8	10,303	3.0	84.3	－	13.4
6月末	10,674	6.7	10,720	7.2	84.7	－	13.4
7月末	10,476	4.8	10,514	5.1	84.3	－	13.1
8月末	10,751	7.5	10,792	7.9	84.4	－	13.2
9月末	10,648	6.5	10,690	6.9	84.7	－	13.2
10月末	10,578	5.8	10,633	6.3	85.1	－	13.1
11月末	10,970	9.7	11,024	10.2	85.2	－	13.0
12月末	10,979	9.8	11,041	10.4	85.2	－	13.0
2024年 1月末	11,215	12.2	11,268	12.7	85.3	－	13.2
2月末	11,358	13.6	11,419	14.2	85.5	－	13.0
3月末	11,502	15.0	11,582	15.8	85.8	－	12.8
（当　期　末）							
2024年 4月26日	11,578	15.8	11,634	16.3	85.6	－	12.6

(注1)騰落率は設定日比です。
(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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

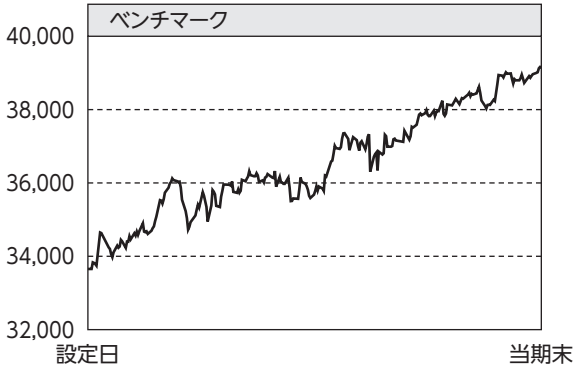


(注)ベンチマークは、2023年4月21日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合(日本円除く)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った結果、当期の基準価額はベンチマークとほぼ同じ動きとなり、上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2023年10月中旬にかけて、主要中央銀行の金融引き締め長期化観測などを背景に上昇（債券価格は下落）しました。同年12月下旬にかけて、主要国の長期金利は、主要先進国のインフレ鈍化を示す指標を受けて、主要中央銀行の利下げ観測が高まったことから低下（債券価格は上昇）しましたが、その後は米国の堅調な経済指標などを背景に上昇しました。

グローバル社債市場では、リスク選好機運の高まりからクレジットスプレッド（国債に対する上乗せ幅）は縮小しました。

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

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）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）債券組入比率

債券ETF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

ベンチマークの通貨・資産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。

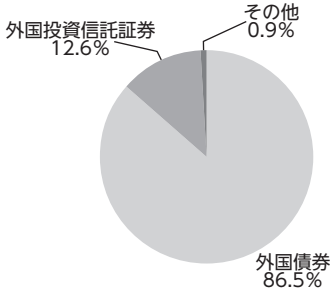
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

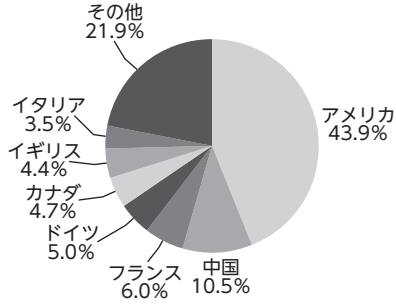
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES MBS ETF	アメリカ	12.6%
2	T 0.25% 10/31/25	アメリカ	0.4%
3	T 3.5% 09/15/25	アメリカ	0.4%
4	T 0.875% 09/30/26	アメリカ	0.3%
5	T 1.25% 04/30/28	アメリカ	0.3%
6	T 2.25% 11/15/27	アメリカ	0.3%
7	T 1.25% 08/15/31	アメリカ	0.3%
8	T 2.25% 11/15/25	アメリカ	0.3%
9	T 0.25% 06/30/25	アメリカ	0.3%
10	CGB 4.08% 10/22/48	中国	0.3%
組入銘柄数		3,093	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

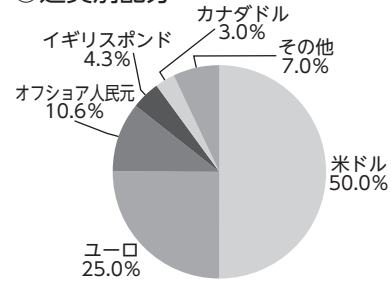
○資産別配分



○国別配分



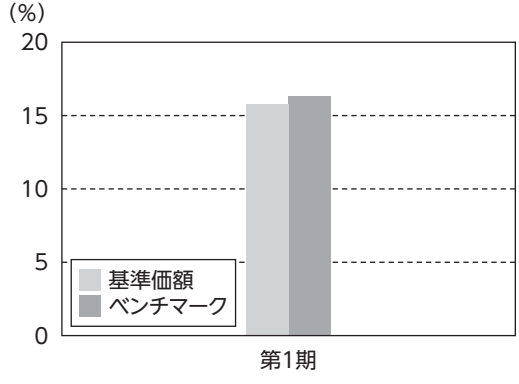
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主なマイナス要因は、売買コスト等です。

今後の運用方針

主としてブルームバーグ・グローバル総合（日本円除く）インデックス（円換算ベース）（以下「ベンチマーク」といいます。）を構成する通貨建ての債券等に投資し、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年4月21日～2024年4月26日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.003%	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	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
（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)	(0.003)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	0	0.000	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	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
（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	6	0.059	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(6)	(0.058)	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）	(－)	(－)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	6	0.062	

（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（10,787円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 180,847	千米ドル 23,767
		地方債証券	4,634	－
		特殊債券	17,281	1,157
		社債券（投資法人債券を含む）	117,077	3,410 (675)
	カナダ	国債証券	千カナダドル 13,376	千カナダドル 2,366
		地方債証券	9,790	196
		特殊債券	4,487	－
		社債券（投資法人債券を含む）	7,223	292
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 53,288	千メキシコペソ 6,676
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 3,460,637	千コロンビアペソ －
	ドイツ	国債証券	千ユーロ 25,814	千ユーロ 7,491
		地方債証券	3,781	－
		特殊債券	5,064	193
		社債券（投資法人債券を含む）	6,074	90
	イタリア	国債証券	23,163	2,723
		特殊債券	93	96
		社債券（投資法人債券を含む）	2,855	174
	フランス	国債証券	25,709	2,648
		特殊債券	2,951	－
		社債券（投資法人債券を含む）	12,346	685
	オランダ	国債証券	4,365	225
		特殊債券	1,219	－
		社債券（投資法人債券を含む）	6,827	291
	スペイン	国債証券	15,264	851
		地方債証券	185	－
		社債券（投資法人債券を含む）	3,149	96
	ベルギー	国債証券	4,996	144
		社債券（投資法人債券を含む）	645	－
	オーストリア	国債証券	3,505	125
		特殊債券	174	－
		社債券（投資法人債券を含む）	756	95

			当期	
			買付額	売付額
外国	ルクセンブルク	社債券（投資法人債券を含む）	965	98
	フィンランド	国債証券	1,503	－
		社債券（投資法人債券を含む）	1,105	99
	アイルランド	国債証券	1,578	91
		社債券（投資法人債券を含む）	553	－
	ギリシャ	国債証券	910	－
	ポルトガル	国債証券	1,863	－
	その他	国債証券	2,118	－
		地方債証券	1,486	－
		特殊債券	13,748	193
		社債券（投資法人債券を含む）	19,828	976
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 21,412	千イギリスポンド 2,225
		特殊債券	2,265	－
		社債券（投資法人債券を含む）	5,536	85
	スイス	国債証券	千スイスフラン 4,315	千スイスフラン 175
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 11,748	千スウェーデンクローナ 294
		社債券（投資法人債券を含む）	25,826	2,918
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 7,979	千ノルウェークローネ 916
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 14,886	千デンマーククローネ 2,644
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 30,880	千チェココルナ 2,513
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 233,808	千ハンガリーフォリント 14,189
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 7,776	千ポーランドズロチ 420
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 11,501	千オーストラリアドル 1,403
		地方債証券	5,733	97
		特殊債券	1,792	－
		社債券（投資法人債券を含む）	1,386	－
	ニュージーランド	国債証券	千ニュージーランドドル 2,477	千ニュージーランドドル 130
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 2,472	千シンガポールドル 9
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 15,418	千マレーシアリンギット 876

			当期 買付額	当期 売付額
外国	タイ	国債証券	千タイバーツ 98,484	千タイバーツ 5,416
	インドネシア	国債証券	千インドネシアルピア 62,253,291	千インドネシアルピア 506,050
	韓国	国債証券	千韓国ウォン 14,019,252	千韓国ウォン 883,478
	中国オフショア	国債証券	千オフショア人民元 314,393	千オフショア人民元 19,254
		特殊債券	298,167	23,693
	イスラエル	国債証券	千イスラエルシェケル 3,912	千イスラエルシェケル －

(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。

＜投資信託受益証券、投資証券＞

	当期 買付 口数	当期 買付 金額	当期 売付 口数	当期 売付 金額
外国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES MBS ETF	1,159	105,614	50	4,661
小計	1,159	105,614	50	4,661

(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	当期 うち利害関係人との取引状況B	当期 B/A	当期 売付額等C	当期 うち利害関係人との取引状況D	当期 D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	115,643	2,668	2.3	5,112	1,243	24.3
金銭信託	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	156,764	16,625	10.6	156,548	16,577	10.6

(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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	325,759	287,962	44,853,044	36.7	－	17.9	12.6	6.2
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	34,510	31,652	3,609,942	3.0	－	1.8	0.8	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	51,470	45,732	414,370	0.3	－	0.2	0.1	0.0
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	3,500,000	3,397,374	133,625	0.1	－	0.1	0.0	－
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	36,540	33,216	5,548,781	4.5	－	2.7	1.5	0.3
イタリア	25,160	23,844	3,983,161	3.3	－	1.9	0.8	0.5
フランス	42,100	38,192	6,380,015	5.2	－	3.1	1.5	0.6
オランダ	13,450	12,129	2,026,179	1.7	－	0.9	0.4	0.3
スペイン	19,290	17,988	3,004,983	2.5	－	1.4	0.7	0.3
ベルギー	6,110	5,587	933,451	0.8	－	0.5	0.2	0.1
オーストリア	4,770	4,293	717,268	0.6	－	0.3	0.2	0.0
ルクセンブルク	1,000	894	149,396	0.1	－	0.0	0.1	0.0
フィンランド	2,850	2,557	427,239	0.3	－	0.1	0.2	0.0
アイルランド	2,350	2,080	347,478	0.3	－	0.2	0.1	－
ギリシャ	850	885	147,913	0.1	－	0.1	0.0	－
ポルトガル	1,980	1,884	314,750	0.3	－	0.2	0.1	0.0
その他	40,842	36,804	6,148,257	5.0	－	2.2	2.1	0.8
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	31,470	26,744	5,208,806	4.3	－	2.7	1.1	0.5
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	3,950	4,190	714,859	0.6	－	0.4	0.2	0.0
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	37,020	34,973	500,126	0.4	－	0.1	0.2	0.1
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	7,600	7,034	99,964	0.1	－	0.0	0.0	0.0
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	13,110	12,384	277,418	0.2	－	0.1	0.0	0.1
	千チェココルナ	千チェココルナ						
チェコ	31,950	29,090	193,290	0.2	－	0.1	0.0	0.0
	千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント						
ハンガリー	274,000	229,104	97,399	0.1	－	0.0	0.0	0.0

世界債券総合インデックスマザーファンド　－第1期－

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
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ	千円	%	%	%	%	%
ポーランド	8,050	7,439	288,117	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	20,870	18,780	1,909,035	1.6	－	0.8	0.5	0.2
	千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル						
ニュージーランド	2,660	2,363	219,545	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	2,570	2,405	275,664	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	14,320	14,498	472,298	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千タイバーツ	千タイバーツ						
タイ	97,300	93,723	394,576	0.3	－	0.2	0.1	0.0
	千インドネシアルピア	千インドネシアルピア						
インドネシア	61,200,000	60,646,459	588,270	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千韓国ウォン	千韓国ウォン						
韓国	14,400,000	13,434,402	1,524,804	1.2	－	0.8	0.3	0.2
	千オフショア人民元	千オフショア人民元						
中国オフショア	556,100	586,162	12,574,879	10.3	－	5.2	3.5	1.6
	千イスラエルシェケル	千イスラエルシェケル						
イスラエル	4,390	3,819	156,316	0.1	－	0.1	0.0	0.0
合　計	－	－	104,635,236	85.6	－	45.1	27.9	12.6

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)個別銘柄開示

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
ADGB 1.625% 06/02/28	1.625	200	174	27,159	2028/6/2
CANADA 0.75% 05/19/26	0.75	200	183	28,576	2026/5/19
CHILE 2.55% 07/27/33	2.55	200	157	24,480	2033/7/27
CHILE 2.75% 01/31/27	2.75	200	185	28,906	2027/1/31
CHILE 4% 01/31/52	4.0	200	148	23,086	2052/1/31
CHILE 4.34% 03/07/42	4.34	200	165	25,848	2042/3/7
HKINTL 4.5% 01/11/28	4.5	200	197	30,795	2028/1/11
HKINTL 4.625% 01/11/33	4.625	200	197	30,746	2033/1/11
INDON 2.85% 02/14/30	2.85	200	174	27,222	2030/2/14
INDON 3.35% 03/12/71	3.35	200	123	19,204	2071/3/12
INDON 4.3% 03/31/52	4.3	200	159	24,889	2052/3/31
INDON 4.35% 01/11/48	4.35	200	163	25,458	2048/1/11
ISRAEL 4.5% 01/17/33	4.5	200	177	27,648	2033/1/17
ITALY 1.25% 02/17/26	1.25	200	184	28,799	2026/2/17
ITALY 3.875% 05/06/51	3.875	200	134	20,925	2051/5/6
KOREA 2.5% 06/19/29	2.5	200	177	27,665	2029/6/19
KSA 2.9% 10/22/25	2.9	200	192	30,013	2025/10/22
KSA 3.45% 02/02/61	3.45	200	122	19,113	2061/2/2
KSA 4.5% 10/26/46	4.5	200	161	25,135	2046/10/26
KSA 4.875% 07/18/33	4.875	200	190	29,707	2033/7/18
KSA 5% 01/18/53	5.0	200	167	26,128	2053/1/18
MEX 3.25% 04/16/30	3.25	200	173	27,005	2030/4/16
MEX 3.75% 04/19/71	3.75	200	118	18,387	2071/4/19
MEX 4.28% 08/14/41	4.28	200	152	23,772	2041/8/14
MEX 4.4% 02/12/52	4.4	200	143	22,353	2052/2/12
MEX 4.75% 04/27/32	4.75	200	182	28,496	2032/4/27
MEX 6.4% 05/07/54	6.4	200	187	29,254	2054/5/7
PANAMA 2.252% 09/29/32	2.252	200	138	21,548	2032/9/29
PANAMA 6.4% 02/14/35	6.4	200	183	28,617	2035/2/14
PERU 2.392% 01/23/26	2.392	200	189	29,457	2026/1/23
PERU 3.3% 03/11/41	3.3	200	142	22,166	2041/3/11
PHILIP 3.229% 03/29/27	3.229	200	188	29,436	2027/3/29
PHILIP 4.2% 03/29/47	4.2	200	159	24,794	2047/3/29
PHILIP 5.17% 10/13/27	5.17	200	198	30,948	2027/10/13
PHILIP 5.5% 01/17/48	5.5	200	192	29,986	2048/1/17
POLAND 5.5% 11/16/27	5.5	200	201	31,364	2027/11/16
QATAR 3.75% 04/16/30	3.75	200	186	29,115	2030/4/16
QATAR 4.817% 03/14/49	4.817	200	176	27,498	2049/3/14
REPHUN 5.5% 03/26/36	5.5	400	371	57,884	2036/3/26
T 0.25% 05/31/25	0.25	1,000	947	147,643	2025/5/31
T 0.25% 06/30/25	0.25	2,500	2,361	367,777	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	2,200	2,069	322,366	2025/7/31
T 0.25% 08/31/25	0.25	1,000	937	145,958	2025/8/31
T 0.25% 09/30/25	0.25	2,000	1,866	290,796	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,350	3,116	485,351	2025/10/31
T 0.375% 12/31/25	0.375	1,000	925	144,102	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	1,450	1,335	207,973	2026/2/28
T 0.5% 10/31/27	0.5	1,000	861	134,239	2027/10/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	1,000	786	122,457	2030/5/15
T 0.625% 07/31/26	0.625	1,400	1,271	198,106	2026/7/31
T 0.625% 08/15/30	0.625	1,000	778	121,282	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	1,200	1,035	161,339	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	2,000	1,720	268,016	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	1,000	861	134,260	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	450	415	64,662	2026/3/31
T 0.75% 05/31/26	0.75	1,000	916	142,766	2026/5/31
T 0.75% 08/31/26	0.75	1,000	908	141,461	2026/8/31
T 0.875% 09/30/26	0.875	3,000	2,725	424,567	2026/9/30
T 0.875% 11/15/30	0.875	1,400	1,101	171,512	2030/11/15
T 1% 07/31/28	1.0	2,470	2,114	329,400	2028/7/31
T 1.125% 02/15/31	1.125	1,000	795	123,911	2031/2/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	1,000	872	135,873	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	500	292	45,571	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	300	173	27,071	2040/8/15
T 1.125% 08/31/28	1.125	1,600	1,373	213,989	2028/8/31
T 1.125% 10/31/26	1.125	1,000	911	141,969	2026/10/31
T 1.25% 03/31/28	1.25	1,000	874	136,183	2028/3/31
T 1.25% 04/30/28	1.25	3,000	2,616	407,510	2028/4/30
T 1.25% 05/15/50	1.25	400	187	29,258	2050/5/15
T 1.25% 05/31/28	1.25	1,050	913	142,289	2028/5/31
T 1.25% 06/30/28	1.25	1,050	911	141,948	2028/6/30
T 1.25% 08/15/31	1.25	3,200	2,523	393,011	2031/8/15
T 1.25% 09/30/28	1.25	1,250	1,076	167,708	2028/9/30
T 1.25% 11/30/26	1.25	1,000	911	142,051	2026/11/30
T 1.25% 12/31/26	1.25	2,000	1,819	283,458	2026/12/31
T 1.375% 08/15/50	1.375	950	460	71,760	2050/8/15
T 1.375% 10/31/28	1.375	1,600	1,382	215,362	2028/10/31
T 1.375% 11/15/31	1.375	850	671	104,551	2031/11/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	300	180	28,158	2040/11/15
T 1.375% 12/31/28	1.375	1,000	860	133,956	2028/12/31
T 1.5% 01/31/27	1.5	1,600	1,461	227,677	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	500	418	65,261	2030/2/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	1,000	925	144,169	2026/8/15
T 1.625% 02/15/26	1.625	1,000	941	146,621	2026/2/15
T 1.625% 05/15/31	1.625	1,000	816	127,254	2031/5/15
T 1.625% 11/15/50	1.625	1,000	519	80,910	2050/11/15
T 1.75% 01/31/29	1.75	2,300	2,009	312,970	2029/1/31
T 1.75% 08/15/41	1.75	400	252	39,341	2041/8/15
T 1.875% 02/15/32	1.875	1,000	815	127,099	2032/2/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	500	326	50,918	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	800	444	69,164	2051/2/15
T 1.875% 02/28/27	1.875	1,000	921	143,487	2027/2/28
T 1.875% 02/28/29	1.875	1,000	877	136,655	2029/2/28
T 1.875% 06/30/26	1.875	160	149	23,354	2026/6/30
T 1.875% 11/15/51	1.875	1,300	716	111,581	2051/11/15
T 2% 02/15/50	2.0	1,050	607	94,685	2050/2/15
T 2% 08/15/25	2.0	1,000	960	149,657	2025/8/15
T 2% 08/15/51	2.0	900	513	80,014	2051/8/15

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
T 2% 11/15/26	2.0	1,300	1,210	188,527	2026/11/15
T 2% 11/15/41	2.0	350	229	35,824	2041/11/15
T 2.25% 02/15/27	2.25	1,000	932	145,179	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	500	303	47,202	2052/2/15
T 2.25% 05/15/41	2.25	260	180	28,075	2041/5/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	300	190	29,748	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	1,100	679	105,833	2049/8/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,500	2,394	372,972	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	2,800	2,567	399,908	2027/11/15
T 2.375% 02/15/42	2.375	200	139	21,729	2042/2/15
T 2.375% 03/31/29	2.375	700	627	97,802	2029/3/31
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,000	1,861	289,871	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	2,000	1,790	278,877	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	1,450	909	141,730	2051/5/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	800	507	79,077	2049/11/15
T 2.5% 02/15/45	2.5	900	614	95,746	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	800	539	84,022	2046/2/15
T 2.5% 03/31/27	2.5	1,900	1,779	277,198	2027/3/31
T 2.5% 05/15/46	2.5	700	470	73,289	2046/5/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	2,000	1,918	298,827	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	1,500	1,364	212,575	2029/2/15
T 2.625% 05/31/27	2.625	500	468	72,948	2027/5/31
T 2.625% 07/31/29	2.625	800	722	112,509	2029/7/31
T 2.75% 04/30/27	2.75	1,000	941	146,669	2027/4/30
T 2.75% 05/15/25	2.75	1,000	975	151,888	2025/5/15
T 2.75% 05/31/29	2.75	1,620	1,475	229,862	2029/5/31
T 2.75% 08/15/32	2.75	800	692	107,888	2032/8/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	200	147	22,946	2042/8/15
T 2.75% 08/31/25	2.75	630	610	95,108	2025/8/31
T 2.75% 11/15/42	2.75	200	146	22,860	2042/11/15
T 2.875% 04/30/29	2.875	620	568	88,619	2029/4/30
T 2.875% 05/15/32	2.875	800	701	109,311	2032/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	300	223	34,803	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	700	495	77,133	2049/5/15
T 2.875% 05/15/52	2.875	600	419	65,375	2052/5/15
T 2.875% 06/15/25	2.875	500	487	75,911	2025/6/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	820	596	92,943	2045/8/15
T 2.875% 11/15/46	2.875	600	431	67,215	2046/11/15
T 3% 02/15/47	3.0	300	220	34,318	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	150	109	17,041	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	100	72	11,304	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	600	461	71,855	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	770	574	89,433	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	220	161	25,123	2047/5/15
T 3% 07/15/25	3.0	1,000	974	151,853	2025/7/15
T 3% 08/15/48	3.0	300	218	33,979	2048/8/15
T 3% 08/15/52	3.0	800	574	89,459	2052/8/15
T 3% 11/15/44	3.0	750	561	87,526	2044/11/15
T 3% 11/15/45	3.0	200	148	23,131	2045/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	200	157	24,505	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	300	233	36,323	2043/2/15

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
T 3.125% 05/15/48	3.125	200	149	23,225	2048/5/15
T 3.125% 08/15/25	3.125	2,000	1,949	303,689	2025/8/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	600	460	71,680	2044/8/15
T 3.125% 08/31/27	3.125	1,000	947	147,643	2027/8/31
T 3.125% 08/31/29	3.125	1,000	924	144,047	2029/8/31
T 3.125% 11/15/28	3.125	1,500	1,400	218,188	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	500	394	61,479	2041/11/15
T 3.25% 05/15/42	3.25	920	735	114,555	2042/5/15
T 3.25% 06/30/27	3.25	1,000	953	148,592	2027/6/30
T 3.25% 06/30/29	3.25	2,000	1,864	290,443	2029/6/30
T 3.375% 05/15/33	3.375	1,500	1,353	210,814	2033/5/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	300	240	37,387	2044/5/15
T 3.375% 08/15/42	3.375	300	243	37,957	2042/8/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	150	116	18,207	2048/11/15
T 3.5% 02/15/33	3.5	1,950	1,780	277,345	2033/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	400	346	54,036	2039/2/15
T 3.5% 09/15/25	3.5	3,000	2,934	457,140	2025/9/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	600	499	77,816	2044/2/15
T 3.625% 02/15/53	3.625	820	666	103,824	2053/2/15
T 3.625% 05/15/53	3.625	1,000	813	126,643	2053/5/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	350	292	45,520	2043/8/15
T 3.75% 06/30/30	3.75	1,150	1,090	169,779	2030/6/30
T 3.75% 11/15/43	3.75	300	254	39,689	2043/11/15
T 3.75% 12/31/28	3.75	1,600	1,533	238,921	2028/12/31
T 3.875% 02/15/43	3.875	300	261	40,657	2043/2/15
T 3.875% 05/15/43	3.875	1,000	868	135,286	2043/5/15
T 3.875% 08/15/33	3.875	2,000	1,874	292,001	2033/8/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	600	534	83,183	2040/8/15
T 3.875% 12/31/29	3.875	250	239	37,291	2029/12/31
T 4% 02/28/30	4.0	1,500	1,444	224,924	2030/2/28
T 4% 10/31/29	4.0	900	868	135,225	2029/10/31
T 4% 11/15/42	4.0	1,000	887	138,230	2042/11/15
T 4% 11/15/52	4.0	840	732	114,107	2052/11/15
T 4.125% 07/31/28	4.125	750	731	113,954	2028/7/31
T 4.125% 08/15/53	4.125	790	703	109,620	2053/8/15
T 4.125% 09/30/27	4.125	2,100	2,054	319,953	2027/9/30
T 4.125% 11/15/32	4.125	1,000	958	149,334	2032/11/15
T 4.25% 02/28/31	4.25	1,100	1,069	166,651	2031/2/28
T 4.25% 05/15/39	4.25	500	471	73,379	2039/5/15
T 4.25% 10/15/25	4.25	1,100	1,086	169,254	2025/10/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	500	465	72,446	2040/11/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	230	216	33,739	2041/5/15
T 4.375% 08/15/43	4.375	800	744	115,885	2043/8/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	300	285	44,478	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	550	546	85,052	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	300	293	45,652	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	300	290	45,199	2039/8/15
T 4.5% 11/15/25	4.5	2,000	1,981	308,672	2025/11/15
T 4.5% 11/15/33	4.5	1,100	1,082	168,565	2033/11/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	500	489	76,197	2040/2/15
T 4.625% 09/30/30	4.625	1,760	1,749	272,525	2030/9/30

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
T 4.625% 11/15/26	4.625	1,600	1,589	247,531	2026/11/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	200	197	30,755	2041/2/15
T 4.75% 11/15/43	4.75	700	683	106,527	2043/11/15
T 4.75% 11/15/53	4.75	1,000	990	154,226	2053/11/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	100	103	16,098	2037/5/15
UAE 4.917% 09/25/33	4.917	200	197	30,810	2033/9/25
UAE 4.951% 07/07/52	4.951	200	180	28,056	2052/7/7
URUGUA 4.375% 10/27/27	4.375	100	98	15,361	2027/10/27
URUGUA 5.75% 10/28/34	5.75	200	203	31,723	2034/10/28
地方債証券					
ALTA 1.3% 07/22/30	1.3	200	160	25,053	2030/7/22
ALTA 3.3% 03/15/28	3.3	200	188	29,313	2028/3/15
ALTA 4.5% 01/24/34	4.5	200	191	29,773	2034/1/24
BRCOL 0.9% 07/20/26	0.9	100	91	14,204	2026/7/20
BRCOL 1.3% 01/29/31	1.3	100	79	12,371	2031/1/29
BRCOL 4.2% 07/06/33	4.2	500	468	72,969	2033/7/6
CADEPO 0.875% 06/10/25	0.875	250	237	37,067	2025/6/10
CADEPO 4.5% 02/13/26	4.5	250	246	38,420	2026/2/13
KOMMUN 3.75% 05/24/28	3.75	200	190	29,714	2028/5/24
MP 1.5% 10/25/28	1.5	200	172	26,827	2028/10/25
MP 4.3% 07/27/33	4.3	300	282	44,067	2033/7/27
NBRNS 3.625% 02/24/28	3.625	100	94	14,763	2028/2/24
ONT 1.125% 10/07/30	1.125	200	157	24,575	2030/10/7
ONT 1.6% 02/25/31	1.6	200	161	25,129	2031/2/25
ONT 1.8% 10/14/31	1.8	200	160	25,006	2031/10/14
ONT 2.125% 01/21/32	2.125	400	326	50,910	2032/1/21
ONT 5.05% 04/24/34	5.05	200	199	31,072	2034/4/24
Q 1.35% 05/28/30	1.35	300	243	37,979	2030/5/28
Q 1.9% 04/21/31	1.9	300	245	38,302	2031/4/21
Q 4.5% 09/08/33	4.5	400	383	59,695	2033/9/8
SCDA 3.25% 06/08/27	3.25	300	284	44,315	2027/6/8
特殊債券(除く金融債)					
AFDB 0.875% 07/22/26	0.875	100	91	14,204	2026/7/22
AFDB 4.375% 03/14/28	4.375	100	98	15,286	2028/3/14
AFDB 5.75% PERP	5.75	200	188	29,317	－
AGFRNC 4.5% 02/17/26	4.5	200	197	30,696	2026/2/17
AIIB 0.5% 01/27/26	0.5	100	92	14,364	2026/1/27
AIIB 0.5% 05/28/25	0.5	200	189	29,543	2025/5/28
ASIA 0.5% 02/04/26	0.5	200	184	28,731	2026/2/4
ASIA 1% 04/14/26	1.0	100	92	14,393	2026/4/14
ASIA 1.75% 09/19/29	1.75	100	85	13,314	2029/9/19
ASIA 1.875% 01/24/30	1.875	200	170	26,550	2030/1/24
ASIA 3.75% 04/25/28	3.75	200	192	29,908	2028/4/25
ASIA 3.875% 09/28/32	3.875	100	93	14,543	2032/9/28
ASIA 4% 01/12/33	4.0	100	93	14,641	2033/1/12
BNG 0.875% 05/18/26	0.875	200	183	28,598	2026/5/18
CADES 1.375% 01/20/31	1.375	200	159	24,845	2031/1/20
CADES 3.75% 05/24/28	3.75	200	191	29,783	2028/5/24
CADES 4% 01/25/26	4.0	300	294	45,822	2026/1/25
CADES 4.625% 11/02/25	4.625	200	198	30,849	2025/11/2
CAF 4.75% 04/01/26	4.75	100	97	15,216	2026/4/1

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
COE 3% 06/16/25	3.0	100	97	15,168	2025/6/16
COE 3.625% 01/26/28	3.625	100	95	14,894	2028/1/26
DBJJP 1.25% 10/20/26	1.25	300	272	42,434	2026/10/20
DBJJP 4.375% 09/22/25	4.375	200	196	30,658	2025/9/22
DBJJP 4.5% 01/30/34	4.5	200	191	29,847	2034/1/30
EBRD 4.375% 03/09/28	4.375	100	98	15,302	2028/3/9
EDC 3.375% 08/26/25	3.375	200	195	30,395	2025/8/26
EIB 0.375% 03/26/26	0.375	500	457	71,275	2026/3/26
EIB 1.375% 03/15/27	1.375	400	362	56,427	2027/3/15
EIB 1.75% 03/15/29	1.75	100	86	13,517	2029/3/15
EIBKOR 1.25% 09/21/30	1.25	200	156	24,410	2030/9/21
EIBKOR 2.5% 06/29/41	2.5	200	135	21,045	2041/6/29
EIBKOR 5% 01/11/28	5.0	200	198	30,938	2028/1/11
ESM 0.375% 09/10/25	0.375	200	187	29,166	2025/9/10
FFCB 4.625% 04/10/26	4.625	500	495	77,223	2026/4/10
FFCB 6.08% 04/28/33	6.08	500	500	77,884	2033/4/28
FHLB 0.96% 03/05/26	0.96	200	185	28,898	2026/3/5
FNMA 0.56% 11/17/25	0.56	200	186	29,008	2025/11/17
FNMA 0.75% 10/08/27	0.75	200	174	27,138	2027/10/8
FNMA 1.875% 09/24/26	1.875	100	93	14,495	2026/9/24
FNMA 5.625% 07/15/37	5.625	200	212	33,035	2037/7/15
FNMA 7.125% 01/15/30	7.125	200	223	34,741	2030/1/15
IADB 0.875% 04/20/26	0.875	100	92	14,349	2026/4/20
IADB 1.125% 01/13/31	1.125	100	78	12,293	2031/1/13
IADB 3.5% 09/14/29	3.5	100	93	14,593	2029/9/14
IADB 4.375% 01/24/44	4.375	200	180	28,161	2044/1/24
IADB 4.5% 05/15/26	4.5	200	197	30,810	2026/5/15
IADB 4.5% 09/13/33	4.5	200	194	30,327	2033/9/13
IBRD 0.5% 10/28/25	0.5	200	186	29,047	2025/10/28
IBRD 0.875% 07/15/26	0.875	100	91	14,234	2026/7/15
IBRD 1.125% 09/13/28	1.125	200	170	26,621	2028/9/13
IBRD 1.375% 04/20/28	1.375	100	87	13,638	2028/4/20
IBRD 3.125% 06/15/27	3.125	500	474	73,905	2027/6/15
IBRD 3.5% 07/12/28	3.5	100	94	14,785	2028/7/12
IDBINV 4.125% 02/15/28	4.125	100	96	15,082	2028/2/15
IFC 0.375% 07/16/25	0.375	200	188	29,368	2025/7/16
IFC 0.75% 08/27/30	0.75	100	77	12,147	2030/8/27
IFC 3.625% 09/15/25	3.625	100	97	15,242	2025/9/15
JBIC 0.625% 07/15/25	0.625	200	188	29,402	2025/7/15
JBIC 2.75% 01/21/26	2.75	200	191	29,840	2026/1/21
JBIC 4.25% 01/26/26	4.25	200	196	30,601	2026/1/26
JBIC 4.25% 04/27/26	4.25	300	294	45,858	2026/4/27
JBIC 4.375% 10/05/27	4.375	200	195	30,483	2027/10/5
JICA 3.25% 05/25/27	3.25	200	189	29,440	2027/5/25
KBN 4% 01/19/28	4.0	200	193	30,106	2028/1/19
KBN 4.625% 10/24/25	4.625	200	197	30,836	2025/10/24
KDB 4.25% 09/08/32	4.25	200	186	28,997	2032/9/8
KFW 0.75% 09/30/30	0.75	100	78	12,162	2030/9/30
KFW 1% 10/01/26	1.0	500	455	70,912	2026/10/1
KFW 3.625% 04/01/26	3.625	100	97	15,167	2026/4/1
KFW 3.75% 02/15/28	3.75	200	192	29,989	2028/2/15

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
KFW 4.125% 07/15/33	4.125	300	284	44,286	2033/7/15
KOHNPW 1.25% 04/27/26	1.25	200	183	28,617	2026/4/27
KORELE 5.375% 07/31/26	5.375	200	199	31,046	2026/7/31
KORGAS 1.125% 07/13/26	1.125	200	182	28,349	2026/7/13
LBANK 1.375% 10/12/28	1.375	100	85	13,382	2028/10/12
NEDFIN 4.75% 11/15/28	4.75	200	198	30,854	2028/11/15
NEDWBK 1% 05/28/30	1.0	200	159	24,771	2030/5/28
NEDWBK 4% 06/01/28	4.0	200	193	30,066	2028/6/1
NIB 3.375% 09/08/27	3.375	200	190	29,651	2027/9/8
NIB 4.25% 02/28/29	4.25	200	195	30,380	2029/2/28
OKB 3.625% 09/09/27	3.625	200	191	29,896	2027/9/9
OKB 4.125% 01/20/26	4.125	100	98	15,306	2026/1/20
OKB 4.625% 11/03/25	4.625	200	198	30,862	2025/11/3
SDBC 2% 02/16/27	2.0	200	184	28,778	2027/2/16
SEK 2.25% 03/22/27	2.25	200	184	28,802	2027/3/22
TVA 3.875% 03/15/28	3.875	200	193	30,115	2028/3/15
TVA 4.25% 09/15/65	4.25	100	81	12,637	2065/9/15
TVA 7.125% 05/01/30	7.125	200	223	34,746	2030/5/1
普通社債券（含む投資法人債券）					
AAPL 0.7% 02/08/26	0.7	100	92	14,405	2026/2/8
AAPL 1.4% 08/05/28	1.4	100	86	13,451	2028/8/5
AAPL 2.65% 05/11/50	2.65	100	61	9,556	2050/5/11
AAPL 2.7% 08/05/51	2.7	200	122	19,090	2051/8/5
AAPL 3.35% 08/08/32	3.35	100	88	13,795	2032/8/8
AAPL 3.75% 11/13/47	3.75	100	76	11,988	2047/11/13
AAPL 4.1% 08/08/62	4.1	200	156	24,332	2062/8/8
AAPL 4.421% 05/08/26	4.421	200	197	30,813	2026/5/8
ABBV 4.45% 05/14/46	4.45	100	84	13,159	2046/5/14
ABBV 5.35% 03/15/44	5.35	200	192	29,990	2044/3/15
ABC 2.7% 03/15/31	2.7	100	83	12,997	2031/3/15
ABIBB 4% 04/13/28	4.0	100	96	14,986	2028/4/13
ABIBB 4.7% 02/01/36	4.7	100	92	14,435	2036/2/1
ABIBB 4.9% 02/01/46	4.9	100	89	13,937	2046/2/1
ABIBB 5% 06/15/34	5.0	200	193	30,074	2034/6/15
ABIBB 5.55% 01/23/49	5.55	100	97	15,249	2049/1/23
ABIBB 5.8% 01/23/59	5.8	100	100	15,685	2059/1/23
ABNANV 2.47% 12/13/29	2.47	200	172	26,842	2029/12/13
ABNANV 3.324% 03/13/37	3.324	200	160	24,949	2037/3/13
ABT 1.15% 01/30/28	1.15	100	86	13,545	2028/1/30
ABT 1.4% 06/30/30	1.4	100	81	12,629	2030/6/30
ACAFP 1.907% 06/16/26	1.907	250	238	37,205	2026/6/16
ACGL 3.635% 06/30/50	3.635	100	68	10,732	2050/6/30
ADBE 2.15% 02/01/27	2.15	100	92	14,405	2027/2/1
ADM 4.5% 08/15/33	4.5	100	92	14,463	2033/8/15
AEE 1.95% 03/15/27	1.95	100	90	14,137	2027/3/15
AEE 3.9% 04/01/52	3.9	100	74	11,599	2052/4/1
AEE 5.2% 04/01/34	5.2	200	193	30,110	2034/4/1
AEP 3.75% 07/01/47	3.75	100	71	11,107	2047/7/1
AEP 5.625% 04/01/53	5.625	200	191	29,773	2053/4/1
AER 1.75% 01/30/26	1.75	150	139	21,775	2026/1/30
AER 2.45% 10/29/26	2.45	150	138	21,589	2026/10/29

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)	
AER 3.4% 10/29/33	3.4	150	121	18,963	2033/10/29
AER 3.85% 10/29/41	3.85	150	112	17,486	2041/10/29
AES 1.375% 01/15/26	1.375	100	92	14,414	2026/1/15
AFL 1.125% 03/15/26	1.125	100	92	14,380	2026/3/15
AGR 3.8% 06/01/29	3.8	100	91	14,256	2029/6/1
AIA 5.625% 10/25/27	5.625	200	201	31,428	2027/10/25
AIG 3.4% 06/30/30	3.4	200	178	27,770	2030/6/30
AIRFP 3.95% 04/10/47	3.95	150	118	18,434	2047/4/10
AJG 5.5% 03/02/33	5.5	100	97	15,234	2033/3/2
AL 2.875% 01/15/26	2.875	100	95	14,822	2026/1/15
AL 3.125% 12/01/30	3.125	100	85	13,320	2030/12/1
AL 5.3% 02/01/28	5.3	100	98	15,322	2028/2/1
ALL 1.45% 12/15/30	1.45	100	77	12,008	2030/12/15
ALLY 4.75% 06/09/27	4.75	100	96	14,978	2027/6/9
AMG 3.3% 06/15/30	3.3	100	87	13,582	2030/6/15
AMGN 3.15% 02/21/40	3.15	100	72	11,299	2040/2/21
AMGN 3.375% 02/21/50	3.375	200	135	21,171	2050/2/21
AMGN 5.15% 03/02/28	5.15	100	99	15,430	2028/3/2
AMGN 5.507% 03/02/26	5.507	200	199	31,094	2026/3/2
AMGN 5.6% 03/02/43	5.6	200	192	29,913	2043/3/2
AMGN 5.75% 03/02/63	5.75	100	94	14,792	2063/3/2
AMP 5.15% 05/15/33	5.15	100	97	15,241	2033/5/15
AMT 1.6% 04/15/26	1.6	100	92	14,409	2026/4/15
AMT 1.875% 10/15/30	1.875	100	79	12,324	2030/10/15
AMT 2.95% 01/15/51	2.95	100	59	9,327	2051/1/15
AMT 3.8% 08/15/29	3.8	100	91	14,201	2029/8/15
AMT 5.65% 03/15/33	5.65	100	98	15,291	2033/3/15
AMXLMM 2.875% 05/07/30	2.875	200	171	26,780	2030/5/7
AMZN 3.875% 08/22/37	3.875	100	85	13,355	2037/8/22
AMZN 4.05% 08/22/47	4.05	100	81	12,675	2047/8/22
AMZN 4.25% 08/22/57	4.25	100	80	12,608	2057/8/22
AMZN 4.55% 12/01/27	4.55	100	98	15,343	2027/12/1
AMZN 4.6% 12/01/25	4.6	200	198	30,873	2025/12/1
AMZN 4.7% 12/01/32	4.7	200	194	30,218	2032/12/1
AN 1.95% 08/01/28	1.95	100	85	13,252	2028/8/1
ANZNZ 3.45% 01/21/28	3.45	200	186	29,044	2028/1/21
AON 3.875% 12/15/25	3.875	100	97	15,161	2025/12/15
APD 2.05% 05/15/30	2.05	100	83	13,033	2030/5/15
APD 2.7% 05/15/40	2.7	100	68	10,722	2040/5/15
APH 4.75% 03/30/26	4.75	100	98	15,380	2026/3/30
ARE 2.75% 12/15/29	2.75	100	86	13,408	2029/12/15
ARE 3.55% 03/15/52	3.55	100	65	10,175	2052/3/15
ARE 4.75% 04/15/35	4.75	100	90	14,152	2035/4/15
ATH 3.95% 05/25/51	3.95	100	69	10,873	2051/5/25
ATH 5.875% 01/15/34	5.875	200	194	30,306	2034/1/15
ATH 6.15% 04/03/30	6.15	100	101	15,837	2030/4/3
ATO 5.75% 10/15/52	5.75	100	99	15,511	2052/10/15
ATO 6.2% 11/15/53	6.2	100	105	16,468	2053/11/15
AVB 1.9% 12/01/28	1.9	100	86	13,434	2028/12/1
AVGO 1.95% 02/15/28	1.95	100	87	13,691	2028/2/15
AVGO 3.137% 11/15/35	3.137	200	154	24,131	2035/11/15

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
AVGO 3.469% 04/15/34	3.469	200	165	25,754	2034/4/15
AVGO 4.15% 04/15/32	4.15	100	90	14,022	2032/4/15
AVOL 5.75% 03/01/29	5.75	200	196	30,542	2029/3/1
AXP 2.55% 03/04/27	2.55	100	92	14,401	2027/3/4
AXP 5.625% 07/28/34	5.625	200	195	30,446	2034/7/28
AZN 0.7% 04/08/26	0.7	100	91	14,278	2026/4/8
AZN 4.875% 03/03/33	4.875	100	96	15,038	2033/3/3
AZO 4% 04/15/30	4.0	100	92	14,411	2030/4/15
BA 2.196% 02/04/26	2.196	100	93	14,514	2026/2/4
BA 2.75% 02/01/26	2.75	200	188	29,375	2026/2/1
BA 3.25% 02/01/28	3.25	200	180	28,085	2028/2/1
BA 3.25% 02/01/35	3.25	100	74	11,619	2035/2/1
BA 5.15% 05/01/30	5.15	100	94	14,678	2030/5/1
BA 5.805% 05/01/50	5.805	100	87	13,669	2050/5/1
BABA 2.125% 02/09/31	2.125	200	161	25,165	2031/2/9
BAC 1.734% 07/22/27	1.734	100	91	14,287	2027/7/22
BAC 1.898% 07/23/31	1.898	100	79	12,436	2031/7/23
BAC 2.087% 06/14/29	2.087	100	86	13,537	2029/6/14
BAC 2.572% 10/20/32	2.572	100	80	12,558	2032/10/20
BAC 2.676% 06/19/41	2.676	100	67	10,499	2041/6/19
BAC 2.687% 04/22/32	2.687	200	164	25,584	2032/4/22
BAC 3.483% 03/13/52	3.483	100	69	10,758	2052/3/13
BAC 3.5% 04/19/26	3.5	100	96	15,032	2026/4/19
BAC 3.946% 01/23/49	3.946	300	229	35,799	2049/1/23
BAC 4.083% 03/20/51	4.083	100	76	11,958	2051/3/20
BAC 4.827% 07/22/26	4.827	200	197	30,752	2026/7/22
BAC 5.08% 01/20/27	5.08	500	494	77,017	2027/1/20
BAC 5.468% 01/23/35	5.468	200	194	30,257	2035/1/23
BACR 5.088% 06/20/30	5.088	200	188	29,339	2030/6/20
BACR 7.385% 11/02/28	7.385	200	209	32,563	2028/11/2
BALN 3.4% 04/15/30	3.4	200	178	27,748	2030/4/15
BATSLN 1.668% 03/25/26	1.668	100	92	14,461	2026/3/25
BATSLN 3.734% 09/25/40	3.734	100	72	11,241	2040/9/25
BATSLN 4.54% 08/15/47	4.54	100	74	11,533	2047/8/15
BATSLN 7.75% 10/19/32	7.75	200	220	34,347	2032/10/19
BAX 1.915% 02/01/27	1.915	100	90	14,133	2027/2/1
BAYNGR 4.4% 07/15/44	4.4	200	147	23,050	2044/7/15
BAYNGR 4.7% 07/15/64	4.7	100	69	10,750	2064/7/15
BCECN 2.15% 02/15/32	2.15	100	78	12,192	2032/2/15
BDX 4.298% 08/22/32	4.298	100	91	14,278	2032/8/22
BDX 4.693% 02/13/28	4.693	100	97	15,150	2028/2/13
BFB 4.75% 04/15/33	4.75	100	95	14,901	2033/4/15
BFCM 4.753% 07/13/27	4.753	200	195	30,417	2027/7/13
BFCM 4.935% 01/26/26	4.935	200	197	30,797	2026/1/26
BG 2.75% 05/14/31	2.75	100	83	13,015	2031/5/14
BHF 5.625% 05/15/30	5.625	100	98	15,409	2030/5/15
BHI 4.08% 12/15/47	4.08	100	77	12,043	2047/12/15
BHP 4.75% 02/28/28	4.75	100	98	15,303	2028/2/28
BIIB 3.15% 05/01/50	3.15	100	62	9,684	2050/5/1
BK 4.414% 07/24/26	4.414	100	98	15,349	2026/7/24
BK 4.596% 07/26/30	4.596	100	96	14,972	2030/7/26

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
BK 4.947% 04/26/27	4.947	200	197	30,833	2027/4/26
BK 5.834% 10/25/33	5.834	100	101	15,784	2033/10/25
BKH 3.05% 10/15/29	3.05	200	175	27,281	2029/10/15
BKH 3.875% 10/15/49	3.875	100	69	10,749	2049/10/15
BKH 6.15% 05/15/34	6.15	200	199	31,052	2034/5/15
BKNG 4.625% 04/13/30	4.625	100	96	14,991	2030/4/13
BLK 1.9% 01/28/31	1.9	100	80	12,605	2031/1/28
BMO 0.949% 01/22/27	0.949	100	92	14,414	2027/1/22
BMO 4.7% 09/14/27	4.7	100	97	15,222	2027/9/14
BMW 3.45% 04/01/27	3.45	100	94	14,791	2027/4/1
BMY 2.95% 03/15/32	2.95	100	84	13,157	2032/3/15
BMY 3.55% 03/15/42	3.55	200	151	23,659	2042/3/15
BMY 4.25% 10/26/49	4.25	100	79	12,424	2049/10/26
BMY 4.625% 05/15/44	4.625	100	86	13,473	2044/5/15
BMY 4.9% 02/22/29	4.9	200	197	30,690	2029/2/22
BNP 1.904% 09/30/28	1.904	200	176	27,455	2028/9/30
BNP 2.159% 09/15/29	2.159	200	171	26,702	2029/9/15
BNP 5.738% 02/20/35	5.738	200	194	30,333	2035/2/20
BNS 4.588% 05/04/37	4.588	100	88	13,726	2037/5/4
BNS 4.75% 02/02/26	4.75	200	197	30,751	2026/2/2
BNSF 2.875% 06/15/52	2.875	100	61	9,523	2052/6/15
BNSF 3.05% 02/15/51	3.05	100	64	9,995	2051/2/15
BNSF 4.05% 06/15/48	4.05	100	78	12,249	2048/6/15
BOCAVI 2.625% 09/17/30	2.625	200	168	26,321	2030/9/17
BOCAVI 4.875% 05/03/33	4.875	200	190	29,632	2033/5/3
BPCEGP 1.652% 10/06/26	1.652	250	234	36,525	2026/10/6
BPCEGP 3.116% 10/19/32	3.116	250	200	31,283	2032/10/19
BPLN 3.001% 03/17/52	3.001	100	62	9,786	2052/3/17
BPLN 3.06% 06/17/41	3.06	100	71	11,158	2041/6/17
BPLN 3.543% 04/06/27	3.543	100	95	14,853	2027/4/6
BPLN 4.893% 09/11/33	4.893	100	95	14,907	2033/9/11
BRK 2.3% 03/15/27	2.3	100	93	14,493	2027/3/15
BRK 2.875% 03/15/32	2.875	100	85	13,292	2032/3/15
BRKHEC 2.85% 05/15/51	2.85	100	59	9,288	2051/5/15
BRKHEC 3.65% 04/15/29	3.65	100	92	14,477	2029/4/15
BRKHEC 3.7% 07/15/30	3.7	100	91	14,203	2030/7/15
BRKHEC 3.95% 08/01/47	3.95	100	75	11,802	2047/8/1
BRKHEC 4.45% 01/15/49	4.45	100	79	12,426	2049/1/15
BRKHEC 5.3% 02/01/55	5.3	100	92	14,408	2055/2/1
BRKHEC 5.35% 01/15/54	5.35	100	99	15,474	2034/1/15
BRO 4.2% 03/17/32	4.2	200	177	27,674	2032/3/17
BSX 1.9% 06/01/25	1.9	100	96	14,969	2025/6/1
BWA 5% 10/01/25	5.0	200	197	30,694	2025/10/1
BXP 3.25% 01/30/31	3.25	100	82	12,893	2031/1/30
BXP 3.4% 06/21/29	3.4	100	87	13,597	2029/6/21
BZLNZ 4.846% 02/07/28	4.846	250	244	38,062	2028/2/7
C 1.122% 01/28/27	1.122	100	92	14,363	2027/1/28
C 1.462% 06/09/27	1.462	100	91	14,248	2027/6/9
C 2.904% 11/03/42	2.904	100	68	10,594	2042/11/3
C 3.668% 07/24/28	3.668	100	94	14,661	2028/7/24
C 4.65% 07/23/48	4.65	200	169	26,409	2048/7/23

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
C 4.658% 05/24/28	4.658	200	194	30,356	2028/5/24
C 4.75% 05/18/46	4.75	100	83	13,070	2046/5/18
C 5.61% 09/29/26	5.61	100	99	15,546	2026/9/29
C 5.875% 01/30/42	5.875	300	301	46,980	2042/1/30
C 6.27% 11/17/33	6.27	200	204	31,907	2033/11/17
CABKSM 5.673% 03/15/30	5.673	200	196	30,616	2030/3/15
CABKSM 6.684% 09/13/27	6.684	200	202	31,562	2027/9/13
CAG 1.375% 11/01/27	1.375	100	86	13,477	2027/11/1
CAG 5.3% 10/01/26	5.3	200	198	30,943	2026/10/1
CAG 5.3% 11/01/38	5.3	100	91	14,213	2038/11/1
CARGIL 3.25% 05/23/29	3.25	100	91	14,283	2029/5/23
CAT 3.25% 04/09/50	3.25	100	69	10,830	2050/4/9
CAT 3.6% 08/12/27	3.6	100	95	14,852	2027/8/12
CAT 4.85% 02/27/29	4.85	200	197	30,716	2029/2/27
CB 1.375% 09/15/30	1.375	100	79	12,360	2030/9/15
CB 2.85% 12/15/51	2.85	100	63	9,831	2051/12/15
CBAAU 3.305% 03/11/41	3.305	200	140	21,913	2041/3/11
CBAAU 3.9% 03/16/28	3.9	200	192	29,919	2028/3/16
CCI 1.05% 07/15/26	1.05	100	90	14,102	2026/7/15
CCI 3.25% 01/15/51	3.25	100	63	9,961	2051/1/15
CCI 4.8% 09/01/28	4.8	100	96	14,998	2028/9/1
CDEL 5.125% 02/02/33	5.125	200	185	28,819	2033/2/2
CDEL 5.95% 01/08/34	5.95	200	194	30,236	2034/1/8
CDEL 6.44% 01/26/36	6.44	200	198	30,890	2036/1/26
CEG 3.25% 06/01/25	3.25	100	97	15,179	2025/6/1
CENEXP 1.169% 08/21/26	1.169	200	181	28,208	2026/8/21
CHD 5.6% 11/15/32	5.6	100	101	15,790	2032/11/15
CHH 3.7% 01/15/31	3.7	100	85	13,290	2031/1/15
CHTR 2.25% 01/15/29	2.25	100	83	12,977	2029/1/15
CHTR 3.5% 06/01/41	3.5	100	63	9,915	2041/6/1
CHTR 4.4% 04/01/33	4.4	100	85	13,249	2033/4/1
CHTR 5.5% 04/01/63	5.5	100	73	11,519	2063/4/1
CHTR 5.75% 04/01/48	5.75	100	79	12,456	2048/4/1
CI 1.25% 03/15/26	1.25	42	38	6,043	2026/3/15
CI 2.375% 03/15/31	2.375	100	81	12,703	2031/3/15
CI 4.8% 07/15/46	4.8	200	169	26,463	2046/7/15
CI 4.8% 08/15/38	4.8	100	89	13,921	2038/8/15
CITNAT 1.375% 05/06/26	1.375	200	183	28,638	2026/5/6
CL 4.8% 03/02/26	4.8	100	99	15,503	2026/3/2
CLR 5.75% 01/15/31	5.75	100	97	15,194	2031/1/15
CLX 1.8% 05/15/30	1.8	100	81	12,681	2030/5/15
CM 3.6% 04/07/32	3.6	100	87	13,631	2032/4/7
CMCSA 2.65% 02/01/30	2.65	100	86	13,488	2030/2/1
CMCSA 2.8% 01/15/51	2.8	100	59	9,265	2051/1/15
CMCSA 3.25% 11/01/39	3.25	100	73	11,513	2039/11/1
CMCSA 3.9% 03/01/38	3.9	100	82	12,870	2038/3/1
CMCSA 4% 03/01/48	4.0	100	76	11,871	2048/3/1
CMCSA 5.25% 11/07/25	5.25	100	99	15,556	2025/11/7
CMCSA 5.35% 05/15/53	5.35	100	92	14,427	2053/5/15
CMCSA 5.35% 11/15/27	5.35	200	201	31,312	2027/11/15
CMCSA 5.5% 05/15/64	5.5	100	92	14,470	2064/5/15

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
CME 4.15% 06/15/48	4.15	100	82	12,774	2048/6/15
CMS 4.75% 06/01/50	4.75	100	90	14,083	2050/6/1
CNA 2.05% 08/15/30	2.05	100	81	12,684	2030/8/15
CNC 4.625% 12/15/29	4.625	200	185	28,942	2029/12/15
CNP 1.45% 06/01/26	1.45	100	92	14,335	2026/6/1
CNP 2.65% 06/01/31	2.65	100	82	12,853	2031/6/1
CNQCN 2.95% 07/15/30	2.95	100	85	13,364	2030/7/15
CNRCN 2.45% 05/01/50	2.45	100	58	9,087	2050/5/1
COF 3.273% 03/01/30	3.273	100	88	13,743	2030/3/1
COF 4.927% 05/10/28	4.927	100	97	15,211	2028/5/10
COF 5.268% 05/10/33	5.268	100	94	14,739	2033/5/10
COF 5.7% 02/01/30	5.7	200	197	30,724	2030/2/1
COP 3.8% 03/15/52	3.8	100	73	11,400	2052/3/15
COP 4.875% 10/01/47	4.875	300	267	41,636	2047/10/1
COST 1.375% 06/20/27	1.375	100	89	13,920	2027/6/20
CP 3% 12/02/41	3.0	100	84	13,144	2041/12/2
CP 4.95% 08/15/45	4.95	100	87	13,687	2045/8/15
CPB 2.375% 04/24/30	2.375	100	83	13,068	2030/4/24
CPPIBC 3.25% 06/15/27	3.25	250	237	36,950	2027/6/15
CRM 1.5% 07/15/28	1.5	100	86	13,449	2028/7/15
CSCO 2.5% 09/20/26	2.5	100	94	14,677	2026/9/20
CSX 3.8% 03/01/28	3.8	100	95	14,824	2028/3/1
CSX 4.1% 11/15/32	4.1	100	91	14,226	2032/11/15
CSX 5.2% 11/15/33	5.2	200	197	30,695	2033/11/15
CVECN 2.65% 01/15/32	2.65	100	80	12,579	2032/1/15
CVS 1.75% 08/21/30	1.75	100	79	12,422	2030/8/21
CVS 4.125% 04/01/40	4.125	100	79	12,373	2040/4/1
CVS 4.78% 03/25/38	4.78	100	87	13,642	2038/3/25
CVS 5% 02/20/26	5.0	100	98	15,414	2026/2/20
CVS 5.125% 02/21/30	5.125	200	195	30,423	2030/2/21
CVS 5.125% 07/20/45	5.125	100	86	13,492	2045/7/20
CVS 6% 06/01/63	6.0	100	94	14,793	2063/6/1
CVX 1.554% 05/11/25	1.554	100	96	14,967	2025/5/11
CVX 6% 03/01/41	6.0	100	105	16,454	2041/3/1
D 2.4% 03/30/32	2.4	100	80	12,467	2032/3/30
D 3.3% 04/15/41	3.3	100	71	11,079	2041/4/15
D 3.5% 03/15/27	3.5	100	94	14,782	2027/3/15
D 5.45% 04/01/53	5.45	200	186	29,070	2053/4/1
DAL 7% 05/01/25	7.0	100	100	15,695	2025/5/1
DANBNK 4.298% 04/01/28	4.298	200	191	29,790	2028/4/1
DB 4.875% 12/01/32	4.875	200	183	28,652	2032/12/1
DB 6.119% 07/14/26	6.119	150	149	23,359	2026/7/14
DB 7.146% 07/13/27	7.146	300	305	47,662	2027/7/13
DBSSP 1.822% 03/10/31	1.822	200	185	28,950	2031/3/10
DD 4.725% 11/15/28	4.725	100	97	15,259	2028/11/15
DE 0.7% 01/15/26	0.7	100	92	14,437	2026/1/15
DE 2% 06/17/31	2.0	100	80	12,567	2031/6/17
DE 3.1% 04/15/30	3.1	100	89	13,915	2030/4/15
DE 4.75% 01/20/28	4.75	300	295	46,073	2028/1/20
DELL 3.45% 12/15/51	3.45	37	24	3,772	2051/12/15
DFS 4.5% 01/30/26	4.5	100	97	15,192	2026/1/30

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)	
DG 4.125% 04/03/50	4.125	100	73	11,449	2050/4/3
DGELN 5.2% 10/24/25	5.2	200	199	31,079	2025/10/24
DGX 2.8% 06/30/31	2.8	100	83	12,985	2031/6/30
DHR 3.25% 11/15/39	3.25	100	76	11,922	2039/11/15
DIS 1.75% 01/13/26	1.75	200	188	29,355	2026/1/13
DIS 2.75% 09/01/49	2.75	100	61	9,603	2049/9/1
DIS 3.5% 05/13/40	3.5	100	77	12,085	2040/5/13
DIS 3.6% 01/13/51	3.6	100	72	11,274	2051/1/13
DIS 3.7% 03/23/27	3.7	100	96	14,994	2027/3/23
DIS 6.2% 12/15/34	6.2	100	106	16,627	2034/12/15
DKS 4.1% 01/15/52	4.1	100	67	10,534	2052/1/15
DLTR 4.2% 05/15/28	4.2	100	95	14,811	2028/5/15
DNBNO 1.535% 05/25/27	1.535	200	183	28,608	2027/5/25
DOW 3.6% 11/15/50	3.6	100	68	10,660	2050/11/15
DOW 6.3% 03/15/33	6.3	100	104	16,264	2033/3/15
DT 4.375% 06/21/28	4.375	150	144	22,432	2028/6/21
DT 4.75% 06/21/38	4.75	150	136	21,226	2038/6/21
DTE 3% 03/01/32	3.0	100	84	13,130	2032/3/1
DTE 5.4% 04/01/53	5.4	100	94	14,784	2053/4/1
DUK 3.25% 08/15/25	3.25	100	97	15,158	2025/8/15
DUK 3.3% 06/15/41	3.3	200	140	21,910	2041/6/15
DUK 3.64% 11/01/46	3.64	100	68	10,698	2046/11/1
DUK 3.7% 09/01/28	3.7	100	93	14,627	2028/9/1
DUK 5% 08/15/52	5.0	100	84	13,218	2052/8/15
DUK 5.25% 03/15/33	5.25	100	98	15,273	2033/3/15
DUK 5.25% 04/01/33	5.25	100	97	15,168	2033/4/1
DUK 5.35% 01/15/53	5.35	200	185	28,839	2053/1/15
DVN 4.5% 01/15/30	4.5	100	94	14,713	2030/1/15
EBAY 1.4% 05/10/26	1.4	100	92	14,348	2026/5/10
EBAY 3.65% 05/10/51	3.65	100	70	10,919	2051/5/10
ECL 3.95% 12/01/47	3.95	100	79	12,363	2047/12/1
ECL 5.25% 01/15/28	5.25	200	200	31,231	2028/1/15
EDF 4.875% 09/21/38	4.875	200	172	26,894	2038/9/21
EDF 5.7% 05/23/28	5.7	200	200	31,262	2028/5/23
EDF 6.9% 05/23/53	6.9	200	208	32,489	2053/5/23
EFX 2.35% 09/15/31	2.35	100	79	12,455	2031/9/15
EIX 2.25% 06/01/30	2.25	100	83	12,928	2030/6/1
EIX 4.125% 03/01/48	4.125	100	76	11,852	2048/3/1
EIX 4.9% 06/01/26	4.9	200	197	30,746	2026/6/1
EIX 5.2% 06/01/34	5.2	200	190	29,664	2034/6/1
EIX 5.95% 11/01/32	5.95	100	101	15,827	2032/11/1
EL 4.375% 05/15/28	4.375	200	194	30,261	2028/5/15
ELV 4.75% 02/15/33	4.75	100	94	14,696	2033/2/15
ELV 4.9% 02/08/26	4.9	100	98	15,390	2026/2/8
ELV 5.125% 02/15/53	5.125	100	89	13,955	2053/2/15
EMN 5.75% 03/08/33	5.75	100	98	15,369	2033/3/8
EMR 2.2% 12/21/31	2.2	100	81	12,678	2031/12/21
ENBCN 3.4% 08/01/51	3.4	100	65	10,175	2051/8/1
ENBCN 5.7% 03/08/33	5.7	100	98	15,364	2033/3/8
ENELIM 1.875% 07/12/28	1.875	200	173	26,996	2028/7/12
ENELIM 2.875% 07/12/41	2.875	200	127	19,926	2041/7/12
ENELIM 4.75% 05/25/47	4.75	200	163	25,431	2047/5/25
ENIIM 4.25% 05/09/29	4.25	200	188	29,434	2029/5/9
EOG 4.375% 04/15/30	4.375	100	95	14,877	2030/4/15
EPD 3.7% 01/31/51	3.7	100	71	11,167	2051/1/31
EPD 3.7% 02/15/26	3.7	100	97	15,148	2026/2/15
EPD 4.25% 02/15/48	4.25	100	80	12,479	2048/2/15
EPD 7.55% 04/15/38	7.55	100	115	17,967	2038/4/15
EQH 4.35% 04/20/28	4.35	100	95	14,841	2028/4/20
EQH 5% 04/20/48	5.0	100	85	13,376	2048/4/20
EQIX 1% 09/15/25	1.0	100	93	14,575	2025/9/15
EQIX 2.5% 05/15/31	2.5	100	81	12,677	2031/5/15
EQNR 3.625% 04/06/40	3.625	100	79	12,320	2040/4/6
EQNR 3.7% 04/06/50	3.7	200	147	22,937	2050/4/6
EQR 1.85% 08/01/31	1.85	100	79	12,362	2031/8/1
ES 3.45% 01/15/50	3.45	100	65	10,212	2050/1/15
ES 4.75% 05/15/26	4.75	100	98	15,309	2026/5/15
ES 5.45% 03/01/28	5.45	100	99	15,443	2028/3/1
ET 4.15% 09/15/29	4.15	100	93	14,493	2029/9/15
ET 5.55% 02/15/28	5.55	100	99	15,565	2028/2/15
ET 5.75% 02/15/33	5.75	100	98	15,364	2033/2/15
ET 5.8% 06/15/38	5.8	100	95	14,910	2038/6/15
ET 6% 06/15/48	6.0	100	93	14,640	2048/6/15
ET 6.05% 12/01/26	6.05	200	202	31,540	2026/12/1
ETR 1.9% 06/15/28	1.9	100	86	13,514	2028/6/15
ETR 2.4% 06/15/31	2.4	100	80	12,585	2031/6/15
EXC 3.35% 03/15/32	3.35	100	85	13,293	2032/3/15
EXC 4.1% 03/15/52	4.1	100	74	11,672	2052/3/15
EXC 5.15% 03/15/28	5.15	100	98	15,370	2028/3/15
EXPE 4.625% 08/01/27	4.625	200	194	30,221	2027/8/1
F 6.95% 06/10/26	6.95	200	202	31,605	2026/6/10
F 7.35% 03/06/30	7.35	200	208	32,431	2030/3/6
F 7.35% 11/04/27	7.35	400	413	64,481	2027/11/4
FANG 4.4% 03/24/51	4.4	100	78	12,188	2051/3/24
FCX 4.125% 03/01/28	4.125	100	93	14,638	2028/3/1
FCX 4.25% 03/01/30	4.25	100	92	14,379	2030/3/1
FDX 2.4% 05/15/31	2.4	100	82	12,866	2031/5/15
FDX 3.1% 08/05/29	3.1	100	89	13,975	2029/8/5
FDX 3.25% 05/15/41	3.25	200	141	21,977	2041/5/15
FDX 4.05% 02/15/48	4.05	100	74	11,603	2048/2/15
FE 4.55% 11/15/30	4.55	100	91	14,326	2030/11/15
FI 5.6% 03/02/33	5.6	100	98	15,372	2033/3/2
FIS 2.25% 03/01/31	2.25	100	81	12,757	2031/3/1
FIS 3.1% 03/01/41	3.1	100	69	10,784	2041/3/1
FISV 5.45% 03/02/28	5.45	100	99	15,510	2028/3/2
FITB 1.707% 11/01/27	1.707	100	90	14,073	2027/11/1
FITB 4.772% 07/28/30	4.772	100	94	14,686	2030/7/28
FLEX 6% 01/15/28	6.0	100	100	15,599	2028/1/15
FMC 3.45% 10/01/29	3.45	100	88	13,769	2029/10/1
FMC 5.15% 05/18/26	5.15	100	98	15,393	2026/5/18
FNF 2.45% 03/15/31	2.45	100	79	12,432	2031/3/15
FOXA 4.709% 01/25/29	4.709	100	96	15,028	2029/1/25

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
FUKOKU 6.8% PERP	6.8	200	204	31,922	－
GD 2.85% 06/01/41	2.85	100	69	10,859	2041/6/1
GD 4.25% 04/01/40	4.25	100	85	13,325	2040/4/1
GE 4.35% 05/01/50	4.35	100	81	12,713	2050/5/1
GE 4.5% 03/11/44	4.5	100	85	13,326	2044/3/11
GEHC 5.857% 03/15/30	5.857	100	101	15,791	2030/3/15
GILD 1.2% 10/01/27	1.2	100	87	13,649	2027/10/1
GILD 2.8% 10/01/50	2.8	100	60	9,434	2050/10/1
GILD 5.25% 10/15/33	5.25	200	196	30,642	2033/10/15
GIS 4.95% 03/29/33	4.95	100	95	14,879	2033/3/29
GIS 5.5% 10/17/28	5.5	100	100	15,620	2028/10/17
GLENLN 1.625% 04/27/26	1.625	100	92	14,388	2026/4/27
GLW 5.45% 11/15/79	5.45	100	88	13,716	2079/11/15
GM 1.25% 01/08/26	1.25	200	185	28,960	2026/1/8
GM 3.1% 01/12/32	3.1	100	82	12,787	2032/1/12
GM 5% 04/09/27	5.0	100	98	15,306	2027/4/9
GM 5.25% 03/01/26	5.25	100	99	15,446	2026/3/1
GM 5.4% 04/01/48	5.4	100	86	13,547	2048/4/1
GM 5.4% 10/15/29	5.4	100	98	15,288	2029/10/15
GMT 3.5% 06/01/32	3.5	100	84	13,188	2032/6/1
GMT 4% 06/30/30	4.0	100	90	14,154	2030/6/30
GMT 5.45% 09/15/33	5.45	100	95	14,937	2033/9/15
GOOGL 1.9% 08/15/40	1.9	100	63	9,868	2040/8/15
GOOGL 2.05% 08/15/50	2.05	100	55	8,626	2050/8/15
GPN 1.2% 03/01/26	1.2	200	184	28,754	2026/3/1
GPN 4.95% 08/15/27	4.95	100	98	15,265	2027/8/15
GPN 5.95% 08/15/52	5.95	100	94	14,775	2052/8/15
GS 1.431% 03/09/27	1.431	400	369	57,545	2027/3/9
GS 2.6% 02/07/30	2.6	100	85	13,323	2030/2/7
GS 3.102% 02/24/33	3.102	200	165	25,823	2033/2/24
GS 3.8% 03/15/30	3.8	200	182	28,459	2030/3/15
GS 3.85% 01/26/27	3.85	100	95	14,940	2027/1/26
GS 4.411% 04/23/39	4.411	100	85	13,362	2039/4/23
GS 4.482% 08/23/28	4.482	500	482	75,181	2028/8/23
GS 6.75% 10/01/37	6.75	100	105	16,367	2037/10/1
GSK 3.375% 06/01/29	3.375	100	92	14,398	2029/6/1
HAL 2.92% 03/01/30	2.92	200	175	27,302	2030/3/1
HAS 3.55% 11/19/26	3.55	100	94	14,752	2026/11/19
HBAN 4.443% 08/04/28	4.443	100	95	14,922	2028/8/4
HCA 2.375% 07/15/31	2.375	100	79	12,448	2031/7/15
HCA 3.125% 03/15/27	3.125	200	187	29,145	2027/3/15
HCA 4.375% 03/15/42	4.375	100	79	12,341	2042/3/15
HCA 5.6% 04/01/34	5.6	200	194	30,276	2034/4/1
HCA 5.625% 09/01/28	5.625	100	99	15,488	2028/9/1
HD 0.9% 03/15/28	0.9	100	85	13,331	2028/3/15
HD 3.3% 04/15/40	3.3	100	75	11,767	2040/4/15
HD 3.625% 04/15/52	3.625	100	71	11,185	2052/4/15
HD 4% 09/15/25	4.0	100	98	15,298	2025/9/15
HES 5.8% 04/01/47	5.8	100	97	15,145	2047/4/1
HIG 4.4% 03/15/48	4.4	100	81	12,724	2048/3/15
HNDA 1.8% 01/13/31	1.8	100	80	12,535	2031/1/13

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)	
HNDA 4.7% 01/12/28	4.7	100	98	15,275	2028/1/12
HNDA 4.75% 01/12/26	4.75	100	98	15,416	2026/1/12
HON 2.5% 11/01/26	2.5	100	93	14,621	2026/11/1
HON 4.5% 01/15/34	4.5	300	281	43,822	2034/1/15
HPQ 4% 04/15/29	4.0	100	93	14,537	2029/4/15
HSBC 6.161% 03/09/29	6.161	200	202	31,479	2029/3/9
HSBC 6.5% 09/15/37	6.5	100	100	15,677	2037/9/15
HSBC 7.336% 11/03/26	7.336	200	204	31,859	2026/11/3
HSY 2.65% 06/01/50	2.65	100	60	9,408	2050/6/1
HUM 5.7% 03/13/26	5.7	100	99	15,573	2026/3/13
HYNMTR 1.5% 06/15/26	1.5	100	91	14,265	2026/6/15
HYNMTR 5.8% 04/01/30	5.8	100	99	15,550	2030/4/1
HYUELE 1.5% 01/19/26	1.5	200	185	28,923	2026/1/19
IBM 3.5% 05/15/29	3.5	100	91	14,320	2029/5/15
IBM 4.15% 07/27/27	4.15	100	96	15,037	2027/7/27
IBM 4.5% 02/06/26	4.5	100	98	15,387	2026/2/6
IBM 4.5% 02/06/28	4.5	200	195	30,389	2028/2/6
IBM 4.75% 02/06/33	4.75	100	95	14,833	2033/2/6
IBM 5.1% 02/06/53	5.1	100	90	14,094	2053/2/6
ICE 2.65% 09/15/40	2.65	100	67	10,581	2040/9/15
ICE 5.2% 06/15/62	5.2	100	90	14,086	2062/6/15
IFCCN 5.459% 09/22/32	5.459	100	97	15,138	2032/9/22
IFF 1.23% 10/01/25	1.23	100	93	14,576	2025/10/1
IFF 3.268% 11/15/40	3.268	100	67	10,546	2040/11/15
IMBLN 3.875% 07/26/29	3.875	200	183	28,547	2029/7/26
INTC 2.45% 11/15/29	2.45	100	86	13,447	2029/11/15
INTC 4.875% 02/10/26	4.875	100	99	15,441	2026/2/10
INTC 5.2% 02/10/33	5.2	100	97	15,231	2033/2/10
INTC 5.625% 02/10/43	5.625	100	97	15,129	2043/2/10
INTC 5.7% 02/10/53	5.7	100	95	14,903	2053/2/10
IPG 3.375% 03/01/41	3.375	100	70	11,018	2041/3/1
ISPIM 7% 11/21/25	7.0	200	202	31,563	2025/11/21
ISPIM 8.248% 11/21/33	8.248	200	216	33,728	2033/11/21
J 5.9% 03/01/33	5.9	100	98	15,398	2033/3/1
J 6.35% 08/18/28	6.35	200	203	31,647	2028/8/18
JAPTOB 2.25% 09/14/31	2.25	200	160	24,950	2031/9/14
JBL 1.7% 04/15/26	1.7	200	185	28,871	2026/4/15
JCI 4.5% 02/15/47	4.5	100	80	12,588	2047/2/15
JD 3.375% 01/14/30	3.375	200	179	27,908	2030/1/14
JEF 2.625% 10/15/31	2.625	100	78	12,297	2031/10/15
JEF 2.75% 10/15/32	2.75	200	155	24,195	2032/10/15
JNJ 0.55% 09/01/25	0.55	100	94	14,664	2025/9/1
JNJ 1.3% 09/01/30	1.3	200	160	25,070	2030/9/1
JNJ 2.1% 09/01/40	2.1	100	64	10,079	2040/9/1
JPM 1.04% 02/04/27	1.04	200	184	28,713	2027/2/4
JPM 1.47% 09/22/27	1.47	100	90	14,123	2027/9/22
JPM 2.963% 01/25/33	2.963	200	166	25,887	2033/1/25
JPM 3.157% 04/22/42	3.157	200	143	22,383	2042/4/22
JPM 3.782% 02/01/28	3.782	100	95	14,867	2028/2/1
JPM 3.897% 01/23/49	3.897	400	304	47,366	2049/1/23
JPM 3.96% 01/29/27	3.96	400	388	60,496	2027/1/29

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)	
JPM 4.26% 02/22/48	4.26	200	161	25,082	2048/2/22
JPM 4.323% 04/26/28	4.323	300	289	45,149	2028/4/26
JPM 4.565% 06/14/30	4.565	100	95	14,872	2030/6/14
JPM 5.625% 08/16/43	5.625	200	197	30,724	2043/8/16
K 5.25% 03/01/33	5.25	100	97	15,151	2033/3/1
KD 4.1% 10/15/41	4.1	100	72	11,367	2041/10/15
KDP 3.95% 04/15/29	3.95	100	93	14,549	2029/4/15
KEY 4.7% 01/26/26	4.7	250	243	37,898	2026/1/26
KHC 4.875% 10/01/49	4.875	100	85	13,283	2049/10/1
KHC 6.5% 02/09/40	6.5	100	104	16,279	2040/2/9
KIM 1.9% 03/01/28	1.9	100	87	13,604	2028/3/1
KLAC 5% 03/15/49	5.0	100	90	14,118	2049/3/15
KMB 3.2% 04/25/29	3.2	100	91	14,247	2029/4/25
KMI 1.75% 11/15/26	1.75	100	91	14,208	2026/11/15
KMI 3.6% 02/15/51	3.6	200	131	20,528	2051/2/15
KMI 5.2% 03/01/48	5.2	100	86	13,418	2048/3/1
KMI 5.2% 06/01/33	5.2	100	95	14,821	2033/6/1
KO 1.375% 03/15/31	1.375	100	78	12,243	2031/3/15
KO 1.45% 06/01/27	1.45	100	90	14,029	2027/6/1
KO 2.5% 06/01/40	2.5	100	68	10,633	2040/6/1
KO 3% 03/05/51	3.0	100	65	10,279	2051/3/5
KO 3.375% 03/25/27	3.375	100	95	14,951	2027/3/25
KOROIL 4.75% 04/03/26	4.75	200	197	30,693	2026/4/3
KR 4.45% 02/01/47	4.45	100	80	12,483	2047/2/1
LH 2.95% 12/01/29	2.95	100	87	13,661	2029/12/1
LHX 1.8% 01/15/31	1.8	100	78	12,298	2031/1/15
LIN 1.1% 08/10/30	1.1	100	79	12,334	2030/8/10
LIN 2% 08/10/50	2.0	100	51	8,097	2050/8/10
LLOYDS 4.716% 08/11/26	4.716	400	393	61,345	2026/8/11
LLY 3.375% 03/15/29	3.375	100	92	14,466	2029/3/15
LLY 4.15% 03/15/59	4.15	100	79	12,336	2059/3/15
LLY 5.1% 02/09/64	5.1	200	185	28,819	2064/2/9
LMT 4.95% 10/15/25	4.95	200	199	31,028	2025/10/15
LMT 5.2% 02/15/64	5.2	200	184	28,743	2064/2/15
LMT 5.7% 11/15/54	5.7	100	100	15,675	2054/11/15
LNC 4.35% 03/01/48	4.35	100	73	11,459	2048/3/1
LNG 5.65% 04/15/34	5.65	200	194	30,310	2034/4/15
LOW 2.8% 09/15/41	2.8	200	134	20,900	2041/9/15
LOW 4.05% 05/03/47	4.05	100	75	11,736	2047/5/3
LOW 5.15% 07/01/33	5.15	100	97	15,187	2033/7/1
LOW 5.625% 04/15/53	5.625	100	94	14,760	2053/4/15
LOW 5.75% 07/01/53	5.75	200	193	30,135	2053/7/1
LRCX 4% 03/15/29	4.0	100	94	14,787	2029/3/15
LUV 5.125% 06/15/27	5.125	100	98	15,366	2027/6/15
LYB 3.375% 10/01/40	3.375	100	71	11,103	2040/10/1
LYB 4.2% 05/01/50	4.2	100	74	11,557	2050/5/1
MA 2.95% 03/15/51	2.95	100	64	10,122	2051/3/15
MA 3.3% 03/26/27	3.3	100	94	14,790	2027/3/26
MA 3.95% 02/26/48	3.95	100	79	12,403	2048/2/26
MAERSK 4.5% 06/20/29	4.5	100	96	14,975	2029/6/20
MAR 2.75% 10/15/33	2.75	200	157	24,499	2033/10/15

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
MAR 4.625% 06/15/30	4.625	100	94	14,784	2030/6/15
MARUB 1.577% 09/17/26	1.577	200	181	28,266	2026/9/17
MBGGR 5.375% 11/26/25	5.375	150	149	23,340	2025/11/26
MCD 2.125% 03/01/30	2.125	100	84	13,084	2030/3/1
MCD 3.5% 07/01/27	3.5	100	94	14,766	2027/7/1
MCD 3.625% 09/01/49	3.625	100	71	11,076	2049/9/1
MCD 4.2% 04/01/50	4.2	100	78	12,181	2050/4/1
MCD 4.6% 09/09/32	4.6	100	95	14,816	2032/9/9
MCK 5.25% 02/15/26	5.25	100	99	15,536	2026/2/15
MCO 2.75% 08/19/41	2.75	100	67	10,440	2041/8/19
MDLZ 1.5% 02/04/31	1.5	100	77	12,080	2031/2/4
MDLZ 2.625% 03/17/27	2.625	100	92	14,460	2027/3/17
MDT 4.25% 03/30/28	4.25	100	96	15,034	2028/3/30
MDT 4.375% 03/15/35	4.375	100	91	14,295	2035/3/15
MET 5% 01/06/26	5.0	150	148	23,192	2026/1/6
MET 5.25% 01/15/54	5.25	200	184	28,811	2054/1/15
META 4.6% 05/15/28	4.6	100	98	15,300	2028/5/15
META 4.65% 08/15/62	4.65	100	82	12,877	2062/8/15
META 5.6% 05/15/53	5.6	100	98	15,358	2053/5/15
MFCCN 3.703% 03/16/32	3.703	100	89	13,939	2032/3/16
MITCO 1.125% 07/15/26	1.125	200	181	28,346	2026/7/15
MITHCC 3.967% 04/13/30	3.967	200	181	28,277	2030/4/13
MITHCC 5.08% 09/15/27	5.08	200	197	30,709	2027/9/15
MIZUHO 2.564% 09/13/31	2.564	200	158	24,743	2031/9/13
MIZUHO 5.414% 09/13/28	5.414	200	199	31,000	2028/9/13
MKC 0.9% 02/15/26	0.9	100	92	14,378	2026/2/15
MKC 2.5% 04/15/30	2.5	100	84	13,167	2030/4/15
MKL 5% 05/20/49	5.0	100	86	13,407	2049/5/20
MLM 4.25% 12/15/47	4.25	100	79	12,335	2047/12/15
MMC 4.2% 03/01/48	4.2	100	79	12,308	2048/3/1
MMC 4.75% 03/15/39	4.75	100	90	14,108	2039/3/15
MMM 2.375% 08/26/29	2.375	200	171	26,669	2029/8/26
MO 3.4% 02/04/41	3.4	100	69	10,864	2041/2/4
MO 4.4% 02/14/26	4.4	100	98	15,273	2026/2/14
MO 5.8% 02/14/39	5.8	100	97	15,161	2039/2/14
MO 5.95% 02/14/49	5.95	100	95	14,932	2049/2/14
MPC 3.8% 04/01/28	3.8	100	94	14,673	2028/4/1
MPLX 2.65% 08/15/30	2.65	100	83	13,071	2030/8/15
MPLX 4.5% 04/15/38	4.5	200	170	26,508	2038/4/15
MPLX 5.2% 12/01/47	5.2	100	86	13,526	2047/12/1
MQGAU 2.871% 01/14/33	2.871	100	80	12,597	2033/1/14
MQGAU 4.098% 06/21/28	4.098	100	95	14,879	2028/6/21
MRK 2.15% 12/10/31	2.15	200	161	25,221	2031/12/10
MRK 3.4% 03/07/29	3.4	100	92	14,438	2029/3/7
MRO 6.6% 10/01/37	6.6	200	202	31,532	2037/10/1
MRVL 5.75% 02/15/29	5.75	200	200	31,290	2029/2/15
MS 1.593% 05/04/27	1.593	200	184	28,696	2027/5/4
MS 2.475% 01/21/28	2.475	300	276	43,083	2028/1/21
MS 3.217% 04/22/42	3.217	100	72	11,251	2042/4/22
MS 3.622% 04/01/31	3.622	200	179	27,909	2031/4/1
MS 4.457% 04/22/39	4.457	100	87	13,559	2039/4/22

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
MS 4.679% 07/17/26	4.679	200	197	30,744	2026/7/17
MS 5.449% 07/20/29	5.449	200	198	30,926	2029/7/20
MS 5.597% 03/24/51	5.597	100	98	15,307	2051/3/24
MS 6.138% 10/16/26	6.138	100	100	15,658	2026/10/16
MS 6.296% 10/18/28	6.296	100	102	15,900	2028/10/18
MSCI 3.25% 08/15/33	3.25	100	79	12,423	2033/8/15
MSFT 1.35% 09/15/30	1.35	100	80	12,503	2030/9/15
MSFT 2.525% 06/01/50	2.525	200	121	18,985	2050/6/1
MSFT 2.921% 03/17/52	2.921	100	65	10,217	2052/3/17
MSFT 3.3% 02/06/27	3.3	100	95	14,935	2027/2/6
MSFT 4.1% 02/06/37	4.1	100	91	14,206	2037/2/6
MSI 5.6% 06/01/32	5.6	100	99	15,448	2032/6/1
MTB 6.082% 03/13/32	6.082	100	97	15,149	2032/3/13
MTNA 4.25% 07/16/29	4.25	100	93	14,615	2029/7/16
MTNA 4.55% 03/11/26	4.55	100	97	15,230	2026/3/11
MTNA 6.55% 11/29/27	6.55	100	102	15,966	2027/11/29
MU 4.185% 02/15/27	4.185	100	96	15,054	2027/2/15
MU 5.875% 09/15/33	5.875	100	100	15,617	2033/9/15
MUFG 4.286% 07/26/38	4.286	100	87	13,673	2038/7/26
MUFG 4.7% 03/10/44	4.7	200	172	26,803	2044/3/10
MUFG 5.133% 07/20/33	5.133	200	193	30,133	2033/7/20
MUNRE 5.875% 05/23/42	5.875	200	198	30,942	2042/5/23
MYLIFE 5.1% 04/26/48	5.1	200	194	30,363	2048/4/26
NAB 4.966% 01/12/26	4.966	250	248	38,710	2026/1/12
NDAQ 1.65% 01/15/31	1.65	100	78	12,188	2031/1/15
NDAQ 5.35% 06/28/28	5.35	200	198	30,956	2028/6/28
NDASS 4.75% 09/22/25	4.75	200	197	30,835	2025/9/22
NEE 1.875% 01/15/27	1.875	100	90	14,154	2027/1/15
NEE 2.45% 02/03/32	2.45	100	81	12,720	2032/2/3
NEE 3.95% 03/01/48	3.95	100	76	11,988	2048/3/1
NEE 5.05% 04/01/28	5.05	100	99	15,484	2028/4/1
NEE 5.25% 02/28/53	5.25	100	89	13,932	2053/2/28
NEM 5.875% 04/01/35	5.875	100	100	15,688	2035/4/1
NESNVX 4% 09/24/48	4.0	150	118	18,469	2048/9/24
NESNVX 4.95% 03/14/30	4.95	150	148	23,116	2030/3/14
NESNVX 5.25% 03/13/26	5.25	150	150	23,368	2026/3/13
NFG 5.5% 01/15/26	5.5	100	99	15,475	2026/1/15
NFLX 4.875% 06/15/30	4.875	100	96	15,096	2030/6/15
NFLX 5.875% 11/15/28	5.875	100	101	15,885	2028/11/15
NI 0.95% 08/15/25	0.95	100	94	14,655	2025/8/15
NI 4.375% 05/15/47	4.375	100	78	12,290	2047/5/15
NIPLIF 2.75% 01/21/51	2.75	200	163	25,451	2051/1/21
NIPLIF 2.9% 09/16/51	2.9	200	161	25,197	2051/9/16
NKE 3.25% 03/27/40	3.25	100	76	11,863	2040/3/27
NKE 3.375% 03/27/50	3.375	100	70	10,977	2050/3/27
NNN 3.5% 04/15/51	3.5	100	67	10,456	2051/4/15
NOC 5.15% 05/01/40	5.15	100	93	14,554	2040/5/1
NOMURA 1.653% 07/14/26	1.653	200	182	28,475	2026/7/14
NOMURA 5.605% 07/06/29	5.605	200	198	30,846	2029/7/6
NOMURA 6.087% 07/12/33	6.087	200	204	31,897	2033/7/12
NOV 3.6% 12/01/29	3.6	100	89	14,007	2029/12/1

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
NOVNVX 2% 02/14/27	2.0	100	92	14,375	2027/2/14
NOVNVX 2.2% 08/14/30	2.2	100	84	13,143	2030/8/14
NRG 2.45% 12/02/27	2.45	100	89	13,902	2027/12/2
NRUC 2.75% 04/15/32	2.75	200	164	25,628	2032/4/15
NRUC 4.3% 03/15/49	4.3	100	79	12,434	2049/3/15
NSC 3% 03/15/32	3.0	100	84	13,142	2032/3/15
NSC 4.15% 02/28/48	4.15	100	77	12,113	2048/2/28
NTRCN 5.8% 03/27/53	5.8	100	95	14,944	2053/3/27
NTRS 3.65% 08/03/28	3.65	100	94	14,666	2028/8/3
NTT 2.065% 04/03/31	2.065	200	161	25,094	2031/4/3
NUE 3.85% 04/01/52	3.85	100	74	11,555	2052/4/1
NVDA 3.5% 04/01/50	3.5	100	73	11,466	2050/4/1
NWG 5.516% 09/30/28	5.516	200	197	30,837	2028/9/30
NWIDE 4.85% 07/27/27	4.85	200	196	30,537	2027/7/27
OC 3.95% 08/15/29	3.95	100	92	14,478	2029/8/15
OGS 4.25% 09/01/32	4.25	100	92	14,393	2032/9/1
OHI 3.625% 10/01/29	3.625	100	87	13,631	2029/10/1
OKE 5.2% 07/15/48	5.2	100	86	13,444	2048/7/15
OKE 6.1% 11/15/32	6.1	100	101	15,754	2032/11/15
OMC 2.6% 08/01/31	2.6	100	82	12,830	2031/8/1
ORCL 1.65% 03/25/26	1.65	200	185	28,960	2026/3/25
ORCL 2.875% 03/25/31	2.875	200	168	26,269	2031/3/25
ORCL 3.65% 03/25/41	3.65	200	148	23,100	2041/3/25
ORCL 4.1% 03/25/61	4.1	100	69	10,821	2061/3/25
ORCL 4.5% 05/06/28	4.5	100	96	15,095	2028/5/6
ORCL 4.9% 02/06/33	4.9	100	94	14,760	2033/2/6
ORCL 6.9% 11/09/52	6.9	100	107	16,789	2052/11/9
ORIX 2.25% 03/09/31	2.25	100	82	12,784	2031/3/9
ORIX 5% 09/13/27	5.0	100	98	15,354	2027/9/13
OTIS 3.112% 02/15/40	3.112	100	72	11,279	2040/2/15
OXY 5.5% 12/01/25	5.5	100	99	15,512	2025/12/1
OXY 6.45% 09/15/36	6.45	100	102	15,978	2036/9/15
OXY 6.6% 03/15/46	6.6	100	102	15,959	2046/3/15
PARA 4.95% 01/15/31	4.95	100	86	13,548	2031/1/15
PCG 3.3% 08/01/40	3.3	100	69	10,828	2040/8/1
PCG 4.2% 06/01/41	4.2	200	153	23,857	2041/6/1
PCG 4.55% 07/01/30	4.55	100	92	14,451	2030/7/1
PCG 4.95% 07/01/50	4.95	100	80	12,599	2050/7/1
PCG 5.45% 06/15/27	5.45	200	198	30,937	2027/6/15
PCP 4.375% 06/15/45	4.375	100	84	13,101	2045/6/15
PEAK 2.125% 12/01/28	2.125	100	86	13,468	2028/12/1
PEAK 5.25% 12/15/32	5.25	200	192	29,926	2032/12/15
PEG 0.95% 03/15/26	0.95	100	92	14,404	2026/3/15
PEG 4.05% 05/01/48	4.05	100	79	12,313	2048/5/1
PEG 5.2% 08/01/33	5.2	100	97	15,215	2033/8/1
PEP 1.95% 10/21/31	1.95	100	80	12,507	2031/10/21
PEP 3.6% 02/18/28	3.6	100	95	14,820	2028/2/18
PEP 4% 05/02/47	4.0	100	79	12,399	2047/5/2
PEP 4.65% 02/15/53	4.65	100	87	13,685	2053/2/15
PERTIJ 1.4% 02/09/26	1.4	200	184	28,775	2026/2/9
PERTIJ 2.3% 02/09/31	2.3	200	161	25,096	2031/2/9

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)	
PETMK 4.55% 04/21/50	4.55	200	165	25,805	2050/4/21
PFE 2.55% 05/28/40	2.55	100	67	10,521	2040/5/28
PFE 3.9% 03/15/39	3.9	100	82	12,841	2039/3/15
PFE 4% 03/15/49	4.0	100	78	12,207	2049/3/15
PFE 4.45% 05/19/26	4.45	200	196	30,627	2026/5/19
PFE 4.65% 05/19/30	4.65	100	96	15,041	2030/5/19
PFG 3.7% 05/15/29	3.7	100	91	14,313	2029/5/15
PFG 5.5% 03/15/53	5.5	200	184	28,671	2053/3/15
PG 1% 04/23/26	1.0	100	92	14,408	2026/4/23
PG 3.55% 03/25/40	3.55	100	80	12,572	2040/3/25
PGR 2.5% 03/15/27	2.5	100	92	14,460	2027/3/15
PH 4.5% 09/15/29	4.5	100	96	14,991	2029/9/15
PKG 4.05% 12/15/49	4.05	100	75	11,769	2049/12/15
PLD 4.75% 06/15/33	4.75	100	94	14,673	2033/6/15
PLD 4.875% 06/15/28	4.875	200	196	30,611	2028/6/15
PLD 5.25% 06/15/53	5.25	100	91	14,236	2053/6/15
PM 4.875% 02/13/26	4.875	100	99	15,440	2026/2/13
PM 5.375% 02/15/33	5.375	100	97	15,197	2033/2/15
PM 5.75% 11/17/32	5.75	200	200	31,220	2032/11/17
PNC 2.55% 01/22/30	2.55	100	85	13,270	2030/1/22
PNC 4.758% 01/26/27	4.758	100	98	15,354	2027/1/26
POHANG 5.75% 01/17/28	5.75	200	200	31,195	2028/1/17
POWFIN 3.95% 04/23/30	3.95	200	178	27,763	2030/4/23
PPG 2.55% 06/15/30	2.55	100	85	13,338	2030/6/15
PPL 4.125% 04/15/30	4.125	100	92	14,438	2030/4/15
PRU 1.5% 03/10/26	1.5	100	93	14,517	2026/3/10
PRU 3.935% 12/07/49	3.935	100	73	11,502	2049/12/7
PRU 6.75% 03/01/53	6.75	100	102	15,915	2053/3/1
PRUFIN 3.625% 03/24/32	3.625	200	175	27,411	2032/3/24
PSA 1.5% 11/09/26	1.5	100	91	14,183	2026/11/9
PSA 5.1% 08/01/33	5.1	100	96	15,052	2033/8/1
PSPCAP 1.625% 10/26/28	1.625	250	216	33,720	2028/10/26
PSX 3.3% 03/15/52	3.3	100	64	10,066	2052/3/15
PSX 4.68% 02/15/45	4.68	100	83	13,039	2045/2/15
PSX 4.95% 12/01/27	4.95	100	98	15,358	2027/12/1
PTTEPT 2.993% 01/15/30	2.993	200	175	27,391	2030/1/15
PXD 5.1% 03/29/26	5.1	100	99	15,460	2026/3/29
PYPL 4.4% 06/01/32	4.4	100	93	14,638	2032/6/1
QCOM 1.65% 05/20/32	1.65	100	76	11,908	2032/5/20
QCOM 6% 05/20/53	6.0	100	104	16,291	2053/5/20
R 2.85% 03/01/27	2.85	100	93	14,499	2027/3/1
R 3.35% 09/01/25	3.35	100	96	15,080	2025/9/1
RABOBK 1.106% 02/24/27	1.106	250	229	35,810	2027/2/24
RABOBK 4.655% 08/22/28	4.655	250	241	37,678	2028/8/22
RCICN 4.5% 03/15/42	4.5	200	163	25,525	2042/3/15
RDSALN 2.75% 04/06/30	2.75	100	87	13,656	2030/4/6
RDSALN 2.875% 11/26/41	2.875	100	69	10,856	2041/11/26
RDSALN 3.25% 04/06/50	3.25	200	134	20,944	2050/4/6
RECLIN 5.625% 04/11/28	5.625	200	198	30,884	2028/4/11
RGA 6% 09/15/33	6.0	100	100	15,625	2033/9/15
RILIN 3.625% 01/12/52	3.625	250	168	26,215	2052/1/12

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
RIOLN 5.125% 03/09/53	5.125	100	91	14,275	2053/3/9
ROP 1% 09/15/25	1.0	100	93	14,623	2025/9/15
ROSW 0.991% 03/05/26	0.991	200	185	28,849	2026/3/5
ROSW 2.076% 12/13/31	2.076	200	160	24,926	2031/12/13
RPRX 1.2% 09/02/25	1.2	100	94	14,666	2025/9/2
RPRX 2.2% 09/02/30	2.2	100	81	12,626	2030/9/2
RRX 6.05% 02/15/26	6.05	100	100	15,591	2026/2/15
RSG 5% 04/01/34	5.0	100	96	14,972	2034/4/1
RTX 1.9% 09/01/31	1.9	100	78	12,203	2031/9/1
RTX 4.35% 04/15/47	4.35	100	80	12,497	2047/4/15
RTX 5% 02/27/26	5.0	100	99	15,464	2026/2/27
RTX 5.75% 01/15/29	5.75	200	202	31,567	2029/1/15
RVTY 2.55% 03/15/31	2.55	100	82	12,819	2031/3/15
RY 1.2% 04/27/26	1.2	200	184	28,693	2026/4/27
RY 3.625% 05/04/27	3.625	100	95	14,825	2027/5/4
RY 4.875% 01/12/26	4.875	100	99	15,432	2026/1/12
RY 6% 11/01/27	6.0	100	102	15,897	2027/11/1
SANUK 6.534% 01/10/29	6.534	200	203	31,718	2029/1/10
SANUSA 6.499% 03/09/29	6.499	100	100	15,706	2029/3/9
SBUX 4.45% 08/15/49	4.45	100	81	12,651	2049/8/15
SBUX 4.8% 02/15/33	4.8	100	95	14,933	2033/2/15
SCHW 2.45% 03/03/27	2.45	100	92	14,352	2027/3/3
SCHW 3.25% 05/22/29	3.25	100	90	14,139	2029/5/22
SCHW 5.853% 05/19/34	5.853	100	99	15,441	2034/5/19
SF 4% 05/15/30	4.0	100	90	14,025	2030/5/15
SHBASS 1.418% 06/11/27	1.418	250	227	35,461	2027/6/11
SHBASS 3.95% 06/10/27	3.95	250	239	37,284	2027/6/10
SHW 2.3% 05/15/30	2.3	100	83	13,036	2030/5/15
SHW 3.45% 06/01/27	3.45	100	94	14,702	2027/6/1
SJM 2.75% 09/15/41	2.75	300	193	30,175	2041/9/15
SLB 2.65% 06/26/30	2.65	100	86	13,469	2030/6/26
SNA 4.1% 03/01/48	4.1	100	79	12,454	2048/3/1
SNX 1.75% 08/09/26	1.75	200	182	28,403	2026/8/9
SO 3.7% 04/30/30	3.7	100	90	14,096	2030/4/30
SO 3.7% 12/01/47	3.7	100	73	11,387	2047/12/1
SO 4.25% 07/01/36	4.25	100	86	13,424	2036/7/1
SO 4.65% 05/16/28	4.65	200	194	30,281	2028/5/16
SO 4.7% 05/15/32	4.7	100	94	14,691	2032/5/15
SOCGEN 3.653% 07/08/35	3.653	200	165	25,855	2035/7/8
SOCGEN 4.027% 01/21/43	4.027	200	135	21,049	2043/1/21
SOCGEN 6.447% 01/12/27	6.447	200	201	31,362	2027/1/12
SPG 1.375% 01/15/27	1.375	100	89	14,017	2027/1/15
SPG 2.45% 09/13/29	2.45	100	85	13,361	2029/9/13
SPG 3.8% 07/15/50	3.8	300	214	33,348	2050/7/15
SPGI 4.75% 08/01/28	4.75	100	97	15,240	2028/8/1
SPLLLC 5.9% 09/15/37	5.9	100	100	15,653	2037/9/15
SRE 3.7% 04/01/29	3.7	100	91	14,292	2029/4/1
SRE 4% 02/01/48	4.0	100	73	11,449	2048/2/1
SRE 5.35% 04/01/53	5.35	100	92	14,364	2053/4/1
STLD 1.65% 10/15/27	1.65	100	88	13,719	2027/10/15
STT 2.203% 02/07/28	2.203	100	91	14,298	2028/2/7

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
STT 5.104% 05/18/26	5.104	100	99	15,481	2026/5/18
STZ 2.25% 08/01/31	2.25	100	79	12,456	2031/8/1
STZ 4.1% 02/15/48	4.1	100	76	11,977	2048/2/15
STZ 4.35% 05/09/27	4.35	100	97	15,109	2027/5/9
SUCN 3.75% 03/04/51	3.75	100	69	10,776	2051/3/4
SUMI 5.55% 03/09/28	5.55	200	201	31,363	2028/3/9
SUMIBK 2.296% 01/12/41	2.296	200	129	20,157	2041/1/12
SUMIBK 3.784% 03/09/26	3.784	200	194	30,219	2026/3/9
SUMIBK 5.464% 01/13/26	5.464	200	199	31,089	2026/1/13
SUMIFL 5.353% 04/25/28	5.353	200	197	30,803	2028/4/25
SUMILF 3.375% 04/15/81	3.375	200	169	26,326	2081/4/15
SWK 6% 03/06/28	6.0	100	101	15,822	2028/3/6
SYK 1.15% 06/15/25	1.15	100	95	14,809	2025/6/15
SYK 1.95% 06/15/30	1.95	100	82	12,821	2030/6/15
SYY 6.6% 04/01/50	6.6	100	107	16,804	2050/4/1
T(AT&T) 05/15/35	4.5	100	89	13,929	2035/5/15
T(AT&T) 09/15/53	3.5	100	65	10,161	2053/9/15
T(AT&T) 1.7% 03/25/26	1.7	100	93	14,511	2026/3/25
T(AT&T) 2.25% 02/01/32	2.25	100	78	12,276	2032/2/1
T(AT&T) 2.55% 12/01/33	2.55	200	153	23,983	2033/12/1
T(AT&T) 3.65% 09/15/59	3.65	100	64	10,073	2059/9/15
T(AT&T) 3.8% 12/01/57	3.8	100	67	10,470	2057/12/1
T(AT&T) 4.35% 03/01/29	4.35	100	95	14,862	2029/3/1
T(AT&T) 4.85% 07/15/45	4.85	300	258	40,237	2045/7/15
T(AT&T) 4.9% 08/15/37	4.9	200	181	28,194	2037/8/15
TACHEM 5.25% 06/23/45	5.25	200	184	28,682	2045/6/23
TAISEM 1.75% 10/25/26	1.75	200	183	28,534	2026/10/25
TCKBCN 3.9% 07/15/30	3.9	100	90	14,050	2030/7/15
TD 4.108% 06/08/27	4.108	100	96	14,983	2027/6/8
TD 5.103% 01/09/26	5.103	100	99	15,522	2026/1/9
TD 5.532% 07/17/26	5.532	100	100	15,593	2026/7/17
TDY 2.25% 04/01/28	2.25	100	88	13,762	2028/4/1
TELEFO 5.52% 03/01/49	5.52	150	135	21,068	2049/3/1
TEMASE 2.375% 08/02/41	2.375	250	175	27,290	2041/8/2
TEMASE 2.75% 08/02/61	2.75	250	158	24,612	2061/8/2
TENCNT 1.81% 01/26/26	1.81	200	187	29,262	2026/1/26
TENCNT 3.975% 04/11/29	3.975	200	186	29,092	2029/4/11
TFC 1.95% 06/05/30	1.95	100	80	12,591	2030/6/5
TFC 4.873% 01/26/29	4.873	100	96	15,086	2029/1/26
TFC 5.9% 10/28/26	5.9	100	99	15,567	2026/10/28
TGT 1.95% 01/15/27	1.95	100	92	14,363	2027/1/15
TGT 4.8% 01/15/53	4.8	300	266	41,520	2053/1/15
TMUS 2.05% 02/15/28	2.05	200	176	27,490	2028/2/15
TMUS 2.25% 02/15/26	2.25	100	94	14,684	2026/2/15
TMUS 3.375% 04/15/29	3.375	100	90	14,135	2029/4/15
TMUS 3.6% 11/15/60	3.6	100	65	10,150	2060/11/15
TMUS 4.5% 04/15/50	4.5	200	162	25,252	2050/4/15
TMUS 5.2% 01/15/33	5.2	100	96	15,091	2033/1/15
TMUS 5.75% 01/15/54	5.75	100	96	15,072	2054/1/15
TOYOTA 1.125% 06/18/26	1.125	200	183	28,555	2026/6/18
TOYOTA 1.9% 09/12/31	1.9	100	79	12,352	2031/9/12
TOYOTA 3.05% 03/22/27	3.05	100	94	14,669	2027/3/22
TOYOTA 3.375% 04/01/30	3.375	100	90	14,071	2030/4/1
TPR 7.85% 11/27/33	7.85	200	207	32,345	2033/11/27
TRPCN 4.75% 05/15/38	4.75	100	87	13,612	2038/5/15
TRV 4.05% 03/07/48	4.05	100	78	12,287	2048/3/7
TSN 4.35% 03/01/29	4.35	100	94	14,763	2029/3/1
TTEFP 2.986% 06/29/41	2.986	100	70	11,029	2041/6/29
TTEFP 3.386% 06/29/60	3.386	100	65	10,168	2060/6/29
TTEFP 3.455% 02/19/29	3.455	100	92	14,462	2029/2/19
TTWO 4.95% 03/28/28	4.95	100	97	15,239	2028/3/28
TXN 3.875% 03/15/39	3.875	100	84	13,233	2039/3/15
TXN 4.15% 05/15/48	4.15	100	80	12,561	2048/5/15
UBS 1.305% 02/02/27	1.305	250	230	35,895	2027/2/2
UBS 4.194% 04/01/31	4.194	250	227	35,467	2031/4/1
UBS 6.442% 08/11/28	6.442	250	253	39,562	2028/8/11
UBS 9.016% 11/15/33	9.016	250	295	45,979	2033/11/15
UCGIM 1.982% 06/03/27	1.982	200	184	28,722	2027/6/3
UDR 2.1% 08/01/32	2.1	100	75	11,777	2032/8/1
UHS 2.65% 10/15/30	2.65	100	82	12,874	2030/10/15
UNANA 1.375% 09/14/30	1.375	100	79	12,351	2030/9/14
UNH 1.15% 05/15/26	1.15	200	184	28,687	2026/5/15
UNH 4.25% 06/15/48	4.25	100	80	12,594	2048/6/15
UNH 4.5% 04/15/33	4.5	100	93	14,582	2033/4/15
UNH 4.75% 05/15/52	4.75	100	86	13,498	2052/5/15
UNH 5% 04/15/34	5.0	200	192	30,047	2034/4/15
UNH 5.15% 10/15/25	5.15	100	99	15,535	2025/10/15
UNH 5.2% 04/15/63	5.2	200	181	28,289	2063/4/15
UNM 4% 06/15/29	4.0	100	92	14,394	2029/6/15
UNP 2.891% 04/06/36	2.891	200	156	24,325	2036/4/6
UNP 3.799% 04/06/71	3.799	100	68	10,683	2071/4/6
UNP 4.75% 02/21/26	4.75	100	99	15,448	2026/2/21
UNP 4.95% 05/15/53	4.95	100	90	14,125	2053/5/15
UPS 5.05% 03/03/53	5.05	100	91	14,271	2053/3/3
UPS 5.3% 04/01/50	5.3	200	190	29,633	2050/4/1
USB 4.548% 07/22/28	4.548	200	193	30,136	2028/7/22
USB 4.967% 07/22/33	4.967	100	91	14,308	2033/7/22
USB 5.727% 10/21/26	5.727	400	399	62,299	2026/10/21
V 1.1% 02/15/31	1.1	100	77	12,060	2031/2/15
V 1.9% 04/15/27	1.9	100	91	14,250	2027/4/15
V 3.65% 09/15/47	3.65	100	75	11,753	2047/9/15
VALEBZ 3.75% 07/08/30	3.75	100	88	13,735	2030/7/8
VLO 2.15% 09/15/27	2.15	100	90	14,024	2027/9/15
VLO 3.65% 12/01/51	3.65	100	67	10,512	2051/12/1
VMC 4.7% 03/01/48	4.7	100	84	13,129	2048/3/1
VMW 4.65% 05/15/27	4.65	100	97	15,160	2027/5/15
VOD 5.25% 05/30/48	5.25	100	89	13,958	2048/5/30
VOD 5.625% 02/10/53	5.625	100	93	14,511	2053/2/10
VTR 2.5% 09/01/31	2.5	100	80	12,470	2031/9/1
VTR 3% 01/15/30	3.0	100	85	13,382	2030/1/15
VTRS 3.85% 06/22/40	3.85	100	70	10,929	2040/6/22
VTRS 5.2% 04/15/48	5.2	100	78	12,201	2048/4/15

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)	
VZ 1.45% 03/20/26	1.45	200	185	28,951	2026/3/20
VZ 2.1% 03/22/28	2.1	200	176	27,558	2028/3/22
VZ 2.55% 03/21/31	2.55	100	82	12,897	2031/3/21
VZ 3.15% 03/22/30	3.15	100	88	13,735	2030/3/22
VZ 3.4% 03/22/41	3.4	100	74	11,555	2041/3/22
VZ 3.7% 03/22/61	3.7	100	67	10,588	2061/3/22
VZ 4.812% 03/15/39	4.812	200	180	28,139	2039/3/15
VZ 4.862% 08/21/46	4.862	100	87	13,694	2046/8/21
WBD 3.625% 05/15/30	3.625	100	86	13,545	2030/5/15
WBD 3.95% 03/20/28	3.95	200	185	28,939	2028/3/20
WBD 4.65% 05/15/50	4.65	100	72	11,287	2050/5/15
WBD 5.2% 09/20/47	5.2	100	78	12,228	2047/9/20
WDAY 3.5% 04/01/27	3.5	100	94	14,764	2027/4/1
WEC 1.8% 10/15/30	1.8	100	79	12,441	2030/10/15
WELL 2.7% 02/15/27	2.7	100	92	14,467	2027/2/15
WFC 2.572% 02/11/31	2.572	100	84	13,154	2031/2/11
WFC 3.526% 03/24/28	3.526	100	94	14,688	2028/3/24
WFC 4.54% 08/15/26	4.54	200	196	30,638	2026/8/15
WFC 4.611% 04/25/53	4.611	100	82	12,887	2053/4/25
WFC 4.808% 07/25/28	4.808	100	97	15,184	2028/7/25
WFC 4.897% 07/25/33	4.897	200	187	29,166	2033/7/25
WFC 5.557% 07/25/34	5.557	200	194	30,332	2034/7/25
WFC 5.574% 07/25/29	5.574	200	199	31,007	2029/7/25
WFC 5.95% 12/15/36	5.95	200	197	30,741	2036/12/15
WHR 4.6% 05/15/50	4.6	100	76	11,977	2050/5/15
WLK 2.875% 08/15/41	2.875	100	65	10,206	2041/8/15
WM 0.75% 11/15/25	0.75	100	93	14,515	2025/11/15
WM 4.875% 02/15/34	4.875	100	95	14,930	2034/2/15
WMB 3.95% 05/15/50	3.95	100	73	11,500	2050/5/15
WMB 4% 03/15/28	4.0	100	94	14,751	2028/3/15
WMB 4.85% 03/01/48	4.85	100	83	13,066	2048/3/1
WMT 1.05% 09/17/26	1.05	300	273	42,635	2026/9/17
WMT 1.8% 09/22/31	1.8	100	80	12,532	2031/9/22
WMT 2.65% 09/22/51	2.65	100	61	9,514	2051/9/22
WMT 3.95% 06/28/38	3.95	100	87	13,555	2038/6/28
WMT 4% 04/15/26	4.0	200	196	30,585	2026/4/15
WMT 4.05% 06/29/48	4.05	100	81	12,709	2048/6/29
WPC 2.4% 02/01/31	2.4	100	81	12,663	2031/2/1
WSTP 1.15% 06/03/26	1.15	200	183	28,607	2026/6/3
WSTP 3.02% 11/18/36	3.02	200	160	25,072	2036/11/18
WSTP 3.133% 11/18/41	3.133	100	67	10,533	2041/11/18
WSTP 5.457% 11/18/27	5.457	100	100	15,690	2027/11/18
WTRG 2.4% 05/01/31	2.4	100	80	12,576	2031/5/1
WTRG 5.3% 05/01/52	5.3	100	88	13,730	2052/5/1
WY 4.75% 05/15/26	4.75	100	98	15,338	2026/5/15
XEL 3.6% 09/15/47	3.6	100	71	11,086	2047/9/15
XEL 4% 06/15/28	4.0	100	93	14,631	2028/6/15
XEL 4.1% 06/01/32	4.1	200	181	28,229	2032/6/1
XOM 3.482% 03/19/30	3.482	100	91	14,304	2030/3/19
XOM 4.227% 03/19/40	4.227	100	86	13,480	2040/3/19
XOM 4.327% 03/19/50	4.327	100	82	12,858	2050/3/19

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)	
ZBH 3.05% 01/15/26	3.05	100	95	14,928	2026/1/15
ZTS 5.4% 11/14/25	5.4	100	99	15,545	2025/11/14
小計				44,853,044	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	300	278	31,769	2026/3/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	290	274	31,349	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	540	436	49,753	2030/12/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	300	278	31,781	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	200	184	21,076	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	430	370	42,235	2030/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	250	236	26,946	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	840	718	81,998	2031/6/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	790	668	76,270	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	630	407	46,469	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	360	334	38,176	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	690	601	68,631	2032/6/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	250	175	19,965	2051/12/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	200	185	21,211	2029/6/1
CAN 2.25% 12/01/29	2.25	270	249	28,479	2029/12/1
CAN 2.5% 12/01/32	2.5	350	315	35,990	2032/12/1
CAN 2.75% 06/01/33	2.75	40	36	4,179	2033/6/1
CAN 2.75% 09/01/27	2.75	150	144	16,434	2027/9/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	270	226	25,844	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/55	2.75	300	246	28,119	2055/12/1
CAN 3% 04/01/26	3.0	70	68	7,787	2026/4/1
CAN 3% 06/01/34	3.0	300	278	31,788	2034/6/1
CAN 3% 10/01/25	3.0	540	528	60,257	2025/10/1
CAN 3.25% 09/01/28	3.25	410	399	45,531	2028/9/1
CAN 3.25% 12/01/33	3.25	300	285	32,565	2033/12/1
CAN 3.5% 08/01/25	3.5	430	424	48,361	2025/8/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	330	316	36,073	2045/12/1
CAN 3.75% 05/01/25	3.75	430	425	48,566	2025/5/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	400	409	46,699	2041/6/1
CAN 4.5% 11/01/25	4.5	470	469	53,559	2025/11/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	450	502	57,339	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	150	163	18,641	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	180	205	23,483	2033/6/1
地方債証券					
ALTA 1.65% 06/01/31	1.65	100	83	9,531	2031/6/1
ALTA 2.55% 06/01/27	2.55	200	189	21,652	2027/6/1
ALTA 2.9% 09/20/29	2.9	100	93	10,665	2029/9/20
ALTA 2.95% 06/01/52	2.95	200	145	16,630	2052/6/1
ALTA 4.15% 06/01/33	4.15	100	97	11,093	2033/6/1
BRCOL 1.55% 06/18/31	1.55	200	165	18,887	2031/6/18
BRCOL 2.95% 06/18/50	2.95	200	146	16,657	2050/6/18
BRCOL 2.95% 12/18/28	2.95	100	94	10,787	2028/12/18
BRCOL 3.2% 06/18/44	3.2	100	79	9,067	2044/6/18
BRCOL 5.62% 08/17/28	5.62	100	105	11,987	2028/8/17
MP 2.85% 09/05/46	2.85	100	72	8,215	2046/9/5
MP 3.2% 03/05/50	3.2	200	150	17,213	2050/3/5

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)	
MP 3.25% 09/05/29	3.25	100	95	10,835	2029/9/5
MP 6.3% 03/05/31	6.3	100	111	12,662	2031/3/5
NBRNS 2.9% 08/14/52	2.9	100	70	8,041	2052/8/14
NBRNS 5.5% 01/27/34	5.5	100	106	12,153	2034/1/27
NF 1.25% 06/02/27	1.25	100	90	10,375	2027/6/2
NF 2.65% 10/17/50	2.65	100	64	7,396	2050/10/17
NF 3.15% 12/02/52	3.15	200	143	16,320	2052/12/2
NF 3.7% 10/17/48	3.7	200	160	18,323	2048/10/17
NS 3.15% 12/01/51	3.15	100	74	8,506	2051/12/1
NS 4.05% 06/01/29	4.05	200	197	22,578	2029/6/1
NS 4.4% 06/01/42	4.4	100	94	10,772	2042/6/1
ONT 1.35% 09/08/26	1.35	300	279	31,878	2026/9/8
ONT 1.55% 11/01/29	1.55	300	260	29,693	2029/11/1
ONT 1.9% 12/02/51	1.9	200	114	13,039	2051/12/2
ONT 2.25% 12/02/31	2.25	100	86	9,825	2031/12/2
ONT 2.55% 12/02/52	2.55	100	66	7,587	2052/12/2
ONT 2.6% 06/02/27	2.6	200	190	21,687	2027/6/2
ONT 2.65% 12/02/50	2.65	100	68	7,857	2050/12/2
ONT 2.8% 06/02/48	2.8	200	144	16,434	2048/6/2
ONT 2.9% 12/02/46	2.9	400	296	33,858	2046/12/2
ONT 3.4% 09/08/28	3.4	200	193	22,051	2028/9/8
ONT 3.45% 06/02/45	3.45	200	165	18,824	2045/6/2
ONT 3.5% 06/02/43	3.5	400	336	38,417	2043/6/2
ONT 3.65% 06/02/33	3.65	100	93	10,666	2033/6/2
ONT 3.75% 06/02/32	3.75	100	95	10,854	2032/6/2
ONT 4.15% 06/02/34	4.15	500	482	55,050	2034/6/2
ONT 4.65% 06/02/41	4.65	200	197	22,541	2041/6/2
ONT 5.6% 06/02/35	5.6	300	325	37,154	2035/6/2
ONT 6.2% 06/02/31	6.2	100	110	12,653	2031/6/2
ONT 6.5% 03/08/29	6.5	100	109	12,514	2029/3/8
ONT 8% 06/02/26	8.0	400	427	48,790	2026/6/2
Q 1.9% 09/01/30	1.9	100	86	9,890	2030/9/1
Q 2.6% 07/06/25	2.6	200	195	22,261	2025/7/6
Q 2.75% 09/01/25	2.75	200	195	22,243	2025/9/1
Q 2.75% 09/01/28	2.75	200	188	21,476	2028/9/1
Q 3.1% 12/01/51	3.1	300	225	25,711	2051/12/1
Q 3.25% 09/01/32	3.25	200	183	20,875	2032/9/1
Q 3.5% 12/01/45	3.5	300	248	28,288	2045/12/1
Q 3.6% 09/01/33	3.6	300	278	31,746	2033/9/1
Q 3.65% 05/20/32	3.65	100	94	10,811	2032/5/20
Q 4.4% 12/01/55	4.4	200	190	21,704	2055/12/1
Q 5% 12/01/41	5.0	200	205	23,416	2041/12/1
Q 6% 10/01/29	6.0	100	108	12,341	2029/10/1
SCDA 2.65% 06/02/27	2.65	200	190	21,711	2027/6/2
SCDA 3.75% 03/05/54	3.75	100	84	9,628	2054/3/5
SCDA 4.2% 12/02/54	4.2	100	91	10,451	2054/12/2
SCDA 4.75% 06/01/40	4.75	100	99	11,366	2040/6/1
特殊債券(除く金融債)					
ASIA 0.75% 02/10/26	0.75	100	93	10,661	2026/2/10
ASIA 1.5% 05/04/28	1.5	100	89	10,263	2028/5/4
CANHOU 0.95% 06/15/25	0.95	100	95	10,937	2025/6/15
CANHOU 1.1% 03/15/31	1.1	200	163	18,681	2031/3/15
CANHOU 1.1% 12/15/26	1.1	400	368	41,997	2026/12/15
CANHOU 1.25% 06/15/26	1.25	100	93	10,674	2026/6/15
CANHOU 1.4% 03/15/31	1.4	300	251	28,630	2031/3/15
CANHOU 1.75% 06/15/30	1.75	300	261	29,814	2030/6/15
CANHOU 1.95% 12/15/25	1.95	200	191	21,884	2025/12/15
CANHOU 2.15% 12/15/31	2.15	100	86	9,910	2031/12/15
CANHOU 2.65% 12/15/28	2.65	100	93	10,697	2028/12/15
CANHOU 3.1% 06/15/28	3.1	100	95	10,945	2028/6/15
CANHOU 3.55% 09/15/32	3.55	200	190	21,757	2032/9/15
CANHOU 3.6% 12/15/27	3.6	300	293	33,524	2027/12/15
CANHOU 3.65% 06/15/33	3.65	100	95	10,891	2033/6/15
CANHOU 3.8% 06/15/27	3.8	100	98	11,258	2027/6/15
CANHOU 3.95% 06/15/28	3.95	200	198	22,621	2028/6/15
CANHOU 4.15% 06/15/33	4.15	200	198	22,639	2033/6/15
CANHOU 4.25% 03/15/34	4.25	400	399	45,524	2034/3/15
IADB 1% 06/29/26	1.0	100	92	10,583	2026/6/29
IBRD 4.25% 09/18/30	4.25	100	99	11,401	2030/9/18
KFW 0.75% 02/19/26	0.75	100	93	10,651	2026/2/19
QHEL 2% 09/01/28	2.0	100	91	10,386	2028/9/1
QHEL 3.4% 09/01/29	3.4	200	191	21,850	2029/9/1
QHEL 4% 02/15/55	4.0	100	88	10,066	2055/2/15
QHEL 4% 02/15/63	4.0	400	351	40,144	2063/2/15
QHEL 5% 02/15/50	5.0	100	103	11,839	2050/2/15
普通社債券(含む投資法人債券)					
ALACN 4.638% 05/15/26	4.638	100	99	11,296	2026/5/15
BAC 3.615% 03/16/28	3.615	100	96	10,953	2028/3/16
BCECN 3% 03/17/31	3.0	100	87	10,008	2031/3/17
BCECN 5.15% 02/09/53	5.15	100	92	10,507	2053/2/9
BMO 1.928% 07/22/31	1.928	100	93	10,623	2031/7/22
BMO 4.537% 12/18/28	4.537	100	98	11,222	2028/12/18
BMO 4.709% 12/07/27	4.709	100	99	11,325	2027/12/7
BNCN 4.82% 01/28/26	4.82	100	99	11,360	2026/1/28
BNP 2.538% 07/13/29	2.538	200	181	20,746	2029/7/13
BNS 5.5% 05/08/26	5.5	100	100	11,509	2026/5/8
BNS 5.679% 08/02/33	5.679	200	202	23,079	2033/8/2
CAECN 5.541% 06/12/28	5.541	100	100	11,480	2028/6/12
CM 2.25% 01/07/27	2.25	200	186	21,290	2027/1/7
CM 4.95% 06/29/27	4.95	100	100	11,407	2027/6/29
CNQCN 2.5% 01/17/28	2.5	100	91	10,458	2028/1/17
CNQCN 4.85% 05/30/47	4.85	100	88	10,041	2047/5/30
CNRCN 3.2% 07/31/28	3.2	100	94	10,796	2028/7/31
CNRCN 3.6% 02/08/49	3.6	100	78	8,953	2049/2/8
CP 2.54% 02/28/28	2.54	100	92	10,545	2028/2/28
CPXCN 4.424% 02/08/30	4.424	200	189	21,646	2030/2/8
CUCN 4.851% 06/03/52	4.851	200	188	21,478	2052/6/3
CVECN 3.5% 02/07/28	3.5	100	94	10,833	2028/2/7
ENBCN 5.7% 11/09/27	5.7	100	102	11,655	2027/11/9
ENBCN 6.1% 11/09/32	6.1	100	104	11,964	2032/11/9
FFHCN 3.95% 03/03/31	3.95	100	91	10,436	2031/3/3
FTSCN 4.431% 05/31/29	4.431	100	98	11,214	2029/5/31

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)	
GWOCN 2.981% 07/08/50	2.981	100	69	7,871	2050/7/8
HYDONE 4.17% 06/06/44	4.17	100	88	10,067	2044/6/6
HYDONE 4.91% 01/27/28	4.91	100	100	11,502	2028/1/27
LCN 2.284% 05/07/30	2.284	100	86	9,911	2030/5/7
MBGGR 5.14% 06/29/26	5.14	100	100	11,448	2026/6/29
MFCCN 5.409% 03/10/33	5.409	100	100	11,494	2033/3/10
MGCN 4.95% 01/31/31	4.95	100	99	11,330	2031/1/31
MRUCN 4.27% 12/04/47	4.27	100	84	9,636	2047/12/4
NACN 5.296% 11/03/25	5.296	100	100	11,428	2025/11/3
NESNVX 2.192% 01/26/29	2.192	100	90	10,288	2029/1/26
NGGLN 5.221% 09/16/31	5.221	100	99	11,358	2031/9/16
PPLCN 5.21% 01/12/34	5.21	100	97	11,152	2034/1/12
PSPCAP 3% 11/05/25	3.0	150	146	16,687	2025/11/5
RCICN 5.25% 04/15/52	5.25	100	92	10,563	2052/4/15
RCICN 6.75% 11/09/39	6.75	100	109	12,432	2039/11/9
REIUCN 4.628% 05/01/29	4.628	100	95	10,934	2029/5/1
REIUCN 6.488% 09/29/26	6.488	200	200	22,852	2026/9/29
RY 2.088% 06/30/30	2.088	100	96	10,987	2030/6/30
RY 2.328% 01/28/27	2.328	100	93	10,673	2027/1/28
SLFCN 2.58% 05/10/32	2.58	100	93	10,623	2032/5/10
SRUUCN 3.192% 06/11/27	3.192	100	93	10,654	2027/6/11
T(AT&T) 4% 11/25/25	4.0	150	147	16,788	2025/11/25
TCN 2.35% 01/27/28	2.35	100	91	10,405	2028/1/27
TCN 5.65% 09/13/52	5.65	100	97	11,175	2052/9/13
TD 1.896% 09/11/28	1.896	300	267	30,532	2028/9/11
TD 2.26% 01/07/27	2.26	100	93	10,663	2027/1/7
TD 2.667% 09/09/25	2.667	100	96	11,038	2025/9/9
TD 4.68% 01/08/29	4.68	100	99	11,307	2029/1/8
TD 5.177% 04/09/34	5.177	200	198	22,659	2034/4/9
TD 5.423% 07/10/26	5.423	100	100	11,509	2026/7/10
TOYOTA 5.16% 07/12/28	5.16	200	202	23,101	2028/7/12
TOYOTA 5.29% 07/13/26	5.29	200	201	22,986	2026/7/13
TRPCN 3.3% 07/17/25	3.3	100	97	11,160	2025/7/17
TRPCN 5.92% 05/12/52	5.92	100	101	11,534	2052/5/12
WFC 2.568% 05/01/26	2.568	100	97	11,101	2026/5/1
小計				3,609,942	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	1,300	1,307	11,849	2036/11/20
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	3,200	2,830	25,648	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	4,000	3,672	33,273	2026/3/5
MBONO 7% 09/03/26	7.0	3,600	3,338	30,248	2026/9/3
MBONO 7.5% 05/26/33	7.5	3,700	3,164	28,677	2033/5/26
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	5,850	5,429	49,199	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	5,750	5,102	46,232	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	4,600	3,726	33,768	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	2,000	1,715	15,543	2034/11/23
MBONO 8% 07/31/53	8.0	3,000	2,442	22,132	2053/7/31
MBONO 8% 11/07/47	8.0	4,220	3,469	31,434	2047/11/7
MBONO 8.5% 03/01/29	8.5	1,000	942	8,543	2029/3/1
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	7,100	6,679	60,517	2029/5/31

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)	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	2,150	1,909	17,300	2038/11/18
小計				414,370	
(コロンビア)		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
国債証券					
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	1,300,000	1,256,063	49,403	2027/6/28
COLTES 13.25% 02/09/33	13.25	1,000,000	1,131,293	44,496	2033/2/9
COLTES 9.25% 05/28/42	9.25	1,200,000	1,010,017	39,726	2042/5/28
小計				133,625	
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
DBR 0% 02/15/30	－	500	432	72,173	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	－	890	750	125,366	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	－	1,220	1,002	167,431	2032/2/15
DBR 0% 05/15/36	－	500	363	60,646	2036/5/15
DBR 0% 08/15/29	－	1,030	900	150,471	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	－	1,000	853	142,653	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	－	950	791	132,156	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	－	700	345	57,718	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	－	510	239	39,943	2052/8/15
DBR 0% 11/15/28	－	350	311	52,014	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	300	279	46,738	2027/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	550	497	83,168	2028/8/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	400	372	62,215	2027/8/15
DBR 1% 05/15/38	1.0	420	335	55,966	2038/5/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	220	161	27,049	2048/8/15
DBR 1.7% 08/15/32	1.7	220	205	34,395	2032/8/15
DBR 1.8% 08/15/53	1.8	390	316	52,800	2053/8/15
DBR 2.1% 11/15/29	2.1	1,230	1,198	200,201	2029/11/15
DBR 2.2% 02/15/34	2.2	500	481	80,500	2034/2/15
DBR 2.3% 02/15/33	2.3	200	195	32,671	2033/2/15
DBR 2.4% 11/15/30	2.4	550	543	90,832	2030/11/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	470	448	74,975	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	260	247	41,417	2046/8/15
DBR 2.5% 08/15/54	2.5	220	208	34,850	2054/8/15
DBR 2.6% 08/15/33	2.6	520	519	86,831	2033/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	40	42	7,110	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	280	317	53,108	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	370	437	73,025	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,150	1,243	207,795	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	1,050	1,245	208,073	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	150	188	31,432	2040/7/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	450	495	82,804	2028/1/4
OBL 0% 04/16/27	－	400	368	61,611	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	－	740	690	115,367	2026/10/9
OBL 1.3% 10/15/27	1.3	500	477	79,687	2027/10/15
OBL 2.4% 10/19/28	2.4	810	801	133,857	2028/10/19
地方債証券					
BAYERN 0.01% 01/18/35	0.01	100	72	12,111	2035/1/18
BAYERN 0.01% 05/07/29	0.01	100	86	14,374	2029/5/7
BAYERN 0.03% 04/03/28	0.03	100	88	14,844	2028/4/3
BERGER 0.01% 03/25/26	0.01	200	188	31,408	2026/3/25

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
BERGER 0.01% 07/02/30	0.01	100	83	13,891	2030/7/2
BERGER 0.125% 06/04/35	0.125	100	72	12,049	2035/6/4
BERGER 0.125% 11/24/45	0.125	200	102	17,069	2045/11/24
BERGER 0.625% 01/26/52	0.625	100	51	8,604	2052/1/26
BERGER 0.625% 07/15/39	0.625	100	68	11,426	2039/7/15
HESLAN 2.375% 09/21/26	2.375	100	97	16,332	2026/9/21
HESLAN 2.625% 08/24/27	2.625	100	96	16,078	2027/8/24
HESLAN 4% 02/04/30	4.0	100	101	16,917	2030/2/4
HESSEN 0% 06/10/26	－	200	186	31,209	2026/6/10
HESSEN 1.3% 10/10/33	1.3	100	85	14,328	2033/10/10
HESSEN 2.875% 01/10/33	2.875	100	98	16,504	2033/1/10
LANDER 0.01% 02/04/31	0.01	100	81	13,653	2031/2/4
LANDER 1.25% 05/04/29	1.25	100	91	15,332	2029/5/4
NIESA 0% 02/11/27	－	100	91	15,297	2027/2/11
NIESA 0% 09/15/25	－	100	95	15,951	2025/9/15
NIESA 0.01% 03/17/26	0.01	300	282	47,133	2026/3/17
NIESA 0.05% 03/09/35	0.05	100	71	12,004	2035/3/9
NIESA 1.125% 09/12/33	1.125	100	84	14,081	2033/9/12
NRW 0% 05/05/25	－	100	96	16,123	2025/5/5
NRW 0% 10/12/35	－	100	69	11,669	2035/10/12
NRW 0.25% 03/13/26	0.25	300	283	47,352	2026/3/13
NRW 0.375% 09/02/50	0.375	100	48	8,049	2050/9/2
NRW 0.5% 11/25/39	0.5	100	66	11,043	2039/11/25
NRW 0.6% 06/04/41	0.6	100	64	10,777	2041/6/4
NRW 1.45% 01/19/22	1.45	200	99	16,676	2122/1/19
NRW 1.65% 05/16/47	1.65	100	72	12,177	2047/5/16
NRW 2.25% 06/14/52	2.25	100	79	13,332	2052/6/14
NRW 2.75% 01/15/32	2.75	100	98	16,377	2032/1/15
NRW 3% 01/27/28	3.0	200	199	33,294	2028/1/27
NRW 3.4% 03/07/2073	3.4	100	102	17,064	2073/3/7
SACHAN 0.125% 06/21/29	0.125	100	86	14,417	2029/6/21
SACHAN 3.15% 02/06/54	3.15	200	194	32,417	2054/2/6
特殊債券(除く金融債)					
DBHNGR 1.875% 05/24/30	1.875	100	92	15,534	2030/5/24
DBHNGR 4% 11/23/43	4.0	200	204	34,185	2043/11/23
KFW 0% 01/10/31	－	200	164	27,420	2031/1/10
KFW 0% 03/31/27	－	100	91	15,281	2027/3/31
KFW 0% 09/30/26	－	100	92	15,497	2026/9/30
KFW 0.125% 01/09/32	0.125	300	241	40,388	2032/1/9
KFW 0.125% 06/30/25	0.125	200	192	32,163	2025/6/30
KFW 0.375% 05/20/36	0.375	100	72	12,121	2036/5/20
KFW 1.25% 06/30/27	1.25	200	189	31,605	2027/6/30
KFW 2% 11/15/29	2.0	100	95	15,883	2029/11/15
KFW 2.5% 11/19/25	2.5	200	197	33,020	2025/11/19
KFW 2.75% 02/14/33	2.75	100	98	16,380	2033/2/14
KFW 2.75% 03/15/28	2.75	800	792	132,387	2028/3/15
KFW 2.875% 05/29/26	2.875	600	596	99,591	2026/5/29
LBANK 0.375% 02/25/27	0.375	100	92	15,437	2027/2/25
LBANK 0.75% 03/16/32	0.75	100	84	14,062	2032/3/16
NRWBK 0% 05/14/29	－	100	85	14,326	2029/5/14
NRWBK 0.1% 07/09/35	0.1	100	71	11,867	2035/7/9
NRWBK 0.75% 06/30/28	0.75	100	90	15,180	2028/6/30
NRWBK 1.25% 05/13/49	1.25	100	63	10,634	2049/5/13
NRWBK 1.625% 08/03/32	1.625	100	89	14,961	2032/8/3
NRWBK 2.875% 04/05/33	2.875	100	98	16,425	2033/4/5
RENTEN 0% 12/13/28	－	100	87	14,550	2028/12/13
RENTEN 0.01% 11/26/40	0.01	100	58	9,773	2040/11/26
RENTEN 0.05% 01/31/31	0.05	100	81	13,681	2031/1/31
RENTEN 0.1% 03/08/27	0.1	100	91	15,341	2027/3/8
RENTEN 2.75% 02/16/32	2.75	200	195	32,713	2032/2/16
RENTEN 3% 11/14/34	3.0	100	99	16,571	2034/11/14
RENTEN 3.25% 09/06/30	3.25	500	506	84,612	2030/9/6
普通社債券(含む投資法人債券)					
ALVGR 2.121% 07/08/50	2.121	100	87	14,632	2050/7/8
ALVGR 4.252% 07/05/52	4.252	100	97	16,356	2052/7/5
ANNGR 0.375% 06/16/27	0.375	100	89	14,924	2027/6/16
ANNGR 0.625% 12/14/29	0.625	100	82	13,698	2029/12/14
ANNGR 1.375% 01/28/26	1.375	300	286	47,860	2026/1/28
BASGR 3.125% 06/29/28	3.125	100	99	16,541	2028/6/29
BASGR 3.75% 06/29/32	3.75	100	99	16,689	2032/6/29
BAYNGR 0.75% 01/06/27	0.75	100	91	15,318	2027/1/6
BAYNGR 1% 01/12/36	1.0	100	69	11,537	2036/1/12
BAYNGR 1.125% 01/06/30	1.125	100	84	14,161	2030/1/6
BERTEL 2% 04/01/28	2.0	100	94	15,801	2028/4/1
BYLAN 1.375% 11/22/32	1.375	100	85	14,362	2032/11/22
CMZB 2.75% 12/08/25	2.75	200	197	33,052	2025/12/8
CMZB 2.875% 04/28/26	2.875	100	99	16,547	2026/4/28
CMZB 3.125% 04/20/29	3.125	100	99	16,626	2029/4/20
CONGR 3.625% 11/30/27	3.625	100	99	16,668	2027/11/30
DAIGR 0.75% 09/10/30	0.75	100	85	14,321	2030/9/10
DAIGR 2% 08/22/26	2.0	100	96	16,183	2026/8/22
DB 0.75% 02/17/27	0.75	200	188	31,490	2027/2/17
DB 2.625% 06/30/37	2.625	200	185	30,915	2037/6/30
DB 4% 11/29/27	4.0	100	101	16,878	2027/11/29
DBOERS 1.625% 10/08/25	1.625	100	97	16,307	2025/10/8
DHLGR 0.375% 05/20/26	0.375	100	94	15,773	2026/5/20
DWNIGY 1.5% 04/30/30	1.5	200	172	28,760	2030/4/30
ENBW 1.625% 08/05/79	1.625	100	90	15,180	2079/8/5
ENBW 2.125% 08/31/2081	2.125	100	80	13,482	2081/8/31
EOANGR 0.375% 09/29/27	0.375	100	90	15,073	2027/9/29
EOANGR 1% 10/07/25	1.0	100	96	16,109	2025/10/7
EOANGR 2.875% 08/26/28	2.875	100	97	16,370	2028/8/26
EOANGR 3.875% 01/12/35	3.875	100	100	16,758	2035/1/12
EOANGR 4% 08/29/33	4.0	100	102	17,043	2033/8/29
EVKGR 2.25% 09/25/27	2.25	100	95	15,937	2027/9/25
FREGR 1.875% 05/24/25	1.875	100	98	16,373	2025/5/24
FREGR 4.25% 05/28/26	4.25	100	100	16,817	2026/5/28
HEIGR 3.75% 05/31/32	3.75	200	197	33,012	2032/5/31
HVB 0.375% 01/17/33	0.375	100	78	13,141	2033/1/17
HVB 3% 07/13/26	3.0	100	99	16,544	2026/7/13
IFXGR 2% 06/24/32	2.0	100	89	14,868	2032/6/24
LBBW 0.375% 02/21/31	0.375	100	78	13,114	2031/2/21

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
LBBW 0.375% 02/28/28	0.375	100	87	14,627	2028/2/28
LBBW 0.375% 05/07/29	0.375	100	84	14,085	2029/5/7
LEGGR 0.375% 01/17/26	0.375	100	93	15,700	2026/1/17
LEGGR 0.875% 11/28/27	0.875	100	90	15,149	2027/11/28
LXSGR 0.625% 12/01/29	0.625	100	81	13,630	2029/12/1
MBGGR 0.75% 02/08/30	0.75	100	86	14,507	2030/2/8
MRKGR 1.625% 09/09/2080	1.625	100	94	15,785	2080/9/9
MUNRE 1% 05/26/42	1.0	100	78	13,081	2042/5/26
NDB 2.25% 09/20/27	2.25	500	482	80,681	2027/9/20
NDB 2.875% 03/19/30	2.875	200	195	32,734	2030/3/19
NDB 4.875% 07/11/28	4.875	100	104	17,479	2028/7/11
RWE 2.125% 05/24/26	2.125	100	97	16,228	2026/5/24
RWE 2.75% 05/24/30	2.75	100	94	15,802	2030/5/24
SAPGR 0.375% 05/18/29	0.375	100	86	14,518	2029/5/18
VW 4.75% 09/25/31	4.75	100	104	17,476	2031/9/25
（イタリア）					
国債証券					
BTPS 0% 04/01/26	－	100	93	15,641	2026/4/1
BTPS 0% 08/01/26	－	160	148	24,752	2026/8/1
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	190	168	28,121	2028/3/15
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	100	86	14,497	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	250	237	39,664	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	210	186	31,091	2028/7/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	150	120	20,199	2031/8/1
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	200	186	31,221	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	270	224	37,576	2031/4/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	250	172	28,762	2037/3/1
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	270	217	36,416	2032/6/1
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	200	170	28,483	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	90	83	13,872	2027/9/15
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	230	188	31,493	2031/12/1
BTPS 1.1% 04/01/27	1.1	300	280	46,916	2027/4/1
BTPS 1.2% 08/15/25	1.2	330	320	53,511	2025/8/15
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	300	284	47,481	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	350	308	51,611	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	100	75	12,642	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	620	607	101,416	2025/5/15
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	170	105	17,577	2045/4/30
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	250	244	40,863	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	150	144	24,145	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	320	275	46,009	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	300	265	44,312	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	210	124	20,764	2051/9/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	330	232	38,833	2041/3/1
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	300	294	49,164	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	200	190	31,769	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	200	195	32,673	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	560	536	89,702	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	170	165	27,609	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	110	65	11,000	2072/3/1
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	160	103	17,276	2052/9/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	420	405	67,731	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	490	403	67,452	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	100	89	14,893	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	280	197	33,001	2050/9/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	530	522	87,301	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/32	2.5	290	262	43,927	2032/12/1
BTPS 2.65% 12/01/27	2.65	390	380	63,503	2027/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	220	168	28,142	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	140	99	16,697	2067/3/1
BTPS 2.8% 06/15/29	2.8	150	145	24,232	2029/6/15
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	300	291	48,771	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	180	156	26,069	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	280	273	45,660	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	260	225	37,648	2040/3/1
BTPS 3.25% 03/01/38	3.25	240	216	36,130	2038/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	310	261	43,749	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	220	207	34,643	2035/3/1
BTPS 3.4% 04/01/28	3.4	100	99	16,684	2028/4/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	280	242	40,502	2048/3/1
BTPS 3.5% 01/15/26	3.5	600	600	100,231	2026/1/15
BTPS 3.5% 02/15/31	3.5	150	148	24,797	2031/2/15
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	450	449	75,008	2030/3/1
BTPS 3.6% 09/29/25	3.6	300	300	50,157	2025/9/29
BTPS 3.7% 06/15/30	3.7	180	180	30,205	2030/6/15
BTPS 3.8% 04/15/26	3.8	300	301	50,427	2026/4/15
BTPS 3.8% 08/01/28	3.8	200	202	33,851	2028/8/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	210	192	32,208	2049/9/1
BTPS 3.85% 09/15/26	3.85	180	181	30,346	2026/9/15
BTPS 3.85% 12/15/29	3.85	350	355	59,323	2029/12/15
BTPS 4% 02/01/37	4.0	440	436	72,997	2037/2/1
BTPS 4% 04/30/35	4.0	140	140	23,430	2035/4/30
BTPS 4% 10/30/31	4.0	150	153	25,572	2031/10/30
BTPS 4% 11/15/30	4.0	250	255	42,613	2030/11/15
BTPS 4.1% 02/01/29	4.1	400	410	68,611	2029/2/1
BTPS 4.15% 10/01/39	4.15	150	147	24,651	2039/10/1
BTPS 4.2% 03/01/34	4.2	240	245	40,949	2034/3/1
BTPS 4.35% 11/01/33	4.35	520	538	89,944	2033/11/1
BTPS 4.4% 05/01/33	4.4	450	469	78,347	2033/5/1
BTPS 4.45% 09/01/43	4.45	100	100	16,842	2043/9/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	80	81	13,604	2026/3/1
BTPS 4.5% 10/01/53	4.5	160	161	26,915	2053/10/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	400	420	70,276	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	230	241	40,385	2044/9/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	330	358	59,957	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	310	335	55,968	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	330	356	59,631	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	430	467	78,084	2029/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	350	399	66,711	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	400	458	76,587	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	200	220	36,815	2027/11/1
普通社債券（含む投資法人債券）					
ACEIM 3.875% 01/24/31	3.875	200	199	33,326	2031/1/24

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
AEMSPA 0.625% 07/15/31	0.625	100	79	13,230	2031/7/15
ASSGEN 3.875% 01/29/29	3.875	100	99	16,595	2029/1/29
ASSGEN 5.272% 09/12/33	5.272	200	208	34,863	2033/9/12
ATIM 1% 11/25/26	1.0	100	92	15,534	2026/11/25
ATIM 1.5% 01/25/30	1.5	100	87	14,552	2030/1/25
ATOSTR 1.625% 01/25/28	1.625	100	91	15,290	2028/1/25
ATOSTR 2% 01/15/30	2.0	100	89	14,881	2030/1/15
ATOSTR 4.75% 01/24/31	4.75	100	102	17,057	2031/1/24
BACRED 4.75% 03/14/28	4.75	100	102	17,092	2028/3/14
BAMIIM 4.875% 01/17/30	4.875	200	203	33,962	2030/1/17
ENELIM 6.625% PERP	6.625	100	108	18,043	－
ENIIM 2.625% PERP	2.625	100	97	16,208	－
ENIIM 4.25% 05/19/33	4.25	100	102	17,052	2033/5/19
HERIM 0.25% 12/03/30	0.25	100	79	13,278	2030/12/3
HERIM 4.25% 04/20/33	4.25	100	100	16,860	2033/4/20
IGIM 0.5% 02/16/33	0.5	100	74	12,397	2033/2/16
IGIM 3.125% 02/08/29	3.125	100	96	16,176	2029/2/8
ISPIM 5% 03/08/28	5.0	150	153	25,721	2028/3/8
ISPIM 5.625% 03/08/33	5.625	150	163	27,263	2033/3/8
SRGIM 1% 09/12/34	1.0	100	74	12,504	2034/9/12
SRGIM 3.375% 12/05/26	3.375	100	98	16,536	2026/12/5
TRNIM 0.375% 06/23/29	0.375	100	85	14,232	2029/6/23
UCGIM 0.325% 01/19/26	0.325	100	94	15,746	2026/1/19
UCGIM 0.925% 01/18/28	0.925	100	92	15,468	2028/1/18
（フランス）					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/26	－	400	377	63,124	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	－	600	551	92,142	2027/2/25
FRTR 0% 05/25/32	－	400	314	52,594	2032/5/25
FRTR 0% 11/25/29	－	1,000	851	142,238	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	－	670	553	92,464	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	－	630	504	84,210	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	490	456	76,277	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	1,380	1,337	223,449	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	580	550	91,879	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	800	709	118,527	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	450	290	48,575	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	200	72	12,091	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	290	167	28,027	2044/6/25
FRTR 0.75% 02/25/28	0.75	900	829	138,505	2028/2/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	650	596	99,588	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	520	268	44,773	2052/5/25
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	490	246	41,183	2053/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	940	853	142,550	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	750	706	118,045	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	500	482	80,680	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	810	679	113,477	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	660	530	88,538	2036/5/25
FRTR 1.25% 05/25/38	1.25	300	230	38,457	2038/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	800	726	121,356	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	470	310	51,940	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	190	121	20,245	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	470	382	63,890	2039/6/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	400	303	50,773	2048/5/25
FRTR 2% 11/25/32	2.0	730	673	112,441	2032/11/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	630	614	102,705	2030/5/25
FRTR 2.5% 05/25/43	2.5	210	181	30,372	2043/5/25
FRTR 2.5% 09/24/26	2.5	610	601	100,537	2026/9/24
FRTR 2.75% 02/25/29	2.75	450	445	74,499	2029/2/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	850	843	140,933	2027/10/25
FRTR 3% 05/25/33	3.0	760	755	126,170	2033/5/25
FRTR 3% 05/25/54	3.0	240	215	35,991	2054/5/25
FRTR 3% 06/25/49	3.0	130	119	19,960	2049/6/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	450	435	72,798	2045/5/25
FRTR 3.25% 05/25/55	3.25	150	140	23,496	2055/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	710	715	119,474	2026/4/25
FRTR 3.5% 11/25/33	3.5	410	422	70,619	2033/11/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	220	238	39,777	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	300	327	54,711	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	320	344	57,550	2038/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	510	582	97,228	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	330	377	63,037	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	490	546	91,310	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	560	670	112,046	2032/10/25
特殊債券(除く金融債)					
AGFRNC 0.125% 09/29/31	0.125	100	79	13,222	2031/9/29
AGFRNC 3.5% 02/25/33	3.5	200	201	33,692	2033/2/25
AGFRNC 3.75% 02/15/27	3.75	100	100	16,850	2027/2/15
CADES 0% 02/25/26	－	300	282	47,174	2026/2/25
CADES 0% 02/25/28	－	300	266	44,554	2028/2/25
CADES 0% 05/25/29	－	100	85	14,312	2029/5/25
CADES 0% 05/25/31	－	100	80	13,465	2031/5/25
CADES 0.45% 01/19/32	0.45	300	245	41,055	2032/1/19
CADES 2.75% 11/25/32	2.75	100	97	16,215	2032/11/25
CADES 2.875% 05/25/27	2.875	100	99	16,558	2027/5/25
CADES 3.125% 03/01/30	3.125	100	100	16,739	2030/3/1
EDF 3.875% 01/12/27	3.875	100	99	16,699	2027/1/12
EDF 4.375% 10/12/29	4.375	200	205	34,289	2029/10/12
EDF 4.625% 01/25/43	4.625	100	100	16,851	2043/1/25
RESFER 0.875% 01/22/29	0.875	400	358	59,829	2029/1/22
RESFER 2.25% 12/20/47	2.25	100	74	12,480	2047/12/20
RESFER 2.625% 12/29/25	2.625	100	98	16,460	2025/12/29
RESFER 3.125% 10/25/28	3.125	100	99	16,597	2028/10/25
SNCF 0.625% 04/17/30	0.625	100	85	14,304	2030/4/17
SNCF 1% 01/19/61	1.0	100	40	6,837	2061/1/19
SNCF 3.375% 05/25/33	3.375	200	199	33,396	2033/5/25
普通社債券(含む投資法人債券)					
ACACB 0.01% 04/12/28	0.01	100	88	14,710	2028/4/12
ACACB 3.25% 09/28/32	3.25	100	99	16,688	2032/9/28
ACACB 3.375% 09/04/28	3.375	500	502	83,876	2028/9/4
ACAFP 1% 07/03/29	1.0	100	88	14,705	2029/7/3
ACAFP 1% 09/18/25	1.0	100	96	16,124	2025/9/18
ACAFP 1.5% 10/06/31	1.5	200	163	27,247	2031/10/6

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
ACAFP 1.875% 04/22/27	1.875	100	96	16,059	2027/4/22
ACAFP 2% 07/17/30	2.0	100	86	14,491	2030/7/17
ACAFP 4.125% 03/07/30	4.125	100	102	17,152	2030/3/7
ADPFP 2.125% 10/02/26	2.125	100	96	16,166	2026/10/2
AIFP 2.875% 09/16/32	2.875	100	96	16,054	2032/9/16
AKEFP 0.75% 12/03/29	0.75	200	170	28,455	2029/12/3
ALOFP 0.125% 07/27/27	0.125	100	88	14,812	2027/7/27
ARRFP 0% 06/19/28	－	100	86	14,500	2028/6/19
AXASA 1.875% 07/10/42	1.875	100	82	13,750	2042/7/10
AXASA 3.625% 01/10/33	3.625	100	101	17,017	2033/1/10
BFCM 0.01% 05/11/26	0.01	100	92	15,503	2026/5/11
BFCM 3.875% 01/26/28	3.875	100	100	16,706	2028/1/26
BFCM 4% 11/21/29	4.0	100	101	16,951	2029/11/21
BFCM 4.375% 01/11/34	4.375	100	97	16,244	2034/1/11
BNFP 0% 12/01/25	－	100	94	15,803	2025/12/1
BNFP 1% PERP	1.0	100	91	15,359	－
BNFP 3.071% 09/07/32	3.071	100	96	16,107	2032/9/7
BNP 0.625% 12/03/32	0.625	100	75	12,654	2032/12/3
BNP 2.125% 01/23/27	2.125	100	97	16,208	2027/1/23
BNP 2.5% 03/31/32	2.5	100	94	15,785	2032/3/31
BPCECB 1.75% 05/27/32	1.75	100	89	14,909	2032/5/27
BPCECB 3% 10/17/29	3.0	100	98	16,475	2029/10/17
BPCECB 3.125% 07/20/27	3.125	200	198	33,219	2027/7/20
BPCECB 3.25% 04/12/28	3.25	200	199	33,350	2028/4/12
BPCEGP 0.5% 09/15/27	0.5	100	92	15,400	2027/9/15
BPCEGP 0.75% 03/03/31	0.75	100	81	13,598	2031/3/3
BPCEGP 2.25% 03/02/32	2.25	100	94	15,728	2032/3/2
BPCEGP 3.625% 04/17/26	3.625	200	199	33,347	2026/4/17
CAFFIL 0.01% 02/22/28	0.01	100	88	14,746	2028/2/22
CAFFIL 0.01% 03/18/31	0.01	500	400	66,951	2031/3/18
CAFFIL 0.125% 06/30/31	0.125	100	80	13,388	2031/6/30
CAFFIL 0.5% 10/01/46	0.5	200	111	18,630	2046/10/1
CAFFIL 3.125% 11/24/33	3.125	400	394	65,916	2033/11/24
CAFP 1.875% 10/30/26	1.875	100	95	16,010	2026/10/30
CAPFP 1.625% 04/15/26	1.625	100	96	16,119	2026/4/15
CAPFP 2% 04/15/29	2.0	100	93	15,663	2029/4/15
CFF 0.01% 10/25/27	0.01	100	89	14,901	2027/10/25
CFF 0.01% 10/29/35	0.01	100	68	11,430	2035/10/29
CFF 0.6% 10/25/41	0.6	100	63	10,569	2041/10/25
CFF 3.375% 09/16/31	3.375	100	100	16,810	2031/9/16
CMCICB 3.125% 06/22/27	3.125	100	99	16,617	2027/6/22
CNPFP 1.25% 01/27/29	1.25	100	87	14,669	2029/1/27
CNPFP 5.25% 07/18/53	5.25	100	103	17,209	2053/7/18
COVFP 1.125% 09/17/31	1.125	100	82	13,723	2031/9/17
CRH 3% 01/11/30	3.0	100	98	16,484	2030/1/11
CRH 3.125% 02/23/33	3.125	400	394	65,968	2033/2/23
DECFP 1.625% 02/07/30	1.625	100	86	14,449	2030/2/7
DEXGRP 0% 01/21/28	－	100	88	14,830	2028/1/21
DEXGRP 0.01% 01/22/27	0.01	100	91	15,279	2027/1/22
DGFP 0% 11/27/28	－	100	86	14,461	2028/11/27
DGFP 0.5% 01/09/32	0.5	100	79	13,356	2032/1/9

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
DSYFP 0.375% 09/16/29	0.375	100	85	14,266	2029/9/16
EDENFP 3.625% 12/13/26	3.625	100	99	16,652	2026/12/13
EFFP 0.375% 01/05/26	0.375	100	95	15,874	2026/1/5
ENFP 2.25% 06/29/29	2.25	100	94	15,724	2029/6/29
ENFP 3.25% 06/30/37	3.25	100	94	15,711	2037/6/30
ENGIFP 1.75% 03/27/28	1.75	100	93	15,599	2028/3/27
ENGIFP 2.125% 03/30/32	2.125	100	89	14,892	2032/3/30
ENGIFP 3.625% 01/11/30	3.625	100	99	16,699	2030/1/11
ENGIFP 4.5% 09/06/42	4.5	100	102	17,119	2042/9/6
GFCFP 0.875% 01/25/33	0.875	100	78	13,129	2033/1/25
HOFP 0% 03/26/26	－	100	93	15,592	2026/3/26
KERFP 3.25% 02/27/29	3.25	100	98	16,464	2029/2/27
KERFP 3.375% 02/27/33	3.375	100	96	16,188	2033/2/27
LIFP 2% 05/12/29	2.0	100	91	15,340	2029/5/12
LRFP 0.75% 05/20/30	0.75	100	86	14,408	2030/5/20
MCFP 0.375% 02/11/31	0.375	100	82	13,824	2031/2/11
NK 1% 07/15/31	1.0	100	79	13,262	2031/7/15
ORAFP 0% 06/29/26	－	100	92	15,475	2026/6/29
ORAFP 1.25% 07/07/27	1.25	100	93	15,626	2027/7/7
ORAFP 3.625% 11/16/31	3.625	100	100	16,844	2031/11/16
ORFP 0.875% 06/29/26	0.875	100	94	15,846	2026/6/29
RENAUL 4.125% 12/01/25	4.125	200	200	33,455	2025/12/1
RIFP 1.375% 04/07/29	1.375	100	90	15,121	2029/4/7
RIFP 1.75% 04/08/30	1.75	100	90	15,124	2030/4/8
SANFP 1% 03/21/26	1.0	100	95	15,971	2026/3/21
SANFP 1.25% 03/21/34	1.25	100	83	13,897	2034/3/21
SGOFP 1.625% 08/10/25	1.625	100	97	16,260	2025/8/10
SGOFP 3.875% 11/29/30	3.875	100	100	16,850	2030/11/29
SOCGEN 0.5% 06/12/29	0.5	100	86	14,434	2029/6/12
SOCGEN 1.125% 06/30/31	1.125	100	92	15,505	2031/6/30
SOCGEN 5.25% 09/06/32	5.25	100	102	17,078	2032/9/6
SOCSFH 0.01% 12/02/26	0.01	100	91	15,353	2026/12/2
SOCSFH 1.75% 05/05/34	1.75	100	86	14,517	2034/5/5
SOCSFH 3.125% 02/24/32	3.125	100	99	16,555	2032/2/24
SOCSFH 3.375% 07/31/30	3.375	500	503	84,154	2030/7/31
SUFP 3.375% 04/13/34	3.375	100	98	16,444	2034/4/13
SWFP 1% 07/17/28	1.0	100	90	15,168	2028/7/17
TOTAL 1.491% 04/08/27	1.491	100	94	15,770	2027/4/8
TTEFP 2.125% PERP	2.125	100	81	13,695	－
ULFP 0.625% 05/04/27	0.625	100	91	15,209	2027/5/4
ULFP 0.875% 03/29/32	0.875	100	78	13,179	2032/3/29
ULFP 1.375% 05/25/33	1.375	200	158	26,465	2033/5/25
ULFP 1.75% 02/27/34	1.75	100	82	13,710	2034/2/27
VIEFP 0% 06/09/26	－	100	92	15,480	2026/6/9
VIEFP 1.625% 09/17/30	1.625	100	88	14,782	2030/9/17
VIEFP 1.94% 01/07/30	1.94	100	91	15,250	2030/1/7
VIVFP 1.125% 12/11/28	1.125	100	94	15,809	2028/12/11
（オランダ）					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/26	－	360	341	57,079	2026/1/15
NETHER 0% 01/15/27	－	130	120	20,100	2027/1/15

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% 01/15/29	－	100	87	14,662	2029/1/15
NETHER 0% 01/15/38	－	160	106	17,804	2038/1/15
NETHER 0% 01/15/52	－	300	137	22,967	2052/1/15
NETHER 0% 07/15/30	－	130	109	18,311	2030/7/15
NETHER 0% 07/15/31	－	210	172	28,780	2031/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	240	231	38,655	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	170	149	24,957	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	210	145	24,279	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	170	161	26,902	2026/7/15
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	110	91	15,275	2032/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	250	234	39,115	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	330	303	50,703	2028/7/15
NETHER 2% 01/15/54	2.0	80	65	10,907	2054/1/15
NETHER 2.5% 01/15/30	2.5	220	216	36,160	2030/1/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	340	331	55,298	2033/1/15
NETHER 2.5% 07/15/33	2.5	110	106	17,825	2033/7/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	230	222	37,142	2047/1/15
NETHER 3.25% 01/15/44	3.25	120	124	20,801	2044/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	270	297	49,686	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	240	265	44,391	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	170	185	31,015	2028/1/15
特殊債券(除く金融債)					
BNG 0.01% 10/05/32	0.01	200	154	25,751	2032/10/5
BNG 0.125% 04/11/26	0.125	200	188	31,459	2026/4/11
BNG 0.125% 07/09/35	0.125	100	71	11,900	2035/7/9
BNG 0.75% 01/24/29	0.75	100	89	14,991	2029/1/24
BNG 0.805% 06/28/49	0.805	100	55	9,229	2049/6/28
BNG 1.25% 03/30/37	1.25	100	78	13,036	2037/3/30
BNG 2.75% 10/04/27	2.75	100	98	16,519	2027/10/4
BNG 3% 04/23/30	3.0	100	99	16,607	2030/4/23
NEDFIN 0.125% 04/03/27	0.125	100	91	15,321	2027/4/3
NEDWBK 0% 02/16/37	－	300	197	32,970	2037/2/16
NEDWBK 0.5% 04/26/51	0.5	100	49	8,206	2051/4/26
NEDWBK 0.75% 10/04/41	0.75	100	64	10,757	2041/10/4
普通社債券(含む投資法人債券)					
ABNANV 0.375% 01/14/35	0.375	100	73	12,357	2035/1/14
ABNANV 3.625% 01/10/26	3.625	100	100	16,717	2026/1/10
ABNANV 5.125% 02/22/33	5.125	100	101	16,989	2033/2/22
ADNA 3.5% 04/04/28	3.5	100	100	16,730	2028/4/4
AIRFP 1.625% 06/09/30	1.625	200	180	30,164	2030/6/9
AIRFP 2.375% 06/09/40	2.375	100	82	13,776	2040/6/9
AKZANA 1.5% 03/28/28	1.5	100	92	15,372	2028/3/28
ASRNED 7% 12/07/43	7.0	100	111	18,617	2043/12/7
BATSLN 3.125% 04/07/28	3.125	100	97	16,251	2028/4/7
BMW 0% 01/11/26	－	200	189	31,662	2026/1/11
BMW 0.2% 01/11/33	0.2	100	76	12,748	2033/1/11
BMW 1% 05/22/28	1.0	100	91	15,265	2028/5/22
EDPPL 1.625% 01/26/26	1.625	100	96	16,163	2026/1/26
ENELIM 1.25% 01/17/35	1.25	100	76	12,826	2035/1/17
ENELIM 3.875% 03/09/29	3.875	100	100	16,827	2029/3/9
ENXFP 0.75% 05/17/31	0.75	100	82	13,778	2031/5/17

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)	
EXOIM 0.875% 01/19/31	0.875	100	83	13,904	2031/1/19
HEIANA 2.25% 03/30/30	2.25	200	186	31,122	2030/3/30
IBESM 1.874% PERP	1.874	100	95	15,933	－
INTNED 0.5% 02/17/27	0.5	500	462	77,208	2027/2/17
INTNED 1% 02/17/37	1.0	200	151	25,237	2037/2/17
INTNED 2.75% 11/21/25	2.75	100	98	16,526	2025/11/21
INTNED 3% 02/15/26	3.0	200	198	33,149	2026/2/15
INTNED 3% 02/15/33	3.0	100	98	16,426	2033/2/15
INTNED 4.5% 05/23/29	4.5	100	102	17,051	2029/5/23
JAPTOB 2.375 04/07/81	2.375	100	96	16,042	2081/4/7
JDEPNA 0% 01/16/26	－	200	187	31,250	2026/1/16
KPN 3.875% 02/16/36	3.875	100	97	16,327	2036/2/16
MBGGR 1.375% 06/26/26	1.375	100	95	16,029	2026/6/26
NNGRNV 0.875% 11/23/31	0.875	100	83	13,898	2031/11/23
NTGYSM 1.25% 01/15/26	1.25	100	95	16,013	2026/1/15
PHIANA 2.625% 05/05/33	2.625	100	88	14,787	2033/5/5
PRXNA 2.031% 08/03/32	2.031	100	80	13,428	2032/8/3
RABOBK 3.064% 02/01/34	3.064	200	197	33,038	2034/2/1
RABOBK 3.822% 07/26/34	3.822	200	199	33,264	2034/7/26
RABOBK 3.875% 11/30/32	3.875	100	98	16,499	2032/11/30
RDSALN 1.5% 04/07/28	1.5	100	92	15,508	2028/4/7
RDSALN 1.875% 04/07/32	1.875	100	88	14,771	2032/4/7
SIEGR 0.375% 06/05/26	0.375	100	94	15,715	2026/6/5
SIEGR 1% 02/25/30	1.0	100	88	14,718	2030/2/25
SIEGR 3.5% 02/24/36	3.5	100	99	16,611	2036/2/24
SIEGR 3.625% 02/24/43	3.625	100	98	16,382	2043/2/24
STLA 1.25% 06/20/33	1.25	100	79	13,317	2033/6/20
STLA 2.75% 05/15/26	2.75	100	98	16,379	2026/5/15
STLA 3.75% 03/19/36	3.75	200	195	32,594	2036/3/19
TENN 0.125% 12/09/27	0.125	100	92	15,525	2027/12/9
TENN 0.875% 06/16/35	0.875	100	84	14,167	2035/6/16
TENN 2.125% 11/17/29	2.125	200	190	31,807	2029/11/17
UNANA 0.75% 02/28/26	0.75	100	95	15,937	2026/2/28
UNANA 3.25% 02/23/31	3.25	100	99	16,596	2031/2/23
VW 1.5% 01/21/41	1.5	200	135	22,637	2041/1/21
VW 3.75% 09/28/27	3.75	100	99	16,691	2027/9/28
VW 3.875% 03/29/26	3.875	300	300	50,137	2026/3/29
VW 4.125% 11/15/25	4.125	100	100	16,765	2025/11/15
VW 4.25% 02/15/28	4.25	100	101	16,943	2028/2/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/26	－	330	312	52,124	2026/1/31
SPGB 0% 01/31/27	－	230	211	35,279	2027/1/31
SPGB 0% 01/31/28	－	400	356	59,633	2028/1/31
SPGB 0% 05/31/25	－	220	211	35,407	2025/5/31
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	260	210	35,212	2031/4/30
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	350	300	50,249	2030/4/30
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	670	551	92,091	2031/10/31
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	400	350	58,512	2029/10/31
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	370	304	50,917	2032/4/30
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	300	278	46,602	2027/7/30
SPGB 0.8% 07/30/29	0.8	350	311	52,043	2029/7/30

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	200	142	23,743	2037/7/30
SPGB 1% 07/30/42	1.0	100	63	10,657	2042/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	330	174	29,214	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	390	268	44,808	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	300	267	44,612	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	300	286	47,918	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	260	243	40,737	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	600	561	93,723	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	320	296	49,501	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	280	265	44,281	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	160	76	12,739	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	510	486	81,319	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	180	176	29,532	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	290	246	41,174	2035/7/30
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	250	163	27,349	2052/10/31
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	290	282	47,258	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	430	401	67,149	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	360	354	59,159	2025/10/31
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	350	322	53,931	2033/7/30
SPGB 2.55% 10/31/32	2.55	300	284	47,442	2032/10/31
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	270	220	36,757	2048/10/31
SPGB 2.8% 05/31/26	2.8	850	842	140,736	2026/5/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	270	231	38,712	2046/10/31
SPGB 3.15% 04/30/33	3.15	350	345	57,669	2033/4/30
SPGB 3.25% 04/30/34	3.25	280	275	46,104	2034/4/30
SPGB 3.45% 07/30/43	3.45	210	198	33,146	2043/7/30
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	200	177	29,626	2066/7/30
SPGB 3.5% 05/31/29	3.5	410	417	69,788	2029/5/31
SPGB 3.55% 10/31/33	3.55	230	233	38,945	2033/10/31
SPGB 3.9% 07/30/39	3.9	240	244	40,832	2039/7/30
SPGB 4% 10/31/54	4.0	90	89	14,990	2054/10/31
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	310	329	55,113	2037/1/31
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	350	355	59,369	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	250	279	46,702	2041/7/30
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	270	306	51,239	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	580	630	105,352	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	210	248	41,540	2044/10/31
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	230	271	45,340	2032/7/30
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	210	221	37,082	2026/7/30
地方債証券					
MADRID 0.16% 07/30/28	0.16	100	87	14,678	2028/7/30
MADRID 3.596% 04/30/33	3.596	100	100	16,820	2033/4/30
普通社債券（含む投資法人債券）					
ABESM 1.25% 02/07/28	1.25	100	90	15,160	2028/2/7
BBVASM 1.75% 11/26/25	1.75	100	97	16,209	2025/11/26
BBVASM 3.875% 01/15/34	3.875	200	200	33,558	2034/1/15
BBVASM 5.75% 09/15/33	5.75	100	104	17,412	2033/9/15
BKTSM 1.25% 12/23/32	1.25	100	89	15,006	2032/12/23
CABKSM 0.375% 11/18/26	0.375	100	94	15,797	2026/11/18
CABKSM 0.75% 07/09/26	0.75	100	93	15,665	2026/7/9
CABKSM 5.375% 11/14/30	5.375	100	106	17,812	2030/11/14
CABKSM 6.25% 02/23/33	6.25	100	104	17,532	2033/2/23
COLSM 0.75% 06/22/29	0.75	100	85	14,282	2029/6/22
IBESM 3.375% 11/22/32	3.375	100	98	16,376	2032/11/22
IBESM 3.625% 07/13/33	3.625	100	99	16,624	2033/7/13
MAPSM 2.875% 04/13/30	2.875	100	91	15,338	2030/4/13
MRLSM 1.75% 05/26/25	1.75	100	97	16,325	2025/5/26
REESM 4.625% PERP	4.625	200	203	33,961	－
SABSM 1.125% 03/11/27	1.125	100	95	15,890	2027/3/11
SABSM 1.75% 05/30/29	1.75	200	183	30,669	2029/5/30
SANTAN 1.625% 10/22/30	1.625	100	84	14,144	2030/10/22
SANTAN 3.375% 01/11/26	3.375	500	498	83,203	2026/1/11
SANTAN 3.375% 01/11/30	3.375	200	199	33,274	2030/1/11
SANTAN 3.75% 01/16/26	3.75	100	100	16,720	2026/1/16
SANTAN 4.25% 06/12/30	4.25	100	102	17,177	2030/6/12
TELEFO 1.788% 03/12/29	1.788	100	92	15,410	2029/3/12
TELEFO 4.055% 01/24/36	4.055	100	99	16,546	2036/1/24
（ベルギー）					
国債証券					
BGB 0% 10/22/27	－	200	180	30,209	2027/10/22
BGB 0% 10/22/31	－	50	40	6,700	2031/10/22
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	170	143	23,940	2030/6/22
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	460	371	62,095	2032/6/22
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	90	56	9,446	2040/6/22
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	60	23	4,004	2071/6/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	330	320	53,521	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	210	196	32,834	2027/6/22
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	170	156	26,110	2028/6/22
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	200	181	30,266	2029/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	120	114	19,191	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	180	157	26,303	2031/6/22
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	210	180	30,229	2033/4/22
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	110	67	11,252	2053/6/22
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	50	40	6,720	2037/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	120	83	14,014	2047/6/22
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	270	186	31,075	2050/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	130	108	18,185	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	140	101	16,894	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	60	44	7,501	2057/6/22
BGB 2.75% 04/22/39	2.75	80	74	12,391	2039/4/22
BGB 2.85% 10/22/34	2.85	150	145	24,350	2034/10/22
BGB 3% 06/22/33	3.0	100	99	16,583	2033/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	140	138	23,124	2034/6/22
BGB 3.3% 06/22/54	3.3	100	94	15,793	2054/6/22
BGB 3.45% 06/22/43	3.45	90	89	14,928	2043/6/22
BGB 3.5% 06/22/55	3.5	80	78	13,064	2055/6/22
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	160	165	27,695	2045/6/22
BGB 4% 03/28/32	4.0	140	149	24,992	2032/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	230	253	42,366	2041/3/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	210	215	35,970	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	280	326	54,466	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	320	350	58,498	2028/3/28

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
普通社債券（含む投資法人債券）					
ABIBB 2.125% 12/02/27	2.125	100	96	16,084	2027/12/2
ABIBB 2.875% 04/02/32	2.875	100	95	15,946	2032/4/2
COFBBB 1% 01/24/28	1.0	100	89	14,934	2028/1/24
GBLBBB 0.125% 01/28/31	0.125	100	79	13,242	2031/1/28
KBCBB 0.125% 01/14/29	0.125	100	87	14,587	2029/1/14
KBCBB 4.375% 11/23/27	4.375	100	101	16,943	2027/11/23
PROXBB 4% 03/08/30	4.0	100	101	16,986	2030/3/8
（オーストリア）					
国債証券					
RAGB 0% 02/20/30	－	100	84	14,112	2030/2/20
RAGB 0% 02/20/31	－	180	147	24,618	2031/2/20
RAGB 0% 04/20/25	－	90	87	14,542	2025/4/20
RAGB 0% 10/20/28	－	130	114	19,109	2028/10/20
RAGB 0% 10/20/40	－	80	47	7,872	2040/10/20
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	120	83	14,016	2036/10/20
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	280	249	41,756	2029/2/20
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	160	148	24,867	2027/4/20
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	70	29	4,982	2071/4/20
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	280	258	43,169	2028/2/20
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	150	83	14,018	2051/3/20
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	320	303	50,642	2026/10/20
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	30	12	2,123	2120/6/30
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	180	153	25,678	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	40	38	6,487	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	110	78	13,164	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	20	11	1,900	2086/11/2
RAGB 1.85% 05/23/49	1.85	90	68	11,393	2049/5/23
RAGB 2% 07/15/26	2.0	150	146	24,508	2026/7/15
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	100	71	11,944	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	130	122	20,417	2034/5/23
RAGB 2.9% 02/20/33	2.9	200	197	32,959	2033/2/20
RAGB 2.9% 02/20/34	2.9	80	78	13,124	2034/2/20
RAGB 2.9% 05/23/29	2.9	60	60	10,032	2029/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	120	117	19,635	2044/6/20
RAGB 3.15% 10/20/53	3.15	50	48	8,107	2053/10/20
RAGB 3.45% 10/20/30	3.45	120	123	20,609	2030/10/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	70	77	12,917	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	190	208	34,856	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	70	72	12,058	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	100	109	18,360	2027/7/15
特殊債券（除く金融債）					
ASFING 0.125% 06/02/31	0.125	100	81	13,615	2031/6/2
OKB 1.5% 07/13/27	1.5	100	94	15,868	2027/7/13
普通社債券（含む投資法人債券）					
ERSTBK 0.875% 05/22/26	0.875	200	188	31,498	2026/5/22
ERSTBK 4% 01/16/31	4.0	100	101	16,892	2031/1/16
OMVAV 2.375% 04/09/32	2.375	100	92	15,515	2032/4/9
OMVAV 2.5% PERP	2.5	100	95	15,922	－
RBIAV 4.125% 09/08/25	4.125	100	99	16,699	2025/9/8
RBIAV 7.375% 12/20/32	7.375	100	103	17,265	2032/12/20
（ルクセンブルク）					
普通社債券（含む投資法人債券）					
ARNDTN 0.375% 04/15/27	0.375	100	84	14,099	2027/4/15
DHR 0.2% 03/18/26	0.2	100	93	15,678	2026/3/18
ERFFP 4% 07/06/29	4.0	100	99	16,631	2029/7/6
HOLNSW 0.125% 07/19/27	0.125	100	89	14,956	2027/7/19
HOLNSW 0.5% 09/03/30	0.5	100	81	13,659	2030/9/3
NESNVX 0% 06/14/26	－	100	93	15,585	2026/6/14
NESNVX 0.875% 06/14/41	0.875	100	67	11,219	2041/6/14
NESNVX 3.5% 12/13/27	3.5	100	100	16,852	2027/12/13
NOVNVX 0% 09/23/28	－	100	86	14,503	2028/9/23
SESGFP 3.5% 01/14/29	3.5	100	97	16,209	2029/1/14
（フィンランド）					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/26	－	70	65	10,890	2026/9/15
RFGB 0% 09/15/30	－	100	83	13,873	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	50	34	5,834	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	70	31	5,203	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	130	105	17,653	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	30	18	3,114	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	40	38	6,355	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	30	18	3,069	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	70	64	10,785	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	160	144	24,092	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	50	44	7,357	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	50	43	7,202	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	140	135	22,666	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	80	66	11,144	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/27	1.375	50	47	7,976	2027/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	70	49	8,207	2047/4/15
RFGB 1.5% 09/15/32	1.5	90	79	13,349	2032/9/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	90	82	13,714	2042/7/4
RFGB 2.75% 04/15/38	2.75	80	75	12,591	2038/4/15
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	100	99	16,601	2028/7/4
RFGB 2.875% 04/15/29	2.875	40	39	6,663	2029/4/15
RFGB 2.95% 04/15/55	2.95	60	56	9,429	2055/4/15
RFGB 3% 09/15/33	3.0	50	49	8,305	2033/9/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	50	50	8,418	2025/7/4
普通社債券（含む投資法人債券）					
NDAFH 0.5% 05/14/27	0.5	200	183	30,709	2027/5/14
NDASS 1% 03/30/29	1.0	200	180	30,085	2029/3/30
NDASS 1.125% 02/16/27	1.125	100	93	15,595	2027/2/16
NESVFH 3.875% 03/16/29	3.875	100	100	16,843	2029/3/16
NOKIA 4.375% 08/21/31	4.375	100	100	16,791	2031/8/21
OPBANK 0.375% 06/16/28	0.375	200	174	29,232	2028/6/16
OPBANK 2.875% 12/15/25	2.875	100	98	16,507	2025/12/15
OPBANK 4.125% 04/18/27	4.125	100	101	16,972	2027/4/18
（アイルランド）					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	－	120	97	16,227	2031/10/18

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)	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	60	55	9,245	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	60	50	8,480	2030/10/18
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	40	32	5,417	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	50	37	6,308	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	80	52	8,780	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	170	157	26,346	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	180	172	28,878	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	170	156	26,110	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	110	95	16,025	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	100	90	15,169	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	120	83	13,985	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	130	110	18,432	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	200	163	27,361	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	140	136	22,808	2030/5/15
IRISH 3% 10/18/43	3.0	20	19	3,248	2043/10/18
普通社債券（含む投資法人債券）					
AIB 3.625% 07/04/26	3.625	100	99	16,653	2026/7/4
DELL 0.5% 10/27/26	0.5	100	92	15,472	2026/10/27
DELL 4.5% 10/18/27	4.5	100	102	17,079	2027/10/18
FREGR 0.5% 10/01/28	0.5	100	87	14,615	2028/10/1
JCI 4.25% 05/23/35	4.25	100	102	17,046	2035/5/23
LIN 1.625% 03/31/35	1.625	100	82	13,784	2035/3/31
（ギリシャ）					
国債証券					
GGB 3.875% 06/15/28	3.875	300	308	51,476	2028/6/15
GGB 4.25% 06/15/33	4.25	300	315	52,774	2033/6/15
GGB 4.375% 07/18/38	4.375	250	261	43,662	2038/7/18
（ポルトガル）					
国債証券					
PGB 0.3% 10/17/31	0.3	70	57	9,640	2031/10/17
PGB 0.475% 10/18/30	0.475	70	60	10,059	2030/10/18
PGB 0.7% 10/15/27	0.7	100	93	15,554	2027/10/15
PGB 1% 04/12/52	1.0	80	43	7,202	2052/4/12
PGB 1.15% 04/11/42	1.15	70	47	7,999	2042/4/11
PGB 1.65% 07/16/32	1.65	150	134	22,547	2032/7/16
PGB 1.95% 06/15/29	1.95	100	95	16,025	2029/6/15
PGB 2.125% 10/17/28	2.125	200	194	32,549	2028/10/17
PGB 2.875% 07/21/26	2.875	240	239	40,008	2026/7/21
PGB 2.875% 10/15/25	2.875	100	99	16,638	2025/10/15
PGB 2.875% 10/20/34	2.875	250	241	40,364	2034/10/20
PGB 3.5% 06/18/38	3.5	100	100	16,737	2038/6/18
PGB 3.875% 02/15/30	3.875	180	189	31,723	2030/2/15
PGB 4.1% 02/15/45	4.1	50	53	8,871	2045/2/15
PGB 4.1% 04/15/37	4.1	120	128	21,517	2037/4/15
PGB 4.125% 04/14/27	4.125	100	103	17,309	2027/4/14
（その他）					
国債証券					
BGARIA 4.125% 09/23/29	4.125	100	103	17,211	2029/9/23
CHILE 0.555% 01/21/29	0.555	200	174	29,102	2029/1/21
CHILE 1.3% 07/26/36	1.3	100	74	12,478	2036/7/26
ICELND 0% 04/15/28	－	100	87	14,628	2028/4/15

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)	
ISRAEL 1.5% 01/16/29	1.5	100	88	14,740	2029/1/16
ISRAEL 2.5% 01/16/49	2.5	100	75	12,572	2049/1/16
KSA 0.75% 07/09/27	0.75	100	91	15,266	2027/7/9
MEX 2.125% 10/25/51	2.125	100	57	9,611	2051/10/25
POLAND 2.375% 01/18/36	2.375	100	86	14,404	2036/1/18
POLAND 3.875% 02/14/33	3.875	100	102	17,087	2033/2/14
POLAND 4.125% 01/11/44	4.125	100	98	16,476	2044/1/11
REPHUN 5% 02/22/27	5.0	100	102	17,188	2027/2/22
ROMANI 2% 01/28/32	2.0	100	77	13,024	2032/1/28
ROMANI 2% 04/14/33	2.0	100	74	12,519	2033/4/14
ROMANI 2.125% 03/07/28	2.125	100	91	15,329	2028/3/7
ROMANI 2.625% 12/02/40	2.625	100	65	10,866	2040/12/2
ROMANI 2.75% 02/26/26	2.75	300	293	49,073	2026/2/26
ROMANI 2.75% 04/14/41	2.75	100	65	10,926	2041/4/14
ROMANI 3.624% 05/26/30	3.624	100	91	15,258	2030/5/26
ROMANI 3.875% 10/29/35	3.875	100	83	14,010	2035/10/29
ROMANI 5% 09/27/26	5.0	100	102	17,108	2026/9/27
ROMANI 6.375% 09/18/33	6.375	100	104	17,498	2033/9/18
地方債証券					
ALTA 0.625% 01/16/26	0.625	200	190	31,891	2026/1/16
KOMINS 0.875% 09/01/29	0.875	100	89	14,981	2029/9/1
KOMINS 2.875% 05/23/30	2.875	100	99	16,587	2030/5/23
KOMINS 3.375% 03/15/27	3.375	400	402	67,236	2027/3/15
KOMMUN 0% 11/17/29	－	100	84	14,134	2029/11/17
KOMMUN 3.375% 04/26/43	3.375	200	198	33,196	2043/4/26
ONT 0.01% 11/25/30	0.01	100	80	13,525	2030/11/25
ONT 0.25% 06/09/31	0.25	100	80	13,513	2031/6/9
Q 0.875% 05/04/27	0.875	100	93	15,548	2027/5/4
Q 1.125% 10/28/25	1.125	100	96	16,134	2025/10/28
Q 3% 01/24/33	3.0	100	97	16,320	2033/1/24
特殊債券(除く金融債)					
AFDB 0.5% 03/22/27	0.5	100	92	15,470	2027/3/22
AFDB 2.25% 09/14/29	2.25	100	95	16,019	2029/9/14
ASIA 0.025% 01/31/30	0.025	100	84	14,066	2030/1/31
ASIA 1.95% 07/22/32	1.95	200	183	30,652	2032/7/22
CAF 0.25% 02/04/26	0.25	200	187	31,277	2026/2/4
COE 0.25% 01/19/32	0.25	100	81	13,549	2032/1/19
COE 1% 04/13/29	1.0	100	90	15,167	2029/4/13
DBJJP 3.125% 04/13/28	3.125	100	99	16,574	2028/4/13
EDC 0.25% 03/07/26	0.25	200	189	31,585	2026/3/7
EFSF 0% 01/20/31	－	100	81	13,654	2031/1/20
EFSF 0% 07/20/26	－	300	279	46,722	2026/7/20
EFSF 0% 10/15/25	－	100	95	15,926	2025/10/15
EFSF 0.05% 10/17/29	0.05	100	85	14,224	2029/10/17
EFSF 0.7% 01/17/53	0.7	200	103	17,273	2053/1/17
EFSF 0.875% 04/10/35	0.875	100	78	13,172	2035/4/10
EFSF 0.875% 09/05/28	0.875	100	91	15,244	2028/9/5
EFSF 1.5% 12/15/25	1.5	100	97	16,234	2025/12/15
EFSF 1.75% 07/17/53	1.75	200	140	23,509	2053/7/17
EFSF 2.375% 06/21/32	2.375	300	285	47,634	2032/6/21
EFSF 2.875% 02/16/33	2.875	200	196	32,885	2033/2/16
EFSF 3% 09/04/34	3.0	42	41	6,930	2034/9/4

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)	
EIB 0% 03/13/26	－	100	94	15,756	2026/3/13
EIB 0% 05/15/28	－	200	177	29,615	2028/5/15
EIB 0% 06/17/27	－	100	90	15,196	2027/6/17
EIB 0% 09/09/30	－	100	82	13,827	2030/9/9
EIB 0.01% 05/15/41	0.01	500	288	48,246	2041/5/15
EIB 0.01% 11/15/35	0.01	100	69	11,671	2035/11/15
EIB 0.05% 10/13/34	0.05	100	73	12,195	2034/10/13
EIB 0.05% 11/15/29	0.05	100	85	14,224	2029/11/15
EIB 0.2% 03/17/36	0.2	300	211	35,405	2036/3/17
EIB 0.25% 01/20/32	0.25	100	81	13,567	2032/1/20
EIB 0.25% 06/15/40	0.25	100	62	10,427	2040/6/15
EIB 0.375% 05/15/26	0.375	500	472	79,003	2026/5/15
EIB 0.375% 09/15/27	0.375	100	91	15,287	2027/9/15
EIB 0.625% 01/22/29	0.625	100	89	14,971	2029/1/22
EIB 2.75% 01/16/34	2.75	200	194	32,470	2034/1/16
EIB 2.75% 07/28/28	2.75	100	99	16,546	2028/7/28
EIB 3% 07/15/33	3.0	300	298	49,793	2033/7/15
EIB 3.625% 03/14/42	3.625	100	103	17,330	2042/3/14
EIBKOR 1.375% 11/24/25	1.375	100	96	16,088	2025/11/24
EIBKOR 3.5% 06/07/26	3.5	200	199	33,255	2026/6/7
ESM 0% 12/15/26	－	200	184	30,796	2026/12/15
ESM 0.01% 10/15/31	0.01	100	80	13,413	2031/10/15
ESM 0.5% 03/05/29	0.5	200	177	29,664	2029/3/5
ESM 3% 03/15/28	3.0	200	199	33,339	2028/3/15
ESM 3% 08/23/33	3.0	100	99	16,631	2033/8/23
EU 0% 03/04/26	－	300	283	47,282	2026/3/4
EU 0% 07/04/31	－	100	80	13,511	2031/7/4
EU 0% 07/04/35	－	400	281	46,989	2035/7/4
EU 0% 07/06/26	－	100	93	15,628	2026/7/6
EU 0% 10/04/28	－	800	702	117,315	2028/10/4
EU 0% 10/04/30	－	100	82	13,824	2030/10/4
EU 0% 11/04/25	－	600	571	95,417	2025/11/4
EU 0.25% 04/22/36	0.25	100	70	11,825	2036/4/22
EU 0.3% 11/04/50	0.3	200	94	15,844	2050/11/4
EU 0.4% 02/04/37	0.4	100	70	11,857	2037/2/4
EU 0.45% 05/02/46	0.45	700	386	64,630	2046/5/2
EU 0.45% 07/04/41	0.45	200	124	20,864	2041/7/4
EU 0.7% 07/06/51	0.7	400	212	35,494	2051/7/6
EU 0.75% 01/04/47	0.75	100	59	9,902	2047/1/4
EU 0.8% 07/04/25	0.8	100	97	16,208	2025/7/4
EU 1% 07/06/32	1.0	100	85	14,283	2032/7/6
EU 1.125% 06/04/37	1.125	200	154	25,798	2037/6/4
EU 1.625% 12/04/29	1.625	100	93	15,549	2029/12/4
EU 2% 10/04/27	2.0	100	96	16,159	2027/10/4
EU 2.5% 10/04/52	2.5	100	82	13,832	2052/10/4
EU 2.625% 02/04/48	2.625	100	87	14,631	2048/2/4
EU 2.75% 02/04/33	2.75	100	97	16,326	2033/2/4
EU 2.75% 10/05/26	2.75	500	495	82,805	2026/10/5
EU 2.75% 12/04/37	2.75	200	188	31,442	2037/12/4
EU 3.375% 11/04/42	3.375	100	99	16,631	2042/11/4
EU 4% 04/04/44	4.0	200	215	36,080	2044/4/4

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)	
EUROF 0.01% 06/23/28	0.01	100	87	14,664	2028/6/23
EUROF 0.15% 10/10/34	0.15	100	73	12,297	2034/10/10
IBRD 0% 01/15/27	－	100	91	15,363	2027/1/15
IBRD 0% 02/21/30	－	200	168	28,067	2030/2/21
IBRD 0.01% 04/24/28	0.01	300	266	44,464	2028/4/24
IBRD 0.1% 09/17/35	0.1	100	71	11,860	2035/9/17
IBRD 0.2% 01/21/61	0.2	100	35	5,906	2061/1/21
IBRD 0.25% 01/10/50	0.25	200	95	16,035	2050/1/10
IBRD 0.5% 04/16/30	0.5	100	86	14,422	2030/4/16
IBRD 0.7% 10/22/46	0.7	100	59	9,897	2046/10/22
IBRD 2.9% 01/19/33	2.9	100	98	16,476	2033/1/19
IBRD 3.1% 04/14/38	3.1	100	97	16,300	2038/4/14
IDAWBG 0.7% 01/17/42	0.7	100	64	10,717	2042/1/17
IDAWBG 1.75% 05/05/37	1.75	100	83	13,992	2037/5/5
IDAWBG 2.5% 01/15/38	2.5	100	90	15,147	2038/1/15
IDBINV 3.125% 06/07/30	3.125	200	199	33,336	2030/6/7
IDBINV 3.125% 11/15/27	3.125	100	99	16,642	2027/11/15
JBIC 3.125% 02/15/28	3.125	100	99	16,582	2028/2/15
KDB 3.375% 05/23/28	3.375	200	198	33,204	2028/5/23
NIB 2.5% 01/30/30	2.5	100	97	16,279	2030/1/30
SBAB 0.5% 02/08/27	0.5	200	183	30,648	2027/2/8
SBAB 1.875% 12/10/25	1.875	100	97	16,228	2025/12/10
SEK 3.25% 04/13/26	3.25	100	99	16,644	2026/4/13
普通社債券（含む投資法人債券）					
AALLN 4.125% 03/15/32	4.125	100	99	16,647	2032/3/15
AALLN 4.5% 09/15/28	4.5	100	102	17,085	2028/9/15
AAPL 0.5% 11/15/31	0.5	100	82	13,743	2031/11/15
ABBV 0.75% 11/18/27	0.75	200	182	30,507	2027/11/18
ABBV 1.25% 11/18/31	1.25	100	85	14,316	2031/11/18
ABBV 2.125% 06/01/29	2.125	100	93	15,697	2029/6/1
AIA 0.88% 09/09/33	0.88	100	85	14,307	2033/9/9
AKERBP 1.125% 05/12/29	1.125	100	87	14,640	2029/5/12
AMT 0.875% 05/21/29	0.875	100	85	14,305	2029/5/21
AMXLMM 0.75% 06/26/27	0.75	100	91	15,337	2027/6/26
ANZNZ 0.2% 09/23/27	0.2	200	177	29,712	2027/9/23
ASABRE 0.336% 04/19/27	0.336	100	90	15,146	2027/4/19
ATDBCN 4.011% 02/12/36	4.011	200	196	32,753	2036/2/12
BAC 0.694% 03/22/31	0.694	100	83	13,916	2031/3/22
BAC 1.949% 10/27/26	1.949	400	388	64,918	2026/10/27
BACR 0.877% 01/28/28	0.877	200	183	30,731	2028/1/28
BACR 1.125% 03/22/31	1.125	100	93	15,562	2031/3/22
BHP 3.25% 09/24/27	3.25	100	99	16,545	2027/9/24
BMO 0.05% 06/08/29	0.05	100	84	14,113	2029/6/8
BMO 0.125% 01/26/27	0.125	200	182	30,491	2027/1/26
BMO 1% 04/05/26	1.0	200	190	31,868	2026/4/5
BMO 2.75% 10/13/26	2.75	1,000	983	164,226	2026/10/13
BNS 0.01% 09/14/29	0.01	100	83	13,960	2029/9/14
BNS 3.25% 01/18/28	3.25	200	198	33,181	2028/1/18
BPLN 3.25 PERP	3.25	100	97	16,253	－
BPLN 3.625% PERP	3.625	100	95	15,895	－
BRITEL 0.5% 09/12/25	0.5	100	95	15,963	2025/9/12

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
BRK 1.625% 03/16/35	1.625	100	81	13,629	2035/3/16
C 3.713% 09/22/28	3.713	100	99	16,691	2028/9/22
CARLB 4.25% 10/05/33	4.25	100	103	17,271	2033/10/5
CB 0.875% 06/15/27	0.875	100	92	15,386	2027/6/15
CCEP 1.75% 03/27/26	1.75	100	96	16,135	2026/3/27
CKHH 2% 04/13/30	2.0	100	89	14,941	2030/4/13
CM 0.01% 10/07/26	0.01	200	183	30,705	2026/10/7
CM 0.375% 03/10/26	0.375	400	377	63,052	2026/3/10
CMCSA 0.25% 05/20/27	0.25	100	90	15,151	2027/5/20
CPPIBC 0.75% 02/02/37	0.75	250	180	30,225	2037/2/2
DANBNK 0.75% 06/09/29	0.75	100	87	14,698	2029/6/9
DANBNK 4% 01/12/27	4.0	100	100	16,760	2027/1/12
DNBNO 0.01% 01/21/31	0.01	100	80	13,485	2031/1/21
DNBNO 3.625% 02/16/27	3.625	100	99	16,629	2027/2/16
DNBNO 4.5% 07/19/28	4.5	100	101	17,035	2028/7/19
DNBNO 5% 09/13/33	5.0	200	204	34,177	2033/9/13
EJRAIL 1.85% 04/13/33	1.85	100	87	14,597	2033/4/13
EJRAIL 3.245% 09/08/30	3.245	200	197	32,970	2030/9/8
EQNR 0.75% 05/22/26	0.75	100	94	15,766	2026/5/22
EQNR 1.375% 05/22/32	1.375	100	85	14,259	2032/5/22
FI 4.5% 05/24/31	4.5	100	103	17,241	2031/5/24
GM 0.85% 02/26/26	0.85	100	95	15,876	2026/2/26
GM 4.5% 11/22/27	4.5	100	102	17,039	2027/11/22
GS 0.25% 01/26/28	0.25	100	88	14,756	2028/1/26
GS 4% 09/21/29	4.0	100	101	17,017	2029/9/21
GSK 1.75% 05/21/30	1.75	100	90	15,188	2030/5/21
HNDA 3.75% 10/25/27	3.75	100	100	16,802	2027/10/25
HSBC 0.309% 11/13/26	0.309	100	94	15,817	2026/11/13
HSBC 3.019% 06/15/27	3.019	200	196	32,772	2027/6/15
HSBC 4.599% 03/22/35	4.599	200	198	33,186	2035/3/22
HSBC 4.787% 03/10/32	4.787	100	103	17,360	2032/3/10
HSBC 6.364% 11/16/32	6.364	100	106	17,726	2032/11/16
IMBLN 2.125% 02/12/27	2.125	100	95	15,961	2027/2/12
INFLN 2.125% 10/06/25	2.125	100	97	16,292	2025/10/6
JPM 0.389% 02/24/28	0.389	100	91	15,223	2028/2/24
JPM 1.963% 03/23/30	1.963	100	91	15,358	2030/3/23
KO 0.95% 05/06/36	0.95	100	74	12,505	2036/5/6
LLOYDS 3.125% 08/24/30	3.125	100	96	16,091	2030/8/24
LSELN 1.75% 12/06/27	1.75	200	188	31,529	2027/12/6
MAERSK 0.75% 11/25/31	0.75	100	80	13,430	2031/11/25
MDLZ 0.25% 03/17/28	0.25	100	88	14,740	2028/3/17
MET 4% 04/05/28	4.0	100	101	16,968	2028/4/5
MIZUHO 4.157% 05/20/28	4.157	100	101	17,008	2028/5/20
MO 2.2% 06/15/27	2.2	100	94	15,854	2027/6/15
MS 2.95% 05/07/32	2.95	200	188	31,492	2032/5/7
MS 4.813% 10/25/28	4.813	100	103	17,221	2028/10/25
MSFT 2.625% 05/02/33	2.625	100	96	16,183	2033/5/2
MUFG 0.337% 06/08/27	0.337	200	186	31,122	2027/6/8
MUFG 0.848% 07/19/29	0.848	200	176	29,521	2029/7/19
NAB 0.01% 01/06/29	0.01	100	85	14,277	2029/1/6
NAB 2.125% 05/24/28	2.125	100	94	15,858	2028/5/24

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)	
NAB 3.146% 02/05/31	3.146	500	495	82,748	2031/2/5
NAB 3.2627% 02/13/26	3.2627	1,000	994	166,183	2026/2/13
NACN 3.5% 04/25/28	3.5	200	200	33,486	2028/4/25
NDAQ 0.875% 02/13/30	0.875	100	85	14,324	2030/2/13
NGGLN 0.163% 01/20/28	0.163	100	87	14,639	2028/1/20
NGGLN 2.949% 03/30/30	2.949	100	95	15,928	2030/3/30
NSANY 2.652% 03/17/26	2.652	100	97	16,295	2026/3/17
NTT 0.342% 03/03/30	0.342	100	83	13,932	2030/3/3
NTT 0.399% 12/13/28	0.399	100	87	14,559	2028/12/13
NWG 0.125% 11/12/25	0.125	100	94	15,790	2025/11/12
NWG 5.763% 02/28/34	5.763	100	104	17,393	2034/2/28
NWIDE 2% 04/28/27	2.0	100	95	15,909	2027/4/28
ORIX 4.477% 06/01/28	4.477	100	102	17,143	2028/6/1
ORSTED 3.75% 03/01/30	3.75	100	100	16,786	2030/3/1
PEP 0.5% 05/06/28	0.5	100	89	14,946	2028/5/6
PLD 4.25% 01/31/43	4.25	100	96	16,133	2043/1/31
PLNIJ 1.875% 11/05/31	1.875	100	82	13,710	2031/11/5
PLNIJ 2.875% 10/25/25	2.875	100	98	16,411	2025/10/25
POWFIN 1.841% 09/21/28	1.841	100	88	14,852	2028/9/21
RELLN 1.3% 05/12/25	1.3	100	97	16,294	2025/5/12
RY 0.01% 10/05/28	0.01	100	86	14,399	2028/10/5
RY 0.625% 03/23/26	0.625	200	189	31,667	2026/3/23
RY 2.375% 09/13/27	2.375	1,000	966	161,427	2027/9/13
SEB 3.25% 05/04/28	3.25	100	99	16,654	2028/5/4
SEB 3.25% 11/24/25	3.25	100	99	16,586	2025/11/24
SEB 4% 11/09/26	4.0	100	100	16,770	2026/11/9
SHBASS 0.01% 09/30/30	0.01	100	81	13,551	2030/9/30
SHBASS 3.75% 05/05/26	3.75	200	200	33,473	2026/5/5
SHBASS 3.75% 11/01/27	3.75	100	100	16,829	2027/11/1
SMINLN 2% 02/23/27	2.0	100	95	15,872	2027/2/23
SSELN 4% PERP	4.0	100	97	16,250	－
STANLN 1.2% 09/23/31	1.2	100	91	15,247	2031/9/23
STANLN 2.5% 09/09/30	2.5	100	97	16,293	2030/9/9
SWEDA 1.3% 02/17/27	1.3	100	93	15,593	2027/2/17
SWEDA 3.125% 07/05/28	3.125	100	99	16,582	2028/7/5
T(AT&T) 1.6% 05/19/28	1.6	200	184	30,898	2028/5/19
T(AT&T) 4.3% 11/18/34	4.3	100	102	17,148	2034/11/18
TACHEM 0.75% 07/09/27	0.75	100	91	15,298	2027/7/9
TCLAU 4.225% 04/26/33	4.225	100	102	17,053	2033/4/26
TD 3.715% 03/13/30	3.715	200	203	34,019	2030/3/13
TD 3.879% 03/13/26	3.879	100	100	16,812	2026/3/13
TELBSS 0.75% 03/23/31	0.75	200	168	28,199	2031/3/23
TELNO 1.75% 05/31/34	1.75	100	84	14,167	2034/5/31
TELNO 4.25% 10/03/35	4.25	200	209	34,959	2035/10/3
TEMASE 3.25% 02/15/27	3.25	150	149	24,891	2027/2/15
TMO 1.875% 10/01/49	1.875	100	68	11,424	2049/10/1
TMO 3.2% 01/21/26	3.2	300	298	49,875	2026/1/21
TOYOTA 0.25% 07/16/26	0.25	100	93	15,571	2026/7/16
TOYOTA 4.05% 09/13/29	4.05	100	102	17,084	2029/9/13
UBS 4.375% 01/11/31	4.375	200	203	33,931	2031/1/11
UBS 7.75% 03/01/29	7.75	200	225	37,692	2029/3/1

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
UNANA 3.3% 06/06/29	3.3	100	99	16,670	2029/6/6
VATFAL 0.125% 02/12/29	0.125	100	84	14,187	2029/2/12
VOD 2.5% 05/24/39	2.5	100	83	13,952	2039/5/24
VZ 0.375% 03/22/29	0.375	100	86	14,384	2029/3/22
VZ 0.75% 03/22/32	0.75	100	80	13,406	2032/3/22
VZ 4.75% 10/31/34	4.75	100	107	17,936	2034/10/31
WFC 1.741% 05/04/30	1.741	100	89	15,012	2030/5/4
XOM 0.524% 06/26/28	0.524	100	89	14,894	2028/6/26
ユーロ計				30,128,878	
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	250	231	45,155	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	430	368	71,757	2028/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	430	324	63,143	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	250	226	44,069	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	560	439	85,690	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	520	436	85,053	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	290	82	15,991	2061/10/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	430	411	80,062	2025/6/7
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	280	186	36,324	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	440	168	32,829	2050/10/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	350	166	32,481	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	400	295	57,582	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	170	142	27,762	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	320	251	49,022	2032/1/31
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	230	144	28,141	2039/1/31
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	320	110	21,526	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	660	599	116,688	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	320	149	29,073	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	260	153	29,978	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	310	290	56,660	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	290	157	30,637	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	270	131	25,612	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	450	403	78,492	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	380	189	36,959	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	330	144	28,132	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	370	208	40,605	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	590	298	58,201	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	600	433	84,454	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	830	800	155,871	2025/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	230	139	27,212	2065/7/22
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	340	274	53,419	2044/1/22
UKT 3.25% 01/31/33	3.25	400	369	71,981	2033/1/31
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	470	390	76,129	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	290	228	44,410	2068/7/22
UKT 3.5% 10/22/25	3.5	940	922	179,646	2025/10/22
UKT 3.75% 01/29/38	3.75	300	274	53,496	2038/1/29
UKT 3.75% 03/07/27	3.75	160	156	30,504	2027/3/7
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	370	310	60,473	2052/7/22
UKT 3.75% 10/22/53	3.75	350	292	56,898	2053/10/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	390	341	66,423	2060/1/22
UKT 4% 10/22/31	4.0	220	216	42,105	2031/10/22
UKT 4% 10/22/63	4.0	180	156	30,519	2063/10/22
UKT 4.125% 01/29/27	4.125	380	376	73,240	2027/1/29
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	580	568	110,767	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	510	510	99,519	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	510	488	95,076	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	370	369	71,912	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	400	380	74,016	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	420	388	75,610	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	270	248	48,329	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	410	374	72,888	2055/12/7
UKT 4.375% 07/31/54	4.375	50	46	9,060	2054/7/31
UKT 4.5% 06/07/28	4.5	320	321	62,642	2028/6/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	670	676	131,738	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	450	437	85,117	2042/12/7
UKT 4.625% 01/31/34	4.625	330	337	65,636	2034/1/31
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	600	619	120,573	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	290	294	57,355	2038/12/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	440	472	91,994	2028/12/7
特殊債券(除く金融債)					
AIIB 1.125% 09/15/26	1.125	100	91	17,888	2026/9/15
ASIA 0.75% 12/07/27	0.75	100	87	17,048	2027/12/7
BNG 0.5% 12/21/26	0.5	100	89	17,421	2026/12/21
COE 4.25% 03/16/26	4.25	100	98	19,243	2026/3/16
DEXGRP 0.25% 12/10/26	0.25	100	88	17,264	2026/12/10
EIB 0.75% 07/22/27	0.75	100	88	17,274	2027/7/22
EIB 0.875% 05/15/26	0.875	200	185	36,069	2026/5/15
EIB 3.875% 04/12/28	3.875	200	195	38,053	2028/4/12
EIB 4.875% 12/16/30	4.875	200	205	39,964	2030/12/16
EIB 5.625% 06/07/32	5.625	100	108	21,116	2032/6/7
IADB 2.125% 12/15/28	2.125	100	90	17,556	2028/12/15
IADB 5% 07/20/30	5.0	100	102	20,029	2030/7/20
IBRD 0.25% 07/22/26	0.25	100	90	17,661	2026/7/22
KFW 1.125% 07/04/25	1.125	100	95	18,618	2025/7/4
KFW 3.75% 07/30/27	3.75	100	97	18,968	2027/7/30
KFW 3.875% 09/02/25	3.875	200	197	38,371	2025/9/2
KFW 4.875% 02/03/31	4.875	100	102	19,988	2031/2/3
NEDWBK 0.875% 09/30/26	0.875	200	182	35,466	2026/9/30
RENTEN 2.125% 12/15/28	2.125	100	90	17,561	2028/12/15
普通社債券(含む投資法人債券)					
AAPL 3.05% 07/31/29	3.05	100	92	18,065	2029/7/31
ALVGR 4.5% 03/13/43	4.5	100	91	17,747	2043/3/13
ANNFND 2.308% 10/06/32	2.308	200	152	29,732	2032/10/6
ANNFND 2.924% 10/06/51	2.924	100	57	11,128	2051/10/6
ANNFND 3.685% 07/12/34	3.685	100	82	16,018	2034/7/12
ANNFND 4.75% 08/09/33	4.75	200	182	35,484	2033/8/9
AVLN 4% 06/03/55	4.0	100	80	15,656	2055/6/3
BACR 3.75% 11/22/30	3.75	100	95	18,650	2030/11/22
BACR 5.851% 03/21/35	5.851	100	98	19,086	2035/3/21
BATSLN 2.25% 09/09/52	2.25	100	44	8,680	2052/9/9
BATSLN 5.75% 07/05/40	5.75	100	90	17,588	2040/7/5

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
BFCM 1% 07/16/26	1.0	100	91	17,751	2026/7/16
BNP 3.375% 01/23/26	3.375	200	192	37,575	2026/1/23
BPLN 4.25% PERP	4.25	100	94	18,395	－
BRK 2.625% 06/19/59	2.625	100	56	10,979	2059/6/19
CDTFIN 2.125% 09/22/28	2.125	100	87	17,111	2028/9/22
CMCSA 4% 11/26/29	4.0	100	95	18,590	2029/11/26
CMCSA 5.5% 11/23/29	5.5	100	102	19,983	2029/11/23
CMCSA 6% 05/21/27	6.0	100	102	19,973	2027/5/21
CPGLN 4.375% 09/08/32	4.375	100	96	18,730	2032/9/8
EDF 5.5% 01/25/35	5.5	100	96	18,701	2035/1/25
EJRAIL 4.75% 12/08/31	4.75	100	97	19,006	2031/12/8
ENELIM 1% 10/20/27	1.0	100	87	16,997	2027/10/20
ENGIFP 5.625% 04/03/53	5.625	100	95	18,613	2053/4/3
EQNR 4.25% 04/10/41	4.25	200	178	34,686	2041/4/10
GSK 5.25% 04/10/42	5.25	100	98	19,161	2042/4/10
HSBC 1.75% 07/24/27	1.75	100	91	17,884	2027/7/24
HSBC 3% 05/29/30	3.0	100	88	17,150	2030/5/29
HSBC 8.201% 11/16/34	8.201	100	107	20,991	2034/11/16
HTHROW 4.625% 10/31/46	4.625	100	83	16,168	2046/10/31
INFLN 3.125% 07/05/26	3.125	100	94	18,496	2026/7/5
LLOYDS 6.5% 09/17/40	6.5	100	109	21,382	2040/9/17
LLOYDS 6.625% 06/02/33	6.625	100	100	19,550	2033/6/2
MCD 3.75% 05/31/38	3.75	100	83	16,267	2038/5/31
MET 1.625% 10/12/28	1.625	100	86	16,905	2028/10/12
MGNLN 6.34% 12/19/63	6.34	100	92	18,106	2063/12/19
MS 2.625% 03/09/27	2.625	100	92	18,079	2027/3/9
NGGLN 2% 04/17/40	2.0	100	60	11,864	2040/4/17
NGGLN 2.75% 02/06/35	2.75	100	77	15,059	2035/2/6
NGGLN 5.272% 01/18/43	5.272	100	92	18,075	2043/1/18
NWG 3.619% 03/29/29	3.619	100	92	18,041	2029/3/29
NWIDE 6.178% 12/07/27	6.178	100	101	19,697	2027/12/7
O 1.875% 01/14/27	1.875	100	90	17,664	2027/1/14
ORSTED 2.5% 02/18/21	2.5	100	71	14,019	3021/2/18
PFE 6.5% 06/03/38	6.5	100	112	21,900	2038/6/3
RABOBK 1.875% 07/12/28	1.875	100	89	17,489	2028/7/12
RTOLN 5% 06/27/32	5.0	100	97	18,912	2032/6/27
SANTAN 4.75% 08/30/28	4.75	100	97	18,990	2028/8/30
SANTAN 5.125% 01/25/30	5.125	100	98	19,164	2030/1/25
SANUK 2.92% 05/08/26	2.92	100	97	18,900	2026/5/8
SGOFP 4.625% 10/09/29	4.625	100	97	19,025	2029/10/9
SSELN 3.74% PERP	3.74	100	95	18,623	－
STANLN 4.375% 01/18/38	4.375	100	87	17,097	2038/1/18
UBS 7% 09/30/27	7.0	100	102	20,033	2027/9/30
VIEFP 5.375% 12/02/30	5.375	100	100	19,603	2030/12/2
VW 3.375% 11/16/26	3.375	100	94	18,484	2026/11/16
WELL 4.8% 11/20/28	4.8	100	96	18,842	2028/11/20
小計				5,208,806	
（スイス）		千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券					
SWISS 0% 06/22/29	－	300	287	49,118	2029/6/22
SWISS 0% 07/24/39	－	100	89	15,262	2039/7/24
SWISS 0.25% 06/23/35	0.25	220	208	35,544	2035/6/23
SWISS 0.5% 05/24/55	0.5	50	47	8,102	2055/5/24
SWISS 0.5% 05/27/30	0.5	350	344	58,737	2030/5/27
SWISS 0.5% 05/30/58	0.5	40	38	6,524	2058/5/30
SWISS 0.5% 06/27/32	0.5	190	186	31,755	2032/6/27
SWISS 0.5% 06/28/45	0.5	130	124	21,256	2045/6/28
SWISS 1.25% 05/28/26	1.25	430	433	73,865	2026/5/28
SWISS 1.25% 06/27/37	1.25	60	63	10,913	2037/6/27
SWISS 1.5% 04/30/42	1.5	180	203	34,722	2042/4/30
SWISS 1.5% 07/24/25	1.5	210	211	36,051	2025/7/24
SWISS 1.5% 10/26/38	1.5	130	143	24,544	2038/10/26
SWISS 2% 06/25/64	2.0	50	74	12,734	2064/6/25
SWISS 2.25% 06/22/31	2.25	380	418	71,432	2031/6/22
SWISS 2.5% 03/08/36	2.5	160	192	32,758	2036/3/8
SWISS 3.25% 06/27/27	3.25	150	161	27,477	2027/6/27
SWISS 3.5% 04/08/33	3.5	250	309	52,759	2033/4/8
SWISS 4% 01/06/49	4.0	20	34	5,948	2049/1/6
SWISS 4% 04/08/28	4.0	550	617	105,347	2028/4/8
小計				714,859	
（スウェーデン）		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券					
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	1,870	1,580	22,605	2031/5/12
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	3,090	2,867	41,006	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	2,030	1,847	26,421	2029/11/12
SGB 1% 11/12/26	1.0	1,420	1,357	19,405	2026/11/12
SGB 1.75% 11/11/33	1.75	200	186	2,669	2033/11/11
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	650	635	9,091	2032/6/1
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	1,980	1,964	28,090	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	980	1,076	15,399	2039/3/30
普通社債券（含む投資法人債券）					
LANSBK 0.5% 09/20/28	0.5	2,000	1,763	25,217	2028/9/20
LANSBK 1% 09/15/27	1.0	3,500	3,232	46,222	2027/9/15
LANSBK 1.5% 09/16/26	1.5	1,000	954	13,647	2026/9/16
LANSBK 3% 09/19/29	3.0	2,000	1,951	27,903	2029/9/19
NDASS 0.5% 09/16/26	0.5	2,700	2,516	35,990	2026/9/16
NDASS 1% 09/17/25	1.0	1,500	1,446	20,686	2025/9/17
SBAB 0.5% 06/11/25	0.5	2,000	1,931	27,617	2025/6/11
SEB 0.5% 12/16/26	0.5	2,000	1,851	26,479	2026/12/16
SHBASS 2.5% 12/01/27	2.5	2,000	1,937	27,701	2027/12/1
SWEDA 1% 03/17/27	1.0	1,000	932	13,341	2027/3/17
SWEDA 1% 03/18/26	1.0	2,000	1,906	27,267	2026/3/18
SWEDA 1% 06/18/25	1.0	1,000	970	13,878	2025/6/18
SWEDA 3% 03/15/28	3.0	1,100	1,082	15,481	2028/3/15
SWEDA 3% 03/28/29	3.0	1,000	979	14,001	2029/3/28
小計				500,126	
（ノルウェー）		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券					
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	200	167	2,375	2031/9/17
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	870	752	10,689	2030/8/19

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)	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	1,050	1,004	14,269	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	1,260	1,188	16,884	2027/2/17
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	750	675	9,593	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	980	912	12,970	2028/4/26
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	450	396	5,629	2032/5/18
NGB 3% 08/15/33	3.0	1,310	1,223	17,380	2033/8/15
NGB 3.5% 10/06/42	3.5	360	353	5,027	2042/10/6
NGB 3.625% 04/13/34	3.625	370	361	5,143	2034/4/13
小計				99,964	
（デンマーク）		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
国債証券					
DGB 0% 11/15/31	－	1,170	967	21,677	2031/11/15
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	1,000	513	11,503	2052/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	2,560	2,376	53,243	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	500	447	10,019	2029/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,570	5,465	122,417	2025/11/15
DGB 2.25% 11/15/33	2.25	760	734	16,460	2033/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	1,550	1,879	42,096	2039/11/15
小計				277,418	
（チェコ）		千チェココルナ	千チェココルナ		
国債証券					
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	2,400	2,157	14,332	2027/2/10
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	4,500	3,712	24,668	2030/5/15
CZGB 1% 06/26/26	1.0	900	841	5,593	2026/6/26
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	1,550	1,268	8,431	2031/3/13
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	1,000	671	4,463	2040/4/24
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	2,400	1,979	13,152	2032/6/23
CZGB 1.95% 07/30/37	1.95	1,400	1,059	7,042	2037/7/30
CZGB 2% 10/13/33	2.0	3,300	2,709	18,001	2033/10/13
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	1,500	1,463	9,723	2025/9/17
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	1,500	1,400	9,304	2028/8/25
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	1,400	1,302	8,654	2029/7/23
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	800	787	5,229	2036/12/4
CZGB 4.85% 11/26/57	4.85	500	529	3,519	2057/11/26
CZGB 4.9% 04/14/34	4.9	1,300	1,355	9,004	2034/4/14
CZGB 5% 09/30/30	5.0	1,000	1,039	6,904	2030/9/30
CZGB 5.5% 12/12/28	5.5	1,800	1,895	12,594	2028/12/12
CZGB 5.75% 03/29/29	5.75	2,000	2,129	14,149	2029/3/29
CZGB 6% 02/26/26	6.0	2,700	2,787	18,521	2026/2/26
小計				193,290	
（ハンガリー）		千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント		
国債証券					
HGB 1% 11/26/25	1.0	10,000	9,101	3,869	2025/11/26
HGB 1.5% 04/22/26	1.5	16,000	14,363	6,106	2026/4/22
HGB 1.5% 08/26/26	1.5	28,000	24,676	10,490	2026/8/26
HGB 2% 05/23/29	2.0	15,000	11,789	5,011	2029/5/23
HGB 2.25% 04/20/33	2.25	10,000	6,837	2,906	2033/4/20
HGB 2.25% 06/22/34	2.25	8,000	5,243	2,229	2034/6/22
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	10,000	8,940	3,800	2026/12/22
HGB 3% 04/25/41	3.0	8,000	4,826	2,051	2041/4/25
HGB 3% 08/21/30	3.0	25,000	19,819	8,425	2030/8/21
HGB 3% 10/27/27	3.0	26,000	22,717	9,658	2027/10/27
HGB 3% 10/27/38	3.0	17,000	10,818	4,599	2038/10/27
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	23,000	17,894	7,607	2031/10/22
HGB 4.5% 03/23/28	4.5	15,000	13,669	5,811	2028/3/23
HGB 4.5% 05/27/32	4.5	19,000	15,946	6,779	2032/5/27
HGB 4.75% 11/24/32	4.75	12,000	10,168	4,323	2032/11/24
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	8,000	7,847	3,336	2025/6/24
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	11,000	10,814	4,597	2028/10/22
HGB 9.5% 10/21/26	9.5	13,000	13,628	5,793	2026/10/21
小計				97,399	
（ポーランド）		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券					
POLGB 0% 10/25/25	－	490	454	17,582	2025/10/25
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	480	424	16,436	2026/10/25
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	280	268	10,395	2025/4/25
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	330	252	9,783	2030/10/25
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	480	358	13,900	2032/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	750	705	27,337	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	730	667	25,860	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	300	271	10,496	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	1,550	1,345	52,101	2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	520	507	19,657	2025/7/25
POLGB 3.75% 05/25/27	3.75	390	372	14,406	2027/5/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	200	201	7,784	2029/4/25
POLGB 6% 10/25/33	6.0	850	861	33,352	2033/10/25
POLGB 7.5% 07/25/28	7.5	700	749	29,021	2028/7/25
小計				288,117	
（オーストラリア）		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券					
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	730	686	69,823	2025/11/21
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	730	671	68,220	2026/9/21
ACGB 1% 11/21/31	1.0	500	394	40,086	2031/11/21
ACGB 1% 12/21/30	1.0	660	537	54,649	2030/12/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	500	395	40,244	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	700	581	59,121	2031/6/21
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	220	119	12,156	2051/6/21
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	400	325	33,120	2032/11/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	800	746	75,889	2028/5/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	640	582	59,253	2030/5/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	140	108	11,033	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	270	229	23,368	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	300	287	29,203	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	640	605	61,533	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	550	512	52,084	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	250	189	19,214	2047/3/21
ACGB 3% 11/21/33	3.0	270	240	24,476	2033/11/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	400	396	40,280	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	390	375	38,146	2029/4/21

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	120	102	10,409	2039/6/21
ACGB 3.5% 12/21/34	3.5	160	147	14,987	2034/12/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	280	258	26,321	2037/4/21
ACGB 3.75% 05/21/34	3.75	200	189	19,249	2034/5/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	520	521	53,024	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	340	343	34,891	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	360	367	37,315	2027/4/21
ACGB 4.75% 06/21/54	4.75	100	100	10,175	2054/6/21
地方債証券					
NSWTC 1.5% 02/20/32	1.5	100	78	7,943	2032/2/20
NSWTC 2% 03/08/33	2.0	100	78	7,992	2033/3/8
NSWTC 2.25% 05/07/41	2.25	300	191	19,462	2041/5/7
NSWTC 3% 04/20/29	3.0	400	372	37,912	2029/4/20
NSWTC 3% 05/20/27	3.0	200	192	19,532	2027/5/20
NSWTC 3% 11/15/28	3.0	100	94	9,559	2028/11/15
NSWTC 4.25% 02/20/36	4.25	400	363	36,985	2036/2/20
NSWTC 4.75% 02/20/35	4.75	200	192	19,594	2035/2/20
NSWTC 4.75% 02/20/37	4.75	100	94	9,608	2037/2/20
NZLGFA 4.7% 08/01/28	4.7	200	199	20,243	2028/8/1
QTC 1.5% 03/02/32	1.5	300	234	23,873	2032/3/2
QTC 1.5% 08/20/32	1.5	200	153	15,619	2032/8/20
QTC 1.75% 07/20/34	1.75	100	73	7,437	2034/7/20
QTC 2% 08/22/33	2.0	200	155	15,759	2033/8/22
QTC 2.25% 10/28/50	2.25	100	54	5,579	2050/10/28
QTC 3.25% 07/21/28	3.25	200	190	19,386	2028/7/21
QTC 4.5% 03/09/33	4.5	100	96	9,854	2033/3/9
QTC 4.5% 08/22/35	4.5	200	187	19,085	2035/8/22
QTC 4.75% 02/02/34	4.75	200	195	19,873	2034/2/2
QTC 4.75% 07/21/25	4.75	100	100	10,202	2025/7/21
TCV 0.5% 11/20/25	0.5	400	376	38,256	2025/11/20
TCV 1.25% 11/19/27	1.25	300	268	27,307	2027/11/19
TCV 1.5% 09/10/31	1.5	100	79	8,037	2031/9/10
TCV 1.5% 11/20/30	1.5	200	163	16,598	2030/11/20
TCV 2% 11/20/37	2.0	100	66	6,746	2037/11/20
TCV 2.25% 09/15/33	2.25	400	314	31,962	2033/9/15
TCV 2.5% 10/22/29	2.5	500	448	45,591	2029/10/22
WATC 1.5% 10/22/30	1.5	100	82	8,395	2030/10/22
WATC 3% 10/21/26	3.0	100	96	9,847	2026/10/21
WATC 4.25% 07/20/33	4.25	200	190	19,378	2033/7/20
WATC 5% 07/23/25	5.0	200	201	20,470	2025/7/23
特殊債券(除く金融債)					
AFDB 3.3% 07/27/27	3.3	100	95	9,745	2027/7/27
ASIA 4.25% 01/17/28	4.25	100	98	10,051	2028/1/17
BNG 1.6% 11/27/30	1.6	100	80	8,196	2030/11/27
BNG 5% 03/13/34	5.0	100	98	9,994	2034/3/13
EDC 4.5% 09/06/28	4.5	100	99	10,101	2028/9/6
EIB 1.8% 01/19/27	1.8	100	93	9,456	2027/1/19
EUROF 3.35% 05/21/29	3.35	100	92	9,435	2029/5/21
IBRD 3% 10/19/26	3.0	100	96	9,806	2026/10/19
IBRD 4.4% 01/13/28	4.4	100	99	10,105	2028/1/13
IFC 1.25% 02/06/31	1.25	100	78	8,018	2031/2/6
IFC 3.6% 02/24/26	3.6	100	98	9,997	2026/2/24

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)	
KBN 0.6% 06/01/26	0.6	100	91	9,342	2026/6/1
KFW 4.3% 07/13/27	4.3	100	99	10,086	2027/7/13
LBANK 4.25% 08/07/25	4.25	100	99	10,095	2025/8/7
NEDWBK 2.25% 09/04/25	2.25	100	96	9,841	2025/9/4
NIB 2.4% 09/22/25	2.4	100	97	9,861	2025/9/22
NRWBK 1.05% 03/31/26	1.05	200	186	18,933	2026/3/31
RENTEN 2.6% 03/23/27	2.6	100	94	9,631	2027/3/23
普通社債券(含む投資法人債券)					
ABIBB 4.1% 09/06/27	4.1	100	97	9,887	2027/9/6
ANZ 5.906% 08/12/32	5.906	100	100	10,230	2032/8/12
BNP 5.288% 02/15/29	5.288	200	198	20,181	2029/2/15
CBAAU 5% 01/13/28	5.0	200	199	20,320	2028/1/13
CPPIBC 4.45% 09/01/27	4.45	100	99	10,088	2027/9/1
LLOYDS 5.3906% 06/10/27	5.3906	100	100	10,183	2027/6/10
MQGAU 6.082% 06/07/32	6.082	100	100	10,218	2032/6/7
QANAU 2.95% 11/27/29	2.95	100	85	8,696	2029/11/27
TLSAU 5.65% 03/06/34	5.65	200	197	20,032	2034/3/6
WSTP 2.4% 01/25/27	2.4	100	93	9,495	2027/1/25
WSTP 6.934% 06/23/38	6.934	100	104	10,619	2038/6/23
小計				1,909,035	
(ニュージーランド)		千ニュージーランドドル	千ニュージーランドドル		
国債証券					
NZGB 0.25% 05/15/28	0.25	290	242	22,532	2028/5/15
NZGB 0.5% 05/15/26	0.5	330	301	28,038	2026/5/15
NZGB 1.5% 05/15/31	1.5	140	112	10,464	2031/5/15
NZGB 1.75% 05/15/41	1.75	110	67	6,276	2041/5/15
NZGB 2% 05/15/32	2.0	250	203	18,861	2032/5/15
NZGB 2.75% 04/15/25	2.75	260	253	23,560	2025/4/15
NZGB 2.75% 04/15/37	2.75	130	101	9,436	2037/4/15
NZGB 2.75% 05/15/51	2.75	90	58	5,430	2051/5/15
NZGB 3% 04/20/29	3.0	110	101	9,443	2029/4/20
NZGB 3.5% 04/14/33	3.5	190	171	15,906	2033/4/14
NZGB 4.25% 05/15/34	4.25	50	47	4,400	2034/5/15
NZGB 4.5% 04/15/27	4.5	390	387	35,952	2027/4/15
NZGB 4.5% 05/15/30	4.5	260	256	23,834	2030/5/15
NZGB 5% 05/15/54	5.0	60	58	5,408	2054/5/15
小計				219,545	
(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	150	143	16,439	2025/11/1
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	150	142	16,294	2026/11/1
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	170	150	17,275	2031/7/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	110	82	9,491	2050/3/1
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	90	67	7,775	2051/10/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	230	223	25,647	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	220	195	22,348	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	90	88	10,181	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	60	53	6,080	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	180	175	20,069	2028/5/1
SIGB 2.625% 08/01/32	2.625	60	56	6,484	2032/8/1

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	120	108	12,489	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	90	82	9,477	2042/4/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	180	175	20,143	2029/7/1
SIGB 2.875% 08/01/28	2.875	50	49	5,625	2028/8/1
SIGB 2.875% 09/01/27	2.875	130	128	14,677	2027/9/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	200	194	22,237	2030/9/1
SIGB 3% 08/01/72	3.0	50	47	5,411	2072/8/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	140	139	16,016	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	100	100	11,497	2027/3/1
小計				275,664	
（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	420	387	12,615	2031/4/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	450	448	14,603	2027/5/31
MGS 3.582% 07/15/32	3.582	600	584	19,027	2032/7/15
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	880	880	28,684	2028/6/15
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	890	847	27,604	2040/5/22
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	250	246	8,020	2034/7/5
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	630	623	20,312	2033/4/15
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	300	301	9,811	2029/8/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,050	1,058	34,492	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	430	433	14,125	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	420	423	13,790	2026/7/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	700	704	22,953	2025/9/15
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	1,000	969	31,573	2050/6/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	200	203	6,643	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	690	703	22,918	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	600	609	19,868	2026/4/15
MGS 4.457% 03/31/53	4.457	380	390	12,718	2053/3/31
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	780	805	26,253	2030/4/15
MGS 4.504% 04/30/29	4.504	850	879	28,634	2029/4/30
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	400	420	13,687	2033/11/7
MGS 4.696% 10/15/42	4.696	760	808	26,323	2042/10/15
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	240	257	8,394	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	640	682	22,236	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	540	586	19,116	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	220	242	7,889	2048/7/6
小計				472,298	
（タイ）		千タイバーツ	千タイバーツ		
国債証券					
THAIGB 0.95% 06/17/25	0.95	2,600	2,559	10,774	2025/6/17
THAIGB 1% 06/17/27	1.0	4,700	4,496	18,931	2027/6/17
THAIGB 1.585% 12/17/35	1.585	6,800	5,959	25,088	2035/12/17
THAIGB 1.6% 06/17/35	1.6	4,000	3,546	14,929	2035/6/17
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	5,000	4,757	20,027	2029/12/17
THAIGB 2% 06/17/42	2.0	5,000	4,216	17,750	2042/6/17
THAIGB 2% 12/17/31	2.0	5,000	4,773	20,095	2031/12/17
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	5,000	4,967	20,911	2026/12/17
THAIGB 2.25% 03/17/27	2.25	5,500	5,474	23,047	2027/3/17
THAIGB 2.35% 06/17/26	2.35	9,500	9,496	39,982	2026/6/17
THAIGB 2.4% 03/17/29	2.4	3,000	2,980	12,548	2029/3/17

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
THAIGB 2.5% 06/17/71	2.5	3,000	2,146	9,038	2071/6/17
THAIGB 2.65% 06/17/28	2.65	4,000	4,024	16,942	2028/6/17
THAIGB 2.75% 06/17/52	2.75	2,200	1,952	8,221	2052/6/17
THAIGB 2.875% 06/17/46	2.875	4,600	4,294	18,079	2046/6/17
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	3,500	3,556	14,974	2028/12/17
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	3,000	3,100	13,053	2038/6/17
THAIGB 3.35% 06/17/33	3.35	7,500	7,855	33,072	2033/6/17
THAIGB 3.39% 06/17/37	3.39	3,400	3,555	14,967	2037/6/17
THAIGB 3.45% 06/17/43	3.45	700	717	3,019	2043/6/17
THAIGB 3.6% 06/17/67	3.6	7,300	7,100	29,894	2067/6/17
THAIGB 3.8% 06/14/41	3.8	2,000	2,191	9,225	2041/6/14
小計				394,576	
（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 5.125% 04/15/27	5.125	7,400,000	7,067,296	68,552	2027/4/15
INDOGB 5.5% 04/15/26	5.5	3,200,000	3,121,056	30,274	2026/4/15
INDOGB 6.25% 06/15/36	6.25	2,000,000	1,869,020	18,129	2036/6/15
INDOGB 6.375% 04/15/32	6.375	5,000,000	4,820,200	46,755	2032/4/15
INDOGB 6.375% 08/15/28	6.375	5,300,000	5,180,644	50,252	2028/8/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	2,000,000	1,945,700	18,873	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	2,000,000	1,991,600	19,318	2025/6/15
INDOGB 6.625% 02/15/34	6.625	3,500,000	3,391,045	32,893	2034/2/15
INDOGB 6.875% 04/15/29	6.875	2,000,000	1,988,400	19,287	2029/4/15
INDOGB 6.875% 08/15/51	6.875	1,000,000	976,480	9,471	2051/8/15
INDOGB 7% 02/15/33	7.0	5,500,000	5,480,035	53,156	2033/2/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	3,500,000	3,509,660	34,043	2030/9/15
INDOGB 7.125% 06/15/38	7.125	3,000,000	3,007,110	29,168	2038/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/42	7.125	1,200,000	1,194,168	11,583	2042/6/15
INDOGB 7.125% 06/15/43	7.125	2,000,000	2,016,230	19,557	2043/6/15
INDOGB 7.25% 02/15/26	7.25	2,000,000	2,021,100	19,604	2026/2/15
INDOGB 7.375% 05/15/48	7.375	4,000,000	4,115,000	39,915	2048/5/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	1,000,000	1,033,220	10,022	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	2,000,000	2,064,780	20,028	2038/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	2,500,000	2,630,075	25,511	2029/5/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	1,100,000	1,223,640	11,869	2039/4/15
小計				588,270	
（韓国）		千韓国ウォン	千韓国ウォン		
国債証券					
KTB 1.375% 12/10/29	1.375	400,000	354,651	40,252	2029/12/10
KTB 1.5% 03/10/50	1.5	300,000	196,176	22,266	2050/3/10
KTB 1.5% 09/10/40	1.5	200,000	147,224	16,710	2040/9/10
KTB 1.5% 12/10/30	1.5	800,000	701,631	79,635	2030/12/10
KTB 1.875% 06/10/29	1.875	500,000	459,656	52,171	2029/6/10
KTB 1.875% 09/10/41	1.875	300,000	231,820	26,311	2041/9/10
KTB 2% 03/10/46	2.0	300,000	227,796	25,854	2046/3/10
KTB 2% 03/10/49	2.0	300,000	222,873	25,296	2049/3/10
KTB 2% 06/10/31	2.0	400,000	359,602	40,814	2031/6/10
KTB 2.125% 03/10/47	2.125	200,000	154,587	17,545	2047/3/10
KTB 2.25% 09/10/37	2.25	200,000	170,303	19,329	2037/9/10
KTB 2.375% 03/10/27	2.375	900,000	873,086	99,095	2027/3/10
KTB 2.375% 12/10/27	2.375	400,000	384,314	43,619	2027/12/10

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)	
KTB 2.5% 03/10/52	2.5	300,000	245,166	27,826	2052/3/10
KTB 2.625% 03/10/48	2.625	200,000	169,567	19,245	2048/3/10
KTB 2.75% 12/10/44	2.75	200,000	175,078	19,871	2044/12/10
KTB 3.125% 06/10/25	3.125	400,000	398,337	45,211	2025/6/10
KTB 3.125% 06/10/26	3.125	800,000	793,672	90,081	2026/6/10
KTB 3.25% 03/10/28	3.25	700,000	692,278	78,573	2028/3/10
KTB 3.25% 03/10/53	3.25	1,500,000	1,427,194	161,986	2053/3/10
KTB 3.25% 06/10/33	3.25	900,000	869,384	98,675	2033/6/10
KTB 3.25% 09/10/42	3.25	600,000	568,012	64,469	2042/9/10
KTB 3.375% 06/10/32	3.375	800,000	784,265	89,014	2032/6/10
KTB 3.5% 09/10/28	3.5	400,000	398,447	45,223	2028/9/10
KTB 3.625% 09/10/53	3.625	600,000	612,478	69,516	2053/9/10
KTB 3.75% 12/10/33	3.75	400,000	401,103	45,525	2033/12/10
KTB 4.25% 12/10/25	4.25	1,400,000	1,415,686	160,680	2025/12/10
小計				1,524,804	
（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 2% 06/15/25	2.0	11,000	11,028	236,593	2025/6/15
CGB 2.18% 08/15/26	2.18	7,000	7,038	150,998	2026/8/15
CGB 2.18% 08/25/25	2.18	5,000	5,024	107,780	2025/8/25
CGB 2.22% 09/25/25	2.22	11,000	11,062	237,329	2025/9/25
CGB 2.28% 11/25/25	2.28	5,000	5,034	107,997	2025/11/25
CGB 2.37% 01/20/27	2.37	11,000	11,128	238,730	2027/1/20
CGB 2.4% 07/15/28	2.4	5,200	5,271	113,085	2028/7/15
CGB 2.44% 10/15/27	2.44	5,500	5,578	119,676	2027/10/15
CGB 2.46% 02/15/26	2.46	12,000	12,120	260,025	2026/2/15
CGB 2.48% 09/25/28	2.48	12,500	12,720	272,884	2028/9/25
CGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,500	3,555	76,286	2027/7/25
CGB 2.52% 08/25/33	2.52	7,500	7,662	164,374	2033/8/25
CGB 2.54% 12/25/30	2.54	3,000	3,065	65,767	2030/12/25
CGB 2.62% 04/15/28	2.62	6,100	6,233	133,719	2028/4/15
CGB 2.62% 06/25/30	2.62	4,400	4,509	96,752	2030/6/25
CGB 2.62% 09/25/29	2.62	9,000	9,227	197,953	2029/9/25
CGB 2.64% 01/15/28	2.64	9,500	9,710	208,323	2028/1/15
CGB 2.67% 05/25/33	2.67	15,000	15,418	330,767	2033/5/25
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	3,000	3,085	66,202	2030/5/21
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	7,000	7,123	152,821	2026/8/12
CGB 2.69% 08/15/32	2.69	5,000	5,164	110,794	2032/8/15
CGB 2.75% 02/17/32	2.75	3,000	3,108	66,679	2032/2/17
CGB 2.75% 06/15/29	2.75	10,500	10,838	232,521	2029/6/15
CGB 2.76% 05/15/32	2.76	7,300	7,578	162,574	2032/5/15
CGB 2.79% 12/15/29	2.79	6,000	6,207	133,164	2029/12/15
CGB 2.8% 03/24/29	2.8	5,000	5,171	110,944	2029/3/24
CGB 2.8% 11/15/32	2.8	5,000	5,210	111,790	2032/11/15
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	2,200	2,262	48,539	2027/6/4
CGB 2.88% 02/25/33	2.88	6,700	7,033	150,888	2033/2/25
CGB 2.91% 10/14/28	2.91	4,400	4,565	97,948	2028/10/14
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	6,600	6,861	147,207	2028/5/13
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	3,000	3,169	67,991	2031/5/27
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	2,500	2,547	54,642	2025/10/22
CGB 3.12% 10/25/52	3.12	2,600	2,928	62,833	2052/10/25

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	3,100	3,266	70,072	2029/11/21
CGB 3.19% 04/15/53	3.19	1,500	1,704	36,569	2053/4/15
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	2,000	2,062	44,254	2026/6/6
CGB 3.27% 03/25/73	3.27	1,000	1,204	25,830	2073/3/25
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	7,000	7,503	160,964	2030/11/19
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	5,000	5,247	112,573	2027/12/3
CGB 3.32% 04/15/52	3.32	2,000	2,318	49,745	2052/4/15
CGB 3.39% 03/16/50	3.39	2,700	3,131	67,177	2050/3/16
CGB 3.4% 07/15/72	3.4	2,000	2,477	53,154	2072/7/15
CGB 3.53% 10/18/51	3.53	2,000	2,401	51,510	2051/10/18
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	2,000	2,468	52,954	2051/4/12
CGB 3.73% 05/25/70	3.73	4,000	5,294	113,583	2070/5/25
CGB 3.76% 03/22/71	3.76	1,000	1,328	28,499	2071/3/22
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	4,000	4,989	107,033	2050/9/14
CGB 3.82% 11/19/68	3.82	1,000	1,326	28,447	2068/11/19
CGB 3.86% 07/22/49	3.86	5,900	7,296	156,528	2049/7/22
CGB 4% 06/24/69	4.0	5,000	6,855	147,074	2069/6/24
CGB 4.08% 10/22/48	4.08	12,900	16,407	351,989	2048/10/22
特殊債券（除く金融債）					
ADBCH 2.12% 03/12/27	2.12	2,000	2,005	43,019	2027/3/12
ADBCH 2.27% 06/08/25	2.27	3,000	3,010	64,579	2025/6/8
ADBCH 2.46% 07/27/25	2.46	3,000	3,020	64,788	2025/7/27
ADBCH 2.5% 08/24/27	2.5	5,000	5,067	108,706	2027/8/24
ADBCH 2.55% 05/11/26	2.55	5,000	5,055	108,458	2026/5/11
ADBCH 2.57% 09/13/28	2.57	5,000	5,091	109,225	2028/9/13
ADBCH 2.6% 12/01/25	2.6	3,000	3,030	65,003	2025/12/1
ADBCH 2.74% 02/23/27	2.74	2,000	2,038	43,735	2027/2/23
ADBCH 2.83% 08/11/29	2.83	7,000	7,218	154,868	2029/8/11
ADBCH 2.85% 10/20/33	2.85	3,500	3,651	78,327	2033/10/20
ADBCH 2.9% 03/08/28	2.9	2,000	2,057	44,143	2028/3/8
ADBCH 2.91% 02/21/29	2.91	2,000	2,063	44,258	2029/2/21
ADBCH 2.97% 10/14/32	2.97	2,000	2,098	45,024	2032/10/14
ADBCH 2.99% 08/11/26	2.99	5,000	5,107	109,569	2026/8/11
ADBCH 3.01% 03/16/30	3.01	1,500	1,560	33,474	2030/3/16
ADBCH 3.06% 06/06/32	3.06	4,000	4,216	90,445	2032/6/6
ADBCH 3.1% 02/27/33	3.1	5,000	5,303	113,781	2033/2/27
ADBCH 3.19% 08/12/28	3.19	2,000	2,086	44,752	2028/8/12
ADBCH 3.3% 11/05/31	3.3	2,000	2,139	45,907	2031/11/5
ADBCH 3.35% 03/24/26	3.35	8,000	8,202	175,957	2026/3/24
ADBCH 3.52% 05/24/31	3.52	5,000	5,408	116,030	2031/5/24
ADBCH 3.79% 10/26/30	3.79	2,000	2,186	46,907	2030/10/26
ADBCH 3.92% 06/18/51	3.92	1,000	1,265	27,144	2051/6/18
ADBCH 3.95% 02/26/36	3.95	1,000	1,162	24,930	2036/2/26
EXIMCH 2.5% 08/04/28	2.5	3,000	3,044	65,308	2028/8/4
EXIMCH 2.57% 06/10/25	2.57	5,000	5,037	108,075	2025/6/10
EXIMCH 2.61% 01/27/27	2.61	2,000	2,030	43,560	2027/1/27
EXIMCH 2.82% 06/17/27	2.82	6,000	6,136	131,636	2027/6/17
EXIMCH 2.87% 02/06/28	2.87	5,000	5,135	110,167	2028/2/6
EXIMCH 2.9% 08/19/32	2.9	4,000	4,172	89,512	2032/8/19
EXIMCH 3.1% 02/13/33	3.1	2,000	2,120	45,498	2033/2/13
EXIMCH 3.18% 03/11/32	3.18	5,000	5,313	113,985	2032/3/11
EXIMCH 3.22% 05/14/26	3.22	3,000	3,073	65,939	2026/5/14

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
EXIMCH 3.23% 03/23/30	3.23	6,000	6,331	135,830	2030/3/23
EXIMCH 3.38% 07/16/31	3.38	2,000	2,147	46,060	2031/7/16
EXIMCH 3.43% 10/23/25	3.43	4,000	4,086	87,671	2025/10/23
EXIMCH 3.74% 11/16/30	3.74	3,000	3,271	70,174	2030/11/16
EXIMCH 3.86% 05/20/29	3.86	5,000	5,401	115,868	2029/5/20
EXIMCH 3.88% 01/12/36	3.88	1,000	1,154	24,767	2036/1/12
SDBC 2.22% 08/25/25	2.22	3,000	3,012	64,622	2025/8/25
SDBC 2.25% 07/06/26	2.25	4,000	4,022	86,297	2026/7/6
SDBC 2.3% 02/22/29	2.3	4,000	4,036	86,587	2029/2/22
SDBC 2.59% 01/11/26	2.59	3,000	3,032	65,046	2026/1/11
SDBC 2.65% 02/24/27	2.65	3,000	3,052	65,488	2027/2/24
SDBC 2.69% 06/16/27	2.69	3,000	3,059	65,629	2027/6/16
SDBC 2.73% 01/11/28	2.73	3,000	3,069	65,854	2028/1/11
SDBC 2.82% 05/22/33	2.82	6,000	6,241	133,897	2033/5/22
SDBC 2.83% 09/10/26	2.83	8,000	8,153	174,912	2026/9/10
SDBC 2.96% 07/18/32	2.96	2,000	2,096	44,980	2032/7/18
SDBC 2.98% 04/22/32	2.98	2,000	2,099	45,030	2032/4/22
SDBC 2.99% 03/01/29	2.99	2,000	2,074	44,501	2029/3/1
SDBC 3% 01/17/32	3.0	4,000	4,197	90,054	2032/1/17
SDBC 3.02% 03/06/33	3.02	7,000	7,387	158,473	2033/3/6
SDBC 3.07% 03/10/30	3.07	7,000	7,332	157,300	2030/3/10
SDBC 3.09% 06/18/30	3.09	2,000	2,099	45,034	2030/6/18
SDBC 3.09% 08/09/28	3.09	5,000	5,193	111,407	2028/8/9
SDBC 3.12% 09/13/31	3.12	2,000	2,114	45,365	2031/9/13
SDBC 3.3% 03/03/26	3.3	10,000	10,242	219,741	2026/3/3
SDBC 3.34% 07/14/25	3.34	3,000	3,051	65,466	2025/7/14
SDBC 3.4% 01/08/28	3.4	5,000	5,227	112,150	2028/1/8
SDBC 3.41% 06/07/31	3.41	4,000	4,302	92,295	2031/6/7
SDBC 3.43% 01/14/27	3.43	13,000	13,481	289,219	2027/1/14
SDBC 3.45% 09/20/29	3.45	7,000	7,448	159,793	2029/9/20
SDBC 3.49% 11/08/41	3.49	2,000	2,288	49,103	2041/11/8
SDBC 3.5% 11/04/46	3.5	2,000	2,349	50,403	2046/11/4
SDBC 3.65% 05/21/29	3.65	2,000	2,141	45,936	2029/5/21
SDBC 3.66% 03/01/31	3.66	2,000	2,179	46,760	2031/3/1
SDBC 3.7% 10/20/30	3.7	8,000	8,693	186,500	2030/10/20
SDBC 3.8% 01/25/36	3.8	2,000	2,291	49,160	2036/1/25
SDBC 4.04% 07/06/28	4.04	2,000	2,153	46,205	2028/7/6
小計				12,574,879	
（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 0.5% 02/27/26	0.5	450	420	17,196	2026/2/27
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	200	192	7,890	2025/4/30
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	630	516	21,142	2030/3/31
ILGOV 1.3% 04/30/32	1.3	340	265	10,859	2032/4/30
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	480	322	13,214	2037/5/31
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	370	357	14,652	2025/8/31
ILGOV 2% 03/31/27	2.0	550	515	21,090	2027/3/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	250	228	9,340	2028/9/28
ILGOV 2.8% 11/29/52	2.8	190	122	5,015	2052/11/29
ILGOV 3.75% 02/28/29	3.75	220	213	8,725	2029/2/28
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	340	276	11,310	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	270	283	11,603	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	100	104	4,275	2026/10/30
小計				156,316	
合計				104,635,236	

（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）償還年月日が「－」の銘柄は、償還期限の定めがありません。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄		当期末 口数(千口)	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)
（アメリカ）			千米ドル	
ISHARES MBS ETF		1,108	99,158	15,444,949
合計	口数・金額	1,108	99,158	15,444,949
	銘柄数＜比率＞	1	－	＜12.6%＞

（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。

投資信託財産の構成

項目	当期末 評価額	当期末 比率
	千円	%
公社債	104,635,236	85.0
投資信託受益証券	15,444,949	12.5
コール・ローン等、その他	3,091,084	2.5
投資信託財産総額	123,171,269	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(122,018,119千円)の投資信託財産総額(123,171,269千円)に対する比率は99.1%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＝155.76円
1コロンビアペソ＝0.039332円
1スイスフラン＝170.58円
1デンマーククローネ＝22.40円
1ポーランドズロチ＝38.7262円
1シンガポールドル＝114.59円
1インドネシアルピア＝0.0097円
1イスラエルシェケル＝40.9285円
1カナダドル＝114.05円
1ユーロ＝167.05円
1スウェーデンクローナ＝14.30円
1チェココルナ＝6.6445円
1オーストラリアドル＝101.65円
1マレーシアリンギット＝32.575円
1韓国ウォン＝0.1135円
1メキシコペソ＝9.0608円
1イギリスポンド＝194.76円
1ノルウェークローネ＝14.21円
1ハンガリーフォリント＝0.425129円
1ニュージーランドドル＝92.90円
1タイバーツ＝4.21円
1オフショア人民元＝21.4529円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年4月26日現在
(A)資産	123,171,269,070円
コール・ローン等	1,326,684,453
公社債(評価額)	104,635,236,560
投資信託受益証券(評価額)	15,444,949,741
未収入金	726,001,402
未収利息	875,026,975
前払費用	163,369,939
(B)負債	943,116,638
未払金	936,340,276
未払解約金	6,776,362
(C)純資産総額(A-B)	122,228,152,432
元本	105,569,240,183
次期繰越損益金	16,658,912,249
(D)受益権総口数	105,569,240,183口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,578円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年4月21日 至 2024年4月26日
(A)配当等収益	2,478,951,299円
受取配当金	377,214,749
受取利息	2,100,248,128
その他収益金	1,701,788
支払利息	△213,366
(B)有価証券売買損益	9,008,596,636
売買益	10,518,997,295
売買損	△1,510,400,659
(C)その他費用	△44,282,052
(D)当期損益金(A+B+C)	11,443,265,883
(E)追加信託差損益金	5,535,631,185
(F)解約差損益金	△319,984,819
(G)計 (D+E+F)	16,658,912,249
次期繰越損益金(G)	16,658,912,249

(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)(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3)(F)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18,542,000,000円、期中追加設定元本額は90,002,312,895円、期中一部解約元本額は2,975,072,712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セレクション(SMA専用)	91,434,057,809円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,186,739,776円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,465,438,542円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,409,206,595円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,223,467,342円
FOFs用 世界債券総合インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,096,732,490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)	445,237,916円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	308,359,713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15期（決算日　2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2008年12月12日から無期限です。
運　用　方　針	主として取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)に投資し、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
組　入　制　限	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【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。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
第11期(2019年11月11日)	28,752	7.2	31,224	7.6	96.3	3.0	0.6	62,222
第12期(2020年11月10日)	31,648	10.1	34,564	10.7	95.8	3.8	0.3	82,503
第13期(2021年11月10日)	37,038	17.0	40,526	17.3	93.6	6.2	0.3	104,132
第14期(2022年11月10日)	34,922	△5.7	38,407	△5.2	95.8	3.8	0.4	114,243
第15期(2023年11月10日)	39,228	12.3	43,509	13.3	94.4	5.2	0.4	164,504

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

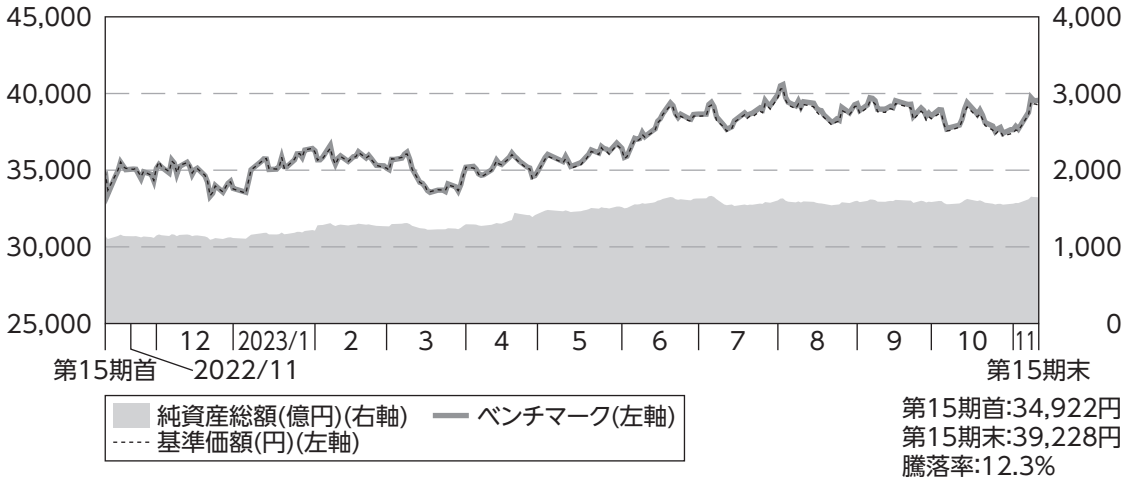
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）です。
MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc.が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。
「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.はMSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

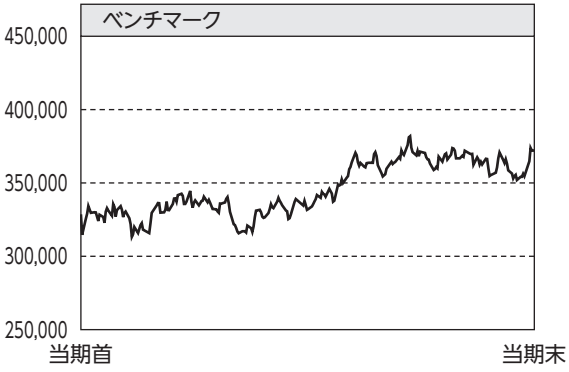


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



新興国株式市場は上昇しました。

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

外国為替市場では、新興国通貨に対し円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円換算ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）組入比率

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

（2）ポートフォリオ構成

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

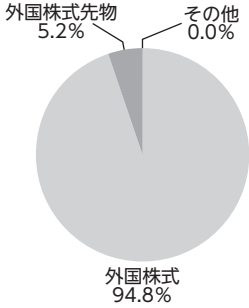
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

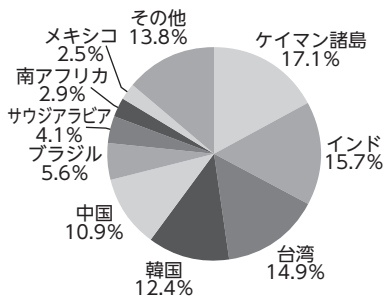
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	6.2%
2	MSCI EMERG M 2312	－	5.2%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	3.8%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.7%
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	ケイマン諸島	2.5%
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.2%
7	MEITUAN-CLASS B	ケイマン諸島	1.1%
8	PDD HOLDINGS INC-ADR	ケイマン諸島	0.9%
9	ICICI BANK LTD	インド	0.8%
10	INFOSYS LTD	インド	0.8%
組入銘柄数		1,248	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

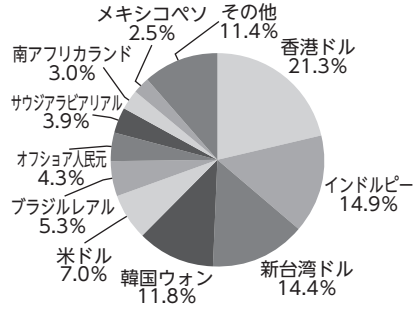
○資産別配分



○国別配分



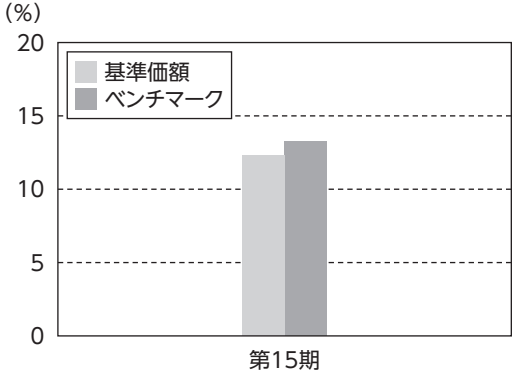
○通貨別配分



（注1）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
その他は未収・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5.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。
差異の主な要因は、配当課税要因※1、先物要因、為替評価差要因※2（いずれもマイナス要因）です。

※1 ベンチマークの計算に用いられる配当金は税引前である一方、当ファンドには税引後の配当金が計上されることによる差異です。
※2 ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2022年11月11日~2023年11月10日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	10円	0.026%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×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）	(8)	(0.021)	
（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）	(2)	(0.005)	
(b) 有価証券取引税	9	0.025	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×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）	(9)	(0.025)	
（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	66	0.179	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(66)	(0.179)	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）	(−)	(−)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	85	0.230	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（36,651円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株　式＞

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	アメリカ	百株 4,801 (234)	千米ドル 9,591 (－)	百株 3,251 (2,273)	千米ドル 1,675 (5,299)
	メキシコ	 31,698 (3,135)	千メキシコペソ 127,124 (－)	 25,085	千メキシコペソ 34,926
	ブラジル	 30,371 (939)	千ブラジルレアル 65,537 (165)	 5,865 (118)	千ブラジルレアル 14,135 (64)
	チリ	 29,379 (18)	千チリペソ 998,752 (1,443)	 10 (－)	千チリペソ 502 (1,443)
	コロンビア	 640	千コロンビアペソ 2,295,955	 8,361	千コロンビアペソ 3,188,943
	ギリシャ	 1,978 (－)	千ユーロ 1,625 (△17)	 320	千ユーロ 517
	トルコ	 14,497 (2,884)	千トルコリラ 62,203 (－)	 3,296	千トルコリラ 8,888
	チェコ	 72	千チェココルナ 6,641	 93	千チェココルナ 6,441
	ハンガリー	 240	千ハンガリーフォリント 212,263	 91	千ハンガリーフォリント 98,786
	ポーランド	 3,456	千ポーランドズロチ 9,002	 2,337	千ポーランドズロチ 1,638
	香港	 377,389 (9,386)	千香港ドル 571,296 (41,156)	 127,961 (－)	千香港ドル 90,188 (41)
	マレーシア	 24,370 (53)	千マレーシアリンギット 19,459 (24)	 13,890	千マレーシアリンギット 3,749
	タイ	 72,438 (620)	千タイバーツ 214,520 (－)	 15,997	千タイバーツ 48,046

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

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜投資信託受益証券、投資証券＞

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
外国				
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,960	5,454	－	－
小計	38,960	5,454	－	－
ブラジル	口	千ブラジルレアル	口	千ブラジルレアル
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	68,800	1,459	－	－
小計	68,800	1,459	－	－
香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	－ (19,877)	－ (41)	19,877	31
小計	－ (19,877)	－ (41)	19,877	31

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種類別		当期			
		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国	株式先物取引	百万円 46,644	百万円 43,074	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	47,906,677千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	136,301,723千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.35

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※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	0.839051	0.839051	100.0	0.839051	0.839051	100.0
コール・ローン	48,256	6,468	13.4	48,209	6,474	13.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国株式＞

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

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR		537	638	1,512	228,985	運輸
BEIGENE LTD-ADR		60	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	20,203	19,714	27,882	4,222,248	
	銘柄数<比率>	40	32	－	<2.6%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S.A.B.-A		3,135	3,135	3,526	30,050	資本財
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		2,424	3,131	66,570	567,213	食品・飲料・タバコ
GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO		2,884	5,906	5,032	42,880	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		1,818	1,818	14,643	124,774	食品・飲料・タバコ
GRUMA S.A.B.-B		259	259	8,427	71,807	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		426	426	7,035	59,944	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		375	1,020	12,830	109,322	資本財
CEMEX SAB-SPONS		20,634	22,142	27,235	232,059	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		3,246	4,123	63,065	537,348	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV		1,785	1,785	5,617	47,861	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		145	350	7,780	66,293	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		1,818	1,818	6,255	53,302	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		233	335	12,811	109,160	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B		4,229	4,888	36,911	314,503	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L		35,136	－	－	－	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		2,525	2,717	10,620	90,494	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM		504	818	14,122	120,331	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V		6,666	8,272	53,367	454,720	生活必需品流通・小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B		436	599	13,608	115,949	運輸
OPERADORA DE SITES MEX- A-1		2,211	2,211	4,063	34,625	電気通信サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV		－	35,213	53,277	453,954	電気通信サービス
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE		1,756	－	－	－	電気通信サービス
BANCO DEL BAJIO SA		－	1,427	7,720	65,778	銀行
小計	株数・金額	92,653	102,401	434,525	3,702,378	
	銘柄数<比率>	21	21	－	<2.3%>	
(ブラジル)				千ブラジルレアル		
BRF SA		1,063	－	－	－	食品・飲料・タバコ
VALE SA		5,095	5,253	37,024	1,134,242	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B		370	370	1,518	46,530	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		1,224	2,117	7,892	241,779	公益事業
BANCO DO BRASIL S.A.		1,160	1,565	7,748	237,371	銀行
ITAUSA SA		5,283	7,746	7,227	221,418	銀行
GERDAU SA-PREF		1,418	1,555	3,535	108,295	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		4,963	5,941	22,302	683,244	エネルギー
VIBRA ENERGIA SA		1,730	1,730	3,710	113,683	一般消費財・サービス流通・小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR		5,764	7,280	25,394	777,953	エネルギー
CCR SA		1,256	2,486	3,090	94,666	運輸
WEG SA		2,175	2,558	8,291	254,024	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF		5,849	8,281	12,638	387,170	銀行
BANCO BRADESCO S.A.		3,260	3,260	4,394	134,635	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		994	994	1,244	38,125	素材

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
SUZANO SA	900	1,217	6,506	199,333	素材
CPFL ENERGIA SA	272	272	951	29,148	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6,122	7,802	22,815	698,957	銀行
BRASKEM SA-PREF A	193	－	－	－	素材
ENGIE BRASIL SA	462	462	1,896	58,106	公益事業
LOCALIZA RENT A CAR	924	1,373	7,588	232,461	運輸
LOJAS RENNER S.A.	1,159	2,164	2,932	89,848	一般消費財・サービス流通・小売り
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	1,772	54,287	エネルギー
COSAN SA	1,621	1,621	2,814	86,209	エネルギー
TOTVS SA	579	579	1,793	54,951	ソフトウェア・サービス
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,651	1,651	5,497	168,427	公益事業
AMERICANAS SA	730	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
JBS SA	1,100	1,100	2,317	71,003	食品・飲料・タバコ
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	2,118	2,118	2,711	83,064	公益事業
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	505	505	3,086	94,557	公益事業
ENEVA SA	－	1,022	1,176	36,036	公益事業
HYPERA SA	545	545	1,764	54,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	7,998	8,874	10,968	336,019	金融サービス
MAGAZINE LUIZA SA	3,055	3,055	522	16,004	一般消費財・サービス流通・小売り
TELEFONICA BRASIL S.A.	523	894	4,426	135,597	電気通信サービス
RAIA DROGASIL SA	1,225	1,892	4,889	149,779	生活必需品流通・小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	1,089	3,408	104,422	保険
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	6,131	10,451	4,661	142,802	ヘルスケア機器・サービス
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	1,326	1,385	42,450	生活必需品流通・小売り
AMBEV SA	6,286	7,562	10,140	310,661	食品・飲料・タバコ
NATURA &CO HOLDING SA	1,003	1,003	1,349	41,331	家庭用品・パーソナル用品
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	－	1,518	1,897	58,130	生活必需品流通・小売り
TIM SA	961	961	1,655	50,726	電気通信サービス
REDE D'OR SAO LUIZ SA	456	957	2,291	70,187	ヘルスケア機器・サービス
LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT	2	－	－	－	運輸
ITAUSA SA-RECEIPT	－	107	101	3,102	銀行
RUMO SA	1,597	2,443	5,582	171,014	運輸
PRIO SA	847	1,300	5,814	178,141	エネルギー
小計 株数・金額	92,438	117,764	270,732	8,293,968	
小計 銘柄数<比率>	45	44	－	<5.0%>	
(チリ)			千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	115,501	115,501	472,170	78,322	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	61	69	161,306	26,756	銀行
BANCO DE CHILE	48,626	75,832	711,304	117,989	銀行
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	236,579	39,243	素材
EMPRESAS COPEC SA	447	904	578,707	95,994	エネルギー
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	73	73	40,395	6,700	食品・飲料・タバコ
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	24,611	24,611	124,043	20,576	運輸
ENEL AMERICAS SA	34,913	34,913	338,622	56,169	公益事業
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	180	212	928,647	154,041	資本財
FALABELLA SA	708	708	132,890	22,043	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
CENCOSUD SA		1,379	3,064	464,704	77,083	生活必需品流通・小売り
ENEL CHILE SA		25,612	25,612	139,282	23,103	公益事業
小計	株数・金額	253,477	282,864	4,328,654	718,024	
	銘柄数<比率>	12	12	－	<0.4%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		505	505	776,859	29,256	公益事業
ECOPETROL SA		7,934	－	－	－	エネルギー
BANCOLOMBIA SA		293	506	1,561,498	58,806	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		615	615	1,663,486	62,646	銀行
小計	株数・金額	9,348	1,627	4,001,843	150,709	
	銘柄数<比率>	4	3	－	<0.1%>	
(ギリシャ)				千ユーロ		
ALPHA SERVICES AND HLD		2,636	2,636	377	61,000	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		736	736	405	65,577	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		262	262	338	54,618	電気通信サービス
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A		4,276	4,276	653	105,573	銀行
MYTILINEOS S.A.		98	202	705	114,038	資本財
MOTOR OIL (HELLAS) SA		－	52	116	18,805	エネルギー
OPAP SA		184	205	318	51,384	消費者サービス
JUMBO SA		193	193	517	83,617	一般消費財・サービス流通・小売り
PUBLIC POWER CORP		208	558	547	88,447	公益事業
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS		－	1,130	315	50,961	銀行
ユーロ計	株数・金額	8,597	10,255	4,295	694,027	
	銘柄数<比率>	8	10	－	<0.4%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T.A.S.		2,763	5,861	17,210	91,192	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		995	1,991	8,498	45,033	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		1,167	2,588	9,712	51,464	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		65	163	13,677	72,471	自動車・自動車部品
HEKTAS TICARET T.A.S		－	1,330	3,012	15,963	素材
KOC HOLDING AS		898	898	12,880	68,249	資本財
SASA POLYESTER SANAYI		－	1,180	5,230	27,716	素材
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		2,987	2,987	14,596	77,344	資本財
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		－	316	8,374	44,375	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		866	866	19,938	105,649	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		1,430	1,430	7,948	42,117	電気通信サービス
TURKIYE IS BANKASI-C		3,844	3,844	7,712	40,865	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		116	1,425	21,474	113,784	エネルギー
YAPI VE KREDI BANKASI		－	3,711	6,298	33,371	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING		2,113	2,113	12,344	65,407	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		428	812	24,855	131,703	生活必需品流通・小売り
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS		－	167	375	1,991	素材
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS		－	71	5,310	28,137	運輸
小計	株数・金額	17,677	31,763	199,452	1,056,839	
	銘柄数<比率>	12	18	－	<0.6%>	

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)	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		226	133	8,952	58,911	銀行
CEZ AS		179	252	25,169	165,618	公益事業
MONETA MONEY BANK AS		607	607	5,500	36,193	銀行
小計	株数・金額	1,013	992	39,622	260,723	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.2%>	
(ハンガリー)				千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT		151	287	256,369	109,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY		445	445	127,157	54,177	エネルギー
OTP BANK NYRT		386	400	550,288	234,459	銀行
小計	株数・金額	983	1,132	933,816	397,868	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.2%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
M BANK SA		14	14	761	27,699	銀行
BUDIMEX		－	26	1,265	46,063	資本財
KGHM POLSKA MIEDZ SA		201	201	2,210	80,451	素材
BANK PEKAO SA		276	276	3,622	131,847	銀行
ORANGE POLSKA SA		556	－	－	－	電気通信サービス
ORLEN SA		833	1,029	6,513	237,070	エネルギー
LPP SA		1	1	1,753	63,817	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA		73	73	3,483	126,790	銀行
CD PROJEKT SA		67	67	737	26,840	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA		1,302	1,302	5,717	208,099	銀行
CYFROWY POLSAT SA		360	360	442	16,121	メディア・娯楽
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA		634	998	720	26,219	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		485	865	4,098	149,188	保険
DINO POLSKA SA		59	94	4,072	148,229	生活必需品流通・小売り
ALLEGRO.EU SA		392	837	2,595	94,455	一般消費財・サービス流通・小売り
PEPCO GROUP NV		－	228	418	15,244	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額	5,260	6,379	38,413	1,398,138	
	銘柄数<比率>	14	15	－	<0.8%>	
(ロシア)				千ロシアルーブル		
SBERBANK OF RUSSIA PJSC		11,414	11,414	0.00011	－	銀行
PHOSAGRO PJSC		88	88	－	－	素材
POLYUS PJSC		39	39	－	－	素材
TATNEFT PJSC		1,794	1,794	0.00001	－	エネルギー
NOVOLIPETSK STEEL PJSC		1,959	1,959	0.00001	－	素材
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO		797	797	－	－	電気通信サービス
MAGNIT PJSC		79	79	－	－	生活必需品流通・小売り
NOVATEK PJSC		1,059	1,059	0.00001	－	エネルギー
GAZPROM PJSC		13,106	13,106	0.00013	－	エネルギー
LUKOIL PJSC		440	440	－	－	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC		1,340	1,340	0.00001	－	エネルギー
VTB BANK PJSC		7,560,740	7,560,740	0.0756	0.124	銀行
MMC NORILSK NICKEL PJSC		72	72	－	－	素材

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

銘柄	当期首(前期末)	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)	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	4,937	4,937	5,757	111,630	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	9,180	13,200	13,939	270,281	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	9,050	10,624	206,012	素材
MMG LIMITED	3,040	－	－	－	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	3,992	3,992	3,057	59,292	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	4,088	5,134	99,558	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	－	220	179	3,485	エネルギー
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	4,160	4,243	82,275	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	880	1,160	6,658	129,106	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	4,460	4,460	2,461	47,736	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	4,860	4,860	1,744	33,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	2,080	2,460	10,110	196,044	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	3,100	3,100	1,732	33,600	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	13,810	19,710	6,918	134,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	4,020	4,580	11,450	222,015	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	7,929	10,591	324,931	6,300,429	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	8,190	10,580	40,204	779,555	保険
LI NING CO LTD	2,920	3,800	9,500	184,205	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,006	19,516	公益事業
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	1,971	38,224	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	2,140	6,300	3,276	63,521	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,533	29,740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	4,600	4,555	11,045	214,179	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	5,180	5,180	4,009	77,748	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	13,714	13,714	6,322	122,593	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	4,420	3,757	72,848	資本財
BAIDU INC-CLASS A	2,819	3,514	36,796	713,490	メディア・娯楽
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	121,876	152,016	67,799	1,314,626	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	996	1,221	10,006	194,018	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	946	18,361	自動車・自動車部品
MINTH GROUP LTD	640	1,760	3,139	60,881	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,640	3,640	1,619	31,407	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	4,120	7,280	2,686	52,087	素材
BANK OF CHINA LTD-H	102,282	123,942	34,579	670,502	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	－	－	－	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	725	725	579	11,232	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,949	6,219	18,502	358,757	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	70,435	100,565	37,309	723,434	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,810	1,810	1,677	32,533	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	517	10,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,960	1,960	631	12,237	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	3,290	3,290	1,990	38,594	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	780	780	1,463	28,372	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	1,579	30,622	資本財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	10,166	－	－	－	不動産管理・開発
CMOC GROUP LTD-H	8,100	8,100	3,458	67,064	素材

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
CHINA CITIC BANK-H	9,512	15,652	5,446	105,615	銀行
SUNNY OPTICAL TECH	929	1,195	8,263	160,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,516	1,988	18,090	350,780	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	250	250	476	9,229	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	1,393	27,028	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	6,259	588	11,408	不動産管理・開発
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	4,380	4,380	1,357	26,327	耐久消費財・アパレル
KINGSOFT CORP LTD	920	1,712	5,084	98,591	メディア・娯楽
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	－	31,490	3,747	72,660	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	545	1,665	2,387	46,295	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	7,060	7,060	2,527	49,007	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	436	8,469	食品・飲料・タバコ
DONGYUE GROUP	1,470	1,470	876	16,987	素材
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	605	1,605	5,689	110,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,560	2,579	50,023	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	3,866	3,866	6,579	127,584	保険
CRRC CORP LTD-H	4,090	9,360	3,023	58,621	資本財
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	1,650	1,650	1,156	22,427	耐久消費財・アパレル
SINOPHARM GROUP CO-H	1,912	1,912	3,636	70,514	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	2,360	－	－	－	エネルギー
CHINA RESOURCES CEMENT	2,880	2,880	558	10,833	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,583	3,583	1,322	25,639	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,190	5,555	3,916	75,936	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,520	4,520	2,906	56,354	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,474	28,581	ヘルスケア機器・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	－	2,520	2,882	55,899	一般消費財・サービス流通・小売り
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	1,162	－	－	－	資本財
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	1,600	1,600	1,433	27,797	資本財
LONGFOR PROPERTIES	2,290	3,435	4,204	81,524	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	964	1,054	1,764	34,211	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	6,744	6,744	1,726	33,476	銀行
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,412	－	－	－	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	3,750	3,750	832	16,142	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	39,100	39,350	11,096	215,165	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	920	920	1,810	35,106	一般消費財・サービス流通・小売り
FAR EAST HORIZON LTD	2,400	2,400	1,336	25,920	金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	660	660	891	17,276	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	2,857	2,857	4,635	89,877	金融サービス
SEAZEN GROUP LTD	7,680	－	－	－	エクイティ不動産投資信託（REIT）
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	2,470	2,470	3,280	63,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	3,572	3,572	1,621	31,444	金融サービス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	1,208	23,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	9,390	18,780	4,732	91,764	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	730	730	1,321	25,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,830	4,830	2,038	39,521	金融サービス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	2,760	2,760	1,656	32,109	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	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 LESSO GROUP HOLDINGS L	1,280	－	－	－	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	－	－	－	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	10,590	10,750	3,891	75,456	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	480	480	706	13,700	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	1,320	1,320	3,161	61,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EAST BUY HOLDING LTD	－	440	1,304	25,296	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	2,320	3,410	2,441	47,341	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	537	537	991	19,221	生活必需品流通・小売り
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	950	950	1,369	26,562	素材
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	1,045	－	－	－	エクイティ不動産投資信託（REIT）
CHINA TOWER CORP LTD-H	45,660	70,820	5,523	107,109	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	19,062	24,042	39,717	770,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIGENE LTD	－	1,109	12,998	252,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI APPTEC CO LTD-H	422	636	6,101	118,304	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	5,589	8,061	92,707	1,797,593	消費者サービス
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	1,668	1,668	2,465	47,802	消費者サービス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	1,160	2,340	3,898	75,590	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	6,259	8,959	4,399	85,302	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	1,390	2,030	9,601	186,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	8,320	8,320	640	12,422	金融サービス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	1,040	1,040	532	10,324	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	2,430	2,430	1,620	31,427	資本財
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1,240	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	100	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	1,140	4,100	2,652	51,435	一般消費財・サービス流通・小売り
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	1,220	1,220	1,771	34,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	5,640	5,640	2,763	53,586	食品・飲料・タバコ
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	19,309	26,039	213,917	4,147,862	一般消費財・サービス流通・小売り
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	334	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC - CL A	2,735	3,791	38,707	750,533	一般消費財・サービス流通・小売り
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,950	1,950	1,261	24,463	食品・飲料・タバコ
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	－	90	819	15,889	一般消費財・サービス流通・小売り
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	570	2,350	2,042	39,597	消費者サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	2,116	3,724	21,394	414,837	メディア・娯楽
HAIER SMART HOME CO LTD-H	3,030	3,106	6,957	134,904	耐久消費財・アパレル
BILIBILI INC-CLASS Z	266	266	3,053	59,210	メディア・娯楽
AKESO INC	－	610	2,909	56,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETEASE INC	2,584	3,136	55,449	1,075,171	メディア・娯楽
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	880	－	－	－	ソフトウェア・サービス
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,680	12,680	2,345	45,485	メディア・娯楽
GDS HOLDINGS LTD-CL A	1,267	1,267	1,355	26,286	ソフトウェア・サービス
NONGFU SPRING CO LTD-H	2,276	2,826	12,476	241,924	食品・飲料・タバコ
LI AUTO INC-CLASS A	－	1,716	26,587	515,528	自動車・自動車部品
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,508	1,934	7,370	142,912	生活必需品流通・小売り
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	352	754	3,717	72,076	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	676	1,190	3,451	66,914	不動産管理・開発

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	51	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	1,784	3,155	2,524	48,940	不動産管理・開発
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	2,445	2,445	13,178	255,532	消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP	646	646	1,498	29,060	一般消費財・サービス流通・小売り
JD LOGISTICS INC	－	3,262	3,105	60,214	運輸
TRIP.COM GROUP LTD	－	876	23,001	445,993	消費者サービス
XPENG INC - CLASS A SHARES	－	1,671	10,832	210,034	自動車・自動車部品
ZAI LAB LTD	－	1,282	2,994	58,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	900	900	1,813	35,163	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H	14,280	14,280	2,627	50,947	公益事業
GF SECURITIES CO LTD-H	886	886	894	17,351	金融サービス
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	584	584	2,046	39,689	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	2,660	2,660	2,878	55,806	金融サービス
3SBIO INC	1,190	4,455	3,145	60,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	－	3,390	1,613	31,288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA LITERATURE LTD	516	516	1,545	29,965	メディア・娯楽
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	640	640	1,007	19,532	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	2,460	－	－	－	食品・飲料・タバコ
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	2,250	2,250	1,516	29,404	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	238	238	1,284	24,896	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,161	1,161	2,496	48,400	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1,080	2,340	3,397	65,881	自動車・自動車部品
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	2,036	3,512	4,670	90,569	金融サービス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,460	6,280	31,651	613,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	540	540	1,564	30,334	素材
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	－	914	1,547	30,004	不動産管理・開発
HUISHAN DAIRY UNTRADE	4,350	4,350	－	－	食品・飲料・タバコ
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	6,500	6,500	－	－	半導体・半導体製造装置
小計 株数・金額	1,053,062	1,311,876	1,794,414	34,793,696	
小計 銘柄数<比率>	194	189	－	<21.2%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	3,007	3,007	1,151	36,891	銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	9,433	9,200	5,317	170,336	銀行
CELCOMDIGI BHD	4,980	4,980	2,121	67,956	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,065	1,072	784	25,120	運輸
RHB BANK BHD	2,170	2,193	1,234	39,557	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	－	－	－	資本財
GAMUDA BHD	－	1,619	744	23,857	資本財
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	166	166	285	9,142	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	1,212	2,311	74,053	銀行
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	506	1,142	2,499	80,071	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	5,711	8,815	8,039	257,519	銀行
MISC BHD	2,175	2,175	1,566	50,172	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	72	182	2,220	71,124	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	734	734	1,065	34,129	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	884	2,022	64,788	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)	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)	
PETRONAS GAS BHD	755	1,484	2,513	80,526	公益事業
TELECOM MALAYSIA BHD	2,715	2,715	1,414	45,319	電気通信サービス
TENAGA NATIONAL BHD	3,052	4,417	4,373	140,096	公益事業
QL RESOURCES BHD	1,248	1,248	698	22,386	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	872	27,959	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	18,704	21,229	8,937	286,287	銀行
TOP GLOVE CORP BHD	5,049	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	2,716	2,716	1,146	36,714	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	916	29,369	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	2,703	2,703	1,070	34,292	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	3,363	3,363	800	25,642	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,813	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	5,410	5,410	1,325	42,464	電気通信サービス
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,079	34,583	電気通信サービス
INARI AMERTRON BHD	2,747	2,747	813	26,046	半導体・半導体製造装置
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,699	4,164	2,998	96,035	素材
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	4,714	2,800	89,694	ヘルスケア機器・サービス
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	4,802	7,576	3,704	118,669	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	1,072	34,344	食品・飲料・タバコ
MR DIY GROUP M BHD	3,034	3,034	482	15,455	一般消費財・サービス流通・小売り
小計 株数・金額	107,358	117,892	68,387	2,190,609	
小計 銘柄数<比率>	34	32	－	<1.3%>	
(タイ)			千タイバーツ		
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,776	1,776	4,795	20,283	生活必需品流通・小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	8,334	35,254	銀行
CP AXTRA PCL-NVDR	－	2,379	6,364	26,920	生活必需品流通・小売り
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	814	3,560	11,482	48,571	公益事業
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	－	－	－	電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR	832	832	10,940	46,279	銀行
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	－	17,132	13,105	55,438	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	169	712	9,184	38,851	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	1,218	1,218	8,712	36,852	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	5,564	5,564	10,460	44,247	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,532	2,038	45,243	191,380	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	8,401	8,401	9,913	41,934	一般消費財・サービス流通・小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	389	4,960	41,416	175,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	13,936	16,846	56,012	236,934	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,849	－	－	－	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	1,015	1,015	4,669	19,749	金融サービス
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	6,627	28,033	不動産管理・開発
SIAM CEMENT PCL-NVDR	1,026	1,304	38,337	162,168	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	5,270	6,549	45,188	191,145	運輸
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	2,263	3,784	23,650	100,039	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	11,769	18,881	50,506	213,643	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	827	827	19,269	81,508	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,627	3,627	10,065	42,579	消費者サービス

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
NCSOFT CORPORATION	19	27	716,530	82,472	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	221	221	228,993	26,357	電気通信サービス
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	550	820	1,157,062	133,177	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	－	86	511,037	58,820	資本財
LG H&H CO LTD	13	13	449,800	51,772	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	61	80	3,780,672	435,155	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	8	8	258,715	29,778	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	3	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	594	677	2,358,674	271,483	銀行
HMM CO LTD	355	355	582,582	67,055	運輸
S-OIL CORPORATION	63	63	427,929	49,254	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	123	182	575,694	66,262	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	479	－	－	－	金融サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	159	603,593	69,473	金融サービス
POSCO FUTURE M CO LTD	33	47	1,386,957	159,638	資本財
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	19	23	365,233	42,038	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	43	43	291,884	33,595	一般消費財・サービス流通・小売り
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	43	62	614,362	70,713	資本財
HYUNDAI MOBIS	81	101	2,273,152	261,639	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	689	873	11,183,360	1,287,204	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	97	97	345,298	39,743	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	34	34	350,763	40,372	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	168	207	3,623,802	417,099	自動車・自動車部品
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	－	28	214,206	24,655	資本財
HYUNDAI STEEL CO	111	111	383,782	44,173	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	283	283	326,078	37,531	銀行
KIA CORP	327	392	3,041,410	350,066	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	12	12	577,920	66,518	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	264	442	760,485	87,531	公益事業
KOREAN AIR LINES CO LTD	237	268	580,696	66,838	運輸
CJ LOGISTICS	8	－	－	－	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	18	18	248,258	28,574	素材
HLB INC	100	239	732,626	84,325	ヘルスケア機器・サービス
LG ELECTRONICS INC	135	172	1,789,239	205,941	耐久消費財・アパレル
LG CORP	116	166	1,377,616	158,563	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	121	124,338	14,311	金融サービス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	67	－	－	－	資本財
NAVER CORP	170	215	4,276,759	492,255	メディア・娯楽
L&F CO LTD	30	43	663,761	76,398	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	262,774	30,245	金融サービス
PACIFIC CORP	33	－	－	－	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	77	285	443,610	51,059	消費者サービス
POSCO HOLDINGS INC	101	117	5,426,992	624,646	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	185	303	745,380	85,793	資本財
COSMOAM&T CO LTD	－	39	618,181	71,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDI CO LTD	68	88	3,877,708	446,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)	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)	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	68	92	1,232,605	141,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GREEN CROSS CORP	5	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,036	7,504	52,760,079	6,072,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	951	951	681,410	78,430	資本財
HANWHA AEROSPACE CO LTD	－	58	724,171	83,352	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,077	1,330	7,569,236	871,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUHAN CORPORATION	125	131	816,770	94,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	190	190	142,690	16,423	自動車・自動車部品
GS HOLDINGS CORP	65	65	277,894	31,985	資本財
LG DISPLAY CO LTD	383	383	510,935	58,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	122	175	2,771,952	319,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	－	72	445,137	51,235	半導体・半導体製造装置
HANA FINANCIAL GROUP	410	512	2,075,584	238,899	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	27	27	484,306	55,743	運輸
CELLTRION PHARM INC	19	20	147,719	17,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOTTE SHOPPING CO	10	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	73	－	－	－	保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	121	121	840,678	96,762	保険
AMOREPACIFIC CORP	37	37	545,490	62,785	家庭用品・パーソナル用品
JYP ENTERTAINMENT CORP	－	41	439,845	50,626	メディア・娯楽
SK INNOVATION CO LTD	67	100	1,365,984	157,224	エネルギー
ECOPRO CO LTD	－	31	2,283,957	262,883	素材
CJ CHEILJEDANG CORP	7	18	558,136	64,241	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	136,785	15,744	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	26	645,692	74,319	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	45	63	1,020,482	117,457	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	486	645	3,449,586	397,047	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	58	134	624,514	71,881	資本財
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	21	21	89,889	10,346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	79	169	903,070	103,943	金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	11	11	347,805	40,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	38	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMART	35	－	－	－	生活必需品流通・小売り
HANKOOK TIRE & TECHONOLOGY CO	70	70	308,077	35,459	自動車・自動車部品
HD HYUNDAI	51	51	306,656	35,296	エネルギー
BGF RETAIL CO LTD/NEW	16	16	239,904	27,612	生活必需品流通・小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	31	31	387,094	44,554	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	11	－	－	－	素材
NETMARBLE CORP	24	24	115,608	13,306	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	770	1,138	1,397,635	160,867	銀行
ECOPRO BM CO LTD	65	82	2,045,652	235,454	資本財
SD BIOSENSOR INC	39	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	31	31	272,384	31,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KRAFTON INC	35	37	723,704	83,298	メディア・娯楽
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	21	21	234,553	26,997	資本財
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	23	23	157,347	18,110	素材

銘柄	当期首(前期末)	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)	
SK SQUARE CO LTD	116	116	557,931	64,217	資本財
SK BIOSCIENCE CO LTD	21	21	144,480	16,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KAKAO GAMES CORP	30	30	81,264	9,353	メディア・娯楽
HYBE CO LTD	24	24	524,488	60,368	メディア・娯楽
LG ENERGY SOLUTION	31	73	3,161,301	363,865	資本財
KAKAOBANK CORP	184	354	852,788	98,156	銀行
F&F CO LTD / NEW	30	30	283,899	32,676	耐久消費財・アパレル
KAKAOPAY CORP	－	30	130,415	15,010	金融サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	37	72	1,046,710	120,476	ソフトウェア・サービス
ALTEOGEN INC	34	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG C&T CORP	119	119	1,383,942	159,291	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	22	26	1,934,025	222,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEARL ABYSS CORP	46	46	218,967	25,203	メディア・娯楽
DOOSAN BOBCAT INC	43	120	489,969	56,395	資本財
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	88	153	1,081,344	124,462	ヘルスケア機器・サービス
小計 株数・金額	20,480	24,999	167,794,042	19,313,094	
小計 銘柄数<比率>	111	103	－	<11.7%>	
(台湾)			千新台湾ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	700	700	38,780	181,843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	2,558	6,178	21,623	101,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	920	1,270	45,371	212,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	619	859	35,451	166,237	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	2,341	4,541	18,348	86,038	素材
TAIWAN BUSINESS BANK	－	7,987	10,463	49,063	銀行
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	1,880	12,690	59,504	半導体・半導体製造装置
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	－	750	17,325	81,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	1,000	1,000	17,200	80,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,410	2,110	32,599	152,862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	2,862	4,082	89,411	419,257	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EVA AIRWAYS CORP	3,860	3,860	11,444	53,666	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	1,187	1,187	21,781	102,135	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,935	6,083	10,585	49,637	銀行
CHINA AIRLINES LTD	4,650	4,650	9,741	45,680	運輸
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	7,932	37,195	自動車・自動車部品
CHINA STEEL	14,942	17,792	43,680	204,823	素材
ADVANTECH CO LTD	433	762	26,043	122,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	4,317	8,057	23,850	111,837	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,399	3,029	91,476	428,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,150	2,590	16,731	78,455	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	5,053	5,843	68,657	321,939	電気通信サービス
AUO CORP	7,560	12,680	20,289	95,137	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	2,452	2,452	24,127	113,137	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE	1,232	1,832	19,970	93,643	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,620	10,951	51,351	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	704	789	14,754	69,185	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	399	23,682	111,050	耐久消費財・アパレル

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

銘柄	当期首(前期末)	当期末			業種
	株数(百株)	株数(百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
PEGATRON CORP	2,004	3,404	26,556	124,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	185	185	20,319	95,282	資本財
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	－	－	－	半導体・半導体製造装置
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,803	2,207	39,284	184,211	金融サービス
PARADE TECHNOLOGIES LTD	80	80	8,520	39,951	半導体・半導体製造装置
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	30	－	－	－	半導体・半導体製造装置
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	1,379	1,379	14,274	66,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	11,107	15,149	38,933	182,563	銀行
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	4,518	6,899	30,876	144,784	銀行
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	90	90	12,825	60,137	資本財
WIWYNN CORP	80	160	28,560	133,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	4,273	5,143	60,689	284,577	半導体・半導体製造装置
SILERGY CORP	360	530	17,384	81,515	半導体・半導体製造装置
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	3,010	5,760	16,387	76,841	半導体・半導体製造装置
PHARMAESSENTIA CORP	－	250	9,362	43,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOMO.COM INC	60	66	3,544	16,619	一般消費財・サービス流通・小売り
GLOBALWAFERS CO LTD	240	420	21,588	101,228	半導体・半導体製造装置
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	310	310	9,656	45,280	耐久消費財・アパレル
小計 株数・金額	420,849	545,566	5,067,778	23,763,322	
小計 銘柄数<比率>	87	90	－	<14.4%>	
(中国オフショア)			千オフショア人民元		
EVE ENERGY CO LTD-A	75	394	1,894	39,295	資本財
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	91	91	610	12,658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	1,716	1,716	1,139	23,646	金融サービス
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	103	－	－	－	食品・飲料・タバコ
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	327	327	297	6,175	半導体・半導体製造装置
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	112	112	499	10,361	素材
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	481	481	687	14,268	資本財
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	183	183	393	8,160	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	80	80	558	11,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	430	－	－	－	素材
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	407	407	676	14,040	資本財
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	－	41	124	2,582	ソフトウェア・サービス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	22	22	345	7,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	－	73	203	4,214	資本財
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	404	404	575	11,942	資本財
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	163	163	473	9,822	メディア・娯楽
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	285	285	554	11,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,113	－	－	－	素材
GEM CO LTD-A	－	2,898	1,733	35,949	素材
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	55	55	450	9,341	ソフトウェア・サービス
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	409	8,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	615	615	370	7,679	メディア・娯楽
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	100	100	902	18,710	資本財
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	413	537	422	8,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	277	277	655	13,601	耐久消費財・アパレル

銘柄	当期首(前期末)	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)	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	348	348	573	11,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	94	94	212	4,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	274	274	498	10,333	食品・飲料・タバコ
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	84	84	213	4,418	資本財
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	288	－	－	－	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	170	170	766	15,890	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	58	58	137	2,846	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	335	335	1,249	25,909	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	148	941	19,520	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	53	53	87	1,805	食品・飲料・タバコ
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	201	201	470	9,769	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	796	796	725	15,059	エネルギー
CHINA BAOAN GROUP-A	640	640	703	14,590	資本財
TIANQI LITHIUM CORP-A	114	114	628	13,027	素材
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	348	348	387	8,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	470	470	503	10,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	922	－	－	－	素材
NAVINFO CO LTD-A	332	332	336	6,976	ソフトウェア・サービス
BY-HEALTH CO LTD-A	297	297	542	11,262	家庭用品・パーソナル用品
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	5,664	－	－	－	エクイティ不動産投資信託（REIT）
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	378	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	312	6,488	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	188	188	431	8,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	484	484	543	11,266	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	440	9,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	68	68	530	10,995	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	197	197	689	14,311	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	313	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	1,374	1,374	524	10,887	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	705	917	1,654	34,315	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	280	280	871	18,086	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	－	502	1,372	28,480	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	229	4,754	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	148	148	256	5,311	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,994	1,994	1,130	23,452	資本財
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	1,050	21,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	97	97	406	8,440	ヘルスケア機器・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD-A	280	280	820	17,018	エネルギー
TONGLING NONFERROUS METALS-A	3,316	3,316	984	20,429	素材
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	245	245	603	12,517	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	184	3,969	82,341	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	283	283	1,788	37,099	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	595	595	412	8,553	食品・飲料・タバコ
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	295	368	714	14,816	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	334	334	366	7,604	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	264	343	381	7,920	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	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)	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	812	16,856	金融サービス
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	536	536	439	9,117	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	464	464	1,482	30,756	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	476	476	804	16,697	素材
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	960	19,923	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	270	5,609	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	303	303	647	13,438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	557	557	367	7,625	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	523	10,867	ソフトウェア・サービス
HESTEEL CO LTD-A	－	8,321	1,805	37,456	素材
GOERTEK INC -A	269	269	500	10,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	1,520	1,520	1,073	22,267	金融サービス
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	425	－	－	－	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	583	583	1,466	30,427	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	168	168	228	4,746	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,020	1,122	462	9,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	199	199	114	2,373	金融サービス
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	793	793	298	6,185	不動産管理・開発
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	433	433	723	15,018	自動車・自動車部品
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	12	785	2,027	42,055	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	99	99	504	10,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EAST MONEY INFORMATION CO-A	978	1,174	1,824	37,853	金融サービス
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,103	22,897	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	302	415	6,579	136,490	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	641	641	453	9,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	452	9,390	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	547	547	606	12,572	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	435	435	1,465	30,409	耐久消費財・アパレル
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	－	2,251	2,212	45,900	金融サービス
PING AN BANK CO LTD-A	1,194	1,194	1,252	25,981	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	381	381	703	14,588	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	934	19,384	金融サービス
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	642	13,322	不動産管理・開発
ZTE CORP-A	126	764	2,115	43,883	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	801	801	517	10,733	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	432	432	610	12,671	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	902	18,730	金融サービス
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	201	201	182	3,792	資本財
BYD CO LTD -A	97	170	4,068	84,387	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	500	500	332	6,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	248	248	697	14,465	素材
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	108	108	468	9,709	素材
LB GROUP CO LTD-A	153	153	271	5,630	素材
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	223	223	237	4,917	素材
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	142	142	560	11,626	半導体・半導体製造装置
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	499	499	886	18,394	素材

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)	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)	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	1,011	2,252	46,725	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	599	12,429	資本財
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	3,157	3,157	1,158	24,034	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	796	16,529	銀行
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	－	895	670	13,905	エネルギー
GEMDALE CORP-A	455	455	247	5,143	不動産管理・開発
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	175	403	3,423	71,024	素材
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	－	4,867	2,160	44,826	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,056	2,691	3,196	66,316	素材
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	828	－	－	－	金融サービス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	676	1,769	2,140	44,401	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	699	839	1,903	39,492	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	122	207	1,988	41,253	一般消費財・サービス流通・小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	737	15,300	素材
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	1,225	1,225	418	8,690	金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,643	1,643	948	19,665	素材
AIR CHINA LTD-A	259	259	203	4,217	運輸
TBEA CO LTD-A	225	292	418	8,683	資本財
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	－	2,301	1,603	33,268	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	3,309	3,309	1,075	22,308	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	845	17,536	資本財
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	552	552	1,420	29,470	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	197	4,105	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	160	160	470	9,754	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	1,140	1,140	481	9,979	金融サービス
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	598	12,415	自動車・自動車部品
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	923	923	1,333	27,666	公益事業
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	410	8,513	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	1,475	1,475	1,140	23,651	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	104	216	160	3,325	ヘルスケア機器・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	－	1,835	1,768	36,694	運輸
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	1,142	1,142	732	15,194	金融サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A	284	284	1,421	29,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	72	72	165	3,434	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	742	15,404	資本財
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	207	310	611	12,682	エネルギー
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	168	3,493	運輸
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	432	432	662	13,746	資本財
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	878	99	194	4,027	エネルギー
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	165	165	540	11,210	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	131	131	227	4,723	ソフトウェア・サービス
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	185	185	683	14,176	自動車・自動車部品
AVICOPTER PLC-A	155	155	578	11,993	資本財
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	－	3,076	2,448	50,791	金融サービス
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	－	2,377	1,916	39,757	エネルギー
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	600	600	238	4,953	素材

銘柄	当期首(前期末)	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)	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	228	228	132	2,752	資本財
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	39	39	978	20,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	93	93	2,330	48,342	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	208	－	－	－	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	－	1,467	911	18,897	エネルギー
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	304	－	－	－	素材
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	1,105	1,105	711	14,761	一般消費財・サービス流通・小売り
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	85	－	－	－	エクイティ不動産投資信託（REIT）
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	－	322	1,167	24,222	ソフトウェア・サービス
ZHEJIANG JUHUA CO-A	－	1,294	1,921	39,861	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	2,866	2,866	854	17,716	素材
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	280	831	2,438	50,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	411	411	600	12,456	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	－	640	891	18,493	エネルギー
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	115	115	396	8,230	食品・飲料・タバコ
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	179	250	199	4,137	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	90	90	142	2,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	243	243	426	8,856	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	882	18,301	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	79	95	417	8,659	ソフトウェア・サービス
JCET GROUP CO LTD-A	298	298	940	19,515	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	75	75	191	3,979	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	79	79	595	12,351	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	262	262	857	17,782	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	100	－	－	－	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	179	179	546	11,342	素材
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	47	47	482	10,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA JUSHI CO LTD -A	922	922	1,080	22,415	素材
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	471	471	669	13,883	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	114	114	667	13,849	資本財
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	902	902	742	15,399	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	98	98	134	2,780	素材
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	78	101	681	14,134	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	107	107	373	7,750	食品・飲料・タバコ
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	－	103	565	11,736	素材
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	33	59	445	9,247	資本財
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	90	90	707	14,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	－	37	464	9,644	資本財
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	210	210	1,093	22,682	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD-A	254	254	803	16,672	半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	2,413	2,413	1,148	23,826	公益事業
ZANGGE MINING CO LTD-A	374	374	849	17,626	素材
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	27	27	317	6,575	資本財
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	470	1,003	2,432	50,453	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	90	90	1,290	26,764	自動車・自動車部品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	962	962	1,748	36,279	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)	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)	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	202	540	2,081	43,183	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	173	173	969	20,107	食品・飲料・タバコ
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	293	293	554	11,505	自動車・自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	263	263	769	15,969	資本財
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7	7	50	1,037	自動車・自動車部品
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	723	723	1,093	22,691	金融サービス
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	1,256	26,066	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	22	22	107	2,231	食品・飲料・タバコ
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	183	183	1,377	28,584	食品・飲料・タバコ
SKSHU PAINT CO LTD-A	－	99	586	12,167	素材
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	2,297	2,297	1,571	32,597	銀行
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	1,127	1,127	1,201	24,921	銀行
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	392	392	758	15,731	自動車・自動車部品
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	557	557	765	15,875	運輸
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	79	79	291	6,051	耐久消費財・アパレル
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	20	20	181	3,755	ヘルスケア機器・サービス
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	556	556	917	19,041	公益事業
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	151	211	574	11,921	半導体・半導体製造装置
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	101	141	508	10,542	生活必需品流通・小売り
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	29	29	874	18,142	メディア・娯楽
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	82	82	411	8,531	資本財
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	405	405	364	7,558	金融サービス
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	124	－	－	－	素材
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	36	36	61	1,273	金融サービス
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	110	110	426	8,853	商業・専門サービス
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	128	128	158	3,295	不動産管理・開発
小計 株数・金額	177,568	255,186	342,099	7,096,437	
小計 銘柄数<比率>	345	347	－	<4.3%>	
(インド)			千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,870	4,813	1,112,212	2,035,349	エネルギー
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	962	935	35,871	65,645	エネルギー
ASIAN PAINTS LTD	469	569	175,325	320,845	素材
BANK OF BARODA	－	2,483	47,924	87,701	銀行
EICHER MOTORS LTD	178	178	63,291	115,824	自動車・自動車部品
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	1,107	1,501	233,146	426,658	自動車・自動車部品
SHREE CEMENT LTD	13	13	35,992	65,865	素材
ICICI BANK LTD	6,532	8,122	761,418	1,393,395	銀行
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	594	594	17,726	32,439	エネルギー
STATE BANK OF INDIA	2,269	2,688	155,607	284,761	銀行
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	264	264	19,445	35,585	運輸
TATA STEEL LTD	9,408	11,379	136,212	249,268	素材
JSW STEEL LTD	993	993	74,548	136,424	素材
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	610	932	84,129	153,957	食品・飲料・タバコ
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	－	29	21,209	38,813	金融サービス
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	145	150	70,126	128,330	食品・飲料・タバコ
NESTLE INDIA LIMITED	39	51	124,677	228,158	食品・飲料・タバコ

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

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

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

銘柄	当期首(前期末)	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)	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	563	998	8,726	70,862	素材
EXXARO RESOURCES LTD	342	342	6,487	52,678	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	113	146	27,608	224,181	銀行
MTN GROUP LTD	2,192	2,553	24,283	197,184	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	513	－	－	－	素材
FIRSTRAND LTD	6,175	8,166	51,513	418,288	金融サービス
NASPERS LTD-N SHS	276	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
NEDBANK GROUP LTD	631	631	13,094	106,325	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	59	99	6,635	53,876	素材
SASOL LTD	722	881	20,360	165,329	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	600	852	21,007	170,582	生活必需品流通・小売り
MR PRICE GROUP LTD	285	－	－	－	一般消費財・サービス流通・小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,737	2,036	39,009	316,755	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	－	－	－	生活必需品流通・小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,104	1,763	12,322	100,060	一般消費財・サービス流通・小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	561	561	9,590	77,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABSA GROUP LTD	1,091	1,401	24,823	201,566	銀行
SANLAM LTD	2,140	3,074	21,207	172,205	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	1,140	1,508	12,132	98,516	素材
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,814	22,853	素材
VODACOM GROUP	844	793	8,677	70,461	電気通信サービス
NEPI ROCKCASTLE N.V.	605	673	7,002	56,863	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	4,896	9,746	11,734	95,287	保険
REINET INVESTMENTS SCA	171	171	7,083	57,520	金融サービス
PEPKOR HOLDINGS LTD	1,445	4,755	8,707	70,707	一般消費財・サービス流通・小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	405	－	－	－	メディア・娯楽
SIBANYE STILLWATER LTD	3,949	3,949	9,174	74,493	素材
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	480	480	5,586	45,363	素材
NASPERS LTD-N SHS	－	305	98,796	802,226	一般消費財・サービス流通・小売り
OUTSURANCE GROUP LTD	－	721	2,979	24,190	保険
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	－	674	21,537	174,887	素材
BID CORP LTD	439	580	24,660	200,239	生活必需品流通・小売り
小計 株数・金額	37,474	52,104	592,449	4,810,691	
小計 銘柄数＜比率＞	36	33	－	〈2.9%〉	
(アラブ首長国連邦)			千アラブ首長国連邦ディルハム		
ABU DHABI ISLAMIC BANK	1,857	1,857	1,969	81,331	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK	3,354	5,251	2,904	119,937	銀行
EMIRATES TELECOM GROUP CO	4,357	5,585	10,891	449,816	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	3,270	4,714	3,922	161,990	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	5,293	7,240	9,701	400,686	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	5,768	11,086	7,538	311,358	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	4,870	7,258	4,093	169,069	不動産管理・開発
EMIRATES NBD PJSC	2,702	2,702	4,810	198,678	銀行
MULTIPLY GROUP	－	5,196	1,917	79,192	資本財
AMERICANA RESTAURANTS INTERN	－	4,314	1,453	60,049	消費者サービス

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO		4,440	4,440	1,536	63,449	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	株数・金額	35,915	59,647	50,739	2,095,560	
	銘柄数<比率>	9	11	－	<1.3%>	
(サウジアラビア)				千サウジアラビアリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL		265	510	1,925	77,874	素材
JARIR MARKETING CO		125	1,250	1,792	72,488	一般消費財・サービス流通・小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE		－	62	739	29,922	保険
ETIHAD ETISALAT CO		488	488	2,315	93,626	電気通信サービス
SAUDI AWWAL BANK		1,167	1,478	5,131	207,536	銀行
AL RAJHI BANK		2,485	3,075	21,773	880,510	銀行
ARAB NATIONAL BANK		860	860	2,083	84,263	銀行
BANK ALBILAD		611	897	3,296	133,312	銀行
BANK AL-JAZIRA		358	978	1,668	67,458	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI		675	948	3,527	142,666	銀行
RIYAD BANK		1,660	2,344	6,436	260,289	銀行
SAUDI INVESTMENT BANK/THE		706	706	1,045	42,278	銀行
SAUDI TELECOM CO		1,835	3,013	11,510	465,480	電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO		282	374	4,923	199,108	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP		1,191	1,439	11,198	452,849	素材
SAUDI ELECTRICITY CO		1,119	1,621	2,804	113,413	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP		384	853	1,940	78,463	素材
SAVOLA		253	362	1,348	54,518	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C		319	319	379	15,364	素材
ALMARAI CO		301	301	1,624	65,674	食品・飲料・タバコ
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP		42	42	622	25,179	メディア・娯楽
EMAAR ECONOMIC CITY		461	－	－	－	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH		472	472	1,516	61,324	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO		117	117	442	17,880	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO		1,034	1,034	1,108	44,839	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV		1,009	1,009	1,486	60,117	不動産管理・開発
RABIGH REFINING AND PETROCHE		449	449	438	17,718	エネルギー
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO		905	905	1,312	53,072	電気通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE		60	142	2,915	117,911	保険
ALINMA BANK		1,242	1,613	5,622	227,356	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO		1,065	2,108	7,864	318,039	素材
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO		79	159	1,716	69,419	ヘルスケア機器・サービス
DALLAH HEALTHCARE CO		－	68	1,067	43,162	ヘルスケア機器・サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO		3,066	4,162	13,945	563,943	エネルギー
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL		117	117	2,990	120,922	ヘルスケア機器・サービス
ACWA POWER CO		91	169	3,584	144,940	公益事業
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO		－	93	1,265	51,191	素材
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA		－	44	1,373	55,551	ソフトウェア・サービス
NAHDI MEDICAL CO		－	64	845	34,173	生活必需品流通・小売り
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING		39	109	1,873	75,770	金融サービス
ELM CO		24	40	2,903	117,416	ソフトウェア・サービス
POWER & WATER UTILITY CO FOR		－	160	876	35,442	公益事業

銘柄		当期首(前期末)	当期末			業種
		株数(百株)	株数(百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
THE SAUDI NATIONAL BANK		2,762	4,370	15,317	619,426	銀行
小計	株数・金額	28,132	39,341	158,553	6,411,902	
	銘柄数<比率>	37	42	－	<3.9%>	
(クウェート)				千クウェート・ディナール		
KUWAIT FINANCE HOUSE		9,321	12,929	897	440,606	銀行
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO		2,968	2,968	142	70,105	電気通信サービス
GULF BANK		1,371	1,551	37	18,439	銀行
NATIONAL BANK OF KUWAIT		8,931	12,049	1,072	526,591	銀行
AGILITY		1,576	3,233	169	83,046	運輸
MABANEE CO KPSC		1,337	1,418	118	58,078	不動産管理・開発
BOUBYAN BANK K.S.C		1,528	1,620	97	47,661	銀行
小計	株数・金額	27,036	35,772	2,534	1,244,529	
	銘柄数<比率>	7	7	－	<0.8%>	
合計	株数・金額	10,913,312	13,078,694	－	155,297,427	
	銘柄数<比率>	1,244	1,240	－	<94.4%>	

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄		当期首(前期末)	当期末		
		口数(口)	口数(口)	評価額	
				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		391,700	391,700	11,241	95,785
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV		58,400	97,360	14,324	122,052
小計	口数・金額	450,100	489,060	25,566	217,838
	銘柄数＜比率＞	2	2	－	＜0.1%＞
(ブラジル)				千ブラジルレアル	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT		45,900	45,900	1,353	41,467
ENERGISA SA-UNITS		37,400	37,400	1,792	54,904
KLABIN SA-UNIT		100,000	100,000	2,261	69,266
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT		131,500	200,300	6,519	199,734
小計	口数・金額	314,800	383,600	11,926	365,373
	銘柄数＜比率＞	4	4	－	＜0.2%＞
(南アフリカ)				千南アフリカランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		478,733	478,733	4,950	40,194
小計	口数・金額	478,733	478,733	4,950	40,194
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞
合計	口数・金額	1,243,633	1,351,393	－	623,406
	銘柄数＜比率＞	7	7	－	＜0.4%＞

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)＜　＞内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額(百万円)	売建額(百万円)
外国	MSCI EMERG M	8,526	－

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

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	155,297,427	94.2
投資信託受益証券	487,426	0.3
投資証券	135,980	0.1
コール・ローン等、その他	8,931,784	5.4
投資信託財産総額	164,852,617	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(164,567,837千円)の投資信託財産総額(164,852,617千円)に対する比率は99.8%です。
(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル＝151.43円
1チリペソ＝0.165877円
1イギリスポンド＝185.08円
1ハンガリーフォリント＝0.426067円
1香港ドル＝19.39円
1フィリピンペソ＝2.7103円
1新台湾ドル＝4.6891円
1カタールリアル＝41.59円
1サウジアラビアリアル＝40.44円
1メキシコペソ＝8.5205円
1コロンビアペソ＝0.03766円
1トルコリラ＝5.2987円
1ポーランドズロチ＝36.3973円
1マレーシアリンギット＝32.0325円
1インドネシアルピア＝0.0097円
1オフショア人民元＝20.7438円
1南アフリカランド＝8.12円
1クウェート・ディナール＝491.02円
1ブラジルレアル＝30.6353円
1ユーロ＝161.56円
1チェココルナ＝6.5802円
1ロシアルーブル＝1.65円
1タイバーツ＝4.23円
1韓国ウォン＝0.1151円
1インドルピー＝1.83円
1アラブ首長国連邦ディルハム＝41.30円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2023年11月10日現在
(A)資産	**164,920,447,425円**
コール・ローン等	7,503,319,583
株式(評価額)	155,297,427,328
投資信託受益証券(評価額)	487,426,422
投資証券(評価額)	135,980,476
未収入金	123,926,100
未収配当金	203,368,549
差入委託証拠金	1,168,998,967
(B)負債	**415,987,498**
未払金	259,644,459
未払解約金	156,342,980
未払利息	57
その他未払費用	2
(C)純資産総額(A-B)	**164,504,459,927**
元本	41,935,603,524
次期繰越損益金	122,568,856,403
(D)受益権総口数	**41,935,603,524口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**39,228円**

■損益の状況

項目	当期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配当等収益	**4,188,069,288円**
受取配当金	4,034,836,619
受取利息	106,982,057
その他収益金	46,735,760
支払利息	△485,148
(B)有価証券売買損益	**13,100,953,465**
売買益	26,493,493,644
売買損	△13,392,540,179
(C)先物取引等取引損益	**242,805,788**
取引益	1,135,442,921
取引損	△892,637,133
(D)その他費用	**△272,108,055**
(E)当期損益金(A+B+C+D)	**17,259,720,486**
(F)前期繰越損益金	**81,529,469,186**
(G)追加信託差損益金	**34,497,961,479**
(H)解約差損益金	**△10,718,294,748**
(I)計 (E+F+G+H)	**122,568,856,403**
次期繰越損益金(I)	**122,568,856,403**

(注1)(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3)(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は32,714,193,593円、期中追加設定元本額は13,135,238,010円、期中一部解約元本額は3,913,828,079円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

お知らせ

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

（変更日：2023年6月28日）

J-REITインデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第16期（決算日　2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【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。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441
第13期(2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598
第14期(2021年11月10日)	21,895	24.8	21,683	24.7	3.8	96.1	111,120
第15期(2022年11月10日)	21,469	△1.9	21,266	△1.9	3.1	96.9	131,445
第16期(2023年11月10日)	20,865	△2.8	20,641	△2.9	2.9	97.1	114,790

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		REIT先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2022年11月10日	21,469	－	21,266	－	3.1	96.9
11月末	21,792	1.5	21,586	1.5	3.1	96.9
12月末	21,020	△2.1	20,822	△2.1	3.0	97.0
2023年 1月末	20,352	△5.2	20,157	△5.2	3.0	97.0
2月末	20,671	△3.7	20,480	△3.7	3.0	97.0
3月末	20,069	△6.5	19,881	△6.5	2.9	97.1
4月末	21,098	△1.7	20,901	△1.7	2.9	97.1
5月末	21,235	△1.1	21,036	△1.1	2.9	97.1
6月末	21,103	△1.7	20,905	△1.7	2.8	97.1
7月末	21,352	△0.5	21,149	△0.5	2.8	97.2
8月末	21,668	0.9	21,463	0.9	3.4	96.6
9月末	21,330	△0.6	21,127	△0.7	3.2	96.8
10月末	20,890	△2.7	20,673	△2.8	3.3	96.6
(当期末)						
2023年11月10日	20,865	△2.8	20,641	△2.9	2.9	97.1

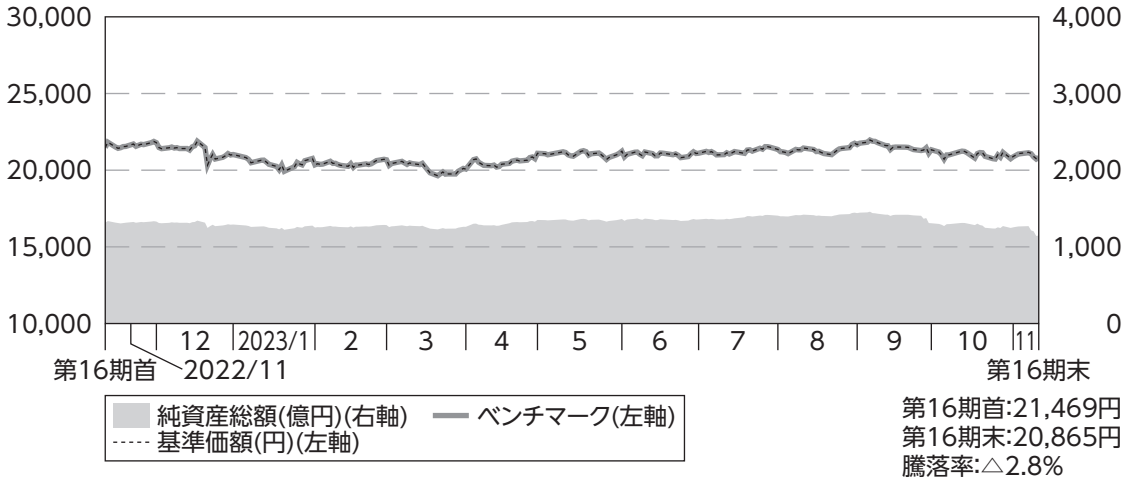
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。
【「東証REIT指数」】とは、株式会社ＪＰＸ総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

【同指数】の指数値及び【同指数】に係る標章又は商標は、株式会社ＪＰＸ総研又は株式会社ＪＰＸ総研の関連会社（以下「ＪＰＸ」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など【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ＪＰＸが有します。ＪＰＸ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、ＪＰＸにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもＪＰＸは責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

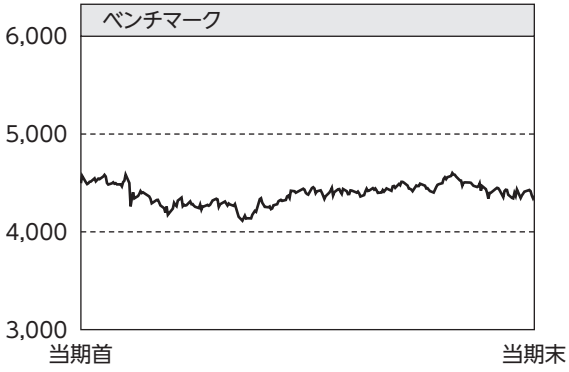


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



当期のJ−REIT市場は下落しました。
日銀により長期金利の変動許容幅が拡大されたことが事実上の利上げと受け止められたことや、公募増資の発表が相次ぎ短期的な需給への影響が意識されたことなどから2023年1月にかけて下落しました。
2023年3月中旬にかけては米銀行の経営破綻や欧州金融機関の信用不安が報じられ、世界的なリスクオフの流れがJ−REIT市場にも波及したことで一時的に下落する局面もありましたが、その後は各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対しての過度な懸念が後退したことなどから上昇しました。
2023年4月以降は米雇用統計の発表などを受け景気の減速懸念が後退したことや、日銀金融政策決定会合での金融政策の現状維持の決定が好感されたことも追い風となり上昇しましたが、高値警戒感が強まる中、米金融引き締め長期化の観測に加えて米暫定予算の成立が危ぶまれたことから米政府機関閉鎖の可能性が懸念され、下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行いました。
主としてわが国の取引所に上場している不動産投資信託証券（J−REIT）に投資し、取引コストに留意しながらベンチマークの構成比率に合わせたポートフォリオを組成し、当期末時点では東証REIT指数を構成する全銘柄と東証REIT指数先物に投資しています。

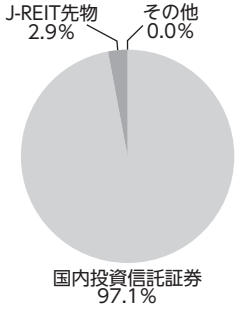
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

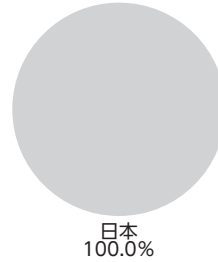
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.7%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.4%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.1%
4	日本プロロジスリート投資法人	日本	4.5%
5	日本都市ファンド投資法人	日本	4.4%
6	KDX不動産投資法人	日本	4.4%
7	GLP投資法人	日本	4.3%
8	大和ハウスリート投資法人	日本	3.9%
9	オリックス不動産投資法人	日本	3.2%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数		59	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

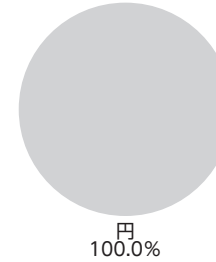
○資産別配分



○国別配分



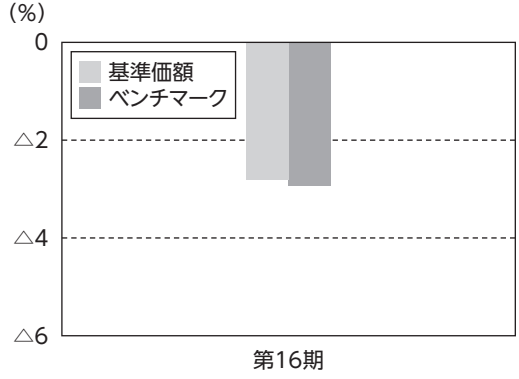
○通貨別配分



（注1）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。
（注2）国別配分においては、上記の他、オフバランスでJ－REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.9%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。
差異の主な要因は2023年10月の指数構成銘柄の吸収合併により生じた価格差によるものです。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2022年11月11日~2023年11月10日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	−	−	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(株式)	(−)	(−)	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
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(−)	(−)	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)	(−)	(−)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.001	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(21,048円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国	エスコンジャパンリート投資法人	476	54,972	666	78,398
国	サンケイリアルエステート投資法人	748	66,316	1,045	95,430
国	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	1,473 (70)	194,566 (9,401)	1,637	205,567
国	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	70 (△70)	9,401 (△9,401)	－	－
国	東海道リート投資法人	606 (286)	73,293 (32,569)	708	87,182
国	東海道リート投資法人	286 (△286)	32,569 (△32,569)	－	－
国	日本アコモデーションファンド投資法人	819	512,713	1,139	713,076
国	森ヒルズリート投資法人	2,807	419,249	3,897	564,315
国	産業ファンド投資法人	3,982	587,960	5,029	712,956
国	アドバンス・レジデンス投資法人	2,647	887,250	3,776	1,276,233
国	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,911 (△8,607)	405,775 (△1,812,442)	1,708	376,581
国	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,236	495,975	1,761	719,406
国	ＧＬＰ投資法人	9,668	1,397,160	11,040	1,535,718
国	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,426 (34)	457,724 (9,504)	1,605	521,233
国	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	34 (△34)	9,504 (△9,504)	－	－
国	日本プロロジスリート投資法人	5,083 (223)	1,522,649 (64,703)	5,710	1,615,229
国	日本プロロジスリート投資法人	223 (△223)	64,703 (△64,703)	－	－
国	星野リゾート・リート投資法人	543	360,943	601	383,036
国	Ｏｎｅリート投資法人	406	99,653	568	145,624
国	イオンリート投資法人	4,115 (124)	616,312 (16,796)	3,974	584,868
国	イオンリート投資法人	124 (△124)	16,796 (△16,796)	－	－
国	ヒューリックリート投資法人	2,227	353,675	3,094	489,845
国	日本リート投資法人	770	259,443	1,071	374,281
国	積水ハウス・リート投資法人	7,147	560,637	10,332	834,983
国	トーセイ・リート投資法人	511	68,134	838	115,129
内	ケネディクス商業リート投資法人	1,024 (△5,097)	267,361 (△1,359,835)	1,021	283,273
内	ヘルスケア＆メディカル投資法人	579	94,200	808	122,300

		当期			
		買付		売付	
		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	775	89,300	881	100,336
	野村不動産マスターファンド投資法人	7,683	1,234,188	10,681	1,779,703
	いちごホテルリート投資法人	391	41,898	544	59,254
	ラサールロジポート投資法人	3,631	560,957	4,183	628,136
	スターアジア不動産投資法人	6,842	375,445	4,842	279,664
	マリモ地方創生リート投資法人	695	90,143	495	62,992
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,213	585,572	1,354	646,823
	大江戸温泉リート投資法人	373	23,830	615	39,865
	投資法人みらい	3,715	170,298	4,152	192,931
	森トラスト・ホテルリート投資法人	138 (△2,807)	18,563 (△394,098)	80	10,763
	三菱地所物流リート投資法人	830	337,189	1,130	439,728
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,504	265,565	1,397	235,855
	ザイマックス・リート投資法人	380	43,427	532	61,717
	タカラレーベン不動産投資法人	1,365 (172)	128,592 (15,208)	1,553	151,814
	タカラレーベン不動産投資法人	172 (△172)	15,208 (△15,208)	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,061	143,207	1,441	186,362
	日本ビルファンド投資法人	2,770	1,618,190	3,852	2,318,356
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,739	1,530,949	3,373	1,944,490
	日本都市ファンド投資法人	11,732	1,157,846	19,133	1,873,428
	オリックス不動産投資法人	4,743	843,456	6,590	1,169,835
	日本プライムリアルティ投資法人	1,590	567,262	2,225	798,859
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,571 (306)	344,037 (37,427)	3,202	432,308
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	306 (△306)	37,427 (△37,427)	—	—
	東急リアル・エステート投資法人	1,600	303,532	2,221	411,334
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,371	259,799	2,431	277,499
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,260	783,705	7,502	1,148,122
	森トラストリート投資法人	4,605 (13,715)	362,016 (394,098)	5,896	450,398
	インヴィンシブル投資法人	16,297	907,604	15,627	903,664
	フロンティア不動産投資法人	879	424,809	1,223	571,797
	平和不動産リート投資法人	2,378 (92)	354,818 (13,637)	2,416	353,635
内	平和不動産リート投資法人	92 (△92)	13,637 (△13,637)	—	—
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,572	479,111	2,561	758,751
	福岡リート投資法人	1,215	199,930	1,694	275,311

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

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

＜先物取引の種類別取引状況＞

種類別		当期			
		買建		売建	
		新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	ＲＥＩＴ先物取引	25,632	26,144	ー	ー

(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	27	27	100.0	27	27	100.0
コール・ローン	748,719	71,510	9.6	744,223	71,859	9.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)	当期末		
	口数(口)	口数(口)	評価額(千円)	比率(%)
エスコンジャパンリート投資法人	2,382	2,192	259,094	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	3,754	3,457	312,512	0.3
ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	5,478	5,384	643,388	0.6
東海道リート投資法人	1,421	1,605	200,625	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	4,046	3,726	2,265,408	2.0
森ヒルズリート投資法人	13,779	12,689	1,763,771	1.5
産業ファンド投資法人	17,511	16,464	2,242,396	2.0
アドバンス・レジデンス投資法人	11,716	10,587	3,440,775	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,404	―	―	―
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,186	5,661	2,264,400	2.0
ＧＬＰ投資法人	37,821	36,449	4,978,933	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5,451	5,306	1,687,308	1.5
日本プロロジスリート投資法人	19,201	18,797	5,174,814	4.5
星野リゾート・リート投資法人	2,049	1,991	1,184,645	1.0
Ｏｎｅリート投資法人	2,044	1,882	484,615	0.4
イオンリート投資法人	12,971	13,236	1,891,424	1.6
ヒューリックリート投資法人	10,963	10,096	1,523,486	1.3
日本リート投資法人	3,806	3,505	1,200,462	1.0
積水ハウス・リート投資法人	35,609	32,424	2,535,556	2.2
トーセイ・リート投資法人	2,599	2,272	308,764	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	5,094	―	―	―
ヘルスケア＆メディカル投資法人	2,889	2,660	383,572	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,046	2,940	318,990	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	37,892	34,894	5,820,319	5.1
いちごホテルリート投資法人	1,941	1,788	183,091	0.2
ラサールロジポート投資法人	14,345	13,793	2,068,950	1.8
スターアジア不動産投資法人	14,630	16,630	949,573	0.8
マリモ地方創生リート投資法人	1,463	1,663	211,034	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,629	4,488	2,098,140	1.8
大江戸温泉リート投資法人	1,891	1,649	108,009	0.1
投資法人みらい	14,236	13,799	623,024	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,749	―	―	―
三菱地所物流リート投資法人	4,026	3,726	1,406,565	1.2
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	4,538	4,645	745,987	0.6
ザイマックス・リート投資法人	1,901	1,749	204,982	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	5,132	5,116	498,810	0.4

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

(注1)比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

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

①資産運用会社

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

②一般事務受託会社

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

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

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額（百万円）	売建額（百万円）
国内	東証ＲＥＩＴ指数	3,355	－

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	111,416,247	92.5
コール・ローン等、その他	9,055,244	7.5
投資信託財産総額	120,471,491	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2023年11月10日現在
(A)資産	120,471,491,820円
コール・ローン等	7,232,349,014
投資証券(評価額)	111,416,247,550
未収入金	122,018,001
未収配当金	1,432,956,164
差入委託証拠金	267,921,091
(B)負債	5,681,027,880
未払金	211,410,108
未払解約金	5,469,613,245
未払利息	4,444
その他未払費用	83
(C)純資産総額(A-B)	114,790,463,940
元本	55,015,213,467
次期繰越損益金	59,775,250,473
(D)受益権総口数	55,015,213,467口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,865円

■損益の状況

項目	当期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配当等収益	5,319,385,391円
受取配当金	5,320,964,111
受取利息	12,383
その他収益金	61,938
支払利息	△1,653,041
(B)有価証券売買損益	△8,360,807,690
売買益	944,750,922
売買損	△9,305,558,612
(C)先物取引等取引損益	△144,825,090
取引益	376,947,140
取引損	△521,772,230
(D)その他費用	△83
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△3,186,247,472
(F)前期繰越損益金	70,219,792,611
(G)追加信託差損益金	12,054,054,754
(H)解約差損益金	△19,312,349,420
(I)計 (E+F+G+H)	59,775,250,473
次期繰越損益金(I)	59,775,250,473

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3) (H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は61,225,723,115円、期中追加設定元本額は11,096,208,886円、期中一部解約元本額は17,306,718,534円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	26,696,166,094円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,705,566,878円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,926,122,015円
分散投資コア戦略ファンドS	1,830,619,539円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,011,513,433円
コア投資戦略ファンド(切替型)	750,196,687円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	526,962,705円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	524,199,116円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	508,830,600円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	420,963,439円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	350,225,825円
J-REIT パッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	280,493,401円
グローバル経済コア	280,077,565円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	256,354,957円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	129,646,228円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	70,179,766円
SMT インデックスバランス・オープン	23,921,569円
10資産分散投資ファンド	23,142,611円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,349,392円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,440,387円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	8,937,152円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,941,545円
グローバル10資産バランスファンド	2,695,542円

お知らせ

該当事項はありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第16期（決算日　2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【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。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第12期(2019年11月11日)	19,790	9.2	21,166	9.9	99.4	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838	△14.9	18,082	△14.6	99.6	80,213
第14期(2021年11月10日)	24,699	46.7	26,632	47.3	99.5	102,118
第15期(2022年11月10日)	24,409	△1.2	26,413	△0.8	99.5	84,560
第16期(2023年11月10日)	24,877	1.9	27,027	2.3	99.7	105,580

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注)騰落率は期首比です。

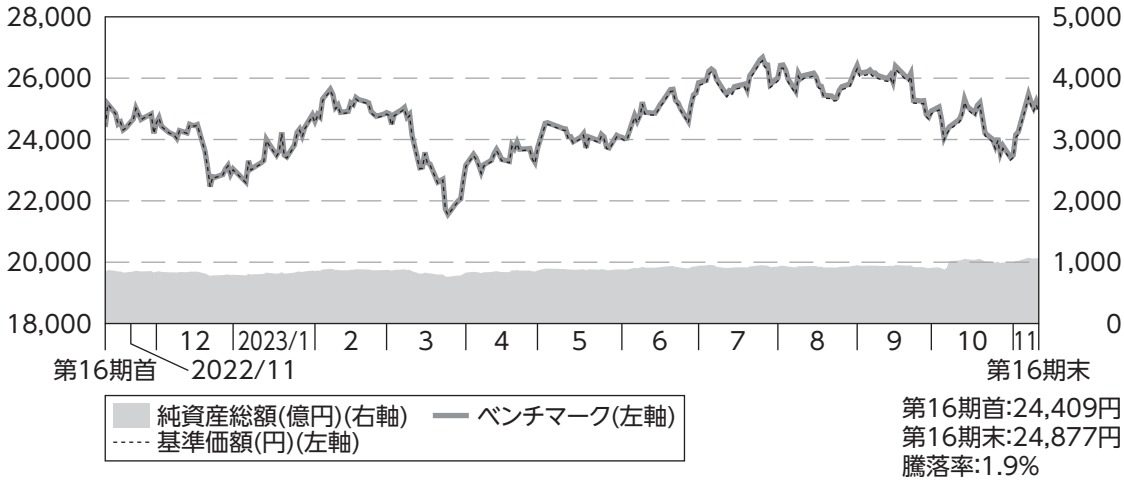
ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）です。

S&P先進国REIT指数とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJI」）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SPDJI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、SPDJI、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

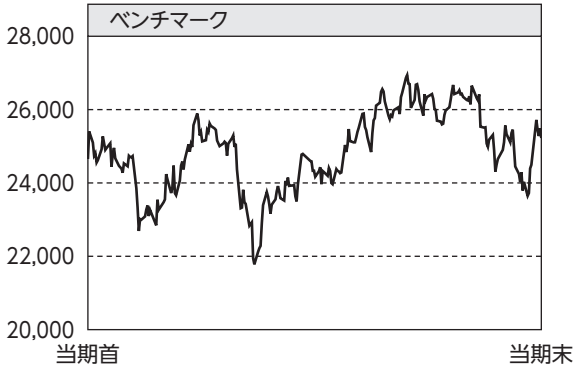


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

当ファンドのポートフォリオ

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

（1）組入比率

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

（2）ポートフォリオ構成

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

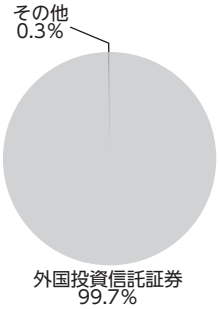
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

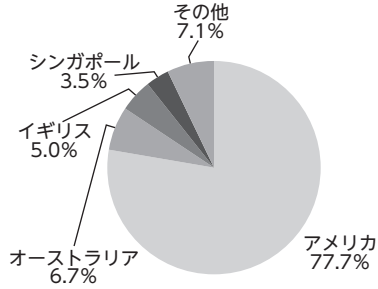
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.2%
2	EQUINIX INC	アメリカ	6.1%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	4.0%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.3%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.3%
6	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	3.2%
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.0%
8	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.4%
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	2.1%
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.1%
組入銘柄数		308	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

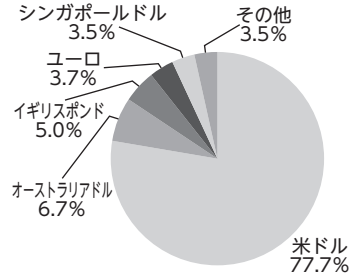
○資産別配分



○国別配分



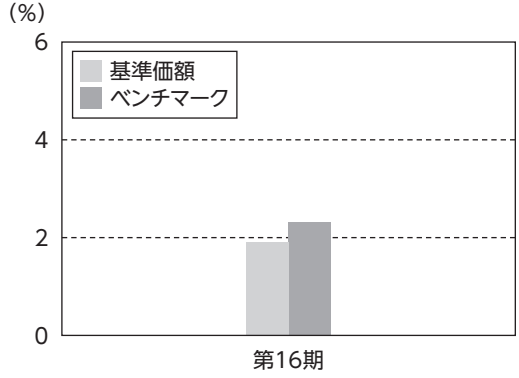
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2022年11月11日~2023年11月10日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.006%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(−)	(−)	
（新株予約権証券）	(−)	(−)	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
（オプション証券等）	(−)	(−)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(−)	(−)	
（投資信託証券）	(1)	(0.006)	
（商品）	(−)	(−)	
（先物・オプション）	(−)	(−)	
(b) 有価証券取引税	3	0.011	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(−)	(−)	
（新株予約権証券）	(−)	(−)	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
（オプション証券等）	(−)	(−)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(−)	(−)	
（公社債）	(−)	(−)	
（投資信託証券）	(3)	(0.011)	
(c) その他費用	9	0.037	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(9)	(0.037)	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）	(−)	(−)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	13	0.054	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（24,496円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

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

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

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

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

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

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

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
RETAIL ESTATES	2,210	120	－	－
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	5,697	78	－	－
WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,705	798	3,000	79
MONTEA NV	4,230	288	－	－
AEDIFICA	9,180	532	－ (－)	－ (28)
CARE PROPERTY INVEST	12,000	156	4,113	67
CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	－ (10,887)	－ (－)	10,887	6
AEDIFICA SA-RIGHTS	－ (20,737)	－ (28)	20,737	8
XIOR STUDENT HOUSING NV	7,670	221	－	－
小計	80,900 (31,624)	2,781 (28)	41,056 (－)	338 (28)
その他				
CROMWELL REIT EUR	－ (－)	－ (△13)	－	－
小計	－ (－)	－ (△13)	－	－
ユーロ計	258,226 (31,624)	6,573 (△148)	70,212 (－)	1,316 (29)
イギリス	口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	129,650	451	20,138	63
DERWENT LONDON PLC	16,649	347	3,000	64
BIG YELLOW GROUP PLC	21,900	223	－	－
HAMMERSON PLC	909,460	226	241,321	60
WORKSPACE GROUP PLC	19,080	88	－	－
UNITE GROUP PLC	74,278	695	30,484	273
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	174,230	164	－	－
SHAFTESBURY PLC	－ (△139,823)	－ (△525)	－	－
SEGRO PLC	183,936	1,355	23,590	182
LAND SECURITIES GROUP PLC	108,460	667	21,309	126
ASSURA PLC	505,423	239	120,000	59
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	110,000	51	136,908	71
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,583	228	14,378	62
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	－	－	135,000	61

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
HELICAL PLC	65,400	163	－	－
PICTON PROPERTY INCOME LTD	80,000	50	－	－
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	128,750	68	－	－
SAFESTORE HOLDINGS PLC	38,640	332	7,090	62
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	123,420	213	－	－
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	337,675 (469,245)	381 (525)	－	－
WAREHOUSE REIT PLC	60,185	64	52,309	60
NEWRIVER REIT PL	70,000	54	－	－
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	－	－	330,067	262
CLS HOLDINGS PLC	75,636	111	－	－
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	168,840	135	－	－
TRITAX BIG BOX REIT PLC	288,560	405	48,784	62
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	391,491	304	－	－
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	72,010	61	－	－
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	－	－	110,000	75
LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	130	－	－
LXI REIT PLC	335,710	320	119,999	110
URBAN LOGISTICS REIT PLC	73,230	78	－	－
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	80,000	73	67,062	69
小計	4,868,134 (329,422)	7,688 (－)	1,481,439	1,728
オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
BWP TRUST	94,560	336	31,619	115
MIRVAC GROUP	580,488	1,227	70,000	157
CHARTER HALL RETAIL REIT	67,470	228	－	－
GPT GROUP	256,974	1,039	41,111	170
CENTURIA CAPITAL GROUP	217,027	325	－	－
ABACUS GROUP	120,145	127	－	－
STOCKLAND	347,474	1,334	40,803	169
DEXUS	156,893	1,155	14,931	118
GOODMAN GROUP	257,879	5,286	41,786	824
VICINITY CENTERS	517,712	946	79,179	146
CHARTER HALL GROUP	65,454	685	10,617	119

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
INGENIA COMMUNITIES GROUP	53,150	215	－	－
REGION RE GROUP	157,570	348	－	－
ARENA REIT	31,370	118	－	－
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	101,860	298	35,000	108
CHARTER HALL LONG WALE REIT	89,730	337	－	－
NATIONAL STORAGE REIT	302,130	703	30,000	74
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	25,000	88	40,179	125
GDI PROPERTY GROUP	130,000	70	138,903	105
RURAL FUNDS GROUP	90,748	165	－	－
SCENTRE GROUP	716,370	1,849	87,218	232
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	－	－	190,640	135
HMC CAPITAL LTD	57,170	263	－	－
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	52,350	131	－	－
HOMECO DAILY NEEDS REIT	431,268	511	96,718	114
HEALTHCO REIT	243,191	346	80,000	114
ABACUS STORAGE KING	153,450 (194,329)	162 (－)	－	－
CENTURIA OFFICE REIT	99,190	153	136,206	207
WAYPOINT REIT LTD	69,640	156	－	－
小計	5,486,263 (194,329)	18,613 (－)	1,164,910	3,039
ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
AMP NZ OFFICE LTD	240,000	286	－	－
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,000	138	241,387	490
GOODMAN PROPERTY TRUST	157,325	327	－	－
KIWI PROPERTY GROUP LTD	180,000	153	－	－
ARGOSY PROPERTY LTD	90,000	103	－	－
STRIDE PROPERTY GROUP	－	－	300,000	380
小計	727,325	1,008	541,387	871
香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
LINK REIT	586,500	26,105	54,100	2,544
PROSPERITY REIT	260,000	368	260,000	578
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	566,000	1,253	575,000	1,078
CHAMPION REIT	422,000	1,273	－	－

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
FORTUNE REIT	270,000	1,472	―	―
LINK REIT -RIGHTS	― (206,000)	― (―)	206,000	886
小計	2,104,500 (206,000)	30,472 (―)	1,095,100	5,089
シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	717,100 (―)	1,346 (△8)	60,000	120
CAPITALAND ASCENDAS REIT	677,100 (―)	1,841 (△36)	122,500	329
SUNTEC REIT	265,600 (―)	320 (△9)	―	―
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	435,200 (―)	723 (△64)	―	―
STARHILL GLOBAL REIT	200,000	95	186,400	97
CAPITALAND ASCOTT TRUST	606,100 (―)	607 (△20)	95,200	101
KEPPEL REIT	242,000	211	―	―
FRASERS CENTREPOINT TRUST	172,200	364	―	―
ESR-LOGOS REIT	1,188,200 (―)	361 (△11)	―	―
CDL HOSPITALITY TRUSTS	― (―)	― (△2)	―	―
CAPITALAND CHINA TRUST	89,300 (―)	101 (△30)	―	―
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	― (―)	― (△6)	538,100	122
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	184,900 (―)	232 (△6)	―	―
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	70,700 (―)	263 (△7)	―	―
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	279,800 (―)	636 (△1)	―	―
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	343,900 (―)	516 (△10)	64,700	106
PARAGON REIT	351,900	300	―	―
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	― (―)	― (△0.38454)	―	―
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	― (―)	― (△3)	1,273,644	270

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

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)内は合併・分割・減資・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	25,797	－	－	7,163	5	0.1
金銭信託	0.525324	0.525324	100.0	0.525324	0.525324	100.0
コール・ローン	21,604	2,183	10.1	21,587	2,198	10.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)	当期末			
	口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	70,288	93,284	8,822	1,336,036	1.3
ALEXANDER'S INC	1,190	1,336	252	38,271	0.0
BOSTON PROPERTIES	67,517	86,210	4,499	681,328	0.6
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	110,823	146,224	4,518	684,209	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	72,024	83,954	524	79,457	0.1
AGREE REALTY CORP	37,791	58,082	3,303	500,279	0.5
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	81	12,356	0.0
SL GREEN REALTY CORP	30,439	38,074	1,165	176,425	0.2
EPR PROPERTIES	35,511	44,397	1,982	300,183	0.3
PROLOGIS INC	439,354	550,595	56,865	8,611,135	8.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,793	84,474	14,053	2,128,188	2.0
LXP INDUSTRIAL TRUST	132,496	172,796	1,425	215,873	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	50,428	63,691	5,548	840,152	0.8
VERIS RESIDENTIAL INC	37,510	48,670	676	102,444	0.1
NNN REIT INC	83,841	109,365	4,179	632,966	0.6
COUSINS PROPERTIES INC	71,685	89,515	1,652	250,230	0.2
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	－	－	－	－
SITE CENTERS CORP	88,151	106,484	1,357	205,592	0.2
SAFEHOLD INC	40,416	27,084	449	68,123	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST	30,829	38,070	7,902	1,196,628	1.1
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	160,241	205,257	11,024	1,669,417	1.6
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,470	43,887	4,016	608,290	0.6
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	62,519	79,678	3,420	517,977	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	255,424	326,458	5,135	777,620	0.7
EQUITY COMMONWEALTH	52,660	64,970	1,222	185,158	0.2

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

銘柄	当期首(前期末)	当期末			
	口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49,792	62,559	1,124	170,235	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	78,173	100,683	695	105,352	0.1
WELLTOWER INC	221,128	329,696	27,905	4,225,725	4.0
EASTGROUP PROPERTIES,INC	20,624	27,135	4,523	684,979	0.6
KIMCO REALTY CORP	292,774	368,258	6,518	987,045	0.9
KILROY REALTY CORPORATION	49,792	62,832	1,783	270,025	0.3
LTC PROPERTIES INC	19,175	25,125	792	119,961	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	116,800	235	35,727	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	104,507	397	60,136	0.1
IRON MOUNTAIN INC	137,603	173,734	10,227	1,548,783	1.5
MACERICH CO/THE	101,670	127,260	1,266	191,746	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	82,800	110,558	7,185	1,088,049	1.0
ACADIA REALTY TRUST	47,870	56,767	804	121,808	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	338,412	422,565	6,866	1,039,821	1.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	54,646	69,921	8,375	1,268,247	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,550	19,211	190	28,858	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	21,139	25,669	1,290	195,480	0.2
CENTERSPACE	7,349	8,999	459	69,634	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	8,599	158	24,024	0.0
GETTY REALTY CORP	20,690	27,420	752	113,936	0.1
RPT REALTY	43,950	48,173	513	77,690	0.1
REALTY INCOME CORP	294,425	423,162	21,230	3,214,864	3.0
REGENCY CENTERS CORP	72,902	98,033	5,824	881,949	0.8
UDR INC	144,582	180,055	5,759	872,230	0.8
COPT DEFENSE PROPERTIES	53,219	66,436	1,563	236,821	0.2
SAUL CENTERS INC	6,800	6,846	238	36,087	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	156,090	195,279	22,220	3,364,895	3.2
LIFE STORAGE INC	39,946	－	－	－	－
PUBLIC STORAGE	75,268	94,419	23,284	3,525,997	3.3
SUN COMMUNITIES INC	58,379	73,816	8,443	1,278,646	1.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,407	62,168	1,493	226,220	0.2
UMH PROPERTIES INC	25,129	33,009	478	72,429	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	26,942	318	48,182	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,793	7,811	305	46,307	0.0
VENTAS INC	189,214	239,543	10,079	1,526,409	1.4
VORNADO REALTY TRUST	76,257	94,277	1,927	291,808	0.3
ELME COMMUNITIES	41,374	55,407	725	109,912	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	103,723	133,039	2,748	416,218	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,891	125,689	14,843	2,247,807	2.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	45,973	98	14,967	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,505	124,355	1,177	178,330	0.2
CUBESMART	106,251	134,302	4,915	744,347	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	137,142	180,630	23,050	3,490,490	3.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	99,846	124,486	1,004	152,126	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	283,552	352,832	1,637	247,912	0.2
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	83,212	98,752	1,110	168,232	0.2

銘柄	当期首(前期末)	当期末			
	口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	58,955	74,955	891	135,070	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	75,292	420	63,620	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	67,550	399	60,453	0.1
TERRENO REALTY CORP	31,471	49,321	2,664	403,532	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,331	29,232	538	81,538	0.1
RLJ LODGING TRUST	77,042	93,642	919	139,249	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	127,511	152,283	3,823	579,041	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,226	71,638	833	126,163	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	22,938	108	16,499	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,562	241	36,502	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	109,335	136,268	1,858	281,462	0.3
WHITESTONE REIT	23,074	31,954	328	49,791	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	76,753	412	62,530	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	84,837	108,041	3,709	561,661	0.5
WP CAREY INC	98,249	127,017	6,894	1,044,031	1.0
ALEXANDER & BALDWIN INC	36,712	43,393	686	103,953	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15,061	21,491	292	44,324	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	180,143	229,675	3,275	495,958	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,109	36,095	3,326	503,679	0.5
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	41,231	416	63,122	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,541	85,476	3,266	494,705	0.5
PHYSICIANS REALTY TRUST	107,135	140,705	1,549	234,589	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	80,979	123,217	5,488	831,060	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	143,210	188,879	6,512	986,195	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	105,006	132,286	1,703	258,013	0.2
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,242	16,592	1,246	188,766	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	47,111	56,141	744	112,813	0.1
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	－	－	－	－
UNITI GROUP INC	－	142,940	683	103,465	0.1
INVITATION HOMES INC	274,483	342,404	10,686	1,618,245	1.5
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	342,700	83	12,714	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	68,118	77,843	652	98,781	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,286	21,712	451	68,321	0.1
SAFEHOLD INC	8,335	－	－	－	－
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	66,851	91,911	2,073	313,991	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	33,166	90	13,710	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	120,938	155,899	7,013	1,062,114	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	141,856	180,627	3,766	570,296	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	28,700	59	8,996	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	0.00002	0.003	0.0
PRIME US REIT	295,000	295,000	39	5,986	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	13,280	180	27,349	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	5,700	85	12,955	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	31,919	40,139	972	147,215	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	28,000	305	46,216	0.0
CITY OFFICE REIT INC	25,050	15,298	64	9,799	0.0

銘柄	当期首(前期末)	当期末			
	口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
ORION OFFICE REIT INC	30,374	34,844	174	26,487	0.0
NETSTREIT CORP	23,831	41,060	621	94,136	0.1
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	17,000	33	5,122	0.0
CARETRUST REIT INC	45,932	58,902	1,265	191,680	0.2
PEAKSTONE REALTY TRUST	－	19,000	262	39,733	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	－	－	－	－
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	55,243	69,083	2,276	344,802	0.3
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	－	－	－	－
APARTMENT INCOME REIT CO	72,989	87,719	2,559	387,606	0.4
BROADSTONE NET LEASE INC-A	81,949	110,537	1,585	240,031	0.2
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	12,400	201	30,531	0.0
STAR HOLDINGS	－	6,183	69	10,449	0.0
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	15,737	336	50,973	0.0
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	368,800	193	29,319	0.0
NET LEASE OFFICE PROPERTY	－	8,467	107	16,270	0.0
STORE CAPITAL CORP	125,789	－	－	－	－
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	100,128	426	64,591	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	37,791	343	51,962	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	55,595	69,794	1,118	169,419	0.2
EQUINIX INC	43,383	55,772	42,219	6,393,368	6.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	42,991	57,181	614	93,083	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,132	64,012	752	113,993	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	13,856	406	61,624	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,398	48,998	1,492	226,080	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	14,980	385	58,343	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	100,761	125,391	1,956	296,212	0.3
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	115,311	921	139,517	0.1
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	－	15,669	124	18,815	0.0
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	35	5,361	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	835,164	65	9,864	0.0
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	106,435	127,396	1,658	251,176	0.2
VICI PROPERTIES INC	459,464	602,621	16,939	2,565,175	2.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	38,562	53,622	1,170	177,259	0.2
小計 口数・金額	12,568,769	15,403,951	540,713	81,880,308	
小計 銘柄数<比率>	145	143	－	<77.6%>	
(カナダ)			千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	30,663	43,154	991	108,737	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	39,175	49,930	2,216	243,082	0.2
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	76,841	680	74,650	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,377	90,439	1,564	171,557	0.2
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	37,679	617	67,674	0.1
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	5,339	43	4,818	0.0
PRIMARIS REIT	28,309	30,375	407	44,663	0.0
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,047	13,593	902	98,937	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	30,330	187	20,552	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	26,577	354	38,875	0.0

銘柄		当期首(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)	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		33,790	42,842	507	55,619	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES		48,099	58,872	267	29,307	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL		12,890	6,956	93	10,197	0.0
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM		8,700	－	－	－	－
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR		59,149	73,332	886	97,213	0.1
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T		20,000	20,000	58	6,425	0.0
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT		39,728	－	－	－	－
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		15,334	19,135	1,238	135,855	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		25,800	25,800	37	4,102	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT		76,025	100,975	1,290	141,498	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		11,100	11,100	156	17,124	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		27,730	27,730	376	41,230	0.0
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES		23,900	－	－	－	－
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T		16,000	16,000	71	7,807	0.0
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T		9,500	9,500	139	15,333	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		49,695	66,348	906	99,377	0.1
SLATE GROCERY REIT		17,300	16,578	174	19,104	0.0
NEXUS INDUSTRIAL REIT		16,015	16,015	109	11,993	0.0
SLATE OFFICE REI		17,000	－	－	－	－
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		12,000	－	－	－	－
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		21,900	35,647	598	65,666	0.1
小計	口数・金額	901,473	951,087	14,878	1,631,407	
	銘柄数<比率>	31	26	－	<1.5%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		37,000	37,000	249	40,230	0.0
ALSTRIA OFFICE REIT -AG		7,200	－	－	－	－
小計	口数・金額	44,200	37,000	249	40,230	
	銘柄数<比率>	2	1	－	<0.0%>	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		33,790	33,790	72	11,791	0.0
小計	口数・金額	33,790	33,790	72	11,791	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE		15,570	19,987	639	103,331	0.1
ALTAREA		2,480	1,959	138	22,407	0.0
KLEPIERRE		92,974	114,775	2,598	419,814	0.4
GECINA SA		25,736	30,327	2,962	478,693	0.5
COVIVIO(FP)		21,972	29,683	1,281	206,977	0.2
MERCIALYS		36,384	57,605	474	76,733	0.1
CARMILA		26,392	32,392	461	74,521	0.1
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		49,378	61,522	3,131	505,920	0.5
小計	口数・金額	270,886	348,250	11,688	1,888,400	
	銘柄数<比率>	8	8	－	<1.8%>	
(オランダ)				千ユーロ		
VASTNED RETAIL		10,650	10,650	207	33,448	0.0
WERELDHAVE NV		22,670	26,376	393	63,578	0.1

銘柄		当期首(前期末)	当期末			
		口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
NSI NV		10,050	7,359	129	20,972	0.0
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV		17,493	25,490	557	90,023	0.1
小計	口数・金額	60,863	69,875	1,287	208,023	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.2%>	
(スペイン)				千ユーロ		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		141,272	167,444	944	152,574	0.1
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		34,000	34,000	194	31,420	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		157,888	200,710	1,707	275,789	0.3
小計	口数・金額	333,160	402,154	2,845	459,784	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.4%>	
(ベルギー)				千ユーロ		
COFINIMMO		14,199	20,088	1,266	204,623	0.2
RETAIL ESTATES		5,335	7,545	475	76,795	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		12,100	17,797	359	58,080	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		66,064	94,769	2,348	379,403	0.4
MONTEA NV		4,970	9,200	639	103,301	0.1
AEDIFICA		18,867	28,047	1,618	261,454	0.2
CARE PROPERTY INVEST		15,000	22,887	290	46,959	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV		9,813	17,483	541	87,561	0.1
小計	口数・金額	146,348	217,816	7,540	1,218,179	
	銘柄数<比率>	8	8	－	<1.2%>	
(アイルランド)				千ユーロ		
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		210,000	210,000	207	33,588	0.0
小計	口数・金額	210,000	210,000	207	33,588	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
(その他)				千ユーロ		
CROMWELL REIT EUR		170,400	170,400	207	33,586	0.0
小計	口数・金額	170,400	170,400	207	33,586	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.0%>	
ユーロ計	口数・金額	1,269,647	1,489,285	24,099	3,893,583	
	銘柄数<比率>	28	27	－	<3.7%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		446,042	555,554	1,742	322,449	0.3
DERWENT LONDON PLC		53,156	66,805	1,368	253,220	0.2
BIG YELLOW GROUP PLC		82,773	104,673	1,099	203,415	0.2
HAMMERSON PLC		1,673,646	2,341,785	571	105,840	0.1
WORKSPACE GROUP PLC		65,316	84,396	474	87,862	0.1
INTU PROPERTIES PLC		521,960	521,960	9	1,715	0.0
UNITE GROUP PLC		190,394	234,188	2,248	416,097	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		630,955	805,185	772	142,913	0.1
SHAFTESBURY PLC		139,823	－	－	－	－
SEGRO PLC		572,354	732,700	5,697	1,054,488	1.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		355,654	442,805	2,665	493,365	0.5
ASSURA PLC		1,400,809	1,786,232	801	148,371	0.1
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST		260,756	233,848	110	20,385	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		109,600	143,805	589	109,016	0.1

銘柄		当期首(前期末)	当期末			
		口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		350,000	215,000	90	16,752	0.0
HELICAL PLC		－	65,400	136	25,237	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		268,000	348,000	226	41,865	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		405,972	534,722	307	57,004	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		98,896	130,446	986	182,520	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		464,236	587,656	1,037	191,967	0.2
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD		378,400	378,400	244	45,172	0.0
SHAFTESBURY CAPITAL PLC		354,157	1,161,077	1,354	250,779	0.2
WAREHOUSE REIT PLC		230,000	237,876	192	35,573	0.0
NEWRIVER REIT PL		126,000	196,000	156	29,020	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		330,067	－	－	－	－
PRS REIT PLC/THE		260,002	260,002	210	38,978	0.0
CLS HOLDINGS PLC		－	75,636	69	12,836	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		203,286	203,286	118	21,897	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		589,189	758,029	601	111,395	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC		888,708	1,128,484	1,659	307,232	0.3
CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT		234,276	234,276	203	37,723	0.0
TARGET HEALTHCARE REIT PLC		－	391,491	312	57,748	0.1
HOME REIT PLC		374,236	374,236	142	26,354	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		306,000	378,010	347	64,365	0.1
EDISTON PROPERTY INVESTMENT		110,000	－	－	－	－
LIFE SCIENCE REIT PLC		－	176,938	119	22,202	0.0
AEW UK REIT PLC		68,000	68,000	65	12,031	0.0
LXI REIT PLC		811,588	1,027,299	968	179,294	0.2
REGIONAL REIT LTD		222,000	222,000	63	11,730	0.0
URBAN LOGISTICS REIT PLC		223,421	296,651	350	64,786	0.1
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		229,355	242,293	202	37,444	0.0
小計	口数・金額	14,029,027	17,745,144	28,317	5,241,057	
	銘柄数<比率>	37	38	－	<5.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST		228,066	291,007	992	95,492	0.1
MIRVAC GROUP		1,867,868	2,378,356	4,697	452,016	0.4
CROMWELL PROPERTY GROUP		669,440	669,440	251	24,157	0.0
CHARTER HALL RETAIL REIT		244,874	312,344	1,011	97,384	0.1
GPT GROUP		906,785	1,122,648	4,389	422,406	0.4
CENTURIA CAPITAL GROUP		274,928	491,955	617	59,412	0.1
ABACUS GROUP		194,329	314,474	319	30,715	0.0
STOCKLAND		1,130,026	1,436,697	5,516	530,892	0.5
DEXUS		509,145	651,107	4,557	438,592	0.4
GOODMAN GROUP		804,776	1,020,869	22,938	2,207,412	2.1
VICINITY CENTERS		1,831,690	2,270,223	4,075	392,142	0.4
CHARTER HALL GROUP		223,905	278,742	2,781	267,696	0.3
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS		138,810	138,810	309	29,787	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP		173,646	226,796	927	89,262	0.1
REGION RE GROUP		528,421	685,991	1,447	139,287	0.1
ARENA REIT		161,278	192,648	645	62,104	0.1

銘柄		当期首(前期末)	当期末			
		口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT		255,476	322,336	957	92,124	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT		286,964	376,694	1,243	119,622	0.1
DEXUS INDUSTRIA REIT		113,000	113,000	291	28,054	0.0
NATIONAL STORAGE REIT		473,590	745,720	1,573	151,414	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L		117,885	102,706	283	27,278	0.0
GDI PROPERTY GROUP		324,500	315,597	173	16,703	0.0
RURAL FUNDS GROUP		181,331	272,079	510	49,091	0.0
SCENTRE GROUP		2,456,991	3,086,143	7,931	763,237	0.7
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE		190,640	－	－	－	－
HMC CAPITAL LTD		92,191	149,361	699	67,265	0.1
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR		157,784	210,134	540	51,968	0.0
HOMECO DAILY NEEDS REIT		734,103	1,068,653	1,202	115,691	0.1
HEALTHCO REIT		137,130	300,321	411	39,592	0.0
ABACUS STORAGE KING		－	347,779	363	34,972	0.0
CENTURIA OFFICE REIT		240,945	203,929	250	24,137	0.0
WAYPOINT REIT LTD		336,956	406,596	943	90,774	0.1
小計	口数・金額	15,987,473	20,503,155	72,853	7,010,694	
	銘柄数<比率>	31	31	－	<6.6%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AMP NZ OFFICE LTD		556,295	796,295	911	81,337	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR		181,387	－	－	－	－
GOODMAN PROPERTY TRUST		498,199	655,524	1,337	119,297	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD		743,753	923,753	762	67,986	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		417,278	507,278	558	49,779	0.0
STRIDE PROPERTY GROUP		300,000	－	－	－	－
小計	口数・金額	2,696,912	2,882,850	3,569	318,401	
	銘柄数<比率>	6	4	－	<0.3%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		997,800	1,530,200	60,442	1,171,987	1.1
PROSPERITY REIT		752,000	752,000	1,007	19,538	0.0
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT		1,315,660	1,306,660	1,476	28,629	0.0
CHAMPION REIT		745,000	1,167,000	2,894	56,117	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		561,000	561,000	1,155	22,408	0.0
FORTUNE REIT		605,000	875,000	3,998	77,535	0.1
小計	口数・金額	4,976,460	6,191,860	70,975	1,376,218	
	銘柄数<比率>	6	6	－	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		2,383,544	3,040,644	5,533	616,152	0.6
CAPITALAND ASCENDAS REIT		1,581,818	2,136,418	5,832	649,381	0.6
SUNTEC REIT		1,060,900	1,326,500	1,472	163,938	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		1,523,285	1,958,485	3,055	340,170	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		849,400	863,000	409	45,641	0.0
CAPITALAND ASCOTT TRUST		847,977	1,358,877	1,216	135,411	0.1
KEPPEL REIT		936,300	1,178,300	948	105,609	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		469,862	642,062	1,341	149,408	0.1
ESR-LOGOS REIT		2,418,564	3,606,764	973	108,425	0.1

銘柄		当期首(前期末)	当期末			
		口数(口)	口数(口)	評価額		比率(%)
				外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
CDL HOSPITALITY TRUSTS		397,900	397,900	387	43,194	0.0
CAPITALAND CHINA TRUST		553,921	643,221	498	55,502	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		538,100	—	—	—	—
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		275,000	459,900	574	64,006	0.1
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		163,200	233,900	806	89,846	0.1
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		941,863	1,221,663	2,675	297,883	0.3
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA		1,090,073	1,369,273	1,848	205,814	0.2
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		540,000	540,000	329	36,675	0.0
PARAGON REIT		409,600	761,500	609	67,828	0.1
EC WORLD REIT		180,000	180,000	46	5,200	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		295,800	295,800	199	22,230	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		1,273,644	—	—	—	—
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		883,950	1,058,150	581	64,797	0.1
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST		328,400	—	—	—	—
KEPPEL DC REIT		626,303	798,203	1,436	159,969	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		1,364,796	1,726,296	1,812	201,816	0.2
小計	口数・金額	21,934,200	25,796,856	32,592	3,628,904	
	銘柄数<比率>	25	22	—	<3.4%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		42,950	—	—	—	—
E KOCREF CR-REIT CO LTD		13,200	—	—	—	—
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD		36,380	46,380	289,411	33,311	0.0
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD		11,253	—	—	—	—
LOTTE REIT CO LTD		72,480	72,480	221,064	25,444	0.0
KORAMCO LIFE INFRA REIT		25,433	25,433	138,101	15,895	0.0
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT		14,201	—	—	—	—
JR REIT XXVII		76,683	95,683	387,516	44,603	0.0
SK REITS CO LTD		39,229	75,914	299,860	34,513	0.0
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L		81,340	102,340	341,815	39,342	0.0
D&D PLATFORM REIT CO LTD		28,240	28,240	84,720	9,751	0.0
NH ALL-ONE REIT CO LTD		14,949	14,949	50,452	5,807	0.0
小計	口数・金額	456,338	461,419	1,812,941	208,669	
	銘柄数<比率>	12	8	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD		103,500	103,500	1,592	62,676	0.1
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT		115,000	115,000	885	34,842	0.0
MENIVIM- THE NEW REIT LTD		360,000	360,000	529	20,823	0.0
小計	口数・金額	578,500	578,500	3,007	118,341	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
合計	口数・金額	75,398,799	92,004,107	—	105,307,588	
	銘柄数<比率>	324	308	—	<99.7%>	

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資証券	105,307,588	99.4
コール・ローン等、その他	672,617	0.6
投資信託財産総額	105,980,205	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(105,580,274千円)の投資信託財産総額(105,980,205千円)に対する比率は99.6%です。
(注2)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル＝151.43円　1カナダドル＝109.65円　1ユーロ＝161.56円
1イギリスポンド＝185.08円　1オーストラリアドル＝96.23円　1ニュージーランドドル＝89.21円
1香港ドル＝19.39円　1シンガポールドル＝111.34円　1韓国ウォン＝0.1151円
1イスラエルシェケル＝39.3481円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2023年11月10日現在
(A)資産	105,980,205,739円
コール・ローン等	537,071,979
投資証券(評価額)	105,307,588,300
未収入金	3,605,255
未収配当金	131,940,205
(B)負債	400,172,240
未払金	269,166,320
未払解約金	131,005,839
未払利息	80
その他未払費用	1
(C)純資産総額(A-B)	105,580,033,499
元本	42,440,513,111
次期繰越損益金	63,139,520,388
(D)受益権総口数	42,440,513,111口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,877円

■損益の状況

項目	当期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配当等収益	3,780,759,271円
受取配当金	3,767,102,940
受取利息	13,702,551
その他収益金	3,802
支払利息	△50,022
(B)有価証券売買損益	△1,333,019,067
売買益	9,018,650,058
売買損	△10,351,669,125
(C)その他費用	△35,275,760
(D)当期損益金(A+B+C)	2,412,464,444
(E)前期繰越損益金	49,916,887,937
(F)追加信託差損益金	16,210,411,963
(G)解約差損益金	△5,400,243,956
(H)計 (D+E+F+G)	63,139,520,388
次期繰越損益金(H)	63,139,520,388

(注1)(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3)(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は34,643,734,497円、期中追加設定元本額は11,402,252,400円、期中一部解約元本額は3,605,473,786円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

お知らせ

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

(変更日:2023年6月28日)

グローバル・コモディティ（米ドル建て）マザーファンド

運 用 報 告 書

第16期（決算日　2024年5月27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7月1日から無期限です。
運　用　方　針	主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に償還価格が概ね連動する米ドル建て債券（以下「米ドル建て債券」といいます。）に投資を行い、世界の様々な商品（コモディティ）市況を捉えることを目的に、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	米ドル建て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

【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。
・－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。

<409990>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第12期(2020年5月26日)	2,494	△15.7	2,711	△21.5	97.8	－	19,644
第13期(2021年5月26日)	3,665	47.0	3,985	47.0	98.3	－	19,227
第14期(2022年5月26日)	6,239	70.2	6,755	69.5	98.5	－	35,578
第15期(2023年5月26日)	5,544	△11.1	5,570	△17.5	98.1	－	22,896
第16期(2024年5月27日)	6,856	23.7	6,607	18.6	98.6	－	30,671

(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		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（当期首）	円	%		%	%	%
2023年 5月26日	5,544	－	5,570	－	98.1	－
5月末	5,502	△0.8	5,511	△1.1	98.1	－
6月末	5,771	4.1	5,829	4.6	99.1	－
7月末	5,988	8.0	6,062	8.8	98.2	－
8月末	6,170	11.3	6,222	11.7	98.3	－
9月末	6,283	13.3	6,352	14.0	98.2	－
10月末	6,257	12.9	6,264	12.5	98.5	－
11月末	6,114	10.3	6,035	8.4	98.3	－
12月末	5,785	4.3	5,663	1.7	97.9	－
2024年 1月末	5,988	8.0	5,849	5.0	98.0	－
2月末	6,010	8.4	5,840	4.8	98.3	－
3月末	6,267	13.0	6,041	8.4	98.8	－
4月末	6,765	22.0	6,504	16.8	98.5	－
（当期末）						
2024年 5月27日	6,856	23.7	6,607	18.6	98.6	－

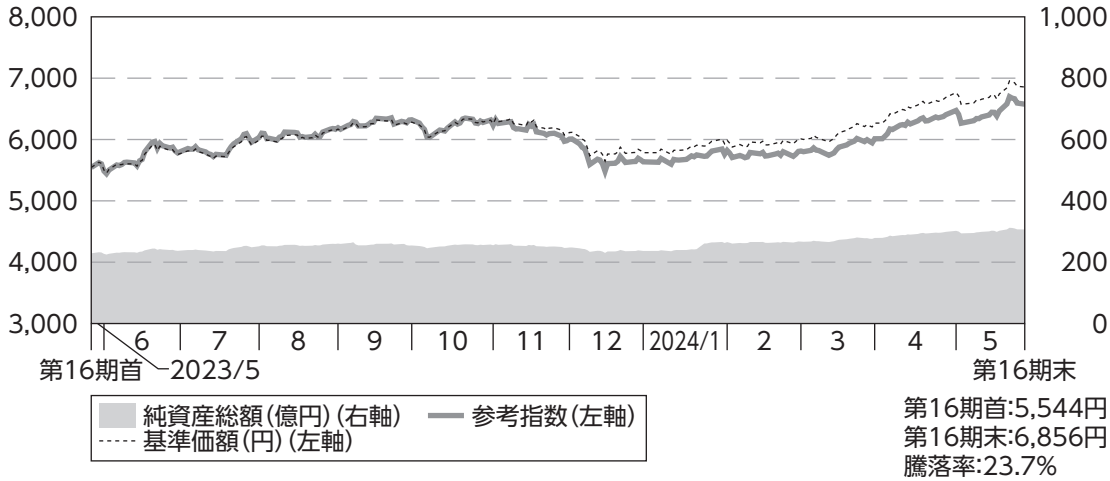
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

参考指数は、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）です。
ブルームバーグ商品指数は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社とUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の共同商品で、現物商品の先物契約により構成され、商品市場全体の値動きを表します。
「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。

ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）及び「ブルームバーグ（Bloomberg®）」は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー（Bloomberg Finance L.P.）及び、その関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）のサービスマークであり、当社による一定の目的での利用のためにライセンスされています。ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）は、ブルームバーグとUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー（UBS Securities LLC）の間の契約に従ってブルームバーグが算出し、配信し、販売するものです。ブルームバーグ、ならびにUBSセキュリティーズ・エル・エル・シー及びその関係会社（以下「UBS」と総称します。）のいずれも、当社の関係会社ではなく、ブルームバーグ及びUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューし又は推奨するものではありません。ブルームバーグ及びUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数（Bloomberg Commodity Index SM）に関連するいかなるデータ又は情報の適時性、正確性又は完全性も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、2023年5月26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

当ファンドの基準価額は、ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）が上昇したことから、前期末比で上昇しました。

投資環境

商品市場は、主要中央銀行による利上げサイクルが終盤に近いとの見方が広がり、景気回復や商品需要の拡大などへの期待感から2023年9月中旬にかけて上昇しました。その後は、再び世界的な景気悪化が意識されたことでエネルギーセクターを中心に下落しましたが、2024年2月下旬以降は中東の地政学リスクの高まりなどを背景に上昇に転じました。

外国為替市場は、日本の金融緩和継続が見込まれた一方、米国では利上げ局面の長期化が意識されたことで、円安・米ドル高が進行しました。2023年末にかけて米国の早期の利下げ転換観測から円高・米ドル安となる局面がありましたが、年明け以降は米国の雇用や消費の底堅さなどを受けて同国の利下げ観測が後退し、再び円安・米ドル高が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

主としてブルームバーグ商品指数（円換算ベース）に概ね連動する投資成果を目標として、償還価格がブルームバーグ商品指数の騰落率と概ね連動する米ドル建て債券の組み入れを高位に保つ運用を行いました。

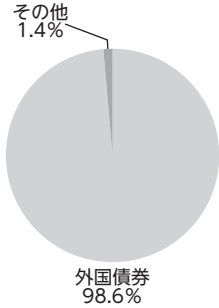
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

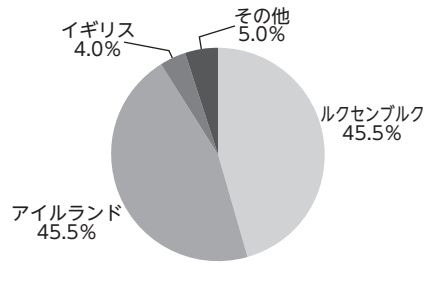
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 008 10/24/24	アイルランド	44.9%
2	SG ISSUER 037 12/30/24	ルクセンブルク	13.9%
3	SG ISSUER 036 10/31/24	ルクセンブルク	11.3%
4	SG ISSUER 038 02/28/25	ルクセンブルク	10.7%
5	SG ISSUER 035 08/30/24	ルクセンブルク	9.1%
6	BAR USD COM 042 04/30/25	イギリス	3.9%
7	IPATH DOW COMM 06/12/36	アメリカ	2.6%
8	ETFS ALL COMMODITIES	ジャージー	2.4%
9	———	—	—
10	———	—	—
組入銘柄数		8	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○資産別配分



○国別配分

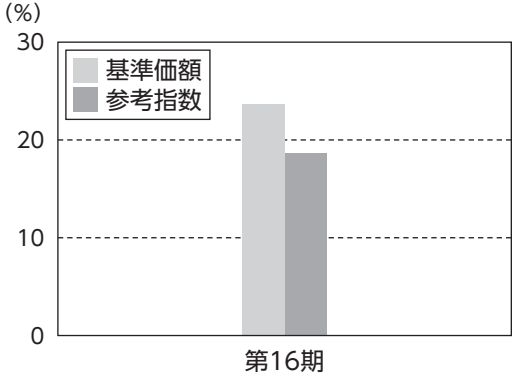


○通貨別配分

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

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



今後の運用方針

ブルームバーグ商品指数（円換算ベース）と概ね連動する投資成果をめざして運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年5月27日～2024年5月27日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（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）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（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	2	0.026	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(2)	(0.026)	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）	(－)	(－)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	2	0.026	

（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（6,075円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	社債券（投資法人債券を含む）	千米ドル 109,533	千米ドル 95,863

（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）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。

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	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	63,651	5,015	7.9	63,559	4,996	7.9

（注）当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A)債券種類別開示

区分	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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	(注4)	192,818	30,247,437	98.6	－	4.9	－	93.7
合計	(注4)	192,818	30,247,437	98.6	－	4.9	－	93.7

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)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。
(注4)額面基準の異なる銘柄を組入れているため、額面金額を表示していません。

(B)個別銘柄開示

銘柄	当期末				
	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)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
普通社債券(含む投資法人債券)					
BAR USD COM 042 04/30/25	－	8,000	7,665	1,202,502	2025/4/30
ETFS ALL COMMODITIES	－	(注3)40,000	4,608	722,856	－
IPATH DOW COMM 06/12/36	－	(注4)15,000	5,016	786,937	2036/6/12
SG ISSUER 035 08/30/24	－	18,000	17,776	2,788,646	2024/8/30
SG ISSUER 036 10/31/24	－	22,000	22,024	3,454,936	2024/10/31
SG ISSUER 037 12/30/24	－	26,000	27,110	4,252,777	2024/12/30
SG ISSUER 038 02/28/25	－	20,000	20,888	3,276,700	2025/2/28
STAR HELIOS 008 10/24/24	－	52,000	87,729	13,762,079	2024/10/24
合計				30,247,437	

(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)償還年月日が「－」の銘柄は、償還期限の定めがありません。
(注3)無額面のため、取引数量を表示しております。
(注4)額面は50米ドルです。

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	30,247,437	98.2
コール・ローン等、その他	544,606	1.8
投資信託財産総額	30,792,043	100.0

（注1）当期末における外貨建純資産（30,515,252千円）の投資信託財産総額（30,792,043千円）に対する比率は99.1％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＝156.87円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年5月27日現在
(A)資産	30,792,043,785円
コール・ローン等	544,605,963
公社債(評価額)	30,247,437,310
未収利息	512
(B)負債	120,881,218
未払解約金	120,881,218
(C)純資産総額(A-B)	30,671,162,567
元本	44,736,174,481
次期繰越損益金	△14,065,011,914
(D)受益権総口数	44,736,174,481口
1万口当たり基準価額(C/D)	6,856円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年5月27日 至 2024年5月27日
(A)配当等収益	13,152,912円
受取利息	13,245,398
支払利息	△92,486
(B)有価証券売買損益	5,812,835,926
売買益	5,836,287,991
売買損	△23,452,065
(C)その他費用	△7,130,120
(D)当期損益金(A+B+C)	5,818,858,718
(E)前期繰越損益金	△18,403,337,098
(F)追加信託差損益金	△3,622,000,946
(G)解約差損益金	2,141,467,412
(H)計 (D+E+F+G)	△14,065,011,914
次期繰越損益金(H)	△14,065,011,914

（注1）(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
（注2）(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
（注3）(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は41,300,101,166円、期中追加設定元本額は9,072,212,617円、期中一部解約元本額は5,636,139,302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。

コモディティ・オープン（SMA専用）	33,875,373,521円
SMTAMコモディティ・オープン	3,492,543,046円
コア投資戦略ファンド（成長型）	2,251,431,268円
コモディティ・オープン（適格機関投資家専用）	1,493,618,996円
コア投資戦略ファンド（安定型）	1,332,783,050円
コア投資戦略ファンド（切替型）	1,005,955,795円
コア投資戦略ファンド（切替型ワイド）	614,929,065円
FOFs用 グローバル・コモディティ（米ドル建て）・ファンドS（適格機関投資家専用）	450,424,973円
コア投資戦略ファンド（積極成長型）	154,784,956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）	64,329,811円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

（変更日：2023年11月18日）

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

運 用 報 告 書

第7期（決算日　2024年7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

【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。
・－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。

<580023>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第3期(2020年7月10日)	12,833	25.8	13,043	27.2	99.0	28,966
第4期(2021年7月12日)	12,644	△1.5	12,848	△1.5	98.9	36,114
第5期(2022年7月11日)	12,005	△5.1	12,266	△4.5	100.1	30,762
第6期(2023年7月10日)	12,430	3.5	12,805	4.4	98.4	30,894
第7期(2024年7月10日)	14,302	15.1	14,897	16.3	101.1	30,802

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。

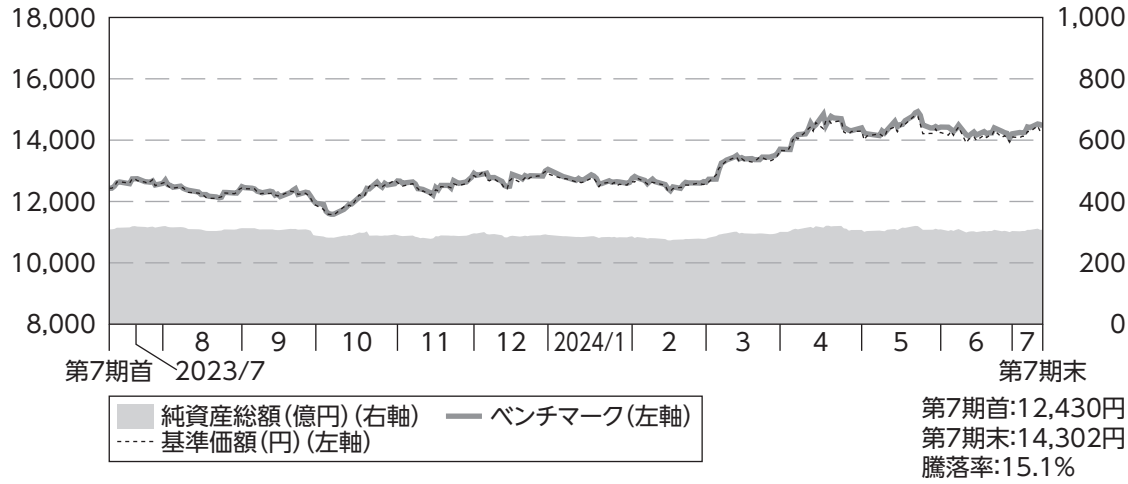
当期中の基準価額と市況の推移

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)	円	%		%	%
2023年 7月10日	12,430	－	12,805	－	98.4
7月末	12,603	1.4	12,970	1.3	97.9
8月末	12,439	0.1	12,861	0.4	102.7
9月末	11,876	△4.5	12,301	△3.9	103.1
10月末	12,618	1.5	13,052	1.9	99.9
11月末	12,844	3.3	13,307	3.9	97.4
12月末	12,898	3.8	13,441	5.0	96.0
2024年 1月末	12,645	1.7	13,137	2.6	98.2
2月末	12,579	1.2	13,009	1.6	103.2
3月末	13,665	9.9	14,118	10.3	99.8
4月末	14,292	15.0	14,834	15.8	100.6
5月末	14,250	14.6	14,861	16.1	98.2
6月末	14,102	13.5	14,635	14.3	100.6
(当期末)					
2024年 7月10日	14,302	15.1	14,897	16.3	101.1

(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、2023年7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LBMA金価格(円ヘッジベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境

金価格は、上昇しました。
期初から10月末頃にかけては、FRB（米連邦準備理事会）による金融引き締めの長期化が金価格の重しとなりました。一方中東情勢が緊迫化したことで金の需要が高まりました。1月末頃にかけては、FRBによる金融引き締めが終了したとの見方から米国債利回りが低下し、その後3月末頃にかけて再度中東情勢が緊迫化したことで金価格は上昇しました。期末にかけては中東情勢を巡る過度な警戒が後退したことや各種経済指標を受けて年内の利下げ観測が後退したことで金価格は上昇が一服しました。

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。

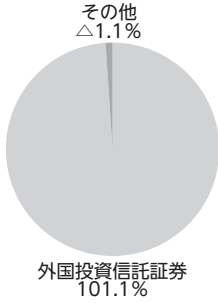
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

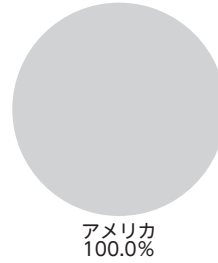
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	101.1%
2	―――	－	－
3	―――	－	－
4	―――	－	－
5	―――	－	－
6	―――	－	－
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		1	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

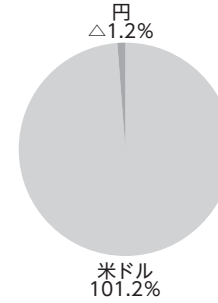
○資産別配分



○国別配分



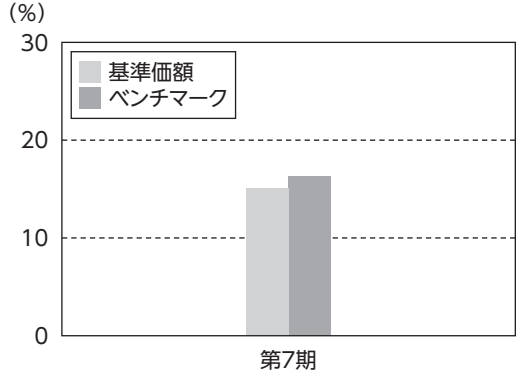
○通貨別配分



（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、ETF要因※（すべてマイナス要因）などです。

※ベンチマークがロンドン時間の価格を元に算出されるのに対しETFは米国市場の終値で評価されることにより発生する評価差要因です。

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 (2023年7月11日~2024年7月10日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.009%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(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)	(0.009)	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
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(−)	(−)	
(b) 有価証券取引税	0	0.000	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(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)	(0.000)	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	2	0.016	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(2)	(0.016)	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)	(−)	(−)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	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(13,067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	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES GOLD TRUST	671	25,612	2,205	85,409
小計	671	25,612	2,205	85,409

(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	%
為替先物取引	377,179	526	0.1	371,735	30,600	8.2
為替直物取引	3,737	－	－	12,792	500	3.9
金銭信託	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	35,238	2,434	6.9	35,278	2,443	6.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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)				千米ドル	
ISHARES GOLD TRUST		5,850	4,315	192,720	31,134,017
合計	口数・金額	5,850	4,315	192,720	31,134,017
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜101.1%＞

(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
	千円	%
投資信託受益証券	31,134,017	99.6
コール・ローン等、その他	123,111	0.4
投資信託財産総額	31,257,128	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(31,184,097千円)の投資信託財産総額(31,257,128千円)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＝161.55円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年7月10日現在
(A)資産	61,332,712,865円
コール・ローン等	123,110,881
投資信託受益証券(評価額)	31,134,017,469
未収入金	30,075,584,381
未収利息	134
(B)負債	30,530,532,926
未払金	30,524,227,387
未払解約金	6,305,539
(C)純資産総額(A-B)	30,802,179,939
元本	21,536,876,050
次期繰越損益金	9,265,303,889
(D)受益権総口数	21,536,876,050口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,302円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年7月11日 至 2024年7月10日
(A)配当等収益	2,193,279円
受取利息	2,231,068
支払利息	△37,789
(B)有価証券売買損益	4,126,395,499
売買益	11,465,979,200
売買損	△7,339,583,701
(C)その他費用	△4,821,694
(D)当期損益金(A+B+C)	4,123,767,084
(E)前期繰越損益金	6,039,897,112
(F)追加信託差損益金	920,159,796
(G)解約差損益金	△1,818,520,103
(H)計 (D+E+F+G)	9,265,303,889
次期繰越損益金(H)	9,265,303,889

(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24,854,962,097円、期中追加設定元本額は3,222,543,967円、期中一部解約元本額は6,540,630,014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	7,669,032,598円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	2,944,443,957円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,557,515,681円
分散投資コア戦略ファンドA	1,929,983,078円
グローバル経済コア	1,562,059,842円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,531,035,994円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,156,062,529円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	705,405,213円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	480,948,921円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	368,788,906円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	297,446,229円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	181,630,048円
グローバル10資産バランスファンド	78,745,893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)	73,777,161円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年8月11日)

ファンドのベンチマークである「LBMA金価格（円ヘッジベース）」について、ファンドの運用成果により近い計算方法へ変更を行いました。

米国株式LSマザーファンド

運 用 報 告 書

第7期（決算日　2024年7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2017年10月10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	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券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

【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。
・－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	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円	%	%	%	百万円
第3期(2020年7月10日)	10,113	△5.1	96.8	－	24,162
第4期(2021年7月12日)	9,712	△4.0	97.7	－	18,398
第5期(2022年7月11日)	10,481	7.9	98.4	－	21,178
第6期(2023年7月10日)	10,849	3.5	96.6	－	22,446
第7期(2024年7月10日)	12,617	16.3	98.6	－	20,065

(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

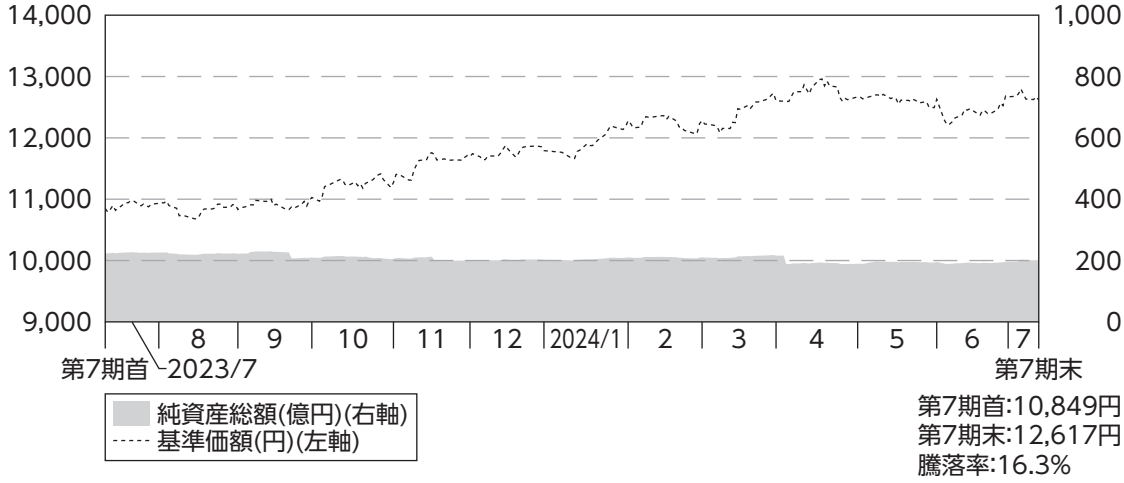
年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
	円	%	%	%
(当期首) 2023年 7月10日	10,849	－	96.6	－
7月末	10,934	0.8	95.9	－
8月末	10,832	△0.2	100.8	－
9月末	11,028	1.6	100.6	－
10月末	11,272	3.9	97.8	－
11月末	11,696	7.8	95.1	－
12月末	11,792	8.7	92.3	－
2024年 1月末	12,281	13.2	96.7	－
2月末	12,282	13.2	99.3	－
3月末	12,604	16.2	84.4	－
4月末	12,668	16.8	100.7	－
5月末	12,628	16.4	97.7	－
6月末	12,669	16.8	100.8	－
(当期末) 2024年 7月10日	12,617	16.3	98.6	－

(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



第7期首:10,849円
第7期末:12,617円
騰落率:16.3%

基準価額の主な変動要因

主要投資対象である米ドル建債券において、Two Sigmaグループの運用会社が活用する計量モデルに基づき銘柄選択を行いました。当期の基準価額は上昇しました。2023年の9月から2024年の4月にかけて堅調に推移しました。

投資環境

当期の米国株式市場は上昇しました。期初から2023年10月にかけては、米経済の軟着陸期待が強まったことは好材料となりましたが、大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRB（米連邦準備理事会）が政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから下落基調となりました。11月以降は、物価指標の伸びが鈍化したことで早期の利下げ転換期待が高まったことや、生成AI（人工知能）市場の成長期待を背景に半導体関連株が買われたことなどから期末にいたるまで堅調に上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

米ドル建債券の組入比率を高位に保つとともに、対円での為替ヘッジ（米ドル売り/円買い）を行い、米ドル/円の為替変動に伴うリスクの低減を図りました。米ドル建債券においては、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等を対象にしたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行い、期を通してロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに米ドル建債券の時価総額比で150%程度を維持しました。

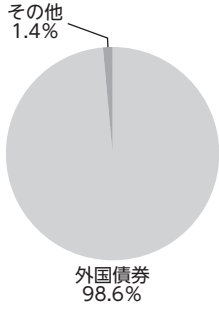
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

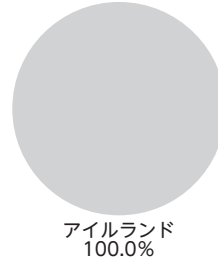
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 004 10/18/27	アイルランド	98.6%
2	―――	－	－
3	―――	－	－
4	―――	－	－
5	―――	－	－
6	―――	－	－
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		1	

（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

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

UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社（SPC）の発行する米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建（ロングポジション）と売建（ショートポジション）を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。
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（2023年7月11日~2024年7月10日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（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）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（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	3	0.023	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(3)	(0.023)	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）	(－)	(－)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.023	

（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（11,890円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	社債券(投資法人債券を含む)	千米ドル －	千米ドル 58,499

(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)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。

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	244,105	244,105	100.0	238,598	238,598	100.0
為替直物取引	－	－	－	8,772	8,772	100.0
金銭信託	20	20	100.0	20	20	100.0
コール・ローン	220,545	16,194	7.3	220,889	16,273	7.4

(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(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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	80,000	122,410	19,775,387	98.6	－	－	98.6	－
合計	80,000	122,410	19,775,387	98.6	－	－	98.6	－

(注1)邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)個別銘柄開示

銘柄	当期末				
	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)	
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
普通社債券(含む投資法人債券)					
STAR HELIOS 004 10/18/27	－	80,000	122,410	19,775,387	2027/10/18
合計				19,775,387	

(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
	千円	%
公社債	19,775,387	95.3
コール・ローン等、その他	976,203	4.7
投資信託財産総額	20,751,590	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(19,775,387千円)の投資信託財産総額(20,751,590千円)に対する比率は95.3%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＝161.55円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年7月10日現在
(A)資産	40,412,341,050円
コール・ローン等	976,201,554
公社債(評価額)	19,775,387,196
未収入金	19,660,750,500
未収利息	1,800
(B)負債	20,346,941,286
未払金	20,346,532,900
未払解約金	408,386
(C)純資産総額(A-B)	20,065,399,764
元本	15,903,410,443
次期繰越損益金	4,161,989,321
(D)受益権総口数	15,903,410,443口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,617円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年7月11日 至 2024年7月10日
(A)配当等収益	2,489,108円
受取利息	2,709,620
支払利息	△220,512
(B)有価証券売買損益	3,141,820,422
売買益	8,083,413,751
売買損	△4,941,593,329
(C)その他費用	△4,724,797
(D)当期損益金(A+B+C)	3,139,584,733
(E)前期繰越損益金	1,757,494,730
(F)追加信託差損益金	320,658,765
(G)解約差損益金	△1,055,748,907
(H)計 (D+E+F+G)	4,161,989,321
次期繰越損益金(H)	4,161,989,321

(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20,689,301,202円、期中追加設定元本額は1,469,520,237円、期中一部解約元本額は6,255,410,996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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	11,981,569,064円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,358,649,623円
コア投資戦略ファンド(安定型)	958,616,493円
コア投資戦略ファンド(切替型)	606,990,747円
FOFs用 米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	309,332,106円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	247,342,593円
米国株式LSファンド(SMA専用)	107,000,577円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	66,793,057円

お知らせ

該当事項はありません。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

運 用 報 告 書

第5期（決算日　2024年5月27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2019年7月8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	主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建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

【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。
・－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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円	%	%	%	百万円
設定日(2019年7月 8日)	10,000	－	－	－	2,500
第1期(2020年5月26日)	11,113	11.1	98.0	－	10,908
第2期(2021年5月26日)	11,168	0.5	98.9	－	20,334
第3期(2022年5月26日)	11,343	1.6	98.6	－	23,203
第4期(2023年5月26日)	12,611	11.2	99.5	－	21,071
第5期(2024年5月27日)	12,524	△0.7	99.2	－	17,793

(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

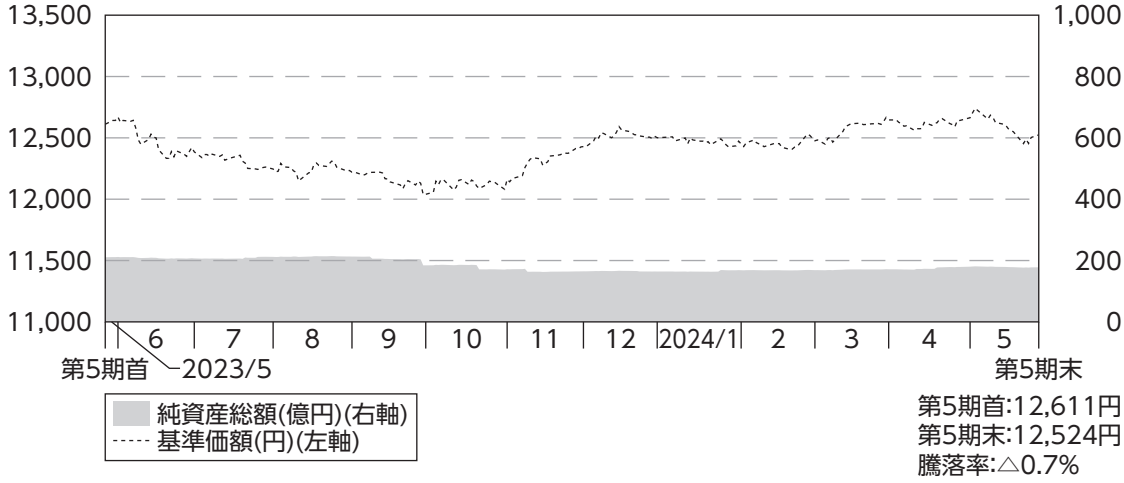
年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
(当期首)	円	%	%	%
2023年 5月26日	12,611	－	99.5	－
5月末	12,670	0.5	99.5	－
6月末	12,386	△1.8	99.3	－
7月末	12,246	△2.9	99.1	－
8月末	12,220	△3.1	98.9	－
9月末	12,040	△4.5	98.8	－
10月末	12,161	△3.6	99.3	－
11月末	12,429	△1.4	98.9	－
12月末	12,501	△0.9	99.1	－
2024年 1月末	12,450	△1.3	99.2	－
2月末	12,476	△1.1	99.3	－
3月末	12,646	0.3	99.0	－
4月末	12,664	0.4	99.0	－
(当期末)				
2024年 5月27日	12,524	△0.7	99.2	－

(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

当ファンドの基準価額は、ブルームバーグ商品フォワード指数※の騰落率がブルームバーグ商品指数の騰落率を下回ったため、前期末比で下落しました。

※ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）および構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数です。

投資環境

商品市場は、主要中央銀行による利上げサイクルが終盤に近いとの見方が広がり、景気回復や商品需要拡大への期待から2023年9月中旬にかけて上昇しました。原油市場ではサウジアラビアやロシアなどの主要産油国が減産や輸出量削減の方針を示し供給懸念が強まったこともあり、期近物の価格上昇幅が期先物を上回り、当ファンドのリターンにマイナスに影響しました。その後は、天然ガス市場で世界的な暖冬を背景に暖房需要が低調となったことなどから期近物を中心に下落しましたが、2024年5月以降は米国内での天然ガスの生産量と在庫の減少に加え、気温上昇に伴う冷房需要の増加を受けて期近物を中心に上昇に転じました。

当ファンドのポートフォリオ

主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とブルームバーグ商品フォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指して運用を行いました。

※主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値と、ブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券です。なお、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値です。

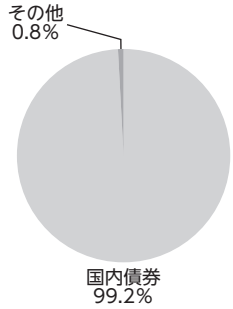
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

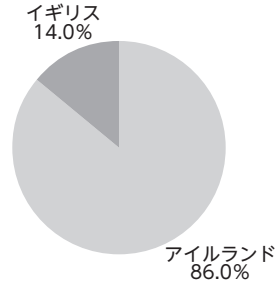
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 07/16/24	アイルランド	85.3%
2	ソシエテ・ジェネラル 0% 2025/04/30	イギリス	13.9%
3	―――	－	－
4	―――	－	－
5	―――	－	－
6	―――	－	－
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		2	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

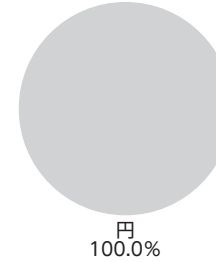
○資産別配分



○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

主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数（以下、「フォワード指数※1」といいます。）の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。

※1 この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品（エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物）及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。
※2 運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乗じる一定数は同値とします。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年5月27日～2024年5月27日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	－円	－%	(a)売買委託手数料＝〔期中の売買委託手数料〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（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）	(－)	(－)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(b)有価証券取引税＝〔期中の有価証券取引税〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(－)	(－)	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
（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	3	0.025	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(3)	(0.025)	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）	(－)	(－)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	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（12,407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	社債券（投資法人債券を含む）	千円 4,905,410	千円 7,942,350

（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）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。

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	3	3	100.0	3	3	100.0
コール・ローン	52,340	4,343	8.3	52,308	4,338	8.3

（注）当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

＜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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
普通社債券 （含む投資法人債券）	14,530,000 (14,530,000)	17,643,939 (17,643,939)	99.2 (99.2)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	99.2 (99.2)
合計	14,530,000 (14,530,000)	17,643,939 (17,643,939)	99.2 (99.2)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	99.2 (99.2)

（注1）組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
（注2）（　）内は非上場債で内書きです。
（注3）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（B）個別銘柄開示

当期末				
銘柄名	利率（%）	額面金額（千円）	評価額（千円）	償還年月日
普通社債券（含む投資法人債券）				
ソシエテ・ジェネラル　0%　2025／04／30	0	2,500,000	2,470,500	2025/4/30
STAR HELIOS　0%　07／16／24	0	12,030,000	15,173,439	2024/7/16
合計		14,530,000	17,643,939	

※ 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
	千円	%
公社債	17,643,939	99.2
コール・ローン等、その他	150,360	0.8
投資信託財産総額	17,794,299	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年5月27日現在
(A)資産	17,794,299,705円
コール・ローン等	150,360,427
公社債(評価額)	17,643,939,000
未収利息	278
(B)負債	589,949
未払解約金	589,949
(C)純資産総額(A-B)	17,793,709,756
元本	14,208,102,699
次期繰越損益金	3,585,607,057
(D)受益権総口数	14,208,102,699口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,524円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年5月27日 至 2024年5月27日
(A)配当等収益	△46,531円
受取利息	28,315
支払利息	△74,846
(B)有価証券売買損益	△278,585,000
売買益	41,880,000
売買損	△320,465,000
(C)その他費用	△4,678,846
(D)当期損益金(A+B+C)	△283,310,377
(E)前期繰越損益金	4,362,596,253
(F)追加信託差損益金	466,384,497
(G)解約差損益金	△960,063,316
(H)計 (D+E+F+G)	3,585,607,057
次期繰越損益金(H)	3,585,607,057

(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16,709,046,613円、期中追加設定元本額は1,902,752,276円、期中一部解約元本額は4,403,696,190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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	10,547,181,298円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,246,194,696円
コア投資戦略ファンド(安定型)	882,072,289円
コア投資戦略ファンド(切替型)	566,603,847円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	350,143,771円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	230,431,272円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	215,030,778円
コモディティLSアルファ・ファンド(SMA専用)	116,092,211円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	54,352,537円

お知らせ

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ･トレンド戦略マザーファンド

運 用 報 告 書

第4期（決算日　2024年3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2020年10月6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	主として米国株式イントラデイ･トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建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

【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。
・－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。

<680061>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円	%	%	%	百万円
設定日(2020年10月 6日)	10,000	－	－	－	0.4
第1期(2021年 3月10日)	9,132	△8.7	98.7	－	17,580
第2期(2022年 3月10日)	7,851	△14.0	98.8	－	18,312
第3期(2023年 3月10日)	9,002	14.7	98.7	－	8,402
第4期(2024年 3月11日)	9,032	0.3	99.4	－	7,474

(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

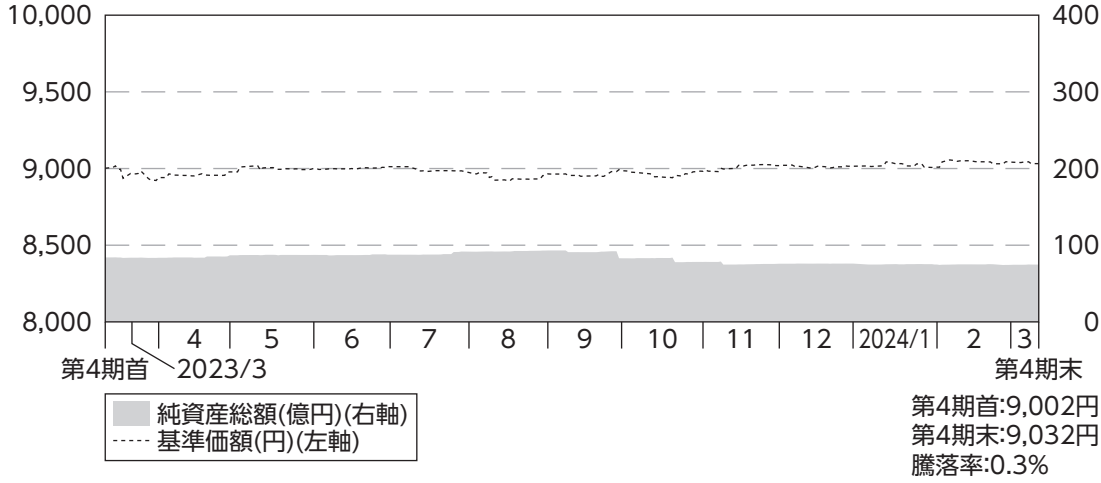
年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
	円	%	%	%
(当期首) 2023年 3月10日	9,002	－	98.7	－
3月末	8,941	△0.7	98.5	－
4月末	8,978	△0.3	99.1	－
5月末	9,001	△0.0	99.2	－
6月末	9,012	0.1	99.6	－
7月末	8,974	△0.3	99.1	－
8月末	8,965	△0.4	99.2	－
9月末	8,986	△0.2	99.5	－
10月末	8,982	△0.2	99.1	－
11月末	9,019	0.2	99.5	－
12月末	9,015	0.1	97.4	－
2024年 1月末	9,009	0.1	98.5	－
2月末	9,042	0.4	99.5	－
(当期末) 2024年 3月11日	9,032	0.3	99.4	－

(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

当期の米国株式イントラデイ・トレンド戦略※のリターンがプラスとなったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

※米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までに解消する戦略です。

投資環境

米国株式市場は、CPI（消費者物価指数）の伸びが鈍化したことでFRB（米連邦準備理事会）による利上げの休止が期待されたことや、米国景気の軟着陸期待の高まりなどから2023年7月にかけて上昇しましたが、その後は大手格付会社が米国債の格下げを発表したことや、FRBが政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから軟調に推移しました。11月以降は、労働需給の軟化、インフレ鈍化を示す指標を受けて長期金利が低下したことや、FRBによる早期の利下げ転換への期待が高まったことなどから上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指しました。

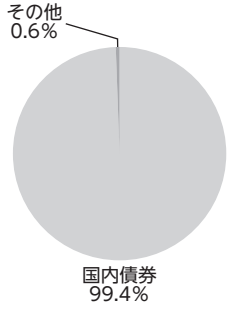
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

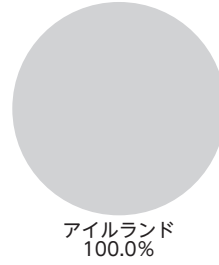
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 10/18/24	アイルランド	99.4%
2	―――	－	－
3	―――	－	－
4	―――	－	－
5	―――	－	－
6	―――	－	－
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		1	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

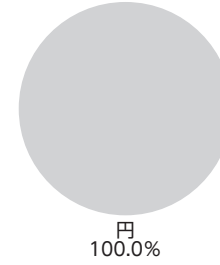
○資産別配分



○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

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

主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年3月11日~2024年3月11日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	ー円	ー%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(ー)	(ー)	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
（新株予約権証券）	(ー)	(ー)	
（オプション証券等）	(ー)	(ー)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(ー)	(ー)	
（投資信託証券）	(ー)	(ー)	
（商品）	(ー)	(ー)	
（先物・オプション）	(ー)	(ー)	
(b) 有価証券取引税	ー	ー	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(ー)	(ー)	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
（新株予約権証券）	(ー)	(ー)	
（オプション証券等）	(ー)	(ー)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(ー)	(ー)	
（公社債）	(ー)	(ー)	
（投資信託証券）	(ー)	(ー)	
(c) その他費用	3	0.036	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(3)	(0.036)	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）	(ー)	(ー)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.036	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（8,993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
		千円	千円
国内	社債券（投資法人債券を含む）	1,570,627	2,454,158

（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）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。

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	1	1	100.0	1	1	100.0
コール・ローン	22,114	1,723	7.8	22,184	1,738	7.8

（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

＜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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
普通社債券（含む投資法人債券）	8,234,000 (8,234,000)	7,432,008 (7,432,008)	99.4 (99.4)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	99.4 (99.4)
合計	8,234,000 (8,234,000)	7,432,008 (7,432,008)	99.4 (99.4)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	99.4 (99.4)

（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

当期末				
銘柄名	利率（%）	額面金額（千円）	評価額（千円）	償還年月日
普通社債券（含む投資法人債券）				
STAR HELIOS 0% 10／18／24	0	8,234,000	7,432,008	2024/10/18
合計		8,234,000	7,432,008	

※ 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
	千円	%
公社債	7,432,008	99.4
コール・ローン等、その他	43,223	0.6
投資信託財産総額	7,475,231	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年3月11日現在
(A)資産	7,475,231,938円
コール・ローン等	43,223,538
公社債(評価額)	7,432,008,400
(B)負債	623,115
未払解約金	623,096
未払利息	19
(C)純資産総額(A-B)	7,474,608,823
元本	8,275,462,179
次期繰越損益金	△800,853,356
(D)受益権総口数	8,275,462,179口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,032円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年3月11日 至 2024年3月11日
(A)配当等収益	△43,575円
受取利息	274
支払利息	△43,849
(B)有価証券売買損益	24,915,300
売買益	32,074,700
売買損	△7,159,400
(C)その他費用	△2,941,449
(D)当期損益金(A+B+C)	21,930,276
(E)前期繰越損益金	△932,021,444
(F)追加信託差損益金	△218,855,465
(G)解約差損益金	328,093,277
(H)計 (D+E+F+G)	△800,853,356
次期繰越損益金(H)	△800,853,356

(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9,334,795,160円、期中追加設定元本額は2,153,866,306円、期中一部解約元本額は3,213,199,287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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	5,180,706,394円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1,207,604,607円
コア投資戦略ファンド(成長型)	607,209,558円
コア投資戦略ファンド(安定型)	445,375,786円
コア投資戦略ファンド(切替型)	274,686,394円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	174,857,855円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS(適格機関投資家専用)	131,483,357円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	120,319,234円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	106,915,299円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	26,303,695円

お知らせ

該当事項はありません。

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

運 用 報 告 書

第4期（決算日　2024年2月20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2020年3月25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	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
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。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。

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

【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。
・－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。

<680057>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円	%	%	%	百万円
設定日(2020年3月25日)	10,000	－	－	－	99
第1期(2021年2月22日)	10,193	1.9	53.2	△40.0	263
第2期(2022年2月21日)	10,123	△0.7	50.5	△79.8	277
第3期(2023年2月20日)	11,285	11.5	50.5	△29.7	6,187
第4期(2024年2月20日)	11,267	△0.2	57.7	△37.5	20,286

(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

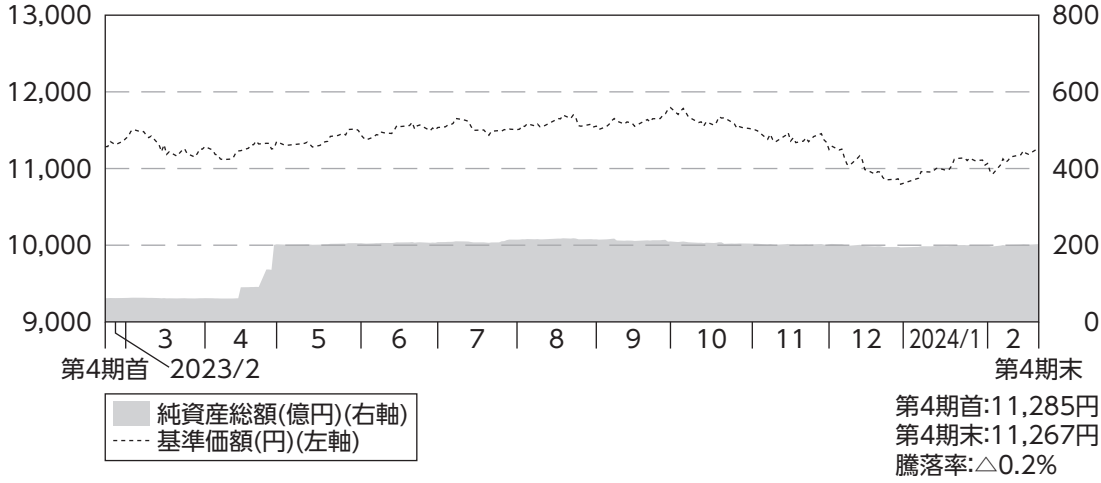
年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
(当期首)	円	%	%	%
2023年 2月20日	11,285	－	50.5	△29.7
2月末	11,391	0.9	50.0	△31.3
3月末	11,287	0.0	50.5	△27.6
4月末	11,351	0.6	58.5	△35.6
5月末	11,437	1.3	57.6	△26.3
6月末	11,535	2.2	56.9	△26.7
7月末	11,507	2.0	55.1	△27.9
8月末	11,553	2.4	54.9	△29.6
9月末	11,795	4.5	56.4	△63.7
10月末	11,508	2.0	57.4	△46.7
11月末	11,249	△0.3	57.8	△46.6
12月末	10,807	△4.2	60.2	△48.9
2024年 1月末	11,066	△1.9	58.7	△51.1
(当期末)				
2024年 2月20日	11,267	△0.2	57.7	△37.5

(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



第4期首:11,285円
第4期末:11,267円
騰落率:△0.2%

基準価額の主な変動要因

基準価額は下落しました。2023年4月から9月にかけて英国の長期金利が上昇(債券価格は下落)、英国債のショートがプラスに寄与し、基準価額は上昇しましたが、10月から12月にかけて英国の長期金利が低下(債券価格は上昇)、英国債のショートがマイナスに影響し、基準価額は下落しました。その後、2024年1月から2月にかけて英国の長期金利が上昇、英国債のショートがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

投資環境

○国内債券市場
金融緩和政策の維持を受けて買われました。

○米国債券市場
政策金利の引き上げを受けて売られました。

○ドイツ債券市場
利下げ観測が高まったことを受けて買われました。

○英国債券市場
政策金利の引き上げを受けて売られました。

○豪ドル／円相場
豪ドルは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○カナダドル／円相場
カナダドルは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○スイスフラン／円相場
スイスフランは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○ユーロ／円相場
ユーロは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

投資環境

○イギリスポンド／円相場

イギリスポンドは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○ノルウェークローネ／円相場

ノルウェークローネは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○ニュージーランドドル／円相場

ニュージーランドドルは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○スウェーデンクローナ／円相場

スウェーデンクローナは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

○米ドル／円相場

米ドルは対円で、金利差拡大を受けて買われました。

当ファンドのポートフォリオ

主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引と為替予約取引について、定量的手法により運用を行いました。

・国内債券市場
全期間でロングポジションを継続しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・米国債券市場
概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・ドイツ債券市場
概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

・英国債券市場
概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。しかし、基準価額への影響はマイナスでした。

・豪ドル／円相場
概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響は限定的でした。

・カナダドル／円相場
概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響は限定的でした。

・スイスフラン／円相場
全期間でショートポジションを継続しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

・ユーロ／円相場
概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

当ファンドのポートフォリオ

・イギリスポンド／円相場
概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。しかし、基準価額への影響はマイナスでした。

・ノルウェークローネ／円相場
概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響は限定的でした。

・ニュージーランドドル／円相場
概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・スウェーデンクローナ／円相場
概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・米ドル／円相場
概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

当ファンドの組入資産の内容

○ロング上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	長期国債標準物先物 2403	日本	53.3%
2	第1152回国庫短期証券	日本	34.5%
3	第1189回国庫短期証券	日本	9.9%
4	第1145回国庫短期証券	日本	8.4%
5	第1183回国庫短期証券	日本	4.9%
6	US 10YR NOTE 2403	アメリカ	3.0%
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		6	

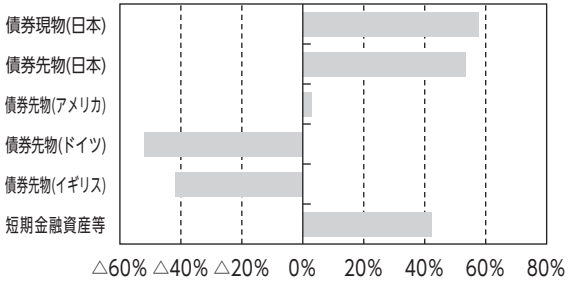
(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○ショート上位10銘柄

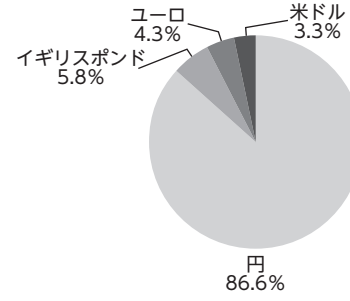
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	EURO-BUND 2403	ドイツ	△52.1%
2	LONG GILT FU 2403	イギリス	△41.8%
3	―――	－	－
4	―――	－	－
5	―――	－	－
6	―――	－	－
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		2	

(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・国別配分



○通貨別配分



(注)資産・国別配分、通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。また、オフバランス取引を行っているため、資産・国別配分の合計は100%となりません。

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。

今後の運用方針

主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。
債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2023年2月21日~2024年2月20日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	5円	0.047%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(株式)	(ー)	(ー)	
(新株予約権証券)	(ー)	(ー)	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
(オプション証券等)	(ー)	(ー)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(ー)	(ー)	
(投資信託証券)	(ー)	(ー)	
(商品)	(ー)	(ー)	
(先物・オプション)	(5)	(0.047)	
(b) 有価証券取引税	ー	ー	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(株式)	(ー)	(ー)	
(新株予約権証券)	(ー)	(ー)	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
(オプション証券等)	(ー)	(ー)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(ー)	(ー)	
(公社債)	(ー)	(ー)	
(投資信託証券)	(ー)	(ー)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
(保管費用)	(ー)	(ー)	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)	(ー)	(ー)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	5	0.047	

(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(11,373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	当期 売付額
		千円	千円
国内	国債証券	11,714,278	－ (3,120,000)

(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。

派生商品の取引状況等

＜先物取引の銘柄別取引・残高状況＞

銘柄別			当期 買建 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額	当期末評価額 買建額	当期末評価額 売建額	当期末評価額 評価損益
			百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券	１０年国債標準物	72,961	65,212	－	－	10,817	－	△28
外国	債券	US 10YR NOTE	5,414	4,779	50,887	52,841	610	－	△2
		LONG GILT FU	7,464	7,213	51,764	44,312	－	8,472	174
		EURO-BUND	－	－	84,568	77,396	－	10,563	90

(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	当期 うち利害関係人との取引状況B	当期 B/A	当期 売付額等C	当期 うち利害関係人との取引状況D	当期 D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	279,520	279,520	100.0	277,546	277,546	100.0
為替直物取引	1,968	1,968	100.0	－	－	－
金銭信託	74	74	100.0	74	74	100.0
コール・ローン	1,447,117	124,191	8.6	1,443,768	124,494	8.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	11,700,000 (11,700,000)	11,702,705 (11,702,705)	57.7 (57.7)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	57.7 (57.7)
合計	11,700,000 (11,700,000)	11,702,705 (11,702,705)	57.7 (57.7)	－ (－)	－ (－)	－ (－)	57.7 (57.7)

(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

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
国債証券				
第１１４５回国庫短期証券	－	1,700,000	1,700,215	2024/3/21
第１１５２回国庫短期証券	－	7,000,000	7,001,344	2024/4/22
第１１８３回国庫短期証券	－	1,000,000	1,000,348	2024/9/20
第１１８９回国庫短期証券	－	2,000,000	2,000,798	2024/10/21
合計		11,700,000	11,702,705	

＜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	10,817	－
外国	LONG GILT FU	－	8,472
	EURO-BUND	－	10,563
	US 10YR NOTE	610	－

(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	%
公社債	11,702,705	57.5
コール・ローン等、その他	8,632,643	42.5
投資信託財産総額	20,335,348	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(2,710,788千円)の投資信託財産総額(20,335,348千円)に対する比率は13.3%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＝150.38円　　1ユーロ＝161.94円　　1イギリスポンド＝189.30円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年2月20日現在
(A)資産	38,052,922,602円
コール・ローン等	5,703,109,841
公社債(評価額)	11,702,705,900
未収入金	18,044,712,426
差入委託証拠金	2,602,394,435
(B)負債	17,766,198,563
未払金	17,765,637,536
未払解約金	559,999
未払利息	1,028
(C)純資産総額(A-B)	20,286,724,039
元本	18,004,988,482
次期繰越損益金	2,281,735,557
(D)受益権総口数	18,004,988,482口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,267円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年2月21日 至 2024年2月20日
(A)配当等収益	64,284,603円
受取利息	23,584
その他収益金	67,047,727
支払利息	△2,786,708
(B)有価証券売買損益	50,827,734
売買益	1,827,409,625
売買損	△1,776,581,891
(C)先物取引等取引損益	△111,415,747
取引益	2,154,229,482
取引損	△2,265,645,229
(D)その他費用	△6,163
(E)当期損益金(A+B+C+D)	3,690,427
(F)前期繰越損益金	704,738,004
(G)追加信託差損益金	1,896,198,596
(H)解約差損益金	△322,891,470
(I)計 (E+F+G+H)	2,281,735,557
次期繰越損益金(I)	2,281,735,557

(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5,483,012,464円、期中追加設定元本額は14,415,686,407円、期中一部解約元本額は1,893,710,389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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	6,822,564,896円
分散投資コア戦略ファンドS	6,382,953,534円
分散投資コア戦略ファンドA	3,027,614,598円
コア投資戦略ファンド(成長型)	470,003,414円
コア投資戦略ファンド(安定型)	344,838,529円
FOFs用 GBCAファンドS(ミドルリスク型)(適格機関投資家専用)	283,902,671円
コア投資戦略ファンド(切替型)	226,527,080円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)	201,058,139円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	142,281,202円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	82,859,039円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	20,385,380円

お知らせ

該当事項はありません。

日本債券ツイン戦略マザーファンド

運 用 報 告 書

第5期（決算日　2024年2月21日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2019年10月18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	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。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。

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

【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。
・－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。

<680047>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
設定日(2019年10月18日)	10,000	―	10,000	―	―	―	14,930
第1期(2020年 2月21日)	10,023	0.2	9,990	△0.1	98.7	△17.3	18,583
第2期(2021年 2月22日)	9,864	△1.6	9,793	△2.0	97.4	△3.2	43,033
第3期(2022年 2月21日)	9,886	0.2	9,717	△0.8	98.3	5.8	69,323
第4期(2023年 2月21日)	9,341	△5.5	9,342	△3.9	98.2	△3.4	84,644
第5期(2024年 2月21日)	9,343	0.0	9,349	0.1	97.5	△4.9	8,901

(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		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2023年 2月21日	9,341	―	9,342	―	98.2	△3.4
2月末	9,371	0.3	9,416	0.8	98.4	△5.5
3月末	9,487	1.6	9,548	2.2	96.9	―
4月末	9,501	1.7	9,570	2.4	95.7	△2.1
5月末	9,509	1.8	9,561	2.4	97.2	―
6月末	9,546	2.2	9,587	2.6	97.6	△5.9
7月末	9,432	1.0	9,438	1.0	97.8	△2.6
8月末	9,367	0.3	9,370	0.3	97.0	△5.7
9月末	9,306	△0.4	9,303	△0.4	95.6	△3.5
10月末	9,170	△1.8	9,155	△2.0	98.0	△2.8
11月末	9,319	△0.2	9,348	0.1	97.6	△1.6
12月末	9,369	0.3	9,386	0.5	97.7	3.3
2024年 1月末	9,310	△0.3	9,319	△0.2	97.6	―
(当期末)						
2024年 2月21日	9,343	0.0	9,349	0.1	97.5	△4.9

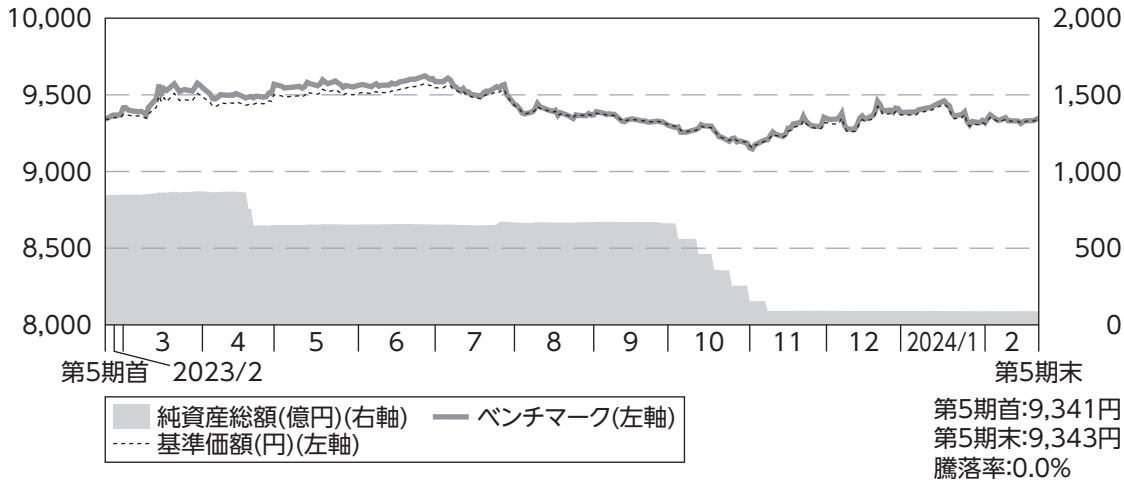
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。
【NOMURA-BPI総合】とは、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

【同指数】の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社に帰属します。
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ＆コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



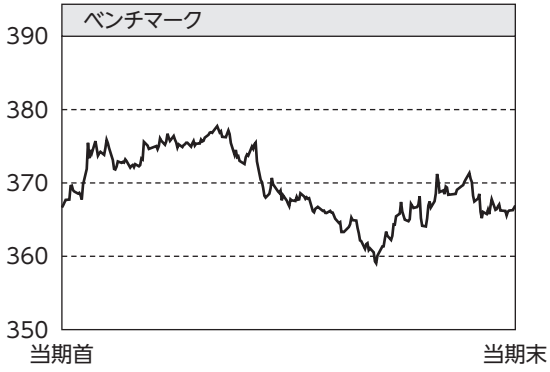
(注)ベンチマークは、2023年2月21日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は小幅に上昇しました。

期初から2023年6月にかけて、日銀総裁が「物価目標の達成にはなお時間がかかる」との認識を示し、日銀が金融緩和政策を維持したことに加え、米地銀破綻に端を発した金融不安の高まりなどから、金利は低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。その後、7月に日銀が金融政策決定会合で長短金利操作の運用柔軟化を決定し、長期金利の上限を従来の0.5%程度から事実上1%に引き上げ、10月においても、さらなる運用柔軟化として、長期金利の上限を「目途」と変更し、一定程度の超過を容認する姿勢を示しました。日銀による政策修正により、長期金利に上昇の余地が出来たことから、金利上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落したものの、11月以降は、米国の追加利上げ観測が後退し、米長期金利が急速に低下したことで、金利は低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。

投資環境



国内債券市場では、期初から6月にかけて、米地銀破綻に端を発した金融不安の高まりなどから、金利は低下しました。その後、日銀が7月の金融政策決定会合で長短金利操作の運用柔軟化を決定し、10月においても、さらなる運用柔軟化として、長期金利の上限を「目途」と変更したことから、金利上昇しました。しかしながら、11月以降は、米国の追加利上げ観測が後退し、米長期金利が急速に低下したことで、再び金利は低下しました。

クレジットスプレッドについては、欧米の金融引き締めは最終段階にあるとの見方から市場心理が改善し、事業債のスプレッドは縮小基調で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合を上回る投資成果を目標とし、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。

当ファンドの組入資産の内容

○ロング上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第1212回国庫短期証券	日本	5.5%
2	第53回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	日本	3.4%
3	第1208回国庫短期証券	日本	3.4%
4	第1回韓国投資証券株式會社円貨社債(2023)	日本	3.4%
5	第7回三菱商事利払繰延・期限前償還(劣後特約付)	日本	3.3%
6	第372回利付国債(10年)	日本	3.1%
7	第1210回国庫短期証券	日本	3.0%
8	第169回利付国債(20年)	日本	3.0%
9	第16回利付国債(40年)	日本	2.6%
10	第7回HSBC・HD・ピーエルシー期限前償還円貨社債	日本	2.3%
組入銘柄数		70	

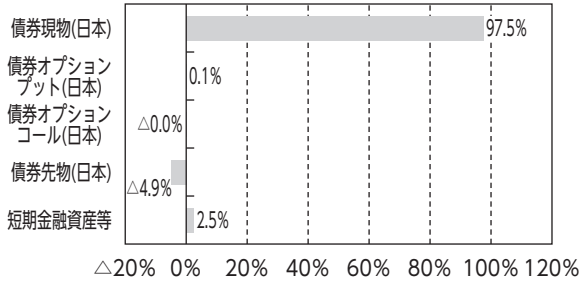
(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○ショート上位10銘柄

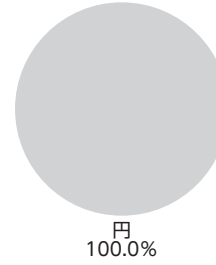
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	長期国債標準物先物 2403	日本	△4.9%
2	第165回利付国債(5年)コール 2405	日本	△0.0%
3	第165回利付国債(5年)コール 2404	日本	△0.0%
4	第457回利付国債(2年)コール 2404	日本	△0.0%
5	第456回利付国債(2年)コール 2403	日本	△0.0%
6	第456回利付国債(2年)コール 2403	日本	△0.0%
7	―――	－	－
8	―――	－	－
9	―――	－	－
10	―――	－	－
組入銘柄数		6	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○資産・国別配分



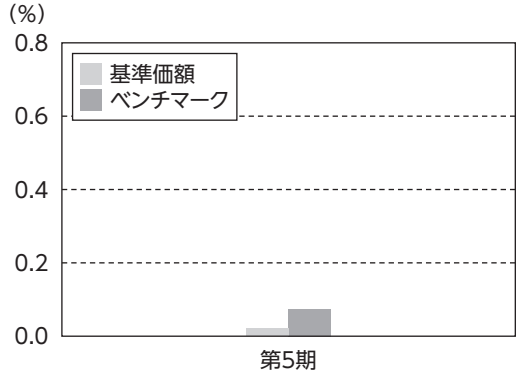
○通貨別配分



(注)資産・国別配分、通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。また、オフバランス取引を行っているため、資産・国別配分の合計は100%となりません。

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ベンチマーク騰落率を下回りました。
金利戦略では、金利低下した局面でデュレーションをショートで運営していたことなどがマイナスに影響しました。一方で、クレジット戦略は、劣後債のスプレッド縮小がプラス寄与しました。

今後の運用方針

わが国の公社債に投資しつつ、国債先物取引及び国債に係る選択権付債券売買取引を行うことでNOMURA-BPI総合を上回る投資成果を目指します。
ポートフォリオは、クレジット戦略に基づいて事業債を中心とした銘柄選択を行い、金利戦略に基づいてデュレーション等を調整しながら構築します。なお、金利戦略においては、国債先物取引や国債に係る選択権付債券売買取引を活用します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2023年2月22日~2024年2月21日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a)売買委託手数料=〔期中の売買委託手数料〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(−)	(−)	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
（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)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	−	−	(b)有価証券取引税=〔期中の有価証券取引税〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（株式）	(−)	(−)	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
（新株予約権証券）	(−)	(−)	
（オプション証券等）	(−)	(−)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(−)	(−)	
（公社債）	(−)	(−)	
（投資信託証券）	(−)	(−)	
(c) その他費用	0	0.001	(c)その他費用=〔期中のその他費用〕/〔期中の平均受益権口数〕×10,000
（保管費用）	(0)	(0.001)	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）	(−)	(−)	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）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.001	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（9,390円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

		当期 買付額	当期 売付額
		千円	千円
国内	国債証券	198,859,438	239,888,348
国内	社債券（投資法人債券を含む）	4,811,329	35,329,125 (2,300,000)

（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。

派生商品の取引状況等

＜先物取引の銘柄別取引・残高状況＞

銘柄別			当期 買建 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額	当期末評価額 買建額	当期末評価額 売建額	当期末評価額 評価損益
			百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券	１０年国債標準物	1,615	1,614	26,058	28,530	―	438	△0.52099

（注）金額は受渡代金です。

＜オプションの銘柄別取引・残高状況＞

銘柄別			コール・プット別	当期 買建 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 買建 権利行使	当期 買建 権利放棄	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額	当期 売建 権利被行使	当期 売建 義務消滅	当期末評価額 買建額	当期末評価額 売建額	当期末評価額 評価損益
				百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
国内	債券	債券店頭	コール	0.577	5	―	―	13	125	―	―	―	3	△2
			プット	50	42	―	―	4	33	―	―	8	―	5

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	44	44	100.0	44	44	100.0
コール・ローン	427,307	49,300	11.5	428,801	49,517	11.5

(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

＜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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	3,930,000 (1,440,000)	3,721,777 (1,440,375)	41.8 (16.2)	－ (－)	25.6 (－)	－ (－)	16.2 (16.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	5,100,000 (5,100,000)	4,955,979 (4,955,979)	55.7 (55.7)	－ (－)	37.8 (37.8)	8.9 (8.9)	9.0 (9.0)
合計	9,030,000 (6,540,000)	8,677,756 (6,396,354)	97.5 (71.9)	－ (－)	63.4 (37.8)	8.9 (8.9)	25.2 (25.2)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注2)(　)内は非上場債で内書きです。
(注3)評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

※ 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。

(B)個別銘柄開示

銘柄名	当期末 利率(%)	当期末 額面金額(千円)	当期末 評価額(千円)	当期末 償還年月日
国債証券				
第１１６４回国庫短期証券	－	200,000	200,071	2024/6/20
第１２０８回国庫短期証券	－	300,000	300,056	2024/4/22
第１２０９回国庫短期証券	－	180,000	180,042	2024/5/7
第１２１０回国庫短期証券	－	270,000	270,068	2024/5/13
第１２１２回国庫短期証券	－	490,000	490,135	2024/5/20
第１６回利付国債（４０年）	1.3	270,000	232,367	2063/3/20
第３６８回利付国債（１０年）	0.2	170,000	164,252	2032/9/20
第３７１回利付国債（１０年）	0.4	100,000	97,587	2033/6/20
第３７２回利付国債（１０年）	0.8	270,000	272,789	2033/9/20
第３７３回利付国債（１０年）	0.6	40,000	39,559	2033/12/20
第４６回利付国債（３０年）	1.5	100,000	100,000	2045/3/20
第４７回利付国債（３０年）	1.6	100,000	101,697	2045/6/20
第５１回利付国債（３０年）	0.3	160,000	122,758	2046/6/20
第５８回利付国債（３０年）	0.8	130,000	109,733	2048/3/20
第６４回利付国債（３０年）	0.4	100,000	74,438	2049/9/20
第６８回利付国債（３０年）	0.6	30,000	23,256	2050/9/20
第７９回利付国債（３０年）	1.2	30,000	26,596	2053/6/20
第８１回利付国債（３０年）	1.6	50,000	48,769	2053/12/20
第１６０回利付国債（２０年）	0.7	150,000	144,714	2037/3/20
第１６９回利付国債（２０年）	0.3	300,000	263,346	2039/6/20
第１７３回利付国債（２０年）	0.4	200,000	175,054	2040/6/20
第１８５回利付国債（２０年）	1.1	110,000	104,031	2043/6/20
第１８６回利付国債（２０年）	1.5	140,000	141,498	2043/9/20
第１８７回利付国債（２０年）	1.3	40,000	38,956	2043/12/20
小　計		3,930,000	3,721,777	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第３回第一生命ＨＤ利払繰延・任意償還付永久社債（劣後）	1.124	100,000	94,147	－
第１回朝日生命保険利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.5	100,000	97,946	2057/2/10
第４回DMG森精機利払繰延・任意償還付無担保永久社債（劣後）	0.9	100,000	97,158	－
第１回横浜冷凍利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.76	100,000	96,283	2058/9/27
第２回中央日本土地建物グループ株式会社無担保社債	0.53	100,000	98,012	2028/3/17
第２回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.28	100,000	100,279	2055/7/2
第３回ヒューリック利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.4	100,000	99,753	2057/7/2
第１回東急不動産ホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特	1.06	100,000	99,621	2055/12/17
第１回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	0.7	100,000	98,766	2081/6/15
第３回ＥＮＥＯＳホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後）	1.31	100,000	86,293	2081/6/15
第１回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.74	100,000	99,106	2081/10/14
第２回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.885	100,000	97,556	2081/10/14
第３回パナソニック株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.0	200,000	185,642	2081/10/14
第１回日本生命第５回劣後ローン流動化利払繰延・期限前償還（劣	1.05	200,000	193,312	2050/9/23
第７回三菱商事利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.51	300,000	295,575	2081/9/13
第１回ニプロ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.6	100,000	99,588	2055/9/28
第７回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.74	100,000	95,675	2050/12/2
第８回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.185	100,000	87,503	2051/9/8
第９回イオン利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.734	100,000	81,283	2056/9/8
第５回株式会社三井住友フィナンシャルグループ期限前償還条項付	0.75	100,000	99,097	2029/6/8
第２回東京センチュリー利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.38	100,000	100,337	2080/7/30
第６４回アイフル株式会社無担保社債	0.97	100,000	100,052	2024/6/14
第６６回アイフル株式会社無担保社債	0.87	100,000	99,738	2026/6/12
第１回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.62	100,000	99,479	2080/3/13
第２回オリックス利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.91	100,000	93,595	2080/3/13
第１回三菱ＨＣキャピタル利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.63	100,000	98,572	2081/9/27
第２回Ｔ＆Ｄホールディングス利払繰延・期限前償還（劣後特約付	0.69	100,000	99,746	2050/2/4
第３回東京建物利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.13	100,000	93,977	2061/2/10
第２回西日本鉄道株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	0.67	100,000	96,513	2058/6/21
第１回日本航空株式会社利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	1.6	100,000	100,195	2058/10/11
第１３回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.52	100,000	93,766	2031/6/3
第２３回株式会社光通信無担保社債	1.38	100,000	88,677	2034/8/8
第３３回株式会社光通信無担保社債	0.85	100,000	92,147	2031/6/16
第４回ソフトバンクグループ利払繰延・期限前償還（劣後特約付）	3.0	100,000	98,721	2056/2/4
第５３回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債	1.57	300,000	300,201	2024/6/14
第１７回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付非	1.163	100,000	99,463	2027/7/13
第７回クレディ・アグリコル期限前償還非上位円貨社債	1.248	200,000	200,692	2026/6/4
第７回ＨＳＢＣ・ＨＤ・ピーエルシー期限前償還円貨社債	1.478	200,000	200,758	2026/9/15
第１回韓国投資証券株式會社円貨社債（２０２３）	1.04	300,000	298,989	2024/7/22
第２４回ルノー円貨社債	1.54	100,000	100,286	2024/7/5
ＢＮＰパリバ　０．５５７％　２０２７／０５／２０	0.557	100,000	97,480	2027/5/20
小　計		5,100,000	4,955,979	
合　計		9,030,000	8,677,756	

(注)償還年月日が「－」の銘柄は、償還期限の定めがありません。

＜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	ー	438

＜オプションの銘柄別期末残高＞

銘柄別			コール・プット別	当期末	
				買建額	売建額
国内	債券	債券店頭		百万円	百万円
			コール	ー	3
			プット	8	ー

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	8,677,756	94.8
コール・ローン等、その他	474,039	5.2
投資信託財産総額	9,151,795	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2024年2月21日現在
(A)資産	9,151,635,901円
コール・ローン等	178,991,626
公社債(評価額)	8,677,756,960
プット・オプション(買)	8,873,000
未収入金	259,296,640
未収利息	18,994,884
前払費用	1,649,691
差入委託証拠金	6,073,100
(B)負債	250,233,902
コール・オプション(売)	3,578,000
未払金	240,111,790
未払解約金	6,544,078
未払利息	34
(C)純資産総額(A-B)	8,901,401,999
元本	9,527,038,253
次期繰越損益金	△625,636,254
(D)受益権総口数	9,527,038,253口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,343円

■損益の状況

項目	当期 自 2023年2月22日 至 2024年2月21日
(A)配当等収益	391,734,598円
受取利息	392,504,967
支払利息	△770,369
(B)有価証券売買損益	△635,864,580
売買益	1,083,779,850
売買損	△1,719,644,430
(C)先物取引等取引損益	△181,678,690
取引益	94,043,110
取引損	△275,721,800
(D)その他費用	△480,157
(E)当期損益金(A+B+C+D)	△426,288,829
(F)前期繰越損益金	△5,975,320,569
(G)追加信託差損益金	△316,151,957
(H)解約差損益金	6,092,125,101
(I)計 (E+F+G+H)	△625,636,254
次期繰越損益金(I)	△625,636,254

(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90,619,857,119円、期中追加設定元本額は5,823,446,550円、期中一部解約元本額は86,916,265,416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。

私募日本債券ツイン戦略ファンド(適格機関投資家専用)	7,790,639,970円
日本債券ツイン戦略ファンド(適格機関投資家専用)	1,736,398,283円

お知らせ

該当事項はありません。