

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2013年3月29日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の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 日本株式最小分散インデックスマザーファンド 国内債券インデックス マザーファンド 外国株式インデックス マザーファンド 外国株式最小分散インデックスマザーファンド 外国債券インデックス マザーファンド 新興国株式インデックス マザーファンド 新興国債券インデックス マザーファンド 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) 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・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用) 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) FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用) マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)
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、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。 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。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

分散投資コア戦略ファンドS (愛称:コアラップS)

運用報告書(全体版)

第9期(決算日 2021年7月12日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		税込分配金	期中騰落率						
第5期(2017年7月10日)	円 10,759	円 0	% 9.3	% 13.1	% 0.4	% 13.3	% 0.0	% 71.9	百万円 57,661
第6期(2018年7月10日)	11,008	0	2.3	13.2	0.8	14.2	0.1	70.9	75,431
第7期(2019年7月10日)	11,109	0	0.9	17.0	0.4	12.2	0.0	69.4	89,663
第8期(2020年7月10日)	10,980	0	△1.2	35.2	0.8	26.1	0.2	36.5	143,157
第9期(2021年7月12日)	12,554	0	14.3	38.8	0.9	32.2	0.1	26.7	171,466

(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	標準価額		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	騰落率					
(当期首) 2020年 7月10日	円 10,980	% -	% -	% 35.2	% 0.8	% 26.1	% 0.2	% 36.5
7月末	11,045	0.6	34.5	0.8	25.9	0.2	37.1	
8月末	11,414	4.0	35.8	0.8	25.3	0.2	36.9	
9月末	11,262	2.6	36.7	1.1	25.9	0.1	35.1	
10月末	11,096	1.1	36.8	1.2	33.1	0.0	27.5	
11月末	11,499	4.7	39.6	1.1	31.9	0.1	26.4	
12月末	11,712	6.7	40.1	0.9	31.2	0.0	27.0	
2021年 1月末	11,802	7.5	39.2	1.0	31.6	0.0	27.1	
2月末	11,892	8.3	39.9	0.9	31.2	0.1	26.7	
3月末	12,133	10.5	40.1	1.0	31.3	0.1	26.6	
4月末	12,344	12.4	39.2	1.1	31.6	0.1	26.9	
5月末	12,498	13.8	39.3	1.0	31.4	0.0	27.3	
6月末	12,508	13.9	39.1	1.0	32.0	0.1	26.7	
(当期末) 2021年 7月12日	12,554	14.3	38.8	0.9	32.2	0.1	26.7	

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

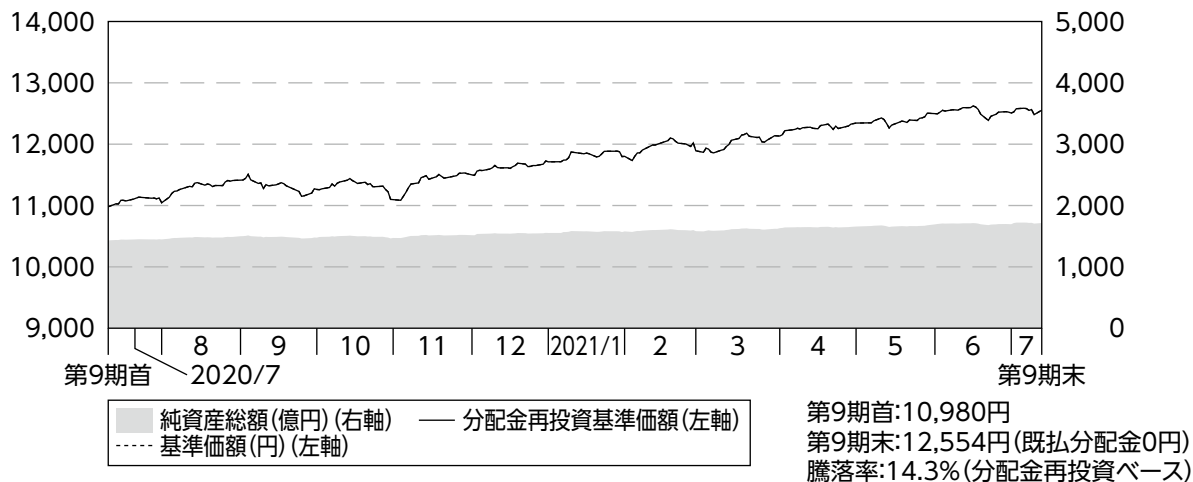
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2020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	投資資産等※	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	7.9%	30.0%
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	国内株式	2.1%	13.5%
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	23.0%	0.2%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	21.2%	43.8%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	先進国株式	6.3%	23.8%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	4.4%	4.4%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	2.9%	28.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	0.5%	6.7%
J-REITインデックス マザーファンド	国内リート	1.1%	36.4%
グローバルREITインデックス マザーファンド	海外リート	1.0%	46.2%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	テールリスクヘッジ	8.9%	△1.5%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	テールリスクヘッジ	4.7%	△10.5%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド	2.0%	11.4%
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	5.2%	2.3%
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	テールリスクヘッジ	5.0%	19.1%
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド	3.0%	5.1%

※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。

(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。

○国内株式市場

期初から2021年3月にかけては、新型コロナウイルスワクチン開発の進展や各国による追加経済対策に対する期待を背景に上昇基調で推移しました。その後期末にかけては、国内での新型コロナウイルスのワクチン接種進展が期待された一方で新規感染者数の増加や緊急事態宣言発出を受けた国内景気の先行き懸念も高まり、上値の重い展開となりました。

○国内債券市場

期初から2021年2月下旬にかけては、米国で追加経済支援策が早期に成立するとの観測が高まり米国長期金利が上昇したことに加え、日銀が長期金利の操作幅を拡大するとの見方が強まったことを受け、利回りは上昇しました。3月以降は、米国長期金利が低下に転じたことやその後期末にかけては、国内での新型コロナウイルスのワクチン接種進展が期待された一方で新規感染者数の増加や緊急事態宣言発出を受けた国内景気の先行き懸念も高まり、利回りは低下しました。

○先進国株式市場

期初から各国の大規模な財政出動や金融緩和政策による景気回復への期待に加え、新型コロナウイルスワクチン開発の進展などを背景に上昇基調で推移しました。米欧各国での新型コロナウイルスの新規感染者数増加や米長期金利の急上昇への警戒感などから上昇幅を縮小する場面も見られましたが、ワクチン接種の進展や良好な経済指標などが支えとなり、期末まで堅調な推移が続きしました。

○先進国債券市場

主要国の長期金利は、期初には各国の中央銀行が大規模な金融緩和政策を展開したことなどを受け概ね低位で推移する場面も見られましたが、その後、2021年3月にかけては、新型コロナウイルスワクチン開発の進展や米国などでの大規模財政出動のための国債増発による債券需給悪化懸念が高まったほか、インフレ率の上昇を織り込む形で主要国の利回りは上昇しました。4月以降は、FRB(米連邦準備理事会)高官から金融緩和の長期化を示唆する発言が続いたことなどから、利回りは低下しました。

外国為替市場では、米ドルは、米長期金利の上昇による日米金利差の拡大を材料に、対円で上昇しました。ユーロや英ポンドは、2021年5月末にかけて、欧州での景気回復期待の高まりなどを背景に対円で上昇した後、6月以降は、米ドル買い戻しの流れの影響から、それまでの上昇幅を縮小しました。

○新興国株式市場

期初から2021年2月中旬にかけては、新型コロナウイルスのワクチン普及に伴う経済正常化への期待が世界的に高まったことや、中国の堅調な経済指標が好感されたことなどから大幅に上昇しました。2月下旬から当期末にかけては、米長期金利の上昇を受けて市場の警戒感が広がったことや、インドなどでの新型コロナウイルスの感染再拡大が嫌気されたことなどから軟調に推移しました。

○新興国債券市場

期初から2020年12月末にかけて、新型コロナウイルス感染拡大による景気減速懸念が高まった一方、欧米の株高などを背景としたリスク選好の動きから、新興国債券市場に資金の流入が続き、利回りは低下しました。2021年1月から3月末にかけては、米国の長期金利の上昇が続く中、新型コロナウイルスに対するワクチンの普及による世界経済の正常化期待やインフレ懸念から、利回りは上昇しました。4月以降、利回りはレンジ内で推移しました。

○国内リート市場

当期初から2020年10月末にかけては、世界的な新型コロナウイルスの感染拡大や、大型オフィス銘柄の国内リート市場設立来最大規模の公募増資による短期的な需給悪化懸念などにより、国内リート市場は上値の重い展開となりました。10月末から期末にかけては、新型コロナウイルスの感染拡大が嫌気される局面もありましたが、利回り水準で見た国内リートの割安感が拡大する中、各国の強力な金融・財政政策のサポートや新型コロナウイルスワクチン接種への期待などを受けた世界的なリスクオンなどの動きなどにより、国内リート市場は上昇する展開となりました。

○海外リート市場

新型コロナウイルスワクチン接種の進展や米国で大型経済対策が成立したことなどをを受けて景気回復期待が高まり、海外リート市場は2021年3月にかけて上昇しました。その後も、ISM(米供給管理協会)製造業景況指数やユーロ圏製造業PMI(購買担当者指数)など主要国の良好なマクロ経済指標が好感されたことなどから堅調な展開となりました。

○コモディティ市場

商品市場は、各国中央銀行による大規模な金融緩和政策や新型コロナウイルスワクチンの実用化、米国の追加経済対策成立などをを受けて景気回復と商品需要拡大への期待が高まり、エネルギーセクター、穀物セクターをはじめとして全般的に上昇しました。金は、概ね横ばいとなりました。期初は米国で追加経済対策が実施されるとの観測などから大きく上昇しましたが、2021年に入り米国の財政支出拡大による国債増発懸念を受けた長期金利の上昇や米ドル高などを背景に下落しました。期末にかけては、主に米国でのインフレ率の動向やFRBによる今後の利上げ観測などをにらみ、方向感を欠く展開となりました。

○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。

・国内債券インデックス マザーファンド

投資割合の見直しなどに伴い買付を行い、当期末時点における組入比率は23.0%となりました。

・ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

投資割合の見直しなどに伴い売却を行い、当期末時点における組入比率は2.0%となりました。

・外国株式インデックス マザーファンド

投資割合の見直しなどに伴い買付を行い、当期末時点における組入比率は21.2%となりました。

・外国債券インデックス マザーファンド

投資割合の見直しなどに伴い売却を行い、当期末時点における組入比率は4.4%となりました。

・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伴い売却を行い、当期末時点における組入比率は7.9%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
国内債券インデックス マザーファンド	10.2%	23.0%	+12.8%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	11.9%	2.0%	△9.8%
外国株式インデックス マザーファンド	11.5%	21.2%	+9.7%
外国債券インデックス マザーファンド	13.0%	4.4%	△8.6%
国内株式インデックス マザーファンド	15.3%	7.9%	△7.5%
J-REITインデックス マザーファンド	7.1%	1.1%	△6.0%
グローバルREITインデックス マザーファンド	6.4%	1.0%	△5.4%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	—	4.7%	+4.7%
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	1.0%	5.0%	+4.0%
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)	2.1%	5.2%	+3.1%
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	3.3%	6.3%	+3.0%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6.1%	8.9%	+2.8%
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	0.8%	3.0%	+2.2%
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	1.8%	—	△1.8%
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	3.6%	2.1%	△1.5%
FOFs用 KIM 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)	1.0%	—	△1.0%
新興国債券インデックス マザーファンド	1.4%	0.5%	△0.9%
新興国株式インデックス マザーファンド	2.6%	2.9%	+0.3%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

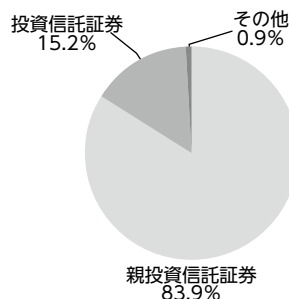
当ファンドの組入資産の内容

○組入上位ファンド

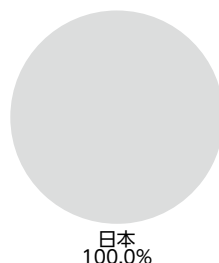
順位	ファンド名	当期末
		2021年7月12日
1	国内債券インデックス マザーファンド	23.0%
2	外国株式インデックス マザーファンド	21.2%
3	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	8.9%
4	国内株式インデックス マザーファンド	7.9%
5	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	6.3%
6	FOFs用ピクテマルチストラテジーリンクファンド(適格機関投資家専用)	5.2%
7	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	5.0%
8	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	4.7%
9	外国債券インデックス マザーファンド	4.4%
10	マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	3.0%
組入ファンド数		16

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

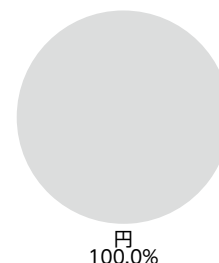
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

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

分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第9期	
	2020年7月11日～2021年7月12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)	2,553	

(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、75%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		項目の概要
	(2020年7月11日~2021年7月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	130円	1.106%	(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11,767円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(78)	(0.664)	
(販売会社)	(46)	(0.387)	
(受託会社)	(7)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.002)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.019	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(2)	(0.017)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	132	1.130	

(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。

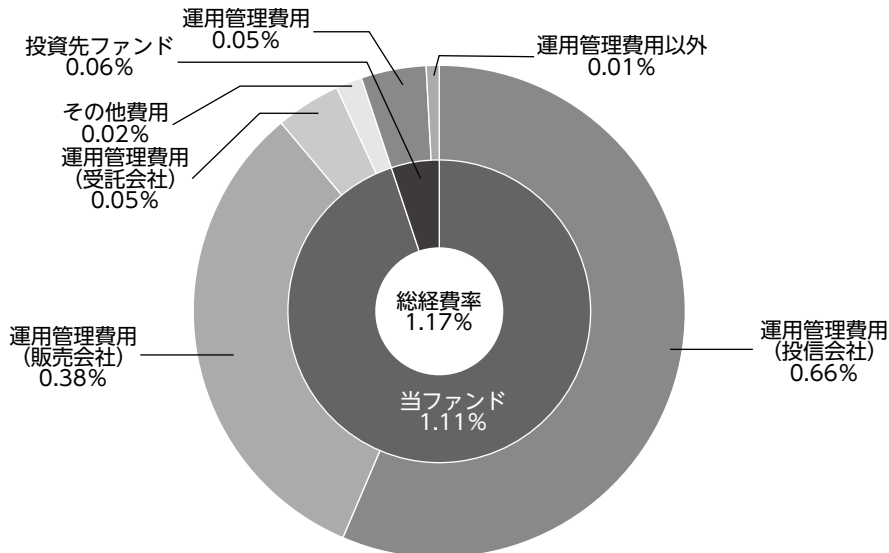
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(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>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.17%です。



総経費率(①+②+③)	1.17%
①当ファンドの費用の比率	1.11%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.05%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.01%

(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8)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	ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・ 為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	284,272	342,430	13,384,645	14,424,585
	マルチストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	3,838,512	3,834,800	—	—
内	FOFs用 KIM 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)	—	—	1,503,751	1,541,995
	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)	5,390,256	5,800,230	—	—
	FOFs用 MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	6,134,920	5,917,230	—	—

(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	42,686	75,610	5,311,125	9,340,000
グローバルREITインデックス マザーファンド	135,369	220,210	5,266,923	8,700,000
新興国株式インデックス マザーファンド	149,377	477,540	101,839	300,000
国内株式インデックス マザーファンド	269,283	464,190	8,238,848	12,915,000
外国株式インデックス マザーファンド	4,930,300	14,119,360	1,660,685	5,800,000
国内債券インデックス マザーファンド	17,505,009	24,668,820	—	—
外国債券インデックス マザーファンド	342,696	1,037,090	4,211,556	12,550,000
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	372,162	100,000	10,219,094	2,864,412
新興国債券インデックス マザーファンド	12,459	20,790	722,792	1,200,000
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	5,224,407	6,880,950	—	—
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	189,404	191,050	2,064,485	2,150,000
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	3,424,436	4,130,820	—	—
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	8,997,719	8,886,080	—	—

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	20,087,272千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	82,732,482千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.24

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<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	219,378,713千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	390,939,366千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.56

(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	84,856,894千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	446,109,255千円
(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。

<日本株式最小分散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	5,401,087千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	4,954,083千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.09

(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。

<外国株式最小分散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	16,490,106千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,914,508千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.03

(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	15,894	15,894	100.0	15,966	15,966	100.0
金 銭 信 託	0.103779	0.103779	100.0	0.103779	0.103779	100.0
コール・ローン	716,319	5,412	0.8	715,800	5,644	0.8

(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。

<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	0.127193	0.127193	100.0	0.127193	0.127193	100.0
コール・ローン	607,190	10,517	1.7	606,357	10,759	1.8

<平均保有割合 3.5%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<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	6,346	—	—	33,115	16	0.0
金 銭 信 託	0.000955	0.000955	100.0	0.000955	0.000955	100.0
コール・ローン	47,880	305	0.6	47,875	308	0.6

<平均保有割合 4.0%>

(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。

<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	%
金 銭 信 託	0.083362	0.083362	100.0	0.083362	0.083362	100.0
コール・ローン	31,340	326	1.0	31,307	326	1.0

<平均保有割合 5.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

<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	0.159183	0.159183	100.0	0.159183	0.159183	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	823,183	11,488	1.4	822,407	11,711	1.4

<平均保有割合 3.8%>

(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。

<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	34,055	—	—	77,838	34	0.0
金 銭 信 託	0.039161	0.039161	100.0	0.039161	0.039161	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	176,457	2,254	1.3	183,511	3,980	2.2

<平均保有割合 6.5%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	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	0.056937	0.056937	100.0	0.056937	0.056937	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	291,939	3,758	1.3	292,299	3,902	1.3

<平均保有割合 5.3%>

(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。

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	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	34,377	376	1.1	21,774	119	0.5
金 銭 信 託	0.155211	0.155211	100.0	0.155211	0.155211	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	831,231	14,054	1.7	830,711	14,412	1.7

<平均保有割合 3.2%>

(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・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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.007363	百万円 0.007363	% 100.0	百万円 0.007363	百万円 0.007363	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	58,346	1,000	1.7	58,303	1,031	1.8

<平均保有割合 12.7%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.011725	百万円 0.011725	% 100.0	百万円 0.011725	百万円 0.011725	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	166,165	2,226	1.3	165,718	2,245	1.4

<平均保有割合 1.8%>

(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。

<ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.005240	百万円 0.005240	% 100.0	百万円 0.005240	百万円 0.005240	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	38,210	554	1.4	38,126	548	1.4

<平均保有割合 39.6%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<日本株式最小分散インデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.006547	百万円 0.006547	% 100.0	百万円 0.006547	百万円 0.006547	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	27,920	440	1.6	27,911	452	1.6

<平均保有割合 75.9%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式最小分散インデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 7,246	百万円 7,246	% 100.0	百万円 5,477	百万円 5,477	% 100.0
金 銭 信 託	0.000255	0.000255	100.0	0.000255	0.000255	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	19,475	15	0.1	19,476	16	0.1

<平均保有割合 50.4%>

(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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.011066	百万円 0.011066	% 100.0	百万円 0.011066	百万円 0.011066	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	101,066	366	0.4	100,180	275	0.3

<平均保有割合 42.5%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式インデックス マザーファンド>

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	340百万円	146百万円	1,164百万円

(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
	千口	千円	%
ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	2,971,680	3,500,639	2.0
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	5,027,202	5,118,697	3.0
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)	8,217,875	8,848,186	5.2
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	7,613,682	8,568,438	5.0
合 計	23,830,440	26,035,961	15.2

(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	6,092,076	823,636	1,887,528
グローバルREITインデックス マザーファンド	5,898,622	767,067	1,747,916
新興国株式インデックス マザーファンド	1,279,448	1,326,986	4,931,878
国内株式インデックス マザーファンド	15,115,390	7,145,826	13,479,887
外国株式インデックス マザーファンド	6,081,166	9,350,780	36,326,847
国内債券インデックス マザーファンド	10,388,137	27,893,146	39,415,806
外国債券インデックス マザーファンド	6,316,052	2,447,192	7,530,500
グローバル・コモディティ(米ドル建て) マザーファンド	9,846,932	—	—
新興国債券インデックス マザーファンド	1,192,669	482,336	849,780
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	6,802,087	12,026,495	15,206,300
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	5,001,224	3,126,143	3,613,196
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	4,075,161	7,499,598	10,887,916
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	—	8,997,719	8,053,858

(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	49,323,843千口	外国債券インデックス マザーファンド	100,722,788千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	41,364,083千口	新興国債券インデックス マザーファンド	40,865,028千口
新興国株式インデックス マザーファンド	26,523,301千口	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	28,562,552千口
国内株式インデックス マザーファンド	251,095,419千口	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	4,074,360千口
外国株式インデックス マザーファンド	137,442,391千口	外国株式最小分散インデックスマザーファンド	13,765,562千口
国内債券インデックス マザーファンド	451,320,574千口	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	21,125,701千口

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	26,035,961	15.1
J-R E I Tインデックス マザーファンド	1,887,528	1.1
グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	1,747,916	1.0
新興国株式インデックス マザーファンド	4,931,878	2.9
国内株式インデックス マザーファンド	13,479,887	7.8
外国株式インデックス マザーファンド	36,326,847	21.0
国内債券インデックス マザーファンド	39,415,806	22.8
外国債券インデックス マザーファンド	7,530,500	4.4
新興国債券インデックス マザーファンド	849,780	0.5
ゴールドマザーファンド（為替ヘッジあり）	15,206,300	8.8
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	3,613,196	2.1
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	10,887,916	6.3
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	8,053,858	4.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,648,924	1.5
投 資 信 託 財 産 総 額	172,616,297	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(94,272,386千円)の投資信託財産総額(94,310,203千円)に対する比率は100.0%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(98,547,734千円)の投資信託財産総額(98,809,387千円)に対する比率は99.7%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(533,853,092千円)の投資信託財産総額(534,342,816千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) 外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(306,417,105千円)の投資信託財産総額(310,041,821千円)に対する比率は98.8%です。

(注5) 新興国債券インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(71,089,711千円)の投資信託財産総額(72,291,581千円)に対する比率は98.3%です。

(注6) ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)において、当期末における外貨建純資産(35,725,685千円)の投資信託財産総額(36,120,015千円)に対する比率は98.9%です。

(注7) 外国株式最小分散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(19,982,355千円)の投資信託財産総額(19,984,227千円)に対する比率は100.0%です。

(注8) 外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=110.17円

1ブラジルレアル=20.9442円

1ペルーヌエボソル=27.7565円

1ユーロ=130.82円

1スウェーデンクローナ=12.85円

1トルコリラ=12.7324円

1ポーランドズロチ=28.7664円

1ニュージーランドドル=76.99円

1マレーシアリンギット=26.3269円

1インドネシアルピア=0.0076円

1インドルピー=1.49円

1カタールリアル=30.03円

1サウジアラビアリアル=29.42円

1カナダドル=88.44円

1チリペソ=0.147175円

1ウルグアイペソ=2.5123円

1イギリスポンド=153.11円

1ノルウェークローネ=12.69円

1チェココルナ=5.08円

1ロシアルーブル=1.48円

1香港ドル=14.18円

1タイバーツ=3.37円

1韓国ウォン=0.0962円

1イスラエルシェケル=33.6225円

1南アフリカランド=7.72円

1クウェート・ディナール=367.23円

1メキシコペソ=5.5418円

1コロンビアペソ=0.028739円

1ドミニカペソ=1.938円

1スイスフラン=120.51円

1デンマーククローネ=17.59円

1ハンガリーフォリント=0.367804円

1オーストラリアドル=82.37円

1シンガポールドル=81.53円

1フィリピンペソ=2.2003円

1新台幣ドル=3.9285円

1パキスタンルピー=0.70円

1アラブ首長国連邦ディルハム=29.95円

1香港・オフショア人民元=17.0001円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項	目	当 期 末 2021年7月12日現在
(A) 資産		172,616,297,151円
	コール・ローン等	2,648,918,734
	投資信託受益証券(評価額)	26,035,961,567
	J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	1,887,528,871
	グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	1,747,916,347
	新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,931,878,698
	国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	13,479,887,139
	外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	36,326,847,327
	国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	39,415,806,001
	外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,530,500,124
	新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	849,780,042
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)(評価額)	15,206,300,398
	日本株式最小分散インデックスマザーファンド(評価額)	3,613,196,530
	外国株式最小分散インデックスマザーファンド(評価額)	10,887,916,541
	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)	8,053,858,832
(B) 負債		1,150,071,037
	未払解約金	244,208,892
	未払信託報酬	904,661,365
	未払利息	4,042
	その他未払費用	1,196,738
(C) 純資産総額(A-B)		171,466,226,114
	元本	136,583,457,227
	次期繰越損益金	34,882,768,887
(D) 受益権総口数		136,583,457,227口
	1万口当たり基準価額(C/D)	12,554円

■ 損益の状況

項 目	当 期
	自 2020年7月11日 至 2021年7月12日
(A) 配当等収益	50,715,019円
受取配当金	51,788,865
受取利息	7,096
支払利息	△1,080,942
(B) 有価証券売買損益	21,701,765,197
売買益	23,810,249,057
売買損	△2,108,483,860
(C) 信託報酬等	△1,737,649,094
(D) 当期損益金 (A+B+C)	20,014,831,122
(E) 前期繰越損益金	549,003,766
(F) 追加信託差損益金	14,318,933,999
(配当等相当額)	(9,906,328,871)
(売買損益相当額)	(4,412,605,128)
(G) 計 (D+E+F)	34,882,768,887
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金 (G+H)	34,882,768,887
追加信託差損益金	14,318,933,999
(配当等相当額)	(9,916,783,224)
(売買損益相当額)	(4,402,150,775)
分配準備積立金	20,563,834,888

(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130,381,111,649円、期中追加設定元本額は17,432,745,205円、期中一部解約元本額は11,230,399,627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)		1,781,811,259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)		15,383,662,849円
(C)	収益調整金額		14,318,933,999円
(D)	分配準備積立金額		3,398,360,780円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		34,882,768,887円
(F)	期末残存口数		136,583,457,227口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		2,553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追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2020年10月10日)

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:2021年4月10日)

組入投資信託証券の内容

■ヘッジファンド・リターン・ターゲットファンド・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	BNPパリバ・アセットマネジメント株式会社
運 用 方 針	当ファンドはヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンドへの投資を通じて、その主な投資対象(海外の上場先物、為替取引など)の組み合わせに拠り、ヘッジファンドの代表的指数であるHFRI総合指数(HFRI Weighted Composite Index)を参照し、ヘッジファンドの過去の平均リターンと類似の投資収益となるような投資成果を目指します。 当ファンドは、原則として対円での為替ヘッジを行います。
主 要 運 用 対 象	主として、ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンドの受益証券を投資対象とします。
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。

●損益の状況

項 目	第 8 期 自 2019年8月16日 至 2020年8月17日
(A) 配 当 等 収 益	△265,520円
支 払 利 息	△265,520
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,310,313,674
売 買 益	3,766,246,532
売 買 損	△2,455,932,858
(C) 信 託 報 酬 等	△238,941,327
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	1,071,106,827
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△329,965,469
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金 (配当等相当額)	1,954,901,707 (1,304,492,285)
(売買損益相当額)	(650,409,422)
(G) 計 (D+E+F)	2,696,043,065
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	2,696,043,065
追 加 信 託 差 損 益 金 (配当等相当額)	1,954,901,707 (1,310,905,205)
(売買損益相当額)	(643,996,502)
分 配 準 備 積 立 金	741,141,358

●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
ヘッジファンド・リターン・ターゲットマザーファンド	千口 23,734,885	千口 19,927,427	千円 33,854,706

下記は、ヘッジファンド・リターン・ターゲット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		利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
銘 柄 名					
国債証券					
第916回国庫短期証券		—	3,000,000	3,005,620	2021/6/21
第126回利付国債(5年)		0.1	10,000,000	10,007,650	2020/12/20
合 計			13,000,000	13,013,271	

<外国投資信託証券>

銘 柄	第 7 期 末		第 8 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		
ISHARES JP MORGAN EM BOND FD	207,332	550,495	62,382	6,646,812	
SPDR GOLD TRUST	32,835	54,241	9,901	1,054,967	
合 計	口 数 ・ 金 額	240,167	604,736	72,283	7,701,779
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<22.6%>

(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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別		第 8 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外	EMINI S&P	4,387	—
	DAX INDEX FU	447	—
	MINI MSCI EM	1,765	—
	RUSSELL2000M	5,238	—
国	SWISS MKT IX	—	2,982
	FTSE 100 IDX	203	—
	US10YR NOTE	—	2,179

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

組入投資信託証券の内容

■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
運用方針	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンドへの投資を通じて、主としてゴールドマン・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(SPC)の発行する円建債券に投資し、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」(以下「PTR ディバーシファイド・アルファ・ファンド」*といたします。)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。 ※PTR ディバーシファイド・アルファ・ファンドは、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です。
主要運用対象	ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンドの受益証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。

●損益の状況

項目	第 5 期 自 2019年10月11日 至 2020年10月12日
(A)配当等収益	△4,643円
受取利息	39
支払利息	△4,682
(B)有価証券売買損益	720,914,331
売買益	741,850,274
売買損	△20,935,943
(C)信託報酬等	△8,018,997
(D)当期損益金(A+B+C)	712,890,691
(E)前期繰越損益金	112,867,782
(F)追加信託差損益金	668,150,007
(配当等相当額)	(569,541,023)
(売買損益相当額)	(98,608,984)
(G)計(D+E+F)	1,493,908,480
(H)収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,493,908,480
追加信託差損益金	668,150,007
(配当等相当額)	(569,492,033)
(売買損益相当額)	(98,657,974)
分配準備積立金	826,020,008
繰越損益金	△261,535

●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
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	10,808,347	17,430,129	18,873,344

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		5	期		未	
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)						
S I G N U M	G E N E V A	1 0 % 1 2 / 1 5 / 2 5	0	33,768,000	37,198,491	2025/12/15
合		計		33,768,000	37,198,491	

組入投資信託証券の内容

■ FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド 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
運 用 方 針	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として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) の発行する円建債券に投資し、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」(以下「MAN AHL ファンド」*といたします。)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。 *MAN AHL ファンドは、主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券です。
主 要 運 用 対 象	MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンドの受益証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。

● 損益の状況

項 目	第 5 期 自 2019年10月11日 至 2020年10月12日
(A)配 当 等 收 益	△15,657円
受 取 利 息	23
支 払 利 息	△15,680
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△65,358,271
売 買 益	70,629,952
売 買 損	△135,988,223
(C)信 託 報 酬 等	△3,518,555
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	△68,892,483
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△22,571,460
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△360,394,290
(配 当 等 相 当 額)	(△36,244)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△360,358,046)
(G)計 (D+E+F)	△451,858,233
(H)收 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△451,858,233
追 加 信 託 差 損 益 金	△360,394,290
(配 当 等 相 当 額)	(△54,588)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△360,339,702)
繰 越 損 益 金	△91,463,943

● 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	評 価 額
	千口		千円	
MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド	6,005,520		8,647,301	8,310,057

下記は、MAN AHL ダイバーシファイド 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		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)							
STAR	HELIOS	0% 02/12/26	0	15,450,000	14,383,934	2026/2/12	
合		計		15,450,000	14,383,934		

組入投資信託証券の内容

■マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
運用方針	主としてわが国を含む世界の株式及び債券に投資するとともに、有価証券先物取引、有価証券指数先物取引、オプション取引、スワップ取引(トータル・リターン・スワップ取引を含みます。)、金利先渡取引、為替先渡取引、直物為替先渡取引、クレジットデリバティブ取引(以下、「デリバティブ取引」といいます。))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。なお、主要投資対象及び主要取引対象への投資は、投資信託証券を通じて行うことがあります。 ポートフォリオの構築は、複数の運用戦略を組み合わせることで行い、信用取引による株式の売付や債券の空売りをを用いる運用戦略を含みます。
主要運用対象	わが国を含む世界の株式及び債券を主要投資対象とし、デリバティブ取引及び為替予約取引を主要取引対象とします。
組入制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。))への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 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。

●損益の状況

項目	第 8 期 自 2020年2月8日 至 2021年2月8日
(A)配当等収益	261,068,083円
受取配当金	267,646,083
受取利息	96,169
その他の収益	440,094
支払利息	△7,114,263
(B)有価証券売買損益	3,140,335,628
売買益	10,196,302,451
売買損	△7,055,966,823
(C)先物取引等取引損益	△1,304,466,475
取引益	4,249,150,969
取引損	△5,553,617,444
(D)信託報酬等	△530,894,200
(E)当期損益金(A+B+C+D)	1,566,043,036
(F)前期繰越損益金	△713,558,315
(G)追加信託差損益金	△315,546,736
(配当等相当額)	(144,270,949)
(売買損益相当額)	(△459,817,685)
(H)計(E+F+G)	536,937,985
(I)収益分配金	△534,745,352
次期繰越損益金(H+I)	2,192,633
追加信託差損益金	△315,546,736
(配当等相当額)	(152,017,463)
(売買損益相当額)	(△467,564,199)
分配準備積立金	450,857,856
繰越損益金	△133,118,487

●組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第7期末	第8期	第8期	第8期
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額	評価額
水産・農林業(一%)				
日本水産	36	—	—	—
鉱業(0.4%)				
日鉄鉱業	0.8	—	—	—
国際石油開発帝石	282.3	60.7	42,368	—
石油資源開発	9.4	3.9	9,141	—
建設業(3.9%)				
ミライト・ホールディングス	47.8	—	—	—
安藤・間	21	8.1	6,439	—
大成建設	—	6.8	25,772	—
大林組	70.7	37.7	35,626	—
飛鳥建設	9.6	11.4	13,372	—
鹿島建設	—	1.7	2,589	—
不動テトラ	0.9	—	—	—
西松建設	20	20.2	52,358	—
大豊建設	3.3	—	—	—
前田建設工業	—	15.5	14,988	—
浅沼組	—	0.9	4,104	—
熊谷組	8.4	6.3	17,784	—
NIPPPO	11.1	—	—	—
日本道路	2	2.2	16,566	—
東洋建設	5.2	—	—	—
福田組	0.4	0.5	2,615	—
大和ハウス工業	32.1	26.5	85,250	—
積水ハウス	—	12.6	26,642	—
ユアテック	9.6	10.1	8,605	—
関電工	46.2	51.7	47,719	—
きんでん	11.4	6.1	11,132	—
東京エネシス	2.3	2.4	2,296	—
協和エクシオ	17.3	28.7	83,459	—
九電工	1.9	14.8	52,688	—
日揮ホールディングス	20.2	—	—	—
食料品(3.1%)				
ニッポン	4.3	1.8	2,953	—
日清製粉グループ本社	40.4	—	—	—
日本甜菜製糖	8.3	5.8	9,854	—
三井製糖	—	1.4	2,770	—
森永乳業	—	3.9	19,890	—
明治ホールディングス	1.5	—	—	—
雪印メグミルク	3.8	3.3	7,863	—
日本ハム	—	8.9	41,652	—
丸大食品	5.8	6.1	10,797	—
アサヒグループホールディングス	—	3.1	13,760	—
キリンホールディングス	9	15.2	34,390	—
宝ホールディングス	—	15.2	21,508	—
コカ・コーラ ボトラーズ	7.5	—	—	—
ジャパンホールディングス	—	—	—	—
サントリー食品インターナショナル	—	3.6	13,698	—
日ドールグループホールディングス	0.5	—	—	—
日清オイリオグループ	4.8	3.3	10,378	—
J-オイルミルズ	3.7	2.6	9,906	—
味の素	6.5	23.3	53,508	—
ハウス食品グループ本社	—	8.6	34,056	—
アリアケジャパン	—	1.4	10,038	—
ニチレイ	28.2	5.7	16,854	—
日本たばこ産業	35.8	35.5	76,360	—

銘柄	第7期末	第8期	第8期	第8期
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額	評価額
わらべや日洋ホールディングス	5.3	6.9	11,847	—
繊維製品(0.1%)				
グンゼ	1.5	1	3,870	—
アツギ	14	10.6	5,437	—
T S Iホールディングス	9.1	17.5	5,057	—
三陽商会	7.7	—	—	—
パルプ・紙(0.1%)				
王子ホールディングス	10.1	—	—	—
日本製紙	15.1	5.8	8,537	—
北越コーポレーション	11.7	15.6	7,300	—
中越パルプ工業	2.1	—	—	—
レンゴー	428.1	—	—	—
化学(7.5%)				
旭化成	2.6	—	—	—
住友化学	—	128.2	65,766	—
日本曹達	20	8.9	29,815	—
東亜合成	14.5	—	—	—
信越化学工業	42.8	12.6	227,745	—
日本酸素ホールディングス	—	11.3	23,289	—
日本化学工業	2.7	2.2	6,677	—
保土谷化学工業	8.9	—	—	—
日本触媒	17.2	—	—	—
カネカ	6.7	7.3	29,163	—
三菱瓦斯化学	59.2	—	—	—
J S R	34.1	—	—	—
東京応化工業	—	21.2	152,216	—
三菱ケミカルホールディングス	—	39.6	29,565	—
ダイセル	—	15.7	13,156	—
住友ベークライト	8	—	—	—
積水化学工業	1	—	—	—
扶桑化学工業	37	32.3	117,087	—
トリケミカル研究所	10	16.4	67,896	—
ADEKA	9.5	18.5	34,558	—
D I C	4.6	4.3	11,859	—
東洋インキS Cホールディングス	—	7.3	14,096	—
富士フイルムホールディングス	13.8	15.2	93,768	—
ライオン	6.2	4.5	10,656	—
高砂香料工業	2.6	2.7	7,055	—
マンダム	6.2	—	—	—
ポーラ・オルビスホールディングス	—	12.8	27,776	—
長谷川香料	7.9	—	—	—
荒川化学工業	1.2	1.3	1,678	—
メック	30	—	—	—
アキレス	—	2.3	3,496	—
医薬品(3.0%)				
協和キリン	18.6	4.7	14,969	—
武田薬品工業	6.5	26	94,744	—
アステラス製薬	76	73.1	134,211	—
大日本住友製薬	3.9	—	—	—
塩野義製薬	1.6	—	—	—
中外製薬	0.8	—	—	—
エーザイ	1.9	1	7,813	—
キッセイ薬品工業	7.4	8.6	20,218	—
第一三共	—	7.7	24,832	—
キョーリン製薬ホールディングス	8.7	—	—	—
大塚ホールディングス	24	17.4	82,528	—

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
大正製薬ホールディングス	0.5	0.5	3,570	
石油・石炭製品(0.7%)				
ニチレキ	12	6.6	10,329	
出光興産	—	3.7	9,571	
ENEOSホールディングス	132.3	105.1	46,601	
コスモエネルギーホールディングス	—	10.8	25,639	
ゴム製品(0.2%)				
TOYO TIRE	14.5	3.6	6,566	
ブリヂストン	—	4.1	16,978	
住友理工	—	3.3	2,253	
ガラス・土石製品(1.5%)				
AGC	—	1.9	7,134	
日本山村硝子	2.8	1.9	1,732	
日本電気硝子	7.7	7.1	17,409	
太平洋セメント	1.7	5.7	16,051	
東洋炭素	—	5.5	11,258	
TOTO	—	0.6	4,350	
日本碍子	120	67.9	129,756	
フジインコーポレーテッド	10.1	—	—	
鉄鋼(0.6%)				
日本製鉄	52.3	6.3	9,254	
神戸製鋼所	46.8	42	26,544	
合同製鐵	5.9	—	—	
ジェイエフイーホールディングス	—	30.3	32,663	
共英製鋼	3.6	—	—	
日立金属	—	2.7	4,698	
非鉄金属(1.9%)				
三井金属鉱業	—	2.6	10,348	
三菱マテリアル	10.8	11.5	29,049	
住友金属鉱山	34.4	26	130,130	
DOWAホールディングス	7.7	—	—	
古河電気工業	—	6.5	18,954	
住友電気工業	22	34.2	54,685	
リョービ	1.2	—	—	
アーレスティ	21	16.8	6,854	
金属製品(0.5%)				
東洋製鋼グループホールディングス	6.7	16.1	21,702	
ホッカンホールディングス	8	6.9	10,287	
横河ブリッジホールディングス	0.5	—	—	
三和ホールディングス	24.9	—	—	
文化シヤッター	2.9	—	—	
三協立山	5	5.3	4,616	
LIXIL	—	6.9	19,906	
ジーテクト	6.5	8.1	12,781	
機械(7.6%)				
日本製鋼所	—	52	166,140	
芝浦機械	—	8.9	24,911	
アマダ	25.8	—	—	
牧野フライス製作所	10	—	—	
NITTOKU	10	—	—	
ヒラノテクシード	—	28	68,236	
平田機工	—	11	91,300	
ナブテスコ	10	—	—	
三井海洋開発	—	4.8	10,041	
SMC	2.8	1.9	123,234	
日精エー・エス・ビー機械	75.9	3.2	19,392	
小松製作所	26.1	—	—	
住友重機械工業	—	10.1	31,865	
クボタ	—	19.3	48,732	
新東工業	7.2	7.6	6,019	
ダイキン工業	2.7	—	—	

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
栗田工業	—	8.2	34,317	
ダイフク	5	10.4	115,960	
CKD	—	9.7	23,250	
平和	4.8	—	—	
SANKYO	—	6.3	19,152	
竹内製作所	—	18.4	47,416	
大和冷機工業	4.7	3.6	4,089	
セガサミーホールディングス	24.3	—	—	
TPR	1	5.6	8,836	
日本精工	—	12.7	13,347	
ジェイテクト	12	22.3	25,199	
不二越	—	3.9	17,101	
日本トムソン	100.3	33.6	17,068	
THK	10	—	—	
イーグル工業	—	6.6	7,979	
マキタ	—	3.6	17,892	
日立造船	26.4	21.8	14,213	
三菱重工業	12.9	—	—	
IHI	11.5	4.6	9,650	
スター精密	—	8	13,304	
電気機器(18.3%)				
日清紡ホールディングス	4.8	—	—	
イビデン	1.9	—	—	
コニカミノルタ	44.1	68.9	37,826	
日立製作所	37.3	21.9	109,434	
三菱電機	65	43.4	74,843	
富士電機	10.6	15.5	67,580	
明電舎	—	9.2	22,503	
山洋電気	—	4	25,720	
日本電産	5.5	9.8	139,258	
ダイヘン	23	4.7	23,359	
JVCケンウッド	91	67.6	13,925	
大崎電気工業	8.7	9.1	5,669	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	11.5	—	—	
日本電気	10.3	10	63,200	
富士通	3.6	4.3	69,122	
沖電気工業	2.4	—	—	
ルネサスエレクトロニクス	—	46.8	56,300	
セイコーエプソン	—	11.4	21,238	
ワコム	—	145.5	129,640	
日本信号	3.8	—	—	
パナソニック	25.4	22.3	32,312	
ソニー	13	14	169,330	
TDK	—	4.3	68,069	
アルプスアルパイン	—	20.5	30,524	
メイコー	—	46	90,206	
マクセルホールディングス	3.1	7.8	11,450	
アズビル	34.3	3.8	19,228	
キーエンス	—	0.4	22,700	
シスメックス	21.4	3.1	36,843	
イリソ電子工業	—	9.2	47,380	
レーザータック	—	6.5	88,140	
スタンレー電気	—	37.4	131,648	
日本セラミック	17	6	18,180	
日本電子	44	—	—	
ファナック	—	1.9	53,684	
芝浦電子	—	8	26,440	
ローム	8.4	5.5	61,655	
新光電気工業	—	18.3	49,483	
京セラ	3.6	3.2	22,176	
村田製作所	67.1	25.9	245,221	

銘柄	第7期末		第8期末		評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	
ニチコン	15.5	6.8			9,669
リコー	88.9	33.2			31,208
東京エレクトロン	1.8	5.9			242,785
輸送用機器(5.3%)					
ユニプレス	—	6.5			7,293
豊田自動織機	—	2.1			20,013
デンソー	—	4.2			28,219
東海理化電機製作所	9.5	—			—
川崎重工業	—	7.7			18,518
日産自動車	97.1	74.1			46,653
いすゞ自動車	29.4	12.6			14,464
トヨタ自動車	49.8	41			329,517
三菱自動車工業	—	91.2			28,363
新明和工業	11.5	6.2			6,007
トビー工業	2	—			—
ティラド	3.6	1.3			2,073
タチエス	—	1.9			2,276
NOK	—	14.4			20,448
プレス工業	5.8	11.8			4,212
太平洋工業	25.4	3			3,747
アイシン精機	3.7	—			—
マツダ	32.2	36.3			35,065
本田技研工業	33.7	26.7			80,447
スズキ	15.7	2.7			13,440
SUBARU	23.6	10.8			22,863
エクセディ	—	4.6			7,645
ヨロズ	5.6	—			—
エフ・シー・シー	13.9	—			—
精密機器(0.8%)					
日本エム・ディ・エム	142.2	—			—
インターアクション	64	9.4			23,970
東京精密	12.9	1.9			8,664
ニコン	—	50.7			45,579
エー・アンド・デイ	—	21.3			28,158
朝日インテック	59.5	—			—
その他製品(1.7%)					
トランザクション	204.2	—			—
フルヤ金属	—	7.1			49,132
パイロットコーポレーション	—	1.6			5,160
タカラトミー	—	4.9			4,699
凸版印刷	2.6	37.3			60,426
大日本印刷	16.3	—			—
リンテック	—	2.2			5,315
任天堂	0.4	1.3			82,485
コクヨ	—	8.1			11,769
美津濃	4.5	—			—
電気・ガス業(2.0%)					
中部電力	30.9	55.4			74,762
関西電力	39.2	32.5			34,775
北陸電力	33.9	24.3			17,058
東北電力	67.1	6.6			6,184
四国電力	12.5	24.5			18,595
九州電力	—	26.3			24,800
北海道電力	44.9	27.9			13,113
電源開発	13.2	13.5			23,692
東京瓦斯	—	3.3			7,660
大阪瓦斯	17.5	16.6			33,498
静岡ガス	6.9	—			—
陸運業(1.2%)					
SBSホールディングス	—	4.2			10,626
東日本旅客鉄道	8.6	2.8			21,534

銘柄	第7期末		第8期末		評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	
西日本旅客鉄道	2.1	—			—
東海旅客鉄道	2.7	—			—
日本通運	4	4.3			33,196
丸全昭和運輸	4.8	3			10,680
セコーグループホールディングス	39	39.5			40,092
ニッコンホールディングス	4.1	2.8			6,370
日立物流	13.6	8			27,440
海運業(0.3%)					
日本郵船	17.5	11.1			32,745
商船三井	3.1	—			—
空運業(-%)					
日本航空	27.8	—			—
倉庫・運輸関連業(-%)					
日新	2.2	—			—
日本コンセプト	62	—			—
情報・通信業(13.1%)					
NECネットエスアイ	—	3.3			6,583
日鉄ソリューションズ	—	5.7			20,064
ラクーンホールディングス	—	160			318,720
グリリー	—	29			17,835
コエーテックモホールディングス	21.3	10.9			68,561
ネクソン	—	3.1			10,757
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	12.2	6.1			16,000
GMOペイメントゲートウェイ	29.6	11.5			176,985
マークラインズ	71.9	—			—
Ubicomホールディングス	—	4.8			15,552
チェンジ	—	14.2			51,617
ユーザーローカル	—	16			67,200
野村総合研究所	—	5			17,750
フジ・メディア・ホールディングス	49.2	17.7			23,487
Zホールディングス	—	49.9			33,283
トレンドマイクロ	4.1	9.5			57,095
日本オラクル	5.5	—			—
フューチャー	—	8			15,632
伊藤忠テクノソリューションズ	18.1	21.9			81,030
大塚商会	1.6	—			—
日本ユニシス	—	5.5			19,552
TBSホールディングス	15.6	13.6			30,178
日本テレビホールディングス	20	17.9			25,525
テレビ朝日ホールディングス	12.9	14.7			31,869
スカパーJ SATホールディングス	11.5	25.1			12,449
日本電信電話	66.4	66			183,909
KDDI	52.7	25.7			85,760
ソフトバンク	23.9	24.2			34,327
NTTドコモ	16.9	—			—
GMOインターネット	—	4.4			14,300
KADOKAWA	5	1.8			7,002
エヌ・ティ・ティ・データ	21.5	24.2			40,583
S C S K	27.3	—			—
コナミホールディングス	—	1			7,350
ソフトバンクグループ	74.5	21.7			205,824
卸売業(4.8%)					
東京エレクトロン デバイス	—	5.1			18,538
双日	89.9	—			—
アルフレッサ ホールディングス	12.4	—			—
バイタルケースケー・ホールディングス	14.1	6.7			5,587
佐島電機	4.7	1.9			1,447
三菱食品	10.8	9.8			28,469
メディバルホールディングス	7.4	2.6			5,818
萩原電気ホールディングス	—	34			95,166
日本ライフライン	52	11.5			16,939

銘柄	第7期末		第8期末		評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	
I DOM	—	23.3	—	23.3	15,471
シークス	—	10	—	10	16,470
伊藤忠商事	81.4	17.3	—	17.3	53,647
九紅	71	35.3	—	35.3	26,256
豊田通商	—	2.2	—	2.2	10,362
三井物産	45.7	39.8	—	39.8	79,998
日立ハイテク	7.9	—	—	—	—
住友商事	—	14.9	—	14.9	22,193
三菱商事	23.8	28.1	—	28.1	79,747
キャンマーケティングジャパン	17.3	8	—	8	19,784
岩谷産業	—	1	—	1	6,460
東邦ホールディングス	8.2	8.3	—	8.3	17,355
日鉄物産	—	3	—	3	11,595
トラスコ中山	49	—	—	—	—
ミスミグループ本社	39	25.4	—	25.4	91,440
スズケン	3.8	—	—	—	—
小売業(7.3%)					
カワチ薬品	5.5	4.1	—	4.1	12,464
ゲオホールディングス	9.7	—	—	—	—
アダストリア	12.8	12.9	—	12.9	27,412
エディオン	14.4	12.3	—	12.3	13,333
アルペン	5.9	5.3	—	5.3	11,972
D CMホールディングス	70.2	61.4	—	61.4	66,680
MonotaRO	27.3	21.4	—	21.4	122,836
マツモトキヨシホールディングス	—	6.1	—	6.1	28,182
三越伊勢丹ホールディングス	36	45.9	—	45.9	33,966
オイシックス・ラ・大地	—	4	—	4	12,420
セブン&アイ・ホールディングス	20.5	38.7	—	38.7	164,397
クスリのアオキホールディングス	27.8	—	—	—	—
コジマ	95.8	—	—	—	—
コーナン商事	7.4	4.1	—	4.1	12,201
バン・バンフィック・インター ナショナルホールディングス	37.7	7.9	—	7.9	19,434
サイゼリヤ	—	8.9	—	8.9	19,188
葉王堂ホールディングス	—	5	—	5	13,460
ファミリーマート	23.7	—	—	—	—
日本瓦斯	107.8	20	—	20	105,000
島忠	8.7	—	—	—	—
MrMaxHD	—	5.6	—	5.6	4,390
AOKIホールディングス	—	21.1	—	21.1	13,419
コメリ	6.2	3.3	—	3.3	9,523
青山商事	8.4	19.7	—	19.7	14,361
しまむら	—	3.9	—	3.9	45,513
高島屋	21	13.2	—	13.2	14,493
エイチ・ツー・オー リテイリング	21.4	14.9	—	14.9	12,411
イズミ	—	5.7	—	5.7	23,085
平和堂	—	2.5	—	2.5	5,530
ゼビオホールディングス	13.1	14.8	—	14.8	14,208
ヤマダホールディングス	15.4	119.4	—	119.4	65,670
アークランドサカモト	10.1	2.8	—	2.8	4,354
ニトリホールディングス	4.5	—	—	—	—
サンドラッグ	—	10.9	—	10.9	47,742
銀行業(4.1%)					
西日本フィナンシャルホールディングス	7.5	—	—	—	—
あおぞら銀行	11.8	25.1	—	25.1	53,588
三菱UFJフィナンシャル・グループ	227.9	207.4	—	207.4	107,765
三井住友フィナンシャルグループ	77.7	68.6	—	68.6	244,902
武蔵野銀行	1.7	—	—	—	—
千葉興業銀行	25.6	26.7	—	26.7	6,888
十六銀行	3.2	6	—	6	11,970
八十二銀行	1.6	20.7	—	20.7	7,659
北國銀行	—	1.4	—	1.4	3,698
南都銀行	—	2.9	—	2.9	5,234

銘柄	第7期末		第8期末		評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	
ほくほくフィナンシャルグループ	—	5	—	5	6,958
広島銀行	—	19.2	—	19.2	—
百十四銀行	—	1.4	—	1.4	—
みずほフィナンシャルグループ	614.7	50.1	—	50.1	76,627
山口フィナンシャルグループ	—	35.8	—	35.8	9,158
北洋銀行	—	25	—	25	—
トモニホールディングス	—	4.7	—	4.7	—
証券・商品先物取引業(1.2%)					
SBIホールディングス	—	—	—	39.8	115,022
野村ホールディングス	—	—	—	75.8	45,684
保険業(1.0%)					
MS&ADインシュアランス グループホールディングス	—	—	—	7.3	23,360
ソニーフィナンシャルホールディングス	—	23.9	—	23.9	—
第一生命ホールディングス	—	59.6	—	59.6	30,227
東京海上ホールディングス	—	—	—	6.5	35,912
T&Dホールディングス	—	—	—	28.6	40,783
その他金融業(0.2%)					
イオンフィナンシャルサービス	—	96.7	—	96.7	—
オリックス	111.6	16.4	—	16.4	30,192
不動産業(2.1%)					
野村不動産ホールディングス	—	21.3	—	21.3	66,066
オープンハウス	—	—	—	25	111,750
東急不動産ホールディングス	—	—	—	38.5	25,140
飯田グループホールディングス	—	19	—	11.2	27,921
パーク24	—	8	—	8	—
三井不動産	—	10.7	—	10.7	—
三菱地所	—	—	—	8.5	15,555
東京建物	—	—	—	10.1	16,129
ゴールドクレスト	—	0.5	—	0.5	6,317
サービス業(5.5%)					
ミクシィ	—	—	—	5	12,585
日本M&Aセンター	—	—	—	1	6,060
アイティメディア	—	—	—	8	17,936
エス・エム・エス	—	31.6	—	31.6	57,532
総合警備保障	—	5.9	—	5.9	—
エムスリー	—	102.6	—	102.6	124,070
アウトソーシング	—	—	—	5.5	8,206
電通グループ	—	8.3	—	8.3	29,055
シーティーエス	—	316.3	—	316.3	30,909
H. U. グループホールディングス	—	—	—	9	27,990
りらいあコミュニケーションズ	—	34.9	—	34.9	64,485
ユー・エス・エス	—	—	—	33.2	72,210
サイバーエージェント	—	—	—	4	26,840
山田コンサルティンググループ	—	119	—	119	—
テクノプロ・ホールディングス	—	7.4	—	7.4	52,000
リクルートホールディングス	—	4	—	4	13,944
日本郵政	—	41.8	—	41.8	41,561
リロググループ	—	120.8	—	120.8	—
共立メンテナンス	—	—	—	2.8	10,962
カナモト	—	—	—	1.3	3,134
セコム	—	1.1	—	1.1	16,392
メイテック	—	10	—	10	56,459
応用地質	—	—	—	1.6	2,110
イオンディライト	—	2.6	—	2.6	—
ダイセキ	—	—	—	12	41,040
合計					
株数・金額	8,701	5,806	12,939	372	
銘柄数<比率>	302	337	<29.5%>		

(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。

<国内投資信託受益証券、投資証券>

銘	柄	第 7 期 末	第 8 期 末	
		口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額 (千円)
	Japan Small Cap Fund—Class A JPY	20	9	185,796
	Japan Small Cap Fund—Class B JPY	46	46	1,486,009
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	66	56	1,671,805
		2	2	<3.8%>

(注) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘	柄	第 7 期 末	第 8 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 GOLD SHARES ETF	183	53	9,058
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	183	53	9,058
		1	1	<2.2%>

(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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	第 8 期 末	
			買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内	TOPIX		848	9,100
外国	S&P 500 EMIN		757	—
	DAX INDEX FU		757	—
	US 10YR NOTE		—	1,543

(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。

<親投資信託残高>

	第 7 期 末	第 8 期 末	
	口 数 千口	口 数 千口	評 価 額 千円
日本株式リサーチ・マーケット・ニュートラル マザーファンド	11,950,247	8,494,347	9,646,181
先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり	1,000	1,000	1,028
外国株式最小分散インデックスマザーファンド	7,568,647	3,798,414	4,779,164

下記は、日本株式リサーチ・マーケット・ニュートラル 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7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
鉱業 (0.9%)				
国際石油開発帝石	—	250.5	174,849	
建設業 (5.1%)				
コムシスホールディングス	142.6	54.6	186,732	
大成建設	103.6	54.9	208,071	
大林組	343.1	101.4	95,823	
大和ハウス工業	171.1	74.7	240,309	
協和エクシオ	—	64.5	187,566	
日揮ホールディングス	130.3	98.7	132,850	
食料品 (0.9%)				
ヤクルト本社	49.2	—	—	
明治ホールディングス	45.3	16.4	121,196	
アリアケジャパン	20.4	8.4	60,228	
化学 (7.2%)				
信越化学工業	61.8	34.2	618,165	
三菱ケミカルホールディングス	492.8	—	—	
花王	61.5	34.5	259,336	
資生堂	90.8	53.9	419,773	
ファンケル	—	45.6	178,752	
コーセー	12.2	—	—	
タカラバイオ	49.1	—	—	
医薬品 (4.2%)				
協和キリン	217.9	22.6	71,981	
中外製薬	—	15.8	84,703	
第一三共	162.2	177.2	571,470	
ペプチドリーム	37.8	19.9	129,549	
石油・石炭製品 (—%)				
コスモエネルギーホールディングス	98.5	—	—	
ガラス・土石製品 (3.3%)				
太平洋セメント	61.6	—	—	
TOTO	63.6	53.9	390,775	
日本碍子	—	148.6	283,974	
鉄鋼 (0.5%)				
日本製鉄	—	71.8	105,474	
非鉄金属 (2.5%)				
住友金属鉱山	60.7	62.9	314,814	
住友電気工業	—	125.5	200,674	
金属製品 (0.9%)				
SUMCO	172.7	79.2	179,308	
機械 (7.8%)				
日本製鋼所	192.3	59.6	190,422	
ディスコ	15.7	4.7	159,565	
SMC	10.4	5.3	343,758	

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
小松製作所	59.4	—	—	
ダイキン工業	26.8	15.5	362,235	
ダイフク	115.9	38.6	430,390	
THK	95.3	30.2	107,059	
電気機器 (23.8%)				
イビデン	135.3	54.7	266,662	
日立製作所	92.2	—	—	
明電舎	—	50.1	122,544	
日本電産	42.4	25.6	363,776	
オムロン	—	35	339,500	
アンリツ	296.3	146.3	368,090	
ソニー	163.2	77.8	940,991	
アドバンテスト	—	13.8	121,992	
キーエンス	27.1	11.9	675,325	
シスメックス	25.5	17.6	209,176	
ファナック	21.7	13.6	384,268	
ローム	19.7	—	—	
太陽誘電	66.3	30.4	178,448	
村田製作所	78.4	49.9	472,453	
東京エレクトロン	26.2	10.6	436,190	
輸送用機器 (11.1%)				
豊田自動織機	76.1	26.8	255,404	
デンソー	76.5	41	275,479	
川崎重工業	—	141.6	340,548	
トヨタ自動車	142.1	101.2	813,344	
アイシン精機	—	77.2	277,920	
スズキ	35.5	19	94,582	
シマノ	15.2	8.3	203,806	
精密機器 (2.0%)				
HOYA	53.2	22.8	297,882	
朝日インテック	—	35.7	118,881	
その他製品 (1.4%)				
ヤマハ	58.7	29.8	189,528	
ビジョン	51	23.3	104,500	
情報・通信業 (4.9%)				
GMOペイメントゲートウェイ	18.9	10.5	161,595	
ALBERT	20	—	—	
チェンジ	—	23.9	86,876	
野村総合研究所	331.1	116.4	413,220	
伊藤忠テクノソリューションズ	105.8	53	196,100	
ネットワンシステムズ	76.7	—	—	
日本電信電話	103.3	54.4	151,585	
エヌ・ティ・ティ・データ	479.6	—	—	

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ソフトバンクグループ	105.5	—	—	—
卸売業(2.7%)				
三菱商事	219.6	127.7	362,412	
ミスミグループ本社	—	53.2	191,520	
小売業(5.0%)				
マツモトキヨシホールディングス	76.1	37	170,940	
コスモス薬品	7	6.3	105,336	
良品計画	92.3	68.2	172,750	
バン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	—	74.7	183,762	
ニトリホールディングス	16.7	7	144,235	
ファーストリテイリング	4.1	2.7	252,801	
銀行業(5.0%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,591.1	957.8	497,672	
三井住友フィナンシャルグループ	242.9	145.7	520,149	
証券、商品先物取引業(1.5%)				
野村ホールディングス	—	522.9	315,151	
保険業(2.4%)				
第一生命ホールディングス	225	153.1	277,111	
東京海上ホールディングス	—	36.6	202,215	
不動産業(1.0%)				
三井不動産	230.9	87.8	211,334	
サービス業(5.9%)				
日本M&Aセンター	81.6	39.1	236,946	
エムスリー	79.5	33.1	285,189	
オリエンタルランド	—	11.6	206,828	
リクルートホールディングス	166.4	93.7	466,626	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,941 70	5,604 76	20,473,456 <88.4%>

(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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	第8期末	
	買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
国内 T O P I X	—	20,918

下記は、先進国ハイインカム入替戦略マザーファンド 為替ヘッジあり全体の内容です。

<外国(外貨建)公社債>

銘柄	第 8		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) 国債証券 T 1.25% 05/15/50	1.25	千米ドル 11,500	千米ドル 9,623	1,015,628	2050/5/15
(カナダ) 国債証券 CAN 3.5% 12/01/45	3.5	千カナダドル 8,900	千カナダドル 12,536	1,036,543	2045/12/1
(フランス) 国債証券 FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	千ユーロ 7,900	千ユーロ 8,288	1,052,747	2040/5/25
(ベルギー) 国債証券 BGB 0.4% 06/22/40	0.4	8,100	8,314	1,056,126	2040/6/22
(オーストリア) 国債証券 RAGB 0.75% 03/20/51 RAGB 0.85% 06/30/20	0.75 0.85	4,450 400	5,064 464	643,247 59,047	2051/3/20 2120/6/30
(アイルランド) 国債証券 IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	9,300	11,696	1,485,667	2037/5/15
ユ ー ロ 計				4,296,837	
(スウェーデン) 国債証券 SGB 0.125% 05/12/31	0.125	千スウェーデン クローナ 134,400	千スウェーデン クローナ 134,240	1,690,082	2031/5/12
(ノルウェー) 国債証券 NGB 1.375% 08/19/30 NGB 1.75% 09/06/29 NGB 2% 04/26/28	1.375 1.75 2.0	千ノルウェー クローネ 150,600 102,600 98,900	千ノルウェー クローネ 153,048 107,854 105,694	1,891,682 1,333,077 1,306,383	2030/8/19 2029/9/6 2028/4/26
小 計				4,531,143	
(オーストラリア) 国債証券 ACGB 1% 11/21/31 ACGB 3.25% 06/21/39	1.0 3.25	千オーストラリア ドル 13,700 11,000	千オーストラリア ドル 13,310 13,319	1,077,496 1,078,192	2031/11/21 2039/6/21
小 計				2,155,689	

第		8		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)		
(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 2.125% 06/01/26	2.125	33,800	36,401	2,879,365	2026/6/1	
	SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	10,000	11,216	887,185	2028/5/1	
	SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	10,000	11,514	910,765	2029/7/1	
小 計					4,677,316		
(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 1.5% 05/31/37	1.5	40,300	40,116	1,286,945	2037/5/31	
	ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	19,600	26,682	855,966	2047/3/31	
小 計					2,142,911		
合 計					21,546,152		

(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。

下記は、外国株式最小分散インデックスマザーファンド全体の内容です。

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	第7期末	第8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	22	36	448	47,333	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	13	20	254	26,851	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	34	20	341	35,992	保険
ALLSTATE CORP	61	103	1,104	116,612	保険
AMERICAN ELECTRIC POWER	38	—	—	—	公益事業
AFLAC	79	—	—	—	保険
PINNACLE WEST CAPITAL	30	16	132	13,938	公益事業
AMEREN CORPORATION	39	66	495	52,288	公益事業
AUTOZONE INC	2	4	522	55,128	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	10	51	1,205	127,221	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	40	67	523	55,214	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	3	5	138	14,595	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	209	356	1,969	207,878	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	58	15	105	11,088	保険
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	3	210	22,186	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	79	—	—	—	消費者サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	28	49	298	31,543	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORPORATION	4	7	103	10,906	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CABOT OIL & GAS CORP	18	38	68	7,196	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	37	60	287	30,374	食品・飲料・タバコ
CHURCH & DWIGHT CO INC	43	72	603	63,724	家庭用品・パーソナル用品
CLOROX COMPANY	16	27	518	54,720	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	160	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	48	81	647	68,312	家庭用品・パーソナル用品
AON PLC	15	—	—	—	保険
CONSOLIDATED EDISON INC	116	194	1,392	146,975	公益事業
CMS ENERGY CORP	32	54	313	33,050	公益事業
DANAHER CORP	23	37	884	93,340	ヘルスケア機器・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	4	19	374	39,505	小売
REPUBLIC SERVICES INC	94	142	1,297	136,955	商業・専門サービス
DTE ENERGY COMPANY	8	—	—	—	公益事業
DUKE ENERGY CORP	68	114	1,082	114,196	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	9	—	—	—	消費者サービス
EXXON MOBIL	31	—	—	—	エネルギー
NEXTERA ENERGY INC	50	283	2,368	250,021	公益事業
GENERAL MILLS INC	26	44	256	27,091	食品・飲料・タバコ
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	11	19	351	37,125	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	49	82	1,208	127,583	食品・飲料・タバコ
JUNIPER NETWORKS INC	39	62	152	16,110	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOME DEPOT	4	8	226	23,897	小売
HORMEL FOODS CORP	123	189	930	98,238	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	2	3	141	14,891	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	第7期末		第8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)	
JOHNSON & JOHNSON	75	126	2,087	220,352	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KELLOGG CO	52	88	513	54,183	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	20	35	463	48,878	家庭用品・パーソナル用品
KROGER CO	—	465	1,543	162,893	食品・生活必需品小売り
LILLY (ELI) & CO	53	90	1,822	192,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	1	1	65	6,865	資本財
DOMINION ENERGY INC	51	85	630	66,571	公益事業
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	24	80	727	76,824	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	48	80	1,710	180,495	消費者サービス
EVEREST RE GROUP LTD	6	11	244	25,841	保険
MARKEL CORP	2	4	488	51,522	保険
MARSH & MCLENNAN COS	54	90	1,028	108,527	保険
MEDTRONIC PLC	45	75	894	94,369	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	87	176	1,338	141,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	39	65	1,194	126,087	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWMONT CORPORATION	332	348	2,068	218,341	素材
NVR INC	0.35	—	—	—	耐久消費財・アパレル
EVERSOURCE ENERGY	9	13	121	12,843	公益事業
ORACLE CORP	46	129	826	87,193	ソフトウェア・サービス
PFIZER	164	275	961	101,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALTRIA GROUP INC	57	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BROWN & BROWN INC	12	20	89	9,450	保険
PROCTER & GAMBLE CO	55	92	1,197	126,410	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	14	77	680	71,830	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	15	26	424	44,853	保険
US BANCORP	14	—	—	—	銀行
ROLLINS INC	—	35	132	13,993	商業・専門サービス
ACCENTURE PLC-CL A	28	47	1,200	126,728	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	5	8	119	12,641	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	41	69	924	97,605	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	2	3	114	12,032	ヘルスケア機器・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	3	—	—	—	小売
SOUTHERN CO	123	206	1,259	132,958	公益事業
AT&T INC	168	283	819	86,511	電気通信サービス
STRYKER CORP	19	16	400	42,287	ヘルスケア機器・サービス
SYSCO CORP	39	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TYLER TECHNOLOGIES INC	9	25	1,087	114,762	ソフトウェア・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	8	14	478	50,482	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
WALMART INC	47	105	1,519	160,402	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	83	139	1,590	167,838	商業・専門サービス
JM SMUCKER CO	25	43	495	52,331	食品・飲料・タバコ
WEC ENERGY GROUP INC	91	153	1,332	140,624	公益事業
TJX COMPANIES INC	61	—	—	—	小売
DOMINO'S PIZZA INC	—	13	518	54,702	消費者サービス

銘柄	第7期末		第8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)	
MASTERCARD INC-CLASS A	1	2	90	9,545	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	178	263	604	63,767	ソフトウェア・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	34	58	841	88,819	ソフトウェア・サービス
WABCO HOLDINGS INC	9	—	—	—	資本財
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	17	—	—	—	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	61	103	2,156	227,628	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	3	84	8,963	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	30	52	427	45,138	ソフトウェア・サービス
DOLLAR GENERAL CORP	19	73	1,416	149,531	小売
PALO ALTO NETWORKS INC	6	9	358	37,884	ソフトウェア・サービス
SPRINT CORP	79	—	—	—	電気通信サービス
BLACK KNIGHT INC	62	100	862	91,015	ソフトウェア・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	26	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	2	—	—	—	小売
EVERGY INC	16	25	137	14,494	公益事業
AMCOR PLC	107	167	191	20,252	素材
AON PLC	—	25	575	60,734	保険
FNF GROUP	41	—	—	—	保険
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	95	1,367	144,306	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	34	—	—	—	電気通信サービス
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	8	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	—	3	112	11,822	ヘルスケア機器・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	77	129	1,285	135,695	商業・専門サービス
CHENIERE ENERGY INC	14	13	88	9,382	エネルギー
AMAZON.COM	—	1	489	51,652	小売
ADOBE INC	—	38	1,889	199,443	ソフトウェア・サービス
AMGEN	2	4	109	11,547	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN ELECTRIC POWER	—	64	527	55,706	公益事業
COMCAST CORP-CL A	19	30	158	16,700	メディア・娯楽
AUTOMATIC DATA PROCESS	31	52	881	93,022	ソフトウェア・サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	13	49	443	46,758	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	46	964	101,827	メディア・娯楽
VERISIGN INC	9	15	307	32,407	ソフトウェア・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	25	41	496	52,358	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	55	75	990	104,509	ソフトウェア・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6	—	—	—	保険
CISCO SYSTEMS	—	119	575	60,729	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	35	59	443	46,791	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	18	30	325	34,385	小売
ELECTRONIC ARTS INC	—	57	817	86,296	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2	16	418	44,194	保険
FISERV INC	47	80	898	94,785	ソフトウェア・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	—	222	1,523	160,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
F5 NETWORKS INC	3	6	122	12,967	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	第7期末		第8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)	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	32	49	750	79,173	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	—	32	297	31,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	—	81	935	98,730	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	—	77	782	82,574	メディア・娯楽
MICROSOFT CORP	—	4	118	12,525	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC	138	231	1,470	155,153	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2	3	151	16,038	小売
PAYCHEX INC	94	157	1,444	152,428	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	90	149	2,102	221,859	食品・飲料・タバコ
REGENERON PHARMACEUTICALS	—	31	1,564	165,096	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEAGEN INC	—	11	217	22,933	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	36	—	—	—	保険
ROSS STORES INC	12	—	—	—	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	8	15	86	9,165	食品・飲料・タバコ
STARBUCKS CORP	34	57	609	64,292	消費者サービス
NORTONLIFELOCK INC	—	85	179	18,961	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	—	24	414	43,742	半導体・半導体製造装置
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	—	99	2,136	225,526	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CME GROUP INC	8	14	273	28,844	各種金融
ALLIANT ENERGY CORPORATION	20	35	174	18,424	公益事業
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	4	230	24,374	各種金融
MASIMO CORP	—	12	316	33,404	ヘルスケア機器・サービス
T-MOBILE US INC	38	108	1,355	143,049	電気通信サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	7	327	34,541	ソフトウェア・サービス
SABRE CORP	19	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	—	43	77	8,147	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CDK GLOBAL INC	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	137	—	—	—	食品・生活必需品小売り
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	60	118	683	72,107	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	93	142	364	38,500	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12	21	193	20,369	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	5,811 136	9,754 133	94,320 —	9,954,624 <62.2%>
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	99	154	1,398	115,590	素材
BARRICK GOLD CORP	747	695	1,983	163,964	素材
BCE INC	63	96	532	44,066	電気通信サービス
CGI INC - CL A	33	56	576	47,672	ソフトウェア・サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	91	151	897	74,201	電気通信サービス
OPEN TEXT CORP	11	18	116	9,617	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	89	295	798	66,033	電気通信サービス
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	6	10	471	38,979	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	68	—	—	—	メディア・娯楽
KINROSS GOLD CORP	521	804	746	61,689	素材
INTACT FINANCIAL CORP	30	50	744	61,573	保険

銘柄		第7期末	第8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)	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		187	286	1,487	123,018	素材
FRANCO-NEVADA CORP		78	121	1,884	155,775	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		83	140	687	56,873	素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,113	2,882	12,325	1,019,056	
		14	13	—	<6.4%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MERCK KGAA		11	19	278	35,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAP SE		17	29	315	40,097	ソフトウェア・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		20	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
BEIERSDORF AG		18	30	285	36,265	家庭用品・パーソナル用品
DEUTSCHE TELEKOM		748	1,212	1,826	232,030	電気通信サービス
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		389	629	143	18,180	電気通信サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		30	52	259	32,919	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,237	1,974	3,108	394,866	
		8	6	—	<2.5%>	
(イタリア)						
ENI		119	—	—	—	エネルギー
DIASORIN SPA		—	16	286	36,398	ヘルスケア機器・サービス
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL		—	102	92	11,731	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	119	118	378	48,130	
		1	2	—	<0.3%>	
(フランス)						
ORANGE		635	1,064	1,047	133,115	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		3	5	479	60,857	耐久消費財・アパレル
SODEXO		11	—	—	—	消費者サービス
ILIAD SA		—	3	51	6,542	電気通信サービス
GETLINK		91	—	—	—	運輸
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	742	1,073	1,578	200,516	
		4	3	—	<1.3%>	
(オランダ)						
KONINKLIJKE AHOLD NV		111	181	424	53,866	食品・生活必需品小売り
QIAGEN N. V.		—	61	278	35,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOPAK		—	25	106	13,543	エネルギー
KPN (KON.)		850	1,439	385	48,913	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	961	1,707	1,194	151,740	
		2	4	—	<0.9%>	
(スペイン)						
TELEFONICA		138	247	93	11,928	電気通信サービス
INDITEX		70	119	312	39,722	小売
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		23	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AENA SME SA		8	—	—	—	運輸
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	240	366	406	51,650	
		4	2	—	<0.3%>	

銘柄	株数 (百株)	第7期末	第8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)	
(ベルギー)						
UCB (GROUPE)	36	60	535	67,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	22	35	180	22,958	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	14	20	172	21,949	各種金融	
PROXIMUS	63	97	168	21,437	電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	21	—	—	—	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	157 5	213 4	1,057 —	134,331 <0.8%>	
(フィンランド)						
SAMPO OYJ-A SHS	16	—	—	—	保険	
ELISA A	59	91	442	56,160	電気通信サービス	
NOKIA OYJ	490	684	245	31,132	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	566 3	775 2	687 —	87,292 <0.5%>	
(アイルランド)						
KERRY GROUP PLC-A	20	33	385	49,016	食品・飲料・タバコ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	20 1	33 1	385 —	49,016 <0.3%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,046 28	6,263 24	8,798 —	1,117,544 <7.0%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
COMPASS GROUP PLC	146	—	—	—	消費者サービス	
GLAXOSMITHKLINE	122	198	251	36,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ASTRAZENECA	16	27	202	29,389	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
OCADO GROUP PLC	—	22	61	8,954	小売	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	101	—	—	—	保険	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	387 4	248 3	515 —	74,780 <0.5%>	
(スイス)			千スイスフラン			
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.57	0.96	194	22,849	食品・飲料・タバコ	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.18	0.26	209	24,601	食品・飲料・タバコ	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.04	0.07	598	70,174	食品・飲料・タバコ	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	—	4	385	45,215	素材	
SWISS PRIME SITE-REG	6	10	90	10,568	不動産	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	—	8	210	24,701	資本財	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	10	106	12,485	銀行	
SGS SA	1	2	582	68,279	商業・専門サービス	
SWISSCOM	10	16	790	92,729	電気通信サービス	
GIVAUDAN-REG	1	2	754	88,515	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	7	7	294	34,520	保険	
NOVARTIS	115	193	1,573	184,526	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ROCHE HOLDING GENUSS	37	63	1,953	229,005	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NESTLE SA - REGISTERED	118	180	1,813	212,684	食品・飲料・タバコ	
SONOVA HOLDING AG-REG	8	13	306	35,908	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	15	26	532	62,441	運輸	

銘柄	第7期末		第8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)	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG SWISS RE LTD	— 82	51 —	516 —	60,565 —	テクノロジー・ハードウェアおよび機器 保険
小計	406	593	10,914	1,279,773	
	銘柄数 <比率>	14	17	—	<8.0%>
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ERICSSON (LM) B	175	280	3,118	39,260	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA CO AB	397	635	2,300	28,962	電気通信サービス
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	29	—	—	—	電気通信サービス
小計	602	915	5,418	68,222	
	銘柄数 <比率>	3	2	—	<0.4%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
TELENOR ASA	302	447	6,476	80,045	電気通信サービス
小計	302	447	6,476	80,045	
	銘柄数 <比率>	1	1	—	<0.5%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
NOVO NORDISK A/S-B	54	182	8,053	137,555	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S	24	41	1,052	17,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B	47	76	7,696	131,452	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S	52	77	1,507	25,752	保険
CHR HANSEN HOLDING A/S	5	9	514	8,781	素材
小計	183	387	18,824	321,524	
	銘柄数 <比率>	5	5	—	<2.0%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
TELSTRA CORP	838	1,423	448	36,301	電気通信サービス
CSL LIMITED	4	7	204	16,530	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP	489	—	—	—	運輸
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	152	264	130	10,568	保険
NEWCREST MINING LIMITED	323	522	1,298	105,134	素材
SONIC HEALTHCARE LTD	158	267	934	75,683	ヘルスケア機器・サービス
WESFARMERS LTD	151	254	1,417	114,754	小売
WOOLWORTHS GROUP LTD	63	101	416	33,748	食品・生活必需品小売り
CROWN RESORTS LTD	138	—	—	—	消費者サービス
小計	2,320	2,841	4,851	392,721	
	銘柄数 <比率>	9	7	—	<2.5%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	111	—	—	—	運輸
RYMAN HEALTHCARE LTD	51	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	74	247	18,845	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	509	815	387	29,431	電気通信サービス
小計	671	889	635	48,277	
	銘柄数 <比率>	3	2	—	<0.3%>
(香港)			千香港ドル		
BANK EAST ASIA	—	830	1,430	19,474	銀行
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	—	21	1,085	14,776	各種金融

銘柄	第7期末		第8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	645	990	4,405	59,958	運輸
HANG SENG BANK	252	490	6,874	93,564	銀行
HONG KONG & CHINA GAS	—	881	960	13,069	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	745	2,365	5,415	73,709	銀行
NWS HOLDINGS LTD	680	—	—	—	資本財
PCCW LTD	1,870	2,730	1,206	16,422	電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	280	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	215	370	1,962	26,714	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,687 7	8,677 8	23,342 —	317,691 <2.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	132	330	124	9,866	資本財
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	266	—	—	—	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	336	510	500	39,614	各種金融
OCBC BANK	—	125	128	10,184	銀行
SINGAPORE AIRLINES	225	351	146	11,577	運輸
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	2,811	4,698	1,094	86,585	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,770 5	6,014 5	1,995 —	157,829 <1.0%>
(イスラエル)			千イスラエルシェケル		
NICE LTD	8	13	1,245	39,958	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	42	—	—	—	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	50 2	13 1	1,245 —	39,958 <0.2%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	25,353 231	39,928 221	— —	14,872,050 <93.0%>

(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。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	第 7 期 末		第 8 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		邦貨換算金額 (千円)
			外 貨 建 金 額	外 貨 建 金 額	
(アメリカ)			千米ドル		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	61	—	—	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3	—	—	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	3	—	—	—	—
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6	—	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	2	4	750	—	79,168
ESSEX PROPERTY TRUST	0.86	—	—	—	—
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	6	—	—	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.973	—	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	14	—	—	—	—
WELLTOWER INC	3	—	—	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	11	—	—	—	—
REGENCY CENTERS CORP	2	—	—	—	—
UDR INC	6	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP	0.897	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	3	5	1,227	—	129,542
VENTAS INC	3	—	—	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	3	5	682	—	72,014
AGNC INVESTMENT CORP	23	—	—	—	—
AMERICAN TOWER CORPORATION	0.706	1	277	—	29,237
WP CAREY INC	0.927	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	160	17	2,936	309,962
	銘柄数 <比率>	21	4	—	<1.9%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	7	42	2,845	—	38,727
HKT TRUST AND HKT LTD	157	243	2,541	—	34,593
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	170	1,295	—	17,630
小 計	口 数 ・ 金 額	164	455	6,682	90,951
	銘柄数 <比率>	2	3	—	<0.6%>
合 計	口 数 ・ 金 額	324	472	—	400,914
	銘柄数 <比率>	23	7	—	<2.5%>

(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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	第 8 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 S&P 500 EMIN	389	—
S&P/TSE 60	176	—

(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。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2021年5月31日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式組入比率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	162,440
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	462,835

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式組入比率
	騰落率	期中騰落率	騰落率	期中騰落率	
(当期首) 2020年 5月29日	円	%		%	%
	14,762	—	1,563.67	—	97.0
6月末	14,738	△0.2	1,558.77	△0.3	98.7
7月末	14,145	△4.2	1,496.06	△4.3	98.8
8月末	15,300	3.6	1,618.18	3.5	99.0
9月末	15,498	5.0	1,625.49	4.0	98.2
10月末	15,059	2.0	1,579.33	1.0	98.4
11月末	16,740	13.4	1,754.92	12.2	98.1
12月末	17,238	16.8	1,804.68	15.4	99.2
2021年 1月末	17,277	17.0	1,808.78	15.7	99.0
2月末	17,815	20.7	1,864.49	19.2	99.4
3月末	18,831	27.6	1,954.00	25.0	98.4
4月末	18,299	24.0	1,898.24	21.4	98.5
(当期末) 2021年 5月31日	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5

(注1)騰落率は期首比です。

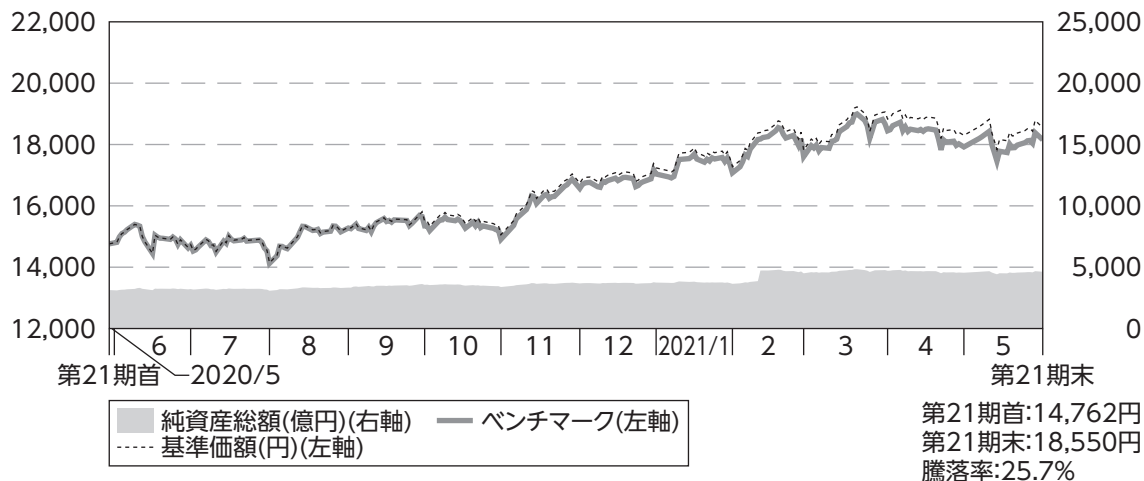
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

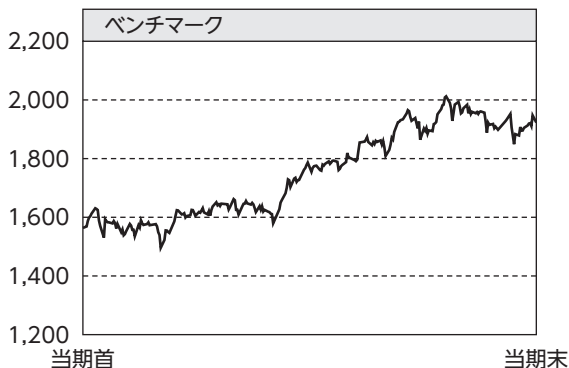


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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)の動きを反映して基準価額は変動し、期首と比べて上昇しました。

投資環境



国内株式市場は、世界的な経済活動の再開や新型コロナウイルスワクチンの開発進展が期待される一方、欧米の新型コロナウイルス感染拡大などが重石となり、2020年10月までは一進一退の展開となりました。2020年11月に、米国大統領選挙を通過し米国政治の先行き不透明感が後退したことなどから上昇し、その後も、米国の追加経済対策や各国の新型コロナウイルスワクチンの普及、国内企業業績の回復などが好感され、上昇しました。期末にかけては、国内での新型コロナウイルスワクチンの接種進展が期待されたものの、新型コロナウイルス新規感染者数の増加による緊急事態宣言の発令などが重石となり、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)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

- (1) 株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。
- (2) 東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX(東証株価指数)の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

当ファンドの組入資産の内容

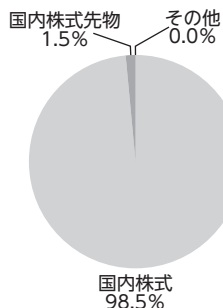
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.4%
2	ソニーグループ	日本	2.5%
3	ソフトバンクグループ	日本	2.4%
4	キーエンス	日本	2.0%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.6%
6	東証株価指数先物 2106	日本	1.5%

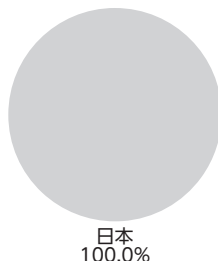
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	任天堂	日本	1.4%
8	リクルートホールディングス	日本	1.4%
9	信越化学工業	日本	1.3%
10	日本電信電話	日本	1.3%
組入銘柄数		2,115	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

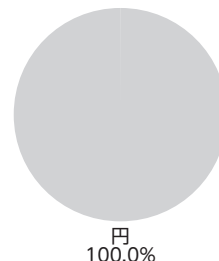
○資産別配分



○国別配分



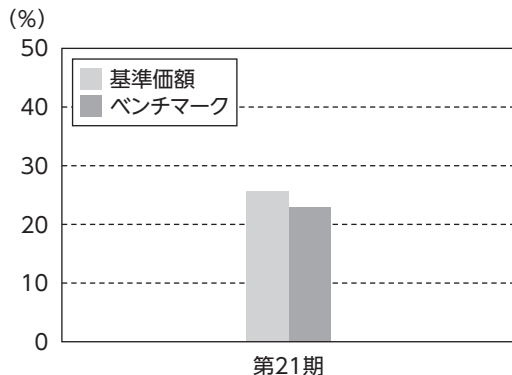
○通貨別配分



(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。
 (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。

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

今後の運用方針

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年5月30日～2021年5月31日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.002% (0.002) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
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(16,308円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 67,361 (△15,660)	千円 155,537,538 (-)	千株 32,910	千円 77,484,980

(注1)金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
国内	内	証券 -	千円 -	証券 - (38,100)	千円 - (-)

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 48,757	百万円 48,214	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	233,022,518千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	378,599,957千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.61

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 13	百万円 13	% 100.0	百万円 735	百万円 735	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	833,187	39,349	4.7	831,052	39,349	4.7

(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	370百万円	153百万円	1,214百万円

(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	当期末(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	6.6	7.6	22,009
日本水産	188	217.9	110,475
マルハニチロ	27.2	36.7	87,896
雪国まいたけ	—	19.3	33,253
カネコ種苗	5.7	7.1	10,479
サカタのタネ	22.4	28	104,020
ホクト	14.3	19.7	38,080
ホクリヨウ	2.9	3.6	2,761
鉱業(0.2%)			
住石ホールディングス	38	41.1	5,301
日鉄鉱業	4.3	5.4	33,750
三井松島ホールディングス	7.3	9.8	9,300
I N P E X	754.3	862.8	649,688
石油資源開発	24.6	30.7	60,540
K&Oエナジーグループ	9.1	11.4	15,504
建設業(2.3%)			
ヒノキヤグループ	4.7	5.8	14,494
ショーボンドホールディングス	29.3	33.5	153,262
ミライト・ホールディングス	55.9	81.3	156,909
タマホーム	10.1	14.2	29,876
サンヨーホームズ	1.6	2.7	1,930
日本アクア	7.5	9.3	5,003
ファーストコーポレーション	5.7	7.2	5,407
ベストテラ	3.2	4.5	7,110
Robot Home	38.8	44	11,484
キャンディル	3.1	4	2,168
スペースバリューホールディングス	22.9	28.6	20,963
ダイセキ環境ソリューション	3.6	4.5	4,306
第一カッター興業	2.3	5.8	7,888
明豊ファシリティワークス	6	—	—
安藤・間	112	150.4	123,177
東急建設	55.1	68.7	48,227
コムシスホールディングス	66.7	83.2	257,088
ビーアールホールディングス	20.5	31.4	15,825
高松コンストラクショングループ	11.7	14.6	29,900
東建コーポレーション	5.8	7.2	68,688
ソネック	1.9	2.4	2,188
ヤマウラ	8.2	10.2	9,241
オリエンタル白石	—	78.9	22,013
大成建設	144.8	168.6	644,052

銘柄	当期末(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
大林組	434.2	541.8	499,539
清水建設	440.7	507.5	455,227
飛鳥建設	12.5	15.5	16,430
長谷工コーポレーション	168.1	177.5	272,462
松井建設	17.1	21.3	15,698
銭高組	1.9	2.4	10,512
鹿島建設	340.9	397	601,455
不動テトラ	11.3	13.3	23,846
大末建設	5	6.8	6,738
鉄建建設	9.4	10.9	20,110
西松建設	33.5	38.8	130,368
三井住友建設	104.9	130.9	61,261
大豊建設	9.7	11.9	48,433
前田建設工業	108.8	135.7	129,593
佐田建設	9.3	12.5	5,787
ナカノフドー建設	11.9	13	5,226
奥村組	23.6	29.8	85,287
東鉄工業	18.6	23.2	54,682
イチケン	3.1	3.9	7,101
富士ビー・エス	6.4	7	3,829
浅沼組	4.9	6.5	29,152
戸田建設	180.3	225	174,825
熊谷組	20.1	25.1	74,672
北野建設	2.6	3.3	7,837
植木組	1.9	4.8	7,123
矢作建設工業	19.2	23.9	16,849
ピーエス三菱	14.3	17.8	11,587
日本ハウスホールディングス	29.6	37	12,654
大東建託	47.4	59.1	680,832
新日本建設	18.5	23	19,619
N I P P O	35.9	44.8	127,097
東亜道路工業	2.7	3.4	15,385
前田道路	38.3	33.5	72,058
日本道路	4.2	5.2	39,104
東亜建設工業	13.5	14.5	35,612
日本国土開発	42.2	52.7	29,722
若築建設	7.8	9.7	13,308
東洋建設	48.7	60.7	33,992
五洋建設	172.1	230.1	177,867
世紀東急工業	20.8	26	21,866
福田組	5	6.3	31,563

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
住友林業	110	127.4	282,318			
日本基礎技術	14.6	16.5	8,316			
バコーボレーション	19.3	24.1	9,399			
大和ハウス工業	429.6	500.3	1,603,961			
ライト工業	24.8	31	56,327			
積水ハウス	470.9	587.6	1,338,552			
日特建設	11.3	14.1	10,701			
北陸電気工事	7.5	9.4	11,223			
ユアテック	24.8	31	22,785			
日本リーテック	9.1	11.3	18,317			
四電工	2.4	2.9	9,845			
中電工	17.5	24.9	57,992			
関電工	61.8	88.1	79,818			
きんでん	103.2	110	202,510			
東京エネシス	14.4	18	17,280			
トーエネック	4.4	5.4	19,953			
住友電設	12.3	15.3	34,914			
日本電設工業	23.8	29.7	53,133			
協和エクシオ	65.8	82.1	220,849			
新日本空調	11.5	14.3	29,086			
九電工	30.5	38	128,630			
三機工業	31.3	38.4	53,145			
日揮ホールディングス	133.7	180.7	188,650			
中外炉工業	4.7	5.9	12,266			
ヤマト	13.9	17.3	13,511			
太平電業	10.5	12	31,860			
高砂熱学工業	37.7	49	88,102			
三晃金属工業	1.9	2.1	5,031			
朝日工業社	2.9	4	11,848			
明星工業	28.1	35	25,935			
大気社	21.1	26.3	82,845			
ダイダン	10.4	12	31,980			
日比谷総合設備	14	17.4	31,581			
フィル・カンパニー	2.5	3.1	9,216			
テスホールディングス	—	9.9	17,295			
OSJBホールディングス	68.5	—	—			
東洋エンジニアリング	18.2	22.8	15,572			
レイズネクスト	23.3	29.1	33,726			
食料品(3.4%)						
ニッポン	40.7	50.7	78,838			
日清製粉グループ本社	157	195.9	322,059			
日東富士製粉	1	1.3	9,334			
昭和産業	12.8	14.6	43,420			
鳥越製粉	12.3	15.4	12,427			
中部飼料	17	21.2	25,122			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
フィード・ワン	93.3	23.3	17,638			
東洋精糖	2.3	2.9	3,445			
日本甜菜製糖	7.2	9	14,544			
DM三井製糖ホールディングス	12.2	13.7	24,906			
塩水港精糖	15	20.7	4,657			
日新製糖	6.6	8.2	14,046			
森永製菓	32.6	40.7	137,566			
中村屋	3.6	4.2	15,918			
江崎グリコ	41.2	47.7	199,386			
名糖産業	6.7	7.6	11,597			
井村屋グループ	7.9	9.8	22,971			
不二家	7.8	11.1	23,343			
山崎製パン	104.2	130	212,940			
第一屋製パン	2.4	3.3	3,138			
モロゾフ	2.4	2.8	14,840			
亀田製菓	7.9	9.9	44,055			
寿スピリッツ	13.4	16.7	116,065			
カルビー	63.3	79	199,475			
森永乳業	25.7	32.1	181,686			
六甲バター	9.2	11.5	17,549			
ヤクルト本社	95.6	119.3	705,063			
明治ホールディングス	91.9	114.7	779,960			
雪印メグミルク	33.5	41.7	87,695			
プリマハム	21.7	24.4	73,322			
日本ハム	53.1	66.3	290,062			
林兼産業	4.6	5.7	3,482			
丸大食品	14.8	17.1	28,591			
S F o o d s	11.1	15.6	50,154			
柿安本店	4.8	6	14,922			
伊藤ハム米久ホールディングス	89.5	111.6	79,124			
サッポロホールディングス	47.4	59.2	127,102			
アサヒグループホールディングス	291	378.8	1,976,957			
キリンホールディングス	589.4	735.4	1,626,337			
宝ホールディングス	103	128.5	186,325			
オエノンホールディングス	36.7	49.3	18,586			
養命酒製造	4.3	5.3	9,439			
コカ・コーラ ボトラーズ	97.5	132.8	239,571			
ジャパンホールディングス						
サントリー食品インターナショナル	93	116	468,060			
ダイドーグループホールディングス	7.1	9.8	48,412			
伊藤園	42.2	52.6	318,756			
キーコーヒー	13.7	17	35,258			
ユニカフェ	3.6	5.2	5,189			
ジャパンフーズ	2	2.5	3,025			
日清オイリオグループ	17.9	22.2	66,555			

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
不二製油グループ本社	33.9	42.3	116,621
かどや製油	1.5	1.9	7,742
J-オイルミルズ	7.2	16.2	30,213
キッコーマン	100	124.8	887,328
味の素	306.9	412.4	1,037,598
ブルドックソース	—	7.9	18,004
キュービー	77.4	96.5	241,732
ハウス食品グループ本社	52	64.8	207,360
カゴメ	52.7	70.9	205,964
焼津水産化学工業	6.7	8.4	8,148
アリアケジャパン	12.7	15.8	100,804
ビエトロ	1.8	2.3	3,829
エバラ食品工業	3.4	3.8	9,458
やまみ	1.2	1.9	3,876
ニチレイ	66.2	82.6	232,353
東洋水産	71.5	89.2	391,588
イトアンドホールディングス	4.8	6	11,178
大冷	1.8	1.9	3,705
ヨシムラ・フード・ホールディングス	7.7	9.7	7,449
日清食品ホールディングス	59.1	68	539,240
永谷園ホールディングス	6.8	8.5	18,504
一正蒲鉾	5.4	6.7	6,338
フジッコ	15	18.8	35,889
ロック・フィールド	15	18.7	29,359
日本たばこ産業	802.4	929.7	2,010,476
ケンコーマヨネーズ	7.8	10.6	17,702
わらべや日洋ホールディングス	9.1	11.3	21,549
なとり	7.8	9.7	18,168
イフジ産業	2.4	2.7	2,459
ビックスコーポレーション	3	4.1	12,730
ファーマフーズ	—	16.4	51,742
北の達人コーポレーション	48.5	60.5	28,798
ユウグレナ	59.9	88.3	72,847
紀文食品	—	10.1	16,442
ミヨシ油脂	5.3	6.1	7,551
理研ビタミン	13.1	16.4	23,616
繊維製品(0.5%)			
片倉工業	20.1	23	35,167
グンゼ	10.1	12.5	54,562
東洋紡	53.9	67.2	90,854
ユニチカ	41	50.9	18,324
富士紡ホールディングス	6.7	8.3	33,449
倉敷紡績	13.7	15.9	28,953
シキボウ	7.1	9.5	8,844
日本毛織	45.1	56.2	53,109

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
トーア紡コーポレーション	5.4	6.7	3,061
帝国繊維	15.5	19.3	39,159
帝人	110.9	159.5	281,836
東レ	982.7	1,225.8	871,053
サカイオーベックス	3.8	4.6	13,606
住江織物	3	3.7	7,030
日本フェルト	8.6	10.7	4,825
イチカワ	2.3	2.6	3,562
日東製網	1.6	1.8	2,750
アツギ	11.3	13.3	8,272
ダイニック	5.1	6.4	5,024
セーレン	33.7	41.8	84,895
ソトー	5.5	7	5,579
東海染工	2	2.3	2,589
小松マテーレ	22.4	28	25,452
ワコールホールディングス	35.4	42.3	105,750
ホギメディカル	15.5	22.9	75,455
クラウドIAホールディングス	3.6	—	—
T S I ホールディングス	45.7	52.1	15,734
マツオカコーポレーション	3.9	5.5	9,564
ワルド	19.3	22.3	30,818
三陽商会	7.2	8.8	7,999
ナイガイ	5.2	6.8	2,216
オンワードホールディングス	81.7	102.4	30,515
ルックホールディングス	4.7	5.9	8,643
ゴールドウイン	24.6	28	169,400
デサント	26.5	29	55,187
キング	6.6	9.4	4,784
ヤマトインターナショナル	12.2	15.5	5,192
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	8.6	10.4	45,032
王子ホールディングス	566.9	761.7	494,343
日本製紙	60	74.8	96,641
三菱製紙	15.4	24	8,616
北越コーポレーション	80.8	121	71,390
中越パルプ工業	5.7	6.4	7,667
巴川製紙所	4	5.6	4,457
大王製紙	59.8	81.6	137,659
阿波製紙	3.5	4.4	1,874
レンゴー	128.2	174.5	160,191
トーモク	8.3	10.4	19,916
ザ・バック	10.3	12.8	35,136
化学(7.4%)			
クラレ	213.6	266.5	302,744
旭化成	898.8	1,121.5	1,351,407

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
共和レザー	7.4	9.2	6,449
昭和電工	96.5	128.5	437,542
住友化学	996.3	1,331.9	799,140
住友精化	6	8.2	28,905
日産化学	75.3	93.3	529,011
ラサ工業	4.8	5.5	10,356
クレハ	11.6	14.5	92,365
多木化学	5.3	6.6	35,970
テイカ	9.9	12.4	15,165
石原産業	24.3	30.3	28,845
片倉コープアグリ	3.5	4.4	5,442
日本曹達	20.1	23.6	79,060
東ソー	209.6	261.5	500,249
トクヤマ	39.1	50.3	115,388
セントラル硝子	27.7	32.3	67,539
東亜合成	85.1	103.2	122,188
大阪ソーダ	13.8	17.2	42,380
関東電化工業	32.2	40.1	38,816
デンカ	49.5	61.7	250,502
信越化学工業	232.8	312.9	5,899,729
日本カーバイド工業	4.6	6.2	7,960
堺化学工業	8.8	11.9	21,253
第一稀元素化学工業	14.7	17	25,891
エア・ウォーター	126.1	172.5	316,020
日本酸素ホールディングス	130.3	139.4	301,104
日本化学工業	4.2	4.8	13,147
東邦アセチレン	2	2.5	3,005
日本パーカライジング	68.4	85.4	93,256
高圧ガス工業	21.5	26.8	17,607
チタン工業	1.7	2.1	3,979
四国化成工業	20.9	22.5	27,652
戸田工業	3.1	3.6	8,280
ステラ ケミファ	7.4	9.2	26,716
保土谷化学工業	5.1	5	19,925
日本触媒	21	30.6	169,830
大日精化工業	12	14	32,228
カネカ	35.1	43.8	195,567
三菱瓦斯化学	126.2	169.5	432,733
三井化学	123.1	146.1	536,187
J S R	126.4	169.8	547,605
東京応化工業	23.3	29	196,620
大阪有機化学工業	12.5	15.6	63,492
三菱ケミカルホールディングス	906.5	1,131.1	990,391
KHネオケム	23.9	27.9	78,287
ダイセル	176.6	227.5	198,152

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
住友ベークライト	21.3	26.6	118,237
積水化学工業	291.6	357.8	667,297
日本ゼオン	122.3	152.6	245,228
アイカ工業	40.7	47.1	183,454
宇部興産	68.5	85.4	196,761
積水樹脂	24.4	27.9	57,836
タキロンシーアイ	29.3	36.6	21,557
旭有機材	7.7	9.6	12,576
ニチバン	7.1	8.9	15,397
リケンテクノス	34.1	41.3	23,375
大倉工業	6.4	8	18,264
積水化成成品工業	18.2	22.7	13,188
群栄化学工業	3.1	3.9	9,555
タイガースポリマー	7.1	8.9	3,987
ミライアル	4.8	5.4	7,295
ダイキアグシス	4.8	6.5	5,616
ダイキョーニシカワ	28.6	35.7	27,096
竹本容器	4.8	6	5,838
森六ホールディングス	7.3	9.1	20,138
恵和	—	3.3	10,230
日本化薬	83.9	104.7	107,003
カーリットホールディングス	14.5	16.8	11,474
日本精化	10.9	12.2	17,360
扶桑化学工業	13.7	13.3	52,269
トリケミカル研究所	3	15.7	53,929
ADEKA	62.4	77.9	150,658
日油	51.1	63.7	361,179
新日本理化	22.4	28	8,036
ハリマ化成グループ	11.2	12.6	11,390
花王	331.5	413.7	2,769,721
第一工業製薬	5.1	5.7	20,463
石原ケミカル	3.7	4.3	9,558
日華化学	4.6	5.7	6,834
ニイタカ	2.8	3.5	9,275
三洋化成工業	8.1	10.1	56,156
有機合成薬品工業	10.4	13	3,861
大日本塗料	15.3	19.1	16,005
日本ペイントホールディングス	111.9	698	1,105,632
関西ペイント	152.4	190.1	561,745
神東塗料	10.7	13.3	2,566
中国塗料	38.6	40.8	35,006
日本特殊塗料	10.1	12.7	12,954
藤倉化成	18.3	22.8	12,015
太陽ホールディングス	10	12.4	62,124
D I C	57.3	71.5	199,842

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
サカタインクス	29.6	36.9	37,601
東洋インキSCホールディングス	28.7	35.8	72,638
T&K TOKA	10.5	11.8	9,664
富士フイルムホールディングス	265.5	303.6	2,315,253
資生堂	275.1	343.3	2,722,025
ライオン	180	224.6	430,558
高砂香料工業	8.7	10.8	29,127
マンダム	31.1	36.2	69,540
ミルボン	18.5	23.1	143,913
ファンケル	56	62.9	217,005
コーセー	26	32.5	558,025
コタ	8	10.9	15,805
シーボン	1.8	2.2	4,283
ポーラ・オルビスホールディングス	59.1	73.7	209,897
ノエビアホールディングス	11.7	14.7	74,235
アジュバンコスメジャパン	3.1	3.9	3,978
新日本製薬	—	4.7	9,667
エステー	8.9	11.1	19,169
アグロ カネショウ	5.8	6.5	9,353
コニシ	22.7	28.4	43,480
長谷川香料	23.9	29.8	62,788
星光PMC	7.9	9.9	7,712
小林製薬	38.8	48.4	470,448
荒川化学工業	12.4	14.4	17,121
メック	9.5	11.8	33,382
日本高純度化学	3.8	4.7	13,484
タカラバイオ	36.2	45.2	135,012
JCU	16.8	19.4	69,258
新田ゼラチン	8.7	10.8	6,955
OATアグリオ	2.4	3.3	4,847
デクセリアルズ	35.8	48.3	107,805
アース製薬	10.4	13	81,900
北興化学工業	14.2	16.1	14,731
大成ラミック	4.5	5.3	14,553
クミアイ化学工業	57.3	71.4	59,190
日本農薬	24.7	30.8	16,077
アキレス	9.5	11.9	16,517
有沢製作所	21.9	24	21,864
日東電工	95.5	104.4	886,356
レック	14.8	20.5	22,591
三光合成	15.8	18.1	7,457
きもと	23.5	26.4	6,758
藤森工業	12.4	15.5	63,937
前澤化成工業	8.8	11	13,574
未来工業	7.4	6.2	10,719

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ウェーブブロックホールディングス	4.8	6	4,254
JSP	8.1	10.1	16,816
エフビコ	15.2	31.8	134,037
天馬	9.2	12.9	31,101
信越ポリマー	24.9	26.6	28,142
東リ	34.5	43	10,664
ニフコ	50.8	63.4	236,799
バルカー	11.2	14	29,050
ユニ・チャーム	266.9	366.3	1,583,514
ショーエイコーポレーション	2.1	3.8	3,663
医薬品(5.1%)			
協和キリン	139.3	173.8	575,278
武田薬品工業	1,152	1,437.4	5,345,690
アステラス製薬	1,200.5	1,497.9	2,692,475
大日本住友製薬	102.6	128.1	267,216
塩野義製薬	174.1	217.3	1,207,536
わかもと製薬	16.5	20.6	6,715
あすか製薬	15.8	—	—
日本新薬	36.2	49	384,160
ピオフェルミン製薬	2.4	2.9	8,946
中外製薬	144.4	540.4	2,268,599
科研製薬	23.7	29.6	134,088
エーザイ	165.7	190.9	1,404,642
ロート製薬	71.1	82.3	222,210
小野薬品工業	318	396.7	982,625
久光製薬	36.6	50.2	301,200
持田製薬	19.2	24	85,680
参天製薬	257.9	300.6	439,777
扶桑薬品工業	4.9	5.6	12,342
日本ケミファ	1.8	2.1	4,886
ツムラ	42.9	57.6	198,720
日医工	39.2	48.9	42,689
キッセイ薬品工業	24.5	30.6	64,780
生化学工業	26.9	30.5	35,136
栄研化学	24.3	30.4	65,177
日水製薬	5.8	6.3	6,054
鳥居薬品	8.7	10.8	26,254
JCRファーマ	9.8	48.7	161,927
東和薬品	17.7	24.9	58,988
富士製薬工業	9.4	10.6	12,031
沢井製薬	28.4	—	—
ゼリア新薬工業	25.1	31.3	65,479
第一三共	396.2	1,357.7	3,434,981
キョーリン製薬ホールディングス	30.6	38.1	65,112
大幸薬品	16.9	21.2	22,323

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ダイト	8.4	11	36,080
大塚ホールディングス	263.8	359.1	1,621,695
大正製薬ホールディングス	29.3	41.1	255,642
ペプチドリーム	70.4	89.1	457,083
あすか製薬ホールディングス	—	19.7	20,685
サワグルーブホールディングス	—	37.8	180,684
石油・石炭製品(0.4%)			
日本コークス工業	117	146	15,476
ニチレキ	16.3	20.4	27,254
ユシロ化学工業	7.8	9.7	11,290
ビービー・カストロール	4.9	6.2	8,649
富士石油	37	41.9	11,313
MORESCO	5	6.2	6,758
出光興産	153.7	191.7	495,544
ENEOSホールディングス	2,082.9	2,599	1,176,047
コスモエネルギーホールディングス	40.1	54.6	124,542
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	80.2	100	220,600
TOYO TIRE	79.5	90.9	199,889
ブリヂストン	398.8	459.4	2,207,876
住友ゴム工業	124.4	155.2	219,763
藤倉コンポジット	12.1	15.1	7,519
オカモト	8.4	10.5	42,787
フコク	6.1	7.6	7,022
ニッタ	15.6	17.9	46,217
住友理工	26.8	33.5	22,445
三ツ星ベルト	18.2	21	36,834
バンドー化学	24.4	30.4	25,262
ガラス・土石製品(0.8%)			
日東紡績	20.6	25.7	88,665
AGC	136.9	158.6	758,108
日本板硝子	66.2	87.7	53,233
石塚硝子	2.5	2.9	5,634
日本山村硝子	5.8	7.3	6,810
日本電気硝子	55.6	64.1	168,070
オハラ	5.5	6.9	10,784
住友大阪セメント	26.2	31.1	94,233
太平洋セメント	87.5	102.3	257,898
日本ヒューム	13.9	15.9	11,607
日本コンクリート工業	29.9	37.6	12,784
三谷セキサン	6.5	8.1	32,197
アジアパイルホールディングス	19.7	26.8	13,105
東海カーボン	145.1	169	272,766
日本カーボン	7.1	9.6	41,280
東洋炭素	8.1	10.2	24,918

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ノリタケカンパニーリミテド	7.7	9.6	40,176
TOTO	98.9	123.4	728,060
日本碍子	166.2	190.2	364,803
日本特殊陶業	105.3	131.5	226,706
MARUWA	5.3	6	64,560
品川リフラクトリーズ	3.7	4.1	14,883
黒崎播磨	2.8	3	13,425
ヨータイ	11	12.5	14,062
イソライト工業	7.2	7.8	4,703
東京窯業	17.7	22.4	7,100
ニッカトー	6.3	8	5,552
フジインコーポレーテッド	12.3	13.9	69,778
クニミネ工業	5.6	5.5	6,424
エーアンドエーマテリアル	2.3	3.3	3,366
ニチアス	37.9	43.7	118,995
ニチハ	19.3	24.1	69,962
鉄鋼(0.8%)			
日本製鉄	612.8	815.6	1,676,058
神戸製鋼所	250.8	312.8	232,097
中山製鋼所	19.2	23.9	9,894
合同製鐵	7.4	9.3	15,586
ジェイ エフ イー ホールディングス	369.9	494.4	720,835
東京製鐵	66.8	66.6	74,392
共英製鋼	15.5	19.3	27,348
大和工業	29.1	36.3	129,954
東京鐵鋼	5.7	6.6	10,296
大阪製鐵	7.3	9.1	10,273
淀川製鋼所	18.5	22.5	52,087
丸一鋼管	44.5	55.5	153,291
モリ工業	4.1	5.1	12,280
大同特殊鋼	22.4	28	151,480
日本高周波鋼業	5.2	6.5	2,684
日本冶金工業	11.4	13.3	30,018
山陽特殊製鋼	9.4	20.5	33,005
愛知製鋼	7.7	9.6	29,664
日立金属	147.6	161.1	341,693
日本金属	3.2	4.3	4,201
大平洋金属	9.3	11.6	22,527
新日本電工	88.6	110.5	35,139
栗本鐵工所	6.8	7.8	13,150
虹技	2.1	2.4	2,923
三菱製鋼	10.2	12.7	11,061
日亜鋼業	20.3	25.3	7,488
日本精練	2.3	2.5	10,937
エンビプロ・ホールディングス	5.9	7.4	8,339

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
シンニッタン	21.5	21	5,229	
新家工業	3.2	4.3	6,961	
非鉄金属(0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	22.7	25.9	31,028	
日本軽金属ホールディングス	347.1	46.6	87,328	
三井金属鉱業	37	46.1	149,133	
東邦亜鉛	7.1	9.5	19,275	
三菱マテリアル	90.5	112.9	261,928	
住友金属鉱山	175.1	218.4	1,071,907	
DOWAホールディングス	34.7	43.3	196,365	
古河機械金属	24.4	28.3	35,573	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.3	17.9	14,857	
東邦チタニウム	24.7	30.7	29,072	
UACJ	20.8	26	60,684	
CKサンエツ	2.9	3.6	12,996	
古河電気工業	42.6	53.1	154,680	
住友電気工業	512	596.3	999,696	
フジクラ	165.7	206.3	96,548	
昭和電線ホールディングス	15.9	16.6	28,153	
東京特殊電線	2.1	2.2	5,524	
タツタ電線	27.3	30.4	17,328	
カナレ電気	2.3	2.9	5,260	
平河ヒューテック	6.9	9.6	11,692	
リョービ	16.9	21.1	33,464	
アーレスティ	18.2	21.3	9,009	
アサヒホールディングス	24	64.2	153,373	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	7.7	9.6	14,208	
宮地エンジニアリンググループ	4.2	5.6	12,140	
トーカロ	38	44.1	61,872	
アルファC o	4.8	6	6,708	
SUMCO	162.7	217.9	553,683	
川田テクノロジーズ	2.8	3.5	13,475	
RS Technologies	3.9	5.5	29,315	
ジェイテックコーポレーション	—	1.9	5,795	
信和	7.9	9.1	6,997	
東洋製鐵グループホールディングス	87.2	108.8	163,200	
ホッカンホールディングス	7.5	8.7	12,206	
コロナ	7.6	9.4	8,751	
横河ブリッジホールディングス	25.5	29.3	58,600	
駒井ハルテック	2.6	3.5	6,034	
高田機工	1.3	1.6	4,288	
三和ホールディングス	129.1	161.1	213,618	
文化シャッター	40.3	50.3	54,575	
三協立山	17.6	22	17,314	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
アルインコ	9.9	11.3	11,254	
東洋シャッター	3.3	3.8	2,523	
L I X I L	202	235.3	676,958	
日本ファイルコン	10.5	11.9	5,926	
ノーリツ	28.4	35.4	67,720	
長府製作所	13.9	17.4	35,235	
リンナイ	26.6	33.2	353,912	
ダイニチ工業	7.4	8.2	6,535	
日東精工	18.9	21.4	11,620	
三洋工業	1.8	2.1	3,933	
岡部	27.7	34.6	22,870	
ジーテクト	17	21.2	31,800	
東ブレ	25.5	31.9	52,379	
高周波熱錬	26.4	32.9	18,259	
東京製綱	9.8	12.2	14,737	
サンコール	10.2	14.6	6,643	
モリテック スチール	10.7	13.3	6,836	
パイオラックス	20.2	25.3	36,862	
エイチワン	13.4	16.8	12,969	
日本発條	146.9	170.2	149,095	
中央発條	1.6	8.2	9,889	
アドパネクス	2	2.5	3,360	
立川ブラインド工業	6	7.5	9,855	
三益半導体工業	10.7	13.3	34,074	
機械(5.6%)				
日本ドライケミカル	3.4	4.3	7,331	
日本製鋼所	41.6	51.9	147,499	
三浦工業	59.3	74	372,220	
タクマ	46.5	58	107,880	
ツガミ	28.5	35.5	59,427	
オークマ	16	20	113,200	
芝浦機械	15.5	17.8	44,482	
アマダ	170	250.6	291,698	
アイダエンジニアリング	36	45	39,150	
滝澤鉄工所	4.3	5	5,620	
F U J I	58.9	68.3	185,639	
牧野フライス製作所	16.1	20.1	87,234	
オーエスジー	63.4	84.4	147,784	
ダイジェット工業	1.6	2.1	2,805	
旭ダイヤモンド工業	36.2	45.3	23,329	
DMG森精機	86.7	108.2	204,498	
ソディック	32.3	41.1	46,155	
ディスコ	18.6	23.2	779,520	
日東工器	7.5	8.2	15,325	
日進工具	5.4	13.5	19,588	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
パンチ工業	12.5	14.4	8,280	
富士ダイス	6.2	8.7	5,689	
豊和工業	7.7	9.7	7,847	
OKK	5.9	6.6	2,554	
東洋機械金属	10	12.4	6,485	
津田駒工業	2.8	3.3	2,917	
エンシュウ	3.4	4.4	3,770	
島精機製作所	21.6	25.1	53,161	
オプトラン	15.3	21.5	58,243	
NCホールディングス	4.3	5.3	5,029	
イワキポンプ	8.8	11	10,395	
フリーユ	13.5	16.8	19,068	
ヤマシンフィルタ	29.8	34.6	27,749	
日阪製作所	17	21.2	17,129	
やまびこ	26.6	33.2	40,470	
平田機工	6.5	8.1	52,407	
ベガスサミシン製造	14.1	17.5	8,575	
マルマエ	5.1	7.1	13,518	
タツモ	6.4	7.3	11,899	
ナブテスコ	80.7	100.7	505,514	
三井海洋開発	14.6	18.2	38,656	
レオン自動車	13.5	16.8	21,386	
SMC	43.4	50.6	3,315,312	
ホソカワミクロン	4.8	6	36,180	
ユニオンツール	5.1	6.4	23,840	
オイレス工業	17.8	24	37,104	
日精エー・エス・ビー機械	4	5.8	30,682	
サトーホールディングス	19.5	22.5	57,622	
技研製作所	12.1	15.1	67,497	
日本エアータック	4.8	5.7	7,375	
カワタ	4.1	4.8	4,291	
日精樹脂工業	11.6	13.3	16,452	
オカダアイヨン	4.4	5.5	7,166	
ワイエイシィホールディングス	5.9	6.8	6,895	
小松製作所	627.2	782.8	2,507,308	
住友重機械工業	79.3	99	335,115	
日立建機	55.5	80.8	293,304	
日工	19.1	26.1	18,322	
巴工業	5.9	6.8	14,334	
井関農機	13.9	17.4	23,716	
TOWA	14.1	16.2	32,999	
丸山製作所	2.9	3.6	6,505	
北川鉄工所	6.3	7.9	13,256	
ローツェ	6.1	7.6	75,240	
タカキタ	5	6.2	3,949	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
クボタ	734.7	907.6	2,258,108	
荏原実業	3.5	4.4	28,028	
三菱化工機	4.8	5.6	15,265	
月島機械	25.6	32	37,088	
帝国電機製作所	11.5	12.1	15,173	
新東工業	33	41.3	32,090	
澁谷工業	12.1	15.2	50,084	
アイチ コーポレーション	24.1	29.6	25,781	
小森コーポレーション	35.3	44.1	34,971	
鶴見製作所	10.7	13.4	23,155	
住友精密工業	2.1	2.6	6,385	
日本ギア工業	5.8	7.2	2,354	
酒井重工業	2.7	3.1	6,342	
荏原製作所	57.3	71.7	387,180	
石井鐵工所	1.8	2.5	7,425	
西島製作所	14.1	17.7	15,664	
北越工業	14.3	17.9	20,244	
ダイキン工業	176.4	220.1	4,755,260	
オルガノ	5	5.6	35,840	
トーヨーカネツ	6.1	6.6	15,655	
栗田工業	75	93.5	470,305	
椿本チエイン	19.8	24.7	75,952	
大同工業	6.8	8.4	9,181	
木村化工機	11.8	14.6	13,388	
アネスト岩田	21.6	29.2	29,492	
ダイフク	70.8	95.1	874,920	
サムコ	3.5	4.3	13,674	
加藤製作所	7.7	9.7	9,593	
油研工業	2.4	3	5,202	
タダノ	67	83.6	88,448	
フジテック	50.4	59.5	143,276	
CKD	38	40.1	104,500	
キトー	10.5	14.6	24,747	
平和	38.7	48.2	87,772	
理想科学工業	12.3	12.7	21,958	
SANKYO	30.8	41.1	109,654	
日本金銭機械	15.4	19.3	10,788	
マースグループホールディングス	8.8	11	17,611	
フクシマガリレイ	8.6	11.9	50,218	
オーイズミ	6	7.5	2,902	
ダイコク電機	6.4	8	7,136	
竹内製作所	23.2	28.9	83,752	
アマノ	36.3	45.3	129,784	
JUKI	19.3	24	18,480	
蛇の目ミシン工業	12.8	15.8	12,877	

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
マックス	21.2	23.2	38,906
グローリー	35.6	44.4	99,811
新晃工業	12.9	16.1	30,654
大和冷機工業	20.1	27.8	29,301
セガサミーホールディングス	137.4	157.2	218,979
日本ビストンリング	5.1	6.4	7,577
リケン	6.4	8	19,600
T P R	18.7	23.3	33,924
ツバキ・ナカシマ	28.3	33.3	58,541
ホシザキ	40.5	54.4	529,312
大豊工業	11.4	14.2	12,666
日本精工	260.8	354.9	368,741
NTN	320.8	399.8	122,738
ジェイテクト	132.9	165.8	189,177
不二越	12.9	16.1	67,056
日本トムソン	41.3	47.5	29,070
THK	80.6	107.7	383,412
ユーシン精機	10.8	11.6	9,581
前澤給装工業	5.1	12.1	13,249
イーグル工業	17.2	21.4	23,989
前澤工業	9.4	10.5	6,310
日本ビラー工業	14.1	17.5	33,845
キッツ	56.2	53.5	40,553
マキタ	180.6	225.3	1,189,584
日立造船	110.1	137.3	98,444
三菱重工業	232.1	271.5	900,022
I H I	99.8	116.2	309,324
スター精密	21.4	26.7	48,140
電気機器 (17.8%)			
日清紡ホールディングス	92.4	105.7	95,552
イビデン	84.9	83.3	423,164
コニカミノルタ	303.7	352.2	210,615
ブラザー工業	169.3	211.4	483,471
ミネベアミツミ	257.3	298.2	888,636
日立製作所	665.3	830.7	4,764,895
東芝	—	341.9	1,571,030
三菱電機	1,384.6	1,727.6	2,923,099
富士電機	83.5	104.1	534,033
東洋電機製造	5.1	7	8,232
安川電機	149.1	186	987,660
シンフォニアテクノロジー	18	22.5	28,755
明電舎	25.5	29.4	66,267
オリジン	3.8	4.9	6,526
山洋電気	6.8	8.5	64,940
デンヨー	11.9	14.8	29,984

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
東芝テック	17.4	18.6	78,771
芝浦メカトロニクス	2.6	3.2	20,736
マブチモーター	38.5	48.1	207,551
日本電産	333.3	415.9	5,211,227
トレックス・セミコンダクター	8.4	9.8	21,648
東光高岳	8.2	9.5	13,547
ダイヘン	15.2	18.9	94,027
ヤーマン	23.3	28.9	43,118
J V Cケンウッド	115.7	154.1	35,751
ミマキエンジニアリング	13.6	17	11,543
I - P E X	5.8	8.5	20,655
日新電機	32.6	40.6	52,333
大崎電気工業	27.8	34.6	20,690
オムロン	124.1	143.8	1,239,556
日東工業	20.4	25.4	45,059
I D E C	20.1	23.2	47,420
正興電機製作所	3.7	6.1	10,113
不二電機工業	2.7	3.7	4,754
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46.5	62.4	193,128
サクサホールディングス	3.3	4.2	5,859
メルコホールディングス	5	6.2	29,326
テクノメディア	3.4	4.5	7,254
日本電気	168	219.5	1,121,645
富士通	133.5	155.5	2,765,567
沖電気工業	56.4	70.3	68,753
岩崎通信機	6.1	7.6	7,136
電気興業	6.7	8.4	19,387
サンケン電気	15.2	20.2	107,868
ナカヨ	2.8	3.5	5,218
アイホン	7.9	9.9	20,413
ルネサスエレクトロニクス	663.2	744.7	829,595
セイコーエプソン	171.9	214.4	414,864
ワコム	94.1	126.6	84,315
アルバック	25.5	31.8	163,770
アクセル	6.4	8.3	7,486
E I Z O	10.8	14.7	69,237
日本信号	35.4	40.4	37,976
京三製作所	32.7	37.5	15,937
能美防災	18.6	23.4	48,040
ホーチキ	10.4	13.4	16,254
星和電機	7.6	10.4	5,772
エレコム	15.4	40.1	83,728
パナソニック	1,582.1	1,842.6	2,297,722
シャープ	160.3	229.8	459,140
アンリツ	89.2	103.9	217,254

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
富士通ゼネラル	37.6	52.8	142,084			
ソニーグループ	867.4	1,082.3	11,672,605			
T D K	66.9	83.5	1,163,990			
帝国通信工業	6.5	8.6	10,027			
タムラ製作所	46.5	62.4	34,819			
アルプスアルパイン	122.9	142	167,134			
池上通信機	4.4	5.5	4,510			
鈴木	7.4	8.8	9,380			
日本トリム	2	4	14,240			
ローランド ディー、ジー、	8	10.7	22,523			
フォスター電機	14.6	17.6	18,057			
SMK	3.6	4.5	11,668			
ヨコオ	9.1	13.9	31,983			
ホシデン	38.4	48.2	48,730			
ヒロセ電機	21.5	26.6	414,694			
日本航空電子工業	31.8	39.7	76,740			
T O A	15	20.6	18,128			
マクセルホールディングス	30.3	35.2	43,683			
古野電気	18.4	23.2	24,081			
ユニデンホールディングス	3.9	4.5	10,935			
スミダコーポレーション	11.3	15.7	16,202			
アイコム	7.7	7.2	17,424			
リオン	6	7.7	19,550			
本多通信工業	13	15.6	7,488			
横河電機	127.1	173	299,809			
新電元工業	4.9	6.7	25,058			
アズビル	87.4	116.9	512,606			
東亜ディーケーケー	7.4	9.8	8,045			
日本光電工業	57.4	71.7	222,270			
チノー	4.9	5.6	8,198			
共和電業	14.8	18.7	7,554			
日本電子材料	5.6	7.2	14,760			
堀場製作所	27.4	34.2	240,768			
アドバンテスト	103	128.5	1,270,865			
小野測器	6.7	9.2	4,986			
エスベック	12.6	15.8	31,805			
キーエンス	125.5	169.6	9,136,352			
日置電機	7.4	8.5	43,520			
シスメックス	99	134.9	1,505,484			
日本マイクロニクス	24.7	30.7	47,431			
メガチップス	13.1	17.6	57,728			
OBARA GROUP	8.2	8.1	30,861			
澤藤電機	1.9	2.3	5,138			
原田工業	7.1	8.2	7,298			
コーセル	19	22	23,826			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
イリソ電子工業	11.8	14.7	67,987			
オブテックグループ	23.1	28.9	55,690			
千代田インテグレ	6.7	7.8	14,281			
アイ・オー・データ機器	5	7.3	7,964			
レーザーテック	60.9	75.9	1,563,540			
スタンレー電気	97.5	121.2	395,112			
岩崎電気	5.7	7	12,089			
ウシオ電機	76.8	89.2	140,846			
岡谷電機産業	12.3	15.3	5,416			
ヘリオス テクノ ホールディング	14.2	18.9	6,501			
エノモト	4.6	5.4	9,450			
日本セラミック	14.3	17.9	50,227			
遠藤照明	7.8	10.1	7,867			
古河電池	10.7	13	20,306			
双信電機	8	10.5	6,373			
山一電機	10.3	11.9	19,873			
図研	9.2	11.6	36,540			
日本電子	27.5	31.6	177,592			
カシオ計算機	122.5	139	264,795			
ファナック	131.6	151.6	3,987,080			
日本シイエムケイ	33.8	39.4	18,005			
エンプラス	7.3	8.1	33,250			
大真空	5.3	6.2	21,700			
ローム	61.5	71.9	745,603			
浜松ホトニクス	99.4	124.1	826,506			
三井ハイテック	15.6	17.2	70,864			
新光電気工業	46.8	58.3	208,131			
京セラ	194.9	263.5	1,771,247			
太陽誘電	61.7	77	405,790			
村田製作所	406.8	507.6	4,202,420			
双葉電子工業	22.4	30.8	25,718			
北陸電気工業	6.1	7.6	7,866			
ニチコン	47.6	55.3	63,705			
日本ケミコン	10.5	17.4	44,613			
K O A	21.4	24.6	39,556			
市光工業	21.6	27.3	19,628			
小糸製作所	83.1	103.6	736,596			
ミツバ	26.6	31.8	29,192			
S C R E E Nホールディングス	24	30	312,600			
キヤノン電子	14.8	16.5	28,066			
キヤノン	745.4	858.5	2,197,760			
リコー	352.4	439.6	570,600			
象印マホービン	40.9	47.4	79,158			
M U T O Hホールディングス	2.1	2.9	4,613			
東京エレクトロン	87.9	101.2	4,924,392			

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
輸送用機器 (7.6%)			
トヨタ紡織	40.4	50.4	106,495
芦森工業	2.9	3.3	3,432
ユニプレス	26.9	28.4	26,809
豊田自動織機	112.1	139.8	1,305,732
モリタホールディングス	24.2	27.7	42,602
三櫻工業	17.6	24	26,400
デンソー	304.9	380.4	2,854,141
東海理化電機製作所	36.5	45.5	80,034
三井E&Sホールディングス	50	66.9	33,048
川崎重工業	107.7	134.4	353,740
名村造船所	44.6	51.9	8,667
日本車輛製造	5	6.3	13,784
三菱ロジスネクスト	18.3	22.9	23,358
近畿車輛	2.1	3	3,750
日産自動車	1,633	2,037.5	1,098,416
いすゞ自動車	401.2	458.7	661,904
トヨタ自動車	1,544.9	1,750.2	15,953,073
日野自動車	172.9	215.7	219,582
三菱自動車工業	512.5	639.5	194,408
エフテック	9.8	12.2	9,699
レシップホールディングス	5.4	6.8	3,984
GMB	2.6	3.2	2,937
ファルテック	2.5	3.1	2,387
武蔵精密工業	30.9	38.5	84,854
日産車体	27	25.3	17,937
新明和工業	37.3	48.8	47,433
極東開発工業	25.7	29.8	51,554
日信工業	28.2	—	—
トピー工業	11.4	14.3	18,990
ティラド	5.1	5.4	14,504
曙ブレーキ工業	76	94.8	16,495
タチエス	22.8	26.5	33,893
NOK	74.5	83.6	112,442
フタバ産業	38.6	43.4	21,613
KYB	15.5	19.3	73,822
大同メタル工業	26.7	35.8	20,549
プレス工業	68.9	85.9	27,745
ミクニ	17.8	22.2	6,304
太平洋工業	29.1	36.3	42,942
ケーヒン	31.8	—	—
河西工業	18.8	23.5	9,282
アイシン	114	126.5	607,200
マツダ	407.4	542.2	506,957
今仙電機製作所	12.9	15.2	10,609

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
本田技研工業	1,090.2	1,360.3	4,561,085
スズキ	274.4	342.4	1,624,003
S U B A R U	429.8	495.1	1,054,810
安永	6.7	8.4	9,618
ヤマハ発動機	180.6	244.1	779,899
ショーワ	32.7	—	—
T B K	16.6	20.7	8,590
エクセディ	18.8	23.5	37,717
豊田合成	44.7	55.8	155,570
愛三工業	21.8	27.2	21,515
盟和産業	2.2	2.7	2,559
日本ブラスト	11	14.7	10,172
ヨロズ	13	14.9	18,148
エフ・シー・シー	22.7	28.3	48,081
シマノ	51.8	64.7	1,604,560
テイ・エス テック	32.2	80.3	125,990
ジャムコ	7	10.1	10,120
精密機器 (2.7%)			
テルモ	391.8	529.6	2,233,323
クリエートメディック	4.6	5.7	5,745
日機装	41.6	55.8	66,681
日本エム・ディ・エム	8	10	20,160
島津製作所	165.5	222.3	852,520
J M S	11.7	14.6	12,687
長野計器	10.1	12.5	14,962
ブイ・テクノロジ	6.5	8.1	42,606
東京計器	8.8	11	11,594
愛知時計電機	1.8	2.3	9,867
インターアクション	7.4	8.7	20,297
オーバル	12.5	15.6	4,446
東京精密	25.1	29.1	158,304
マニー	55.2	68.8	165,739
ニコン	211.5	263.9	296,095
トプコン	69.8	87	149,379
オリンパス	766.1	955.9	2,247,320
理研計器	12.2	15.2	41,876
タムロン	11.2	13.9	33,943
HOYA	276.5	340	4,879,000
シード	5.9	6.8	5,222
ノーリツ鋼機	9.4	15.5	35,324
エー・アンド・デイ	12.7	14.6	15,140
朝日インテック	156.8	181.9	492,585
シチズン時計	162.3	219.3	94,518
リズム	4.4	5.5	4,532
大研医器	9.6	13.7	7,603

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
メニコン	19.6	26.6	181,944
シンシア	1.6	1.9	1,231
松風	6.3	7.9	14,686
セイコーホールディングス	19.6	24.5	52,405
ニプロ	95.8	128.8	171,561
その他製品 (2.6%)			
中本バックス	3.5	4.4	7,040
スノーピーク	7.4	10.2	35,904
パラマウントベッドホールディングス	14.6	33.1	66,365
トランザクション	7.6	9.5	12,967
粧美堂	4	5	2,110
ニホンフラッシュ	12.9	14.8	18,633
前田工織	15.3	19	65,075
永大産業	18.1	22.6	6,847
アートネイチャー	14.8	16.6	10,690
バンダイナムコホールディングス	143.1	142.9	1,120,478
アイフィスジャパン	3.5	4.4	3,163
共立印刷	23.1	28.9	4,074
SHOEI	12.1	16.2	63,747
フランスベッドホールディングス	19.6	22.2	20,535
パイロットコーポレーション	22.6	29.2	99,718
萩原工業	7.7	9.6	13,737
トッパン・フォームズ	29.7	30.8	33,818
フジシールインターナショナル	31	35.5	84,099
タカラトミー	62.1	77.5	73,780
廣済堂	9.6	12	13,416
エステールホールディングス	3.7	4.6	2,948
アーク	52.8	—	—
タカノ	5.4	5.9	3,681
プロネクサス	11.9	13.9	14,317
ホクシン	8.5	10.7	1,872
ウッドワン	4.7	5.8	7,180
大建工業	9.3	11.6	22,550
凸版印刷	195.4	262.6	503,666
大日本印刷	181.2	208.7	492,323
共同印刷	4.3	5.3	14,871
NISSHA	28.4	35.5	54,137
光村印刷	1.2	1.5	2,563
TAKARA & COMPANY	6.7	8.5	14,586
アシックス	114.3	152.8	401,100
ツツミ	4.3	4.3	10,461
ローランド	—	13.4	85,492
小松ウオール工業	4.2	5.3	10,197
ヤマハ	82.3	102.7	674,739
河合楽器製作所	4.3	4.8	18,168

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
クリナップ	12.9	16.1	8,404
ビジョン	83.7	110.9	342,126
オリバー	2.9	3.7	11,673
兼松サステック	0.9	1.1	1,938
キングジム	11.5	14.3	13,470
リントック	32.9	37	89,466
イトーキ	29.4	34.3	12,313
任天堂	84.9	98.9	6,695,530
三菱鉛筆	22.8	28.4	40,810
タカラスタンダード	28.6	35.7	57,120
ココヨ	66.4	82.9	140,515
ナカバヤシ	13.6	17	10,234
グローブライド	6.2	8.4	34,776
オカムラ	48.3	59.4	83,278
美津濃	12.6	17.1	38,389
電気・ガス業 (1.2%)			
東京電力ホールディングス	1,105.3	1,465.4	496,770
中部電力	423.6	528.5	692,863
関西電力	524.6	654.6	679,474
中国電力	199.7	249.2	265,148
北陸電力	126.6	157.9	98,687
東北電力	345.9	404.6	360,094
四国電力	124.7	143.6	105,689
九州電力	285.4	381.5	337,627
北海道電力	129.6	161.7	80,850
沖縄電力	26.89	33.6	47,040
電源開発	110.2	137.5	213,125
エフオン	7.4	10.4	10,524
イーレックス	19.7	25.4	46,812
レノバ	23.1	29.3	106,652
東京瓦斯	266.3	332.2	719,711
大阪瓦斯	268.7	312.9	645,199
東邦瓦斯	68.1	85	510,000
北海道瓦斯	7.4	9.3	14,294
広島ガス	28.5	35.6	13,207
西部ガスホールディングス	15.6	19.4	47,530
静岡ガス	39.3	49	51,205
メタウォーター	6.7	19.4	39,110
陸運業 (3.3%)			
SBSホールディングス	12	12.8	39,680
東武鉄道	144.3	180.1	501,938
相鉄ホールディングス	44.3	59.2	125,859
東急	349.2	435.7	638,736
京浜急行電鉄	177.8	221.9	313,322
小田急電鉄	205.9	276.7	782,230

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
京王電鉄	71.8	96.5	656,200
京成電鉄	96.4	129.5	437,062
富士急行	18.9	23.6	120,596
新京成電鉄	3.6	4.4	9,446
東日本旅客鉄道	243.7	304.1	2,326,365
西日本旅客鉄道	123.4	153.9	958,797
東海旅客鉄道	115.1	143.6	2,335,654
西武ホールディングス	185.8	208.2	263,581
鴻池運輸	22	27.5	30,992
西日本鉄道	38.4	47.9	130,479
ハマキョウレックス	10.6	13.3	40,299
サカイ引越センター	7.3	7.9	44,082
近鉄グループホールディングス	131.1	163.6	631,496
阪急阪神ホールディングス	174.9	218.2	746,244
南海電気鉄道	62.2	77.6	181,816
京阪ホールディングス	58.4	72.9	252,598
神戸電鉄	3.1	3.9	13,533
名古屋鉄道	107.8	134.5	282,450
山陽電気鉄道	9.4	11.7	21,996
アルプス物流	—	11.4	10,659
日本通運	45.4	56.6	496,382
ヤマトホールディングス	229.9	229.3	690,193
山九	36.4	42	199,290
丸運	7.5	9.3	2,427
丸全昭和運輸	10.6	13.3	46,882
センコーグループホールディングス	72.3	90.2	90,831
トナミホールディングス	3.1	3.9	19,383
ニッコンホールディングス	46.9	54.9	127,917
日本石油輸送	1.4	1.8	4,629
福山通運	16.8	20.9	84,854
セイノーホールディングス	98.2	122.5	188,650
エスライン	3.9	4.5	4,023
神奈川中央交通	3.2	4.1	14,903
日立物流	24	36	125,640
九和運輸機関	13.8	34.5	52,957
C&Fロジホールディングス	13.3	16.5	27,159
九州旅客鉄道	115	126.6	316,120
S Gホールディングス	137.6	309.1	756,058
海運業(0.3%)			
日本郵船	110.3	137.2	619,458
商船三井	83.4	97.4	428,073
川崎汽船	40.4	50.4	148,881
N Sユナイテッド海運	7.9	8.4	17,740
飯野海運	64.8	79.4	34,539
共栄タンカー	3.4	4.7	3,995

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
乾汽船	7.6	11.2	12,476
空運業(0.5%)			
日本航空	231.9	398.6	996,101
ANAホールディングス	239.7	441.6	1,172,448
パスコ	2.5	3.2	4,716
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	3.7	5	42,050
日新	11.3	13	18,772
三菱倉庫	41.6	56.6	186,780
三井倉庫ホールディングス	15	17.4	39,741
住友倉庫	47.2	57.8	84,908
澁澤倉庫	7.2	9	18,594
東陽倉庫	23.7	27.4	8,877
日本トランスシティ	28.9	36	18,468
ケイヒン	2.5	3.2	4,361
中央倉庫	8	10	11,060
川西倉庫	2.4	3	3,435
安田倉庫	10.8	13.4	12,529
ファイズホールディングス	2.8	2.9	2,462
東洋埠頭	4	5	7,555
宇徳	11.2	11.7	5,838
上組	73.2	90	195,120
サンリツ	3.1	4.2	3,112
キムラユニティー	3.5	4.4	5,764
キューソー流通システム	3.3	4.1	6,555
近鉄エクスプレス	27.9	30.9	76,632
東海運	7.5	9.3	2,845
エアアティー	9.3	10.3	10,227
内外トランスライン	4.6	5.7	10,094
日本コンセプト	4.2	5.2	8,751
情報・通信業(9.0%)			
NECネットエスアイ	38.7	56.3	98,581
クロスキャット	3.8	4.8	4,891
システナ	48.6	60.7	117,090
デジタルアーツ	6.7	9.9	79,596
日鉄ソリューションズ	20.5	24.7	78,916
キューブシステム	7.6	9.4	9,794
エイジア	2.7	2.8	5,868
コア	6	7.4	10,626
ラクーンホールディングス	6.4	12.1	32,512
ソリトンシステムズ	6.2	8.7	15,051
ソフトクリエイトホールディングス	6.1	6.8	15,334
T I S	136	169.7	477,705
J N Sホールディングス	5.4	8.3	4,482
電算システム	5.3	6.5	19,025

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
グリー	84	104.6	59,099	
GMOベバボ	—	1.5	7,935	
コーエーテクモホールディングス	27.9	45.1	234,069	
三菱総合研究所	5.9	7.4	28,860	
電算	1.6	2	4,882	
AGS	8	9.1	7,698	
ファインデックス	11.7	14.6	15,417	
ブレインパッド	3.5	4.5	21,690	
KL a b	26.3	31.1	21,179	
ポルトウウィン・ピット クルーホールディングス	16.7	22.9	24,525	
イーブクイニシアティブジャパン	2.1	2.9	7,540	
ネクソン	379.1	429.1	1,108,794	
アイスタイル	38.9	52.4	27,038	
エムアップホールディングス	4	4.5	12,172	
エイチーム	9.7	11.9	19,801	
エニグモ	13.1	16.3	21,581	
テクノスジャパン	11	13.8	8,293	
コロブラ	44.8	56.2	44,679	
ブロードリーフ	67.8	84.7	44,382	
クロス・マーケティンググループ	6.9	8.2	5,658	
デジタルハーツホールディングス	7.5	8	11,680	
システム情報	10.4	13.1	11,960	
メディアドウ	4.3	6.7	37,453	
じげん	34.4	42.9	17,117	
ブイキューブ	—	9.4	22,682	
エンカレッジ・テクノロジー	3.3	3.6	2,293	
サイバーリンクス	2.3	5.8	9,471	
フィックスターズ	14.7	18.5	15,910	
CARTA HOLDINGS	6.8	7.1	11,402	
オブティム	7.2	12	29,304	
セレス	4.7	5.7	21,204	
SHIFT	5.5	8.5	131,665	
ティーガイア	12.2	18.2	33,961	
セック	2.1	2.6	6,851	
日本アジアグループ	14.3	16.4	15,465	
テクマトリックス	9.7	26.5	46,110	
プロシップ	4.2	5.2	6,812	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	32.9	41	83,804	
GMOペイメントゲートウェイ	28.8	32.5	427,050	
ザッパラス	6.6	7.3	4,022	
システムリサーチ	3.8	5.1	10,485	
インターネットイニシアティブ	20.2	45.3	136,579	
さくらインターネット	15	18.8	11,656	
ヴィンクス	4.1	5.2	5,106	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2.6	3.8	19,304	
SRAホールディングス	7.3	9.1	23,632	
システムインテグレータ	4.6	5.4	3,380	
朝日ネット	9.9	14.3	10,024	
eBASE	16.5	20.7	17,967	
アバント	13.2	18.4	27,618	
アドソル日進	4.9	6.2	14,960	
ODKソリューションズ	—	4	3,476	
フリービット	7.4	10.5	9,408	
コムチュア	15.3	15.7	35,890	
サイバーコム	2.6	3.3	4,953	
アステリア	8.8	12.7	10,452	
アイル	7.7	9.6	14,937	
マークラインズ	6.9	7.2	21,211	
メディカル・データ・ビジョン	10.6	19.5	39,390	
gumi	—	23.8	27,132	
ショーケース	3.6	4.2	3,179	
モバイルファクトリー	3.3	4.1	5,198	
テラスカイ	5	5.6	14,061	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	5.5	7.7	16,016	
PCIホールディングス	5.4	6.7	8,509	
パイブドHD	1.9	3.7	5,816	
アイビーシー	2.5	3.1	3,093	
ネオジャパン	2.8	3.4	5,671	
PR TIMES	1.3	3.7	12,025	
ラクス	—	51.2	103,731	
ランドコンピュータ	2.3	2.9	3,062	
ダブルスタンダード	1.8	2.3	11,166	
オーブントア	6.9	10.2	26,866	
マイネット	4.4	5.5	4,053	
アカツキ	4.9	6.9	24,219	
ベネフィットジャパン	1.2	1.5	3,048	
Ubicomホールディングス	3.2	4.6	14,283	
LINE	31.2	—	—	
カナミックネットワーク	12.7	18.7	12,342	
ノムラシステムコーポレーション	3.5	8.7	2,557	
チェンジ	4.8	31.3	92,835	
シンクロ・フード	6.5	11.1	4,218	
オークネット	8.6	9.2	12,622	
キャピタル・アセット・プランニング	—	3.7	3,944	
セグエグループ	3.3	4.7	5,419	
エイトレッド	2.4	3.4	7,612	
AOI TYO Holdings	14.3	17.6	15,804	
マクロミル	28.1	35.1	29,905	
ビーグリー	2.8	3.6	4,640	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
オロ	3.7	5.5	19,607			
ユーザーローカル	1.4	2.6	10,660			
テモナ	3.3	4	4,088			
ニーズウェル	3	4.1	2,521			
サインポスト	3	4.1	3,690			
ソルクシーズ	6.2	6.9	6,775			
フェイス	5.2	5.6	4,737			
プロトコーポレーション	12.4	20.6	23,957			
ハイマックス	1.7	5.2	5,538			
野村総合研究所	192.7	294.6	1,028,154			
サイバネットシステム	10.1	12.5	10,050			
CEホールディングス	7.7	9.7	5,238			
日本システム技術	2.4	3.3	5,078			
インテージホールディングス	17.3	21.4	33,148			
東邦システムサイエンス	3.9	4.9	4,532			
ソースネクスト	65.3	81.7	24,019			
インフォコム	15	15.6	39,639			
HEROZ	2	5	12,210			
ラクスル	11	18.5	87,042			
I P S	—	4.1	11,193			
F I G	15.7	19.7	5,673			
システムサポート	3.2	5.3	7,128			
イーゾル	6.7	9.5	10,839			
アルテリア・ネットワークス	15.2	19	30,134			
E d u L a b	—	1.7	9,452			
東海ソフト	1.2	2.9	3,799			
ウイングアーク1st	—	9	21,573			
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2.6	4	8,152			
サーバーワークス	—	1.7	6,460			
東名	—	1.9	2,027			
ヴィッツ	—	1.8	3,452			
トピラシステムズ	1.8	2.5	3,255			
S a n s a n	—	15.1	124,726			
L i n k e r - U	—	3.4	3,757			
ギフティ	—	10.3	35,071			
ベース	—	2	10,660			
フォーカスシステムズ	8.7	11.8	10,407			
クレスコ	8.4	11.3	18,972			
フジ・メディア・ホールディングス	131.1	176.2	218,135			
オービック	47.1	53.4	1,095,768			
ジャストシステム	22.1	24.2	142,780			
TDCソフト	12.2	15.2	15,473			
Zホールディングス	1,866.4	2,329.7	1,198,863			
トレンドマイクロ	60.5	90.6	502,830			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
IDホールディングス	5.4	6.7	8,951			
日本オラクル	27.6	34.4	342,968			
アルファシステムズ	4.3	4.6	16,560			
フューチャー	16.6	20.6	41,715			
C A C H o l d i n g s	9.1	11.3	16,102			
S B テクノロジー	5	6.2	18,817			
トーセ	4	5.1	4,176			
オービックビジネスコンサルタント	13.9	17.3	103,627			
伊藤忠テクノソリューションズ	62	77.3	266,685			
アイティフォー	16.8	22.6	17,469			
東計電算	2.1	2.6	11,843			
エックスネット	2.4	3	3,066			
大塚商会	73.6	91.8	537,948			
サイボウズ	16	20	48,640			
ソフトブレーン	8.5	—	—			
電通国際情報サービス	8.5	21.1	80,918			
A C C E S S	13	21.6	18,900			
デジタルガレージ	24.5	28.1	126,028			
EMシステムズ	19.4	28.4	23,515			
ウェザーニューズ	4.7	5.2	27,664			
C I J	9.6	12	10,116			
ビジネスエンジニアリング	1.7	1.8	5,877			
日本エンタープライズ	14.8	19	4,104			
WOWOW	6.6	8.3	19,297			
スカラ	9.4	15.6	12,495			
インテリジェント ウェイブ	8.3	10.5	7,066			
I M A G I C A G R O U P	12.3	15.2	7,767			
ネットワンシステムズ	51.8	69.3	230,422			
システムソフト	32.7	37.5	5,737			
アルゴグラフィックス	11.6	13.3	39,793			
マーベラス	21.1	27.2	22,032			
エイベックス	23.6	29.4	44,305			
日本ユニシス	42.5	58.9	186,713			
兼松エレクトロニクス	7.5	9.3	33,340			
都築電気	—	7.8	14,640			
T B S ホールディングス	82.8	112.7	207,029			
日本テレビホールディングス	113.6	141.8	185,332			
朝日放送グループホールディングス	13.9	17.4	12,336			
テレビ朝日ホールディングス	37.5	52.6	98,625			
スカパーJSATホールディングス	90	112.5	48,712			
テレビ東京ホールディングス	11.3	12.3	26,297			
日本BS放送	4.8	6.1	6,703			
ビジョン	13	21.4	21,464			
スマートバリュー	3.8	4.9	4,008			
ワイヤレスゲート	6.9	7.8	3,315			

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
コネクシオ	7.9	9.9	14,513	
クロップス	2.9	3.5	2,947	
日本電信電話	1,816.3	1,983	5,813,164	
KDDI	1,012.6	1,359.6	5,053,633	
ソフトバンク	1,234.9	1,540.9	2,167,275	
光通信	14	20	435,600	
NTTドコモ	971.6	—	—	
エムティーアイ	13.6	17	11,917	
GMOインターネット	53.7	60.1	177,715	
ファイバーゲート	4.6	5.8	7,719	
アドマーケティングコミュニケーション	4.6	5.3	2,231	
KADOKAWA	36.7	44	191,620	
学研ホールディングス	18.4	24.2	32,234	
ゼンリン	27.3	31.1	36,231	
昭文社ホールディングス	7	7.6	3,610	
インプレスホールディングス	11.2	14	3,024	
アイネット	7.2	9	12,951	
松竹	9	11.2	142,688	
東宝	80.2	100.1	453,953	
東映	5.1	5.6	127,120	
エヌ・ティ・ティ・データ	362	451.6	803,848	
ビー・シー・エー	2.4	2.6	10,933	
ビジネスブレイン太田昭和	2.4	6	10,758	
DTS	30.5	35.3	89,767	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58	72.4	423,540	
シーイーシー	14.7	18.4	25,539	
カブコン	64.1	145.4	523,440	
アイ・エス・ピー	2.8	8.1	10,683	
ジャステック	8.9	11.1	14,463	
SCSK	31.4	39.2	248,920	
日本システムウエア	4.6	5.8	13,206	
アイネス	13.6	17	22,270	
TKC	11.5	28.8	97,920	
富士ソフト	17.4	18.1	99,188	
NSD	43.8	54.7	97,037	
コナミホールディングス	49.4	61.6	432,432	
福井コンピュータホールディングス	5.4	7.9	34,128	
JBCホールディングス	9.3	11.7	15,561	
ミロク情報サービス	12.1	17	27,183	
ソフトバンクグループ	1,078.1	1,345.2	11,105,971	
卸売業(4.7%)				
ハウスイ	1.1	1.4	1,341	
高千穂交易	5.3	6.6	7,583	
オルバヘルスクエアホールディングス	1.6	2.8	4,832	
伊藤忠食品	3.4	4.1	20,459	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
エレマテック	12.8	13.6	16,700	
JALUX	3.9	4.8	8,280	
あらた	10.9	13.5	57,105	
トーメンデバイス	2.1	2.2	8,690	
東京エレクトロン デバイス	4.9	5.6	34,048	
フィールズ	10.4	14.9	6,943	
双日	753.2	939.8	317,652	
アルフレッサ ホールディングス	151.6	176.5	298,638	
横浜冷凍	35.7	47.7	41,689	
ラサ商事	7.2	9	8,262	
アルコニックス	14.5	18.1	27,711	
神戸物産	47.1	117.4	324,493	
ハイパー	2.1	3.5	1,918	
あい ホールディングス	19.5	24.3	52,682	
ディーブイエックス	4.9	5.2	4,997	
ダイワボウホールディングス	11.6	77.5	132,447	
マクニカ・富士エレホールディングス	32.5	40.6	98,495	
ラクト・ジャパン	5.1	7.4	19,906	
グリムス	—	5.1	9,271	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25.7	29.6	21,104	
八洲電機	10.6	13.2	12,724	
メディアスホールディングス	7.8	9.7	10,660	
レスターホールディングス	14.2	17.7	32,196	
ジューテックホールディングス	3.1	3.9	4,036	
大光	5.8	6.6	4,468	
OCHIホールディングス	4	5	6,425	
TOKAIホールディングス	72.1	82.5	72,600	
黒谷	3.8	4.7	4,638	
Cominix	2.4	3	2,238	
三洋貿易	13.7	17.2	21,826	
ビューティガレージ	2.2	2.7	9,882	
ウイン・パートナーズ	9.9	12.3	12,140	
ミタチ産業	4.1	4.7	3,031	
シップヘルスクエアホールディングス	21.9	60	155,220	
明治電機工業	4.3	5.9	8,130	
デリカフーズホールディングス	4.8	6.7	4,281	
スターティアホールディングス	3.1	3.3	4,818	
コメダホールディングス	29.7	37.1	74,867	
ピーバンドットコム	1.4	2.4	1,982	
アセンテック	1.5	4.4	5,803	
富士興産	4.2	5.2	6,484	
協栄産業	1.5	1.9	2,612	
小野建	12.2	15.3	19,890	
南陽	3	3.5	6,636	
佐鳥電機	9.3	10.6	8,236	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
エコートレーディング	3.2	3.6	2,214			
伯東	8.3	10.4	16,255			
コンドーテック	10.6	13.2	13,226			
中山福	7.9	9.9	4,385			
ナガイレーベン	18.1	22.6	58,172			
三菱食品	15	18.7	53,743			
松田産業	10	12.4	27,776			
第一興商	20.3	33.8	144,495			
メディパルホールディングス	147.2	170.5	357,027			
S P K	5.9	7.3	9,840			
萩原電気ホールディングス	5.1	6.3	15,107			
アズワン	8.9	12.2	152,378			
スズデン	4.7	5.9	8,507			
尾家産業	4	5	5,990			
シモジマ	8.4	10.4	11,242			
ドウシシャ	12.9	16.1	26,774			
小津産業	3	3.8	7,353			
高速	8.1	9	12,780			
たけびし	4.8	6	9,426			
リックス	3.1	3.9	5,967			
丸文	12.1	15.1	8,939			
ハビネット	11.4	14.2	20,391			
橋本総業ホールディングス	2.8	3.4	9,084			
日本ライフライン	40.4	55	76,175			
タカショー	8.9	11.1	8,735			
マルカ	4.8	5.5	12,870			
I D O M	36.8	57.4	34,727			
進和	8.1	10.1	21,250			
エスケイジャパン	3	4.2	1,831			
ダイترون	5.8	7.2	14,104			
シークス	17.4	21.7	33,895			
田中商事	4.2	5.3	3,460			
オーハシテクニカ	7.7	8.7	13,363			
白銅	4.9	6.1	11,108			
ダイコー通産	—	2	3,108			
伊藤忠商事	953.8	1,190.1	3,866,634			
丸紅	1,419.5	1,678	1,623,129			
高島	2.2	2.7	4,652			
長瀬産業	76.7	93.4	150,093			
蝶理	8.7	10.9	18,704			
豊田通商	152.2	170.9	838,264			
三共生興	20.7	25.8	13,416			
兼松	50.9	68	99,484			
ツカモトコーポレーション	2.4	2.8	3,805			
三井物産	1,180.8	1,357.4	3,276,763			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
日本紙パルプ商事	7.8	8.9	31,550			
カメイ	17.8	22.2	25,596			
東都水産	1.7	2	8,960			
O U Gホールディングス	2.2	2.7	7,524			
スターゼン	5	12.6	26,384			
山善	53.3	66.5	64,106			
椿本興業	2.5	3.1	10,648			
住友商事	860.4	1,073.8	1,640,766			
内田洋行	5.4	7.3	34,602			
三菱商事	957	1,036	3,091,424			
第一実業	6.7	7.7	32,956			
キャノンマーケティングジャパン	33.8	42.2	107,863			
西華産業	7.7	9	15,957			
佐藤商事	11.3	14.1	15,679			
菱洋エレクトロ	13.8	13	34,710			
東京産業	12.4	15.5	9,377			
ユアサ商事	12.9	17.4	52,287			
神鋼商事	3.4	3.8	8,838			
トルク	8.2	10.3	2,482			
阪和興業	25.5	34.1	105,539			
正栄食品工業	8.8	11	43,615			
カナデン	11.1	13.8	14,904			
菱電商事	9.8	12.3	19,557			
フルサト工業	7.5	8.6	15,497			
岩谷産業	30.3	40.8	263,568			
ナイス	5.8	6.7	13,587			
昭光通商	4.4	—	—			
ニチモウ	2.1	2.7	5,580			
極東貿易	3.9	4.9	10,633			
イワキ	17.9	24.5	17,027			
三愛石油	33.6	41.9	49,442			
稲畑産業	30	40.9	69,939			
G S Iクレオス	3.4	8.4	8,559			
明和産業	12.6	15.8	7,394			
クワザワホールディングス	4.9	6.1	3,501			
ヤマエ久野	9.9	12.4	13,999			
ワキタ	29.1	33.5	37,252			
東邦ホールディングス	43.8	54.6	93,639			
サンゲツ	37.2	45.9	70,089			
ミツロコグループホールディングス	20.1	25.1	30,521			
シナネンホールディングス	5.6	6.3	17,406			
伊藤忠エネクス	30.2	37.7	37,888			
サンリオ	38.3	47.8	86,613			
サンワテクノス	9.7	11.2	13,641			
リョーサン	15.1	18.8	38,051			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
新光商事	21.4	23	16,882	
トーヨー	6.2	7.7	12,943	
三信電気	7.3	9.1	19,428	
東陽テクニカ	14.6	16.8	18,480	
モスフードサービス	17.9	24.1	73,987	
加賀電子	13.6	15.4	45,491	
ソーダニッカ	14.1	16.3	9,454	
立花エレテック	10.1	12.6	18,459	
フォーバル	6	6	5,322	
PAL TAC	21.9	27.3	157,794	
三谷産業	18	22.5	8,820	
西本Wismettaホールディングス	2.5	3.9	10,881	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.2	1.5	3,010	
コア商事ホールディングス	—	12.8	9,126	
国際紙パルプ商事	32.4	36.4	8,990	
ヤマタネ	6.8	7.3	10,920	
丸紅建材リース	1.3	1.7	3,058	
日鉄物産	9.7	12.1	52,030	
泉州電業	4.2	4.8	16,056	
トラスコ中山	28.4	39	107,406	
オートバックスセブン	50.6	63.1	92,126	
モリト	10	12.5	7,537	
加藤産業	19.7	24.6	80,934	
北恵	3.5	4.3	3,904	
イノテック	7.1	9.6	12,672	
イエローハット	25.8	32.2	62,274	
JKホールディングス	12.3	15.4	12,119	
日伝	12.3	14.1	28,059	
北沢産業	10.3	11.7	2,913	
杉本商事	7.4	8.6	19,023	
因幡電機産業	38.8	45.4	115,951	
東テク	4.5	5.6	15,545	
ミスミグループ本社	170.9	213.5	751,520	
アルテック	10.9	12.6	4,460	
タキヒヨー	4.1	5.7	10,311	
蔵王産業	2.6	3.3	4,821	
スズケン	57.8	72.1	249,466	
ジェコス	9.4	11.8	10,325	
グローセル	13.7	18.5	7,696	
小売業(4.5%)				
ローソン	34.5	43.1	212,483	
サンエー	11.4	13	55,185	
カワチ薬品	10.6	12	26,640	
エービーシー・マート	21.3	26.6	166,250	
ハードオフコーポレーション	5.7	8	6,080	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
アスクル	14.3	27.7	49,444	
ゲオホールディングス	24.7	23.1	25,548	
アダストリア	19	23.8	44,982	
ジーフット	8.2	—	—	
くら寿司	7.2	20.1	77,787	
キャンドウ	6.6	8.3	16,292	
アイケイ	—	5.4	4,131	
パルグループホールディングス	14.1	15.1	23,993	
エディオン	62.8	72.5	78,445	
サーラコーポレーション	28	35.2	20,662	
ワッツ	6.3	8.7	7,899	
ハローズ	5.2	7	19,334	
フジオフードグループ本社	11.6	14.3	18,833	
あみやき亭	3	3.8	10,883	
ひらまつ	25.1	—	—	
大黒天物産	3.3	5.5	41,745	
ハニーズホールディングス	12.2	13.9	13,900	
ファーマライズホールディングス	3.6	4.6	3,565	
アルペン	10.6	13.2	35,455	
ハブ	4.2	6	4,278	
クオールホールディングス	20.2	23.2	34,405	
ジンズホールディングス	7.2	11.6	92,916	
ビックカメラ	81.1	101.3	109,606	
DCMホールディングス	75.7	105.4	107,508	
MonotaRO	97	242.1	615,418	
東京一番フーズ	3.9	5	2,920	
DDホールディングス	5.4	—	—	
きちりホールディングス	3.9	4.5	2,646	
アークランドサービスホールディングス	10.1	14.4	32,731	
J. フロント リテイリング	163.1	203.5	218,966	
ドトール・日レスホールディングス	19.7	27.2	44,363	
マツモトキヨシホールディングス	56.4	70.4	332,640	
ブロンコビリー	7.2	9.1	20,911	
ZOZO	93.9	100.4	371,982	
トレジャー・ファクトリー	4.3	5.4	5,578	
物語コーポレーション	3.7	9.1	60,060	
ココカラファイン	14.3	15.2	120,688	
三越伊勢丹ホールディングス	238.7	298.2	234,087	
Hamee	5	4.6	6,872	
マーケットエンタープライズ	—	1.4	1,516	
ウエルシアホールディングス	40.6	90.1	301,384	
クリエイトSDホールディングス	23	25.2	81,144	
丸善CHIホールディングス	15.9	19.9	7,960	
ミサワ	—	4	2,756	
ティーライフ	2.2	2.6	3,720	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
チムニー	4.3	5.2	6,858	
シュッピン	9.5	12	10,908	
オイシックス・ラ・大地	13.5	22.5	69,750	
ネクステージ	19.8	30.2	48,471	
ジョイフル本田	40.1	50.1	65,480	
鳥貴族ホールディングス	4.1	6.5	11,557	
キリン堂ホールディングス	5.5	—	—	
ホットランド	9.3	13	18,057	
すかいらくホールディングス	152.9	190.9	294,367	
SFPホールディングス	7.9	8.3	10,956	
綿半ホールディングス	5.2	13.1	15,995	
ヨシックス	2.3	3.5	7,273	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	39.8	49.8	53,684	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6.6	9.1	12,285	
BEENOS	6.5	8.7	31,624	
あさひ	10.3	12.9	18,085	
日本調剤	8.4	10.6	16,938	
コスモス薬品	12.1	17.2	261,956	
トーエル	6.9	8.8	6,705	
オンリー	2.7	3.8	1,729	
セブン&アイ・ホールディングス	533.5	665.7	3,152,755	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	73.5	91.5	73,383	
ツルハホールディングス	29.7	37.1	493,430	
サンマルクホールディングス	10.9	13.7	21,139	
フェリシモ	3.2	4.1	5,465	
トリドールホールディングス	33.9	42.3	71,910	
TOKYO BASE	12.9	15.9	10,700	
ウイルプラスホールディングス	2	3	3,864	
JMホールディングス	10.4	11.6	23,942	
サツドラホールディングス	2.1	2.7	5,564	
アレンザホールディングス	7.1	13.3	15,999	
串カツ田中ホールディングス	2.9	4.7	8,601	
パロックジャパンリミテッド	9.8	12.3	9,618	
クスリのアオキホールディングス	12.2	17	130,560	
力の源ホールディングス	6.5	7.7	4,812	
FOOD & LIFE COMPANIES	74.9	99.7	490,524	
LIXILビバ	13.5	—	—	
メディカルシステムネットワーク	13.6	15.3	11,016	
はるやまホールディングス	6.7	8.5	5,669	
ノジマ	24.3	30.4	91,504	
カッパ・クリエイト	19.1	23.9	34,726	
ライトオン	10.2	12.7	8,521	
良品計画	181.2	196	407,484	
三城ホールディングス	15.2	22.5	6,007	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
アドヴァン	21	17.7	16,620	
アルビス	5.3	5.6	12,807	
コナカ	16.7	20	6,840	
ハウス オブ ローゼ	1.8	2.3	3,772	
G-7ホールディングス	8.1	8.4	24,948	
イオン北海道	18.2	22.6	23,097	
コジマ	23.9	29.7	23,789	
ヒマラヤ	5	6.3	6,369	
コーナン商事	19.5	24.3	72,778	
エコス	5.1	6.5	12,031	
ワタミ	16.3	22.4	20,406	
マルシェ	3.9	4.5	2,182	
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	299.8	340.3	733,686	
西松屋チェーン	30.1	37.6	57,603	
ゼンショーホールディングス	65.4	91.5	249,703	
幸楽苑ホールディングス	8.8	10.8	16,945	
ハークスレイ	3	4	3,696	
サイゼリヤ	20.3	25.4	61,569	
VTホールディングス	57.1	64.9	30,048	
魚力	3.9	5.5	10,774	
フジ・コーポレーション	3.7	9.3	11,476	
ユナイテッドアローズ	14.4	19.7	36,523	
ハイデイ日高	19.8	24.8	42,804	
京都きもの友禅	9.5	12.3	3,247	
コロワイド	45.3	56.5	107,971	
ピーシーデポコーポレーション	18.4	20.6	9,064	
壳番屋	9.6	12.1	57,051	
PLANT	3.8	4.9	3,528	
スギホールディングス	27.3	34	293,080	
薬王堂ホールディングス	6	7.6	18,072	
スクロール	21.5	24.7	22,279	
ヨンドシーホールディングス	14	15.9	29,319	
ファミリーマート	109	—	—	
木曽路	17.9	22.4	51,923	
SRSホールディングス	16.3	22.4	18,211	
タカキュー	12	—	—	
リテールパートナーズ	18.2	21	23,877	
ケーヨー	28.3	31.7	23,141	
上新電機	16.1	19.7	52,008	
日本瓦斯	21.6	84.3	142,382	
ロイヤルホールディングス	23.9	29.7	60,469	
いなげや	17	19.1	28,210	
島忠	25.7	—	—	
チヨダ	14.5	18.2	15,888	

銘柄	当期首(前期末)		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ライフコーポレーション	10.4	17.1	57,541
リンガーハット	16.9	21	46,662
MrMaxHD	19.2	24	14,784
テンアライド	12.6	—	—
AOKIホールディングス	27.6	34.6	22,040
オークワ	21.5	26.9	29,751
コメリ	21.1	26.4	68,244
青山商事	28.4	38.3	32,861
しまむら	15.9	19.8	206,316
はせがわ	7.7	10.3	3,028
高島屋	99.5	124.1	154,380
松屋	27.7	37.4	34,370
エイチ・ツー・オー リテイリング	64.8	80.8	70,942
近鉄百貨店	5.3	6.6	20,361
丸井グループ	125.1	144	300,240
アクシアル リテイリング	11.4	14.2	55,380
イオン	524.8	654.8	1,919,873
イズミ	27.8	34.6	141,687
平和堂	27.8	31.5	73,363
フジ	16.5	20.6	41,982
ヤオコー	15.5	19.3	121,011
ゼビオホールディングス	16.7	21	19,761
ケーズホールディングス	131.7	145.1	188,630
Olympicグループ	7.3	9.3	7,105
日産東京販売ホールディングス	21	26.6	6,570
シルバーライフ	1.9	3.6	8,964
一家ダイニングプロジェクト	1.4	—	—
Genky DrugStores	6.1	7.6	25,308
ナルミヤ・インターナショナル	3.3	3.6	4,082
ブックオフグループホールディングス	7.9	9.9	9,256
ギフト	—	2.3	5,278
アインホールディングス	16.8	24.8	166,656
元気寿司	3.5	4.9	12,867
ヤマダホールディングス	415.9	571	303,772
アークランドサカモト	21.5	26.9	39,435
ニトリホールディングス	59	67.5	1,280,137
グルメ杵屋	9.9	12.5	12,087
愛眼	10.9	13.6	3,114
ケーユーホールディングス	7.4	9.3	8,807
吉野家ホールディングス	44.9	56.1	112,592
松屋フーズホールディングス	6.6	8.3	28,635
サガミホールディングス	18.4	24.4	25,180
関西スーパーマーケット	11.5	13.2	12,936
王将フードサービス	10	11.3	62,715
プレナス	15.4	19.3	37,345

銘柄	当期首(前期末)		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ミニストップ	10.2	12.7	17,119
アークス	28	32.6	77,848
パローホールディングス	30.3	34.9	77,582
ベルク	6.8	8.5	46,835
大庄	7.4	9.5	9,338
ファーストリテイリング	18.2	22.8	2,033,076
サンドラッグ	51.4	64.1	235,247
サックスパー ホールディングス	11.9	15.1	9,271
ヤマザワ	3.3	4.2	7,140
やまや	2.9	3.5	7,973
ペルーナ	29.7	36.9	40,147
銀行業(5.2%)			
島根銀行	3.6	5.9	3,817
じもとホールディングス	92.3	11.5	7,532
めぶきフィナンシャルグループ	709.6	885.4	205,412
東京きらぼしフィナンシャルグループ	18.4	21.4	28,954
九州フィナンシャルグループ	298.8	348	142,680
ゆうちょ銀行	386.9	482.7	449,393
富山第一銀行	32.6	40.6	11,124
コンコルディア・フィナンシャルグループ	780	1,038.1	416,278
西日本フィナンシャルホールディングス	90.9	111.3	75,016
関西みらいフィナンシャルグループ	80.1	—	—
三十三フィナンシャルグループ	12.7	14.7	19,271
第四北越フィナンシャルグループ	23.7	27.7	65,621
ひろぎんホールディングス	—	251.3	147,261
新生銀行	100.2	138.9	236,130
あおぞら銀行	81.4	101.5	251,009
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,341.8	11,656.2	7,226,844
りそなホールディングス	1,498.6	1,966.4	918,702
三井住友トラスト・ホールディングス	258.1	322.1	1,214,639
三井住友フィナンシャルグループ	944.5	1,179.2	4,659,019
千葉銀行	455.7	568.7	395,815
群馬銀行	262.3	350.7	123,446
武蔵野銀行	20.3	25.4	43,129
千葉興業銀行	37.4	43.4	11,414
筑波銀行	56.8	70.8	12,106
七十七銀行	46.1	53.5	70,834
青森銀行	10.6	13.2	28,630
秋田銀行	8.8	10.2	14,229
山形銀行	15.3	19.1	16,960
岩手銀行	8.9	11.2	20,204
東邦銀行	122.1	152.4	31,242
東北銀行	6.5	8.2	8,429
みちのく銀行	8.8	10.9	10,867
ふくおかフィナンシャルグループ	115	153.8	307,907

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
静岡銀行	338.2	415	359,805	
十六銀行	17.1	21.4	42,372	
スルガ銀行	139.7	149.4	52,887	
八十二銀行	329.6	383.8	142,389	
山梨中央銀行	15.9	19.8	16,117	
大垣共立銀行	27	33.7	62,850	
福井銀行	11.7	14.6	22,016	
北國銀行	13.6	15.8	36,592	
清水銀行	5.6	7	10,969	
富山銀行	2.6	3.3	8,537	
滋賀銀行	27.4	34.2	69,049	
南都銀行	22.7	24.8	46,028	
百五銀行	122.9	153.3	47,829	
京都銀行	48.9	61	328,790	
紀陽銀行	48.4	60.3	87,314	
ほくほくフィナンシャルグループ	90.9	113.4	99,225	
広島銀行	201.6	—	—	
山陰合同銀行	81	107.4	56,277	
中国銀行	117.5	146.6	125,782	
鳥取銀行	4.7	5.4	6,080	
伊予銀行	194.9	225.8	130,286	
百十四銀行	14.5	18.1	26,281	
四国銀行	20.7	24.2	16,649	
阿波銀行	22.3	26.1	53,687	
大分銀行	7.9	9.8	16,699	
宮崎銀行	9.1	10.6	21,443	
佐賀銀行	8.3	9.7	13,434	
沖縄銀行	12.5	15.6	40,388	
琉球銀行	31.5	37	25,937	
セブン銀行	456.2	569.3	129,231	
みずほフィナンシャルグループ	18,556.6	2,315.4	3,873,664	
高知銀行	5	6.2	5,108	
山口フィナンシャルグループ	170.5	212.7	135,915	
長野銀行	4.5	5.6	6,305	
名古屋銀行	10.2	13.7	36,318	
北洋銀行	205.9	256.9	62,683	
愛知銀行	4.9	5.7	15,885	
中京銀行	5.6	6.1	8,985	
大光銀行	4.7	5.8	7,940	
愛媛銀行	19.1	23.8	19,468	
トマト銀行	5.3	6.6	6,903	
京葉銀行	58.2	72.7	29,879	
栃木銀行	66	82.3	14,320	
北日本銀行	4.3	5.3	9,126	
東和銀行	24	29.9	16,474	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
福島銀行	12.9	19.5	4,309	
大東銀行	7.1	8.2	4,969	
トモニホールディングス	105.6	131.7	39,114	
フィデアホールディングス	132.6	165.4	19,848	
池田泉州ホールディングス	157	195.9	31,344	
証券、商品先物取引業(0.8%)				
F P G	42.4	57.6	42,048	
ジャパンインベストメントアドバイザー	—	11.6	16,762	
マーキュリアインベストメント	6.4	6.9	5,112	
S B I ホールディングス	152.6	210	580,230	
ジャフコ グループ	21	26.2	208,028	
大和証券グループ本社	1,096.2	1,276.5	803,939	
野村ホールディングス	2,403.3	2,602	1,563,802	
岡三証券グループ	116.9	145.7	63,379	
丸三証券	41	50.9	33,237	
東洋証券	50.2	57.6	9,446	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	157.5	182.2	74,155	
光世証券	3.6	4.4	2,908	
水戸証券	40.4	46.2	13,906	
いちよし証券	25.9	34.5	20,838	
松井証券	78.2	83.7	69,722	
だいこう証券ビジネス	6.8	—	—	
マネックスグループ	101	153.1	124,929	
極東証券	18.7	23.1	18,849	
岩井コスモホールディングス	13.1	17.6	29,620	
藍澤證券	24.8	30.8	33,572	
マネーパートナーズグループ	15.4	19.1	4,507	
スパークス・グループ	63.9	79.5	22,339	
保険業(2.0%)				
かんぽ生命保険	48.4	211.2	443,520	
SOMPOホールディングス	256.8	300.4	1,322,961	
アニコム ホールディングス	11.3	47.9	46,127	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	357.1	413.8	1,383,333	
ソニーフィナンシャルホールディングス	112.2	—	—	
第一生命ホールディングス	772.8	900.2	2,010,146	
東京海上ホールディングス	482.8	561.2	2,906,454	
T & Dホールディングス	408.2	509.3	758,857	
アドバンスクリエイト	2.8	8.1	7,047	
その他金融業(1.1%)				
全国保証	38.5	44.4	200,022	
ジェイリース	3.8	—	—	
イントラスト	4.8	5.2	3,551	
日本モーゲージサービス	2.8	9	8,613	
C a s a	4.8	5	4,770	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
アルビ	21.7	25.3	39,721
プレミアグループ	7.4	8	25,920
クレディセゾン	95.7	99.7	134,495
芙蓉総合リース	14.3	17.9	129,954
みずほリース	21.1	26.4	91,344
東京センチュリー	27.5	39.6	255,024
日本証券金融	60.2	72.4	64,580
アイフル	208.3	286.7	103,498
リコーリース	10.7	13.5	45,697
イオンフィナンシャルサービス	83.6	104.5	133,028
アコム	274.5	343	167,727
ジャックス	15.1	18.9	47,363
オリエントコーポレーション	369.4	462.7	70,793
日立キャピタル	32.2	—	—
アプラスフィナンシャル	65.5	—	—
オリックス	854.1	1,034.6	1,998,329
三菱HCキャピタル	346.6	589.8	359,778
九州リースサービス	6.7	8.8	5,869
日本取引所グループ	392	460.4	1,164,812
イー・ギャランティ	14.6	19.7	41,941
アサックス	7.1	9.2	6,274
NECキャピタルソリューション	5.6	7.1	14,476
不動産業(2.0%)			
いちご	180.3	194.1	67,740
日本駐車場開発	149.1	196.8	29,913
スター・マイカ・ホールディングス	8.3	10.2	10,689
SREホールディングス	—	2.8	15,540
ADワークスグループ	25.3	34.2	5,540
ビューリック	293.5	362.7	446,483
三栄建築設計	7.1	7.6	15,184
野村不動産ホールディングス	83.9	104.1	292,208
三重交通グループホールディングス	31.7	37.6	17,897
サムティ	20.8	25	48,200
ディア・ライフ	23.6	25.2	11,541
日本商業開発	10	11.6	20,938
プレサンスコーポレーション	—	28.9	48,205
ハウスコム	3.8	4.2	4,981
日本管理センター	10.7	10.4	12,989
サンセイランディック	6.4	6.8	5,861
フージャースホールディングス	27.2	27.8	20,433
オープンハウス	40.4	54.4	276,896
東急不動産ホールディングス	375	465.6	302,640
飯田グループホールディングス	115.2	142.6	415,821
イーグランド	5.1	4.3	4,188
ムゲンエステート	13.2	13.5	6,844

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
ハウスドゥ	6.7	8.4	8,778
シーアールイー	4.9	5.5	8,206
グッドコムアセット	4.5	9.2	12,502
ジェイ・エス・ビー	3.7	3.6	12,510
テンポイノベーション	5.6	6.6	5,643
フェイスネットワーク	—	2.5	3,320
パーク24	74.3	92.1	210,540
パラカ	4.7	5.3	8,538
三井不動産	674.5	777.2	1,981,471
三菱地所	958	1,120.2	1,986,674
平和不動産	25.7	29.5	122,277
東京建物	145.3	169.2	275,457
ダイビル	37.1	44.4	55,455
京阪神ビルディング	23.3	30.5	41,358
住友不動産	307.7	383.4	1,395,192
テーオーシー	29.7	35.5	25,027
東京楽天地	2.7	3.2	12,816
スターツコーポレーション	19.5	20.8	56,867
フジ住宅	19.5	22.2	13,786
空港施設	18.1	19.5	12,148
明和地所	11.9	10.5	6,436
ゴールドクレスト	12	16.2	28,123
エスリード	6.7	7.6	12,357
日神グループホールディングス	25	28.4	13,120
日本エスコン	24.7	30.9	23,638
タカラレーベン	62.4	71.4	24,490
AVANTIA	10.3	10.5	9,324
イオンモール	69.8	86.3	153,527
毎日コムネット	5.8	8	5,576
ファースト住建	7.9	8.5	10,599
カチタス	34.7	42.7	130,448
トーセイ	20.7	24.9	25,896
穴吹興産	4.2	4.4	9,561
サンフロンティア不動産	21.1	22.6	20,837
エフ・ジェー・ネクスト	14.2	18.2	18,600
インテリックス	3.8	3.8	2,971
ランドビジネス	4.6	7.2	2,649
サンネクスタグループ	6	6.9	6,941
グランディハウス	15.6	15.1	6,417
日本空港ビルディング	44	59.5	290,062
サービス業(5.6%)			
明豊ファシリティワークス	—	7.9	6,572
日本工営	8.9	10.4	32,812
LIFULL	46.5	51.2	18,790
ミクシィ	—	42.1	111,733

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
ジェイエイシーリクルートメント	9	11.5	20,585
日本M&Aセンター	100	270.9	709,758
メンバーズ	4	5	14,475
中広	2.1	3	1,068
UTグループ	20.9	23.9	70,959
アイティメディア	5.4	5.7	9,929
タケエイ	12.8	18.6	23,975
E・Jホールディングス	2.4	8.9	9,496
夢真ビーネックスグループ	16.7	44.1	56,580
コシダカホールディングス	32.1	44.6	28,410
アルトナー	3.4	4.3	3,483
パソナグループ	14.4	18	34,164
CDS	3.4	4.3	6,454
リンクアンドモチベーション	29.5	30.3	16,695
GCA	16.2	21.9	19,359
エス・エム・エス	41.2	56.2	164,441
サニーサイドアップグループ	4.7	6.1	4,739
パーソルホールディングス	132.4	165.2	342,790
リニカル	6.5	9.7	7,110
クックパッド	46.6	52.9	13,542
エスクリ	4.4	—	—
アイ・ケイ・ケイ	6.7	8.4	5,678
学情	4.8	6	8,568
スタジオアリス	6.7	8.4	18,790
シミックホールディングス	6.6	9.3	13,987
エプコ	2.9	4.3	4,097
NJS	3	4.2	8,790
総合警備保障	52.7	65.7	329,157
カカコム	97.8	122	406,870
アイロムグループ	4.7	5.9	12,201
セントケア・ホールディング	8.9	12.3	12,336
サイネックス	2.4	3.2	2,236
ルネサンス	7.5	10.6	12,847
ディップ	18.7	25.9	83,786
デジタルホールディングス	7.3	11.6	26,633
新日本科学	—	20.5	15,949
ツクイホールディングス	31.4	—	—
キャリアデザインセンター	3.2	4.4	4,831
ベネフィット・ワン	48.2	60.2	187,222
エムスリー	291.8	291.3	2,157,659
ツカダ・グローバルホールディング	8.7	13.1	5,069
プラス	1.9	—	—
アウトソーシング	75.9	94.7	191,388
ウェルネット	13.5	17.2	8,789
ワールドホールディングス	4.6	5.8	15,062

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
ディー・エヌ・エー	64.9	70	153,580
博報堂DYホールディングス	184.1	229.9	416,808
ぐるなび	23.2	29.2	16,965
タカミヤ	14.3	20.5	10,475
ジャパンベストレスキューシステム	10.4	11.2	7,795
ファンコミュニケーションズ	36.7	46.1	17,702
ライク	4.4	4.5	9,558
ビジネス・ブレークスルー	5.9	7.5	3,270
エスプール	34.1	42.7	36,551
WDBホールディングス	6.1	7.6	19,380
手間いらず	0.9	2.1	13,755
ティア	8	10.2	4,814
CDG	1.5	1.7	2,696
アドウェイズ	—	27.1	23,875
バリューコマース	7.5	11.2	33,600
インフォマート	145.1	167.3	153,916
J Pホールディングス	42	48.1	13,900
エコナックホールディングス	25.2	32.9	2,928
E P Sホールディングス	18	25	44,950
レグス	3.4	4.2	10,638
プレステージ・インターナショナル	49.7	62.3	42,737
アミューズ	7.3	9.1	19,838
ドリームインキュベータ	4.1	5.3	5,162
クイック	8.3	10.5	12,873
TAC	8.7	10.1	2,454
ケネディクス	123.5	—	—
電通グループ	136.4	185.7	698,232
テイクアンドギヴ・ニーズ	5.2	—	—
びあ	3.8	—	—
イオンファンタジー	5.2	6.5	14,144
シーティーエス	15.1	18.9	16,461
ネクシィーズグループ	4.2	6.1	5,666
H. U. グループホールディングス	37.1	46.3	136,353
アルプス技研	11.8	14.7	28,665
ダイオーズ	2.7	3.5	3,465
日本空調サービス	14	17.7	12,921
オリエンタルランド	140.7	175.6	2,864,036
ダスキン	32.9	38.4	97,958
明光ネットワークジャパン	16.9	19.9	11,482
ファルコホールディングス	7.4	8	13,912
ラウンドワン	37.1	56.5	84,524
リゾートトラスト	60.7	75.8	131,058
ビー・エム・エル	17.1	21.3	79,555
ワタベウエディング	2.5	—	—
りらいあコミュニケーションズ	24	25.3	30,562

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
リソー教育	60.9	84.7	26,087
早稲田アカデミー	5.9	7.3	6,577
ユー・エス・エス	148.2	185	354,090
東京個別指導学院	4.9	15	8,895
サイバーエージェント	81.5	407	894,586
楽天グループ	616.8	770.7	967,228
クリーク・アンド・リバー社	7	8.8	13,032
モーニングスター	—	24.7	10,744
テー・オー・ダブリュー	21.4	29.7	9,949
山田コンサルティン グループ	8.7	9.8	11,485
セントラルスポーツ	5	6.3	15,617
フルキャストホールディングス	13.3	14.2	29,237
エン・ジャパン	23.6	29.4	112,749
リソルホールディングス	1.5	1.9	7,714
テクノプロ・ホールディングス	26.4	33	259,380
アトラグループ	3.5	3.8	1,284
インターワークス	2.9	5.4	2,203
アイ・アールジャパンホールディングス	5.4	6.7	92,460
KeepEr 技研	5	10.7	24,695
ファーストロジック	2.8	3.6	2,602
三機サービス	2.7	3.4	3,631
Gunosy	8.4	10.6	10,112
デザインワン・ジャパン	4.4	5.3	1,208
イー・ガーディアン	5.9	6.8	16,972
リブセンス	9	10.3	2,296
ジャパンマテリアル	40.8	51	64,209
ベクトル	16.6	20.9	19,039
ウチヤマホールディングス	6.9	8.9	3,284
チャーム・ケア・コーポレーション	11.4	12.5	14,400
ライクキッズ	2.4	—	—
キャリアリンク	4.6	5.5	12,320
I B J	9.2	13.8	14,434
アサンテ	5.4	6.1	10,931
N・フィールド	9.3	—	—
バリューHR	5.3	6.7	11,101
M&Aキャピタルパートナーズ	10.8	13.6	62,900
ライドオンエクスプレスホールディングス	5.1	6.6	9,609
ERIホールディングス	3.9	5.1	2,993
アピスト	2.1	2.7	7,857
シグマックス	9.1	9.2	18,832
ウィルグループ	8.8	12.4	11,829
エスクロー・エージェント・ジャパン	18.9	25.6	6,246
メドピア	—	12.8	60,096
レアジョブ	—	3.2	5,868
リクルートホールディングス	947.9	1,182.6	6,569,343

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
エラン	7.9	23	32,085
土木管理総合試験所	6.1	8.8	3,370
ネットマーケティング	5.3	8.7	3,523
日本郵政	1,084.6	1,249.3	1,137,862
ベルシステム24ホールディングス	22.3	27.8	45,369
鎌倉新書	10.1	16.9	20,618
SMN	3	3.9	3,123
一蔵	1.8	—	—
LITALICO	4.6	—	—
グローバルキッズCOMPANY	2.6	3.3	3,296
エアトリ	6.9	10.3	30,148
アトラエ	4	11.6	19,290
ストライク	5	6.3	26,460
ソラスト	36.6	40.7	53,113
セラク	4.3	5.3	11,241
インソース	5.5	16.1	34,518
ベイクレント・コンサルティン グ	8	10.8	360,720
Orchestra Holdings	2.9	3.8	11,084
アイモバイル	4.9	4.9	6,757
キャリアインデックス	5.8	7.2	4,946
MS-Japan	4.4	7	7,518
船場	2.3	3.6	2,980
グレイステクノロジー	6.1	16.9	32,988
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	14	47.7	109,519
フルテック	2	2.5	3,475
グリーンズ	3.6	6.2	3,571
ツナグループ・ホールディングス	2.5	—	—
GameWith	4.1	5.4	3,294
ソウルドアウト	2.8	4.1	6,654
MS&Consulting	2.7	3.1	1,906
ウェルビー	—	6.3	9,072
エル・ティー・エス	—	1.7	5,958
ミダック	1.8	3.6	21,780
日総工産	9	13.3	10,613
キュービネットホールディングス	5.5	7.7	13,860
RPAホールディングス	10.2	19.6	14,386
スプリックス	3.9	4.9	6,242
マネジメントソリューションズ	5.9	8.2	16,564
プロレド・パートナーズ and factory	1.8	3.1	9,238
and factory	1.4	—	—
テノ. ホールディングス	—	2	2,312
フロンティア・マネジメント	—	3.9	5,070
ピアラ	—	1.4	1,575
コプロ・ホールディングス	—	2.4	3,292

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ギークス	1.5	3	5,835			
カープスホールディングス	36.5	45.6	38,988			
フォーラムエンジニアリング	7	11.7	11,044			
ダイレクトマーケティングミックス	—	8.9	32,307			
ポピンズホールディングス	—	4.4	19,580			
L I T A L I C O	—	6.7	35,778			
アドバンテッジリスクマネジメント	6.8	8.7	7,090			
リログループ	72.4	90.4	201,140			
東祥	8.3	10.4	18,772			
エイチ・アイ・エス	20.6	25.8	65,145			
ラックランド	3.1	4.8	12,302			
共立メンテナンス	22	27.4	100,558			
イチネンホールディングス	14.9	17.4	21,106			
建設技術研究所	9.2	10.7	26,728			
スペース	8.7	11	9,944			
長大	5.4	6.7	13,312			
燦ホールディングス	5.9	7.4	8,813			
スバル興業	0.8	1	8,260			
東京テアトル	5.3	6.4	8,064			
タナベ経営	2.6	3.4	4,821			
ナガワ	4.2	5.3	44,308			
よみうりランド	2.9	—	—			
東京都競馬	8.7	10.9	58,642			
カナモト	21.7	29.2	78,139			
東京ドーム	53.7	—	—			
西尾レントオール	12.3	15.3	49,342			
トランス・コスモス	12.6	15.8	47,210			
乃村工藝社	56.8	71.1	62,994			
藤田観光	5.8	6.5	14,878			
KNT-CTホールディングス	8.2	8.8	11,985			
日本管財	14.2	17.8	41,847			
トーカイ	12.8	16.1	38,672			
白洋舎	1.6	—	—			
セコム	140.4	162.7	1,394,339			
セントラル警備保障	6.4	8	23,376			
丹青社	25.2	31.5	26,932			
メイテック	16.2	20	122,200			
応用地質	14.3	18.8	23,782			
船井総研ホールディングス	27.4	33.9	78,715			
進学会ホールディングス	5.4	7.1	2,932			
オオバ	9.6	11.9	9,270			
いであ	3.3	4.2	7,585			
学究社	4	5	6,615			
ベネッセホールディングス	44.1	60.6	152,348			
イオンディライト	16.3	20.4	67,422			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ナック	7.5	8.1	7,395			
ニチイ学館	18.9	—	—			
ダイセキ	22.2	27.7	114,816			
ステップ	4.9	6.2	9,771			
合 計	株 数・金 額	162,264	181,054	455,964	175	
	銘柄数<比率>	2,102	2,114	<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。

<国内新株予約権証券>

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	評 価 額 (千円)	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	評 価 額 (千円)
千葉興業銀行第7回新株予約権	38,100	—	—			
合 計	証 券 数・金 額	38,100	—	—	—	—
	銘柄数<比率>	1	—	<—%>		

(注)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	6,749	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	455,964,175	97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	10,088,751	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	466,052,926	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年5月31日現在
(A)資 産	466,038,871,721円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,303,888,136
株 式(評価額)	455,964,175,980
未 収 入 金	404,451,849
未 収 配 当 金	4,047,569,256
差 入 委 託 証 拠 金	318,786,500
(B)負 債	3,203,165,890
未 払 金	3,103,330,743
未 払 解 約 金	99,825,660
未 払 利 息	9,487
(C)純 資 産 総 額(A-B)	462,835,705,831
元 本	249,503,103,457
次 期 繰 越 損 益 金	213,332,602,374
(D)受 益 権 総 口 数	249,503,103,457口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,550円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A)配 当 等 収 益	8,698,722,260円
受 取 配 当 金	8,698,493,737
受 取 利 息	22,353
そ の 他 収 益 金	1,589,254
支 払 利 息	△1,383,084
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	73,878,008,087
売 買 益	86,318,327,018
売 買 損	△12,440,318,931
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	765,644,250
取 引 益	1,143,466,200
取 引 損	△377,821,950
(D)そ の 他 費 用	△6,565
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	83,342,368,032
(F)前 期 繰 越 損 益 金	101,112,686,657
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	65,108,893,068
(H)解 約 差 損 益 金	△36,231,345,383
(I)計 (E+F+G+H)	213,332,602,374
次 期 繰 越 損 益 金(I)	213,332,602,374

(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212,335,378,830円、期中追加設定元本額は91,146,447,303円、期中一部解約元本額は53,978,722,676円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMTAM日本株式インデックスファンドVL-P(適格機関投資家専用)	46,538,120,296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)	42,587,150,766円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	24,216,585,712円
DCマイセレクション50	17,856,939,441円
DCマイセレクション75	17,462,256,715円
SMT TOPIXインデックス・オープン	10,403,753,770円
DCマイセレクションS50	8,420,319,159円
DC日本株式インデックス・オープンS	7,493,326,205円
分散投資コア戦略ファンドS	7,197,643,246円
DCマイセレクション25	6,050,615,568円
DCマイセレクションS75	5,940,925,341円
DC日本株式インデックス・オープン	5,795,526,637円
コア投資戦略ファンド(成長型)	5,195,855,155円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,861,892,511円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,731,672,493円
日本株式インデックス・オープン	3,598,093,148円
DC世界経済インデックスファンド	3,182,301,074円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,102,276,547円
DCマイセレクションS25	2,854,636,452円
世界経済インデックスファンド	2,683,336,435円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,637,915,929円
分散投資コア戦略ファンドA	2,047,093,068円
コア投資戦略ファンド(切替型)	2,005,334,416円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,859,449,520円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,525,588,405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)	1,203,380,236円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,174,226,556円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,165,542,032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)	653,344,546円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	649,975,544円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	622,042,108円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	558,309,169円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	484,894,150円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	463,116,992円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	425,421,036円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	403,509,178円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	394,131,292円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	383,058,796円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	318,403,754円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	279,324,640円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	248,443,863円
グローバル経済コア	235,932,236円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	202,558,578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)	198,868,482円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	170,954,225円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	165,260,518円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	127,725,155円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	109,285,845円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	98,131,095円
SMT インデックスバランス・オープン	59,576,799円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	52,924,180円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	52,282,962円

SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	43,456,736円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	41,853,585円
SMT 世界経済インデックス・オープン	33,560,024円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	30,614,108円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	29,119,791円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	26,725,162円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	26,682,640円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	25,297,047円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	22,433,643円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	19,525,758円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,712,867円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	10,309,323円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	7,621,865円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	6,195,294円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,778,508円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	3,968,204円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2,713,907円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,358,345円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	1,143,472円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	801,202円

お知らせ

該当事項はありません。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

運用報告書

第1期（決算日 2021年1月22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4月15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上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 比	純資産額
	期騰落率	中落率	期騰落率	中落率		
設定日(2020年4月15日)	円 10,000	% —	円 10,000	% —	% —	百万円 6,500
第1期(2021年1月22日)	11,299	13.0	11,257	12.6	96.9	4,603

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 比	株式先物率
	騰落率	中落率	騰落率	中落率		
(設定日) 2020年 4月15日	円 10,000	% —	円 10,000	% —	% —	% —
4月末	9,914	△0.9	9,904	△1.0	97.9	1.8
5月末	10,504	5.0	10,489	4.9	99.6	0.4
6月末	10,381	3.8	10,364	3.6	98.0	1.6
7月末	9,789	△2.1	9,770	△2.3	98.3	1.5
8月末	10,461	4.6	10,441	4.4	98.3	1.5
9月末	10,461	4.6	10,440	4.4	97.5	2.5
10月末	10,061	0.6	10,041	0.4	96.8	3.1
11月末	10,953	9.5	10,920	9.2	97.2	2.8
12月末	11,112	11.1	11,073	10.7	97.0	2.8
(当期末) 2021年 1月22日	11,299	13.0	11,257	12.6	96.9	2.8

(注1)騰落率は設定日比です。

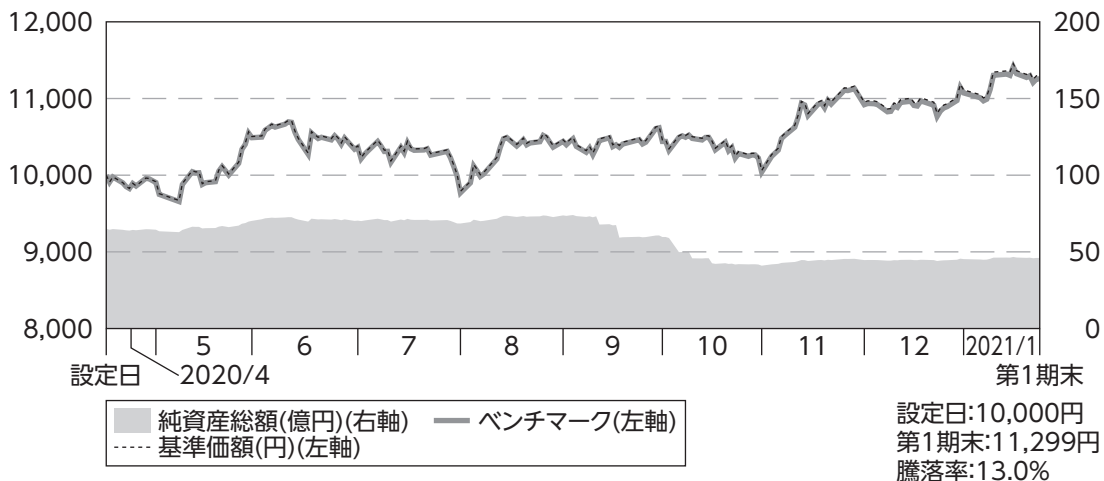
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCI 日本株最小分散インデックス(配当込み)です。

MSCI 日本株最小分散インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc. が開発した日本の株式市場に上場する日本株を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、指数値の変動幅を一定の制約条件下で最小化することを目指します。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2020年4月15日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCI 日本株最小分散インデックス(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、設定来では上昇しました。

投資環境



設定当初の国内株式市場は、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による景気や企業業績の減速懸念などから、軟調な展開となりました。その後は、各国の大型経済対策や金融緩和策が好感されたこと、世界的な経済活動の再開、新型コロナウイルスワクチン開発の進展報道などが好感され上昇しましたが、国内外の実質GDP(国内総生産)の悪化や、新型コロナウイルス感染再拡大への警戒感などが上値を抑えました。期末にかけては、米国大統領選挙を通過し、米国政治の先行き不透明感が後退したこと、新型コロナウイルスワクチンの早期の実用化期待、米国の追加経済対策の成立や財政支出拡大による景気回復が期待されたことなどから、上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCI 日本株最小分散インデックス(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

株式組入比率は期を通じて100%に近い水準を維持しました。なお、資金の効率的な運用を行う目的で、株価指数先物取引を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式については、MSCI 日本株最小分散インデックス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

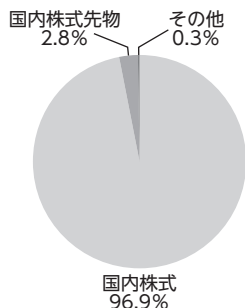
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	東証株価指数先物 2103	日本	2.8%
2	中外製薬	日本	1.7%
3	村田製作所	日本	1.6%
4	日本電信電話	日本	1.5%
5	富士通	日本	1.5%
6	HOYA	日本	1.5%

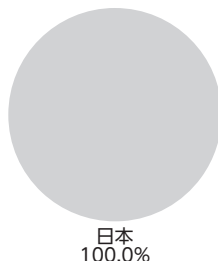
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ソフトバンク	日本	1.5%
8	キーエンス	日本	1.5%
9	ニトリホールディングス	日本	1.5%
10	トヨタ自動車	日本	1.5%
組入銘柄数		139	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

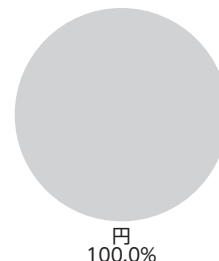
○資産別配分



○国別配分



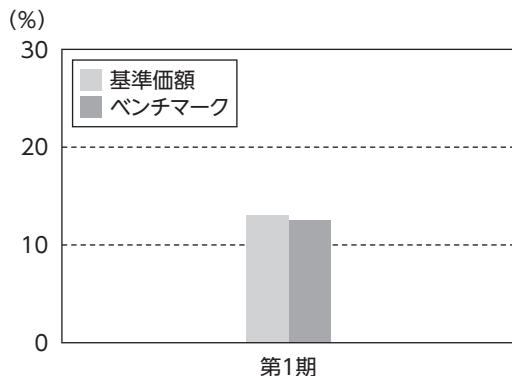
○通貨別配分



(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。
 (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2.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当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 日本株最小分散インデックス(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		項目の概要
	(2020年4月15日~2021年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.001% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,404円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上 場	千株 3,757 (△472)	千円 8,204,608 (-)	千株 1,872	千円 4,281,533

(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。

<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 860	百万円 763	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	12,486,142千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,856,042千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	2.13

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

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 39	百万円 39	% 100.0	百万円 39	百万円 39	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	37,690	4,968	13.2	37,562	4,968	13.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
建設業(1.6%)		
大成建設	2.3	8,303
大東建託	2	19,080
積水ハウス	20.2	42,995
食料品(6.0%)		
山崎製パン	8.1	14,231
カルビー	2.8	8,722
明治ホールディングス	3.8	26,790
キリンホールディングス	8.5	19,643
サントリー食品インターナショナル	10.7	38,894
味の素	16.3	40,049
東洋水産	8.4	43,176
日清食品ホールディングス	1.9	17,271
日本たばこ産業	28.3	57,958
繊維製品(0.2%)		
帝人	5.4	10,438
化学(5.7%)		
信越化学工業	0.7	13,524
花王	6.9	53,026
日本ペイントホールディングス	1.1	10,505
関西ペイント	9.2	27,434
富士フイルムホールディングス	10.4	65,384
資生堂	0.8	5,660
ライオン	10.5	24,906
小林製薬	0.8	9,544
ユニ・チャーム	9.1	44,799
医薬品(7.1%)		
協和キリン	6	16,668
武田薬品工業	11.4	40,891
アステラス製薬	32.7	55,099
塩野義製薬	7.4	41,869
中外製薬	14.3	80,351
エーザイ	0.7	5,343
小野薬品工業	12.7	38,798
参天製薬	2.6	4,365
第一三共	5.2	18,616
大塚ホールディングス	2	8,826
ペプチドリーム	1	5,830
ゴム製品(1.4%)		
ブリヂストン	15.7	64,370
金属製品(0.7%)		
リンナイ	2.7	30,348
機械(1.8%)		
SMC	0.1	6,824
ダイキン工業	2.2	50,897
セガサミーホールディングス	6.6	11,292

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
ホンザキ	1.2	10,872
電気機器(12.7%)		
東芝	6.1	18,074
日本電産	0.7	9,940
日本電気	8.8	51,832
富士通	4.2	71,190
ソニー	3.7	38,776
ヒロセ電機	1.6	24,672
アズビル	4.6	25,714
キーエンス	1.2	69,180
シスメックス	2.6	33,800
ファナック	0.1	2,707
浜松ホトニクス	6.2	39,680
京セラ	5.8	39,811
村田製作所	6.8	71,366
キヤノン	23.2	50,854
東京エレクトロン	0.4	17,404
輸送用機器(2.5%)		
トヨタ自動車	8.9	68,174
スズキ	0.4	2,039
シマノ	1.6	42,024
精密機器(3.7%)		
テルモ	10.5	43,648
オリンパス	13.5	28,356
HOYA	5.2	70,850
朝日インテック	6.8	23,664
その他製品(2.5%)		
バンダイナムコホールディングス	5	46,370
任天堂	1	63,920
電気・ガス業(5.8%)		
中部電力	21.2	27,729
中国電力	41.1	52,238
東北電力	22.8	20,565
九州電力	37.3	37,449
東京瓦斯	21	48,268
大阪瓦斯	22.1	43,802
東邦瓦斯	4.6	29,026
陸運業(9.6%)		
東武鉄道	5.1	15,029
東急	10.5	13,209
小田急電鉄	14.6	47,377
京王電鉄	3.6	29,664
京成電鉄	0.7	2,415
東日本旅客鉄道	6.9	46,644
東海旅客鉄道	2.9	42,412
近鉄グループホールディングス	4.2	18,711

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
阪急阪神ホールディングス	3	9,975
京阪ホールディングス	9.8	48,265
名古屋鉄道	19.2	51,379
ヤマトホールディングス	1.3	3,354
九州旅客鉄道	16.2	34,797
S Gホールディングス	22.7	63,650
情報・通信業(12.9%)		
コーエーテクモホールディングス	4.5	26,910
ネクソン	8.1	26,446
野村総合研究所	2.8	10,920
オービック	3	62,790
Zホールディングス	64.3	44,997
日本オラクル	2.8	37,184
伊藤忠テクノソリューションズ	5.2	19,266
大塚商会	2.3	11,891
日本電信電話	26.4	71,266
KDD I	21	68,124
ソフトバンク	51.6	69,505
光通信	0.7	15,190
東宝	14.4	57,168
エヌ・ティ・ティ・データ	16.9	25,350
スクウェア・エニックス・ホールディングス	1.5	8,895
カブコン	1.3	9,282
コナミホールディングス	1.5	9,960
卸売業(3.3%)		
メディパルホールディングス	1.7	3,512
伊藤忠商事	18.2	57,202
三井物産	12.6	25,949
住友商事	12.1	17,145
三菱商事	12.2	32,738
スズケン	2.6	10,452
小売業(11.2%)		
ローソン	9.6	46,944
エービーシー・マート	7.3	43,070
日本マクドナルドホールディングス	11	56,320
Monotaro	2.2	11,440
ウエルシアホールディングス	4.7	16,896
コスモス薬品	0.9	14,580
セブン&アイ・ホールディングス	13.4	52,930
ツルハホールディングス	0.9	12,699
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	17.7	40,462
しまむら	2.4	28,200
ヤマダホールディングス	89.4	48,186
ニトリホールディングス	3.1	68,200
ファーストリテイリング	0.6	55,092
サンドラッグ	1.6	6,560
銀行業(3.2%)		
ゆうちょ銀行	66.8	59,184
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4.8	2,318

銘柄	当 期 末	
	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
三井住友フィナンシャルグループ	7.2	24,040
みずほフィナンシャルグループ	40.9	57,566
保険業(1.6%)		
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	7.7	24,139
東京海上ホールディングス	8.9	48,264
その他金融業(0.3%)		
日本取引所グループ	4.2	11,222
不動産業(0.3%)		
ヒューリック	3.8	4,252
三菱地所	5.3	8,586
サービス業(5.9%)		
総合警備保障	2.9	15,080
カカクコム	2.7	8,056
エムスリー	4	40,600
オリエンタルランド	3.7	59,200
ユー・エス・エス	8.1	16,961
サイバーエージェント	0.9	6,759
日本郵政	69.4	57,706
セコム	6.4	60,659
合 計	1,412	4,461,935
	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	<96.9%>

(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。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	129	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 4,461,935	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	141,611	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	4,603,546	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年1月22日現在
(A)資 産	4,603,546,951円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	127,870,311
株 式(評価額)	4,461,935,140
未 収 入 金	6,139,000
未 収 配 当 金	7,406,500
差 入 委 託 証 拠 金	196,000
(B)負 債	57
未 払 利 息	57
(C)純 資 産 総 額(A-B)	4,603,546,894
元 本	4,074,360,095
次 期 繰 越 損 益 金	529,186,799
(D)受 益 権 総 口 数	4,074,360,095口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,299円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年4月15日 至 2021年1月22日
(A)配 当 等 収 益	67,303,750円
受 取 配 当 金	67,351,346
受 取 利 息	622
そ の 他 収 益 金	17,120
支 払 利 息	△65,338
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	538,860,048
売 買 益	877,124,626
売 買 損	△338,264,578
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	32,393,450
取 引 益	33,745,650
取 引 損	△1,352,200
(D)そ の 他 費 用	△354
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	638,556,894
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	13,213,523
(G)解 約 差 損 益 金	△122,583,618
(H)計 (E+F+G)	529,186,799
次 期 繰 越 損 益 金(H)	529,186,799

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は6,500,000,000円、期中追加設定元本額は551,776,477円、期中一部解約元本額は2,977,416,382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

3,126,143,390円

分散投資コア戦略ファンドA

948,216,705円

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2021年5月31日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379,592	△2.0	99.7	—	300,760
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382,463	0.8	99.9	—	379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390,052	2.0	99.7	0.0	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388,127	△0.5	100.5	—	540,159
第21期(2021年5月31日)	14,082	△0.4	386,621	△0.4	99.8	—	628,366

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2020年5月29日	14,136	—	388,127	—	100.5	—
6月末	14,080	△0.4	386,558	△0.4	99.9	—
7月末	14,129	△0.0	387,913	△0.1	99.8	—
8月末	14,064	△0.5	386,087	△0.5	99.7	—
9月末	14,105	△0.2	387,219	△0.2	99.9	—
10月末	14,082	△0.4	386,633	△0.4	99.8	—
11月末	14,101	△0.2	387,118	△0.3	99.8	—
12月末	14,103	△0.2	387,203	△0.2	99.8	—
2021年1月末	14,069	△0.5	386,252	△0.5	99.7	—
2月末	13,952	△1.3	383,056	△1.3	99.7	—
3月末	14,049	△0.6	385,724	△0.6	99.9	—
4月末	14,076	△0.4	386,440	△0.4	99.8	—
(当期末) 2021年5月31日	14,082	△0.4	386,621	△0.4	99.8	—

(注1) 騰落率は期首比です。

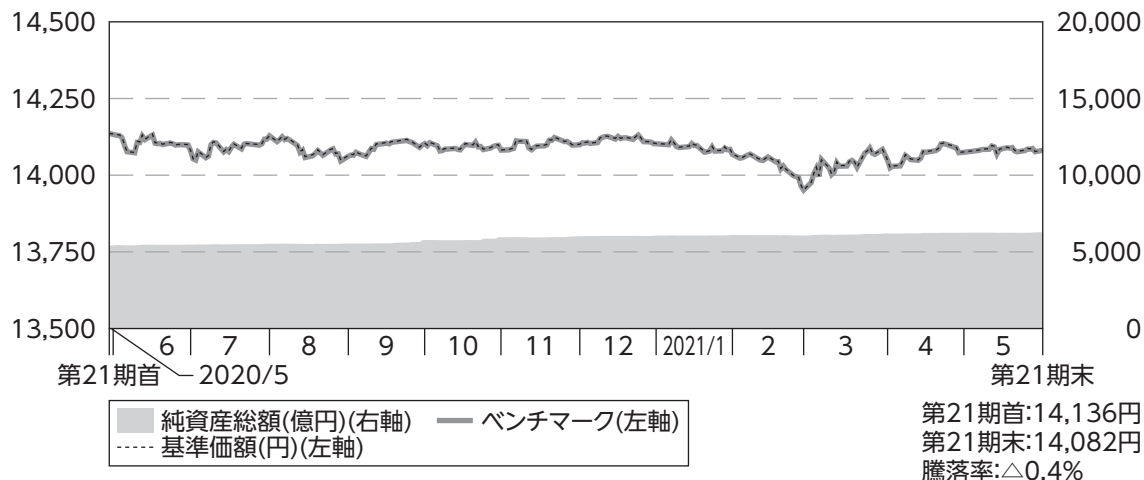
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

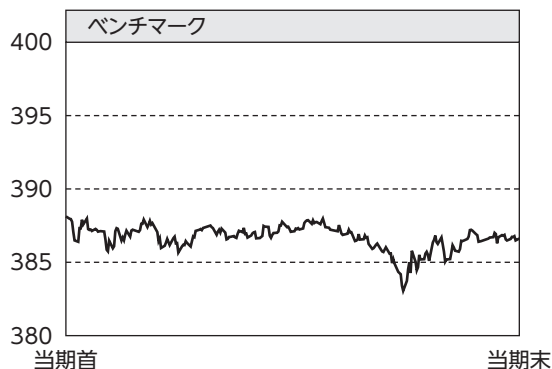


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年12月下旬にかけて、大規模な経済対策に伴う国債増発による需給悪化懸念が続いた一方で、資金運用難と見られる国内投資家の根強い債券需要や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を背景にリスク回避姿勢が強まったことなどから国内金利がレンジ内推移となり、基準価額はもみ合い推移となりました。12月下旬から2021年2月下旬にかけては、国債増発への警戒と新型コロナウイルスに対するワクチン普及による米長期金利上昇の影響や、日銀が長期金利操作幅を拡大するとの見方から国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。その後は期末にかけて、上昇が続いていた米長期金利が低下に転じた影響や、国内では新型コロナウイルスの感染拡大を背景に東京や大阪などで3度目の緊急事態宣言が発出されたことからリスク回避姿勢が高まり、国内金利が低下(債券価格は上昇)推移となったことから、基準価額は上昇しました。

投資環境



2020年12月下旬にかけて、大規模な経済対策に伴う国債増発による需給悪化懸念が続いた一方で、国内投資家の根強い債券需要や欧米での新型コロナウイルスの感染再拡大を背景にリスク回避姿勢が強まったことなどから、国内金利はレンジ内推移となりました。12月下旬から2021年2月下旬にかけては、米長期金利上昇の影響や日銀が長期金利操作幅を拡大するとの見方から、国内金利は上昇しました。その後は期末にかけて、上昇が続いていた米長期金利が低下に転じた影響や、国内では新型コロナウイルスの感染拡大を背景に東京や大阪などで3度目の緊急事態宣言が発出されたことからリスク回避姿勢が高まり、国内金利は低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

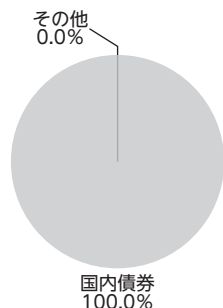
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第145回利付国債(5年)	日本	1.3%
2	第350回利付国債(10年)	日本	1.3%
3	第141回利付国債(5年)	日本	1.2%
4	第138回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第137回利付国債(5年)	日本	1.1%
6	第344回利付国債(10年)	日本	1.1%

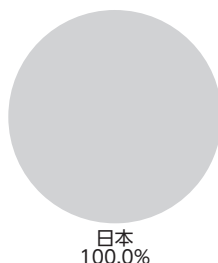
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第340回利付国債(10年)	日本	1.0%
9	第346回利付国債(10年)	日本	1.0%
10	第140回利付国債(5年)	日本	1.0%
組入銘柄数		982	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

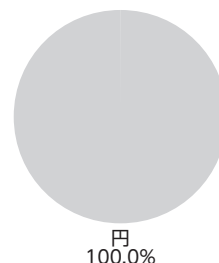
○資産別配分



○国別配分



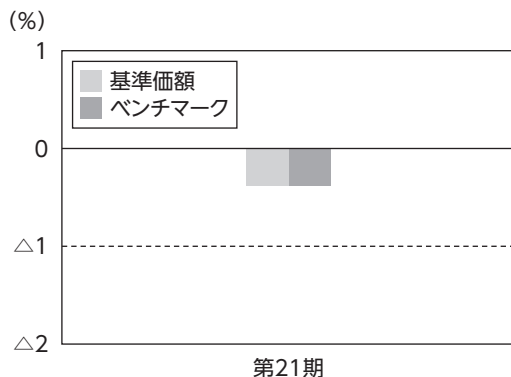
○通貨別配分



(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。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期 (2020年5月30日~2021年5月31日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(14,078円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	国 債 証 券	152,657,851	75,390,085
	地 方 債 証 券	8,839,229	3,485,669
	特 殊 債 券	12,721,866	9,396,590 (738,947)
	社債券(投資法人債券を含む)	11,819,019	6,389,293

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	債券先物取引	百万円 28,690	百万円 28,688	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 510	百万円 510	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	294,472	11,665	4.0	294,262	11,665	4.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千 円	千 円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	491,570,000 (4,080,000)	525,432,430 (4,097,299)	83.6 (0.7)	— (—)	55.7 (—)	20.4 (—)	7.4 (0.7)
地 方 債 証 券	32,321,430 (32,321,430)	34,036,521 (34,036,521)	5.4 (5.4)	— (—)	3.5 (3.5)	1.3 (1.3)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	35,448,599 (35,448,599)	36,934,695 (36,934,695)	5.9 (5.9)	— (—)	3.4 (3.4)	1.3 (1.3)	1.2 (1.2)
金 融 債 証 券	2,400,000 (2,400,000)	2,403,743 (2,403,743)	0.4 (0.4)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	27,826,000 (27,826,000)	28,160,874 (28,160,874)	4.5 (4.5)	— (—)	2.3 (2.3)	1.9 (1.9)	0.3 (0.3)
合 計	589,566,029 (102,076,029)	626,968,264 (105,633,133)	99.8 (16.8)	— (—)	65.0 (9.2)	25.1 (4.7)	9.7 (2.9)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期			末
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千 円)	評 価 額 (千 円)	償 還 年 月 日
国債証券				
第414回利付国債(2年)	0.1	2,360,000	2,365,994	2022/7/1
第415回利付国債(2年)	0.1	1,060,000	1,062,904	2022/8/1
第416回利付国債(2年)	0.1	4,670,000	4,684,056	2022/9/1
第417回利付国債(2年)	0.1	4,240,000	4,253,568	2022/10/1
第418回利付国債(2年)	0.1	1,040,000	1,043,546	2022/11/1
第419回利付国債(2年)	0.1	660,000	662,382	2022/12/1
第420回利付国債(2年)	0.1	1,250,000	1,254,662	2023/1/1
第421回利付国債(2年)	0.1	590,000	592,318	2023/2/1
第422回利付国債(2年)	0.1	130,000	130,557	2023/3/1
第423回利付国債(2年)	0.005	370,000	370,950	2023/4/1
第424回利付国債(2年)	0.005	570,000	571,527	2023/5/1
第133回利付国債(5年)	0.1	4,380,000	4,392,833	2022/9/20
第134回利付国債(5年)	0.1	5,700,000	5,720,406	2022/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	4,080,000	4,097,299	2023/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	4,400,000	4,421,252	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	6,760,000	6,796,706	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	7,050,000	7,092,441	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	6,070,000	6,110,062	2024/3/20

銘 柄 名	当 期			末
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千 円)	評 価 額 (千 円)	償 還 年 月 日
第140回利付国債(5年)	0.1	6,300,000	6,344,352	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	7,790,000	7,848,113	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	5,380,000	5,423,201	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	4,800,000	4,841,232	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	6,520,000	6,579,723	2025/6/20
第145回利付国債(5年)	0.1	8,240,000	8,318,362	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	2,460,000	2,483,640	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	1,450,000	1,457,337	2026/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	577,564	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,581,491	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	773,696	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	1,200,000	1,693,932	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,070,000	1,461,309	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,697,421	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,040,000	1,347,985	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,230,000	1,493,908	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	1,220,000	1,111,359	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,370,000	2,527,391	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,790,000	1,850,484	2058/3/20

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第12回利付国債(40年)	0.5	1,710,000	1,598,217	2059/3/20
第13回利付国債(40年)	0.5	2,250,000	2,096,685	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	200,000	199,378	2061/3/20
第325回利付国債(10年)	0.8	4,590,000	4,645,447	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	3,120,000	3,160,060	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	3,190,000	3,235,904	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	3,400,000	3,444,778	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	3,210,000	3,271,760	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,900,000	1,941,059	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	915,282	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	4,800,000	4,889,760	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	3,030,000	3,092,569	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	4,900,000	5,009,564	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,370,000	2,419,130	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	1,050,000	1,073,415	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,850,000	2,893,206	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	4,560,000	4,651,382	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	4,850,000	4,953,693	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	6,320,000	6,462,136	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	3,440,000	3,504,534	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	5,380,000	5,431,863	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	4,820,000	4,866,464	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	6,640,000	6,705,404	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	3,340,000	3,373,533	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	6,350,000	6,414,706	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,880,000	3,920,080	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,880,000	4,930,947	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	4,130,000	4,173,447	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	7,960,000	8,044,137	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	4,610,000	4,657,252	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	3,900,000	3,938,532	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,300,000	4,340,635	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	4,690,000	4,732,116	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	4,270,000	4,306,081	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	4,640,000	4,676,563	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,689,384	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	3,790,000	3,814,938	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	4,580,000	4,604,777	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	6,150,000	6,178,474	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	4,740,000	4,755,736	2030/12/20
第32回利付国債(10年)	0.1	3,300,000	3,308,019	2031/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	135,407	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	193,160	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	144,360	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	139,551	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	60,541	2031/5/20

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第6回利付国債(30年)	2.4	350,000	433,867	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	222,715	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	350,000	416,094	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	274,536	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	177,726	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	260,000	307,704	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	234,617	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	400,000	490,272	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	800,000	1,023,488	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	440,871	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	200,000	260,118	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	950,000	1,226,592	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	345,000	441,996	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	530,000	680,726	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	631,766	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	645,745	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	529,580	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	570,760	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	380,000	505,654	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	456,393	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	1,140,000	1,507,957	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	1,770,000	2,380,827	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	2,140,000	2,890,669	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	2,237,699	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,770,000	2,352,276	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,447,567	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,560,000	2,089,214	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,820,000	2,348,145	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,795,000	2,389,970	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,240,000	2,907,564	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	2,130,000	2,773,749	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,070,000	2,663,841	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,500,000	1,903,890	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,500,000	1,938,270	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,230,000	1,564,990	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	990,000	1,240,836	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,500,000	1,881,870	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,390,000	1,745,589	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,220,000	1,533,564	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,230,000	1,493,896	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,750,000	2,126,722	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,350,000	1,672,420	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,880,000	2,244,231	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,440,000	1,719,648	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	1,840,000	1,942,506	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,810,000	1,699,137	2046/6/20

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第5 2 回利付国債 (3 0年)	0.5	1,910,000	1,878,351	2046/9/20
第5 3 回利付国債 (3 0年)	0.6	880,000	884,892	2046/12/20
第5 4 回利付国債 (3 0年)	0.8	2,110,000	2,219,150	2047/3/20
第5 5 回利付国債 (3 0年)	0.8	1,540,000	1,618,509	2047/6/20
第5 6 回利付国債 (3 0年)	0.8	1,680,000	1,764,336	2047/9/20
第5 7 回利付国債 (3 0年)	0.8	1,550,000	1,626,585	2047/12/20
第5 8 回利付国債 (3 0年)	0.8	2,600,000	2,726,334	2048/3/20
第5 9 回利付国債 (3 0年)	0.7	620,000	634,427	2048/6/20
第6 0 回利付国債 (3 0年)	0.9	2,700,000	2,893,401	2048/9/20
第6 1 回利付国債 (3 0年)	0.7	1,660,000	1,693,233	2048/12/20
第6 2 回利付国債 (3 0年)	0.5	20,000	19,339	2049/3/20
第6 3 回利付国債 (3 0年)	0.4	1,160,000	1,089,901	2049/6/20
第6 4 回利付国債 (3 0年)	0.4	2,550,000	2,389,018	2049/9/20
第6 5 回利付国債 (3 0年)	0.4	860,000	804,340	2049/12/20
第6 6 回利付国債 (3 0年)	0.4	1,030,000	962,854	2050/3/20
第6 7 回利付国債 (3 0年)	0.6	1,410,000	1,387,679	2050/6/20
第6 8 回利付国債 (3 0年)	0.6	1,870,000	1,840,173	2050/9/20
第6 9 回利付国債 (3 0年)	0.7	840,000	847,257	2050/12/20
第7 0 回利付国債 (3 0年)	0.7	980,000	987,301	2051/3/20
第5 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	300,000	307,935	2022/9/20
第5 9 回利付国債 (2 0年)	1.7	200,000	205,680	2022/12/20
第6 0 回利付国債 (2 0年)	1.4	350,000	358,305	2022/12/20
第6 1 回利付国債 (2 0年)	1.0	240,000	244,891	2023/3/20
第6 2 回利付国債 (2 0年)	0.8	320,000	326,121	2023/6/20
第6 3 回利付国債 (2 0年)	1.8	200,000	207,942	2023/6/20
第6 4 回利付国債 (2 0年)	1.9	320,000	335,011	2023/9/20
第6 5 回利付国債 (2 0年)	1.9	220,000	231,411	2023/12/20
第6 6 回利付国債 (2 0年)	1.8	330,000	346,272	2023/12/20
第6 7 回利付国債 (2 0年)	1.9	130,000	137,395	2024/3/20
第6 8 回利付国債 (2 0年)	2.2	190,000	202,410	2024/3/20
第6 9 回利付国債 (2 0年)	2.1	390,000	414,378	2024/3/20
第7 0 回利付国債 (2 0年)	2.4	400,000	430,940	2024/6/20
第7 1 回利付国債 (2 0年)	2.2	200,000	214,246	2024/6/20
第7 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	630,000	676,393	2024/9/20
第7 3 回利付国債 (2 0年)	2.0	360,000	387,234	2024/12/20
第7 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	200,000	215,844	2024/12/20
第7 5 回利付国債 (2 0年)	2.1	130,000	141,016	2025/3/20
第7 6 回利付国債 (2 0年)	1.9	270,000	290,819	2025/3/20
第7 7 回利付国債 (2 0年)	2.0	290,000	313,466	2025/3/20
第7 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	170,000	183,982	2025/6/20
第7 9 回利付国債 (2 0年)	2.0	270,000	293,306	2025/6/20
第8 0 回利付国債 (2 0年)	2.1	220,000	239,885	2025/6/20
第8 1 回利付国債 (2 0年)	2.0	390,000	425,677	2025/9/20
第8 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	600,000	657,486	2025/9/20
第8 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	290,000	319,255	2025/12/20
第8 4 回利付国債 (2 0年)	2.0	470,000	515,265	2025/12/20

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第8 5 回利付国債 (2 0年)	2.1	290,000	320,693	2026/3/20
第8 6 回利付国債 (2 0年)	2.3	210,000	234,250	2026/3/20
第8 7 回利付国債 (2 0年)	2.2	1,830,000	2,032,507	2026/3/20
第8 8 回利付国債 (2 0年)	2.3	420,000	470,941	2026/6/20
第8 9 回利付国債 (2 0年)	2.2	350,000	390,677	2026/6/20
第9 0 回利付国債 (2 0年)	2.2	630,000	706,696	2026/9/20
第9 1 回利付国債 (2 0年)	2.3	450,000	507,181	2026/9/20
第9 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	880,000	987,008	2026/12/20
第9 3 回利付国債 (2 0年)	2.0	410,000	459,556	2027/3/20
第9 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	610,000	687,287	2027/3/20
第9 5 回利付国債 (2 0年)	2.3	610,000	697,864	2027/6/20
第9 6 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,590,000	1,799,689	2027/6/20
第9 7 回利付国債 (2 0年)	2.2	400,000	457,348	2027/9/20
第9 8 回利付国債 (2 0年)	2.1	440,000	500,297	2027/9/20
第9 9 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,290,000	1,473,321	2027/12/20
第1 0 0 回利付国債 (2 0年)	2.2	480,000	553,876	2028/3/20
第1 0 1 回利付国債 (2 0年)	2.4	715,000	834,805	2028/3/20
第1 0 2 回利付国債 (2 0年)	2.4	1,260,000	1,477,942	2028/6/20
第1 0 3 回利付国債 (2 0年)	2.3	400,000	466,356	2028/6/20
第1 0 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	160,000	184,278	2028/6/20
第1 0 5 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,180,000	1,364,481	2028/9/20
第1 0 6 回利付国債 (2 0年)	2.2	380,000	442,190	2028/9/20
第1 0 7 回利付国債 (2 0年)	2.1	260,000	301,810	2028/12/20
第1 0 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	660,000	756,142	2028/12/20
第1 0 9 回利付国債 (2 0年)	1.9	520,000	597,760	2029/3/20
第1 1 0 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,100,000	1,281,676	2029/3/20
第1 1 1 回利付国債 (2 0年)	2.2	970,000	1,142,281	2029/6/20
第1 1 2 回利付国債 (2 0年)	2.1	790,000	923,952	2029/6/20
第1 1 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,720,000	2,019,090	2029/9/20
第1 1 4 回利付国債 (2 0年)	2.1	2,330,000	2,744,996	2029/12/20
第1 1 5 回利付国債 (2 0年)	2.2	700,000	830,655	2029/12/20
第1 1 6 回利付国債 (2 0年)	2.2	1,490,000	1,774,545	2030/3/20
第1 1 7 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,080,000	1,276,765	2030/3/20
第1 1 8 回利付国債 (2 0年)	2.0	660,000	777,024	2030/6/20
第1 1 9 回利付国債 (2 0年)	1.8	530,000	614,407	2030/6/20
第1 2 0 回利付国債 (2 0年)	1.6	1,570,000	1,791,699	2030/6/20
第1 2 1 回利付国債 (2 0年)	1.9	1,500,000	1,757,805	2030/9/20
第1 2 2 回利付国債 (2 0年)	1.8	940,000	1,092,844	2030/9/20
第1 2 3 回利付国債 (2 0年)	2.1	1,870,000	2,232,349	2030/12/20
第1 2 4 回利付国債 (2 0年)	2.0	610,000	722,410	2030/12/20
第1 2 5 回利付国債 (2 0年)	2.2	1,820,000	2,197,304	2031/3/20
第1 2 6 回利付国債 (2 0年)	2.0	730,000	867,130	2031/3/20
第1 2 7 回利付国債 (2 0年)	1.9	1,020,000	1,201,672	2031/3/20
第1 2 8 回利付国債 (2 0年)	1.9	970,000	1,146,035	2031/6/20
第1 2 9 回利付国債 (2 0年)	1.8	890,000	1,042,643	2031/6/20
第1 3 0 回利付国債 (2 0年)	1.8	1,285,000	1,509,335	2031/9/20

当 期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,164,370	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	1,160,000	1,353,824	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,230,000	1,448,361	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	1,130,000	1,333,818	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	1,030,000	1,204,791	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,450,000	1,680,593	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,090,000	1,277,839	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	620,000	713,322	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	730,000	847,836	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	2,200,000	2,586,210	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	1,780,000	2,096,893	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	1,040,000	1,236,986	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,800,000	2,103,840	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,440,000	1,666,368	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	2,595,000	3,071,130	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,730,000	3,237,288	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,490,000	2,927,642	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,230,000	2,599,912	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	2,860,000	3,339,278	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	3,260,000	3,769,407	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,495,000	1,691,158	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	3,290,000	3,724,312	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,570,000	2,946,299	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,700,000	3,060,558	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,800,000	3,097,052	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,600,000	2,649,972	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,780,000	2,747,863	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,430,000	2,506,593	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,930,000	3,065,160	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	2,480,000	2,629,618	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,890,000	1,973,802	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	520,000	542,557	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	2,610,000	2,720,585	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,660,000	1,700,852	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	1,640,000	1,678,228	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	900,000	949,842	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,770,000	2,827,006	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	2,430,000	2,436,050	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	1,690,000	1,661,540	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,360,000	2,315,797	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,290,000	1,263,348	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	2,830,000	2,817,661	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	3,250,000	3,232,807	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	2,420,000	2,404,899	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	1,190,000	1,202,852	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	1,670,000	1,686,700	2041/3/20
小 計		491,570,000	525,432,430	

当 期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
地方債証券				
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	106,299	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	107,560	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	132,500	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	131,132	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	127,316	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	126,274	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	300,000	343,203	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	115,002	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	116,258	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	99,770	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	233,296	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	232,900	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	200,000	2025/12/19
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	101,183	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,117	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	101,767	2023/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	200,000	203,678	2023/12/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	101,635	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,638	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,896	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,692	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	301,893	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	199,236	2029/12/20
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	101,363	2023/2/28
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,965	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,332	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	101,000	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	201,338	2028/12/28
第29回1号宮城県公募公債(10年)	0.68	100,000	101,610	2023/10/25
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	270,900	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	115,975	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	233,466	2030/11/12
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	116,280	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,412	2034/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	203,132	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,841	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,809	2027/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,692	2027/6/18
第243回神奈川県公募公債	0.075	200,000	199,152	2029/12/20
第6回大阪府公募公債(20年)	1.98	200,000	233,404	2030/9/13
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	233,532	2031/9/26
第10回大阪府公募公債(20年)	1.72	100,000	116,566	2032/9/24
第371回大阪府公募公債(10年)	0.58	100,000	101,066	2023/4/26
第375回大阪府公募公債(10年)	0.835	100,000	101,831	2023/8/29
第377回大阪府公募公債(10年)	0.729	100,000	101,713	2023/10/30

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第389回大阪府公債(10年)	0.53	100,000	101,740	2024/10/30	
第395回大阪府公債(10年)	0.435	151,000	153,447	2025/4/28	
第399回大阪府公債(10年)	0.529	100,000	102,158	2025/8/28	
第402回大阪府公債(10年)	0.493	100,000	102,123	2025/11/27	
第407回大阪府公債(10年)	0.09	156,000	156,556	2026/4/27	
第410回大阪府公債(10年)	0.001	200,000	199,494	2026/7/28	
第439回大阪府公債(10年)	0.193	500,000	503,270	2028/12/27	
第440回大阪府公債(10年)	0.2	100,000	100,718	2029/1/30	
平成21年度第3回京都府公債(20年)	2.19	100,000	117,170	2029/9/20	
平成23年度第5回京都府公債(20年)	1.79	100,000	116,408	2031/10/17	
平成25年度第7回京都府公債(20年)	0.8	100,000	101,821	2023/9/19	
平成27年度第4回京都府公債(20年)	0.553	100,000	102,199	2025/6/19	
平成28年度第5回京都府公債(20年)	0.327	100,000	99,454	2036/8/15	
平成29年度第5回京都府公債(20年)	0.63	100,000	103,659	2037/8/14	
第2回兵庫県公債(12年)	1.1	100,000	103,315	2024/6/26	
第2回兵庫県公債(20年)	2.37	100,000	114,420	2027/9/17	
第3回兵庫県公債(12年)	0.56	100,000	102,091	2025/4/16	
第6回兵庫県公債(15年)	1.35	400,000	435,920	2028/7/14	
第7回兵庫県公債(15年)	1.12	100,000	107,655	2028/12/25	
第8回兵庫県公債(15年)	1.09	100,000	107,650	2029/4/16	
第9回兵庫県公債(20年)	2.25	400,000	471,052	2029/11/19	
平成24年度第15回兵庫県公債(20年)	0.75	200,000	201,764	2022/8/16	
平成25年度第4回兵庫県公債(20年)	0.82	100,000	101,773	2023/8/18	
平成26年度第17回兵庫県公債(20年)	0.46	100,000	101,645	2025/2/26	
第35回兵庫県公債(20年)	0.578	100,000	102,260	2038/5/28	
令和元年度第17回兵庫県公債(20年)	0.15	300,000	300,384	2030/1/28	
第9回静岡岡県公債(30年)	1.539	100,000	120,519	2045/6/20	
第12回静岡岡県公債(30年)	0.822	100,000	103,578	2048/3/19	
第15回静岡岡県公債(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15	
第18回静岡岡県公債(20年)	1.473	100,000	115,312	2034/7/10	
平成24年度第10回静岡岡県公債(20年)	0.678	100,000	101,208	2023/3/22	
平成29年度第5回静岡岡県公債(20年)	0.19	100,000	100,753	2027/6/18	
平成29年度第8回静岡岡県公債(20年)	0.21	100,000	100,873	2027/6/18	
平成29年度第11回静岡岡県公債(20年)	0.215	100,000	100,971	2027/9/17	
平成29年度第14回静岡岡県公債(5年)	0.04	100,000	100,053	2023/3/20	
平成21年度第5回愛知県公債(20年)	2.28	100,000	117,457	2029/6/20	
平成24年度第18回愛知県公債(10年)	0.801	150,000	152,073	2023/2/28	
平成24年度第19回愛知県公債(10年)	0.639	100,000	101,147	2023/3/28	
平成25年度第2回愛知県公債(10年)	0.576	100,000	101,077	2023/4/26	
平成26年度第3回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	101,909	2024/4/30	
平成26年度第5回愛知県公債(10年)	0.66	200,000	203,888	2024/5/28	
平成27年度第17回愛知県公債(10年)	0.38	100,000	101,733	2026/1/27	
平成28年度第5回愛知県公債(10年)	0.07	100,000	100,151	2026/6/29	
平成29年度第6回愛知県公債(10年)	0.22	200,000	201,926	2027/7/28	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
平成29年度第12回愛知県公債(20年)	0.606	300,000	309,552	2037/11/20	
平成30年度第1回愛知県公債(10年)	0.185	100,000	100,790	2028/4/27	
平成30年度第6回愛知県公債(30年)	0.777	100,000	102,341	2048/6/19	
令和元年度第16回愛知県公債(10年)	0.09	200,000	199,310	2030/2/15	
令和2年度第7回愛知県公債(10年)	0.145	100,000	100,020	2030/7/31	
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	116,466	2028/9/21	
平成21年度第1回広島県公債(20年)	2.21	200,000	233,352	2029/5/28	
平成24年度第4回広島県公債(20年)	0.81	100,000	101,197	2022/11/28	
平成27年度第4回広島県公債(20年)	0.476	125,230	127,847	2025/11/25	
平成29年度第1回広島県公債(20年)	0.175	100,000	100,715	2027/5/25	
第3回埼玉県公債(20年)	2.42	100,000	114,190	2027/6/18	
第5回埼玉県公債(20年)	2.35	100,000	115,494	2028/3/17	
第6回埼玉県公債(20年)	2.26	200,000	231,768	2028/9/21	
第6回埼玉県公債(30年)	0.957	100,000	107,202	2046/12/20	
第7回埼玉県公債(20年)	2.29	200,000	235,098	2029/6/22	
第8回埼玉県公債(15年)	0.367	200,000	200,484	2036/4/18	
第10回埼玉県公債(20年)	1.94	200,000	233,466	2030/11/12	
第18回埼玉県公債(20年)	0.323	200,000	199,094	2036/5/20	
平成24年度第9回埼玉県公債(20年)	0.844	100,000	101,394	2023/1/31	
平成25年度第11回埼玉県公債(20年)	0.655	100,000	101,818	2024/3/26	
平成27年度第7回埼玉県公債(20年)	0.469	100,000	102,098	2025/12/25	
平成28年度第6回埼玉県公債(20年)	0.085	100,000	100,239	2026/9/29	
平成28年度第9回埼玉県公債(20年)	0.249	100,000	101,109	2027/2/24	
平成29年度第4回埼玉県公債(20年)	0.19	100,000	100,755	2027/6/22	
平成19年度第1回福岡県公債(20年)	2.38	100,000	114,368	2027/8/20	
平成20年度第2回福岡県公債(20年)	2.05	100,000	114,744	2028/12/20	
平成22年度第1回福岡県公債(20年)	1.67	100,000	107,429	2025/11/21	
平成23年度第1回福岡県公債(20年)	2.008	100,000	118,145	2031/5/23	
平成23年度第1回福岡県公債(15年)	1.491	100,000	107,953	2026/11/27	
平成24年度第1回福岡県公債(30年)	2.12	100,000	131,560	2042/9/19	
平成26年度第4回福岡県公債(20年)	1.249	100,000	112,663	2035/2/23	
平成27年度第7回福岡県公債(20年)	0.464	100,000	102,075	2025/12/25	
平成30年度第1回福岡県公債(30年)	0.777	100,000	102,341	2048/6/19	
平成30年度第1回福岡県公債(20年)	0.639	100,000	103,435	2038/8/20	
令和2年度第1回福岡県公債(20年)	0.155	300,000	300,408	2030/6/24	
令和3年度第2回福岡県公債(20年)	0.155	100,000	100,000	2031/5/30	
第5回千葉県公債(20年)	2.26	200,000	231,768	2028/9/21	
第6回千葉県公債(20年)	2.26	100,000	116,901	2029/4/20	
第13回千葉県公債(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15	
平成25年度第5回千葉県公債(20年)	0.84	100,000	101,856	2023/8/25	
平成26年度第7回千葉県公債(20年)	0.429	100,000	101,566	2025/2/25	
平成27年度第1回千葉県公債(20年)	0.549	100,000	102,143	2025/5/23	
平成28年度第4回千葉県公債(20年)	0.085	100,000	100,238	2026/9/25	
平成28年度第6回千葉県公債(20年)	0.18	120,000	120,844	2027/1/25	
令和元年度第7回千葉県公債(20年)	0.08	300,000	298,701	2030/2/25	
令和3年度第1回長野県公債(10年)	0.19	100,000	100,389	2031/4/16	

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成29年度第1回岐阜県公募債(10年)	0.205	100,000	100,926	2027/10/29		
第112回共同発行市場公募債地方債	0.84	220,000	222,094	2022/7/25		
第113回共同発行市場公募債地方債	0.77	200,000	201,876	2022/8/25		
第116回共同発行市場公募債地方債	0.8	100,000	101,175	2022/11/25		
第117回共同発行市場公募債地方債	0.72	200,000	202,218	2022/12/22		
第119回共同発行市場公募債地方債	0.8	400,000	405,488	2023/2/24		
第121回共同発行市場公募債地方債	0.57	100,000	101,064	2023/4/25		
第125回共同発行市場公募債地方債	0.82	200,000	203,622	2023/8/25		
第127回共同発行市場公募債地方債	0.68	100,000	101,610	2023/10/25		
第128回共同発行市場公募債地方債	0.66	100,000	101,615	2023/11/24		
第130回共同発行市場公募債地方債	0.76	200,000	203,980	2024/1/25		
第131回共同発行市場公募債地方債	0.66	100,000	101,776	2024/2/23		
第132回共同発行市場公募債地方債	0.66	300,000	305,490	2024/3/25		
第134回共同発行市場公募債地方債	0.674	112,000	114,216	2024/5/24		
第135回共同発行市場公募債地方債	0.659	100,000	101,991	2024/6/25		
第136回共同発行市場公募債地方債	0.611	100,000	101,893	2024/7/25		
第137回共同発行市場公募債地方債	0.566	100,000	101,795	2024/8/23		
第140回共同発行市場公募債地方債	0.505	100,000	101,724	2024/11/25		
第141回共同発行市場公募債地方債	0.406	200,000	203,088	2025/4/25		
第146回共同発行市場公募債地方債	0.553	200,000	204,318	2025/5/23		
第148回共同発行市場公募債地方債	0.553	125,400	128,225	2025/7/25		
第152回共同発行市場公募債地方債	0.496	100,000	102,180	2025/11/25		
第156回共同発行市場公募債地方債	0.1	100,000	100,456	2026/3/25		
第157回共同発行市場公募債地方債	0.08	100,000	100,357	2026/4/24		
第159回共同発行市場公募債地方債	0.07	200,000	200,302	2026/6/25		
第160回共同発行市場公募債地方債	0.05	200,000	200,102	2026/7/24		
第161回共同発行市場公募債地方債	0.06	400,000	400,416	2026/8/25		
第164回共同発行市場公募債地方債	0.05	100,000	100,054	2026/11/25		
第166回共同発行市場公募債地方債	0.18	100,000	100,704	2027/1/25		
第167回共同発行市場公募債地方債	0.245	100,000	101,087	2027/2/25		
第171回共同発行市場公募債地方債	0.185	200,000	201,452	2027/6/25		
第174回共同発行市場公募債地方債	0.145	194,300	195,337	2027/9/24		
第175回共同発行市場公募債地方債	0.215	100,000	100,988	2027/10/25		
第181回共同発行市場公募債地方債	0.18	300,000	302,265	2028/4/25		
平成24年度第2回熊本県公募債(10年)	0.8	200,000	202,222	2022/10/26		
平成29年度第1回熊本県公募債(5年)	0.01	100,000	99,997	2022/7/28		
平成29年度第1回静岡市公募債	0.22	100,000	101,033	2027/11/24		
第13回大阪市公募債(20年)	2.08	200,000	234,944	2030/6/14		
第22回大阪市公募債(20年)	0.347	300,000	299,661	2036/5/30		
第24回大阪市公募債(20年)	0.655	100,000	104,121	2037/4/21		
令和3年度第2回大阪市公募債	0.16	200,000	200,098	2031/5/21		
第1回名古屋市公募債(30年)	2.53	100,000	129,978	2035/3/20		
第5回名古屋市公募債(30年)	2.49	100,000	134,601	2039/3/18		
第9回名古屋市公募債(20年)	2.07	100,000	114,895	2028/12/20		
第11回名古屋市公募債(30年)	1.774	100,000	125,280	2044/9/20		
第481回名古屋市公募債(10年)	0.744	100,000	101,142	2022/12/20		

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第499回名古屋市公募債(10年)	0.225	100,000	100,986	2027/3/26		
第512回名古屋市公募債(10年)	0.15	300,000	300,402	2030/6/20		
平成24年度第2回京都市公募債	0.849	122,500	123,780	2022/8/29		
平成24年度第4回京都市公募債	0.801	100,000	101,101	2022/10/21		
平成24年度第5回京都市公募債	0.854	100,000	101,410	2023/1/31		
平成28年度第6回京都市公募債	0.18	200,000	201,410	2027/1/27		
平成18年度第3回神戸市公募債(20年)	2.54	120,000	135,126	2026/6/19		
平成20年度第1回神戸市公募債(20年)	2.38	200,000	232,114	2028/5/26		
平成21年度第11回神戸市公募債(20年)	2.233	100,000	118,122	2030/1/29		
平成24年度第12回神戸市公募債(20年)	1.711	100,000	116,853	2032/12/17		
令和2年度第9回神戸市公募債(30年)	0.674	100,000	98,421	2050/6/20		
第5回横浜市公募債(20年)	2.17	100,000	108,755	2025/6/20		
第20回横浜市公募債(20年)	2.1	300,000	349,608	2029/10/19		
平成28年度第4回横浜市公募債	0.175	100,000	100,675	2027/1/22		
平成29年度第2回横浜市公募債	0.24	100,000	101,076	2027/7/16		
平成30年度第1回横浜市公募債	0.195	100,000	100,855	2028/4/17		
平成30年度第4回横浜市公募債	0.289	200,000	202,988	2028/10/17		
第30回横浜市公募債(20年)	1.376	200,000	228,428	2034/10/20		
令和2年度第1回横浜市公募債	0.15	300,000	300,399	2030/6/12		
令和3年度第2回横浜市公募債	0.16	100,000	100,049	2031/5/23		
平成23年度第9回札幌市公募債(15年)	1.493	100,000	108,176	2027/2/12		
平成24年度第10回札幌市公募債(10年)	0.8	100,000	101,229	2022/12/20		
平成26年度第9回札幌市公募債(10年)	0.43	100,000	101,491	2024/12/20		
第11回川崎市公募債(20年)	1.84	100,000	115,688	2030/10/18		
第89回川崎市公募債	0.16	100,000	100,581	2026/12/18		
平成26年度第2回北九州市公募債	0.451	100,000	101,534	2024/12/24		
平成27年度第2回北九州市公募債	0.484	100,000	102,109	2025/12/18		
平成28年度第1回北九州市公募債	0.08	100,000	100,309	2026/4/15		
平成21年度第3回福岡市公募債(20年)	2.14	100,000	116,747	2029/9/18		
平成25年度第6回福岡市公募債(20年)	1.511	100,000	115,548	2034/2/17		
平成26年度第5回福岡市公募債	0.539	200,000	203,606	2024/10/28		
平成30年度第5回福岡市公募債(5年)	0.03	200,000	200,088	2023/8/17		
平成30年度第9回福岡市公募債(10年)	0.289	100,000	101,500	2028/10/30		
平成25年度第3回広島市公募債	0.67	150,000	152,706	2024/2/23		
平成26年度第2回広島市公募債	0.456	100,000	101,589	2024/12/25		
平成28年度第4回広島市公募債	0.165	105,000	105,640	2026/12/25		
平成29年度第6回広島市公募債	0.23	170,000	171,881	2028/2/25		
令和元年度第6回広島市公募債	0.115	550,000	549,285	2030/2/25		
令和2年度第3回広島市公募債(5年)	0.02	200,000	200,086	2025/10/24		
令和元年度第5回千葉市公募債	0.08	200,000	199,134	2030/2/25		
平成24年度第1回徳島県公募債	0.68	100,000	101,215	2023/3/24		
平成24年度第2回岡山県公募債(10年)	0.68	150,000	151,836	2023/3/29		
平成24年度第1回岡山県公募債(10年)	0.844	200,000	202,788	2023/1/31		
平成26年度第1回岡山県公募債(10年)	0.33	200,000	202,344	2025/1/30		

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	114,152	2027/12/20
小計		32,321,430	34,036,521	
特殊債券(除く金融債)				
第25回政府保証日本政策金融公庫債券	0.815	200,000	202,882	2023/2/24
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	126,000	126,086	2026/3/13
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	100,775	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	210,726	2027/9/24
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	189,025	2028/9/15
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	102,000	103,855	2023/6/27
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	410,000	415,006	2023/3/15
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	300,000	313,518	2023/6/19
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.085	100,000	100,359	2026/12/14
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	143,259	2049/6/30
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	233,232	2029/9/28
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	117,752	2029/11/30
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	131,191	2040/5/31
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	118,739	2030/12/27
第170回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	101,021	2022/8/31
第180回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	300,000	303,543	2022/12/28
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	116,320	2032/12/28
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	101,419	2023/1/31
第184回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	304,350	2023/2/28
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	202,450	2023/3/17
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	302,000	305,204	2023/4/28
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	628,000	635,787	2023/5/31
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	200,000	203,652	2023/6/30
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	150,749	2023/9/29
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.699	100,000	101,679	2023/10/31
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	265,800	270,214	2023/11/30
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	200,000	203,546	2023/12/28
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	422,000	430,359	2024/1/31

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	101,809	2024/3/29
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	230,482	2034/3/31
第215回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	102,000	103,974	2024/4/30
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,950	2024/6/28
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	101,871	2024/7/31
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	200,000	229,120	2034/9/29
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	101,807	2024/10/31
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	101,628	2024/12/27
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	303,408	2025/1/31
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	111,573	2035/2/28
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.216	200,000	224,768	2035/3/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	200,000	202,914	2026/1/30
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,658	2026/2/27
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.394	100,000	94,500	2046/5/31
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	106,911	2026/11/30
第297回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.085	316,000	317,055	2026/12/28
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	205,000	206,043	2027/1/29
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,669	2027/3/31
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.14	200,000	201,298	2027/4/30
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	100,741	2027/8/31
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	120,000	121,209	2028/2/29
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	200,000	201,394	2028/5/31
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	300,000	309,939	2038/9/30
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	214,000	216,424	2028/10/31
第44回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.834	200,000	202,786	2023/1/20
第45回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	101,425	2023/2/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	200,000	202,450	2023/3/17
第47回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	101,051	2023/4/21
第48回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	101,214	2023/5/16

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	101,831	2023/8/14	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	105,000	106,718	2023/11/17	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	203,556	2024/2/16	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	101,784	2024/3/15	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	101,672	2025/12/12	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	100,069	2026/3/13	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,359	2026/12/14	
第92回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.115	100,000	100,506	2027/1/19	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,618	2027/4/16	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,772	2027/7/16	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,729	2027/8/13	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	111,103	2028/2/15	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	157,689	2028/8/15	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,128	2028/10/16	
第119回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.001	300,000	299,949	2023/3/20	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	95,187	2070/7/16	
第14回道路債券	1.91	100,000	102,956	2022/12/20	
第17回道路債券	1.54	100,000	102,381	2022/12/20	
第21回道路債券	2.75	100,000	129,097	2033/6/20	
第27回道路債券	2.42	400,000	426,888	2024/3/20	
第28回道路債券	2.83	200,000	262,004	2033/12/20	
第33回道路債券	2.91	200,000	265,924	2034/6/20	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	115,413	2028/3/17	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	151,178	2048/3/20	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	116,209	2028/6/20	
第42回道路債券	2.22	100,000	108,325	2025/3/21	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	117,752	2029/4/20	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	116,795	2032/9/17	
第102回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.666	200,000	202,364	2023/3/20	
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	900,000	911,430	2023/3/20	
第106回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	101,853	2023/3/20	
第112回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.85	300,000	305,115	2023/6/20	
第115回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	101,656	2023/9/20	
第131回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	114,323	2034/6/20	
第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,600	2024/12/20	
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	130,540	2055/3/19	
第158回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	224,070	2035/6/20	
第188回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	616,824	2037/9/18	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第208回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	108,573	2058/3/19	
第2回公営企業債券(30年)	2.39	300,000	376,761	2033/12/20	
第3回公営企業債券(20年)	1.03	210,000	213,872	2023/3/22	
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	107,967	2029/1/26	
第5回公営企業債券(30年)	2.72	300,000	392,910	2034/9/22	
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	106,119	2024/3/22	
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	131,598	2035/6/20	
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	42,503	2024/3/22	
第8回公営企業債券(30年)	2.5	100,000	129,643	2035/9/21	
第8回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.043	200,000	233,596	2030/6/28	
第11回地方公共団体金融機構債券(30年)	0.633	200,000	194,342	2050/8/26	
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	200,000	233,480	2031/12/26	
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	116,056	2032/9/28	
第38回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	504,765	2022/7/28	
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,183	2022/11/28	
第44回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	202,592	2023/1/27	
第58回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,029	2024/3/28	
第65回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	305,262	2024/10/28	
第67回地方公共団体金融機構債券	0.501	100,000	101,716	2024/12/27	
第69回地方公共団体金融機構債券	0.478	100,000	101,714	2025/2/28	
第76回地方公共団体金融機構債券	0.505	200,000	204,190	2025/9/26	
F77回地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	107,750	2026/10/20	
F88回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	100,026	2026/9/28	
F95回地方公共団体金融機構債券	1.336	100,000	104,848	2025/2/6	
F107回地方公共団体金融機構債券	1.388	100,000	105,195	2025/3/19	
第116回地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,184	2029/1/26	
F132回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	104,452	2025/7/30	
F146回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	209,818	2025/10/28	
F208回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	103,927	2026/2/4	
F214回地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	104,996	2027/4/28	
第7回阪神高速道路債券	2.18	100,000	108,090	2025/3/21	
第22回阪神高速道路株式会社債	0.005	200,000	199,944	2023/3/20	
第4回株式会社日本政策金融公社債	2.2	100,000	116,819	2029/9/20	
第18回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	119,185	2031/5/9	
第85回株式会社日本政策金融公社債	0.001	300,000	299,961	2022/8/8	
第87回株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,894	2024/3/11	
第117回都市再生債券	0.804	200,000	211,328	2030/11/20	
第159回都市再生債券	0.43	200,000	170,600	2059/3/19	
第161回都市再生債券	0.687	100,000	93,465	2059/3/19	
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	107,737	2024/12/20	
第344回東京交通債券	1.67	100,000	102,842	2023/2/17	
第346回東京交通債券	1.13	20,000	20,453	2023/6/20	
第59回独立行政法人福祉医療機構債券	0.001	100,000	99,985	2022/12/20	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	11,614	11,884	2042/5/10	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	11,973	12,283	2037/11/10	

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	12,220	12,575	2037/11/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.18	170,388	170,260	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	121,776	121,763	2033/1/10
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	12,037	12,336	2042/8/10
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.03	12,964	13,381	2038/5/10
第4回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.08	219,867	219,262	2033/4/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	10,412	10,473	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	21,718	22,034	2037/5/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	12,853	13,257	2038/11/10
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.06	239,190	238,240	2034/2/10
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.14	85,152	85,070	2034/2/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	11,487	11,732	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	13,445	13,923	2039/5/10
第8回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	277,119	276,722	2034/6/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	11,519	11,766	2037/5/10
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	191,114	190,974	2034/8/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	13,492	13,988	2039/11/10
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	114,225	2027/12/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	17,727	18,806	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	18,079	19,246	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	20,103	21,519	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	21,975	23,396	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	24,025	25,726	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	24,731	26,435	2044/12/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	53,036	56,620	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	11,727	11,963	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	24,116	25,504	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	11,871	12,125	2041/2/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	11,635	11,931	2041/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	25,284	26,759	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	10,835	10,996	2041/9/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	25,463	27,004	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	24,570	25,986	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	12,799	13,297	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	52,836	55,660	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	28,334	29,903	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	12,608	13,034	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	38,124	40,247	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	36,086	38,035	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	35,943	37,917	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	78,650	82,793	2047/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	86,012	89,828	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	43,793	45,692	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	44,048	46,334	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	44,455	46,814	2048/2/10

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	38,448	40,330	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	38,348	39,936	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	44,052	46,425	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	177,618	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	117,438	122,282	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	158,420	164,951	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	44,774	46,547	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	46,185	48,049	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	46,920	48,682	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	116,874	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	149,076	154,639	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	50,949	52,672	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	107,012	109,922	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	59,449	61,271	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	63,247	64,993	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	62,965	65,018	2050/6/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	194,613	201,768	2050/7/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	130,992	135,660	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	63,697	65,844	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	68,722	71,103	2051/1/10
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	74,782	75,068	2051/5/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	79,920	80,417	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	79,777	80,104	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	80,101	80,769	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	80,443	81,468	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	81,184	82,097	2052/2/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	82,887	83,793	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	83,619	84,630	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	83,142	83,924	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	83,565	84,375	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	84,074	84,936	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	169,582	170,960	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	84,134	84,967	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	171,258	173,381	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	85,536	86,393	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	171,114	172,561	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	86,396	87,573	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	174,142	175,207	2053/7/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	174,894	176,251	2053/8/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	129,508	2043/3/20
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	88,538	89,714	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	88,771	90,135	2053/11/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	88,785	89,418	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	181,280	181,811	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	90,679	90,859	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,658	90,969	2054/5/10

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	182,760	183,070	2054/6/10	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	92,456	91,915	2054/7/10	
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	278,994	275,961	2054/9/10	
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	187,094	185,024	2054/10/10	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	94,910	95,269	2055/2/10	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	95,465	95,524	2055/3/10	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	195,232	196,362	2055/9/10	
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	98,274	98,678	2055/11/10	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	197,188	198,045	2055/12/10	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	197,600	198,103	2056/1/10	
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	99,077	99,581	2056/2/10	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	198,976	200,818	2056/3/10	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	200,000	201,644	2056/5/10	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	100,000	100,641	2056/6/10	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	96,864	2036/7/18	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	0.753	100,000	99,708	2051/3/20	
第60回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,978	2022/9/20	
第62回日本学生支援債券	0.001	100,000	99,984	2023/2/20	
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	108,140	2025/6/20	
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	117,307	2033/9/20	
第48回東日本高速道路株式会社債	0.09	600,000	600,648	2022/12/20	
第64回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	99,581	2029/11/29	
第67回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	200,426	2030/1/31	
第73回東日本高速道路株式会社債	0.21	500,000	500,065	2030/7/17	
第73回中国日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	100,020	2022/7/29	
第83回中国日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	100,037	2023/4/20	
第27回西日本高速道路株式会社債	0.58	100,000	102,229	2025/9/2	
第28回西日本高速道路株式会社債	0.566	100,000	102,259	2025/11/5	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	101,534	2023/9/20	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	99,947	2026/8/19	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	199,204	2034/5/30	
第141回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.001	200,000	199,970	2022/12/20	
小計		35,448,599	36,934,695		
金融債券					
い第823号商工債	0.17	200,000	200,668	2023/12/27	
い第829号商工債	0.13	200,000	200,366	2024/6/27	
い第832号商工債	0.06	200,000	199,932	2024/9/27	
い第833号商工債	0.05	100,000	99,880	2024/10/25	
い第843号商工債	0.12	200,000	200,252	2025/8/27	
第337回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,125	2022/12/27	
第338回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,124	2023/1/27	
第339回信金中金債(5年)	0.11	200,000	200,260	2023/2/27	
第342回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,148	2023/5/26	
第350回信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,106	2024/1/26	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第360回信金中金債(5年)	0.01	200,000	199,788	2024/11/27	
第236号商工債(3年)	0.02	300,000	299,961	2022/9/27	
第254号商工債(3年)	0.05	300,000	300,084	2024/3/27	
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	102,049	2025/9/26	
小計		2,400,000	2,403,743		
普通社債券(含む投資法人債券)					
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	101,878	2025/3/25	
第507回中部電力株式会社社債	0.605	100,000	102,251	2026/1/23	
第511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	100,306	2026/7/24	
第519回中部電力株式会社社債	0.84	100,000	104,330	2037/1/23	
第540回中部電力株式会社社債	0.53	100,000	98,234	2040/2/24	
第508回関西電力株式会社社債	0.455	100,000	101,397	2027/4/23	
第510回関西電力株式会社社債	0.49	200,000	203,172	2027/7/23	
第511回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	101,085	2027/9/17	
第524回関西電力株式会社社債	0.514	100,000	101,657	2028/10/25	
第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	100,832	2030/12/20	
第538回関西電力株式会社社債	0.39	100,000	100,327	2031/1/24	
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	102,553	2025/7/25	
第398回中国電力株式会社社債	0.425	100,000	101,376	2027/7/23	
第400回中国電力株式会社社債	0.34	100,000	100,842	2027/9/24	
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,576	2024/10/25	
第416回中国電力株式会社社債	0.355	200,000	201,316	2029/5/25	
第425回中国電力株式会社社債	0.37	100,000	100,664	2030/6/25	
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	104,578	2026/6/25	
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	100,000	101,171	2027/6/25	
第330回北陸電力株式会社社債	0.34	200,000	201,160	2029/5/25	
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	129,548	2023/12/25	
第481回東北電力株式会社社債	0.803	100,000	102,863	2025/7/25	
第496回東北電力株式会社社債	0.355	100,000	100,967	2027/9/24	
第508回東北電力株式会社社債	0.465	100,000	101,544	2029/4/25	
第521回東北電力株式会社社債	0.45	200,000	202,446	2030/5/24	
第527回東北電力株式会社社債	0.32	100,000	100,000	2031/2/25	
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	101,968	2023/6/23	
第309回四国電力株式会社社債	0.4	100,000	100,918	2030/5/24	
第314回四国電力株式会社社債	0.29	100,000	99,952	2031/5/23	
第449回九州電力株式会社社債	0.43	200,000	202,856	2027/4/23	
第465回九州電力株式会社社債	0.38	100,000	100,970	2028/7/25	
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	101,324	2028/8/25	
第484回九州電力株式会社社債	0.375	200,000	201,240	2029/11/22	
第489回九州電力株式会社社債	0.44	100,000	101,047	2030/5/24	
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	100,000	102,948	2025/12/25	
第340回北海道電力株式会社社債	0.48	100,000	101,542	2027/4/23	
第350回北海道電力株式会社社債	0.754	100,000	102,028	2038/3/25	
第39回大成建設株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,923	2030/6/14	
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	100,134	2027/11/30	

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.03	200,000	199,416	2023/11/27
第7回住友林業株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,964	2024/3/6
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	300,000	300,015	2026/6/3
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,251	2024/9/13
第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,768	2023/11/27
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,399	2024/6/13
第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,826	2023/10/13
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	100,000	101,864	2025/2/28
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.09	200,000	200,010	2026/6/3
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,088	2025/8/29
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	100,280	2022/7/15
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	101,973	2024/4/24
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	100,144	2028/10/20
第10回J・フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.47	100,000	100,041	2028/5/26
第2回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.856	100,000	101,906	2024/7/29
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,849	2023/8/30
第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	100,000	100,476	2030/4/22
第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.19	200,000	200,870	2025/12/19
第13回旭化成株式会社無担保社債	0.12	100,000	100,060	2025/6/19
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.45	100,000	100,887	2028/11/29
第9回イビデン株式会社無担保社債	0.03	100,000	99,755	2022/9/12
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	100,326	2028/8/31
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	100,803	2028/2/25
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	200,000	200,182	2027/2/26
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.19	200,000	200,770	2025/6/11
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.09	100,000	100,005	2026/6/3
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.74	100,000	100,037	2041/6/3
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	100,610	2028/3/23
第5回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.005	400,000	399,756	2022/9/27
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.01	200,000	199,714	2023/11/27
第4回株式会社電通グループ無担保社債	0.22	100,000	100,147	2025/7/8
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	100,000	100,404	2030/7/8
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,981	2026/3/6

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第42回DTC株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,043	2023/4/17
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	97,664	2029/7/31
第14回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,924	2023/3/3
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	102,573	2024/10/23
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,014	2024/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	100,326	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	100,000	100,247	2026/4/17
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,806	2026/6/19
第28回ジェイ エフ イーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,369	2026/5/27
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	300,258	2025/7/14
第33回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.15	100,000	100,030	2024/6/20
第8回株式会社タダノ無担保社債	0.28	100,000	99,963	2025/7/17
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	99,361	2030/3/12
第1回株式会社安川電機無担保社債	0.13	100,000	100,030	2026/5/20
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,168	2025/7/16
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	100,000	99,879	2030/7/16
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,501	2023/9/20
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	200,000	203,004	2026/9/18
第20回パナソニック株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,980	2023/12/22
第21回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	100,000	100,232	2025/12/24
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	100,000	2028/3/17
第19回株式会社デンソー無担保社債	0.001	300,000	299,637	2023/11/20
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,677	2024/9/3
第35回三菱重工株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,022	2027/8/27
第11回J&A三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,198	2023/9/7
第1回明治和田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,134	2022/8/4
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,051	2026/2/4
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	200,000	198,440	2026/9/25
第12回本田技研工業株式会社無担保社債	0.05	200,000	199,818	2023/3/3
第1回明治和田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	100,000	100,156	2023/9/25
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	100,005	2026/3/11
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	101,888	2024/3/14
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	97,800	2040/3/9
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	102,053	2024/5/30
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	100,638	2027/7/12
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	117,546	2033/3/4
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	200,542	2029/7/11
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,461	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	101,007	2028/9/14
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	0.61	100,000	100,091	2029/12/12
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	100,000	117,956	2029/10/16

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	112,322	2027/4/20
第141回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.82	100,000	101,202	2023/1/23
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	101,395	2024/9/12
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	100,000	101,370	2024/12/20
第1回みずほFG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	300,000	304,266	2024/7/16
第3回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,311	2025/7/15
第4回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,242	2025/10/7
第16回N T T ファイナンス株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,872	2025/12/19
第18回N T T ファイナンス株式会社無担保社債	0.38	200,000	202,018	2030/9/20
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,706	2026/6/19
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	200,000	199,762	2023/9/19
第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.16	100,000	100,133	2025/9/19
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.14	100,000	99,959	2025/12/19
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.11	100,000	100,065	2025/10/21
第37回リコーリース株式会社無担保社債	0.02	300,000	299,751	2022/10/11
第41回リコーリース株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,836	2026/4/17
第7回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.19	200,000	199,832	2023/3/20
第30回株式会社ジャックス無担保社債	0.28	100,000	100,258	2026/1/27
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	104,117	2026/9/18
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,337	2023/12/20
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,906	2024/1/19
第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,534	2023/11/27
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,186	2023/10/25
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	201,946	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	101,478	2028/1/18
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.474	100,000	101,412	2028/10/18
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	100,190	2027/8/27
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	200,000	200,304	2023/9/4
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	201,292	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,610	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	97,476	2039/8/5
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,275	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	102,238	2024/9/9
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	101,897	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	104,199	2026/6/17

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,710	2023/11/27
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	99,557	2046/9/26
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	100,627	2040/6/11
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,618	2023/11/27
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	103,568	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	99,438	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	96,257	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	101,134	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	101,044	2028/9/7
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	112,326	2026/9/18
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	232,632	2028/12/12
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.06	100,000	99,717	2026/7/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	107,440	2047/7/26
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	107,859	2058/9/27
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.265	100,000	100,523	2030/4/22
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.836	100,000	99,557	2050/12/16
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.596	100,000	100,365	2041/4/15
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	115,235	2028/3/17
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	101,830	2056/12/13
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.042	100,000	105,371	2047/8/30
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.13	500,000	501,385	2025/5/21
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.582	100,000	100,028	2041/4/22
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	130,484	2039/12/16
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	124,111	2044/10/28
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	100,000	111,957	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	106,659	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	93,198	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	92,630	2070/1/31
第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.878	200,000	193,404	2049/11/19
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,878	2025/9/4
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,022	2024/12/6
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,669	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,190	2028/11/22
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.3	400,000	400,020	2026/6/3
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	107,774	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	102,323	2023/12/20
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	101,918	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	101,279	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	100,744	2028/7/20
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	200,000	204,602	2029/10/9

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	400,000	404,336	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	103,005	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.64	300,000	303,633	2026/10/8
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	103,076	2032/10/8
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.4	100,000	100,077	2026/4/22
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	100,000	100,241	2031/4/22
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.805	100,000	98,942	2050/9/9
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.225	200,000	200,262	2030/9/10
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	200,000	200,098	2031/6/3
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	100,019	2041/6/3
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	101,619	2023/6/20
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,033	2022/7/21
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	100,000	100,694	2022/12/16
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	200,000	202,712	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債	0.384	100,000	100,324	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債	0.25	300,000	299,619	2024/10/10
第2回B・P・C・E・S・A 円貨社債 (ソーシャルボンド)	0.367	100,000	100,252	2024/6/28

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第2回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	100,000	100,674	2023/7/12
第14回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	100,180	2026/6/17
第15回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	100,264	2024/1/26
第17回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,992	2023/1/25
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	100,177	2024/6/7
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	399,688	2023/7/6
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,905	2023/6/2
小計		27,826,000	28,160,874	
合計		589,566,029	626,968,264	

投資信託財産の構成

項目	当 期		末	
	評 価 額	比	評 価 額	率
公 社 債	千円	%		
	626,968,264	97.2		
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,254,472	2.8		
投 資 信 託 財 産 総 額	645,222,736	100.0		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年5月31日現在
(A)資 産	645,322,783,404円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,444,560,667
公 社 債(評価額)	626,968,264,763
未 収 入 金	14,534,188,600
未 収 利 息	1,253,652,398
前 払 費 用	22,069,976
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B)負 債	16,956,612,883
未 払 金	16,722,426,420
未 払 解 約 金	134,135,091
未 払 利 息	4,372
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純 資 産 総 額(A-B)	628,366,170,521
元 本	446,205,859,601
次 期 繰 越 損 益 金	182,160,310,920
(D)受 益 権 総 口 数	446,205,859,601口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,082円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A)配 当 等 収 益	4,288,930,766円
受 取 利 息	4,289,443,397
支 払 利 息	△512,631
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△6,376,403,467
売 買 益	264,590,045
売 買 損	△6,640,993,512
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,244,740
取 引 益	6,749,940
取 引 損	△8,994,680
(D)そ の 他 費 用	△4,604
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△2,089,722,045
(F)前 期 繰 越 損 益 金	158,033,529,561
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	32,991,162,844
(H)解 約 差 損 益 金	△6,774,659,440
(I)計 (E+F+G+H)	182,160,310,920
次 期 繰 越 損 益 金(I)	182,160,310,920

(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382,125,773,582円、期中追加設定元本額は80,683,811,289円、期中一部解約元本額は16,603,725,270円です。

※担保に供している資産

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

国債証券 101,057,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS 92,758,841,858円

FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用) 77,436,978,713円

DC日本債券インデックス・オープンP 69,290,781,589円

DCマイセクション50 27,468,404,443円

分散投資コア戦略ファンドS 26,474,515,732円

分散投資コア戦略ファンドA 26,190,440,582円

DCマイセクション25 24,259,996,622円

SMT 国内債券インデックス・オープン 20,498,916,841円

日本債券ファンド・シリーズ1 14,119,889,697円

DCマイセクションS50 12,370,734,258円

DCマイセクションS25 11,081,370,502円

DCマイセクション75 7,952,503,833円

グローバル・バランスファンド・シリーズ1 6,023,231,385円

SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,701,103,587円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,511,595,997円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,494,948,162円
DC世界経済インデックスファンド	2,900,386,752円
DCマイセレクションS75	2,628,230,250円
世界経済インデックスファンド	2,422,718,815円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	1,836,449,848円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,538,051,502円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,264,891,633円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,147,086,631円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,109,102,036円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	968,655,807円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	823,729,199円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	667,635,127円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	438,924,206円
DC日本債券インデックス・オープン	436,898,315円
グローバル経済コア	195,080,047円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	191,715,196円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	146,968,465円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	135,459,099円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	123,749,905円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	83,726,323円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	61,620,608円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	54,145,348円
SMT インデックスバランス・オープン	53,437,052円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	44,597,302円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	40,798,833円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	39,906,749円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	38,416,976円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	35,911,181円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,348,303円
SMT 世界経済インデックス・オープン	23,069,358円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	21,131,825円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	15,062,826円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,063,855円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	11,186,019円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,355,501円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	5,983,140円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	5,191,061円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	2,930,513円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	2,651,160円
エマージング株式オープン	2,227,240円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	1,015,770円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	816,513円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	279,511円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2021年5月31日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率						
第17期(2017年5月29日)	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
第18期(2018年5月29日)	22,222	17.5	596.68	15.6	95.1	2.5	2.5	2.5	2.5	306,484
第19期(2019年5月29日)	24,481	10.2	644.41	8.0	92.8	4.9	2.2	2.2	2.2	336,874
第20期(2020年5月29日)	25,011	2.2	644.69	0.0	95.0	2.5	2.7	2.7	2.7	345,116
第21期(2021年5月29日)	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5	2.5	2.5	399,725
第21期(2021年5月31日)	37,583	45.3	934.05	43.2	95.3	2.5	2.2	2.2	2.2	517,603

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率					
(当期首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%	%	%	%
2020年 6月末	25,857	—	652.38	—	92.9	4.2	2.5	2.5	2.5
2020年 7月末	26,354	1.9	663.23	1.7	95.3	2.3	2.4	2.4	2.4
2020年 8月末	27,231	5.3	686.51	5.2	95.7	1.8	2.4	2.4	2.4
2020年 9月末	29,318	13.4	735.60	12.8	96.0	1.5	2.3	2.3	2.3
2020年 10月末	28,168	8.9	705.43	8.1	94.7	3.0	2.3	2.3	2.3
2020年 11月末	27,382	5.9	686.46	5.2	94.0	3.8	2.3	2.3	2.3
2020年 12月末	30,537	18.1	765.01	17.3	94.8	3.0	2.2	2.2	2.2
2021年 1月末	31,417	21.5	786.13	20.5	95.9	2.1	2.1	2.1	2.1
2021年 2月末	32,066	24.0	800.16	22.7	95.5	2.3	2.1	2.1	2.1
2021年 3月末	33,155	28.2	829.14	27.1	95.9	1.9	2.2	2.2	2.2
2021年 4月末	35,378	36.8	877.34	34.5	96.1	1.7	2.2	2.2	2.2
2021年 5月31日	37,039	43.2	920.75	41.1	96.0	1.7	2.2	2.2	2.2
(当期末) 2021年 5月31日	37,583	45.3	934.05	43.2	95.3	2.5	2.2	2.2	2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

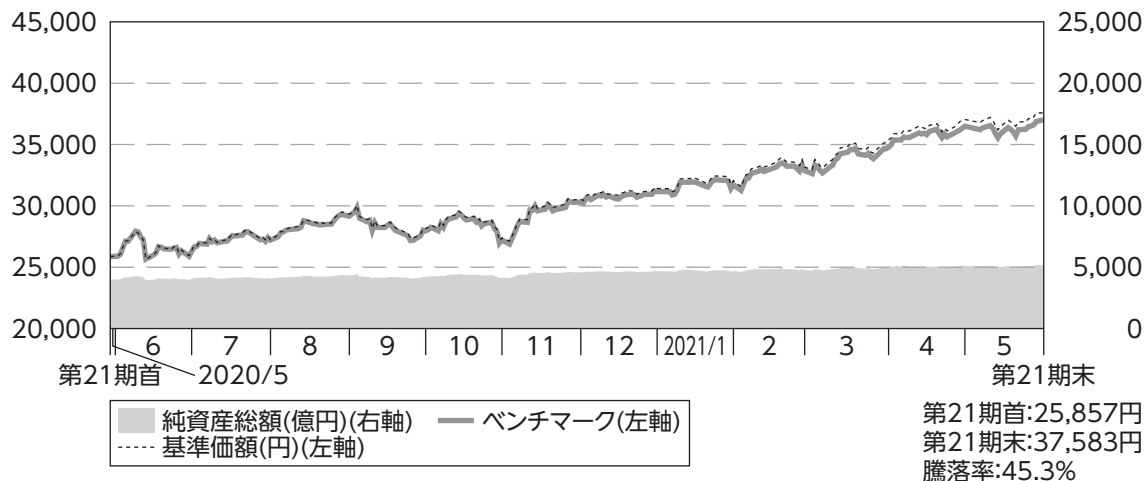
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

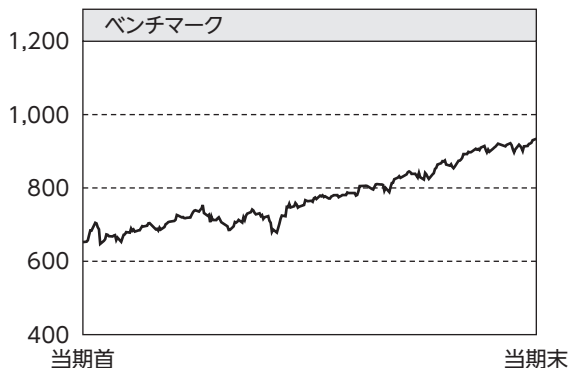


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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(円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、FRB(米連邦準備理事会)やECB(欧州中央銀行)など各国中央銀行による金融緩和と政策、大型ハイテク企業の好決算などを受けて2020年8月にかけて上昇しました。その後は、米欧各国にて新型コロナウイルスの新規感染者数が増加傾向となったことなどが嫌気されて下落する場面もありましたが、米国にて上下両院で民主党が多数を確保したことで大規模な経済対策が実現するとの期待が高まったことや、米雇用統計などの概ね良好なマクロ経済指標、米欧各国でワクチン接種が順調に進んでいることなどが好感されて堅調に推移し、先進国株式市場は過去最高値圏で終了しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

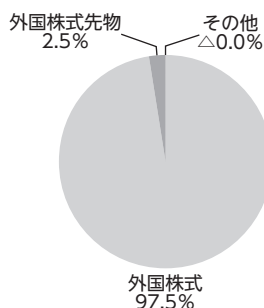
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	3.8%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	3.3%
3	AMAZON.COM	アメリカ	2.5%
4	S&P 500 EMIN 2106	アメリカ	1.8%
5	FACEBOOK INC-A	アメリカ	1.4%
6	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%

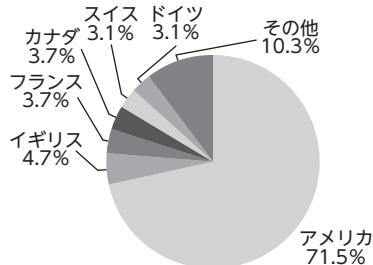
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
9	TESLA INC	アメリカ	0.9%
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
組入銘柄数		1,301	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

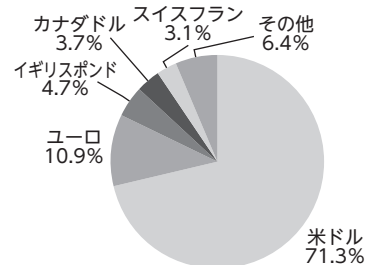
○資産別配分



○国別配分



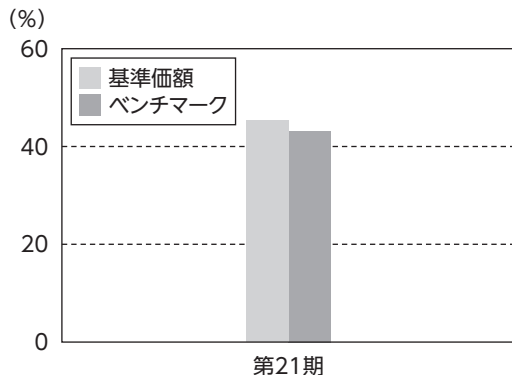
○通貨別配分



(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。
 (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2.5%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。

差異の主な要因は、プラスの影響としては配当要因*1、マイナスの影響としては為替評価差要因*2です。

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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年5月30日~2021年5月31日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.003%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.002)	
(b) 有価証券取引税	1	0.003	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(1)	(0.003)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	9	0.030	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(9)	(0.028)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.002)	
合計	11	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(30,325円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 25,603 (17,688)	千米ドル 218,798 (5,469)	百株 55,914 (902)	千米ドル 469,552 (5,710)
	カ ナ ダ	6,259 (553)	千カナダドル 20,967 (-)	7,211	千カナダドル 31,032
	ド イ ツ	3,345 (515)	千ユーロ 12,008 (△631)	4,924 (58)	千ユーロ 17,820 (1)
	イ タ リ ア	3,622 (-)	3,753 (△3)	5,183 (644)	3,893 (476)
	フ ラ ン ス	1,847 (△220)	7,268 (△302)	3,446 (218)	18,379 (151)
	オ ラ ン ダ	1,694 (199)	6,555 (△5,330)	4,439 (-)	11,088 (92)
	ス ペ イ ン	2,628 (42,101)	1,474 (1,113)	14,009 (40,244)	4,719 (763)
	ベ ル ギ ー	128	1,342	282	1,703
	オ ー ス ト リ ア	-	-	176	645
	ル ク セ ン ブ ル ク	133 (104)	246 (-)	532	425
	フ ィ ン ラ ン ド	574 (411)	1,018 (-)	1,936	1,934
	ア イ ル ラ ン ド	84 (46)	685 (542)	1,741	1,159
	ポ ル ト ガ ル	398 (2,359)	169 (-)	2,858	254
	そ の 他	- (1,383)	- (6,435)	- (1,383)	- (6,435)
	国	イ ギ リ ス	12,672 (13,240)	千イギリスポンド 8,496 (6,616)	44,807 (6,945)
ス イ ス		1,031 (0.34)	千スイスフラン 9,212 (△349)	2,671 (-)	千スイスフラン 19,256 (15)
ス ウ ェ ー デ ン		3,971 (6,212)	千スウェーデンクローナ 77,464 (-)	4,636	千スウェーデンクローナ 73,983
ノ ル ウ ェ ー		491	千ノルウェークローネ 7,183	455	千ノルウェークローネ 7,584

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	デンマーク	938 (1,698)	千デンマーククローネ 25,549 (-)	1,948	千デンマーククローネ 39,815
	オーストラリア	7,647 (825)	千オーストラリアドル 12,623 (327)	18,639 (466)	千オーストラリアドル 19,778 (277)
	ニュージーランド	510	千ニュージーランドドル 331	1,409	千ニュージーランドドル 650
	香 港	8,180 (△2,144)	千香港ドル 24,480 (3,263)	18,326 (820)	千香港ドル 63,984 (4,247)
	シンガポール	1,019	千シンガポールドル 610	9,237	千シンガポールドル 3,420
	イスラエル	5	千イスラエルシェケル 460	326	千イスラエルシェケル 1,500

(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	アメリカ	証 券 — (11,807)	千米ドル — (69)	証 券 11,807	千米ドル 58
	ス イ ス	— (95,940)	千スイスフラン — (15)	95,940	千スイスフラン 16

(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
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	368	2	371
	BOSTON PROPERTIES	—	—	1	152
	SL GREEN REALTY CORP	—	—	8	339
	PROLOGIS INC	3	320	10	1,088
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	—	—	1	231
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	16	622
	DUKE REALTY CORP	—	—	3	150
	CROWN CASTLE INTL CORP	2	475	5	947
	ESSEX PROPERTY TRUST	—	—	0.81	206
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	—	—	3	222
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	7	632
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4	128	6	205
	WELLTOWER INC	3	191	5	407
	KIMCO REALTY CORP	—	—	35	393
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	—	1	194
	REALTY INCOME CORP	7	460	6	373
	REGENCY CENTERS CORP	3	151	5	298
	SIMON PROPERTY GROUP	4	327	5	469
	PUBLIC STORAGE	0.967	217	2	455
	VENTAS INC	8	323	11	490
	EXTRA SPACE STORAGE INC	—	—	1	200
	DIGITAL REALTY TRUST INC	—	—	1	175
	VEREIT INC	— (△84)	— (—)	—	—
	AMERICAN TOWER CORPORATION	1	453	5	1,303
	EQUINIX INC	0.212	162	0.645	459
	VICI PROPERTIES INC	5	132	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.433	139	1	443
	小 計	48 (△84)	3,851 (—)	150	10,837
	カナダ	千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	—	5	135
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	—	—	9	91
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	—	12	194
	小 計	—	—	27	421

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
ICADE	—	—	2	176
KLEPIERRE	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	(—)	(△14)	—	—
小 計	—	—	3	186
	(—)	(△14)	6	363
ユ ー ロ 計	(—)	(△14)	6	363
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	7	51	—	—
小 計	7	51	—	—
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
SYDNEY AIRPORT	17	115	—	—
	(17)	(93)	(—)	(14)
GOODMAN GROUP	7	145	30	538
VICINITY CENTERS	74	122	—	—
LENDLEASE GROUP	9	128	—	—
SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	—	—	—	—
	(17)	(14)	(17)	(14)
小 計	108	511	30	538
	(34)	(107)	(17)	(28)
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	—	—	28	1,957
小 計	—	—	28	1,957
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	51	99	—	—
	(174)	(340)	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	—	—	—	—
	(10)	(18)	—	—
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	—	—	(243)	(403)
SUNTEC REIT	—	—	173	245
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	365	746	96	202
	(4)	(5)	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	—	—	—	—
	(—)	(△2)	—	—
小 計	417	845	269	447
	(189)	(361)	(243)	(403)

(注1)金額は受渡金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 104,113	百万円 111,916	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	104,997,016千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	436,135,946千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	0.24

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 34,417	百万円 -	% -	百万円 87,123	百万円 34	% 0.0
金 銭 信 託	2	2	100.0	142	142	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	185,297	7,864	4.2	184,452	7,864	4.3

(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(上場、登録株式)>

銘柄	当期末(前期末)	当 期		末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)				千米ドル		
ABBOTT LABORATORIES	1,686	1,527	17,818	1,955,786	ヘルスケア機器・サービス	
AES CORP	617	617	1,569	172,251	公益事業	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	844	774	11,132	1,221,905	ソフトウェア・サービス	
CHUBB LTD	432	386	6,570	721,172	保険	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	210	191	5,728	628,804	素材	
ALLEGHANY CORP	12	12	914	100,358	保険	
RALPH LAUREN CORPORATION	45	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ALLSTATE CORP	309	264	3,609	396,224	保険	
HONEYWELL INTL INC	694	—	—	—	資本財	
HESS CORP	248	248	2,082	228,566	エネルギー	
AMERICAN EXPRESS	663	594	9,514	1,044,358	各種金融	
AMERICAN ELECTRIC POWER	471	—	—	—	公益事業	
AFLAC	686	580	3,289	361,059	保険	
AMERICAN INT'L GROUP	831	752	3,974	436,295	保険	
JONES LANG LASALLE INC	44	—	—	—	不動産	
VALERO ENERGY CORP	392	346	2,788	306,067	エネルギー	
APACHE CORP	642	—	—	—	エネルギー	
ALBEMARLE CORP	101	101	1,700	186,687	素材	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	521	483	3,215	352,987	食品・飲料・タバコ	
PINNACLE WEST CAPITAL	107	107	911	100,001	公益事業	
AMEREN CORPORATION	231	208	1,759	193,134	公益事業	
ARROW ELECTRONICS INC	78	61	734	80,565	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AUTOLIV INC	101	67	718	78,858	自動車・自動車部品	
AUTOZONE INC	22	19	2,793	306,615	小売	
AVERY DENNISON CORP	74	74	1,644	180,499	素材	
BALL CORP	291	279	2,294	251,824	素材	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,258	1,183	34,256	3,759,948	各種金融	
BANK NEW YORK CO	792	712	3,713	407,560	各種金融	
BAXTER INTERNATIONAL	462	440	3,615	396,809	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	258	251	6,074	666,719	ヘルスケア機器・サービス	
AMETEK INC	222	196	2,656	291,618	資本財	
VERIZON COMMUNICATIONS	3,944	3,569	20,162	2,213,063	電気通信サービス	
WR BERKLEY CORP	140	117	913	100,282	保険	
BEST BUY COMPANY INC	227	198	2,309	253,511	小売	
BIO-RAD LABORATORIES-A	21	18	1,116	122,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YUM BRANDS INC	291	258	3,100	340,311	消費者サービス	
FIRSTENERGY CORP	505	457	1,735	190,519	公益事業	
BOEING CO	519	476	11,779	1,292,906	資本財	
ROBERT HALF INTL INC	95	95	849	93,226	商業・専門サービス	
BORGWARNER INC	198	197	1,014	111,358	自動車・自動車部品	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	7	787	86,410	食品・飲料・タバコ	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,330	1,236	5,261	577,551	ヘルスケア機器・サービス	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	20	2,668	292,866	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,235	1,930	12,684	1,392,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ONEOK INC	369	377	1,988	218,287	エネルギー	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	70	63	840	92,286	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)	
UNITED RENTALS INC	64	61	2,038	223,708	資本財
SEMPRA ENERGY	269	270	3,665	402,360	公益事業
FEDEX CORP	241	215	6,798	746,252	運輸
AMPHENOL CORPORATION	276	514	3,460	379,834	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	290	262	2,107	231,268	食品・飲料・タバコ
CABOT OIL & GAS CORP	358	—	—	—	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	158	158	772	84,772	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	159	149	3,574	392,333	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	279	246	1,384	151,960	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	536	472	11,386	1,249,776	資本財
LUMEN TECHNOLOGIES INC	939	861	1,192	130,839	電気通信サービス
JPMORGAN CHASE & CO	3,001	2,635	43,277	4,750,163	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	234	210	1,805	198,121	家庭用品・パーソナル用品
CIGNA CORP	356	302	7,828	859,302	ヘルスケア機器・サービス
CLOROX COMPANY	119	108	1,913	210,079	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,881	3,556	19,666	2,158,587	食品・飲料・タバコ
COLGATE-PALMOLIVE CO	776	704	5,901	647,753	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE INC	—	49	1,241	136,291	ヘルスケア機器・サービス
COMERICA INC	143	—	—	—	銀行
NRG ENERGY INC	230	230	741	81,437	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	459	411	1,568	172,112	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	317	287	2,220	243,696	公益事業
CMS ENERGY CORP	267	267	1,677	184,154	公益事業
THE COOPER COS INC	46	41	1,626	178,527	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	723	649	2,835	311,221	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	146	146	835	91,673	素材
HEICO CORP-CLASS A	64	64	854	93,760	資本財
CUMMINS INC	136	129	3,322	364,679	資本財
DR HORTON INC	321	296	2,823	309,921	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	597	556	14,246	1,563,696	ヘルスケア機器・サービス
MOODY'S CORP	162	147	4,958	544,280	各種金融
TARGET (DAYTON HUDSON)	484	434	9,867	1,083,044	小売
DEERE&CO	290	258	9,339	1,025,102	資本財
MORGAN STANLEY	1,158	1,222	11,115	1,219,992	各種金融
REPUBLIC SERVICES INC	217	200	2,184	239,755	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,719	1,566	27,986	3,071,808	メディア・娯楽
DOVER CORP	138	122	1,836	201,563	資本財
OMNICOM GROUP	208	180	1,482	162,759	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	183	162	2,240	245,967	公益事業
DUKE ENERGY CORP	699	660	6,615	726,141	公益事業
FLOWSERVE CORP	108	—	—	—	資本財
DARDEN RESTAURANTS INC	112	120	1,727	189,641	消費者サービス
BANK OF AMERICA CORP	8,211	6,705	28,426	3,120,067	銀行
CITIGROUP	2,082	1,811	14,258	1,565,053	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	118	126	1,585	173,989	素材
EATON CORP	401	344	5,001	548,921	資本財
EATON VANCE CORP	100	—	—	—	各種金融
ECOLAB INC	247	221	4,772	523,819	素材
PERKINELMER INC	106	93	1,359	149,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SALESFORCE.COM INC	794	792	18,873	2,071,526	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	592	513	4,917	539,777	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)	
ATMOS ENERGY CORP	114	114	1,132	124,294	公益事業
ENERGY CORP	186	169	1,781	195,551	公益事業
EOG RESOURCES INC	555	513	4,123	452,589	エネルギー
EQUIFAX INC	117	104	2,446	268,531	商業・専門サービス
ESTEE LAUDER CO-CL A	212	201	6,179	678,222	家庭用品・パーソナル用品
EXXON MOBIL	4,035	3,651	21,316	2,339,678	エネルギー
FMC CORP	121	121	1,414	155,206	素材
NEXTERA ENERGY INC	466	1,704	12,481	1,369,915	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	36	31	1,052	115,529	各種金融
FAIR ISAAC CORP	—	26	1,323	145,250	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	58	47	761	83,592	保険
M & T BANK CORP	117	117	1,883	206,727	銀行
FRANKLIN RESOURCES INC	260	260	891	97,889	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	1,389	1,253	5,354	587,722	素材
ARTHUR J GALLAGHER & CO	178	163	2,398	263,247	保険
GAP	218	—	—	—	小売
GENERAL DYNAMICS CORP	239	212	4,028	442,153	資本財
GENERAL MILLS INC	576	532	3,349	367,619	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	139	121	1,589	174,413	小売
GARTNER INC	85	75	1,738	190,850	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	154	138	2,672	293,374	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL ELECTRIC CO	8,485	7,612	10,703	1,174,809	資本財
GRAINGER (WW) INC	44	38	1,777	195,094	資本財
HALLIBURTON CO	976	775	1,740	191,064	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	304	297	11,074	1,215,555	各種金融
HARLEY-DAVIDSON	146	—	—	—	自動車・自動車部品
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	214	180	3,943	432,875	資本財
HEICO CORP	36	36	511	56,117	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	138	125	2,168	238,032	食品・飲料・タバコ
HP INC	1,415	1,063	3,108	341,210	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	129	112	1,157	127,050	素材
JUNIPER NETWORKS INC	313	313	824	90,467	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLLYFRONTIER CORP	141	—	—	—	エネルギー
UNUM GROUP	185	—	—	—	保険
HOME DEPOT	1,046	929	29,633	3,252,600	小売
HORMEL FOODS CORP	271	271	1,318	144,685	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	481	481	1,218	133,742	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	28	30	1,071	117,606	資本財
HUMANA INC	126	110	4,832	530,383	ヘルスケア機器・サービス
IDEX CORP	69	69	1,539	169,021	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	312	274	6,350	697,076	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	97	211	3,001	329,404	素材
INT'L PAPER CO	338	338	2,132	234,114	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	338	338	1,139	125,111	メディア・娯楽
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	120	120	1,708	187,541	商業・専門サービス
JOHNSON & JOHNSON	2,512	2,269	38,414	4,216,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	344	303	1,984	217,845	保険
DEVON ENERGY CORPORATION	378	570	1,513	166,167	エネルギー
KELLOGG CO	240	216	1,416	155,480	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	943	832	1,917	210,432	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	327	289	3,776	414,553	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)	
BLACKROCK INC	145	132	11,625	1,275,978	各種金融
KOHL'S CORP	146	—	—	—	小売
KROGER CO	765	613	2,267	248,836	食品・生活必需品小売り
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	35	38	1,635	179,513	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	88	88	1,321	145,047	素材
LEGGETT & PLATT INC	105	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LENNAR CORP-CL A	285	249	2,468	270,900	耐久消費財・アパレル
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	257	—	—	—	各種金融
LILLY (ELI) & CO	824	701	14,021	1,538,983	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
L BRANDS INC	—	198	1,383	151,890	小売
LINCOLN NATIONAL CORP	177	163	1,142	125,350	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	680	621	13,341	1,464,383	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	295	260	3,595	394,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOCKHEED MARTIN CORP	246	216	8,275	908,307	資本財
LOEWS CORP	257	188	1,100	120,793	保険
CARNIVAL CORPORATION	461	705	2,084	228,802	消費者サービス
LOWES COMPANIES	733	637	12,418	1,363,007	小売
DOMINION ENERGY INC	785	690	5,259	577,251	公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	586	330	1,417	155,579	消費者サービス
MCCORMICK & CO-NON VGT SHRS	118	210	1,878	206,139	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	720	648	15,171	1,665,224	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	233	206	7,850	861,709	各種金融
EVEREST RE GROUP LTD	39	32	854	93,817	保険
MANPOWER GROUP	51	—	—	—	商業・専門サービス
MARKEL CORP	13	11	1,416	155,493	保険
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	199	535	5,131	563,276	ヘルスケア機器・サービス
MARSH & MCLENNAN COS	481	446	6,173	677,598	保険
MASCO CORP	276	234	1,415	155,342	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	59	53	1,934	212,383	素材
METLIFE INC	746	642	4,202	461,239	保険
MEDTRONIC PLC	1,278	1,171	14,825	1,627,214	ヘルスケア機器・サービス
CVS HEALTH CORP	1,241	1,136	9,821	1,078,006	ヘルスケア機器・サービス
MERCK & CO	2,428	2,181	16,556	1,817,229	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	88	82	2,274	249,601	ヘルスケア機器・サービス
3 M COMPANY	558	501	10,175	1,116,846	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	50	50	1,066	117,054	耐久消費財・アパレル
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	42	1,420	155,959	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	163	149	3,062	336,174	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	96	79	2,371	260,243	運輸
FORD MOTOR COMPANY	3,751	3,344	4,859	533,405	自動車・自動車部品
NATIONAL OILWELL VARCO INC	371	—	—	—	エネルギー
NEWMONT CORPORATION	782	685	5,038	553,076	素材
NVR INC	3	2	1,451	159,317	耐久消費財・アパレル
NIKE B	1,192	1,092	14,906	1,636,105	耐久消費財・アパレル
NORDSTROM INC	100	—	—	—	小売
NORFOLK SOUTHERN CORP	253	219	6,176	677,894	運輸
EVERSOURCE ENERGY	309	293	2,379	261,131	公益事業
NISOURCE INC	357	357	912	100,146	公益事業
TAPESTRY INC	259	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NORTHROP GRUMMAN CORP	155	135	4,965	544,982	資本財
WELLS FARGO & CO	3,867	3,563	16,650	1,827,553	銀行

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NUCOR CORP	290	255		287,728	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	444	403	6,479	711,217	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	854	791	2,053	225,402	エネルギー
OGE ENERGY CORP	192	—	—	—	公益事業
ORACLE CORP	2,191	1,648	12,980	1,424,751	ソフトウェア・サービス
PARKER HANNIFIN CORP	125	112	3,461	379,962	資本財
PPL CORPORATION	691	699	2,034	223,351	公益事業
PENTAIR PLC	135	145	1,002	110,016	資本財
PERRIGO CO PLC	113	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER	5,277	4,841	18,752	2,058,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	208	208	995	109,306	公益事業
CONOCOPHILLIPS	1,047	1,173	6,539	717,809	エネルギー
PG&E CORP	—	1,353	1,372	150,614	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	158	179	2,732	299,910	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,782	1,612	7,938	871,351	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	418	367	7,146	784,357	銀行
BROWN & BROWN INC	229	198	1,043	114,559	保険
POLARIS INC	46	—	—	—	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC	221	205	3,691	405,133	素材
QUEST DIAGNOSTICS	128	113	1,492	163,814	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	2,378	2,125	28,660	3,145,803	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	557	505	5,011	550,080	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	472	432	2,687	294,945	公益事業
PULTE GROUP INC	219	248	1,434	157,421	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC	286	252	4,899	537,748	ソフトウェア・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	119	103	1,368	150,245	各種金融
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	51	48	749	82,280	保険
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	54	66	838	92,017	保険
RESMED INC	134	123	2,546	279,488	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	1,415	1,226	7,452	818,004	銀行
ROLLINS INC	145	218	744	81,752	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	101	93	4,196	460,640	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC	112	99	2,620	287,664	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	152	192	1,797	197,242	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC	124	124	1,162	127,604	素材
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	40	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	605	551	15,565	1,708,453	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	240	224	3,583	393,290	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	586	538	8,020	880,295	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER	1,322	1,226	3,843	421,821	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,101	1,240	9,162	1,005,691	各種金融
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	196	182	3,076	337,684	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	136	116	1,007	110,578	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC	241	210	8,385	920,416	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	146	128	1,479	162,410	ヘルスケア機器・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	79	219	6,214	682,062	素材
CENTENE CORP	557	513	3,775	414,442	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A. O.) CORP	121	121	863	94,746	資本財
ACUITY BRANDS INC	35	—	—	—	資本財
SNAP-ON INC	49	49	1,247	136,940	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	376	348	3,728	409,186	保険

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ADVANCE AUTO PARTS	61	61	1,173	128,821	小売
EDISON INTL	336	321	1,794	196,950	公益事業
SOUTHERN CO	1,000	913	5,841	641,172	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	1,280	1,157	7,149	784,714	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	233	206	3,847	422,320	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	114	135	831	91,291	運輸
AT&T INC	6,966	6,149	18,099	1,986,585	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,803	1,660	17,238	1,892,118	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	147	137	2,974	326,433	資本財
STATE STREET CORP	347	298	2,600	285,395	各種金融
STRYKER CORP	321	290	7,426	815,168	ヘルスケア機器・サービス
SYSCO CORP	454	435	3,529	387,343	食品・生活必需品小売り
TELEFLEX INC	44	39	1,582	173,663	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,084	804	836	91,778	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TEXTRON	215	188	1,293	141,985	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	382	339	15,936	1,749,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	104	—	—	—	小売
GLOBE LIFE INC	98	81	854	93,793	保険
DAVITA INC	90	57	694	76,226	ヘルスケア機器・サービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	37	37	1,496	164,303	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	282	250	1,993	218,793	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	180	180	829	91,076	公益事業
MARATHON OIL CORP	745	—	—	—	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	674	577	12,967	1,423,273	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,470	1,319	11,708	1,285,122	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	903	819	33,740	3,703,342	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	72	72	1,156	126,992	ヘルスケア機器・サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	82	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	324	286	2,283	250,584	耐久消費財・アパレル
VULCAN MATERIALS CO	126	113	2,080	228,315	素材
WALMART INC	1,356	1,341	19,060	2,092,041	食品・生活必需品小売り
WASTE MANAGEMENT INC	412	362	5,101	559,938	商業・専門サービス
WATERS CORP	63	52	1,684	184,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	70	63	2,195	240,947	ヘルスケア機器・サービス
JM SMUCKER CO	108	91	1,218	133,790	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	35	35	1,168	128,229	消費者サービス
WABTEC CORP	177	150	1,243	136,474	資本財
WEYERHAEUSER CO	696	636	2,416	265,259	不動産
WHIRLPOOL CORP	60	52	1,237	135,840	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS	1,142	1,049	2,765	303,516	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	301	268	2,518	276,459	公益事業
CARMAX INC	157	138	1,600	175,627	小売
TJX COMPANIES INC	1,155	1,031	6,964	764,455	小売
CBRE GROUP INC-A	302	301	2,643	290,111	不動産
REGIONS FINL CORP	924	818	1,915	210,245	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	37	32	1,387	152,319	消費者サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	34	—	—	—	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	331	293	1,696	186,165	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	319	319	1,153	126,582	素材
CELANESE CORP-SERIES A	110	98	1,628	178,728	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	182	182	1,061	116,521	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)	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	190	190	1,014	111,297	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	118	101	2,646	290,476	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	531	485	5,480	601,545	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	159	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT	126	139	1,253	137,556	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	23	3,291	361,261	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	46	44	2,871	315,133	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	856	765	27,591	3,028,491	ソフトウェア・サービス
HANESBRANDS INC	311	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WESTERN UNION CO	387	387	948	104,094	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	104	86	921	101,162	資本財
LEIDOS HOLDINGS	128	112	1,152	126,537	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	113	—	—	—	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	84	—	—	—	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	109	97	1,553	170,529	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	150	146	696	76,454	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	—	—	—	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	290	261	3,062	336,189	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	319	293	3,987	437,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	192	—	—	—	エネルギー
WABCO HOLDINGS INC	49	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	78	78	1,242	136,335	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	309	357	1,020	111,996	各種金融
MSCI INC	79	72	3,386	371,748	各種金融
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,484	1,354	13,061	1,433,602	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,633	1,464	33,281	3,652,926	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	169	154	2,397	263,119	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	620	571	3,534	387,922	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	128	128	1,321	145,045	資本財
KINDER MORGAN INC	1,946	1,794	3,290	361,186	エネルギー
XYLEM INC	175	152	1,796	197,182	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	255	226	2,553	280,264	素材
PVH CORP	72	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	35	761	83,581	資本財
EPAM SYSTEMS INC	52	47	2,270	249,158	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	259	232	5,002	549,093	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	80	71	1,963	215,496	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	158	148	2,838	311,551	銀行
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	134	113	965	105,934	商業・専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	200	—	—	—	エネルギー
LEAR CORP	52	52	1,022	112,207	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	245	209	4,254	466,968	小売
GENERAC HOLDINGS INC	—	58	1,906	209,265	資本財
GENERAL MOTORS CO	1,209	1,140	6,763	742,411	自動車・自動車部品
XPO LOGISTICS INC	80	80	1,175	129,032	運輸
ALLY FINANCIAL INC	360	314	1,720	188,826	各種金融
CAPRI HOLDINGS LTD	115	—	—	—	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	244	235	3,540	388,647	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	424	381	3,209	352,316	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	79	79	774	84,997	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	58	—	—	—	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)	
IQVIA HOLDINGS INC	157	167	4,016	440,896	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SERVICENOW INC	179	169	8,027	881,049	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	93	83	3,018	331,362	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,681	1,522	17,236	1,891,842	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZOETIS INC	454	408	7,212	791,636	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	178	—	—	—	消費者サービス
COTY INC-CL A	305	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
IHS MARKIT LTD	356	326	3,433	376,840	商業・専門サービス
HOWMET AEROSPACE INC	365	365	1,296	142,336	資本財
TWILIO INC - A	112	136	4,600	504,952	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	673	817	5,077	557,340	メディア・娯楽
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	162	—	—	—	耐久消費財・アパレル
BLACK KNIGHT INC	144	144	1,057	116,100	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	576	579	1,414	155,278	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	129	129	1,066	117,015	食品・飲料・タバコ
ALTICE USA INC- A	124	225	811	89,073	メディア・娯楽
TECHNIPFMC PLC	550	—	—	—	エネルギー
RINGCENTRAL INC-CLASS A	70	63	1,677	184,174	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	107	107	510	56,055	運輸
BURLINGTON STORES INC	60	58	1,878	206,143	小売
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	360	360	1,297	142,410	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	123	117	3,430	376,534	ヘルスケア機器・サービス
TWITTER INC	704	701	4,068	446,516	メディア・娯楽
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	138	821	90,200	資本財
EVERGY INC	213	213	1,322	145,129	公益事業
ALLEGION PLC	89	76	1,067	117,200	資本財
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	122	1,100	120,736	ソフトウェア・サービス
STERIS PLC	81	71	1,367	150,056	ヘルスケア機器・サービス
KKR & CO INC	474	436	2,430	266,769	各種金融
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	256	237	2,979	327,076	消費者サービス
ARAMARK	240	209	782	85,905	消費者サービス
DELL TECHNOLOGIES -C	155	215	2,123	233,099	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DOW INC	708	636	4,355	478,065	素材
AMCOR PLC	1,534	1,329	1,569	172,224	素材
PINTEREST INC- CLASS A	321	457	2,988	328,027	メディア・娯楽
XEROX HOLDINGS CORP	167	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLARIVATE PLC	—	273	821	90,201	商業・専門サービス
CHEWY INC - CLASS A	—	68	506	55,577	小売
AVANTOR INC	—	479	1,542	169,328	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DYNATRACE INC	—	178	925	101,596	ソフトウェア・サービス
CLOUDFLARE INC - CLASS A	—	177	1,457	159,980	ソフトウェア・サービス
CARRIER GLOBAL CORP	755	706	3,242	355,929	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	377	350	2,744	301,256	資本財
UBER TECHNOLOGIES INC	384	1,031	5,241	575,255	運輸
CORTEVA INC	701	649	2,952	324,115	素材
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	—	410	1,807	198,356	ソフトウェア・サービス
THE BLACKSTONE GROUP INC	629	587	5,444	597,552	各種金融
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	151	868	95,367	各種金融
VOYA FINANCIAL INC	125	100	658	72,274	各種金融
GRUBHUB INC	82	—	—	—	小売
INGERSOLL-RAND INC	315	315	1,566	171,965	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)	
PAYCOM SOFTWARE INC	47	42	1,395	153,209	ソフトウェア・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	43	408	44,882	ソフトウェア・サービス
AON PLC	223	193	4,904	538,371	保険
ZENDESK INC	—	105	1,434	157,497	ソフトウェア・サービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	—	19	466	51,207	ソフトウェア・サービス
OAK STREET HEALTH INC	—	76	459	50,462	ヘルスケア機器・サービス
ARISTA NETWORKS INC	49	51	1,757	192,919	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	432	993	109,047	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	249	249	1,172	128,739	保険
CATALENT INC	—	152	1,596	175,261	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	530	495	2,347	257,631	各種金融
CITIZENS FINANCIAL GROUP	400	360	1,798	197,397	銀行
WAYFAIR INC- CLASS A	—	60	1,839	201,874	小売
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	176	160	2,278	250,104	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	—	40	2,017	221,442	ソフトウェア・サービス
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	176	—	—	—	素材
GODADDY INC - CLASS A	163	159	1,288	141,414	ソフトウェア・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	348	—	—	—	商業・専門サービス
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	750	633	4,216	462,854	資本財
TRANSUNION	169	170	1,828	200,722	商業・専門サービス
SQUARE INC - A	331	332	7,408	813,116	ソフトウェア・サービス
DUPONT DE NEMOURS INC	707	461	3,902	428,382	素材
CARVANA CO	—	57	1,511	165,848	小売
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	226	192	1,163	127,678	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	—	113	1,712	188,002	ヘルスケア機器・サービス
WESTROCK CO	247	247	1,442	158,327	素材
FORTIVE CORP	285	257	1,865	204,741	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	246	224	2,726	299,295	商業・専門サービス
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	1,237	1,091	1,742	191,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEA LTD-ADR	—	6	161	17,733	メディア・娯楽
EQUITABLE HOLDINGS INC	402	328	1,041	114,356	各種金融
DXC TECHNOLOGY CO	234	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CABLE ONE INC	—	4	807	88,677	メディア・娯楽
LINDE PLC	512	450	13,554	1,487,692	素材
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	133	102	639	70,165	保険
AVALARA INC	—	76	1,017	111,674	ソフトウェア・サービス
VISTRA CORP	350	377	611	67,082	公益事業
CHENIERE ENERGY INC	219	190	1,615	177,370	エネルギー
AMAZON.COM	403	369	119,208	13,084,321	小売
ABIOMED INC	44	37	1,075	118,101	ヘルスケア機器・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	1,009	1,044	8,360	917,641	半導体・半導体製造装置
ADOBE INC	461	412	20,833	2,286,696	ソフトウェア・サービス
HONEYWELL INTL INC	—	599	13,836	1,518,678	資本財
AMGEN	566	497	11,837	1,299,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN ELECTRIC POWER	—	441	3,795	416,540	公益事業
AMERCO	6	10	575	63,116	運輸
ANALOG DEVICES	351	319	5,256	577,007	半導体・半導体製造装置
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	207	189	3,343	366,944	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMCAST CORP-CL A	4,329	3,943	22,611	2,481,795	メディア・娯楽
ANSYS INC	80	74	2,525	277,227	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	4,242	14,508	180,788	19,843,296	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当 期 末		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
APPLIED MATERIALS	881	794	10,969	1,203,977	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	209	189	5,421	595,014	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	412	367	7,206	790,983	ソフトウェア・サービス
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	131	112	1,095	120,247	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	107	97	1,806	198,334	メディア・娯楽
VERISIGN INC	100	87	1,926	211,452	ソフトウェア・サービス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,484	995	622	68,289	メディア・娯楽
CSX CORP	717	658	6,590	723,329	運輸
SEAGATE TECHNOLOGY	228	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHECK POINT SOFTWARE TECH	119	104	1,226	134,637	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	124	104	1,200	131,782	ソフトウェア・サービス
CERNER CORP	300	273	2,142	235,176	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	148	127	1,556	170,873	保険
CINTAS CORP	82	80	2,843	312,104	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	4,045	3,640	19,260	2,114,011	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COPART INC	197	180	2,330	255,831	商業・専門サービス
COGNEX CORP	162	162	1,288	141,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MARRIOTT INTL A	265	243	3,497	383,913	消費者サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	522	460	3,292	361,358	ソフトウェア・サービス
COSTAR GROUP INC	35	34	2,906	318,980	商業・専門サービス
DOLLAR TREE INC	226	201	1,964	215,647	小売
EBAY	739	593	3,612	396,514	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	211	—	—	—	各種金融
CADENCE DESIGN SYSTEMS	263	247	3,141	344,836	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	241	201	876	96,165	メディア・娯楽
ELECTRONIC ARTS INC	278	249	3,565	391,321	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	435	47,816	保険
EXPEDITORS INTL WASH INC	158	142	1,793	196,892	運輸
FASTENAL CO	558	487	2,588	284,074	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	679	613	2,585	283,812	銀行
FISERV INC	551	516	5,955	653,624	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	116	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	489	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DENTSPLY SIRONA INC	201	201	1,350	148,283	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	1,206	1,079	7,138	783,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NVIDIA CORP	554	534	34,719	3,810,833	半導体・半導体製造装置
HASBRO INC	124	124	1,196	131,333	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	140	117	893	98,042	ヘルスケア機器・サービス
F5 NETWORKS INC	53	53	992	108,887	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	244	216	1,367	150,105	ヘルスケア機器・サービス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	171	171	1,327	145,686	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	83	70	1,209	132,776	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	990	854	1,355	148,806	銀行
BIOGEN INC	172	134	3,607	395,988	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	248	235	10,348	1,135,848	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	81	74	4,151	455,638	ヘルスケア機器・サービス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	128	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTEL CORP	4,148	3,504	20,015	2,196,942	半導体・半導体製造装置
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	73	62	969	106,440	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	175	175	1,466	160,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA CORP	150	136	4,325	474,737	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)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
EAST WEST BANCORP INC	138	—	—	—	銀行
LAM RESEARCH CORP	138	124	8,122	891,522	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	154	136	1,561	171,400	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	—	418	1,285	141,133	資本財
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	258	226	2,309	253,502	半導体・半導体製造装置
ACTIVISION BLIZZARD INC	733	669	6,511	714,677	メディア・娯楽
ON SEMICONDUCTOR CORP	359	359	1,441	158,194	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	6,920	6,191	154,596	16,968,551	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	1,056	966	8,134	892,795	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	43	—	—	—	資本財
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	228	224	3,516	385,949	半導体・半導体製造装置
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	605	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MYLAN NV	494	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ILLUMINA INC	140	125	5,070	556,582	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	500	464	3,290	361,161	公益事業
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	84	84	815	89,494	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	205	205	1,592	174,819	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	375	314	902	99,071	耐久消費財・アパレル
NOBLE ENERGY INC	672	—	—	—	エネルギー
NORDSON CORP	—	48	1,081	118,743	資本財
NORTHERN TRUST CORP	195	176	2,135	234,444	各種金融
OLD DOMINION FREIGHT LINE	91	80	2,124	233,173	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	72	60	3,246	356,343	小売
PACCAR INC	323	301	2,760	303,046	資本財
EXELON CORP	928	867	3,912	429,484	公益事業
PAYCHEX INC	302	277	2,801	307,534	ソフトウェア・サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	71	66	3,926	430,947	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	1,329	1,189	17,597	1,931,546	食品・飲料・タバコ
GARMIN LTD	127	128	1,828	200,680	耐久消費財・アパレル
IPG PHOTONICS CORP	32	32	671	73,659	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTCO WHOLESALE CORP	421	384	14,525	1,594,367	食品・生活必需品小売り
PRICE T ROWE GROUP INC	218	200	3,843	421,878	各種金融
QUALCOMM	1,089	984	13,242	1,453,541	半導体・半導体製造装置
EXACT SCIENCES CORP	132	147	1,630	179,016	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGENERON PHARMACEUTICALS	77	91	4,610	506,026	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEAGEN INC	114	114	1,782	195,594	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	387	340	1,357	148,998	保険
ROSS STORES INC	343	316	3,999	438,969	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,373	1,213	7,710	846,277	食品・飲料・タバコ
WILLIS TOWERS WATSON PLC	120	110	2,880	316,158	保険
BOOKING HOLDINGS INC	40	35	8,397	921,728	消費者サービス
POOL CORP	—	37	1,615	177,288	小売
SEI INVESTMENTS COMPANY	122	122	777	85,375	各種金融
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	266	230	1,508	165,592	保険
SVB FINANCIAL GROUP	49	43	2,560	281,055	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	78	—	—	—	メディア・娯楽
STARBUCKS CORP	1,133	1,020	11,621	1,275,620	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	182	182	1,140	125,212	素材
NETFLIX INC	417	385	19,360	2,124,975	メディア・娯楽
NORTONLIFELOCK INC	596	503	1,393	152,939	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	143	134	3,431	376,647	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)	
INTUITIVE SURGICAL INC	110	101	8,589	942,771	ヘルスケア機器・サービス
TERADYNE INC	160	143	1,905	209,155	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS	891	799	15,172	1,665,292	半導体・半導体製造装置
TRACTOR SUPPLY COMPANY	112	99	1,804	198,077	小売
TRIMBLE IMS HOLDINGS	238	211	1,647	180,805	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VIACOMCBS INC-CLASS B	539	485	2,061	226,217	メディア・娯楽
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	245	224	4,685	514,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	724	633	3,333	365,929	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	284	257	1,940	212,954	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SKYWORKS SOLUTIONS INC	161	143	2,441	267,927	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	93	93	1,226	134,637	消費者サービス
NASDAQ INC	109	96	1,617	177,499	各種金融
CME GROUP INC	341	310	6,802	746,649	各種金融
LKQ CORP	293	267	1,360	149,370	小売
ALLIANT ENERGY CORPORATION	241	207	1,187	130,335	公益事業
TD AMERITRADE HOLDING CORP	258	—	—	—	各種金融
XILINX INC	235	209	2,664	292,479	半導体・半導体製造装置
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	51	46	2,292	251,613	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZIONS BANCORPORATION	151	—	—	—	銀行
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	106	106	1,514	166,212	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	52	—	—	—	銀行
LIBERTY GLOBAL PLC-A	155	155	423	46,509	電気通信サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	—	39	1,356	148,873	半導体・半導体製造装置
MARKETAXESS HOLDINGS INC	35	32	1,496	164,222	各種金融
DEXCOM INC	85	84	3,104	340,774	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY INC - A	128	128	411	45,126	メディア・娯楽
EXPEDIA GROUP INC	133	116	2,059	226,033	消費者サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	421	336	916	100,624	電気通信サービス
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	60	—	—	—	運輸
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	176	176	303	33,324	消費者サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	367	—	—	—	銀行
INSULET CORP	59	59	1,597	175,314	ヘルスケア機器・サービス
MASIMO CORP	—	48	1,042	114,416	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	105	107	3,482	382,225	耐久消費財・アパレル
MERCADOLIBRE INC	42	38	5,267	578,167	小売
ULTA BEAUTY INC	53	45	1,561	171,338	小売
DISCOVERY INC-C	311	281	847	92,978	メディア・娯楽
SPLUNK INC	147	147	1,787	196,244	ソフトウェア・サービス
VERISK ANALYTICS INC	145	133	2,314	254,005	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	885	97,190	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NXP SEMICONDUCTORS NV	270	241	5,112	561,108	半導体・半導体製造装置
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	217	193	1,428	156,767	ソフトウェア・サービス
FORTINET INC	138	122	2,686	294,919	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	129	661	41,382	4,542,163	自動車・自動車部品
ENPHASE ENERGY INC	—	110	1,573	172,712	半導体・半導体製造装置
TRIPADVISOR INC	103	—	—	—	メディア・娯楽
FACEBOOK INC-A	2,297	2,077	68,306	7,497,355	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	204	—	—	—	エネルギー
SAREPTA THERAPEUTICS INC	71	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WORKDAY INC-CLASS A	156	155	3,546	389,242	ソフトウェア・サービス
T-MOBILE US INC	410	533	7,551	828,878	電気通信サービス

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価 額		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PTC INC	99	99	1,339	146,996	ソフトウェア・サービス
NEWS CORP-CLASS A	334	334	903	99,178	メディア・娯楽
HD SUPPLY HOLDINGS INC	152	—	—	—	資本財
CDW CORP/DE	137	119	1,982	217,551	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	99	—	—	—	運輸
KEURIG DR PEPPER INC	—	595	2,202	241,764	食品・飲料・タバコ
COUPA SOFTWARE INC	—	60	1,443	158,411	ソフトウェア・サービス
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	—	35	2,104	230,975	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	186	186	834	91,610	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	63	278	30,592	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	152	172	751	82,446	メディア・娯楽
OKTA INC	100	102	2,275	249,765	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	378	352	16,641	1,826,582	半導体・半導体製造装置
MONGODB INC	46	46	1,349	148,136	ソフトウェア・サービス
DOCUSIGN INC	101	155	3,133	343,897	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	50	50	1,301	142,896	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	242	288	788	86,590	ソフトウェア・サービス
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	—	43	614	67,396	各種金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	175	5,816	638,440	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	—	270	5,011	550,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PELTON INTERACTIVE INC-A	—	217	2,397	263,171	耐久消費財・アパレル
NOVAVAX INC	—	57	849	93,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FOX CORP - CLASS A	339	276	1,033	113,384	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	150	150	547	60,097	メディア・娯楽
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	—	156	3,486	382,669	ソフトウェア・サービス
LYFT INC-A	—	212	1,215	133,394	運輸
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	—	90	759	83,322	各種金融
CARLYLE GROUP INC/THE	—	125	549	60,329	各種金融
10X GENOMICS INC-CLASS A	—	56	1,017	111,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DATADOG INC - CLASS A	—	158	1,439	157,969	ソフトウェア・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	179	1,717	188,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PPD INC	—	110	508	55,820	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SABRE CORP	241	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	—	139	802	88,116	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT	20	—	—	—	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	—	67	1,071	117,640	メディア・娯楽
AIRBNB INC-CLASS A	—	46	654	71,889	消費者サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	—	155	623	68,405	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VIATRIS INC	—	1,035	1,577	173,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	175	1,886	207,097	消費者サービス
DRAFTKINGS INC - CL A	—	156	782	85,932	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	704	3,402	373,431	半導体・半導体製造装置
HORIZON THERAPEUTICS PLC	—	179	1,643	180,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	392	43,055	ソフトウェア・サービス
CDK GLOBAL INC	106	—	—	—	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	106	96	1,768	194,095	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-A	—	25	417	45,874	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	102	135	2,247	246,693	メディア・娯楽
BIO-TECHNE CORP	—	32	1,342	147,394	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZILLOW GROUP INC-A	—	54	650	71,370	メディア・娯楽
SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	—	46	1,186	130,268	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)		
ETSY INC	—	110	1,812	198,888	小売	
KRAFT HEINZ CO/THE	641	573	2,499	274,330	食品・飲料・タバコ	
NOVOCURE LTD	—	79	1,618	177,628	ヘルスケア機器・サービス	
MATCH GROUP INC	46	218	3,132	343,877	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL A	285	259	61,223	6,719,934	メディア・娯楽	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,064	959	24,961	2,739,791	ソフトウェア・サービス	
SUNRUN INC	—	139	622	68,311	資本財	
ZILLOW GROUP INC-C	123	134	1,575	172,900	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL C	294	254	61,410	6,740,402	メディア・娯楽	
BEIGENE LTD-ADR	38	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZSCALER INC	—	62	1,210	132,880	ソフトウェア・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	376	342	3,229	354,470	食品・飲料・タバコ	
ROKU INC	83	97	3,377	370,692	メディア・娯楽	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	143	116	8,097	888,784	メディア・娯楽	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	339	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	987	987	483	53,083	不動産	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	201	201	1,303	143,092	資本財	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	205	—	—	—	資本財	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	106	88	987	108,419	各種金融	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	286,867 608	273,341 601	3,207,182 —	352,020,332 <68.0%>	
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES	234	202	1,765	160,287	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	841	741	3,276	297,500	食品・生活必需品小売り	
BARRICK GOLD CORP	1,709	1,535	4,470	406,009	素材	
ATCO LTD -CLASS I	52	52	228	20,712	公益事業	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	—	197	412	37,488	資本財	
BANK MONTREAL	615	558	7,089	643,755	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	1,169	1,047	8,519	773,617	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	332	272	2,572	233,636	銀行	
BCE INC	153	62	372	33,831	電気通信サービス	
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	1,265	1,108	6,739	611,995	各種金融	
BAUSCH HEALTH COS INC	278	278	1,079	98,052	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAPUTO INC	244	244	1,026	93,223	食品・飲料・タバコ	
BLACKBERRY LIMITED	394	394	478	43,435	ソフトウェア・サービス	
CGI INC - CL A	233	184	1,989	180,698	ソフトウェア・サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	131	895	81,337	素材	
CAE INC	259	259	973	88,371	資本財	
CAMECO CORP	410	268	648	58,851	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	350	305	1,907	173,222	電気通信サービス	
CANADIAN IMPERIAL BANK	429	387	5,526	501,818	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	1,223	1,027	4,301	390,627	エネルギー	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	54	54	1,118	101,558	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	360	32,719	公益事業	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	698	608	8,278	751,754	運輸	
YAMANA GOLD INC	—	816	516	46,947	素材	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	176	170	746	67,776	耐久消費財・アパレル	
OPEN TEXT CORP	246	246	1,398	126,996	ソフトウェア・サービス	
EMPIRE CO LTD 'A'	152	152	630	57,261	食品・生活必需品小売り	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	—	102	739	67,133	商業・専門サービス	
FORTIS INC	426	426	2,349	213,397	公益事業	

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価 額		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	569	550	1,652	150,086	素材
TELUS CORP	329	329	897	81,463	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC	237	237	883	80,229	保険
IMPERIAL OIL	247	247	987	89,634	エネルギー
ENBRIDGE	1,939	1,731	8,046	730,746	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	341	31,034	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,901	1,630	4,115	373,731	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	179	129	959	87,173	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	279	232	2,828	256,837	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	569	507	3,299	299,598	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	26	21	1,210	109,904	保険
METRO INC	249	188	1,102	100,085	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC	314	—	—	—	エネルギー
EMERA INC	237	237	1,339	121,619	公益事業
METHANEX CORP	70	—	—	—	素材
ONEX CORP	66	66	584	53,072	各種金融
TC ENERGY CORP	885	823	5,082	461,569	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	—	184	748	67,979	素材
POWER CORP OF CANADA	515	515	2,031	184,445	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	499	45,315	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA	1,372	1,228	15,426	1,400,893	銀行
CP RAILWAY LIMITED	131	575	5,648	512,958	運輸
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	450	354	1,279	116,186	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY	1,473	1,321	3,687	334,893	エネルギー
LUNDIN MINING CORP	622	622	807	73,310	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B	456	405	1,208	109,763	素材
THOMSON REUTERS CORP	187	150	1,776	161,309	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	—	77	845	76,798	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,734	1,563	13,610	1,236,010	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	43	78	725	65,845	素材
WESTON (GEORGE) LTD	68	68	813	73,911	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP	1,253	1,084	1,061	96,416	素材
INTACT FINANCIAL CORP	130	130	2,139	194,294	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	455	395	2,290	208,013	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	19	16	2,879	261,530	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	182	169	3,063	278,203	素材
B2GOLD CORP	—	902	557	50,644	素材
CI FINANCIAL CORP	186	—	—	—	各種金融
KEYERA CORP	186	186	557	50,623	エネルギー
PARKLAND CORP	110	140	557	50,601	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD	243	243	584	53,123	公益事業
PEMBINA PIPELINE CORP	538	456	1,783	161,937	エネルギー
DOLLARAMA INC	267	267	1,410	128,117	小売
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	518	518	956	86,818	公益事業
CENOVUS ENERGY INC	966	966	948	86,114	エネルギー
NORTHLAND POWER INC	—	178	721	65,533	公益事業
TMX GROUP LTD	—	46	629	57,154	各種金融
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	268	234	1,226	111,395	素材
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	518	460	41,809	素材
INTER PIPELINE LTD	354	354	626	56,923	エネルギー
NUTRIEN LTD	555	489	3,678	334,073	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)				
CRONOS GROUP INC	159	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	—	82	722	65,595	ソフトウェア・サービス			
WSP GLOBAL INC	94	106	1,460	132,590	資本財			
IA FINANCIAL CORP INC	82	100	701	63,746	保険			
FIRSTSERVICE CORP	—	36	723	65,674	不動産			
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	—	135	531	48,307	商業・専門サービス			
OVINTIV INC	234	—	—	—	エネルギー			
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	—	43	386	35,136	ソフトウェア・サービス			
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	112	582	52,926	公益事業			
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	183	—	—	—	エネルギー			
AIR CANADA	115	138	375	34,073	運輸			
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	254	230	1,943	176,525	消費者サービス			
AURORA CANNABIS INC	44	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
SHOPIFY INC - CLASS A	98	97	14,588	1,324,781	ソフトウェア・サービス			
CANOPY GROWTH CORP	164	209	660	59,944	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
HYDRO ONE LTD	322	322	992	90,162	公益事業			
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	35,565	35,167	202,656	18,403,218	—	<3.6%>
(ドイツ)					千ユーロ			
ADIDAS AG	172	162	4,862	650,249	耐久消費財・アパレル			
COMMERZBANK AG	804	943	624	83,554	銀行			
FRESENIUS SE&CO KGAA	404	336	1,504	201,196	ヘルスケア機器・サービス			
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	95	325	43,549	電気通信サービス			
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	57	242	32,473	素材			
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	57	57	831	111,178	保険			
GEA GROUP AG	133	133	477	63,910	資本財			
CONTINENTAL AG	99	99	1,207	161,536	自動車・自動車部品			
DEUTSCHE POST AG-REG	917	853	4,759	636,474	運輸			
MERCK KGAA	120	105	1,557	208,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
RWE STAMM	564	553	1,727	231,051	公益事業			
SAP SE	938	902	10,389	1,389,487	ソフトウェア・サービス			
E.ON SE	2,161	1,853	1,850	247,427	公益事業			
HENKEL AG & CO KGAA	101	87	715	95,641	家庭用品・パーソナル用品			
PUMA SE	77	92	865	115,687	耐久消費財・アパレル			
BAYER	941	838	4,379	585,698	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	172	144	1,365	182,602	家庭用品・パーソナル用品			
BASF SE	880	787	5,288	707,243	素材			
BEIERSDORF AG	91	91	894	119,588	家庭用品・パーソナル用品			
HOCHTIEF AG	22	—	—	—	資本財			
HEIDELBERGCEMENT AG	148	130	978	130,877	素材			
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	199	174	1,149	153,708	ヘルスケア機器・サービス			
ALLIANZ SE-REG	398	355	7,737	1,034,875	保険			
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	232	232	248	33,259	運輸			
MUENCHENER RUECKVERSICH.	138	123	2,921	390,784	保険			
VOLKSWAGEN STAMM	32	24	745	99,743	自動車・自動車部品			
VOLKSWAGEN AG-PFD	179	163	3,687	493,119	自動車・自動車部品			
DAIMLER AG	874	733	5,622	751,999	自動車・自動車部品			
NEMETSCHEK SE	—	54	333	44,619	ソフトウェア・サービス			
THYSSEN KRUPP	330	—	—	—	素材			
SIEMENS	731	660	8,915	1,192,364	資本財			
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,905	1,772	2,188	292,735	各種金融			

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	319	286	2,501	334,554	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	373	49,995	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM	3,193	2,850	4,869	651,249	電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	32	22	904	120,908	ヘルスケア機器・サービス
INFINEON TECHNOLOGIES	1,222	1,123	3,732	499,127	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	—	4	359	48,111	資本財
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	520	69,657	ヘルスケア機器・サービス
BECHTLE AG	—	25	405	54,271	ソフトウェア・サービス
DEUTSCHE BOERSE	182	165	2,214	296,209	各種金融
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	140	140	1,281	171,400	自動車・自動車部品
FRAPORT AG	35	—	—	—	運輸
WIRECARD AG	113	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS	72	72	447	59,848	素材
MTU AERO ENGINES AG	47	47	1,014	135,651	資本財
DEUTSCHE WOHNEN SE	337	280	1,467	196,266	不動産
SYMRISE AG	124	114	1,251	167,384	素材
BRENTAG SE	152	125	964	129,002	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	197	197	582	77,856	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	669	987	222	29,823	電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN SE	—	69	843	112,867	不動産
KION GROUP AG	58	58	513	68,686	資本財
VONOVIA SE	495	450	2,321	310,493	不動産
KNORR-BREMSE AG	41	68	695	93,062	資本財
SIEMENS HEALTHINEERS AG	148	245	1,136	151,992	ヘルスケア機器・サービス
METRO AG	137	—	—	—	食品・生活必需品小売り
TEAMVIEWER AG	—	141	455	60,982	ソフトウェア・サービス
SIEMENS ENERGY AG	—	361	945	126,390	資本財
ZALANDO SE	139	139	1,227	164,104	小売
SCOUT24 AG	—	74	500	66,912	メディア・娯楽
COVESTRO AG	150	172	988	132,222	素材
HELLOFRESH SE	—	138	1,024	137,067	小売
UNIPER SE	201	73	221	29,557	公益事業
DELIVERY HERO SE	114	134	1,492	199,581	小売
国 小 計	22,405	21,283	113,879	15,230,237	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	57	60	—	< 2.9% >	
(イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,093	975	1,643	219,803	保険
INTESA SANPAOLO	14,606	14,414	3,472	464,407	銀行
UNICREDIT SPA	1,853	1,890	1,983	265,297	銀行
MEDIOBANCA	539	539	527	70,588	銀行
LEONARDO SPA	354	—	—	—	資本財
ENEL	7,846	6,929	5,642	754,631	公益事業
ENI	2,484	2,185	2,205	295,007	エネルギー
SNAM SPA	2,036	1,894	915	122,408	公益事業
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	374	50,134	電気通信サービス
TELECOM ITALIA RNC	4,701	4,701	220	29,495	電気通信サービス
ATLANTIA SPA	514	465	729	97,528	運輸
TERNA SPA	1,302	1,302	816	109,204	公益事業
RECORDATI SPA	114	98	451	60,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPLIFON SPA	—	116	449	60,125	ヘルスケア機器・サービス
PRYSMIAN SPA	211	211	599	80,153	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)			
DIASORIN SPA	—	20	298	39,934	ヘルスケア機器・サービス		
MONCLER SPA	157	182	1,057	141,420	耐久消費財・アパレル		
NEXI SPA	—	413	689	92,155	ソフトウェア・サービス		
FINECOBANK SPA	531	531	726	97,115	銀行		
POSTE ITALIANE SPA	460	460	529	70,833	保険		
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	—	303	279	37,333	電気通信サービス		
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	644	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
PIRELLI & C SPA	390	—	—	—	自動車・自動車部品		
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	48,369	46,163	23,612	3,157,956	<0.6%>
(フランス)			19	20	—	—	
BOUYGUES ORD	193	214	716	95,768	資本財		
AIR LIQUIDE	453	404	5,651	755,773	素材		
VEOLIA ENVIRONNEMENT	526	434	1,123	150,309	公益事業		
LOREAL	240	216	8,036	1,074,868	家庭用品・パーソナル用品		
LVMH	265	240	15,767	2,108,731	耐久消費財・アパレル		
DASSAULT AVIATION SA	2	2	219	29,369	資本財		
THALES SA	96	96	813	108,862	資本財		
CAPGEMINI SA	154	139	2,136	285,734	ソフトウェア・サービス		
CASINO GUICHARD PERRACHON	58	—	—	—	食品・生活必需品小売り		
INGENICO GROUP	62	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
PUBLICIS GROUPE	214	170	947	126,755	メディア・娯楽		
FAURECIA	59	109	493	66,049	自動車・自動車部品		
BOLLORE	618	836	355	47,543	メディア・娯楽		
MICHELIN	164	138	1,738	232,463	自動車・自動車部品		
PERNOD-RICARD	199	182	3,302	441,634	食品・飲料・タバコ		
RENAULT SA	173	173	592	79,238	自動車・自動車部品		
REMY COINTREAU	23	23	407	54,507	食品・飲料・タバコ		
SEB SA	20	22	351	46,999	耐久消費財・アパレル		
VINCI S.A.	494	459	4,290	573,776	資本財		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	530	465	6,074	812,418	資本財		
VIVENDI	773	612	1,831	244,900	メディア・娯楽		
TOTAL SE	2,295	2,170	8,280	1,107,385	エネルギー		
VALEO SA	193	215	581	77,802	自動車・自動車部品		
ORANGE	1,881	1,715	1,797	240,330	電気通信サービス		
HERMES INTERNATIONAL	30	27	3,124	417,839	耐久消費財・アパレル		
DASSAULT SYSTEMES SA	125	114	2,156	288,406	ソフトウェア・サービス		
KERING	72	64	4,846	648,235	耐久消費財・アパレル		
CNP ASSURANCES	118	162	245	32,858	保険		
CARREFOUR	592	525	877	117,354	食品・生活必需品小売り		
ATOS SE	97	97	535	71,639	ソフトウェア・サービス		
SANOFI	1,079	975	8,579	1,147,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
ACCOR	179	144	472	63,171	消費者サービス		
SOCIETE GENERALE	790	678	1,780	238,185	銀行		
TELEPERFORMANCE	57	47	1,488	199,117	商業・専門サービス		
EURAZEO SA	33	33	243	32,594	各種金融		
SODEXO	81	81	644	86,211	消費者サービス		
AXA SA	1,859	1,668	3,805	508,995	保険		
PEUGEOT SA	528	—	—	—	自動車・自動車部品		
JC DECAUX SA	95	—	—	—	メディア・娯楽		
ESSILORLUXOTTICA	272	251	3,589	480,091	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)		
CREDIT AGRICOLE SA	1,074	1,074	1,322	176,805	銀行	
BNP PARIBAS	1,101	970	5,483	733,382	銀行	
ORPEA	—	43	447	59,816	ヘルスケア機器・サービス	
SAINT-GOBAIN	453	439	2,424	324,275	資本財	
WENDEL	20	20	232	31,059	各種金融	
ILIAD SA	12	12	168	22,589	電気通信サービス	
DANONE (GROUPE)	592	546	3,194	427,223	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	315	284	3,526	471,600	資本財	
ENGIE	1,710	1,582	1,940	259,559	公益事業	
ALSTOM	187	243	1,130	151,177	資本財	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	119	—	—	—	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE	613	395	458	61,338	公益事業	
IPSEN	27	35	302	40,463	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	75	59	646	86,523	素材	
LEGRAND SA	245	217	1,872	250,484	資本財	
EIFFAGE	72	79	721	96,477	資本財	
ADP	23	23	265	35,552	運輸	
NATIXIS	699	897	364	48,709	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	93	70	423	56,645	メディア・娯楽	
SCOR SE	133	133	356	47,667	保険	
BUREAU VERITAS SA	250	250	631	84,401	商業・専門サービス	
GETLINK	441	441	571	76,379	運輸	
SUEZ	280	325	650	86,996	公益事業	
EDENRED	227	227	1,028	137,591	ソフトウェア・サービス	
BIOMERIEUX	41	41	395	52,910	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	—	81	375	50,206	消費者サービス	
WORLDBLINE SA	127	203	1,604	214,626	ソフトウェア・サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	30	24	860	115,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	62	62	454	60,742	各種金融	
国 小 計	24,744	22,705	129,756	17,353,631		
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	67	64	—	< 3.4% >		
(オランダ)						
AIRBUS SE	561	501	5,416	724,377	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	—	42	1,080	144,548	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	123	112	716	95,868	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	1,032	874	2,083	278,604	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	195	153	1,600	214,048	素材	
WOLTERS KLUWER	257	229	1,807	241,668	商業・専門サービス	
QIAGEN N.V.	218	218	887	118,696	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KONINKLIJKE DSM NV	171	149	2,256	301,850	素材	
VOPAK	63	63	247	33,053	エネルギー	
AEGON	1,662	1,662	645	86,277	保険	
ASML HOLDING NV	407	361	19,951	2,668,358	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	3,543	2,829	774	103,602	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS	662	550	1,688	225,837	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	872	772	3,578	478,592	ヘルスケア機器・サービス	
ING GROEP NV-CVA	3,778	3,434	3,920	524,339	銀行	
HEINEKEN NV	243	224	2,199	294,097	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	107	107	888	118,785	食品・飲料・タバコ	
UNILEVER NV	1,405	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
FERRARI NV	112	101	1,760	235,439	自動車・自動車部品	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CNH INDUSTRIAL NV	930	930	1,311	175,360	資本財
PROSUS	458	430	3,651	488,388	小売
JDE PEET'S BV	—	70	226	30,285	食品・飲料・タバコ
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	—	490	517	69,147	食品・飲料・タバコ
NN GROUP NV	276	226	942	126,100	保険
ARGENX SE	—	41	963	128,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
STELLANTIS NV	1,113	1,701	2,740	366,557	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	113	113	843	112,743	小売
ABN AMRO BANK NV-CVA	531	399	437	58,537	銀行
EXOR NV	103	103	731	97,843	各種金融
ALTICE NV -A	500	—	—	—	電気通信サービス
ADYEN NV	10	16	3,169	423,830	ソフトウェア・サービス
国 小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	19,456	16,910	67,037	8,965,637	
	27	29	—	<1.7%>	
(スペイン)					
IBERDROLA SA	5,905	4,983	5,633	753,413	公益事業
ENDESA	317	259	614	82,148	公益事業
BANKINTER SA	588	—	—	—	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA	6,474	5,769	2,957	395,523	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	301	233	500	66,932	公益事業
REPSOL SA	1,330	1,273	1,396	186,710	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	15,998	14,703	5,073	678,539	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA	396	396	650	87,032	公益事業
TELEFONICA	4,381	4,346	1,752	234,406	電気通信サービス
INDITEX	1,019	950	3,034	405,809	小売
ENAGAS	252	252	487	65,199	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	251	224	608	81,342	資本財
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	220	196	498	66,633	資本財
GRIFOLS SA	276	276	632	84,604	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERROVIAL SA	460	410	983	131,579	資本財
MAPFRE SA	909	—	—	—	保険
BANCO DE SABADELL SA	4,496	—	—	—	銀行
CAIXABANK	3,286	3,801	1,080	144,446	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	—	214	418	55,981	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	418	390	2,423	324,162	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA	1,100	—	—	—	銀行
FERROVIAL SA-RTS	—	471	9	1,257	資本財
FERROVIAL SA-RTS	460	—	—	—	資本財
AENA SME SA	65	65	935	125,114	運輸
CELLNEX TELECOM SA	246	414	2,063	276,022	電気通信サービス
国 小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	49,159	39,636	31,754	4,246,861	
	23	20	—	<0.8%>	
(ベルギー)					
UMICORE	176	176	869	116,335	素材
KBC GROEP NV	240	210	1,414	189,144	銀行
SOFINA	—	12	417	55,797	各種金融
SOLVAY SA	69	69	767	102,612	素材
UCB (GROUPE)	124	118	915	122,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	54	54	270	36,241	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	82	106	989	132,311	各種金融
AGEAS	160	160	853	114,130	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)		
PROXIMUS	131	131	219	29,393	電気通信サービス	
GALAPAGOS NV	43	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ELIA GROUP SA/NV	—	29	261	34,933	公益事業	
TELENET GROUP HOLDING NV	49	—	—	—	メディア・娯楽	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	728	637	3,976	531,822	食品・飲料・タバコ	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,860 11	1,706 11	10,955 —	1,465,202 <0.3%>	
(オーストリア)						
OMV AG	149	125	597	79,920	エネルギー	
VERBUND AG	74	64	488	65,313	公益事業	
VOESTALPINE AG	124	71	263	35,276	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	275	239	812	108,699	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	124	124	244	32,689	銀行	
ANDRITZ AG	52	—	—	—	資本財	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	801 6	625 5	2,406 —	321,899 <0.1%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC	11	124	1,091	145,973	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TENARIS SA	406	406	380	50,861	エネルギー	
SES	313	—	—	—	メディア・娯楽	
ARCELORMITTAL	662	616	1,633	218,456	素材	
AROUNDTOWN SA	1,113	940	651	87,133	不動産	
INPOST SA	—	124	199	26,621	運輸	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,507 5	2,212 5	3,955 —	529,046 <0.1%>	
(フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS	—	255	729	97,580	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ	343	419	464	62,142	資本財	
UPM KYMMENE OYJ	506	456	1,428	191,079	素材	
STORA ENSO OYJ R	547	547	800	107,096	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	430	430	1,681	224,903	保険	
FORTUM OYJ	419	419	993	132,811	公益事業	
ELISA A	155	133	651	87,066	電気通信サービス	
NELES OYJ	95	—	—	—	資本財	
NOKIA OYJ	5,456	4,506	1,928	257,931	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OIL OYJ	401	372	2,014	269,393	エネルギー	
NOKIAN RENKAAT OYJ	102	—	—	—	自動車・自動車部品	
KONE OYJ-B	322	290	1,938	259,303	資本財	
ORION OYJ-CLASS B	98	98	357	47,746	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	8,880 12	7,930 11	12,988 —	1,737,054 <0.3%>	
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC	153	144	1,131	151,265	資本財	
CRH PLC	800	647	2,782	372,064	素材	
KERRY GROUP PLC-A	146	130	1,449	193,903	食品・飲料・タバコ	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	195	230	1,004	134,280	素材	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	840	—	—	—	銀行	
AIB GROUP PLC	702	—	—	—	銀行	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	72	145	2,229	298,235	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,909 7	1,298 5	8,596 —	1,149,749 <0.2%>	

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	2,359	2,257	1,078	144,258	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	491	491	505	67,667	エネルギー
JERONIMO MARTINS	249	249	395	52,834	食品・生活必需品小売り
国 小 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	3,100 3	2,998 3	1,979 -	264,760 <0.1%>
ユ ー ロ 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	184,195 237	163,471 233	406,924 -	54,422,038 <10.5%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
ANTOFAGASTA PLC	358	358	553	86,170	素材
ASHTAD GROUP PLC	420	370	1,906	296,653	資本財
SEVERN TRENT PLC	250	224	551	85,757	公益事業
BHP GROUP PLC	2,028	1,824	3,872	602,537	素材
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	964	964	729	113,539	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	332	248	568	88,459	資本財
AVIVA PIC	3,812	3,327	1,368	212,889	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC	134	131	916	142,571	素材
DIAGEO	2,245	2,008	6,835	1,063,567	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	117	117	419	65,276	各種金融
DCC PLC	91	91	546	85,039	資本財
BAE SYSTEMS PLC	3,087	2,601	1,369	213,126	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO	2,193	1,882	5,107	794,780	食品・飲料・タバコ
HALMA PLC	371	310	809	125,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD CHARTERED PLC	2,547	2,124	1,078	167,861	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	914	809	1,295	201,622	食品・飲料・タバコ
JOHNSON MATTHEY PLC	168	168	513	79,852	素材
ANGLO AMERICAN PLC	960	1,089	3,415	531,445	素材
COMPASS GROUP PLC	1,517	1,556	2,503	389,519	消費者サービス
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	19,413	17,544	7,988	1,242,959	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP	5,501	5,145	1,462	227,617	保険
UNILEVER PLC	1,062	2,270	9,598	1,493,475	家庭用品・パーソナル用品
MEGGITT PLC	662	-	-	-	資本財
MORRISON SUPERMARKETS	2,093	2,093	370	57,613	食品・生活必需品小売り
UNITED UTILITIES GROUP PLC	671	585	576	89,655	公益事業
RSA INSURANCE GROUP LTD	865	972	665	103,571	保険
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	367	334	777	120,948	食品・飲料・タバコ
PEARSON	663	663	542	84,414	メディア・娯楽
PERSIMMON PLC	315	256	811	126,297	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL	2,468	2,253	3,382	526,270	保険
RIO TINTO PLC REG	1,078	960	5,827	906,721	素材
VODAFONE GROUP PLC	25,147	23,595	3,027	471,057	電気通信サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	679	605	3,854	599,807	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	1,859	1,668	3,068	477,430	商業・専門サービス
RENTOKIL INITIAL PLC	1,810	1,404	665	103,566	商業・専門サービス
NATWEST GROUP PLC	4,790	3,691	764	118,899	銀行
ST JAMES'S PLACE PLC	447	505	706	109,888	各種金融
SSE PLC	1,003	922	1,423	221,445	公益事業
BP PLC	19,381	17,576	5,381	837,307	エネルギー
SAGE GROUP PLC	1,113	952	625	97,273	ソフトウェア・サービス
SMITHS GROUP PLC	371	371	575	89,559	資本財
LLOYDS BANKING GROUP PLC	66,371	61,902	3,088	480,543	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)	
TAYLOR WIMPEY PLC	2,705	3,559	610	94,927	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	9,196	6,660	1,486	231,353	食品・生活必需品小売り
3I GROUP PLC	881	881	1,095	170,435	各種金融
SMITH & NEPHEW PLC	830	685	1,056	164,423	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE	4,775	4,300	5,780	899,465	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	185	—	—	—	資本財
WPP PLC	1,130	1,130	1,101	171,354	メディア・娯楽
ASTRAZENECA	1,255	1,131	9,106	1,416,990	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BT GROUP PLC	8,172	7,694	1,345	209,351	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	267	—	—	—	消費者サービス
NATIONAL GRID PLC	3,340	3,067	2,881	448,297	公益事業
MARKS & SPENCER GROUP PLC	2,052	—	—	—	小売
BARCLAYS	16,694	15,162	2,776	431,985	銀行
INTERTEK GROUP PLC	154	138	753	117,314	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	404	297	636	98,963	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	132	114	935	145,573	小売
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,490	7,861	841	130,906	資本財
KINGFISHER PLC	1,709	1,985	715	111,333	小売
ITV PLC	2,954	—	—	—	メディア・娯楽
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	302	275	2,089	325,175	各種金融
SAINSBURY (J) PLC	1,483	1,483	393	61,302	食品・生活必需品小売り
G4S PLC	1,325	—	—	—	商業・専門サービス
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	477	74,335	保険
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	105	118	553	86,121	耐久消費財・アパレル
CENTRICA PLC	4,405	—	—	—	公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,998	3,542	4,766	741,731	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	3,573	3,200	4,108	639,327	エネルギー
INTERCONTINENTAL HOTELS	160	160	789	122,827	消費者サービス
WHITBREAD PLC	116	174	554	86,319	消費者サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	164	402	62,572	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TUI AG-DI	379	—	—	—	消費者サービス
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	2,333	2,109	580	90,278	各種金融
EXPERIAN PLC	874	791	2,139	332,944	商業・専門サービス
MONDI PLC	477	367	699	108,900	素材
HARGREAVES LANSDOWN PLC	330	330	548	85,287	各種金融
OCADO GROUP PLC	446	446	842	131,127	小売
GLENCORE PLC	10,330	8,756	2,814	437,992	素材
ENTAIN PLC	592	496	818	127,381	消費者サービス
EVRAZ PLC	430	430	274	42,660	素材
EASYJET PLC	116	—	—	—	運輸
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,137	1,137	338	52,604	保険
COCA-COLA HBC AG-CDI	179	179	461	71,792	食品・飲料・タバコ
AVEVA GROUP PLC	67	109	381	59,436	ソフトウェア・サービス
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	290	—	—	—	ソフトウェア・サービス
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	510	375	58,375	保険
FERGUSON PLC	222	194	1,860	289,559	資本財
M&G PLC	2,291	2,291	560	87,161	各種金融
INFORMA PLC	1,179	1,411	767	119,499	メディア・娯楽
WHITBREAD PLC-NIL	58	—	—	—	消費者サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	973	973	546	85,043	メディア・娯楽
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	72	55	700	108,963	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)	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	46	—	—	—	消費者サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	4,084	4,566	788	122,704	資本財
JD SPORTS FASHION PLC	320	413	390	60,836	小売
小 計	281,854	256,015	150,692	23,447,822	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	94	84	—	<4.5%>
(スイス)			千スイスフラン		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	2	573	69,908	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	1	0.82	696	84,871	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.1	0.1	901	109,840	食品・飲料・タバコ
ROCHE HOLDING AG-BR	—	27	952	116,085	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HOLCIM LTD	—	453	2,447	298,346	素材
BALOISE HOLDING AG - REG	48	43	653	79,712	保険
STRAUMANN HOLDING AG-REG	10	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	245	29,909	耐久消費財・アパレル
VIFOR PHARMA AG	—	44	589	71,888	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	8	5	485	59,130	素材
SWISS PRIME SITE-REG	74	74	689	84,101	不動産
PARGESA HOLDING SA-BR	33	—	—	—	各種金融
DUFREY AG-REG	38	—	—	—	小売
SCHINDLER HOLDING AG-REG	21	21	552	67,355	資本財
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	28	242	29,539	銀行
SIKA AG-BR	122	125	3,627	442,252	素材
SGS SA	5	5	1,424	173,647	商業・専門サービス
SWISSCOM	24	21	1,112	135,654	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	34	29	1,937	236,244	資本財
GIVAUDAN-REG	8	7	3,199	390,096	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	143	127	4,824	588,171	保険
NOVARTIS	2,053	1,919	15,282	1,863,077	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	1,768	1,490	4,572	557,446	資本財
ROCHE HOLDING GENUSS	671	608	19,205	2,341,345	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	132	145	909	110,859	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	475	—	—	—	素材
CLARIANT AG-REG	173	173	338	41,295	素材
NESTLE SA - REGISTERED	2,839	2,487	27,646	3,370,336	食品・飲料・タバコ
TEMENOS AG - REG	65	65	907	110,649	ソフトウェア・サービス
SONOVA HOLDING AG-REG	51	46	1,491	181,828	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	50	45	1,390	169,570	運輸
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	8	1,204	146,796	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,416	2,133	2,102	256,289	各種金融
SWATCH GROUP AG(BEARER)	24	24	809	98,681	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	69	65	3,806	464,058	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	32	28	1,337	163,067	保険
VIFOR PHARMA AG	44	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	19	2,639	321,813	各種金融
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	37	37	1,009	123,015	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	146	1,627	198,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	487	459	5,021	612,139	耐久消費財・アパレル
JULIUS BAER GROUP LTD	211	188	1,158	141,218	各種金融
SWISS RE LTD	283	246	2,148	261,937	保険
ALCON INC	393	426	2,677	326,374	ヘルスケア機器・サービス
UBS GROUP AG	3,701	3,150	4,629	564,342	各種金融
小 計	16,620	14,980	127,071	15,491,273	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	39	40	—	<3.0%>

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)	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A	636	583	29,662	391,539	資本財
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	3,715	49,047	各種金融
SKF AB-B	354	354	7,966	105,152	資本財
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,557	1,384	14,864	196,214	銀行
SWEDBANK AB-A	867	725	11,061	146,013	銀行
SCA SV CELLULOSA B	—	569	7,918	104,523	素材
VOLVO AB-A SHS	—	135	3,048	40,243	資本財
VOLVO B	1,530	1,232	27,016	356,619	資本財
SWEDISH MATCH AB	160	1,272	9,799	129,357	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	500	500	5,661	74,729	電気通信サービス
ELECTROLUX AB-SER B	181	212	5,032	66,425	耐久消費財・アパレル
SECURITAS B	228	295	4,019	53,056	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	439	1,576	30,105	397,398	各種金融
HENNES & MAURITZ B	773	659	14,179	187,174	小売
ASSA ABLOY AB-B	1,017	865	22,173	292,691	資本財
SVENSKA HANDELSBK A	1,503	1,311	12,466	164,551	銀行
ERICSSON (LM) B	2,987	2,538	28,264	373,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANDVIK AB	1,007	966	21,376	282,174	資本財
TELIA CO AB	2,578	2,306	8,510	112,341	電気通信サービス
SKANSKA B	285	320	7,515	99,201	資本財
LUNDIN ENERGY AB	172	172	4,906	64,766	エネルギー
BOLIDEN AB	239	239	7,974	105,257	素材
ALFA LAVAL AB	256	272	8,453	111,580	資本財
KINNEVIK AB - B	236	187	5,654	74,639	各種金融
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	86	—	—	—	電気通信サービス
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	—	94	4,942	65,239	不動産
ICA GRUPPEN AB	79	94	3,866	51,037	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	4,742	62,597	耐久消費財・アパレル
ATLAS COPCO B	365	319	13,823	182,465	資本財
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	—	101	3,426	45,235	各種金融
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	167	111	3,627	47,881	各種金融
HEXAGON AB-B SHS	265	1,697	20,169	266,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
EPIROC AB-A	538	580	10,998	145,178	資本財
EPIROC AB-B	299	379	6,396	84,432	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	570	494	14,228	187,819	家庭用品・パーソナル用品
EQT AB	—	201	6,074	80,187	各種金融
EVOLUTION AB	—	140	21,840	288,292	消費者サービス
EMBRACER GROUP AB	—	187	4,574	60,381	メディア・娯楽
EPIROC AB-A RED SHS	—	580	173	2,294	資本財
EPIROC AB-B RED SHS	—	379	113	1,498	資本財
BOLIDEN AB-RED	—	239	142	1,886	素材
KINNEVIK AB-B-RED	—	187	2,950	38,944	各種金融
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	1,076	9,409	124,206	資本財
NORDEA BANK ABP	3,099	2,809	25,353	334,666	銀行
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	—	140	3,940	52,010	資本財
SINCH AB	—	33	4,939	65,199	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 <比 率>	23,444 32	28,992 45	467,083 —	6,165,495 <1.2%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	968	855	15,927	208,969	銀行

銘柄	株数 (百株)	当期末				業種
		株数 (百株)	評価額		邦貨換算金額 (千円)	
			外貨建金額	評価額		
NORSK HYDRO	1,061	1,268	6,870	90,134	素材	
TELENOR ASA	718	657	9,572	125,588	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	—	70	2,889	37,909	メディア・娯楽	
ORKLA	698	698	6,089	79,896	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	921	763	13,874	182,038	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	184	164	7,317	96,011	素材	
MOWI ASA	409	409	8,918	117,013	食品・飲料・タバコ	
AKER BP ASA	103	—	—	—	エネルギー	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,498	45,899	保険	
ADEVINTA ASA	—	191	3,100	40,682	メディア・娯楽	
SCHIBSTED ASA-B SHS	69	92	3,212	42,148	メディア・娯楽	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	5,320	5,356	81,272	1,066,293	
(デンマーク)		10	11	—	<0.2%>	
CARLSBERG AS-B	103	86	9,700	174,420	食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	6	5	8,668	155,861	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	4,816	86,607	運輸	
GN STORE NORD A/S	—	119	6,210	111,671	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	593	648	7,450	133,955	銀行	
GENMAB A/S	63	51	12,954	232,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	218	191	8,524	153,261	素材	
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	—	7	2,287	41,131	資本財	
DSV PANALPINA A S	204	181	27,004	485,538	運輸	
DEMANT A/S	116	116	3,784	68,037	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSYEMS A/S	176	873	20,865	375,155	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,692	1,478	71,372	1,283,283	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
H LUNDBECK A/S	48	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	112	92	8,928	160,526	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	98	297	4,315	77,591	保険	
PANDORA A/S	84	94	7,767	139,652	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	103	103	5,668	101,912	素材	
AMBU A/S-B	—	135	3,156	56,762	ヘルスケア機器・サービス	
ISS A/S	142	—	—	—	商業・専門サービス	
ORSTED A/S	184	154	14,413	259,161	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数 <比率>	3,952	4,640	227,889	4,097,445	
(オーストラリア)		17	18	—	<0.8%>	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	162	162	1,029	87,072	ヘルスケア機器・サービス	
AGL ENERGY LTD	642	642	531	44,930	公益事業	
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,715	2,396	6,917	585,056	銀行	
WESTPAC BANKING	3,383	3,189	8,438	713,756	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,346	1,384	3,063	259,089	素材	
TELSTRA CORP	4,031	3,084	1,076	91,054	電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	424	—	—	—	銀行	
BRAMBLES LTD	1,603	1,378	1,496	126,534	商業・専門サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	461	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
ASX LTD	202	181	1,390	117,620	各種金融	
BHP GROUP LTD	2,815	2,523	12,153	1,027,927	素材	
AMPOL LTD	206	206	601	50,895	エネルギー	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	451	—	—	—	小売	
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	718	60,766	ソフトウェア・サービス	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額				
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)			
CSL LIMITED	433	388	11,240	950,713	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
REA GROUP LTD	52	52	867	73,398	メディア・娯楽		
TRANSURBAN GROUP	2,623	2,334	3,245	274,508	運輸		
COCHLEAR LIMITED	62	62	1,400	118,490	ヘルスケア機器・サービス		
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,655	1,655	675	57,144	エネルギー		
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,691	1,523	15,319	1,295,758	銀行		
BORAL LIMITED	817	—	—	—	素材		
RIO TINTO LTD	355	320	3,940	333,252	素材		
ARISTOCRAT LEISURE LTD	527	527	2,210	186,992	消費者サービス		
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	2,093	2,294	1,144	96,822	保険		
TPG CORP LTD	314	—	—	—	電気通信サービス		
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	32	—	—	—	消費者サービス		
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	432	369	1,567	132,565	素材		
ORICA LTD	442	382	526	44,527	素材		
CIMIC GROUP LIMITED	92	—	—	—	資本財		
BLUESCOPE STEEL LTD	493	493	1,054	89,159	素材		
MACQUARIE GROUP LIMITED	329	298	4,545	384,465	各種金融		
WORLEY LTD	345	—	—	—	エネルギー		
SUNCORP GROUP LIMITED	1,193	1,193	1,333	112,760	保険		
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,756	2,786	7,548	638,435	銀行		
NEWCREST MINING LIMITED	740	740	2,083	176,233	素材		
OIL SEARCH LTD	1,187	1,861	692	58,559	エネルギー		
INCITEC PIVOT LTD	1,505	—	—	—	素材		
AMP LTD	3,436	—	—	—	各種金融		
QANTAS AIRWAYS LIMITED	850	850	408	34,580	運輸		
QBE INSURANCE GROUP	1,271	1,380	1,521	128,692	保険		
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	—	1,016	1,162	98,334	素材		
CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	440	—	—	—	各種金融		
REECE LTD	—	168	345	29,210	資本財		
SANTOS	1,564	1,564	1,076	91,032	エネルギー		
SONIC HEALTHCARE LTD	389	400	1,395	118,026	ヘルスケア機器・サービス		
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	128	128	380	32,186	エネルギー		
TABCORP HOLDINGS LTD	1,668	1,820	941	79,590	消費者サービス		
WESFARMERS LTD	1,093	1,005	5,584	472,373	小売		
ALUMINA LIMITED	1,704	—	—	—	素材		
WOODSIDE PETROLEUM LTD	908	744	1,645	139,140	エネルギー		
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,208	1,099	4,605	389,571	食品・生活必需品小売り		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	109	109	527	44,577	各種金融		
SEEK LTD	263	315	980	82,943	メディア・娯楽		
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	35	380	32,178	消費者サービス		
AUSNET SERVICES	1,871	1,871	328	27,779	公益事業		
CROWN RESORTS LTD	303	303	392	33,192	消費者サービス		
EVOLUTION MINING LTD	—	1,221	644	54,551	素材		
AURIZON HOLDINGS LTD	1,914	1,914	698	59,116	運輸		
TREASURY WINE ESTATES LTD	705	705	828	70,042	食品・飲料・タバコ		
XERO LTD	—	113	1,479	125,109	ソフトウェア・サービス		
AFTERPAY LTD	—	199	1,872	158,367	ソフトウェア・サービス		
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,698	2,698	844	71,441	保険		
SOUTH32 LTD	4,818	3,411	1,023	86,559	素材		
COLES GROUP LTD	1,284	1,154	1,918	162,232	食品・生活必需品小売り		
WISETECH GLOBAL LTD	180	138	383	32,450	ソフトウェア・サービス		
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	67,883	57,250	128,183	10,841,775	<2.1%>
			59	53	—	—	—

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)			
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル				
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	849	1,178	860	68,320	運輸		
RYMAN HEALTHCARE LTD	363	363	474	37,659	ヘルスケア機器・サービス		
A2 MILK CO LTD	668	668	393	31,212	食品・飲料・タバコ		
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	545	545	1,592	126,446	ヘルスケア機器・サービス		
FLETCHER BUILDING LTD	766	—	—	—	素材		
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,989	1,731	778	61,786	電気通信サービス		
MERCURY NZ LTD	850	646	422	33,551	公益事業		
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	569	45,202	公益事業		
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	7,137	6,238	5,090	404,179	
			8	7	—	<0.1%>	
(香港)			千香港ドル				
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	237	—	—	—	半導体・半導体製造装置		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	3,468	49,046	不動産		
BANK EAST ASIA	1,091	1,091	1,735	24,542	銀行		
CLP HOLDINGS	1,570	1,375	11,006	155,637	公益事業		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	675	675	3,334	47,149	公益事業		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	1,150	1,041	49,697	702,720	各種金融		
MTR CORP	1,510	1,510	6,636	93,839	運輸		
HANG SENG BANK	742	594	9,812	138,754	銀行		
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,252	1,252	4,683	66,225	不動産		
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,375	1,375	6,696	94,684	公益事業		
HONG KONG & CHINA GAS	9,815	8,615	11,769	166,416	公益事業		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,110	1,740	11,301	159,800	消費者サービス		
KERRY PROPERTIES LTD	645	—	—	—	不動産		
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	3,605	2,815	8,050	113,839	銀行		
NWS HOLDINGS LTD	1,630	—	—	—	資本財		
PCCW LTD	3,570	—	—	—	電気通信サービス		
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	685	—	—	—	耐久消費財・アパレル		
NEW WORLD DEVELOPMENT	6,215	1,363	5,748	81,279	不動産		
SINO LAND CO	3,154	3,154	3,904	55,211	不動産		
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,510	1,185	14,362	203,081	不動産		
SWIRE PACIFIC A	405	405	2,446	34,589	不動産		
VITASOY INTL HOLDINGS LTD	640	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
WHEELLOCK & CO LTD	820	—	—	—	不動産		
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,345	1,175	17,190	243,070	資本財		
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	—	1,720	5,220	73,813	資本財		
SJM HOLDINGS LTD	1,320	1,320	1,170	16,555	消費者サービス		
WYNN MACAU LTD	1,408	1,408	1,889	26,718	消費者サービス		
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	1,722	2,503	35,403	小売		
AIA GROUP LTD	11,552	10,452	107,864	1,525,206	保険		
SANDS CHINA LTD	2,428	1,980	7,038	99,530	消費者サービス		
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	2,251	31,830	不動産		
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,400	1,570	7,379	104,339	不動産		
ESR CAYMAN LTD	—	1,570	3,893	55,055	不動産		
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,045	1,459	3,895	55,082	食品・飲料・タバコ		
WH GROUP LTD	9,365	9,365	6,265	88,589	食品・飲料・タバコ		
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,564	2,294	14,182	200,545	資本財		
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,579	2,074	10,955	154,914	不動産		
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	82,106	68,995	346,355	4,897,472	
			34	30	—	<0.9%>	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	2,046	1,474	573	47,539	資本財	
DBS GROUP	1,748	1,552	4,719	391,304	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	428	428	326	27,075	不動産	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	99	—	—	—	小売	
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	512	—	—	—	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	783	783	813	67,450	各種金融	
CAPITALAND LTD	2,235	2,235	818	67,821	不動産	
GENTING SINGAPORE LTD	6,150	6,150	519	43,086	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	1,699	1,373	735	61,015	資本財	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,665	—	—	—	運輸	
OCBC BANK	3,156	2,912	3,640	301,792	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	1,083	1,083	537	44,549	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	1,203	939	2,467	204,596	銀行	
UOL GROUP LIMITED	475	475	352	29,221	不動産	
VENTURE CORP LTD	257	257	494	41,038	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,271	—	—	—	メディア・娯楽	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	7,522	7,522	1,820	150,931	電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	1,070	—	—	—	公益事業	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	855	70,929	食品・飲料・タバコ	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,999	—	—	—	資本財	
小 計	株 数 銘 柄 数	・ 金 額 <比 率>	37,187	28,969	18,675	1,548,352
	20	14	—	<0.3%>		
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
BANK HAPOALIM BM	983	983	2,759	93,248	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,406	1,088	2,811	95,018	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	21	21	919	31,058	資本財	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	995	995	1,636	55,308	銀行	
ICL LTD	677	677	1,613	54,536	素材	
NICE LTD	61	58	4,278	144,578	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	125	125	1,211	40,939	銀行	
AZRIELI GROUP	43	43	1,075	36,344	不動産	
小 計	株 数 銘 柄 数	・ 金 額 <比 率>	4,313	3,992	16,307	551,031
	8	8	—	<0.1%>		
合 計	株 数 銘 柄 数	・ 金 額 <比 率>	1,036,450	947,412	—	493,356,734
	1,248	1,233	—	<95.3%>		

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千米ドル	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10	10	1,955	214,656
BOSTON PROPERTIES	14	13	1,531	168,118
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	20	20	768	84,355
SL GREEN REALTY CORP	8	—	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	125	125	1,161	127,517
PROLOGIS INC	70	63	7,443	816,957
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13	12	2,488	273,132
CAMDEN PROPERTY TRUST	8	8	1,101	120,937
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	16	—	—	—
DUKE REALTY CORP	35	31	1,465	160,836
CROWN CASTLE INTL CORP	39	36	6,984	766,649
ESSEX PROPERTY TRUST	6	5	1,627	178,584
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	35	32	2,484	272,683
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7	—	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	47	45	1,510	165,841
WELLTOWER INC	38	35	2,667	292,808
KIMCO REALTY CORP	35	—	—	—
IRON MOUNTAIN INC	27	27	1,199	131,640
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	16	16	1,173	128,828
HOST HOTELS AND RESORTS INC	67	67	1,162	127,602
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10	9	1,543	169,381
REALTY INCOME CORP	30	31	2,161	237,299
REGENCY CENTERS CORP	14	12	808	88,709
UDR INC	28	28	1,336	146,688
SIMON PROPERTY GROUP	29	28	3,620	397,367
PUBLIC STORAGE	15	13	3,929	431,341
SUN COMMUNITIES INC	9	9	1,517	166,578
VENTAS INC	34	31	1,750	192,110
VORNADO REALTY TRUST	15	15	727	79,865
EXTRA SPACE STORAGE INC	12	10	1,628	178,704
DIGITAL REALTY TRUST INC	25	23	3,625	397,981
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	50	50	1,059	116,264
AGNC INVESTMENT CORP	46	46	857	94,136
VEREIT INC	105	21	1,006	110,477
AMERICAN TOWER CORPORATION	42	38	9,857	1,081,924
WP CAREY INC	16	16	1,244	136,642

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)	
INVITATION HOMES INC	51	51	1,866	204,854	
EQUINIX INC	8	7	5,675	622,963	
VICI PROPERTIES INC	44	49	1,539	168,992	
SBA COMMUNICATIONS CORP	10	9	2,857	313,669	
小 計	1,244	1,058	85,341	9,367,107	
	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	40	36	—	<1.8%>
(カナダ)			千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	5	—	—	—	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8	8	491	44,612	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	9	—	—	—	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	15	329	29,877	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12	—	—	—	
小 計	51	24	820	74,489	
	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	5	2	—	<0.0%>
(フランス)			千ユーロ		
ICADE	2	—	—	—	
KLEPIERRE	17	17	410	54,942	
GECINA SA	4	4	585	78,240	
COVIVIO(FP)	4	4	383	51,337	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	13	10	754	100,911	
ユーロ計	43	37	2,134	285,432	
	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	5	4	—	<0.1%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	79	79	405	63,019	
SEGRO PLC	106	106	1,116	173,732	
LAND SECURITIES GROUP PLC	58	66	466	72,597	
小 計	244	252	1,988	309,350	
	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	3	3	—	<0.1%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	392	392	1,104	93,384	
APA GROUP	114	114	1,053	89,125	
GPT GROUP	167	167	778	65,886	
SYDNEY AIRPORT	89	124	737	62,364	
STOCKLAND	207	207	966	81,749	
DEXUS	94	94	976	82,605	
GOODMAN GROUP	162	139	2,703	228,641	
VICINITY CENTERS	291	365	575	48,642	
LENLEASE GROUP	55	64	800	67,727	

銘柄		当期首(前期末)		当期		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)		
SCENTRE GROUP		486	486	1,333	112,783		
小計	口数・金額	2,062	2,157	11,029	932,912		
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.2%>		
(香港)				千香港ドル			
LINK REIT		199	170	12,761	180,453		
HKT TRUST AND HKT LTD		375	375	3,975	56,206		
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		220	220	1,741	24,631		
小計	口数・金額	794	766	18,478	261,291		
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>		
(シンガポール)				千シンガポールドル			
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		200	426	874	72,500		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		274	284	826	68,553		
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		243	—	—	—		
SUNTEC REIT		173	—	—	—		
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		—	273	540	44,830		
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		220	220	455	37,757		
小計	口数・金額	1,110	1,203	2,697	223,641		
	銘柄数<比率>	5	4	—	<0.0%>		
合計	口数・金額	5,551	5,500	—	11,454,225		
	銘柄数<比率>	71	62	—	<2.2%>		

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

(注2) < >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		期末	
		買建額 (百万円)	売建額 (百万円)	買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
外	S&P 500 EMIN	9,571	—	—	—
	S&P/TSE 60	819	—	—	—
	SWISS MKT IX	473	—	—	—
	DJ EURO STOXX	1,016	—	—	—
国	SPI 200 FUTU	409	—	—	—
	FTSE 100	590	—	—	—

(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	493,356,734	94.7
投 資 信 託 受 益 証 券	300,055	0.1
投 資 証 券	11,154,170	2.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,155,410	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	520,966,369	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(516,260,967千円)の投資信託財産総額(520,966,369千円)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=109.76円

1カナダドル=90.81円

1ユーロ=133.74円

1イギリスポンド=155.60円

1スイスフラン=121.91円

1スウェーデンクローナ=13.20円

1ノルウェークローネ=13.12円

1デンマーククローネ=17.98円

1オーストラリアドル=84.58円

1ニュージーランドドル=79.40円

1香港ドル=14.14円

1シンガポールドル=82.91円

1イスラエルシケル=33.7909円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年5月31日現在
(A) 資 産	523,208,194,313円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,218,350,289
株 式(評価額)	493,356,734,420
投資信託受益証券(評価額)	300,055,551
投資証券(評価額)	11,154,170,244
未 収 入 金	8,641,126,694
未 収 配 当 金	714,017,917
差 入 委 託 証 拠	2,823,739,198
(B) 負 債	5,604,296,068
未 払 金	5,482,709,861
未 払 解 約 金	121,583,593
未 払 利 息	2,614
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	517,603,898,245
元 本	137,722,653,603
次 期 繰 越 損 益 金	379,881,244,642
(D) 受 益 権 総 口 数	137,722,653,603口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,583円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A) 配 当 等 収 益	8,039,244,093円
受 取 配 当 金	8,026,131,811
受 取 利 息	49,618
そ の 他 収 益 金	24,298,172
支 払 利 息	△11,235,508
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	161,089,371,491
売 益	166,992,668,445
売 買 損	△5,903,296,954
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	3,712,077,898
取 引 益	4,058,355,375
取 引 損	△346,277,477
(D) そ の 他 費 用	△137,838,478
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	172,702,855,004
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	245,133,113,723
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	36,850,599,622
(H) 解 約 差 損 益 金	△74,805,323,707
(I) 計 (E+F+G+H)	379,881,244,642
次 期 繰 越 損 益 金(I)	379,881,244,642

(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154,591,953,075円、期中追加設定元本額は18,420,049,488円、期中一部解約元本額は35,289,348,960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	27,319,928,651円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	26,740,756,058円
DC外国株式インデックス・オープン	10,857,890,716円
DC世界経済インデックスファンド	9,933,704,790円
分散投資コア戦略ファンドS	9,758,316,514円
世界経済インデックスファンド	8,312,520,934円
DCマイセクション75	4,536,581,324円
DCマイセクション50	4,109,438,039円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,719,182,060円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,015,262,452円
分散投資コア戦略ファンドA	1,991,958,160円
DCマイセクションS50	1,921,505,344円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,828,517,773円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,601,056,328円
DCマイセクションS75	1,467,520,721円
FOFs用 外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,451,626,311円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	1,413,236,293円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,357,231,684円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,313,100,388円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,248,237,057円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,130,727,778円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,078,410,498円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,028,013,777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)	879,693,757円
DCマイセクション25	840,378,872円
外国株式インデックス・オープン	816,461,080円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	798,937,731円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	733,203,098円
グローバル経済コア	709,212,074円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	697,134,549円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	685,358,023円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	642,435,391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)	618,951,899円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	517,640,889円
SMTAMバランスファンド2002(適格機関投資家専用)	441,289,364円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	412,861,939円
DCマイセクションS25	396,188,847円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	294,802,711円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	286,317,818円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	284,799,149円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	282,822,494円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	275,209,159円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	222,858,386円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	221,558,447円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	177,165,278円

SMT インデックスバランス・オープン	172,400,101円
SMT 世界経済インデックス・オープン	158,341,580円
DCターゲット・イヤールファンダ2045	126,245,778円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	123,337,883円
i-SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	105,143,819円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	94,365,565円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	92,579,914円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	75,931,212円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	72,689,799円
DCターゲット・イヤールファンダ2025	67,787,480円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	48,976,172円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	43,460,989円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	30,835,711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)	30,734,531円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	26,582,046円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	15,279,171円
DCターゲット・イヤールファンダ(6資産・運用継続型)2030	11,894,680円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11,585,601円
DCターゲット・イヤールファンダ(6資産・運用継続型)2040	8,171,747円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,005,685円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,345,507円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	6,247,966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)	5,394,645円
DCターゲット・イヤールファンダ(6資産・運用継続型)2050	3,489,027円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,221,197円
DCターゲット・イヤールファンダ(6資産・運用継続型)2060	2,542,406円
DCターゲット・イヤールファンダ2055	2,058,786円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式最小分散インデックスマザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2021年5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7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	わが国を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組 比率	株式先 物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率				
設定日(2017年7月25日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 8,203
第1期(2018年5月10日)	10,085	0.9	10,118	1.2	90.3	—	8.2	8,376
第2期(2019年5月10日)	11,186	10.9	11,295	11.6	89.2	—	9.5	9,239
第3期(2020年5月11日)	11,360	1.6	11,539	2.2	90.7	—	7.7	13,984
第4期(2021年5月10日)	13,956	22.9	14,181	22.9	90.9	4.5	2.7	17,930

(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 比率	株式先 物比率	投資信託 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2020年 5月11日	11,360	—	11,539	—	90.7	—	7.7
5月末	11,640	2.5	11,820	2.4	90.0	—	7.7
6月末	11,593	2.1	11,776	2.1	94.3	—	4.8
7月末	11,928	5.0	12,110	4.9	94.1	—	4.5
8月末	12,250	7.8	12,455	7.9	93.6	—	4.5
9月末	12,001	5.6	12,195	5.7	93.1	1.8	4.5
10月末	11,530	1.5	11,705	1.4	92.5	1.9	4.5
11月末	12,211	7.5	12,402	7.5	92.3	2.0	4.6
12月末	12,310	8.4	12,500	8.3	93.8	2.8	2.5
2021年 1月末	12,399	9.1	12,597	9.2	93.1	3.5	2.5
2月末	12,385	9.0	12,585	9.1	92.6	3.6	2.7
3月末	13,417	18.1	13,630	18.1	91.5	4.4	2.6
4月末	13,770	21.2	13,986	21.2	90.9	4.5	2.7
(当期末) 2021年 5月10日	13,956	22.9	14,181	22.9	90.9	4.5	2.7

(注1) 騰落率は期首比です。

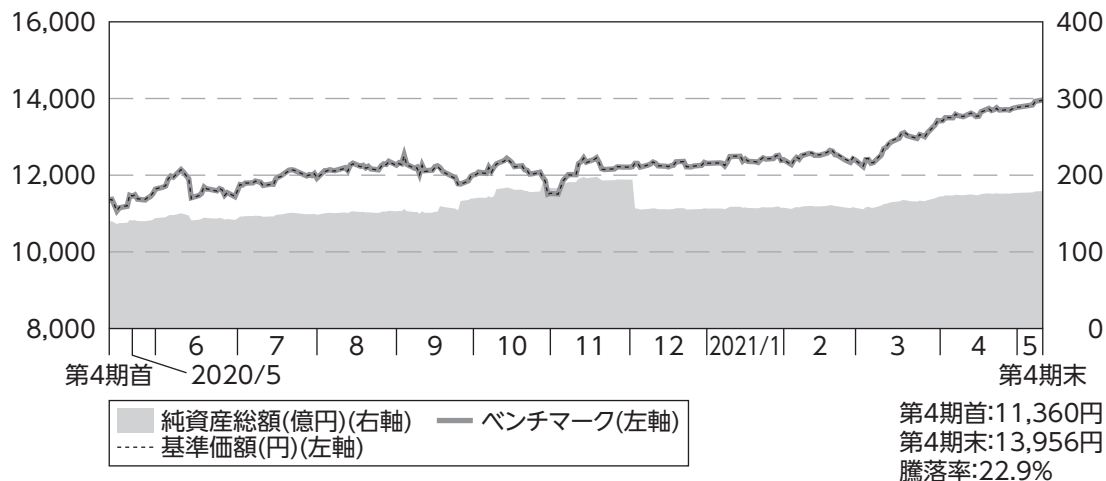
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY)(円換算ベース)です。

MSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY)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に上場する銘柄を対象とした指数です。計量モデルを活用することで、対円の為替変動を含めた指数値の変動幅を、一定の制約条件下で最小化することを目指します。「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ものです。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

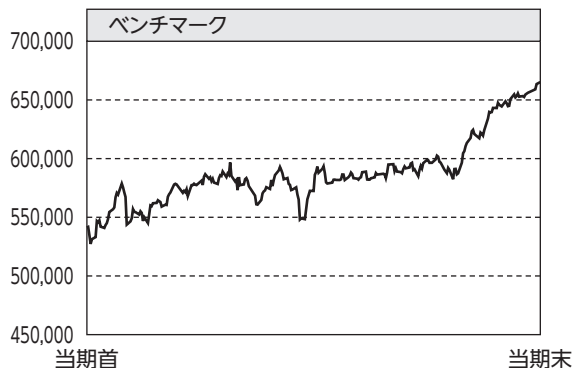


(注)ベンチマークは、2020年5月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY) (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、新型コロナウイルス新規感染の再拡大が警戒されたことなどから下落する場面もありましたが、米欧の中央銀行による低金利政策の長期化観測や、ワクチン早期実用化による経済正常化への期待の高まり、米国での大規模な経済対策の実現期待などを受けて、2021年2月にかけて堅調に推移しました。その後も、米雇用統計などの概ね良好なマクロ経済指標や米欧各国でワクチン接種が順調に進んでいることなどが好感されて一段高となり、先進国株式市場は過去最高値圏で終了しました。

外国為替市場では、世界的な株高を受けたリスク選好姿勢の高まりなどから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コクサイ最小分散インデックス(JPY)(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) 株式組入比率

取引コストに留意しながらリバランスを実施し、先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、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

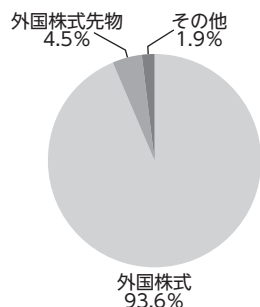
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	S&P 500 EMIN 2106	アメリカ	3.3%
2	DEUTSCHE TELEKOM	ドイツ	1.5%
3	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	1.5%
4	NEWMONT CORPORATION	アメリカ	1.4%
5	NESTLE SA - REGISTERED	スイス	1.3%
6	PEPSICO INC	アメリカ	1.3%

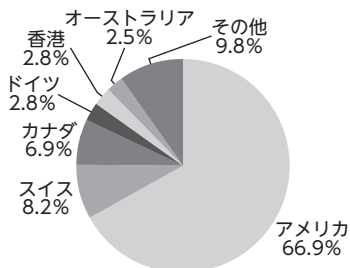
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.3%
8	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	アメリカ	1.3%
9	ROCHE HOLDING GENUSS	スイス	1.3%
10	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	1.3%
組入銘柄数		229	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

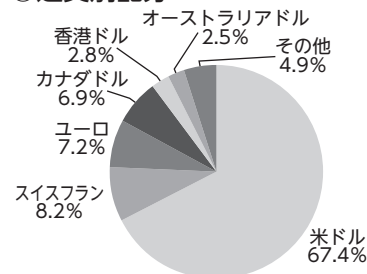
○資産別配分



○国別配分



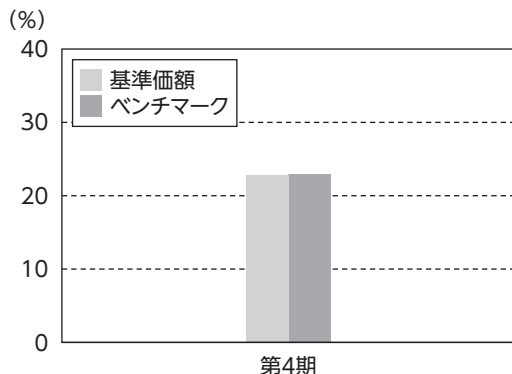
○通貨別配分



(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。
 (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4.5%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。

差異の主な要因は、プラスの影響としては先物要因*1、マイナスの影響としてはキャッシュ要因および配当課税要因*2です。

*1 取引コスト低減のために利用している先物とベンチマークとのリターン差による乖離要因です。

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

今後の運用方針

主としてわが国を除く世界の主要国の株式に投資し、MSCIコクサイ最小分散インデックス(JPY) (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		項目の概要
	(2020年5月12日~2021年5月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (1) (-) (-) (0) (-) (0)	0.006% (0.005) (-) (-) (0.000) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	1 (1) (-) (-) (-) (0)	0.006 (0.005) (-) (-) (-) (0.001)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	7 (7) (-) (0)	0.059 (0.059) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	9	0.071	

(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(12,286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 4,621 (531)	千米ドル 45,689 (56)	百株 4,871 (-)	千米ドル 34,967 (68)
	カ ナ ダ	873	千カナダドル 4,088	1,584	千カナダドル 6,006
	ド イ ツ	502 (-)	千ユーロ 932 (△158)	539	千ユーロ 1,302
	イ タ リ ア	118	393	168	137
	フ ラ ン ス	301	452	452	722
	オ ラ ン ダ	494	556	426	208
	ス ペ イ ン	114 (477)	198 (8)	161 (455)	644 (8)
	ベ ル ギ ー	61	294	105	444
	フ ィ ン ラ ン ド	267	240	431	397
	ア イ ル ラ ン ド	9	99	8	99
	イ ギ リ ス	87	千イギリスポンド 197	500	千イギリスポンド 478
	ス イ ス	219 (0.08)	千スイスフラン 3,739 (△5)	285	千スイスフラン 3,811
	ス ウ ェ ー デ ン	256	千スウェーデンクローナ 1,434	287	千スウェーデンクローナ 2,422
	ノ ル ウ ェ ー	125	千ノルウェークローネ 1,906	178	千ノルウェークローネ 2,702
	デ ン マ ー ク	154 (541)	千デンマーククローネ 7,029 (-)	610	千デンマーククローネ 3,411
	オ ー ス ト ラ リ ア	830	千オーストラリアドル 1,375	1,843	千オーストラリアドル 2,682
	ニ ュ ー ジ ー ラ ン ド	379	千ニュージーランドドル 427	527	千ニュージーランドドル 373
	香 港	4,188 (338)	千香港ドル 11,354 (-)	3,375	千香港ドル 6,591
	シ ン ガ ポ ー ル	1,828 (1,575)	千シンガポールドル 630 (41)	2,562 (1,044)	千シンガポールドル 682 (41)
イ ス ラ エ ル	24	千イスラエルシェケル 440	96	千イスラエルシェケル 943	

(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
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	—	—	100	621
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1	256	7	1,295
CAMDEN PROPERTY TRUST	1	159	7	773
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	—	—	10	317
CROWN CASTLE INTL CORP	1	209	1	205
ESSEX PROPERTY TRUST	0.414	84	1	450
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	2	148	12	742
FEDERAL REALTY INVS TRUST	—	—	1	120
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	—	—	23	571
WELLTOWER INC	—	—	6	306
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.515	60	2	288
REALTY INCOME CORP	—	—	18	1,028
REGENCY CENTERS CORP	—	—	2	119
UDR INC	2	94	12	493
SIMON PROPERTY GROUP	—	—	1	87
PUBLIC STORAGE	1	340	1	316
VENTAS INC	—	—	6	224
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	184	1	175
AGNC INVESTMENT CORP	—	—	38	491
AMERICAN TOWER CORPORATION	0.34	81	0.322	74
WP CAREY INC	—	—	1	85
小 計	14	1,620	260	8,791
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
LINK REIT	31	1,948	—	—
HKT TRUST AND HKT LTD	80	813	99	1,002
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	212	1,640	42	327
小 計	323	4,401	141	1,329

(注)金額は受渡代金です。

<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
外国 株式先物取引	百万円 3,864	百万円 3,215	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	12,156,472千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	15,102,553千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.80

(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			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 5,349	百万円 5,349	% 100.0	百万円 4,727	百万円 4,727	% 100.0
金 銭 信 託	19	19	100.0	19	19	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	17,320	158	0.9	17,345	165	1.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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(上場、登録株式)>

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		
ABBOTT LABORATORIES	35	36	430	46,784	ヘルスケア機器・サービス	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	20	20	303	33,051	ソフトウェア・サービス	
CHUBB LTD	57	20	370	40,252	保険	
ALLSTATE CORP	101	103	1,366	148,664	保険	
AMERICAN ELECTRIC POWER	63	—	—	—	公益事業	
AFLAC	131	—	—	—	保険	
PINNACLE WEST CAPITAL	50	16	146	15,905	公益事業	
AMEREN CORPORATION	65	66	567	61,717	公益事業	
AUTOZONE INC	4	4	645	70,165	小売	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	17	51	1,491	162,209	各種金融	
BAXTER INTERNATIONAL	66	67	586	63,765	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	5	5	129	14,138	ヘルスケア機器・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS	344	356	2,090	227,408	電気通信サービス	
WR BERKLEY CORP	95	15	130	14,157	保険	
BIO-RAD LABORATORIES-A	—	3	207	22,551	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
YUM BRANDS INC	130	—	—	—	消費者サービス	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	48	49	316	34,386	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPHENOL CORPORATION	4	15	108	11,823	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CABOT OIL & GAS CORP	38	38	67	7,344	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO (US)	59	60	300	32,655	食品・飲料・タバコ	
CHURCH & DWIGHT CO INC	71	72	637	69,288	家庭用品・パーソナル用品	
CLOROX COMPANY	26	27	496	53,965	家庭用品・パーソナル用品	
COCA-COLA CO	262	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
COLGATE-PALMOLIVE CO	79	81	665	72,439	家庭用品・パーソナル用品	
CONSOLIDATED EDISON INC	191	194	1,520	165,434	公益事業	
CMS ENERGY CORP	53	54	348	37,940	公益事業	
DANAHER CORP	36	37	970	105,543	ヘルスケア機器・サービス	
TARGET (DAYTON HUDSON)	4	19	425	46,287	小売	
REPUBLIC SERVICES INC	155	142	1,582	172,114	商業・専門サービス	
DTE ENERGY COMPANY	13	—	—	—	公益事業	
DUKE ENERGY CORP	112	114	1,151	125,294	公益事業	
DARDEN RESTAURANTS INC	15	—	—	—	消費者サービス	
EXXON MOBIL	52	—	—	—	エネルギー	
NEXTERA ENERGY INC	82	283	2,111	229,717	公益事業	
GENERAL MILLS INC	44	44	281	30,668	食品・飲料・タバコ	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	18	19	421	45,883	資本財	
HERSHEY FOODS CORPORATION	80	82	1,389	151,121	食品・飲料・タバコ	
JUNIPER NETWORKS INC	61	62	169	18,396	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOME DEPOT	8	8	275	29,962	小売	
HORMEL FOODS CORP	203	189	894	97,282	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)		
HUMANA INC	3	3	173	18,818	ヘルスケア機器・サービス	
JOHNSON & JOHNSON	124	126	2,139	232,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KELLOGG CO	86	88	592	64,425	食品・飲料・タバコ	
KIMBERLY-CLARK CORP	34	35	474	51,643	家庭用品・パーソナル用品	
KROGER CO	—	465	1,756	191,073	食品・生活必需品小売り	
LILLY (ELI) & CO	88	90	1,764	191,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LOCKHEED MARTIN CORP	1	1	75	8,194	資本財	
DOMINION ENERGY INC	84	85	671	72,991	公益事業	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	39	80	720	78,333	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	78	80	1,889	205,497	消費者サービス	
EVEREST RE GROUP LTD	11	11	304	33,150	保険	
MARKEL CORP	4	4	541	58,936	保険	
MARSH & MCLENNAN COS	88	90	1,248	135,843	保険	
MEDTRONIC PLC	74	75	956	104,075	ヘルスケア機器・サービス	
MERCK & CO	143	176	1,384	150,556	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	64	65	1,306	142,064	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NEWMONT CORPORATION	544	348	2,348	255,494	素材	
NVR INC	0.55	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
EVERSOURCE ENERGY	13	13	116	12,673	公益事業	
ORACLE CORP	76	129	1,044	113,598	ソフトウェア・サービス	
PFIZER	270	275	1,090	118,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALTRIA GROUP INC	95	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
BROWN & BROWN INC	12	20	107	11,679	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	90	92	1,249	135,889	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	24	77	818	89,017	保険	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	26	26	439	47,829	保険	
US BANCORP	14	—	—	—	銀行	
ROLLINS INC	—	35	131	14,256	商業・専門サービス	
ACCENTURE PLC-CL A	46	47	1,380	150,177	ソフトウェア・サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	8	8	132	14,465	保険	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	68	69	1,060	115,320	ソフトウェア・サービス	
ANTHEM INC	3	3	155	16,908	ヘルスケア機器・サービス	
ADVANCE AUTO PARTS	5	—	—	—	小売	
SOUTHERN CO	203	206	1,371	149,136	公益事業	
AT&T INC	278	283	911	99,113	電気通信サービス	
STRYKER CORP	31	16	427	46,501	ヘルスケア機器・サービス	
SYSCO CORP	65	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
TYLER TECHNOLOGIES INC	15	25	1,030	112,040	ソフトウェア・サービス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	14	14	615	66,960	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	8	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WALMART INC	77	105	1,476	160,547	食品・生活必需品小売り	
WASTE MANAGEMENT INC	137	139	1,976	215,029	商業・専門サービス	
JM SMUCKER CO	42	43	591	64,364	食品・飲料・タバコ	
WEC ENERGY GROUP INC	150	153	1,498	162,989	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)		
TJX COMPANIES INC	101	—	—	—	—	小売
DOMINO'S PIZZA INC	—	13	594	64,632	—	消費者サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	1	2	100	10,902	—	ソフトウェア・サービス
WESTERN UNION CO	294	263	660	71,841	—	ソフトウェア・サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	57	58	958	104,284	—	ソフトウェア・サービス
WABCO HOLDINGS INC	16	—	—	—	—	資本財
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	28	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	101	103	2,398	260,833	—	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	3	94	10,253	—	ソフトウェア・サービス
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	51	52	438	47,664	—	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	32	73	1,609	175,082	—	小売
PALO ALTO NETWORKS INC	9	9	323	35,188	—	ソフトウェア・サービス
BLACK KNIGHT INC	103	100	755	82,157	—	ソフトウェア・サービス
LAMB WESTON HOLDINGS INC	43	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
BURLINGTON STORES INC	4	—	—	—	—	小売
EVERGY INC	24	25	159	17,368	—	公益事業
AMCOR PLC	165	167	208	22,655	—	素材
AON PLC	25	25	666	72,491	—	保険
FNF GROUP	64	—	—	—	—	保険
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	95	1,371	149,201	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	8	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TELADOC HEALTH INC	—	3	59	6,456	—	ヘルスケア機器・サービス
WASTE CONNECTIONS INC	127	129	1,602	174,336	—	商業・専門サービス
CHENIERE ENERGY INC	21	13	110	12,037	—	エネルギー
AMAZON.COM	—	1	480	52,272	—	小売
ADOBE INC	—	38	1,876	204,131	—	ソフトウェア・サービス
AMGEN	4	4	117	12,802	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN ELECTRIC POWER	—	64	559	60,904	—	公益事業
COMCAST CORP-CL A	30	30	179	19,568	—	メディア・娯楽
AUTOMATIC DATA PROCESS	51	52	1,026	111,693	—	ソフトウェア・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	20	49	496	53,977	—	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	46	790	86,018	—	メディア・娯楽
VERISIGN INC	15	15	343	37,311	—	ソフトウェア・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	41	41	502	54,695	—	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	90	75	909	98,891	—	ソフトウェア・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10	—	—	—	—	保険
CISCO SYSTEMS	—	119	639	69,553	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	58	59	445	48,427	—	ソフトウェア・サービス
DOLLAR TREE INC	30	30	358	38,995	—	小売
ELECTRONIC ARTS INC	—	57	824	89,693	—	メディア・娯楽
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	2	16	341	37,198	—	保険
FISERV INC	78	80	941	102,412	—	ソフトウェア・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	10	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
GILEAD SCIENCES INC	—	222	1,480	161,086	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
F5 NETWORKS INC	3	6	113	12,367	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	53	49	765	83,314	ソフトウェア・サービス
INCYTE CORP	—	32	272	29,680	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	—	81	903	98,326	ソフトウェア・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	—	77	729	79,397	メディア・娯楽
MICROSOFT CORP	—	4	123	13,455	ソフトウェア・サービス
XCEL ENERGY INC	227	231	1,652	179,764	公益事業
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	3	3	190	20,734	小売
PAYCHEX INC	154	157	1,592	173,174	ソフトウェア・サービス
PEPSICO INC	148	149	2,170	236,110	食品・飲料・タバコ
REGENERON PHARMACEUTICALS	—	31	1,557	169,388	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEAGEN INC	—	11	159	17,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ARCH CAPITAL GROUP LTD	60	—	—	—	保険
ROSS STORES INC	20	—	—	—	小売
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	15	15	95	10,393	食品・飲料・タバコ
STARBUCKS CORP	56	57	654	71,150	消費者サービス
NORTONLIFELOCK INC	—	85	179	19,565	ソフトウェア・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	—	24	457	49,810	半導体・半導体製造装置
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	—	99	2,134	232,159	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CME GROUP INC	14	14	289	31,518	各種金融
ALLIANT ENERGY CORPORATION	34	35	199	21,687	公益事業
MARKETAXESS HOLDINGS INC	—	4	176	19,210	各種金融
MASIMO CORP	—	12	272	29,648	ヘルスケア機器・サービス
T-MOBILE US INC	75	108	1,505	163,713	電気通信サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	—	7	230	25,048	ソフトウェア・サービス
SABRE CORP	53	—	—	—	ソフトウェア・サービス
VIATRIS INC	—	43	60	6,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CDK GLOBAL INC	8	—	—	—	ソフトウェア・サービス
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	234	—	—	—	食品・生活必需品小売り
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	98	118	787	85,672	資本財
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	153	—	—	—	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	21	21	232	25,338	各種金融
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	100,512	10,932,697	
	金額	金額	<比率>	<61.0%>	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES	164	154	1,296	116,339	素材
BARRICK GOLD CORP	1,225	695	2,018	181,129	素材
BCE INC	106	96	568	50,970	電気通信サービス
CGI INC - CL A	56	56	623	55,941	ソフトウェア・サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	151	151	935	83,904	電気通信サービス
OPEN TEXT CORP	11	18	108	9,755	ソフトウェア・サービス
TELUS CORP	288	295	777	69,779	電気通信サービス
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	10	10	580	52,104	保険
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	85	—	—	—	メディア・娯楽

銘柄	銘柄	当期首(前期末)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
KINROSS GOLD CORP		866	804	754	67,743	素材
INTACT FINANCIAL CORP		50	50	840	75,450	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		309	286	1,524	136,828	素材
FRANCO-NEVADA CORP		129	121	2,188	196,361	素材
KIRKLAND LAKE GOLD LTD		138	140	696	62,504	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,593 14	2,882 13	12,914 —	1,158,813 <6.5%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		2	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MERCK KGAA		19	19	281	37,267	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAP SE		28	29	341	45,189	ソフトウェア・サービス
HENKEL AG & CO KGAA		32	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
BELERSDORF AG		30	30	294	39,021	家庭用品・パーソナル用品
DEUTSCHE TELEKOM		1,226	1,212	2,004	265,281	電気通信サービス
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI		619	629	154	20,489	電気通信サービス
SIEMENS HEALTHINEERS AG		51	52	256	33,893	ヘルスケア機器・サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,011 8	1,974 6	3,333 —	441,142 <2.5%>	
(イタリア)						
ENI		168	—	—	—	エネルギー
DIASORIN SPA		—	16	225	29,809	ヘルスケア機器・サービス
INFRASTRUTTURA WIRELESS ITAL		—	102	97	12,859	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	168 1	118 2	322 —	42,668 <0.2%>	
(フランス)						
ORANGE		1,046	1,064	1,115	147,657	電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		5	5	570	75,533	耐久消費財・アパレル
SODEXO		18	—	—	—	消費者サービス
ILIAD SA		—	3	50	6,653	電気通信サービス
GETLINK		153	—	—	—	運輸
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,223 4	1,073 3	1,737 —	229,844 <1.3%>	
(オランダ)						
KONINKLIJKE AHOLD NV		182	181	418	55,405	食品・生活必需品小売り
QIAGEN N.V.		—	61	245	32,468	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VOPAK		—	25	94	12,534	エネルギー
KPN (KON.)		1,457	1,439	403	53,412	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,639 2	1,707 4	1,162 —	153,820 <0.9%>	
(スペイン)						
TELEFONICA		221	247	96	12,789	電気通信サービス
INDITEX		117	119	368	48,743	小売
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS		39	—	—	—	ソフトウェア・サービス
AENA SME SA		13	—	—	—	運輸
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	391 4	366 2	465 —	61,532 <0.3%>	

銘柄	株数 (百株)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(ベルギー)					
UCB (GROUPE)	59	60	467	61,795	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	37	35	176	23,329	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	22	20	184	24,384	各種金融
PROXIMUS	105	97	169	22,448	電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV	32	—	—	—	メディア・娯楽
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	258 5	213 4	997 —	131,957 <0.7%>
(フィンランド)					
SAMPO OYJ-A SHS	24	—	—	—	保険
ELISA A	98	91	435	57,588	電気通信サービス
NOKIA OYJ	816	684	292	38,655	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	939 3	775 2	727 —	96,243 <0.5%>
(アイルランド)					
KERRY GROUP PLC-A	33	33	370	49,088	食品・飲料・タバコ
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	33 1	33 1	370 —	49,088 <0.3%>
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6,666 28	6,263 24	9,116 —	1,206,299 <6.7%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
COMPASS GROUP PLC	242	—	—	—	消費者サービス
GLAXOSMITHKLINE	195	198	269	41,094	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASTRAZENECA	27	27	215	32,907	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
OCADO GROUP PLC	—	22	43	6,632	小売
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	196	—	—	—	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	661 4	248 3	528 —	80,634 <0.4%>
(スイス)			千スイスフラン		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	0.93	0.96	196	23,755	食品・飲料・タバコ
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.33	0.26	220	26,582	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.07	0.07	637	76,892	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	—	4	377	45,587	素材
SWISS PRIME SITE-REG	4	10	91	11,102	不動産
SCHINDLER HOLDING AG-REG	—	8	224	27,129	資本財
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	10	96	11,589	銀行
SGS SA	2	2	585	70,731	商業・専門サービス
SWISSCOM	17	16	820	99,027	電気通信サービス
GIVAUDAN-REG	2	2	823	99,393	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	12	7	303	36,641	保険
NOVARTIS	189	193	1,535	185,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING GENUSS	61	63	1,918	231,600	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA - REGISTERED	193	180	1,974	238,358	食品・飲料・タバコ
SONOVA HOLDING AG-REG	13	13	372	45,014	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)		
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	25	26	731	88,248	運輸	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	51	537	64,903	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SWISS RE LTD	134	—	—	—	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	659 14	593 17	11,448 —	1,381,891 <7.7%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ERICSSON (LM) B	275	280	3,260	42,715	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELIA CO AB	624	635	2,304	30,193	電気通信サービス	
MILLCOM INTL CELLULAR-SDR	45	—	—	—	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	945 3	915 2	5,565 —	72,909 <0.4%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
TELENOR ASA	500	447	6,565	87,062	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	500 1	447 1	6,565 —	87,062 <0.5%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
NOVO NORDISK A/S-B	89	182	8,477	150,821	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
H LUNDBECK A/S	41	41	802	14,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	77	76	7,492	133,290	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	83	77	1,131	20,127	保険	
CHR HANSEN HOLDING A/S	8	9	508	9,052	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	301 5	387 5	18,412 —	327,562 <1.8%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
TELSTRA CORP	1,399	1,423	494	42,207	電気通信サービス	
CSL LIMITED	7	7	202	17,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	807	—	—	—	運輸	
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	259	264	135	11,584	保険	
NEWCREST MINING LIMITED	533	522	1,427	121,942	素材	
SONIC HEALTHCARE LTD	263	267	932	79,675	ヘルスケア機器・サービス	
WESFARMERS LTD	250	254	1,382	118,115	小売	
WOOLWORTHS GROUP LTD	99	101	398	34,081	食品・生活必需品小売り	
CROWN RESORTS LTD	234	—	—	—	消費者サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	3,855 9	2,841 7	4,973 —	424,938 <2.4%>	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	165	—	—	—	運輸	
RYMAN HEALTHCARE LTD	76	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	—	74	250	19,822	ヘルスケア機器・サービス	
SPARK NEW ZEALAND LTD	794	815	373	29,584	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	1,036 3	889 2	623 —	49,406 <0.3%>	
(香港)			千香港ドル			
BANK EAST ASIA	—	830	1,328	18,605	銀行	

銘柄	株数 (百株)	当	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	—	21	954	13,368	各種金融	
MTR CORP	1,065	990	4,375	61,304	運輸	
HANG SENG BANK	416	490	7,952	111,417	銀行	
HONG KONG & CHINA GAS	—	881	1,171	16,415	公益事業	
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	1,230	2,365	6,893	96,584	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	1,080	—	—	—	資本財	
PCCW LTD	2,940	2,730	1,255	17,593	電気通信サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	440	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	355	370	2,380	33,357	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	7,526	8,677	26,313	368,647	
	銘柄 数 <比 率>	7	8	—	<2.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	221	330	124	10,211	資本財	
SINGAPORE AIRPORT TERMINAL S	450	—	—	—	運輸	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	558	510	527	43,325	各種金融	
OCBC BANK	—	125	157	12,886	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	354	351	173	14,260	運輸	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	4,634	4,698	1,151	94,474	電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,217	6,014	2,134	175,159	
	銘柄 数 <比 率>	5	5	—	<1.0%>	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
NICE LTD	13	13	1,049	35,115	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	72	—	—	—	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	85	13	1,049	35,115	
	銘柄 数 <比 率>	2	1	—	<0.2%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	41,388	39,794	—	16,301,138	
	銘柄 数 <比 率>	229	220	—	<90.9%>	

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

(注2) < >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		
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	100	—	—	—	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6	—	—	—	
CAMDEN PROPERTY TRUST	6	—	—	—	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	10	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	4	4	847	92,181	
ESSEX PROPERTY TRUST	1	—	—	—	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	9	—	—	—	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	—	—	—	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	23	—	—	—	
WELLTOWER INC	6	—	—	—	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1	—	—	—	
REALTY INCOME CORP	18	—	—	—	
REGENCY CENTERS CORP	2	—	—	—	
UDR INC	9	—	—	—	
SIMON PROPERTY GROUP	1	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	5	5	1,483	161,409	
VENTAS INC	6	—	—	—	
EXTRA SPACE STORAGE INC	5	5	861	93,705	
AGNC INVESTMENT CORP	38	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORPORATION	1	1	294	32,007	
WP CAREY INC	1	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	262	17	3,487	379,303
	銘 柄 数 <比 率>	21	4	—	<2.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	10	42	3,112	43,601	
HKT TRUST AND HKT LTD	262	243	2,770	38,810	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	170	1,341	18,791	
小 計	口 数 ・ 金 額	272	455	7,223	101,204
	銘 柄 数 <比 率>	2	3	—	<0.6%>
合 計	口 数 ・ 金 額	534	472	—	480,507
	銘 柄 数 <比 率>	23	7	—	<2.7%>

(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	
		買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
外国	S&P 500 EMIN	597	—
	S&P/TSE 60	207	—

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

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	16,301,138千円	90.9%
投資信託受益証券	57,602	0.3
投資証券	422,905	2.4
コール・ローン等、その他	1,148,506	6.4
投資信託財産総額	17,930,151	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(17,925,448千円)の投資信託財産総額(17,930,151千円)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=108.77円

1イギリスポンド=152.65円

1ノルウェークローネ=13.26円

1ニュージーランドドル=79.25円

1イスラエルシェケル=33.4685円

1カナダドル=89.73円

1スイスフラン=120.71円

1デンマーククローネ=17.79円

1香港ドル=14.01円

1ユーロ=132.32円

1スウェーデンクローナ=13.10円

1オーストラリアドル=85.44円

1シンガポールドル=82.08円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年5月10日現在
(A)資 産	17,930,151,579円
コーポレート債	947,397,403
株式(評価額)	16,301,138,646
投資信託受益証券(評価額)	57,602,115
投資証券(評価額)	422,905,128
未収入金	45,071,574
未収配当金	10,480,934
差入委託証拠金	145,555,779
(B)負 債	3
未払利息	3
(C)純資産総額(A-B)	17,930,151,576
元 本	12,847,746,890
次期繰越損益金	5,082,404,686
(D)受益権総口数	12,847,746,890口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,956円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月12日 至 2021年5月10日
(A)配 当 等 収 益	310,341,252円
受 取 配 当 金	311,243,699
受 取 利 息	5,633
支 払 利 息	△908,080
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,919,721,869
売 買 益	3,591,816,517
売 買 損	△672,094,648
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	126,964,878
取 引 益	153,451,831
取 引 損	△26,486,953
(D)そ の 他 費 用	△9,904,169
(E)当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	3,347,123,830
(F)前 期 繰 越 損 益 金	1,674,779,077
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	766,921,693
(H)解 約 差 損 益 金	△706,419,914
(I)計 (E+F+G+H)	5,082,404,686
次 期 繰 越 損 益 金 (I)	5,082,404,686

(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12,310,208,669円、期中追加設定元本額は3,731,118,307円、期中一部解約元本額は3,193,580,086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	7,499,598,114円
マルチ・ストラテジー・ファンド(適格機関投資家専用)	3,798,414,400円
分散投資コア戦略ファンドA	1,549,734,376円

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第21期（決算日 2021年5月31日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率	純資産額
	騰落率	中率	騰落率	中率		
第17期(2017年5月29日)	円 26,633	% 0.2	440.540	% 0.9	% 97.3	百万円 219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441.246	0.2	98.0	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454.282	3.0	97.3	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481.049	5.9	97.3	276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510.445	6.1	98.1	304,255

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率	債券先物率 比
	騰落率	中率	騰落率	中率		
(当期首) 2020年 5月29日	円 29,017	% —	481.049	% —	% 97.3	% 2.1
6月末	29,466	1.5	488.814	1.6	96.8	2.3
7月末	29,761	2.6	494.135	2.7	97.5	1.5
8月末	29,723	2.4	492.649	2.4	97.8	1.4
9月末	29,856	2.9	494.877	2.9	97.9	1.2
10月末	29,425	1.4	488.038	1.5	98.0	1.1
11月末	29,723	2.4	493.201	2.5	97.9	1.4
12月末	29,967	3.3	497.331	3.4	98.4	1.0
2021年 1月末	29,924	3.1	496.213	3.2	97.9	1.2
2月末	29,638	2.1	494.148	2.7	97.8	1.3
3月末	30,338	4.6	501.120	4.2	97.6	1.5
4月末	30,310	4.5	502.927	4.5	98.0	1.2
(当期末) 2021年 5月31日	30,717	5.9	510.445	6.1	98.1	1.1

(注1)騰落率は期首比です。

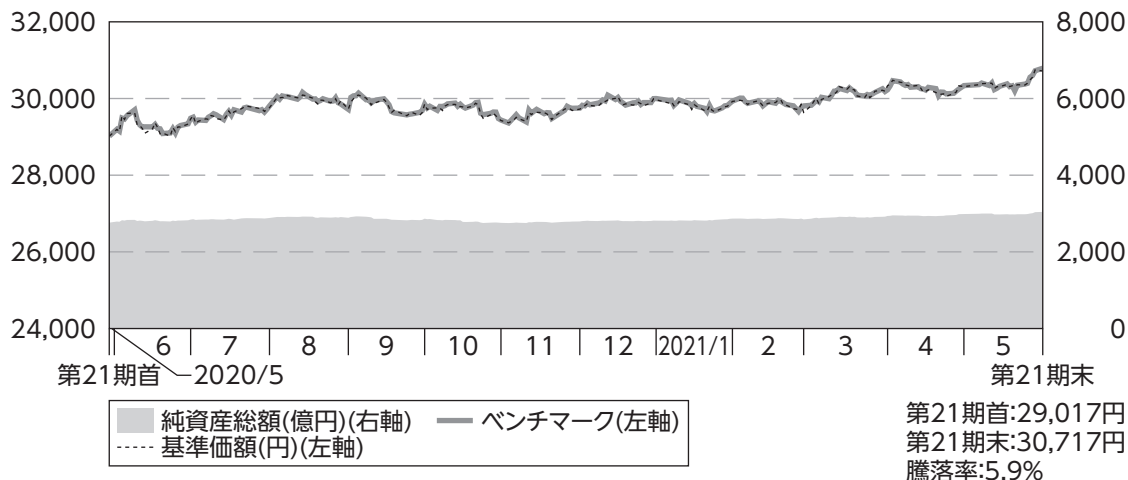
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

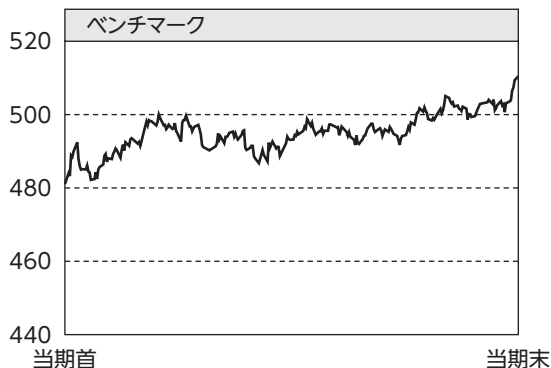


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年8月中旬にかけて、ユーロ圏の景気回復期待が高まったことから外国為替市場でユーロが対円で上昇し、基準価額は上昇しました。その後11月上旬にかけては、主要国の長期金利がレンジ内で上下動を繰り返す中、主要通貨に対しては円高推移となり、基準価額は緩やかに低下しました。11月中旬以降期末にかけては、基準価額は緩やかに上昇しました。米国の景気やインフレの上振れ可能性が意識されたことや欧米での新型コロナウイルスに対するワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから、主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)したことが基準価額の下落要因となったものの、日米金利差の拡大が意識され円売り米ドル買いの動きが強まったこと、世界的な株高を受けたりスク選好姿勢の高まりから米ドル売りユーロ買いの動きが加速した影響や日欧のワクチン接種ペースの差異などを背景に円安・ユーロ高が進行したことなど、外国為替市場での上昇要因が債券市場での下落要因を上回り、基準価額は緩やかな上昇となりました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、大型の追加経済支援策の成立を受けて米国の景気やインフレの上振れ可能性が意識されたことや欧米でのワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから、上昇しました。

外国為替市場では、欧州での景気回復期待の高まりや新型コロナウイルスに対するワクチン接種ペースの差異などを背景に、ユーロやイギリスポンドは期を通じて対円で上昇が続きました。米ドルは、2021年に入ってから、米長期金利の上昇による日米金利差の拡大を材料に、対円で上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

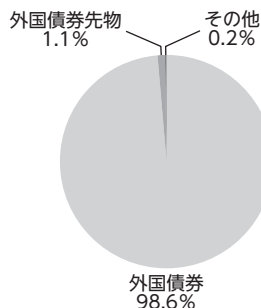
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 0.625% 08/15/30	アメリカ	0.5%
2	T 1.125% 02/15/31	アメリカ	0.5%
3	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
4	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
5	T 2.375% 05/15/27	アメリカ	0.4%
6	T 0.5% 02/28/26	アメリカ	0.4%

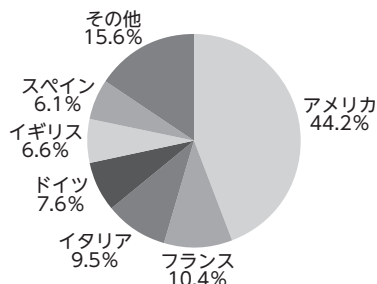
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 1.375% 11/15/40	アメリカ	0.4%
8	T 0.75% 03/31/26	アメリカ	0.4%
9	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.4%
10	T 2% 11/15/26	アメリカ	0.4%
組入銘柄数		779	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

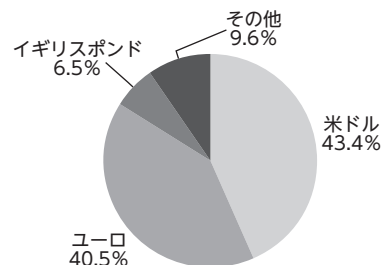
○資産別配分



○国別配分



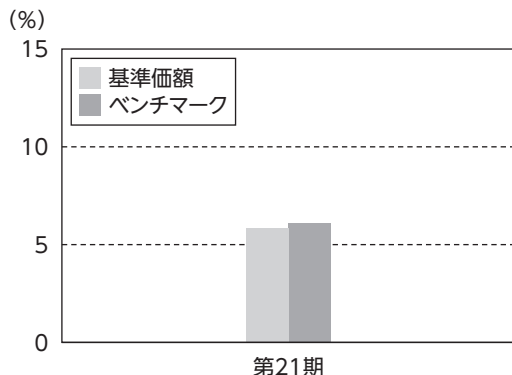
○通貨別配分



(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。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.1%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差※(マイナス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年5月30日~2021年5月31日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	7	0.022	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(6)	(0.022)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	7	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(29,762円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 457,488	千米ドル 342,694
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 34,089	千カナダドル 29,278
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 96,120	千メキシコペソ 92,129
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 49,238	千ユーロ 40,717
	イ タ リ ア	国 債 証 券	44,645	41,154
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	46,062	31,928
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	9,672	7,928
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	25,164	20,917
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	7,389	8,218
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,215	5,428
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,868	1,632
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	4,146	2,260
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 35,739	千イギリスポンド 29,642
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 19,122	千スウェーデンクローナ 2,802
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 11,757	千ノルウェークローネ 13,795
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 19,833	千デンマーククローネ 16,230
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 23,002	千ポーランドズロチ 18,494
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 33,163	千オーストラリアドル 28,254
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,115	千シンガポールドル 3,776
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 13,174	千マレーシアリンギット 11,432
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 13,044	千イスラエルシェケル 4,940	

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 43,703	百万円 46,247	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 34,594	百万円 398	% 1.2	百万円 21,411	百万円 131	% 0.6
金 銭 信 託	8	8	100.0	878	878	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	848,778	49,277	5.8	848,144	49,277	5.8

(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。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千米ドル 1,162,010	千米ドル 1,203,672	千円 132,115,094	% 43.4	% —	% 19.1	% 16.7	% 7.6
カ ナ ダ	千カナダドル 65,030	千カナダドル 68,165	6,190,083	2.0	—	0.9	0.6	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 409,160	千メキシコペソ 435,502	2,399,051	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 145,240	千ユーロ 168,508	22,536,372	7.4	—	4.4	1.9	1.0
イ タ リ ア	181,970	212,485	28,417,855	9.3	—	5.9	2.4	1.0
フ ラ ン ス	199,590	231,573	30,970,696	10.2	—	6.3	2.8	1.0
オ ラ ン ダ	37,250	43,515	5,819,811	1.9	—	1.4	0.4	0.2
ス ペ イ ン	116,300	136,105	18,202,803	6.0	—	3.9	1.6	0.4
ベ ル ギ ー	44,900	54,084	7,233,204	2.4	—	1.8	0.5	0.1
オーストリア	28,760	33,538	4,485,399	1.5	—	0.9	0.4	0.1
フィンランド	12,840	13,804	1,846,189	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	16,880	18,705	2,501,713	0.8	—	0.6	0.2	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 106,280	千イギリスポンド 127,155	19,785,369	6.5	—	4.9	1.1	0.6
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 76,250	千スウェーデンクローナ 82,687	1,091,472	0.4	—	0.2	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 55,570	千ノルウェークローネ 57,183	750,250	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 71,160	千デンマーククローネ 85,326	1,534,167	0.5	—	0.4	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 60,380	千ポーランドズロチ 63,817	1,904,317	0.6	—	0.3	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 73,260	千オーストラリアドル 77,669	6,569,251	2.2	—	1.5	0.4	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 14,300	千シンガポールドル 15,576	1,291,459	0.4	—	0.3	0.1	0.1
マレーシア	千マレーシアリンギット 51,060	千マレーシアリンギット 53,817	1,425,343	0.5	—	0.3	0.1	0.1
イスラエル	千イスラエルシェケル 35,400	千イスラエルシェケル 40,142	1,356,443	0.4	—	0.3	0.1	0.1
合 計	—	—	298,426,352	98.1	—	54.0	30.4	13.6

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.125% 01/15/24	0.125	10,000	9,973	1,094,727	2024/1/15
T 0.125% 02/15/24	0.125	4,710	4,696	515,515	2024/2/15
T 0.125% 05/15/23	0.125	7,500	7,498	823,071	2023/5/15
T 0.125% 09/15/23	0.125	8,060	8,050	883,628	2023/9/15
T 0.125% 10/15/23	0.125	8,000	7,989	876,913	2023/10/15
T 0.125% 12/15/23	0.125	3,250	3,243	355,995	2023/12/15
T 0.125% 12/31/22	0.125	6,400	6,401	702,642	2022/12/31
T 0.25% 03/15/24	0.25	13,000	13,002	1,427,102	2024/3/15
T 0.25% 04/15/23	0.25	10,150	10,173	1,116,631	2023/4/15
T 0.25% 06/15/23	0.25	8,000	8,016	879,863	2023/6/15
T 0.25% 06/30/25	0.25	1,000	987	108,362	2025/6/30
T 0.25% 07/31/25	0.25	10,000	9,860	1,082,293	2025/7/31
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,500	7,378	809,855	2025/9/30
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,536	388,143	2025/10/31
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,873	864,188	2026/1/31
T 0.375% 04/15/24	0.375	7,000	7,019	770,510	2024/4/15
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,954	873,072	2025/4/30
T 0.375% 07/31/27	0.375	9,500	9,107	999,626	2027/7/31
T 0.375% 09/30/27	0.375	8,000	7,641	838,703	2027/9/30
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,959	324,881	2025/11/30
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,941	432,660	2025/12/31
T 0.5% 02/28/26	0.5	11,500	11,374	1,248,434	2026/2/28
T 0.5% 03/15/23	0.5	7,770	7,822	858,598	2023/3/15
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	7,219	792,374	2025/3/31
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,853	313,202	2027/4/30
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,391	372,245	2027/5/31
T 0.5% 06/30/27	0.5	7,100	6,870	754,090	2027/6/30
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,493	493,260	2027/8/31
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	7,207	791,140	2027/10/31
T 0.625% 05/15/30	0.625	14,100	13,054	1,432,874	2030/5/15
T 0.625% 08/15/30	0.625	15,950	14,707	1,614,311	2030/8/15
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,418	265,460	2027/11/30
T 0.625% 12/31/27	0.625	10,000	9,659	1,060,213	2027/12/31
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	8,265	907,230	2028/1/31
T 0.75% 03/31/26	0.75	11,000	10,997	1,207,124	2026/3/31
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	10,492	1,151,637	2030/11/15
T 1.125% 02/15/31	1.125	15,050	14,445	1,585,554	2031/2/15
T 1.125% 02/29/28	1.125	2,000	1,991	218,611	2028/2/29
T 1.125% 05/15/40	1.125	8,060	6,743	740,216	2040/5/15
T 1.125% 08/15/40	1.125	9,300	7,752	850,905	2040/8/15
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,150	5,163	566,721	2028/3/31
T 1.25% 05/15/50	1.25	10,650	8,307	911,867	2050/5/15
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,657	511,229	2023/7/31
T 1.375% 01/31/25	1.375	9,000	9,298	1,020,639	2025/1/31
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	5,127	562,798	2023/6/30
T 1.375% 08/15/50	1.375	9,900	7,979	875,835	2050/8/15
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,567	281,828	2023/8/31
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	4,111	451,285	2023/9/30
T 1.375% 10/15/22	1.375	5,000	5,087	558,425	2022/10/15
T 1.375% 11/15/40	1.375	13,000	11,320	1,242,500	2040/11/15
T 1.5% 01/15/23	1.5	6,200	6,339	695,850	2023/1/15
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	6,184	678,805	2027/1/31
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	6,484	711,700	2030/2/15
T 1.5% 02/28/23	1.5	7,800	7,987	876,695	2023/2/28
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	4,100	450,093	2023/3/31
T 1.5% 08/15/22	1.5	10,000	10,172	1,116,507	2022/8/15
T 1.5% 08/15/26	1.5	8,400	8,682	952,956	2026/8/15
T 1.5% 09/15/22	1.5	9,500	9,673	1,061,721	2022/9/15
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,816	967,654	2024/9/30

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	8,438	926,215	2026/2/15
T 1.625% 04/30/23	1.625	3,500	3,599	395,092	2023/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,363	259,403	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	1,029	113,007	2023/5/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	2,500	2,546	279,534	2022/8/15
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,863	753,382	2029/8/15
T 1.625% 08/31/22	1.625	5,000	5,096	559,379	2022/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,586	283,896	2023/10/31
T 1.625% 10/31/26	1.625	7,300	7,584	832,515	2026/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	8,080	8,259	906,572	2022/11/15
T 1.625% 11/15/50	1.625	8,050	6,922	759,799	2050/11/15
T 1.625% 11/30/26	1.625	8,780	9,121	1,001,148	2026/11/30
T 1.625% 12/15/22	1.625	3,600	3,684	404,404	2022/12/15
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,755	851,266	2023/1/31
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,805	417,742	2023/5/15
T 1.75% 05/31/22	1.75	9,550	9,710	1,065,773	2022/5/31
T 1.75% 06/30/22	1.75	7,000	7,126	782,185	2022/6/30
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,505	275,031	2024/6/30
T 1.75% 07/15/22	1.75	8,320	8,476	930,414	2022/7/15
T 1.75% 09/30/22	1.75	5,150	5,263	577,750	2022/9/30
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	3,077	337,769	2029/11/15
T 1.875% 02/15/41	1.875	3,000	2,851	312,996	2041/2/15
T 1.875% 02/15/51	1.875	9,900	9,859	993,836	2051/2/15
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,189	1,008,619	1,008,619	2022/7/31
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,466	600,028	2026/7/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,489	448,858	2022/8/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	6,293	690,767	2024/8/31
T 1.875% 09/30/22	1.875	2,660	2,723	298,901	2022/9/30
T 1.875% 10/31/22	1.875	7,450	7,637	838,266	2022/10/31
T 2% 02/15/23	2.0	5,000	5,160	566,400	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,937	980,946	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,711	517,158	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,540	717,888	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,477	381,740	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,784	634,854	2024/6/30
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,067	336,688	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	7,295	800,734	2025/8/15
T 2% 10/31/22	2.0	10,000	10,268	1,127,119	2022/10/31
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	10,818	1,187,474	2026/11/15
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,056	225,775	2022/11/30
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,362	588,617	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,789	855,024	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,550	279,929	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,836	421,097	2026/5/31
T 2.125% 06/30/22	2.125	6,000	6,132	673,146	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	5,070	556,483	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,463	928,912	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,808	308,278	2023/11/30
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,489	602,501	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,214	462,604	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	9,594	1,053,073	2027/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	8,036	882,445	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	7,400	812,228	2024/4/30
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	9,157	1,005,092	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	7,290	7,278	798,837	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,470	5,476	601,133	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,695	734,895	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,792	1,184,606	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,709	516,882	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	8,189	898,866	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,735	519,773	2023/12/31

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)		
T 2.25% 12/31/24	2.25	8,400	8,941	981,408	2024/12/31	
T 2.375% 01/31/23	2.375	5,000	5,188	569,455	2023/1/31	
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	6,095	669,088	2024/2/29	
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,802	307,604	2026/4/30	
T 2.375% 05/15/27	2.375	10,750	11,598	1,273,023	2027/5/15	
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	8,610	945,115	2029/5/15	
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	5,324	584,407	2024/8/15	
T 2.375% 11/15/49	2.375	7,500	7,674	842,300	2049/11/15	
T 2.5% 01/31/24	2.5	3,470	3,679	403,882	2024/1/31	
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	5,371	589,617	2025/1/31	
T 2.5% 02/15/45	2.5	3,210	3,362	369,065	2045/2/15	
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,000	4,188	459,688	2046/2/15	
T 2.5% 03/31/23	2.5	4,050	4,225	463,819	2023/3/31	
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	8,418	923,973	2024/5/15	
T 2.5% 05/15/46	2.5	5,050	5,288	580,443	2046/5/15	
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,783	525,080	2023/8/15	
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	5,103	560,179	2026/1/31	
T 2.625% 02/15/29	2.625	9,990	10,928	1,199,470	2029/2/15	
T 2.625% 02/28/23	2.625	1,400	1,461	160,383	2023/2/28	
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,835	860,011	2025/3/31	
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	5,152	565,555	2023/6/30	
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,716	407,959	2023/12/31	
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	6,329	694,773	2025/12/31	
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,203	351,660	2024/2/15	
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	7,218	792,281	2028/2/15	
T 2.75% 04/30/23	2.75	3,600	3,780	414,915	2023/4/30	
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	4,082	448,052	2023/5/31	
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,987	657,209	2025/6/30	
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,056	115,912	2023/7/31	
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,300	1,425	156,432	2042/8/15	
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,950	5,436	596,666	2047/8/15	
T 2.75% 08/31/23	2.75	7,500	7,934	870,855	2023/8/31	
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	7,521	825,504	2025/8/31	
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,120	6,502	713,766	2023/11/15	
T 2.75% 11/15/42	2.75	2,820	3,088	338,976	2042/11/15	
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	3,349	367,617	2047/11/15	
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,366	479,308	2025/4/30	
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	8,060	884,698	2028/5/15	
T 2.875% 05/15/43	2.875	4,150	4,637	509,061	2043/5/15	
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	6,287	690,076	2049/5/15	
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	4,173	458,116	2025/5/31	
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,975	655,894	2025/7/31	
T 2.875% 08/15/28	2.875	8,920	9,910	1,087,826	2028/8/15	
T 2.875% 08/15/45	2.875	4,300	4,814	528,419	2045/8/15	
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	5,047	554,067	2023/9/30	
T 2.875% 10/31/23	2.875	2,500	2,661	292,171	2023/10/31	
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,288	470,656	2023/11/30	
T 2.875% 11/30/25	2.875	7,500	8,234	903,783	2025/11/30	
T 3% 02/15/47	3.0	2,800	3,216	352,995	2047/2/15	
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	5,119	561,925	2048/2/15	
T 3% 02/15/49	3.0	7,000	8,080	886,929	2049/2/15	
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	1,846	202,621	2042/5/15	
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,999	438,962	2045/5/15	
T 3% 05/15/47	3.0	5,710	6,561	720,200	2047/5/15	
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	6,278	689,135	2048/8/15	
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,626	507,847	2025/9/30	
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,512	605,052	2025/10/31	
T 3% 11/15/44	3.0	4,050	4,624	507,595	2044/11/15	
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	1,220	133,957	2042/2/15	
T 3.125% 02/15/43	3.125	3,500	4,067	446,465	2043/2/15	
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	6,981	766,305	2048/5/15	
T 3.125% 08/15/44	3.125	4,140	4,825	529,631	2044/8/15	
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	9,486	1,041,265	2028/11/15	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	2,031	222,947	2041/11/15	
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	3,645	400,169	2044/5/15	
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	6,534	717,252	2048/11/15	
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	940	103,187	2039/2/15	
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	3,015	331,008	2044/2/15	
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,506	275,154	2043/8/15	
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,532	277,950	2041/8/15	
T 3.75% 11/15/43	3.75	5,400	5,749	631,059	2043/11/15	
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,859	204,075	2040/8/15	
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,202	132,023	2039/5/15	
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	3,162	347,085	2040/11/15	
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,346	147,781	2038/2/15	
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,591	284,483	2040/5/15	
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,671	293,257	2041/5/15	
T 4.375% 11/15/39	4.375	1,260	1,712	187,922	2039/11/15	
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,590	2,138	234,713	2036/2/15	
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	751	82,468	2038/5/15	
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,341	257,015	2039/8/15	
T 4.625% 02/15/40	4.625	2,380	3,336	366,230	2040/2/15	
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	1,073	117,807	2041/2/15	
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,570	172,416	2037/5/15	
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,668	183,142	2028/11/15	
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,632	288,909	2031/2/15	
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,553	170,556	2028/8/15	
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,116	232,307	2026/2/15	
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,905	209,172	2027/11/15	
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,476	162,058	2030/5/15	
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,871	205,432	2023/8/15	
小計				132,115,094		
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル			
CAN 0.25% 02/01/23	0.25	3,060	3,059	277,806	2023/2/1	
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,211	200,789	2026/3/1	
CAN 0.25% 04/01/24	0.25	700	694	63,111	2024/4/1	
CAN 0.25% 05/01/23	0.25	2,600	2,596	235,803	2023/5/1	
CAN 0.25% 08/01/22	0.25	910	910	82,680	2022/8/1	
CAN 0.25% 11/01/22	0.25	1,770	1,770	160,744	2022/11/1	
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	3,990	3,941	357,929	2025/9/1	
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,420	2,212	200,893	2030/12/1	
CAN 1% 06/01/27	1.0	1,730	1,724	156,640	2027/6/1	
CAN 1% 09/01/22	1.0	2,500	2,524	229,236	2022/9/1	
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	2,400	2,451	222,651	2025/3/1	
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	5,620	5,543	503,380	2030/6/1	
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,095	99,462	2023/6/1	
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,398	127,036	2026/6/1	
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	600	618	56,137	2024/9/1	
CAN 1.75% 03/01/23	1.75	3,620	3,712	337,128	2023/3/1	
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,383	125,594	2028/6/1	
CAN 2% 09/01/23	2.0	4,310	4,467	405,692	2023/9/1	
CAN 2% 12/01/51	2.0	4,080	4,060	368,711	2051/12/1	
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,413	219,145	2024/3/1	
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,910	173,468	2025/6/1	
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,260	1,352	122,857	2029/6/1	
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,300	1,377	125,098	2024/6/1	
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	3,670	3,764	341,871	2022/6/1	
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,880	2,174	197,487	2048/12/1	
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	560	667	60,581	2064/12/1	
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,480	1,916	174,402	2045/12/1	
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,417	128,731	2041/6/1	
CAN 5% 06/01/37	5.0	820	1,189	108,057	2037/6/1	
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,565	142,145	2029/6/1	
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,410	2,039	185,162	2033/6/1	
小計				6,190,083		

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)	
(メキシコ)					
国債証券					
MBOXO 10% 11/20/36	10.0	8,550	10,842	59,728	2036/11/20
MBOXO 10% 12/05/24	10.0	29,660	33,631	185,265	2024/12/5
MBOXO 5.75% 03/05/26	5.75	45,980	45,304	249,566	2026/3/5
MBOXO 6.5% 06/09/22	6.5	33,080	33,671	185,486	2022/6/9
MBOXO 6.75% 03/09/23	6.75	33,850	34,890	192,201	2023/3/9
MBOXO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	41,258	227,281	2027/6/3
MBOXO 7.75% 05/29/31	7.75	24,180	26,059	143,554	2031/5/29
MBOXO 7.75% 11/13/42	7.75	24,190	24,838	136,828	2042/11/13
MBOXO 7.75% 11/23/34	7.75	14,100	15,123	83,309	2034/11/23
MBOXO 8% 09/05/24	8.0	34,470	36,777	202,593	2024/9/5
MBOXO 8% 11/07/47	8.0	23,430	24,542	135,199	2047/11/7
MBOXO 8% 12/07/23	8.0	34,870	37,086	204,299	2023/12/7
MBOXO 8.5% 05/31/29	8.5	37,670	42,350	233,296	2029/5/31
MBOXO 8.5% 11/18/38	8.5	26,220	29,125	160,441	2038/11/18
小計				2,399,051	
(ドイツ)					
国債証券					
BKO 0% 06/10/22	—	900	906	121,182	2022/6/10
BKO 0% 12/15/22	—	4,950	5,001	668,931	2022/12/15
DBR 0% 02/15/30	—	3,570	3,657	489,178	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	800	814	108,919	2031/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,820	2,796	373,941	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	620	608	81,405	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,478	598,971	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,592	480,503	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	5,380	5,496	735,084	2030/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	670	687	92,006	2030/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	2,720	2,432	325,300	2050/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,160	2,223	297,411	2027/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	4,064	543,628	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,890	4,078	545,407	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,180	2,285	305,626	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,000	3,130	418,737	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	3,158	422,360	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	2,390	2,544	340,347	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	5,690	6,045	808,481	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,109	282,073	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,720	2,909	389,138	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	4,419	591,122	2048/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,960	3,071	410,842	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,150	421,363	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,439	326,306	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	2,800	2,877	384,878	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,760	235,460	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,090	2,145	286,957	2022/7/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	3,032	405,564	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,540	5,344	714,780	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,800	5,842	781,375	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,580	4,217	564,086	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,731	632,815	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,720	4,742	634,325	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,510	469,512	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	3,390	5,548	742,081	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,830	5,301	709,040	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	4,441	594,059	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,332	445,664	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,819	510,881	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,972	263,785	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,407	188,286	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	4,250	4,333	579,518	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26	—	4,070	4,184	559,666	2026/4/10

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)	
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,843	514,083	2025/4/11
OBL 0% 04/14/23	—	2,220	2,249	300,789	2023/4/14
OBL 0% 10/07/22	—	4,160	4,198	561,493	2022/10/7
OBL 0% 10/10/25	—	4,340	4,458	596,271	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,535	205,358	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	3,490	3,569	477,361	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	1,005	134,480	2024/1/15
BTPS 0% 04/15/24	—	500	502	67,184	2024/4/15
BTPS 0.05% 01/15/23	0.05	2,030	2,043	273,322	2023/1/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,654	221,220	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	1,850	1,873	250,576	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	588	78,734	2025/2/1
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	3,710	3,776	505,032	2026/2/1
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,131	151,260	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	1,850	1,794	239,984	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	2,170	2,217	296,626	2023/10/15
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,320	310,357	2027/1/15
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,500	2,508	335,530	2031/4/1
BTPS 0.9% 08/01/22	0.9	3,180	3,228	431,825	2022/8/1
BTPS 0.95% 03/01/23	0.95	2,000	2,045	273,498	2023/3/1
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	961	128,539	2037/3/1
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	2,580	2,638	352,926	2023/3/15
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	2,261	302,445	2030/8/1
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,462	329,311	2027/9/15
BTPS 1% 07/15/22	1.0	2,160	2,194	293,538	2022/7/15
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	2,056	275,053	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	2,030	272,864	2030/4/1
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,450	1,481	198,086	2036/3/1
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,432	325,366	2025/5/15
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,990	2,037	272,463	2022/9/15
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,528	338,125	2024/11/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,558	341,748	2025/6/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	3,030	405,352	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	3,220	430,712	2032/3/1
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,729	364,997	2030/12/1
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,120	1,076	143,914	2051/9/1
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	3,200	3,387	453,072	2024/7/1
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	1,810	1,871	250,282	2041/3/1
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,000	2,120	283,531	2024/5/15
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,901	387,988	2025/7/1
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,690	2,963	396,344	2028/2/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,271	303,725	2025/12/1
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	3,020	403,920	2027/8/1
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,511	469,579	2026/7/15
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	710	95,082	2072/3/1
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,532	338,639	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	2,077	277,904	2036/9/1
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	3,045	407,341	2033/9/1
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,470	1,665	222,804	2050/9/1
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	910	968	129,600	2023/10/1
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,268	437,146	2025/11/15
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,216	430,210	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,510	2,979	398,424	2043/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,320	1,558	208,467	2067/3/1
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	1,890	2,200	294,255	2028/12/1
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,519	336,981	2038/9/1
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,987	533,290	2029/8/1
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,780	238,169	2040/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	2,536	339,270	2046/9/1
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	2,220	2,814	376,362	2035/3/1
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,856	381,975	2048/3/1

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,890	654,010	2030/3/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,421	323,900	2024/9/1
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	2,160	3,119	417,154	2049/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,550	4,861	650,188	2037/2/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	3,105	415,317	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,511	335,920	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,912	523,254	2023/5/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	4,950	5,495	734,973	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	3,630	4,714	630,536	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	3,050	4,836	646,899	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,660	4,354	582,314	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,970	4,354	582,306	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	3,190	5,021	671,597	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,300	5,151	688,956	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,895	654,738	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	1,400	1,503	201,052	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	3,450	3,736	499,782	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,080	4,671	624,803	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	3,940	5,868	784,833	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,600	4,987	666,991	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,929	258,033	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	979	130,977	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
FRTR 0% 02/25/23	—	2,050	2,073	277,303	2023/2/25
FRTR 0% 02/25/24	—	3,500	3,556	475,673	2024/2/25
FRTR 0% 02/25/26	—	5,210	5,314	710,721	2026/2/25
FRTR 0% 02/25/27	—	950	966	129,201	2027/2/25
FRTR 0% 03/25/23	—	5,290	5,353	716,009	2023/3/25
FRTR 0% 03/25/24	—	5,950	6,051	809,280	2024/3/25
FRTR 0% 03/25/25	—	8,090	8,250	1,103,368	2025/3/25
FRTR 0% 05/25/22	—	2,800	2,817	376,868	2022/5/25
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	5,270	704,837	2029/11/25
FRTR 0% 11/25/30	—	6,040	5,995	801,884	2030/11/25
FRTR 0% 11/25/31	—	670	658	88,009	2031/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,836	646,895	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,590	5,816	777,959	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	5,090	5,324	712,077	2026/5/25
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,350	5,598	748,751	2029/5/25
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	2,150	2,089	279,501	2040/5/25
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	751	100,467	2072/5/25
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	910	861	115,232	2044/6/25
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	6,870	7,327	979,930	2028/5/25
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	3,580	3,370	450,799	2052/5/25
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	4,500	4,801	642,176	2028/11/25
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	5,015	670,746	2027/5/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,280	5,630	753,077	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	5,110	5,698	762,133	2034/5/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	4,830	5,380	719,623	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	5,890	6,707	897,033	2031/5/25
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	4,090	4,694	627,870	2050/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,380	5,638	754,036	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,630	2,022	270,533	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,820	4,604	615,863	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,497	601,540	2024/11/25
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,560	4,535	606,541	2048/5/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,452	595,430	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	5,740	5,976	799,264	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	6,380	7,813	1,045,006	2030/5/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,970	7,139	954,847	2027/10/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,350	5,178	692,572	2045/5/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	6,350	7,588	1,014,886	2026/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,400	4,495	601,165	2055/4/25

当		期			末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	2,180	4,263	570,141	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	5,322	711,880	2038/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,020	5,615	751,066	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,720	8,145	1,089,409	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,680	5,885	787,151	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	7,481	1,000,638	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	7,076	946,344	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,449	327,659	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,175	157,220	2023/4/25
(オランダ)					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/24	—	1,850	1,883	251,961	2024/1/15
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,885	252,181	2027/1/15
NETHER 0% 01/15/38	—	700	669	89,485	2038/1/15
NETHER 0% 01/15/52	—	980	850	113,743	2052/1/15
NETHER 0% 07/15/30	—	1,920	1,942	259,808	2030/7/15
NETHER 0% 07/15/31	—	830	833	111,438	2031/7/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,310	2,390	319,653	2025/7/15
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,710	1,775	237,470	2029/7/15
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,290	1,341	179,347	2040/1/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,320	2,441	326,463	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	2,110	2,263	302,686	2027/7/15
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,620	1,745	233,406	2028/7/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,940	2,042	273,118	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,157	288,559	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	1,220	1,260	168,552	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,020	2,605	348,507	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,100	3,321	444,184	2047/1/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	2,330	2,500	334,427	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,060	3,492	467,262	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,180	3,474	464,622	2037/1/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,730	2,413	322,805	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	226	30,357	2023/1/15
(スペイン)					
国債証券					
SPGB 0% 01/31/25	—	2,350	2,380	318,311	2025/1/31
SPGB 0% 01/31/26	—	1,410	1,424	190,559	2026/1/31
SPGB 0% 01/31/28	—	780	777	103,929	2028/1/31
SPGB 0% 04/30/23	—	2,380	2,403	321,417	2023/4/30
SPGB 0% 05/31/24	—	1,260	1,275	170,563	2024/5/31
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	1,850	1,783	238,551	2031/4/30
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,338	312,739	2024/7/30
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	3,590	3,656	489,032	2023/7/30
SPGB 0.4% 04/30/22	0.4	2,390	2,411	322,483	2022/4/30
SPGB 0.45% 10/31/22	0.45	3,060	3,104	415,190	2022/10/31
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	2,900	2,942	393,558	2030/4/30
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	3,400	3,493	467,266	2029/10/31
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,000	2,102	281,142	2027/7/30
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	960	937	125,391	2037/7/30
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,160	1,929	258,003	2050/10/31
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	1,810	1,819	243,391	2040/10/31
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	3,289	439,997	2030/10/31
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	3,450	3,723	497,973	2026/10/31
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	2,120	2,314	309,500	2028/4/30
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,300	3,647	482,417	2028/7/30
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,952	394,894	2029/4/30
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	3,040	3,322	444,409	2027/10/31
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	560	488	65,282	2071/10/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	2,650	2,899	387,814	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,284	439,226	2025/4/30
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,750	3,123	417,689	2035/7/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	3,110	416,062	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,940	3,363	449,811	2030/7/30

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	3,115	416,629	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,920	390,536	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	2,404	321,572	2048/10/31	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,600	3,991	533,808	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,250	3,011	402,753	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,940	2,963	396,375	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,832	378,879	2024/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,751	501,696	2037/1/31	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	3,010	402,611	2023/10/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,433	459,139	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,640	4,332	579,460	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,739	366,326	2024/1/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,550	4,242	567,427	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	4,290	5,882	786,707	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	2,100	3,766	503,784	2044/10/31	
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	2,100	2,309	308,888	2023/1/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	3,220	5,038	673,809	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	3,480	4,581	612,723	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,518	203,058	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0% 10/22/27	—	430	438	58,583	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	630	620	83,024	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,383	185,032	2030/6/22	
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	980	1,000	133,779	2023/10/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	710	676	90,534	2040/6/22	
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,680	224,805	2024/10/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	521	69,736	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,420	2,553	341,506	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,807	241,679	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	2,090	2,242	299,890	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	2,360	2,552	341,381	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,447	327,360	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,980	2,162	289,212	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,683	225,086	2033/4/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	720	823	110,187	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,380	1,612	215,648	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,000	1,195	159,914	2050/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,280	171,217	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	870	1,199	160,416	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,850	1,962	262,420	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	1,059	141,763	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,353	314,755	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,384	185,217	2034/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,975	264,163	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,530	204,705	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,400	4,003	535,381	2041/3/28	
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,100	2,238	299,359	2022/9/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,417	189,617	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,690	4,384	586,442	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,890	520,382	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,130	1,135	151,850	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	590	587	78,591	2031/2/20	
RAGB 0% 04/20/25	—	930	949	126,981	2025/4/20	
RAGB 0% 07/15/23	—	1,500	1,520	203,376	2023/7/15	
RAGB 0% 07/15/24	—	1,350	1,374	183,883	2024/7/15	
RAGB 0% 09/20/22	—	320	322	43,159	2022/9/20	
RAGB 0% 10/20/40	—	420	380	50,942	2040/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,860	248,816	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	890	936	125,203	2027/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,620	1,731	231,575	2028/2/20	

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	790	803	107,460	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,212	295,846	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	350	310	41,561	2120/6/30	
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,430	1,538	205,777	2025/10/20	
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	930	1,126	150,635	2047/2/20	
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	330	422	56,445	2086/11/2	
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,066	142,633	2024/10/21	
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,466	188,100	2023/10/20	
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	780	1,253	167,653	2117/9/20	
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,260	1,614	215,887	2034/5/23	
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,306	174,685	2044/6/20	
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	2,360	2,502	334,636	2022/11/22	
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	470	964	129,007	2062/1/26	
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,898	387,603	2037/3/15	
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,310	1,649	220,619	2026/3/15	
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,663	222,462	2027/7/15	
(フィンランド)						
国債証券						
RFGB 0% 09/15/23	—	540	548	73,322	2023/9/15	
RFGB 0% 09/15/24	—	420	428	57,312	2024/9/15	
RFGB 0% 09/15/30	—	630	631	84,467	2030/9/15	
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	540	523	70,066	2036/4/15	
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	490	419	56,139	2052/4/15	
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	400	383	51,342	2040/9/15	
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	650	86,966	2026/4/15	
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	916	122,595	2027/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	1,030	1,085	145,143	2028/9/15	
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	799	106,942	2029/9/15	
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	500	536	71,744	2031/4/15	
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	732	97,957	2025/9/15	
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	710	792	105,932	2034/4/15	
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	588	78,678	2047/4/15	
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	650	676	90,496	2023/4/15	
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	930	957	128,061	2022/9/15	
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	786	105,156	2024/4/15	
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	590	848	113,431	2042/7/4	
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	420	511	68,367	2028/7/4	
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	987	132,066	2025/7/4	
(アイルランド)						
国債証券						
IRISH 0% 10/18/22	—	530	534	71,481	2022/10/18	
IRISH 0% 10/18/31	—	580	567	75,959	2031/10/18	
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	956	127,916	2027/5/15	
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,030	1,039	138,982	2030/10/18	
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	760	757	101,322	2035/5/15	
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	490	476	63,770	2041/4/22	
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	1,070	1,149	153,682	2028/5/15	
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,420	1,518	203,075	2026/5/15	
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,309	175,074	2029/5/15	
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	749	100,226	2033/5/15	
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	860	964	128,933	2031/3/18	
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	730	839	112,310	2050/5/15	
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	970	129,751	2037/5/15	
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,090	1,386	185,484	2045/2/18	
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,466	196,145	2030/5/15	
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,077	144,160	2024/3/18	
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	1,010	1,092	146,111	2023/3/20	
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,510	1,849	247,322	2025/3/13	
ユ ー ロ 計						
				122,014,046		
(イギリス)						
国債証券						
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	3,000	2,970	462,220	2026/1/30	
UKT 0.125% 01/31/23	0.125	4,510	4,515	702,577	2023/1/31	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	2,970	2,967	461,817	2024/1/31	
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,195	341,549	2028/1/31	
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	2,110	1,974	307,241	2031/7/31	
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,321	361,162	2030/10/22	
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	3,150	3,166	492,781	2022/7/22	
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	1,038	161,561	2061/10/22	
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,727	268,773	2025/6/7	
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,950	2,748	427,705	2035/7/31	
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	2,550	2,130	331,434	2050/10/22	
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,910	2,953	459,524	2023/7/22	
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,260	1,142	177,697	2046/1/31	
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,720	267,720	2029/10/22	
UKT 1% 04/22/24	1.0	1,600	1,640	255,191	2024/4/22	
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	2,990	3,130	487,068	2027/7/22	
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	180	177	27,587	2051/7/31	
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,785	433,366	2041/10/22	
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,000	2,115	329,106	2026/7/22	
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,550	2,661	414,202	2047/7/22	
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	2,200	2,364	367,874	2028/10/22	
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	2,031	316,134	2054/10/22	
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	900	1,074	167,157	2071/10/22	
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,436	223,559	2049/1/22	
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,530	2,897	450,844	2057/7/22	
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	3,120	3,187	495,992	2022/9/7	
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,930	3,172	493,679	2037/9/7	
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,912	297,635	2025/9/7	
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,623	408,228	2023/9/7	
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,920	2,776	432,007	2065/7/22	
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,620	1,756	273,304	2024/9/7	
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,810	3,894	606,057	2044/1/22	
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,550	3,700	575,807	2045/1/22	
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	3,552	552,815	2068/7/22	
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,613	406,688	2052/7/22	
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,858	444,727	2060/1/22	
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,390	3,415	531,381	2036/3/7	
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,831	440,554	2032/6/7	
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,820	2,729	424,711	2039/9/7	
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,699	264,371	2027/12/7	
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,070	3,153	490,755	2040/12/7	
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,180	3,576	556,579	2046/12/7	
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,577	400,982	2049/12/7	
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	2,210	4,062	632,092	2055/12/7	
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,770	2,528	393,434	2034/9/7	
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,340	3,767	586,171	2042/12/7	
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,780	2,424	377,316	2030/12/7	
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,586	402,491	2038/12/7	
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,800	2,124	330,581	2025/3/7	
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,742	271,140	2028/12/7	
小計				19,785,369		
(スウェーデン)		千スウェーデン	千スウェーデン			
国債証券						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	5,270	5,113	67,495	2031/5/12	
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	8,380	8,718	115,081	2028/5/12	
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,430	7,709	101,760	2029/11/12	
SGB 1% 11/12/26	1.0	9,010	9,498	125,378	2026/11/12	
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	13,050	172,268	2023/11/13	
SGB 2.25% 06/01/32	2.25	3,750	4,455	58,814	2032/6/1	
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	10,050	11,109	146,645	2025/5/12	
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,860	8,492	112,094	2039/3/30	
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	14,000	14,540	191,933	2022/6/1	
小計				1,091,472		
(ノルウェー)		千ノルウェー	千ノルウェー			
国債証券						
NOB 1.25% 09/17/31	1.25	3,000	2,928	38,419	2031/9/17	
NOB 1.375% 08/19/30	1.375	4,340	4,313	56,591	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)		
NOB 1.5% 02/19/26	1.5	5,740	5,853	76,799	2026/2/19	
NOB 1.75% 02/17/27	1.75	5,360	5,526	72,506	2027/2/17	
NOB 1.75% 03/13/25	1.75	4,770	4,915	64,488	2025/3/13	
NOB 1.75% 09/06/29	1.75	7,640	7,853	103,041	2029/9/6	
NOB 2% 04/26/28	2.0	6,100	6,386	83,788	2028/4/26	
NOB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,587	152,031	2023/5/24	
NOB 3% 03/14/24	3.0	7,360	7,818	102,583	2024/3/14	
小計				750,250		
(デンマーク)		千デンマーク	千デンマーク			
国債証券						
DGB 0% 11/15/31	—	3,110	3,069	55,191	2031/11/15	
DGB 0.25% 11/15/22	0.25	8,020	8,114	145,898	2022/11/15	
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	3,340	3,022	54,337	2052/11/15	
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	10,420	10,917	196,295	2027/11/15	
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	14,260	14,915	268,176	2029/11/15	
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,420	7,796	140,174	2023/11/15	
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	8,330	9,145	164,337	2025/11/15	
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	16,260	28,345	509,656	2039/11/15	
小計				1,534,167		
(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% 04/25/23	—	1,230	1,223	36,522	2023/4/25	
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	1,500	1,415	42,245	2026/10/25	
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,541	105,666	2025/4/25	
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	2,160	2,045	61,042	2030/10/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	4,137	123,465	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	5,860	6,068	181,074	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	6,050	6,387	190,609	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,060	6,430	191,881	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	4,015	119,812	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	6,030	6,520	194,566	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,520	7,034	209,909	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	6,260	6,828	203,773	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,430	3,724	111,148	2023/10/25	
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	783	23,376	2029/4/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	3,410	3,660	109,221	2022/9/23	
小計				1,904,317		
(オーストラリア)		千オーストラリア	千オーストラリア			
国債証券		ドル	ドル			
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	2,930	2,926	247,556	2024/11/21	
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,303	194,871	2025/11/21	
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	3,640	3,580	302,855	2026/9/21	
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,750	3,508	296,739	2031/11/21	
ACGB 1% 12/21/30	1.0	4,320	4,101	346,937	2030/12/21	
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,613	221,016	2032/5/21	
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	3,155	266,917	2031/6/21	
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	2,090	1,722	145,654	2051/6/21	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	1,610	1,607	135,992	2032/11/21	
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,560	2,751	232,753	2028/5/21	
ACGB 2.25% 11/21/22	2.25	3,160	3,263	275,993	2022/11/21	
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,790	4,120	348,504	2030/5/21	
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,486	125,746	2024/4/21	
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,728	146,175	2041/5/21	
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,230	1,346	113,917	2035/6/21	
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	3,330	3,688	311,931	2027/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,842	155,821	2028/11/21	
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	3,150	3,493	295,451	2029/11/21	
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,830	154,836	2047/3/21	
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	3,480	3,857	326,559	2025/4/21	
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	4,100	4,704	397,906	2029/4/21	
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	980	1,123	95,022	2039/6/21	
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,979	167,398	2037/4/21	
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	2,820	3,303	279,416	2026/4/21	
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,910	2,474	209,322	2033/4/21	
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,831	239,495	2027/4/21	

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 5.5% 04/21/23	5.5	2,500	2,756	233,170	2023/4/21
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	3,350	3,565	301,584	2022/7/15
小計				6,569,251	
(シンガポール)		シンガポールドル	シンガポールドル		
国債証券					
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	390	386	32,043	2025/11/1
SIGB 1.75% 02/01/23	1.75	800	818	67,881	2023/2/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	420	422	35,041	2050/3/1
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	426	35,394	2024/2/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	740	785	65,140	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	730	773	64,117	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	490	524	43,446	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	430	466	38,649	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	1,050	1,145	94,954	2028/5/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	1,240	1,460	121,102	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	900	1,040	86,240	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	1,070	1,122	93,074	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	590	657	54,517	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	760	850	70,552	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,220	1,317	109,240	2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	1,350	1,397	115,882	2022/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	981	81,388	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	998	82,790	2027/3/1
小計				1,291,459	
(マレーシア)		マレーシアリンギット	マレーシアリンギット		
国債証券					
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	1,500	1,528	40,469	2022/8/15
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	700	724	19,177	2024/6/14
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	2,330	2,392	63,353	2023/3/15
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,563	41,399	2027/5/31
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	3,430	3,594	95,198	2028/6/15
MGS 3.757% 04/20/23	3.757	1,090	1,125	29,820	2023/4/20
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	550	524	13,882	2040/5/22
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	1,500	1,537	40,726	2022/9/30
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	930	964	25,551	2023/8/17
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	2,350	2,364	62,624	2033/4/15
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,082	28,658	2025/3/14
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,500	1,580	41,866	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,193	31,619	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	2,092	55,408	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	1,440	1,533	40,619	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	633	16,791	2026/7/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	2,380	2,513	66,570	2025/9/15
MGS 4.059% 09/30/24	4.059	1,900	2,003	53,054	2024/9/30
MGS 4.065% 06/15/50	4.065	760	721	19,097	2050/6/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	1,280	1,351	35,781	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	2,000	2,145	56,812	2031/6/30
MGS 4.254% 05/31/35	4.254	2,030	2,105	55,773	2035/5/31
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	2,910	3,141	83,211	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	2,380	2,603	68,964	2030/4/15
MGS 4.642% 11/07/33	4.642	2,830	3,065	81,188	2033/11/7
MGS 4.736% 03/15/46	4.736	1,480	1,562	41,388	2046/3/15
MGS 4.762% 04/07/37	4.762	2,280	2,458	65,120	2037/4/7
MGS 4.893% 06/08/38	4.893	2,310	2,508	66,436	2038/6/8
MGS 4.921% 07/06/48	4.921	1,400	1,507	39,919	2048/7/6
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,560	1,693	44,856	2043/9/30
小計				1,425,343	
(イスラエル)		イスラエルシェケル	イスラエルシェケル		
国債証券					
ILGOV 0.15% 07/31/23	0.15	700	699	23,629	2023/7/31
ILGOV 0.5% 04/30/25	0.5	2,420	2,426	81,980	2025/4/30

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)	
ILGOV 0.75% 07/31/22	0.75	6,750	6,803	229,891	2022/7/31
ILGOV 1% 03/31/30	1.0	2,220	2,186	73,885	2030/3/31
ILGOV 1.5% 05/31/37	1.5	2,190	2,077	70,202	2037/5/31
ILGOV 1.5% 11/30/23	1.5	1,750	1,807	61,089	2023/11/30
ILGOV 1.75% 08/31/25	1.75	1,080	1,145	38,693	2025/8/31
ILGOV 2.25% 09/28/28	2.25	2,880	3,144	106,243	2028/9/28
ILGOV 3.75% 03/31/24	3.75	4,080	4,480	151,396	2024/3/31
ILGOV 3.75% 03/31/47	3.75	3,130	3,983	134,621	2047/3/31
ILGOV 5.5% 01/31/42	5.5	2,580	4,095	138,374	2042/1/31
ILGOV 6.25% 10/30/26	6.25	5,620	7,292	246,435	2026/10/30
小計				1,356,443	
合計				298,426,352	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別		当期末	
		買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
外	EURO-SCHATZ	299	—
	US 5YR NOTE	543	—
	EURO-BOBL FU	468	—
	EURO-BUND	1,181	—
	US 10YR NOTE	405	—
国	US LONG BOND	481	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 298,426,352	% 96.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,553,071	3.1
投 資 信 託 財 産 総 額	307,979,423	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(299,804,535千円)の投資信託財産総額(307,979,423千円)に対する比率は97.3%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=109.76円

1ユーロ=133.74円

1ノルウェークローネ=13.12円

1オーストラリアドル=84.58円

1イスラエルシェケル=33.7909円

1カナダドル=90.81円

1イギリスポンド=155.60円

1デンマーククローネ=17.98円

1シンガポールドル=82.91円

1メキシコペソ=5.5087円

1スウェーデンクローナ=13.20円

1ポーランドズロチ=29.8401円

1マレーシアリンギット=26.4846円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年5月31日現在
(A)資 産	312,618,086,199円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,072,407,298
公 社 債(評価額)	298,426,352,392
未 収 入 金	6,999,392,733
未 収 利 息	1,649,307,557
前 払 費 用	43,884,777
差 入 委 託 証 拠 金	426,741,442
(B)負 債	8,362,493,178
未 払 金	8,334,333,255
未 払 解 約 金	28,151,963
未 払 利 息	7,960
(C)純 資 産 総 額(A-B)	304,255,593,021
元 本	99,051,563,319
次 期 繰 越 損 益 金	205,204,029,702
(D)受 益 権 総 口 数	99,051,563,319口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,717円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A)配 当 等 収 益	5,713,635,462円
受 取 利 息	5,715,827,826
支 払 利 息	△2,192,364
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	10,891,260,404
売 買 益	24,337,060,926
売 買 損	△13,445,800,522
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△69,652,431
取 引 益	116,270,477
取 引 損	△185,922,908
(D)そ の 他 費 用	△65,457,017
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	16,469,786,418
(F)前 期 繰 越 損 益 金	180,994,431,935
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	33,935,793,069
(H)解 約 差 損 益 金	△26,195,981,720
(I)計 (E+F+G+H)	205,204,029,702
次 期 繰 越 損 益 金(I)	205,204,029,702

(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95,174,617,742円、期中追加設定元本額は17,074,979,800円、期中一部解約元本額は13,198,034,223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)	20,979,445,503円
DC世界経済インデックスファンド	11,110,673,327円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	10,520,507,421円
世界経済インデックスファンド	9,273,410,629円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	7,206,279,137円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	3,609,406,493円
分散投資コア戦略ファンドS	2,414,637,030円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,337,888,027円
DC外国債券インデックス・オープン	2,138,424,220円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,058,100,464円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,926,802,599円
DCマイセレクション25	1,894,927,066円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,610,092,405円
DCマイセレクション50	1,595,744,544円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,439,704,781円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	1,416,182,704円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	1,204,191,321円
分散投資コア戦略ファンドA	1,164,439,715円
DCマイセレクション75	1,080,738,576円
コア投資戦略ファンド(安定型)	879,380,958円
コア投資戦略ファンド(切替型)	865,632,366円
DCマイセレクションS25	861,221,177円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	803,666,732円
グローバル経済コア	768,433,368円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	765,529,114円
DCマイセレクションS50	683,537,640円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	667,628,956円
外国債券ファンド・シリーズ1	628,582,390円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	613,865,226円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	504,898,724円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	503,626,441円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	483,597,824円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	443,659,637円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	424,303,980円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	420,469,762円
DCマイセレクションS75	358,771,668円
外国債券インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	343,393,793円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	337,359,693円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	293,965,946円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	245,707,323円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	233,178,587円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	224,203,433円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	190,814,607円
SMT インデックスバランス・オープン	189,240,480円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	187,453,352円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	186,896,260円
SMT 世界経済インデックス・オープン	175,139,323円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	106,862,002円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	100,449,368円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	95,223,196円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	89,122,379円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	81,147,485円

バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	71, 223, 680円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	61, 809, 375円
DCターゲット・イヤールファンド2045	41, 051, 209円
DCターゲット・イヤールファンド2025	38, 009, 124円
外国債券インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	32, 074, 390円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	27, 480, 170円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	11, 843, 552円
SBI資産設計オープン(分配型)	7, 391, 523円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型) 2030	4, 316, 242円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA専用)	3, 970, 959円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型) 2040	3, 363, 735円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3, 260, 367円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	2, 388, 520円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型) 2050	1, 589, 596円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	1, 529, 048円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型) 2060	1, 178, 678円
DCターゲット・イヤールファンド2055	523, 999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12期（決算日 2020年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率				
第8期(2016年11月10日)	21,467	△8.2	18,491	△10.5	98.6	0.7	0.7	百万円 29,752
第9期(2017年11月10日)	30,310	41.2	25,570	38.3	98.5	1.0	0.5	47,713
第10期(2018年11月12日)	26,828	△11.5	22,122	△13.5	96.2	3.2	0.5	49,931
第11期(2019年11月11日)	28,752	7.2	23,119	4.5	96.3	3.0	0.6	62,222
第12期(2020年11月10日)	31,648	10.1	24,951	7.9	95.8	3.8	0.3	82,503

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	株式先物率 組入比率	投資信託 組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(当期首) 2019年11月11日	28,752	－	23,119	－	96.3	3.0	0.6
11月末	28,549	△0.7	22,889	△1.0	96.9	2.4	0.6
12月末	30,415	5.8	24,376	5.4	97.5	8.6	0.6
2020年 1月末	29,045	1.0	23,271	0.7	94.4	4.9	0.6
2月末	28,000	△2.6	22,433	△3.0	96.4	3.1	0.5
3月末	22,550	△21.6	18,010	△22.1	92.5	7.0	0.3
4月末	24,539	△14.7	19,548	△15.4	97.3	2.5	0.4
5月末	24,822	△13.7	19,790	△14.4	95.5	4.2	0.3
6月末	26,859	△6.6	21,300	△7.9	95.1	4.6	0.3
7月末	28,550	△0.7	22,512	△2.6	93.8	5.8	0.3
8月末	29,844	3.8	23,504	1.7	93.7	6.0	0.3
9月末	28,549	△0.7	22,491	△2.7	96.3	3.5	0.3
10月末	29,598	2.9	23,303	0.8	95.3	4.4	0.3
(当期末) 2020年11月10日	31,648	10.1	24,951	7.9	95.8	3.8	0.3

(注1) 騰落率は期首比です。

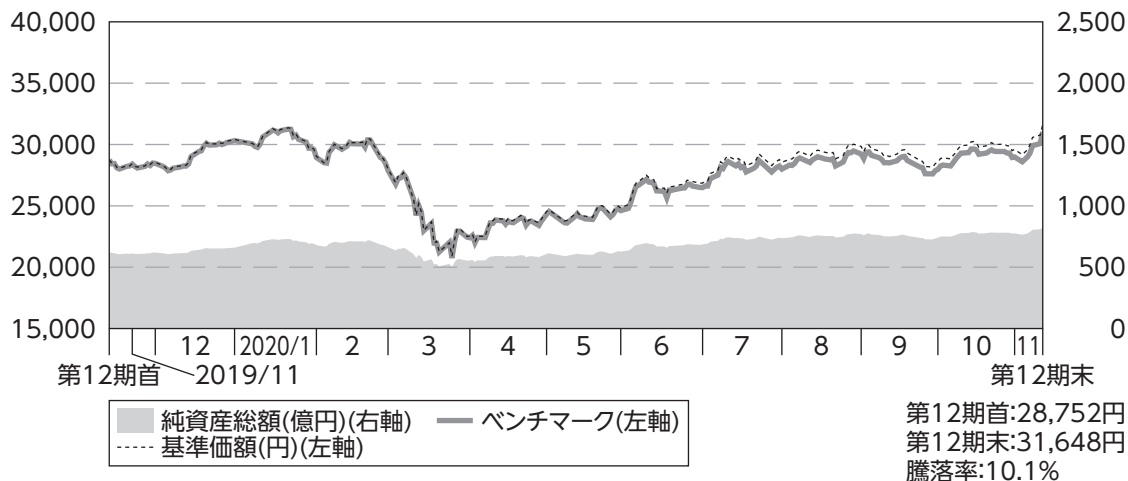
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

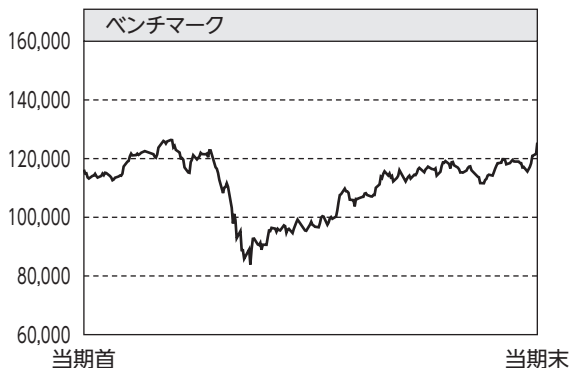


(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



新興国株式市場は上昇しました。

2020年1月中旬までは、米中両政府が通商協議の第1段階の合意に達するなど米中関係改善への期待から概ね堅調に推移しました。しかし、1月下旬から3月中旬にかけては中国湖北省武漢市で発生した新型コロナウイルスの世界的な感染急拡大を受けて景気減速懸念が強まったことを背景に大幅に下落しました。3月下旬以降は、世界的な金融緩和政策や各国の大型経済対策への期待が高まったことから急速に値を戻し、その後も中国の堅調な経済指標が好感されたことなどから上昇して期末を迎えました。

外国為替市場では、ブラジル・リアルやインド・ルピーなどの新興国通貨に対して円高が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

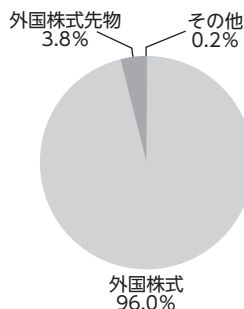
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	ケイマン諸島	7.5%
2	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	6.3%
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	5.4%
4	MSCI EMERG M 2012	ー	3.8%
5	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.5%

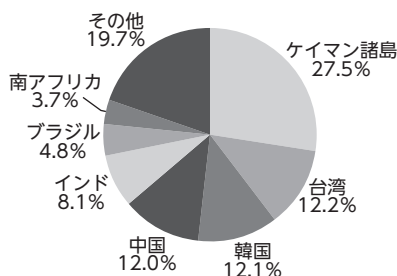
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
6	MEITUAN-CLASS B	ケイマン諸島	2.1%
7	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	1.3%
8	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.1%
9	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	1.0%
10	JD.COM INC-ADR	ケイマン諸島	1.0%
組入銘柄数			1,189

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

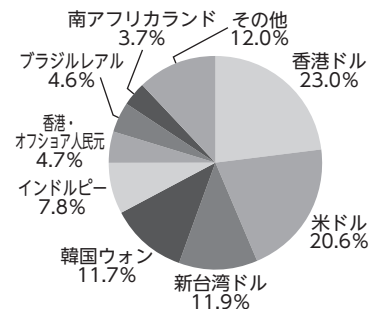
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

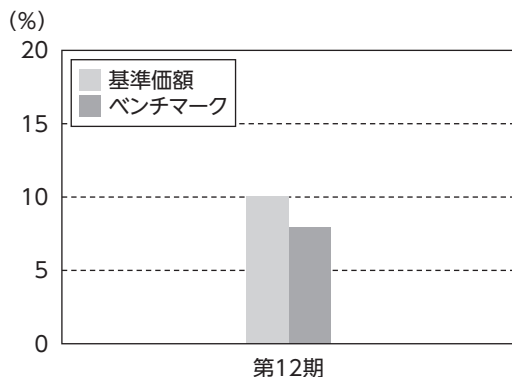


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.8%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当要因* (プラス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	9円	0.031%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(6)	(0.021)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(3)	(0.009)	
(b) 有価証券取引税	4	0.016	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(4)	(0.016)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	42	0.150	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(42)	(0.150)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	55	0.197	

(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(27,610円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 8,211 (351)	千米ドル 28,030 (-)	百株 2,091	千米ドル 2,604
	メ キ シ コ	12,274 (-)	千メキシコペソ 33,314 (△70)	6,331	千メキシコペソ 10,656
	ブ ラ ジ ル	12,296 (5,608)	千ブラジルリアル 35,749 (1,054)	2,646 (612)	千ブラジルリアル 4,168 (709)
	チ リ	19,256 (2)	千チリペソ 382,468 (-)	167,850	千チリペソ 155,222
	コ ロ ン ビ ア	160	千コロンビアペソ 293,715	3,820	千コロンビアペソ 1,069,816
	ギ リ シ ャ	122 (-)	千ユーロ 173 (△0.8716)	4,809	千ユーロ 365
	ト ル コ	3,665 (497)	千トルコリラ 2,927 (-)	1,144	千トルコリラ 1,748
	チ ェ コ	44	千チェココルナ 2,028	-	千チェココルナ -
	ハ ン ガ リ ー	147	千ハンガリーフォリント 84,931	-	千ハンガリーフォリント -
	ポ ー ラ ン ド	2,018	千ポーランドズロチ 5,422	1,233	千ポーランドズロチ 958
国	香 港	155,245 (14,601)	千香港ドル 222,530 (435)	74,325 (4,350)	千香港ドル 25,534 (0.00004)
	マ レ ー シ ア	12,132 (5,365)	千マレーシアリンギット 9,366 (41)	7,450	千マレーシアリンギット 1,545
	タ イ	49,842 (3,303)	千タイバーツ 86,675 (3,819)	4,701 (348)	千タイバーツ 9,435 (2,701)

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	フィリピン	百株 8,090 (157)	千フィリピンペソ 47,316 (34)	百株 9,681 (-)	千フィリピンペソ 11,485 (49)
	インドネシア	42,506 (4,744)	千インドネシアルピア 19,479,143 (-)	62,734	千インドネシアルピア 8,488,211
	韓 国	3,072 (136)	千韓国ウォン 14,483,013 (174,763)	2,143 (50)	千韓国ウォン 4,367,672 (77,412)
	台 湾	44,060 (5,007)	千新台幣ドル 317,767 (595)	12,193	千新台幣ドル 72,727
	イ ン ド	12,083 (906)	千インドルピー 828,271 (2,885)	10,781 (30)	千インドルピー 111,677 (480)
	カ タ ー ル	2,098	千カタールリアル 2,588	2,064	千カタールリアル 678
	南 ア フ リ カ	8,397 (2,056)	千南アフリカランド 79,971 (3,454)	5,696 (-)	千南アフリカランド 24,357 (3,454)
	アラブ首長国連邦	5,543	千アラブ首長国連邦ディルハム 4,451	1,583	千アラブ首長国連邦ディルハム 392
	サウジアラビア	5,673 (274)	千サウジアラビアリアル 23,481 (-)	-	千サウジアラビアリアル -
	中国 オ フ シ ョ ア	75,688 (2,298)	千香港・オフショア人民元 122,102 (168)	29,996	千香港・オフショア人民元 45,148

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	イ タ	証券 — (66,650)	千タイバーツ — (358)	証券 66,650	千タイバーツ 227

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	— (—)	— (△301)	—	—
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	15,100	1,720	—	—
	小 計	15,100 (—)	1,720 (△301)	—	—
	ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
	SUL AMERICA SA-UNITS	10,400	659	—	—
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	18,700	485	—	—
	KLABIN SA-UNIT	—	—	18,400	321
	小 計	29,100	1,144	18,400	321
	南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
	REDEFINE PROPERTIES LTD	—	—	547,985	1,051
	FORTRESS REIT LTD-A	—	—	189,245 (—)	2,099 (185)
	RESILIENT REIT LTD	— (2,789)	— (185)	2,425 (364)	82 (12)
	小 計	— (2,789)	— (185)	739,655 (364)	3,233 (197)

(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 23,074	百万円 22,185	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	17,990,951千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	64,551,209千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.27

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 24	百万円 24	% 100.0	百万円 24	百万円 24	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	25,766	2,194	8.5	25,806	2,207	8.6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式(上場、登録株式)>

銘柄	当	期		業	種	
	期首(前期末)	当	期			末
	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			
BBVA ARGENTINA SA-ADR	312	—	—	—	銀行	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	218	22,995	素材	
CREDICORP LTD	64	73	1,008	106,067	銀行	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	398	398	333	35,095	電気通信サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	54	113	621	65,369	素材	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	63	147	106	11,178	電気通信サービス	
TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B	73	—	—	—	エネルギー	
YPF S. A.-SPONSORED ADR	155	155	64	6,756	エネルギー	
BANCO MACRO SA-ADR	40	—	—	—	銀行	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	134	151	2,658	279,697	消費者サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	474	474	1,016	106,918	小売	
PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	56	—	—	—	公益事業	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	387	409	2,922	307,481	消費者サービス	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	20	20	59	6,249	各種金融	
BEST INC - ADR	—	141	38	4,012	運輸	
HUYA INC-ADR	—	82	172	18,158	メディア・娯楽	
NIO INC - ADR	538	963	4,240	446,155	自動車・自動車部品	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	90	390	591	62,183	メディア・娯楽	
58.COM INC-ADR	94	—	—	—	メディア・娯楽	
AUTOHOME INC-ADR	52	65	678	71,366	メディア・娯楽	
GSX TECHEDU INC- ADR	—	78	543	57,147	消費者サービス	
KE HOLDINGS INC	—	100	720	75,751	不動産	
GLOBANT SA	31	38	788	82,982	ソフトウェア・サービス	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	1,374	2,020	58,707	6,176,635	小売	
YUM CHINA HOLDINGS INC	333	380	2,184	229,786	消費者サービス	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	299	389	1,205	126,794	運輸	
TRIP.COM GROUP LTD	454	524	1,916	201,633	小売	
SINA CORP	57	57	244	25,761	メディア・娯楽	
NETEASE INC-ADR	68	439	3,860	406,124	メディア・娯楽	
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	87	—	—	—	銀行	
51JOB INC-ADR	16	27	196	20,625	商業・専門サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	267	293	4,232	445,352	メディア・娯楽	
YANDEX NV-A	—	321	2,093	220,210	メディア・娯楽	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	139	139	626	65,864	消費者サービス	
JOYY INC	61	61	616	64,870	メディア・娯楽	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	44	76	699	73,556	ソフトウェア・サービス	
ZAI LAB LTD-ADR	—	51	453	47,736	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	—	121	559	58,848	メディア・娯楽	
WEIBO CORP-SPON ADR	52	52	239	25,182	メディア・娯楽	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
JD.COM INC-ADR	719	912	7,741	814,458	小売	
MOMO INC-SPON ADR	129	155	232	24,507	メディア・娯楽	
BAOZUN INC-SPN ADR	35	35	142	14,999	小売	
PINDUODUO INC-ADR	177	289	3,076	323,630	小売	
IQIYI INC-ADR	119	212	572	60,265	メディア・娯楽	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	36	72	232	24,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,040	1,040	68	7,166	エネルギー	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	544	544	45	4,781	不動産	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	367	432	2,728	287,099	エネルギー	
GAZPROM OAO-SPON ADR	5,238	6,573	2,905	305,690	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	1,472	1,738	700	73,693	銀行	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	1,604	1,232	592	62,349	エネルギー	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	92	108	1,688	177,604	エネルギー	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	155	195	495	52,124	素材	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	664	704	1,906	200,581	素材	
ROSNEFT OJSC-GDR	1,335	1,465	762	80,248	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	387	387	557	58,619	素材	
TATNEFT-SPONSORED ADR	261	269	1,028	108,210	エネルギー	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	2,059	3,780	325	34,205	銀行	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	398	472	708	74,524	食品・生活必需品小売り	
SBERBANK-SPONSORED ADR	2,537	2,969	3,655	384,569	銀行	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	268	268	344	36,284	素材	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	71	79	830	87,357	素材	
DP WORLD PLC	211	—	—	—	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	26,398	32,869	125,957	13,251,972	
(メキシコ)		56	56	—	<16.1%>	
ALFA S. A. B. -A	3,599	3,599	5,304	27,373	資本財	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	1,791	2,156	28,641	147,789	食品・飲料・タバコ	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	109	—	—	—	小売	
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,580	2,233	7,001	36,125	メディア・娯楽	
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,324	1,818	7,484	38,621	食品・飲料・タバコ	
GRUMA S. A. B. -B	259	259	5,661	29,212	食品・飲料・タバコ	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	169	169	2,627	13,558	運輸	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	375	1,603	8,275	資本財	
CEMEX SAB-SPONS	14,556	15,451	13,458	69,445	素材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	2,476	2,892	29,778	153,659	銀行	
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	968	968	3,682	19,000	素材	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	145	145	4,551	23,487	素材	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,818	1,818	5,661	29,212	家庭用品・パーソナル用品	
ALSEA SAB DE CV	343	—	—	—	消費者サービス	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	233	233	7,126	36,773	運輸	
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,812	3,503	22,225	114,682	素材	
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	33,042	36,254	50,937	262,837	電気通信サービス	

銘柄	株数 (百株)	当	期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	2,525	2,525	4,214	21,745	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	336	504	4,666	24,078	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	5,102	5,798	30,913	159,513	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	310	436	8,963	46,252	運輸
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	314	314	2,125	10,967	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	377	575	4,177	21,555	公益事業
BECE SAB DE CV	—	481	2,261	11,667	食品・飲料・タバコ
小 計	76,570	82,513	253,068	1,305,834	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	23	22	—	<1.6%>	
(ブラジル)			千ブラジルリアル		
BRF SA	525	525	971	18,978	食品・飲料・タバコ
VALE SA	3,024	3,957	25,009	488,679	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	—	79	548	10,725	公益事業
TIM PARTICIPACOES SA	729	—	—	—	電気通信サービス
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	177	334	1,132	22,124	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	241	336	1,136	22,210	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	811	883	2,887	56,419	銀行
ITAUSA SA	4,435	5,058	5,276	103,096	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	637	957	2,418	47,262	小売
GERDAU SA-PREF	870	1,050	2,310	45,137	素材
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	—	197	1,298	25,367	食品・生活必需品小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	2,927	4,230	9,263	181,012	エネルギー
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	760	760	1,662	32,477	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,024	4,846	10,473	204,643	エネルギー
COGNA EDUCACAO	1,381	1,812	891	17,428	消費者サービス
CCR SA	1,256	1,256	1,561	30,506	運輸
WEG SA	848	928	7,627	149,042	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	3,834	4,839	11,101	216,928	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	1,163	1,466	3,041	59,422	銀行
NATURA COSMETICOS SA	414	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	630	630	1,319	25,789	素材
SUZANO SA	506	626	3,051	59,620	素材
CPFL ENERGIA SA	—	338	1,036	20,256	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4,669	5,293	14,626	285,807	銀行
PORTO SEGURO SA	73	73	373	7,303	保険
BRASKEM SA-PREF A	148	148	357	6,989	素材
ENGIE BRASIL SA	167	292	1,284	25,090	公益事業
LOCALIZA RENT A CAR	590	619	4,095	80,016	運輸
LOJAS RENNER S. A.	829	829	3,977	77,727	小売
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	1,512	29,559	エネルギー
COSAN SA	184	184	1,356	26,497	エネルギー
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	130	1,104	2,423	47,350	公益事業
EMBRAER SA	697	—	—	—	資本財
M DIAS BRANCO SA	63	—	—	—	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
B2W CIA DIGITAL	269	223	1,780	34,800	小売	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	859	—	—	—	不動産	
JBS SA	1,186	1,286	2,604	50,885	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	980	1,021	1,168	22,829	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	347	347	1,611	31,494	公益事業	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	454	454	1,113	21,752	不動産	
HYPERA SA	353	353	1,122	21,934	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	1,905	2,227	11,992	234,334	各種金融	
TELEFONICA BRASIL S.A.	484	523	2,326	45,455	電気通信サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	568	3,336	8,823	172,415	小売	
CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	148	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
CIELO SA	992	992	367	7,176	ソフトウェア・サービス	
RAIA DROGASIL SA	211	1,225	3,083	60,248	食品・生活必需品小売り	
VIA VAREJO SA	—	1,359	2,519	49,232	小売	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	690	1,836	35,890	保険	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	336	544	3,922	76,640	ヘルスケア機器・サービス	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	—	201	1,403	27,422	ヘルスケア機器・サービス	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	415	827	16,161	食品・生活必需品小売り	
AMBEV SA	4,620	5,177	7,361	143,847	食品・飲料・タバコ	
NATURA &CO HOLDING SA	—	809	3,976	77,703	家庭用品・パーソナル用品	
TIM SA	—	961	1,226	23,960	電気通信サービス	
RUMO SA	977	1,142	2,335	45,633	運輸	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	691	939	624	12,205	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	53,992	68,638	186,054	3,635,500	
	銘柄 数 <比 率>	50	51	—	<4.4%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	62,798	62,798	196,872	27,384	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	51	54	149,494	20,794	銀行	
BANCO DE CHILE	37,356	48,626	340,384	47,347	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	231,643	32,221	素材	
EMPRESAS COPEC SA	447	447	290,695	40,435	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	93	225	110,563	15,379	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	185	185	96,466	13,418	電気通信サービス	
ENEL AMERICAS SA	39,900	39,900	438,422	60,984	公益事業	
COLBUN SA	4,758	12,156	155,607	21,644	公益事業	
AGUAS ANDINAS SA-A	2,862	2,862	60,641	8,435	公益事業	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	152	152	26,012	3,618	食品・飲料・タバコ	
LATAM AIRLINES GROUP SA	325	—	—	—	運輸	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	98	105	338,319	47,060	素材	
FALABELLA SA	708	708	171,354	23,835	小売	
ITAU CORPBANCA	167,491	—	—	—	銀行	
CENCOSUD SA	1,379	1,379	163,515	22,745	食品・生活必需品小売り	
CENCOSUD SHOPPING SA	—	416	51,958	7,227	不動産	
ENEL CHILE SA	25,612	25,612	140,537	19,548	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	345,582	196,991	2,962,490	412,082	
	銘柄 数 <比 率>	17	16	—	<0.5%>	

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)	
(コロンビア)			千		
INTERCONEXION ELECTRICA SA	505	505	1,151,650	33,167	公益事業
ECOPETROL SA	4,889	4,889	947,641	27,292	エネルギー
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	125	—	—	—	各種金融
GRUPO AVAL ACCIONES-PF	3,037	—	—	—	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	320	—	—	—	素材
GRUPO ARGOS SA	177	—	—	—	素材
BANCOLOMBIA SA	293	293	786,689	22,656	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF	382	382	1,019,725	29,368	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA	208	208	449,503	12,945	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	9,939 9	6,279 5	4,355,211 —	125,430 <0.2%>
(ギリシャ)			千		
ALPHA BANK AE	1,291	—	—	—	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE	531	—	—	—	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	202	262	343	42,663	電気通信サービス
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	2,910	—	—	—	銀行
MOTOR OIL (HELLAS) SA	90	57	52	6,555	エネルギー
OPAP SA	176	176	141	17,641	消費者サービス
JUMBO SA	85	148	222	27,605	小売
TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	43	—	—	—	素材
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,332 8	645 4	760 —	94,466 <0.1%>
(イギリス)			千		
POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	267	267	442	61,357	素材
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	267 1	267 1	442 —	61,357 <0.1%>
(トルコ)			千		
AKBANK T. A. S.	2,763	2,763	1,486	19,251	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK VE	417	215	461	5,975	食品・飲料・タバコ
ARCELIK AS	153	—	—	—	耐久消費財・アパレル
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	238	995	1,782	23,079	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	1,167	1,167	1,321	17,115	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS	132	65	778	10,085	自動車・自動車部品
KOC HOLDING AS	624	898	1,466	18,996	資本財
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	431	—	—	—	資本財
TURK HAVA YOLLARI AO	621	621	664	8,601	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	950	1,430	2,340	30,315	電気通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI	2,399	2,399	1,795	23,247	銀行
TURKIYE IS BANKASI-C	1,730	1,730	1,015	13,151	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	116	116	954	12,366	エネルギー
YAPI VE KREDI BANKASI	—	2,460	607	7,870	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING	1,143	1,143	1,085	14,056	各種金融
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	428	428	3,014	39,041	食品・生活必需品小売り

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	期 末		業 種
		株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	98	—	—	—	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	13,417 16	16,436 14	18,776 —	243,155 <0.3%>
(チェコ)			千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS	74	74	3,933	18,406	銀行
CEZ AS	137	181	8,618	40,336	公益事業
MONETA MONEY BANK AS	687	687	4,076	19,079	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	899 3	943 3	16,628 —	77,821 <0.1%>
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	151	151	106,094	36,697	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	328	423	72,850	25,199	エネルギー
OTP BANK NYRT	195	248	291,551	100,847	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	675 3	823 3	470,495 —	162,744 <0.2%>
(ポーランド)			千ポーランドズロチ		
BANK MILLENNIUM SA	993	—	—	—	銀行
M BANK SA	16	16	255	7,068	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ SA	131	131	1,804	49,980	素材
BANK PEKAO SA	155	225	1,094	30,296	銀行
ORANGE POLSKA SA	556	556	356	9,863	電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY SA	264	307	1,386	38,388	エネルギー
LPP SA	1	1	933	25,854	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA	36	36	579	16,045	銀行
CD PROJEKT SA	67	67	2,489	68,944	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA	765	1,042	2,376	65,817	銀行
CCC SA	31	—	—	—	耐久消費財・アパレル
GRUPA LOTOS SA	110	110	358	9,925	エネルギー
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	1,464	2,598	1,241	34,377	エネルギー
CYFROWY POLSAT SA	235	360	986	27,327	メディア・娯楽
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	634	634	375	10,383	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	620	620	1,492	41,335	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	41	—	—	—	素材
ALIOR BANK SA	88	—	—	—	銀行
DINO POLSKA SA	44	59	1,545	42,800	食品・生活必需品小売り
ALLEGRO. EU SA	—	273	2,479	68,651	小売
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数 <比率>	6,258 19	7,043 16	19,756 —	547,061 <0.7%>
(香港)			千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	830	830	849	11,533	素材
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	680	1,560	1,322	17,951	運輸
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	1,760	804	10,914	運輸
ANGANG STEEL CO LTD-H	754	—	—	—	素材
CHINA MOBILE (HONG KONG) LIMITED-R	5,945	6,675	33,775	458,333	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)	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,100	1,240	6,429	87,246	素材
DATANG INTL POWER GENERATION CO.LTD. -H	1,380	—	—	—	公益事業
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	390	595	1,487	20,185	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H	3,700	3,700	1,117	15,163	公益事業
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	2,860	3,580	8,234	111,735	ヘルスケア機器・サービス
YANZHOU COAL MINING CO-H	1,420	1,420	823	11,176	エネルギー
HENGAN INTL GROUP CO LTD	665	785	4,254	57,736	家庭用品・パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	1,840	—	—	—	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	4,680	3,080	1,010	13,708	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	2,500	3,680	2,734	37,103	自動車・自動車部品
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	4,520	9,561	7,830	106,265	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	3,810	4,090	8,283	112,401	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	2,651	3,471	12,287	166,744	不動産
CITIC LTD	5,850	6,770	4,143	56,223	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	1,080	2,480	1,267	17,196	運輸
LENOVO GROUP LTD	7,320	7,320	3,960	53,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	19,760	23,820	5,550	75,314	エネルギー
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	7,000	7,340	3,802	51,594	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,418	1,840	2,303	31,265	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	25,574	27,394	8,848	120,070	エネルギー
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	370	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	1,343	18,224	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,420	2,420	6,050	82,098	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	751	847	8,470	114,937	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	2,580	3,600	2,070	28,089	公益事業
TOWNGAS CHINA CO LTD	460	—	—	—	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	1,043	2,507	1,386	18,818	運輸
YUEXIU PROPERTY COMPANY LTD	5,780	5,780	919	12,471	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,655	1,655	1,592	21,611	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	680	9,227	素材
CHINA DING YI FENG HOLDINGS	800	—	—	—	各種金融
WHARF HOLDINGS	—	1,000	1,660	22,526	不動産
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	1,279	1,279	1,632	22,150	運輸
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	1,340	1,340	1,500	20,365	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	1,722	2,862	7,641	103,695	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	1,725	23,411	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	4,710	6,090	12,819	173,959	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,360	3,360	833	11,307	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	860	1,060	3,794	51,495	公益事業
BYD CO LTD-H	685	825	16,170	219,426	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	13,560	13,560	3,484	47,290	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,920	1,920	948	12,870	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	14,500	1,580	21,447	メディア・娯楽
SINOTRANS LIMITED-H	1,100	—	—	—	運輸

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MAANSHAN IRON & STEEL-H	2,920	—	—	—	素材
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	3,850	3,850	1,578	21,424	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,660	1,660	1,039	14,101	素材
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	6,132	6,892	3,970	53,876	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	1,240	2,750	1,155	15,673	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,754	1,754	1,431	19,422	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	3,527	3,527	4,818	65,387	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	7,100	8,710	15,503	210,386	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	7,290	5,030	68,258	素材
MMG LIMITED	1,680	—	—	—	素材
CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	1,440	—	—	—	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,440	2,440	3,660	49,666	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	2,650	3,735	9,225	125,189	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	2,118	3,596	48,802	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	860	860	287	3,897	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,990	5,570	841	11,413	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	380	380	406	5,517	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	—	640	462	6,279	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	2,280	3,173	43,067	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	460	460	2,953	40,074	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	2,720	3,200	4,044	54,887	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,660	1,660	537	7,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,420	1,620	8,237	111,785	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	497	6,747	運輸
CNOOC LTD-R	17,120	18,830	13,896	188,576	エネルギー
SINO BIOPHARMACEUTICAL	7,260	11,130	9,082	123,243	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,570	2,810	11,324	153,670	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	5,517	6,162	383,584	5,205,241	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	5,255	6,325	53,066	720,115	保険
LI NING CO LTD	1,940	2,170	9,862	133,836	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,884	25,578	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	5,939	12,069	1,146	15,559	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	1,032	14,008	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	1,180	2,140	1,138	15,449	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,848	25,088	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	1,680	1,680	378	5,129	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	3,440	3,925	5,447	73,928	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	1,465	4,740	3,024	41,037	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	9,474	10,984	4,591	62,308	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	1,700	929	12,618	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	91,176	102,476	60,563	821,845	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	700	848	11,914	161,678	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	2,159	29,310	自動車・自動車部品
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,420	1,420	1,641	22,275	不動産

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,290	1,290	1,465	19,886	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	3,300	4,120	4,177	56,691	素材
BANK OF CHINA LTD-H	77,262	86,352	23,055	312,869	銀行
SHUI ON LAND LTD	2,095	—	—	—	不動産
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	1,325	3,981	54,030	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,352	1,352	1,408	19,117	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	3,764	4,369	20,491	278,072	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	62,625	64,645	30,383	412,300	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	905	905	1,042	14,147	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	801	10,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	3,120	1,960	915	12,420	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	3,950	5,190	2,195	29,791	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	980	—	—	—	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	350	780	1,688	22,915	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	1,573	21,346	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,160	1,420	4,955	67,250	耐久消費財・アパレル
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	1,030	—	—	—	食品・飲料・タバコ
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	7,702	8,979	9,895	134,282	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	3,360	6,420	2,099	28,488	素材
CHINA CITIC BANK-H	9,512	9,512	3,167	42,982	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	890	1,525	1,765	23,963	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	743	755	11,996	162,798	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,110	1,110	11,188	151,832	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	—	250	562	7,633	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	2,903	39,394	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	5,780	2,369	32,158	不動産
CHINA AOYUAN GROUP LTD	690	1,260	1,040	14,123	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	5,285	5,285	845	11,476	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,940	1,940	717	9,740	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	1,130	2,915	629	8,544	不動産
KINGSOFT CORP LTD	660	920	4,163	56,491	ソフトウェア・サービス
SINOTRUK HONG KONG LTD	425	975	1,907	25,879	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,740	4,740	1,810	24,570	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	544	7,382	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	850	850	3,298	44,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,915	1,915	1,011	13,720	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,600	2,850	38,679	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,708	2,966	7,919	107,463	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,860	1,860	3,132	42,504	不動産
CRRC CORP LTD-H	5,110	5,110	1,609	21,845	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	1,950	2,590	2,175	29,522	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	1,310	—	—	—	素材
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	796	—	—	—	素材
SINOPHARM GROUP CO-H	996	1,252	2,303	31,260	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA RESOURCES CEMENT	2,100	2,880	3,012	40,879	素材
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	1,430	—	—	—	資本財
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	2,523	3,583	3,225	43,764	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,015	1,015	603	8,195	素材
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,510	1,510	498	6,761	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	2,530	4,310	2,586	35,092	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,679	22,790	ヘルスケア機器・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	3,060	—	—	—	公益事業
SIHUAN PHARMACEUTICAL HDGS	3,210	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,340	2,510	7,969	108,142	不動産
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	1,040	3,566	1,141	15,485	不動産
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	—	1,162	859	11,668	資本財
LONGFOR PROPERTIES	1,785	1,970	9,426	127,916	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1,156	964	3,118	42,318	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	5,514	6,744	2,953	40,084	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,560	1,560	595	8,086	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	314	314	370	5,030	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	6,850	6,850	1,959	26,584	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	29,290	31,520	9,077	123,185	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	420	680	4,012	54,442	小売
FAR EAST HORIZON LTD	1,410	2,400	1,893	25,696	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H	1,990	2,485	4,517	61,305	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	1,280	2,040	1,336	18,132	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,000	1,000	844	11,453	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	2,768	3,572	2,493	33,833	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	3,292	44,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	6,920	9,390	2,272	30,836	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	555	555	1,814	24,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,760	2,760	1,614	21,910	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	715	715	218	2,959	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	3,285	4,830	2,318	31,460	各種金融
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	920	—	—	—	自動車・自動車部品
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	—	1,280	1,694	22,997	資本財
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS	4,350	—	—	—	食品・飲料・タバコ
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	1,800	1,537	20,859	商業・専門サービス
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	592	1,094	1,209	16,419	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	7,300	10,590	4,373	59,350	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	340	480	4,459	60,511	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	820	820	1,031	13,998	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	—	225	617	8,381	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,360	1,360	6,779	91,999	商業・専門サービス
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	—	1,310	649	8,817	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	—	401	4,146	56,265	ヘルスケア機器・サービス
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	2,500	—	—	—	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	270	700	931	12,633	消費者サービス
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	—	300	493	6,692	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	—	415	1,504	20,414	商業・専門サービス
CHINA TOWER CORP LTD-H	41,560	45,660	6,301	85,505	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	8,238	11,096	28,350	384,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTPEC CO LTD-H	276	267	3,668	49,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	1,027	3,827	128,281	1,740,773	小売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	—	684	930	12,623	小売
HAIDLIAO INTERNATIONAL HOLDI	370	850	4,730	64,189	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	2,244	3,862	5,600	76,005	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	—	940	5,207	70,667	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	1,272	17,274	各種金融
LOGAN GROUP CO LTD	940	1,500	1,917	26,013	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,595	1,595	5,861	79,542	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	—	80	461	6,258	不動産
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	—	450	702	9,526	消費者サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	—	58	940	12,766	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	—	1,140	1,285	17,449	小売
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	—	1,220	4,361	59,185	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	—	1,440	2,548	34,587	食品・飲料・タバコ
CHINA VANKE CO LTD-H	1,740	1,784	4,852	65,848	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	815	1,925	864	11,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	450	450	1,568	21,281	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H	13,420	13,420	2,254	30,594	公益事業
BAIC MOTOR CORP LTD-H	1,170	1,170	373	5,064	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H	886	886	1,025	13,922	各種金融
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	272	272	1,009	13,693	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	1,588	2,092	2,673	36,280	各種金融
3SBIO INC	1,190	1,190	875	11,885	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEGEND HOLDINGS CORP-H	211	905	1,004	13,631	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	1,575	1,575	653	8,869	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME	9,270	9,270	806	10,944	各種金融
CHINA LITERATURE LTD	322	322	1,932	26,217	メディア・娯楽
SSY GROUP LTD	1,140	1,140	502	6,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DALI FOODS GROUP CO LTD	1,205	2,460	1,195	16,223	食品・飲料・タバコ
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	2,360	2,360	660	8,967	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	—	960	617	8,376	消費者サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	—	800	434	5,894	不動産
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	2,390	2,390	179	2,432	保険
MEITU INC	1,430	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BOC AVIATION LTD	325	325	1,729	23,462	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	457	457	1,937	26,294	保険
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	1,320	1,320	2,597	35,251	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	545	1,080	25,963	352,320	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)	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	16,560	—	—	—	小売
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	—	152	1,427	19,368	食品・飲料・タバコ
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	—	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	888,643	979,813	1,393,132	18,904,813	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	207	206	—	<22.9%>	
(マレーシア)			千マレーシアリングgit		
AMMB HOLDINGS BHD	1,302	2,656	802	20,518	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	140	140	138	3,545	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	4,446	6,351	1,943	49,713	銀行
DIGI.COM BERHAD	3,117	3,117	1,281	32,770	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	535	1,065	461	11,806	運輸
RHB BANK BHD	2,064	2,064	904	23,127	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	382	297	7,621	資本財
GAMUDA BHD	1,392	1,415	523	13,394	資本財
YTL CORPORATION BERHAD	2,523	2,607	202	5,169	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	149	460	669	17,121	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	612	900	23,047	銀行
IJM CORP BHD	1,981	—	—	—	資本財
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	548	556	1,267	32,425	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	85	213	687	17,598	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	3,598	4,040	2,876	73,581	銀行
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	706	—	—	—	銀行
MISC BHD	1,250	1,250	867	22,197	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	69	69	972	24,886	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	526	734	1,393	35,637	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	251	476	12,199	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	755	755	1,215	31,093	公益事業
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	109	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	306	7,832	電気通信サービス
SP SETIA BHD	1,851	—	—	—	不動産
TENAGA NATIONAL BHD	2,944	2,751	2,823	72,219	公益事業
QL RESOURCES BHD	832	1,248	811	20,750	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	1,567	40,104	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	2,985	3,244	4,963	126,969	銀行
AIRASIA GROUP BHD	648	—	—	—	運輸
TOP GLOVE CORP BHD	984	5,049	4,281	109,522	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	—	132	260	6,672	食品・飲料・タバコ
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	—	1,282	961	24,595	ヘルスケア機器・サービス
SUPERMAX CORP BHD	—	1,582	1,523	38,970	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	2,053	3,072	918	23,495	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	783	20,048	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	1,796	2,703	1,208	30,911	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	1,672	3,363	827	21,165	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)		
HARTELEGA HOLDINGS BHD	1,586	1,813	3,303	84,498	ヘルスケア機器・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	2,816	2,852	901	23,060	電気通信サービス	
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,419	36,320	電気通信サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,101	2,699	1,719	43,978	素材	
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	2,293	1,238	31,673	ヘルスケア機器・サービス	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	700	700	279	7,144	運輸	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,443	1,443	864	22,110	素材	
SIME DARBY PROPERTY BHD	1,672	—	—	—	不動産	
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	1,269	32,481	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	68,612	78,659	50,116	1,281,981	
		43	40	—	<1.6%>	
(タイ)				千タイバーツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	519	519	5,553	19,214	銀行	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,027	1,776	5,860	20,278	食品・生活必需品小売り	
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	4,079	14,114	銀行	
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	543	543	2,823	9,769	公益事業	
ROBINSON PCL-NVDR	348	—	—	—	小売	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,475	1,274	9,045	31,297	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	9,614	2,845	9,846	電気通信サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	783	783	6,303	21,808	銀行	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	13,365	31,473	2,926	10,127	銀行	
IRPC PCL - NVDR	8,295	8,295	1,858	6,428	エネルギー	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	3,648	—	—	—	エネルギー	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	232	360	6,714	23,230	公益事業	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	2,437	2,437	13,159	45,532	電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	3,407	4,582	12,600	43,597	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,059	1,197	21,426	74,134	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	4,712	7,435	10,706	37,045	小売	
PTT PCL-NVDR	10,978	12,532	43,548	150,678	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	2,400	4,497	7,150	24,739	食品・飲料・タバコ	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	—	1,015	4,288	14,837	各種金融	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	6,060	20,968	不動産	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	734	810	29,241	101,173	素材	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	4,281	4,281	24,508	84,800	運輸	
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	1,264	1,264	10,206	35,315	銀行	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	1,725	2,263	9,957	34,451	不動産	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	8,196	10,837	20,048	69,367	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	328	328	3,157	10,923	ヘルスケア機器・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,233	3,627	6,638	22,967	消費者サービス	
THAI OIL PCL-NVDR	1,201	1,201	4,623	15,998	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	5,668	6,571	39,590	136,982	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	4,711	8,095	7,852	27,168	運輸	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,247	1,344	11,289	39,062	エネルギー	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	660	660	2,211	7,650	電気通信サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,064	2,064	5,314	18,389	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,249	2,249	10,403	35,995	素材	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	1,855	1,855	8,162	28,240	公益事業	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	8,170	8,170	7,230	25,017	運輸	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	—	534	2,563	8,868	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	524	2,882	9,726	33,654	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	—	660	2,376	8,220	食品・飲料・タバコ	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	—	1,651	3,714	12,853	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	—	8,103	2,755	9,532	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	—	1,822	5,192	17,966	小売	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	—	763	4,024	13,925	各種金融	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	898	898	5,028	17,399	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	—	682	4,398	15,220	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	126,957 37	175,053 43	407,167 —	1,408,798 <1.7%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	6,370	9,429	32,718	71,653	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,379	2,379	11,409	24,986	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	598	598	4,667	10,222	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	5,906	—	—	—	資本財	
DMCI HOLDINGS INC	3,454	—	—	—	資本財	
GLOBE TELECOM INC	46	46	9,849	21,569	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,445	1,445	18,062	39,556	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	2,303	3,035	21,367	46,794	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	610	610	12,134	26,575	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,612	1,612	6,757	14,799	銀行	
BDO UNIBANK INC	1,737	2,199	20,374	44,620	銀行	
MEGAWORLD CORP	6,380	6,380	2,073	4,540	不動産	
PLDT INC	62	104	14,623	32,024	電気通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	930	930	1,514	3,315	不動産	
SECURITY BANK CORP	308	—	—	—	銀行	
SM PRIME HOLDINGS INC	8,875	11,561	41,447	90,771	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	633	955	13,751	30,114	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	228	228	22,576	49,443	資本財	
AYALA CORPORATION	223	282	22,312	48,865	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	23,557	23,557	9,893	21,667	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	895	895	2,541	5,566	公益事業	
MANILA ELECTRIC COMPANY	291	291	9,111	19,954	公益事業	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	—	873	3,566	7,809	食品・生活必需品小売り	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	68	68	3,497	7,659	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	68,917 23	67,483 21	284,252 —	622,513 <0.8%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
BARITO PACIFIC TBK PT	41,347	28,825	2,680,725	20,105	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)		
UNITED TRACTORS TBK PT	2,009	2,009	4,193,787	31,453	エネルギー	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	4,291	4,291	3,089,520	23,171	食品・飲料・タバコ	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	21,527	21,527	12,055,120	90,413	自動車・自動車部品	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,923	7,923	5,070,720	38,030	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	596	596	2,467,440	18,505	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	9,179	9,179	1,312,597	9,844	食品・飲料・タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,900	1,900	2,503,250	18,774	素材	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,442	2,442	2,362,635	17,719	素材	
BUKIT ASAM TBK PT	4,473	—	—	—	エネルギー	
BANK MANDIRI	18,180	20,475	12,592,715	94,445	銀行	
PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	867	—	—	—	素材	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	1,186	7,464	5,933,880	44,504	家庭用品・パーソナル用品	
PT BANK RAKYAT INDONESIA	52,460	58,996	21,769,524	163,271	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	7,915	7,915	890,437	6,678	公益事業	
BANK NEGARA INDONESIA PT	8,102	8,102	4,132,020	30,990	銀行	
KALBE FARMA TBK PT	27,559	27,559	4,078,732	30,590	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	2,346	3,456	3,533,760	26,503	素材	
BANK CENTRAL ASIA PT	9,150	10,510	33,027,675	247,707	銀行	
TELEKOMUNIKASI INDONESIA	45,431	53,497	15,407,136	115,553	電気通信サービス	
XL AXIATA TBK PT	—	3,870	824,310	6,182	電気通信サービス	
ACE HARDWARE INDONESIA	—	9,057	1,476,291	11,072	小売	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	1,235	—	—	—	運輸	
BUMI SERPONG DAMAI PT	6,834	—	—	—	不動産	
ADARO ENERGY PT	14,393	14,393	1,626,409	12,198	エネルギー	
PAKUWON JATI TBK PT	16,104	—	—	—	不動産	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	1,610	1,569,750	11,773	食品・飲料・タバコ	
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	6,691	—	—	—	銀行	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	5,330	—	—	—	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	321,080	305,596	142,598,434	1,069,488	
(韓国)			千韓国ウォン			
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50	50	107,484	10,124	メディア・娯楽	
HANMI SCIENCE CO LTD	6	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	28	42	356,595	33,591	自動車・自動車部品	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	31	31	573,426	54,016	保険	
DB INSURANCE CO LTD	42	42	193,614	18,238	保険	
COWAY CO LTD	50	50	375,303	35,353	耐久消費財・アパレル	
KT&G CORP	106	132	1,101,975	103,806	食品・飲料・タバコ	
S-1 CORPORATION	9	23	200,138	18,853	商業・専門サービス	
KOREA GAS CORPORATION	45	45	132,509	12,482	公益事業	
CJ CORP	12	12	97,785	9,211	資本財	
KAKAO CORP	59	60	2,259,091	212,806	メディア・娯楽	
SK TELECOM	21	42	956,796	90,130	電気通信サービス	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	41	32	262,185	24,697	資本財	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	310	310	282,236	26,586	各種金融
NCSOFT CORPORATION	16	17	1,509,916	142,234	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	141	221	261,075	24,593	電気通信サービス
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	82	—	—	—	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	59	59	81,436	7,671	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	9	9	1,459,812	137,514	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	44	48	3,537,146	333,199	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	4	11	404,182	38,073	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	1	2	195,434	18,409	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	454	518	1,647,793	155,222	銀行
S-OIL CORPORATION	58	44	257,481	24,254	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	107	107	558,853	52,643	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	479	479	166,945	15,726	各種金融
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	57	193,207	18,200	各種金融
POSCO CHEMICAL CO LTD	11	33	278,038	26,191	素材
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	14	19	526,890	49,633	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	30	30	230,960	21,756	小売
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	33	43	392,295	36,954	資本財
HYUNDAI MOBIS	64	69	1,607,970	151,470	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	521	590	5,074,344	478,003	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	63	92	293,338	27,632	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	30	30	249,249	23,479	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	143	156	2,705,145	254,824	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	72	72	221,243	20,841	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	283	283	244,487	23,030	銀行
KCC CORP	8	—	—	—	素材
KIA MOTORS CORPORATION	253	294	1,540,235	145,090	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	7	7	308,502	29,060	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	244	303	619,819	58,386	公益事業
HANWHA CORPORATION	28	28	74,015	6,972	資本財
KOREAN AIR LINES CO LTD	55	91	199,361	18,779	運輸
OCI COMPANY LTD	11	—	—	—	素材
CJ LOGISTICS	8	8	139,644	13,154	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	10	25	384,336	36,204	素材
DOUZONE BIZON CO LTD	—	14	157,433	14,830	ソフトウェア・サービス
LG ELECTRONICS INC	110	110	961,958	90,616	耐久消費財・アパレル
LOTTE CORP	23	23	71,811	6,764	資本財
LG CORP	83	99	721,855	67,998	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	112	121	123,491	11,632	各種金融
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	67	67	199,758	18,817	資本財
NAVER CORP	131	130	3,888,602	366,306	メディア・娯楽
HYUNDAI DEPT STORE CO	12	—	—	—	小売
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	333,184	31,386	各種金融
OTTOGI CORPORATION	0.68	0.68	37,400	3,523	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PACIFIC CORP	21	33	158,792	14,958	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	132	132	283,972	26,750	消費者サービス
POSCO	78	79	1,871,532	176,298	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	185	185	212,008	19,971	資本財
SAMSUNG SDI CO LTD	52	60	3,202,264	301,653	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	56	56	781,618	73,628	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	4,610	5,138	30,932,445	2,913,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	371	593	332,113	31,285	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	796	889	4,893,900	461,005	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHINSEGAE CO LTD	5	8	190,296	17,925	小売
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	—	30	408,566	38,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUHAN CORPORATION	6	55	360,100	33,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	190	190	235,600	22,193	自動車・自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	91	91	222,064	20,918	保険
GS HOLDINGS CORP	42	65	227,458	21,426	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	240	240	365,879	34,465	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	91	102	2,934,360	276,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANA FINANCIAL GROUP	332	325	1,075,734	101,334	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	14	23	424,488	39,986	運輸
LOTTE SHOPPING CO	10	10	93,060	8,766	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	74	74	477,654	44,995	保険
AMOREPACIFIC CORP	28	28	474,045	44,655	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	7	21	111,930	10,543	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	18	60,483	5,697	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	55	55	877,002	82,613	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	7	7	306,125	28,836	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	125,485	11,820	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	14	217,202	20,460	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK HOLDINGS CO LTD	38	39	772,258	72,746	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	381	441	1,894,223	178,435	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	51	106	244,237	23,007	資本財
BNK FINANCIAL GROUP INC	232	481	284,584	26,807	銀行
HANMI PHARM CO LTD	4	4	140,140	13,201	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANWHA LIFE INSURANCE	833	—	—	—	保険
FILA HOLDINGS CORPORATION	40	40	175,848	16,564	耐久消費財・アパレル
EMART	27	18	278,668	26,250	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	13	40	135,604	12,773	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	70	70	228,585	21,532	自動車・自動車部品
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	22	—	—	—	資本財
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	8	13	314,084	29,586	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	5	5	71,370	6,723	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	19	29	356,160	33,550	食品・飲料・タバコ
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	39	—	—	—	保険
NETMARBLE CORP	24	24	317,985	29,954	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)		
WOORI FINANCIAL GROUP INC	556	594	570,891	53,777	銀行	
SAMSUNG SDS CO LTD	31	37	651,875	61,406	ソフトウェア・サービス	
SAMSUNG C&T CORP	77	87	1,003,605	94,539	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	15	18	1,372,083	129,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DOOSAN BOBCAT INC	43	43	131,178	12,357	資本財	
CJ ENM CO LTD	8	8	111,469	10,500	小売	
KMW CO LTD	—	19	131,929	12,427	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HLB INC	23	50	472,566	44,515	耐久消費財・アパレル	
HELIXMITH CO LTD	16	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION PHARM INC	11	12	143,078	13,477	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDY-TOX INC	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEEGENE INC	—	19	527,916	49,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALTEOGEN INC	—	18	319,896	30,134	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP	3	9	186,870	17,603	メディア・娯楽	
SILLAJEN INC	56	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	60	75	694,834	65,453	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	15,374	16,389	102,145,916	9,622,145	
(台湾)		112	106	—	<11.7%>	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	—	480	10,440	38,523	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACER INC	2,558	2,558	6,024	22,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	630	760	19,099	70,475	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	609	509	18,441	68,049	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	2,341	2,341	9,835	36,292	素材	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	270	270	4,927	18,182	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN BUSINESS BANK	4,766	5,004	4,884	18,023	銀行	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	600	600	7,200	26,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	287	617	5,351	19,745	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	2,422	2,862	21,183	78,168	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	421	1,134	4,764	17,579	不動産	
EVA AIRWAYS CORP	1,641	1,641	1,813	6,693	運輸	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	577	697	12,929	47,709	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	4,204	5,818	10,356	38,216	銀行	
CHINA AIRLINES LTD	1,302	—	—	—	運輸	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	6,834	25,219	自動車・自動車部品	
CHINA STEEL	11,202	12,662	26,211	96,720	素材	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,077	3,262	6,362	23,475	保険	
ADVANTECH CO LTD	284	433	12,784	47,173	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COMPAL ELECTRONICS	4,317	4,317	8,181	30,191	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	1,869	2,099	41,455	152,972	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,030	1,540	9,301	34,322	半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,473	3,973	43,704	161,270	電気通信サービス	
AU OPTRONICS CORP	9,450	9,450	10,915	40,279	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,522	1,782	17,909	66,084	電気通信サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
EVERGREEN MARINE	1,329	3,590	7,791	28,749	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,480	9,257	34,160	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	362	434	7,820	28,858	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	199	8,164	30,125	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	530	580	17,007	62,756	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,528	4,138	33,850	124,909	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	400	1,210	3,763	13,885	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	3,540	3,960	28,476	105,079	素材
GIANT MANUFACTURING	254	344	10,080	37,197	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,388	1,608	112,884	416,543	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	6,490	7,100	30,320	111,882	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	7,579	9,640	17,305	63,857	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	260	300	19,470	71,844	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,570	1,570	9,561	35,281	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	9,451	11,701	21,472	79,233	各種金融
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	7,319	8,941	35,407	130,652	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	12,567	12,567	10,833	39,975	保険
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	9,785	12,609	32,091	118,418	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	11,962	13,332	108,259	399,478	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	10,753	11,733	33,733	124,476	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	100	110	36,045	133,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	9,647	12,295	16,045	59,209	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	11,664	11,955	9,779	36,086	保険
INVENTEC CO LTD	2,805	2,805	6,241	23,030	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,254	2,254	10,686	39,432	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,568	11,568	12,783	47,171	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	18,712	18,992	35,420	130,702	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	10,040	11,662	24,548	90,585	銀行
POWERTECH TECHNOLOGY INC	1,237	997	8,679	32,029	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	4,677	5,487	34,077	125,745	素材
WISTRON CORP	2,426	3,556	10,493	38,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	2,737	2,737	7,159	26,417	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	4,463	5,263	33,320	122,953	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	665	595	15,421	56,906	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,092	1,122	9,192	33,920	エネルギー
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	334	1,476	5,935	21,903	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD	221	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	928	928	4,800	17,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
STANDARD FOODS CORP	357	357	2,241	8,272	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	1,281	1,281	5,495	20,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	4,694	5,675	23,353	86,172	素材
TATUNG CO LTD	2,100	—	—	—	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	23,783	26,523	1,216,120	4,487,484	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	12,100	12,100	38,478	141,983	半導体・半導体製造装置

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
WINBOND ELECTRONICS CORP	2,040	3,490	6,072	22,407	半導体・半導体製造装置	
YAGEO CORPORATION	227	387	15,040	55,499	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	1,770	2,640	8,131	30,004	運輸	
CHIMEI INNOLUX CORPORATION	7,750	7,750	7,750	28,597	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WPG HOLDINGS LTD	1,436	1,436	5,718	21,102	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	212	218	5,982	22,075	資本財	
PEGATRON CORP	1,594	2,004	12,208	45,050	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	120	120	9,360	34,538	資本財	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,320	1,373	21,213	78,276	各種金融	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	—	30	4,830	17,822	半導体・半導体製造装置	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	759	599	7,610	28,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	7,696	10,872	21,745	80,241	銀行	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	3,308	3,308	12,853	47,431	銀行	
WIWYNN CORP	—	80	6,240	23,025	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	3,793	3,493	24,521	90,485	半導体・半導体製造装置	
SILERGY CORP	—	70	15,785	58,246	半導体・半導体製造装置	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	160	160	5,664	20,900	耐久消費財・アパレル	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	890	9,167	33,826	半導体・半導体製造装置	
PHISON ELECTRONICS CORP	115	115	3,711	13,696	半導体・半導体製造装置	
TAIMED BIOLOGICS INC	130	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	320	10,272	37,903	半導体・半導体製造装置	
GLOBALWAFERS CO LTD	180	240	10,236	37,770	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	318,108	354,982	2,668,902	9,848,248	
		87	87	—	<11.9%>	
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	2,753	3,066	628,812	899,201	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	661	661	24,831	35,508	エネルギー	
ASIAN PAINTS LTD	249	322	71,675	102,496	素材	
EICHER MOTORS LTD	12	125	27,498	39,322	自動車・自動車部品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	756	756	46,638	66,693	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	9	9	20,366	29,124	素材	
ICICI BANK LTD	2,223	5,417	250,645	358,423	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	594	594	12,363	17,679	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	1,674	1,875	41,157	58,854	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	264	264	10,063	14,390	運輸	
LIC HOUSING FINANCE LTD	279	279	8,511	12,171	銀行	
TATA STEEL LTD	258	397	17,404	24,888	素材	
JSW STEEL LTD	802	802	26,742	38,241	素材	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	—	438	22,379	32,003	食品・飲料・タバコ	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	51	51	18,124	25,918	食品・飲料・タバコ	
NESTLE INDIA LIMITED	23	23	41,510	59,359	食品・飲料・タバコ	
GAIL INDIA LTD	1,747	1,747	15,117	21,617	公益事業	
VEDANTA LTD	1,987	1,987	19,638	28,083	素材	
TITAN INDUSTRIES LTD	278	328	42,265	60,439	耐久消費財・アパレル	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	2,527	2,527	17,297	24,736	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	—	52	7,925	11,333	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	265	265	24,373	34,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAJAJ FINANCE LTD	167	180	69,879	99,927	各種金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	1,585	1,774	381,875	546,081	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	794	794	15,231	21,780	メディア・娯楽
INFOSYS LTD	3,265	3,655	415,435	594,072	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	1,187	1,187	41,780	59,746	ソフトウェア・サービス
INDIAN OIL CORP LTD	1,937	1,937	15,733	22,499	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	596	871	185,934	265,886	家庭用品・パーソナル用品
HCL TECHNOLOGIES LTD	527	1,220	104,372	149,252	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	581	581	30,656	43,838	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	103	103	30,603	43,762	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	104	126	61,698	88,228	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	1,994	1,532	72,286	103,369	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	324	324	18,054	25,817	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	829	829	42,316	60,513	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	90	90	31,012	44,347	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	105	131	90,623	129,590	自動車・自動車部品
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	160	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AUROBINDO PHARMA LTD	203	288	22,688	32,444	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOCON LTD	—	176	7,357	10,521	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	768	768	9,454	13,520	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	190	212	17,721	25,342	各種金融
PETRONET LNG LTD	494	837	19,951	28,531	エネルギー
CIPLA LTD	313	378	28,918	41,353	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	445	497	48,031	68,685	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	92	124	57,672	82,471	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	1,436	—	—	—	資本財
BOSCH LTD	9	9	11,289	16,144	自動車・自動車部品
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	865	966	263,564	376,896	ソフトウェア・サービス
NTPC LTD	2,600	2,600	23,258	33,259	公益事業
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	67	117	16,205	23,173	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YES BANK LTD	1,529	—	—	—	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	735	735	18,331	26,214	素材
BHARAT FORGE LTD	303	303	14,971	21,409	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,213	1,213	23,628	33,788	素材
ITC LTD	3,471	3,884	67,121	95,984	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	81	122	19,570	27,985	素材
UNITED PHOSPHORUS LTD	542	542	23,131	33,078	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	—	61	15,593	22,298	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS INDIA LTD	—	59	7,995	11,434	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	—	64	23,348	33,388	メディア・娯楽
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	384	384	26,476	37,861	家庭用品・パーソナル用品

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
TECH MAHINDRA LTD	480	480	41,940	59,974	ソフトウェア・サービス	
IDEA CELLULAR LTD	4,679	—	—	—	電気通信サービス	
MARICO LTD	424	424	16,155	23,102	家庭用品・パーソナル用品	
PAGE INDUSTRIES LTD	6	6	13,187	18,858	耐久消費財・アパレル	
DLF LTD	—	564	9,749	13,941	不動産	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	1,667	2,013	37,061	52,997	公益事業	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	625	625	22,950	32,818	運輸	
REC LTD	481	481	5,262	7,525	各種金融	
BAJAJ FINSERV LTD	31	38	24,429	34,934	保険	
BAJAJ AUTO LTD	83	83	25,102	35,896	自動車・自動車部品	
JUBILANT FOODWORKS LTD	—	87	20,520	29,344	消費者サービス	
COAL INDIA LTD	1,473	1,473	17,937	25,650	エネルギー	
TATA MOTORS LTD	1,470	1,900	26,801	38,326	自動車・自動車部品	
TATA POWER CO LTD	932	—	—	—	公益事業	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	279	—	—	—	各種金融	
BHARTI INFRATEL LTD	358	358	6,398	9,149	電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	269	—	—	—	銀行	
INDRAPRASTHA GAS LTD	—	132	5,594	8,000	公益事業	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	388	740	43,928	62,817	保険	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	40	10,273	14,690	各種金融	
BANDHAN BANK LTD	360	748	25,443	36,383	銀行	
AXIS BANK LTD	2,000	2,447	138,285	197,748	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	234	234	19,344	27,662	資本財	
BERGER PAINTS INDIA LTD	—	294	19,244	27,520	素材	
GRASIM INDUSTRIES LTD	273	417	33,090	47,319	素材	
AVENUE SUPERMARTS LTD	110	175	40,758	58,284	食品・生活必需品小売り	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	91	235	29,939	42,812	保険	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	—	317	13,392	19,151	保険	
INTERGLOBE AVIATION LTD	83	83	12,465	17,825	運輸	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	—	414	33,476	47,871	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	64,329 80	66,506 86	4,461,854 —	6,380,451 <7.7%>	
(パキスタン)				千パキスタンルピー		
MCB BANK LTD	533	533	9,104	6,100	銀行	
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	730	730	6,859	4,595	エネルギー	
HABIB BANK LTD	665	665	8,658	5,801	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,928 3	1,928 3	24,622 —	16,497 <0.0%>	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR INSURANCE CO	1,896	—	—	—	保険	
QATAR NATIONAL BANK	4,325	4,897	8,912	253,747	銀行	
COMMERCIAL BANK QSC	2,039	2,039	875	24,914	銀行	
OOREDOO QSC	728	728	495	14,093	電気通信サービス	
QATAR FUEL QSC	573	573	1,006	28,658	エネルギー	

銘柄	株数 (百株)	当	期		業	種
		株数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	624	624	1,073	30,566	公益事業	
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	—	985	837	23,850	銀行	
INDUSTRIES QATAR	1,594	1,967	2,024	57,650	資本財	
QATAR ISLAMIC BANK	1,142	1,142	1,919	54,635	銀行	
MASRAF AL RAYAN	4,065	4,065	1,752	49,896	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	2,074	2,074	708	20,173	不動産	
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,439	4,439	910	25,934	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	23,504	23,538	20,517	584,121	
	銘柄数 <比率>	11	11	—	<0.7%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
BIDVEST GROUP LTD	277	277	4,155	28,382	資本財	
CLICKS GROUP LTD	269	269	6,972	47,622	食品・生活必需品小売り	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	473	—	—	—	小売	
DISCOVERY LIMITED	349	484	6,089	41,592	保険	
GOLD FIELDS LTD	835	971	16,376	111,849	素材	
REMGRO LTD	554	554	5,362	36,624	各種金融	
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	240	—	—	—	小売	
NORTHAM PLATINUM LTD	—	339	5,902	40,312	素材	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	—	563	4,366	29,820	素材	
EXXARO RESOURCES LTD	196	349	4,495	30,706	エネルギー	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	43	69	9,131	62,369	銀行	
LIBERTY HOLDINGS LTD	62	—	—	—	保険	
MTN GROUP LTD	1,565	1,730	11,492	78,493	電気通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	384	447	16,729	114,260	素材	
TELKOM SA LTD	113	—	—	—	電気通信サービス	
FIRSTRAND LTD	3,126	5,258	23,530	160,710	各種金融	
PSG GROUP LTD	184	—	—	—	各種金融	
NASPERS LTD-N SHS	424	468	157,818	1,077,899	小売	
NEDBANK GROUP LTD	380	380	4,488	30,655	銀行	
NETCARE LTD	991	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PICK N PAY STORES LTD	622	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
RMB HOLDINGS LTD	743	—	—	—	各種金融	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	52	73	8,408	57,432	素材	
SAPPI LIMITED	499	—	—	—	素材	
SASOL LTD	570	572	6,440	43,991	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	447	584	8,335	56,934	食品・生活必需品小売り	
MR PRICE GROUP LTD	212	285	4,274	29,192	小売	
STANDARD BANK GROUP LTD	1,260	1,426	17,115	116,898	銀行	
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	232	4,336	29,620	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	836	1,104	4,249	29,025	小売	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	372	372	4,711	32,178	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABSA GROUP LTD	709	732	7,236	49,425	銀行	
TIGER BRANDS LTD	130	130	2,778	18,979	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	1,724	2,210	12,167	83,100	保険	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
INVESTEC LTD	288	—	—	—	各種金融
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	—	882	14,302	97,684	素材
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,888	19,726	素材
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	1,565	1,565	2,798	19,117	ヘルスケア機器・サービス
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	680	680	981	6,704	保険
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	1,360	1,012	3,237	22,112	保険
VODACOM GROUP	589	623	8,066	55,092	電気通信サービス
NEPI ROCKCASTLE PLC	321	334	2,314	15,809	不動産
OLD MUTUAL LTD	4,896	4,896	5,718	39,058	保険
REINET INVESTMENTS SCA	116	171	4,670	31,896	各種金融
PEPKOR HOLDINGS LTD	—	830	1,160	7,923	小売
MULTICHOICE GROUP LTD	405	405	5,448	37,214	メディア・娯楽
SIBANYE STILLWATER LTD	—	2,520	13,237	90,410	素材
BID CORP LTD	330	392	10,540	71,992	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	432,331	2,952,824	
	金額 <比率>	金額 <比率>	—	<3.6%>	
(アラブ首長国連邦)			千アラブ首長国 連邦ディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK	1,285	2,159	898	25,773	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	3,006	3,850	1,085	31,151	不動産
EMIRATES NBD PJSC	—	2,652	2,626	75,352	銀行
EMAAR DEVELOPMENT PJSC	305	—	—	—	不動産
EMAAR MALLS PJSC	1,796	1,796	262	7,524	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	1,682	2,004	3,407	97,747	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	2,694	3,311	1,987	57,007	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,598	2,832	3,331	95,571	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC	6,372	5,094	1,370	39,315	不動産
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	14,968	429,443	
	金額 <比率>	金額 <比率>	—	<0.5%>	
(サウジアラビア)			千サウジアラビリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	198	265	1,537	43,190	素材
JARIR MARKETING CO	50	71	1,339	37,612	小売
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	66	66	569	15,993	保険
ETIHAD ETISALAT CO	344	344	1,004	28,227	電気通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	322	717	1,708	47,996	銀行
AL RAJHI BANK	1,204	1,350	9,453	265,546	銀行
ARAB NATIONAL BANK	—	576	1,152	32,381	銀行
BANK ALBILAD	323	458	1,127	31,663	銀行
BANK AL-JAZIRA	358	358	484	13,600	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	483	690	2,161	60,719	銀行
RIYAD BANK	1,065	1,389	2,595	72,906	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP	1,016	1,016	3,111	87,402	銀行
SAUDI TELECOM CO	393	652	6,905	193,971	電気通信サービス
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	145	239	1,901	53,410	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	734	975	9,368	263,173	素材
SAUDI CEMENT	74	74	423	11,906	素材

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SAUDI ELECTRICITY CO	747	922	1,883	52,897	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	210	210	476	13,380	素材
SAVOLA	253	253	1,165	32,737	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	319	319	392	11,013	素材
ALMARAI CO	229	301	1,654	46,464	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY	461	461	442	12,441	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	322	322	499	14,037	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	98	98	593	16,661	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	661	661	707	19,871	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	470	470	398	11,191	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE	235	235	315	8,867	エネルギー
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	16	60	744	20,914	保険
ALINMA BANK	824	1,099	1,754	49,295	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	—	37	489	13,749	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO	368	449	1,736	48,774	素材
SAUDI AIRLINES CATERING CO	44	44	337	9,474	消費者サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	—	2,398	8,514	239,173	エネルギー
NATIONAL COMMERCIAL BANK	1,194	1,593	6,531	183,467	銀行
小 計	13,240	19,189	73,482	2,064,117	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	31	34	—	<2.5%>	
(中国オフショア)			千香港・オフショア人民元		
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	—	373	1,006	16,001	商業・専門サービス
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	—	103	562	8,951	食品・飲料・タバコ
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	—	154	409	6,510	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	—	80	611	9,728	素材
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	—	183	449	7,141	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	—	134	706	11,241	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	—	80	1,024	16,281	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	—	22	779	12,392	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	—	471	1,264	20,108	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	—	261	601	9,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	—	163	1,284	20,422	メディア・娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	—	235	539	8,571	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	—	285	836	13,295	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	—	41	65	1,035	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	—	301	921	14,654	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	—	337	1,285	20,434	素材
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	858	13,650	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	516	8,213	メディア・娯楽
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	—	210	795	12,649	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	—	1,033	568	9,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	—	703	640	10,191	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	—	242	729	11,593	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	—	134	793	12,619	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	—	274	654	10,407	食品・飲料・タバコ
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	—	136	663	10,552	資本財
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	—	250	928	14,767	資本財
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	—	288	581	9,245	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAIID GROUP CO-A	—	170	1,034	16,450	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	—	264	757	12,047	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	82	239	1,717	27,307	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	99	1,504	23,923	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	92	1,463	食品・飲料・タバコ
ADDSINO CO LTD -A	—	347	717	11,404	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	—	228	385	6,122	メディア・娯楽
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	—	348	580	9,223	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	—	470	715	11,381	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	—	922	503	8,004	素材
NAVINFO CO LTD-A	—	332	516	8,208	耐久消費財・アパレル
BY-HEALTH CO LTD-A	—	297	787	12,523	家庭用品・パーソナル用品
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	—	378	725	11,542	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	264	4,211	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	872	13,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	—	323	739	11,760	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	282	4,497	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	—	197	607	9,665	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	—	313	531	8,450	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	137	179	1,230	19,559	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	—	280	957	15,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	204	3,258	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	437	6,948	ヘルスケア機器・サービス
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	—	153	679	10,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	928	14,756	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	313	4,982	ヘルスケア機器・サービス
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	—	245	726	11,554	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	98	1,822	28,974	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	—	204	1,686	26,811	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	—	595	498	7,927	食品・飲料・タバコ
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	—	295	716	11,397	半導体・半導体製造装置
SONGCHEG PERFORMANCE DEVE-A	—	334	573	9,118	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	—	135	488	7,774	ソフトウェア・サービス
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	—	385	561	8,929	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	799	12,718	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	2,983	2,983	1,193	18,971	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	—	536	652	10,380	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	1,683	594	3,543	56,337	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	226	226	236	3,765	資本財
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	1,370	21,787	メディア・娯楽

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	727	11,573	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	—	303	722	11,490	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	—	557	526	8,378	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	450	7,160	ソフトウェア・サービス
GOERTEK INC -A	—	269	1,257	19,995	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	—	806	671	10,675	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	240	240	830	13,203	銀行
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	—	1,020	693	11,028	耐久消費財・アパレル
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	1,845	199	168	2,679	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	—	793	558	8,876	消費者サービス
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	324	12	60	954	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	—	71	730	11,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	170	170	425	6,757	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	1,288	152	409	6,506	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,628	25,898	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	164	212	5,724	91,011	食品・飲料・タバコ
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	—	341	586	9,320	メディア・娯楽
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	—	641	546	8,683	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNING.COM CO LTD-A	458	458	449	7,151	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	613	9,748	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	250	547	805	12,802	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	185	185	1,249	19,869	耐久消費財・アパレル
MIDEA GROUP CO LTD-A	206	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	424	585	2,831	45,019	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PING AN BANK CO LTD-A	851	1,194	2,130	33,868	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	639	381	722	11,491	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	1,114	17,724	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	1,587	25,247	不動産
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	758	—	—	—	資本財
ZTE CORP-A	—	126	479	7,626	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	—	801	608	9,679	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	—	432	727	11,567	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	1,070	17,025	各種金融
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	201	201	243	3,878	資本財
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	—	500	704	11,193	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	—	436	617	9,823	半導体・半導体製造装置
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	—	165	310	4,934	メディア・娯楽
CHACHA FOOD CO LTD-A	—	100	543	8,641	食品・飲料・タバコ
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	—	31	633	10,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	—	277	478	7,601	食品・飲料・タバコ
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	—	224	631	10,034	半導体・半導体製造装置
PERFECT WORLD CO LTD-A	—	228	686	10,908	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	—	48	1,080	17,179	食品・飲料・タバコ
GUOCHENG MINING CO LTD-A	—	311	344	5,483	資本財

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	—	80	590	9,389	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	—	185	565	8,995	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	—	690	478	7,602	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	—	218	413	6,577	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	—	825	309	4,919	半導体・半導体製造装置
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	—	38	1,095	17,416	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	248	248	309	4,925	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	—	137	1,142	18,162	運輸
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	—	602	646	10,280	各種金融
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	—	236	950	15,114	素材
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	455	455	361	5,751	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	—	269	426	6,787	ソフトウェア・サービス
CSC FINANCIAL CO LTD-A	—	241	1,097	17,442	各種金融
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	—	111	592	9,426	資本財
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	—	40	456	7,254	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	—	163	658	10,477	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	846	13,467	素材
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	—	437	711	11,311	各種金融
CHONGQING FULING ZHACAI-A	—	211	899	14,298	食品・飲料・タバコ
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	—	112	759	12,075	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	—	104	1,072	17,048	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	—	70	726	11,545	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OPPEIN HOME GROUP INC-A	—	77	1,013	16,113	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	—	156	721	11,474	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	—	87	473	7,522	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	—	47	594	9,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	—	97	588	9,355	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	875	13,914	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	—	55	791	12,577	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	—	92	680	10,821	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	68	68	1,164	18,514	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	—	441	587	9,346	各種金融
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	—	28	287	4,575	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	—	427	564	8,982	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	—	451	649	10,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	—	53	2,013	32,021	ヘルスケア機器・サービス
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	—	50	225	3,587	素材
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	—	30	604	9,611	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	—	139	956	15,215	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	—	14	473	7,527	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	63	134	3,570	56,765	資本財
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	—	44	1,008	16,033	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD-A	—	88	1,053	16,751	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BATC BLUEPARK NEW ENERGY -A	—	1,047	755	12,006	自動車・自動車部品
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	—	42	486	7,734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	—	18	1,028	16,345	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	—	29	694	11,041	半導体・半導体製造装置
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	—	946	586	9,325	各種金融
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	—	2,201	460	7,314	素材
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	—	467	617	9,823	各種金融
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	—	1,067	610	9,704	運輸
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	—	1,415	673	10,709	銀行
PETROCHINA CO LTD-A	—	1,000	418	6,646	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,612	2,612	1,300	20,682	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	3,536	1,135	18,047	銀行
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	—	200	358	5,698	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	855	1,049	4,513	71,770	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	504	668	5,543	88,134	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	952	952	1,712	27,231	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,383	1,383	1,304	20,736	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	2,736	2,736	1,428	22,708	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	1,209	19,236	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	51	76	13,243	210,572	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	—	989	454	7,233	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	432	432	1,307	20,791	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	182	182	608	9,679	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	444	444	217	3,452	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,040	1,340	2,728	43,379	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,223	1,223	797	12,678	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	—	1,289	525	8,362	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,109	2,109	1,119	17,806	資本財
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	4,943	1,102	477	7,586	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,194	1,194	747	11,884	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	343	343	1,355	21,548	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	580	580	278	4,426	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	7,492	1,664	820	13,043	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	387	387	253	4,024	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	294	294	1,628	25,899	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	562	730	1,624	25,823	各種金融
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	439	818	1,324	21,057	不動産
CRRC CORP LTD-A	—	790	442	7,034	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	207	317	2,837	45,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	—	534	612	9,738	素材
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	—	632	535	8,521	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	—	315	628	9,996	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	—	816	623	9,912	資本財
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	260	738	11,744	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	1,153	18,347	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	799	12,709	銀行
GEMDALE CORP-A	—	455	653	10,395	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	406	406	1,021	16,248	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	475	175	1,529	24,319	素材

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	140	182	258	4,112	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	210	823	780	12,414	メディア・娯楽
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	—	828	789	12,546	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	—	676	642	10,210	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	486	486	1,125	17,888	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	148	148	2,952	46,946	小売
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	539	8,575	素材
AVIC CAPITAL CO LTD -A	—	1,225	563	8,959	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	—	1,643	540	8,594	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	—	28	65	1,037	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AIR CHINA LTD-A	259	259	186	2,965	運輸
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	649	10,327	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	373	5,937	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	—	160	498	7,932	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	—	1,140	611	9,715	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	1,197	19,033	自動車・自動車部品
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	236	236	329	5,234	素材
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	435	6,927	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	505	505	411	6,544	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	573	104	192	3,055	ヘルスケア機器・サービス
ZHONGJIN GOLD CORP-A	340	340	340	5,406	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	—	879	774	12,312	各種金融
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	149	72	187	2,986	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	1,017	16,178	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	409	409	245	3,901	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	405	405	328	5,215	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO-A	—	612	577	9,185	エネルギー
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	—	443	806	12,819	資本財
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	1,500	1,500	819	13,022	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	191	3,040	運輸
CHINA SPACESAT CO LTD -A	—	161	529	8,419	資本財
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	170	170	402	6,403	小売
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	—	1,400	459	7,301	不動産
SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	—	878	532	8,459	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	—	966	681	10,828	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	—	91	856	13,615	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	572	388	1,881	29,912	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	3,746	3,746	1,060	16,855	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	373	373	1,566	24,908	自動車・自動車部品
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	633	—	—	—	運輸
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	—	600	381	6,067	素材
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	39	39	902	14,344	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	195	195	293	4,669	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	67	67	1,577	25,086	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	—	208	547	8,704	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	909	562	8,946	エネルギー

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	—	85	165	2,625	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	67	506	8,049	ソフトウェア・サービス
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	—	234	833	13,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	—	115	763	12,144	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG HUAAHAI PHARMACEUT-A	—	90	305	4,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	—	310	409	6,506	運輸
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	—	243	678	10,791	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	1,017	16,178	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	—	47	306	4,874	ソフトウェア・サービス
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	—	356	586	9,328	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	—	79	834	13,261	食品・飲料・タバコ
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	—	100	252	4,014	素材
ANXIN TRUST CO LTD-A	319	—	—	—	各種金融
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	—	180	1,581	25,143	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	—	432	700	11,141	素材
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	163	163	1,176	18,704	半導体・半導体製造装置
HLA CORP LTD-A	214	—	—	—	小売
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	383	383	378	6,016	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	118	141	2,391	38,020	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	—	173	856	13,624	食品・飲料・タバコ
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	—	293	763	12,140	自動車・自動車部品
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	816	12,988	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	—	22	132	2,112	食品・飲料・タバコ
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	434	434	366	5,824	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	578	578	351	5,587	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	170	170	218	3,467	メディア・娯楽
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	—	50	822	13,080	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	—	26	500	7,964	半導体・半導体製造装置
SDIC CAPITAL CO LTD-A	—	458	683	10,872	各種金融
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	—	47	1,109	17,634	ヘルスケア機器・サービス
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	—	78	812	12,924	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	—	82	808	12,856	資本財
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	—	86	618	9,832	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	317	317	372	5,922	各種金融
SPRING AIRLINES CO LTD-A	83	83	381	6,060	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	1,018	36	71	1,129	各種金融
DAWNING INFORMATION INDUST-A	—	56	209	3,338	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	—	110	928	14,756	商業・専門サービス
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	—	1,176	752	11,966	不動産
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	128	128	437	6,950	不動産
小 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	83,906 114	131,897 284	245,922 —	3,910,161 <4.7%>
合 計	株 数 銘 柄 数 <比 率>	2,583,182 1,031	2,692,452 1,180	— —	79,013,034 <95.8%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄		当期首(前期末)		当 期		末	
		口	数 (口)	口	数 (口)	評 価 額	
						外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(メキシコ)						千メキシコペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA			308,400	308,400		5,353	27,625
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV			43,300	58,400		5,074	26,186
小 計	口 数 ・ 金 額		351,700	366,800		10,428	53,812
	銘 柄 数 <比 率>		2	2		—	<0.1%>
(ブラジル)						千ブラジルレアル	
SUL AMERICA SA-UNITS			16,562	26,962		1,118	21,858
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT			39,900	58,600		2,005	39,183
ENERGISA SA-UNITS			16,500	16,500		763	14,924
KLABIN SA-UNIT			83,000	64,600		1,520	29,714
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT			25,400	25,400		1,993	38,960
小 計	口 数 ・ 金 額		181,362	192,062		7,402	144,641
	銘 柄 数 <比 率>		5	5		—	<0.2%>
(南アフリカ)						千南アフリカランド	
REDEFINE PROPERTIES LTD			547,985	—		—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD			295,047	295,047		3,693	25,229
FORTRESS REIT LTD-A			189,245	—		—	—
小 計	口 数 ・ 金 額		1,032,277	295,047		3,693	25,229
	銘 柄 数 <比 率>		3	1		—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額		1,565,339	853,909		—	223,683
	銘 柄 数 <比 率>		10	8		—	<0.3%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄	別	当 期		末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	MSCI EMERG M		3,138		—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	79,013,034	94.9%
投 資 信 託 受 益 証 券	170,828	0.2
投 資 証 券	52,855	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,019,447	4.8
投 資 信 託 財 産 総 額	83,256,164	100.0

(注1) 当期末における外貨純資産(83,240,253千円)の投資信託財産総額(83,256,164千円)に対する比率は100.0%です。

(注2) 外貨資産は、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=105.21円	1メキシコペソ=5.16円	1ブラジルレアル=19.54円
1チリペソ=0.1391円	1コロンビアペソ=0.0288円	1ユーロ=124.27円
1イギリスポンド=138.52円	1トルコリラ=12.95円	1チェココルナ=4.68円
1ハンガリーフォリント=0.3459円	1ポーランドズロチ=27.69円	1香港ドル=13.57円
1マレーシアリンギット=25.58円	1タイバーツ=3.46円	1フィリピンペソ=2.19円
1インドネシアルピア=0.0075円	1韓国ウォン=0.0942円	1新台幣ドル=3.69円
1インドルピー=1.43円	1パキスタンルピー=0.67円	1カタールリアル=28.47円
1南アフリカランド=6.83円	1アラブ首長国連邦ディルハム=28.69円	1サウジアラビアリアル=28.09円
1香港・オフショア人民元=15.90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 2020年11月10日現在
(A) 資 産	84,084,278,293円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,566,848,225
株 式(評価額)	79,013,034,918
投資信託受益証券(評価額)	170,828,015
投 資 証 券(評価額)	52,855,672
未 収 入 金	1,081,124,886
未 収 配 当 金	61,787,807
差 入 委 託 証 拠 金	1,137,798,770
(B) 負 債	1,580,518,713
未 払 金	841,743,101
未 払 解 約 金	738,775,590
未 払 利 息	22
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	82,503,759,580
元 本	26,069,398,222
次 期 繰 越 損 益 金	56,434,361,358
(D) 受 益 権 総 口 数	26,069,398,222口
1万口当たり基準価額(C/D)	31,648円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	1,424,778,246円
受 取 配 当 金	1,419,032,488
受 取 利 息	4,885,414
そ の 他 収 益 金	1,011,228
支 払 利 息	△150,884
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,399,152,581
売 買 益	16,825,994,012
売 買 損	△10,426,841,431
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	537,134,581
取 引 益	1,462,096,216
取 引 損	△924,961,635
(D) そ の 他 費 用	△99,855,318
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	8,261,210,090
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	40,581,859,847
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,682,933,655
(H) 解 約 差 損 益 金	△3,091,642,234
(I) 計 (E+F+G+H)	56,434,361,358
次 期 繰 越 損 益 金(I)	56,434,361,358

(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21,641,099,794円、期中追加設定元本額は6,101,145,339円、期中一部解約元本額は1,672,846,911円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,527,649,401円
DC世界経済インデックスファンド	5,089,165,939円
DC新興国株式インデックス・オープン	4,620,749,680円
世界経済インデックスファンド	4,032,144,151円
分散投資コア戦略ファンドS	1,286,691,180円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	630,188,596円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	571,145,613円
グローバル経済コア	420,561,727円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	343,620,707円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	326,426,791円
分散投資コア戦略ファンドA	323,155,672円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	306,692,520円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	192,442,399円
SMT インデックスバランス・オープン	105,988,335円
SMT 世界経済インデックス・オープン	103,644,788円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	82,225,009円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	60,827,041円
i-SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	22,536,881円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	19,028,469円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	2,570,105円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2040	609,917円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2060	531,321円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2030	492,755円
DCターゲット・イヤーフンド(6資産・運用継続型)2050	309,225円

お知らせ

該当事項はありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年12月11日から無期限です。
運用方針	新興国の現地通貨建て債券等に投資し、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	新興国の債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
	期騰	期中落率	期騰	期中落率					
	円	%		%	%	%	%	百万円	
第8期(2016年11月10日)	14,906	△5.4	27,964.08	△5.3	96.4	—	—	22,824	
第9期(2017年11月10日)	17,081	14.6	32,201.21	15.2	96.8	—	—	31,411	
第10期(2018年11月12日)	16,292	△4.6	30,698.89	△4.7	95.9	—	—	45,550	
第11期(2019年11月11日)	17,520	7.5	33,355.04	8.7	96.7	—	—	53,734	
第12期(2020年11月10日)	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—	—	61,667	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	騰	落率	騰	落率		
(当期首) 2019年11月11日	円	%		%	%	%
	17,520	—	33,355.04	—	96.7	—
11月末	17,376	△0.8	32,946.41	△1.2	96.6	—
12月末	18,038	3.0	34,229.08	2.6	96.9	—
2020年1月末	17,799	1.6	33,847.00	1.5	94.3	—
2月末	17,440	△0.5	33,243.73	△0.3	95.4	—
3月末	15,028	△14.2	28,753.19	△13.8	95.5	—
4月末	15,355	△12.4	29,315.07	△12.1	94.4	—
5月末	16,317	△6.9	31,237.36	△6.3	92.3	—
6月末	16,517	△5.7	31,553.01	△5.4	91.9	—
7月末	16,479	△5.9	31,502.50	△5.6	94.4	—
8月末	16,514	△5.7	31,592.84	△5.3	94.9	—
9月末	16,094	△8.1	30,913.68	△7.3	96.7	—
10月末	16,082	△8.2	30,873.66	△7.4	97.3	—
(当期末) 2020年11月10日	16,930	△3.4	32,614.59	△2.2	97.2	—

(注1)騰落率は期首比です。

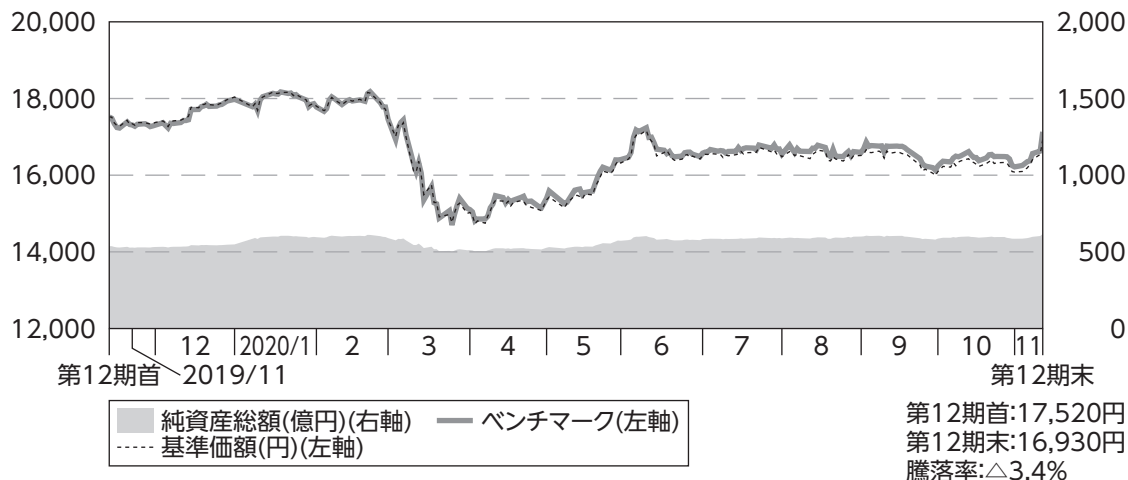
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイドとは、新興国の現地通貨建債券市場の動向を測るためにJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが開発した、時価総額ベースの債券インデックスです。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算したものです。同指数に関する商標・著作権等の知的財産権、指数値の算出、利用その他一切の権利はJPモルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



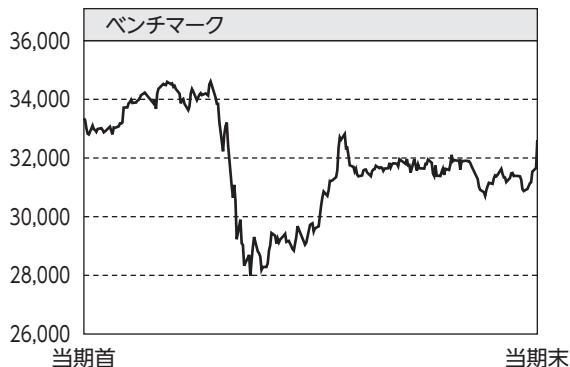
(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は下落しました。

2020年2月下旬にかけて、新興国通貨が概ねレンジ内の動きとなった一方、新興国金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は緩やかな上昇推移となりました。3月には、新型コロナウイルス感染の世界的拡大を背景に市場の不安心理が高まり、新興国通貨が対円で下落するとともに新興国金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は大幅に下落しました。4月以降6月上旬にかけては、市場の不安心理が和らぎリスク回避姿勢が後退したことから、新興国通貨が対円で上昇するとともに、新興国金利が再び低下し、基準価額は上昇しました。その後6月下旬にかけては、欧米株式市場の下落を受けたリスク回避の動きを受けて、新興国通貨が対円で下落し、基準価額は下落しました。7月以降期末にかけては、新型コロナウイルスのワクチン開発進展への期待が高まった一方で、欧州を中心に新型コロナウイルスの感染が再拡大したことなどを背景に、新興国金利に加え新興国通貨も対円でレンジ内推移となり、基準価額は概ねもみ合いで推移しました。

投資環境



新興国為替市場では、2020年2月下旬にかけて、新興国通貨は対円で概ねレンジ内で推移しました。3月に新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、新興国通貨は大幅に下落しましたが、4月以降6月上旬にかけては、市場の不安心理が和らいだことから、上昇しました。7月以降は、レンジ内推移が続きました。

新興国債券市場では、2020年2月にかけて金利は緩やかな低下推移となりましたが、3月にはリスク資産を現金化する動きが強まり、大幅に上昇しました。その後は、世界各国が一斉に金融緩和や資金供給を強めたことで市場の不安心理が和らぎ、金利は低下に転じ、6月以降は緩やかな低下推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバースィファイド(円換算ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 債券組入比率

期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

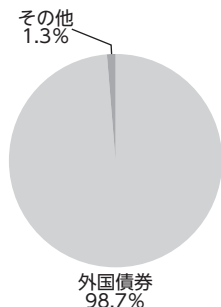
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	COLOM 9.85% 06/28/27	コロンビア	5.6%
2	BLTN 0% 01/01/24	ブラジル	1.6%
3	SAGB 10.5% 12/21/26	南アフリカ	1.6%
4	BLTN 0% 07/01/23	ブラジル	1.4%
5	BNTNF 10% 01/01/23	ブラジル	1.4%
6	BNTNF 10% 01/01/25	ブラジル	1.3%

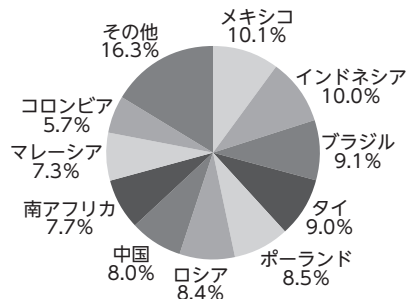
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MGS 3.885% 08/15/29	マレーシア	1.1%
8	CGB 2.94% 10/17/24	中国	1.1%
9	THAIGB 3.3% 06/17/38	タイ	1.1%
10	MBONO 7.5% 06/03/27	メキシコ	1.0%
組入銘柄数		202	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

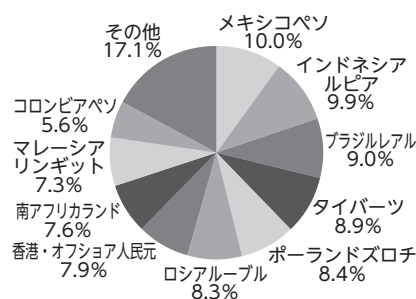
○資産別配分



○国別配分



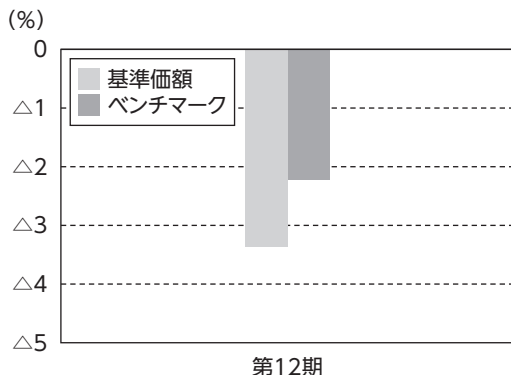
○通貨別配分



(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。

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。

取引コスト、カストディコスト、キャッシュ保有などが主なマイナス要因となりました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	16 (16) (-) (0)	0.095 (0.095) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	16	0.095	

(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(16,586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＞

			期	
			買付額	売付額
外	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 327,855	千メキシコペソ 154,652
	ブラジル	国債証券	千ブラジルリアル 145,246	千ブラジルリアル 66,749
	チリ	国債証券	千チリペソ 3,556,334	千チリペソ 3,082,730
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 64,181,840	千コロンビアペソ 57,269,000
	ペルー	国債証券	千ペルーヌエボソル 10,458	千ペルーヌエボソル 13,299
	ドミニカ共和国	国債証券	千ドミニカペソ 8,295	千ドミニカペソ 8,222
	トルコ	国債証券	千トルコリラ 17,491	千トルコリラ 27,682
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 191,655	千チェココルナ 115,184
	ハンガリー	国債証券	千ハンガリーフォリント 2,190,127	千ハンガリーフォリント 1,378,860
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 52,506	千ポーランドズロチ 41,530
	ロシア	国債証券	千ロシアルーブル 1,347,851	千ロシアルーブル 431,588
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリングgit 101,807	千マレーシアリングgit 64,438
	タイ	国債証券	千タイバーツ 439,013	千タイバーツ 261,514
	国	フィリピン	国債証券	千フィリピンペソ 12,290
インドネシア		国債証券	千インドネシアルピア 252,540,680	千インドネシアルピア 177,289,190
南アフリカ		国債証券	千南アフリカランド 140,781	千南アフリカランド 87,956
中国オフショア		国債証券	千香港・オフショア人民元 306,254	千香港・オフショア人民元 -

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 231	百万円 231	100.0	百万円 231	百万円 231	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	144,906	16,578	11.4	145,280	16,724	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。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A) 債券種類別開示

区 分	額 面 金 額	当 期		組 入 比 率	うちBB格 以下組入比率	未		
		評 価 額				残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
メ キ シ コ	千メキシコペソ 1,039,450	千メキシコペソ 1,157,194	千円 5,971,123	% 9.7	% —	% 5.3	% 2.9	% 1.6
ブ ラ ジ ル	千ブラジルレアル 283,550	千ブラジルレアル 279,488	5,461,204	8.9	8.9	1.6	5.7	1.5
チ リ	千チリペソ 10,145,000	千チリペソ 11,849,908	1,648,322	2.7	—	1.8	0.8	—
コ ロ ン ビ ア	千コロンビアペソ 90,300,000	千コロンビアペソ 116,813,886	3,364,239	5.5	—	5.5	—	—
ペ ル ー	千ペルーヌエボソル 52,000	千ペルーヌエボソル 62,290	1,828,211	3.0	—	2.8	0.2	—
ウ ル グ ア イ	千ウルグアイペソ 32,950	千ウルグアイペソ 34,391	84,946	0.1	—	0.1	—	0.1
ドミニカ共和国	千ドミニカペソ 45,400	千ドミニカペソ 46,962	84,533	0.1	0.1	0.1	0.1	—
ト ル コ	千トルコリラ 97,100	千トルコリラ 89,448	1,158,354	1.9	1.9	0.6	0.8	0.5
チ ェ コ	千チェココルナ 502,400	千チェココルナ 534,269	2,500,380	4.1	—	2.7	1.0	0.3
ハンガリー	千ハンガリーフォリント 6,268,500	千ハンガリーフォリント 6,878,419	2,379,245	3.9	—	1.9	1.5	0.4
ポーランド	千ポーランドズロチ 168,700	千ポーランドズロチ 185,027	5,123,416	8.3	—	3.4	3.8	1.1
ロ シ ア	千ロシアルーブル 3,355,650	千ロシアルーブル 3,669,136	5,026,716	8.2	—	5.1	2.2	0.8
マレーシア	千マレーシアリンギット 158,200	千マレーシアリンギット 170,972	4,373,475	7.1	—	3.8	3.3	—
タ イ	千タイバーツ 1,388,400	千タイバーツ 1,574,452	5,447,604	8.8	—	6.2	1.9	0.8
フィリピン	千フィリピンペソ 45,000	千フィリピンペソ 54,199	118,696	0.2	—	0.1	0.1	—
インドネシア	千インドネシアルピア 731,000,000	千インドネシアルピア 796,262,765	5,971,970	9.7	—	6.7	2.5	0.5
南アフリカ	千南アフリカランド 736,600	千南アフリカランド 670,237	4,577,723	7.4	7.4	6.9	0.5	—
中国オフショア	千香港・オフショア人民元 304,800	千香港・オフショア人民元 302,417	4,808,433	7.8	—	4.8	3.0	—
合 計	—	—	59,928,600	97.2	18.3	59.4	30.3	7.5

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(メキシコ)						
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ			
MBONO 10% 11/20/36	10.0	30,800	41,158	212,377	2036/11/20	
MBONO 10% 12/05/24	10.0	82,250	97,906	505,196	2024/12/5	
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	61,800	63,506	327,692	2026/3/5	
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	108,200	111,786	576,820	2022/6/9	
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	51,950	54,608	281,778	2023/3/9	
MBONO 7.25% 12/09/21	7.25	72,300	74,576	384,815	2021/12/9	
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	108,650	121,019	624,462	2027/6/3	
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	46,200	52,338	270,067	2031/5/29	
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	61,500	67,443	348,007	2042/11/13	
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	29,200	32,821	169,361	2034/11/23	
MBONO 8% 09/05/24	8.0	73,900	82,280	424,566	2024/9/5	
MBONO 8% 11/07/47	8.0	63,700	71,173	367,254	2047/11/7	
MBONO 8% 12/07/23	8.0	97,950	107,556	554,993	2023/12/7	
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	93,600	111,010	572,814	2029/5/31	
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	57,450	68,007	350,916	2038/11/18	
小計				5,971,123		
(ブラジル)						
国債証券		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル			
BLTN 0% 01/01/22	—	28,550	27,502	537,389	2022/1/1	
BLTN 0% 01/01/24	—	61,500	51,130	999,081	2024/1/1	
BLTN 0% 07/01/22	—	22,300	20,818	406,795	2022/7/1	
BLTN 0% 07/01/23	—	51,200	44,303	865,689	2023/7/1	
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	37,750	41,530	811,506	2023/1/1	
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	35,250	39,902	779,704	2025/1/1	
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	26,850	30,827	602,374	2027/1/1	
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	13,200	15,437	301,645	2029/1/1	
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	3,200	3,765	73,569	2031/1/1	
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,677	32,775	2028/1/10	
BRAZIL 12.5% 01/05/22	12.5	45,052	50,000	9,787	2022/1/5	
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	1,900	2,092	40,885	2024/1/5	
小計				5,461,204		
(チリ)						
国債証券		千チリペソ	千チリペソ			
BTPLC 2.5% 03/01/25	2.5	2,535,000	2,662,270	370,321	2025/3/1	
BTPLC 4% 03/01/23	4.0	945,000	1,021,364	142,071	2023/3/1	
BTPLC 4.5% 03/01/26	4.5	1,690,000	1,949,617	271,191	2026/3/1	
BTPLC 4.7% 09/01/30	4.7	1,480,000	1,751,515	243,635	2030/9/1	
BTPLC 5% 03/01/35	5.0	1,930,000	2,309,381	321,235	2035/3/1	
BTPLC 6% 01/01/43	6.0	1,565,000	2,155,758	299,865	2043/1/1	
小計				1,648,322		
(コロンビア)						
国債証券		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ			
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	90,300,000	116,813,886	3,364,239	2027/6/28	
(ペルー)						
国債証券		千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル			
PERUGB 5.35% 08/12/40	5.35	3,950	3,962	116,284	2040/8/12	
PERUGB 5.4% 08/12/34	5.4	5,400	5,799	170,226	2034/8/12	
PERUGB 5.7% 08/12/44	5.7	3,650	4,298	126,162	2044/8/12	
PERUGB 5.94% 02/12/29	5.94	7,150	8,670	254,481	2029/2/12	
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	6,050	7,100	208,412	2032/8/12	
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	6,450	7,983	234,326	2028/8/12	
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	6,950	8,347	244,999	2037/8/12	
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	6,750	8,503	249,584	2031/8/12	
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	5,650	7,622	223,732	2026/8/12	
小計				1,828,211		
(ウルグアイ)						
国債証券		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ			
URUGUA 8.5% 03/15/28	8.5	15,600	16,368	40,430	2028/3/15	
URUGUA 9.875% 06/20/22	9.875	17,350	18,022	44,515	2022/6/20	
小計				84,946		
(ドミニカ共和国)						
国債証券		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ			
DOMREP 8.9% 02/15/23	8.9	20,400	20,714	37,285	2023/2/15	
DOMREP 9.75% 06/05/26	9.75	25,000	26,248	47,247	2026/6/5	
小計				84,533		

銘柄	利率 (%)	期		末		償還年月日
		額面金額	評価額	額	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(トルコ)						
国債証券		千トルコリラ	千トルコリラ			
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	3,950	3,595	46,555	2024/3/20	
TURKGB 10.5% 08/11/27	10.5	8,650	7,755	100,433	2027/8/11	
TURKGB 10.6% 02/11/26	10.6	9,950	9,113	118,019	2026/2/11	
TURKGB 10.7% 08/17/22	10.7	8,150	7,661	99,209	2022/8/17	
TURKGB 11% 02/24/27	11.0	9,150	8,363	108,308	2027/2/24	
TURKGB 11% 03/02/22	11.0	6,550	6,264	81,127	2022/3/2	
TURKGB 12.2% 01/18/23	12.2	9,900	9,547	123,635	2023/1/18	
TURKGB 12.4% 03/08/28	12.4	4,700	4,558	59,306	2028/3/8	
TURKGB 16.2% 06/14/23	16.2	6,000	6,249	80,924	2023/6/14	
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	6,200	5,346	69,235	2023/3/8	
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	7,100	5,748	74,446	2025/3/12	
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	3,750	3,420	44,300	2022/9/14	
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	7,250	6,344	82,163	2024/7/24	
TURKGB 9.5% 01/12/22	9.5	5,800	5,479	70,955	2022/1/12	
小計				1,158,354		
(チェコ)						
国債証券		千チェココロン	千チェココロン			
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	48,700	47,032	220,112	2027/2/10	
CZGB 0.45% 10/25/23	0.45	50,000	50,226	235,057	2023/10/25	
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	46,900	46,501	217,628	2030/5/15	
CZGB 1% 06/26/26	1.0	67,200	68,382	320,227	2026/6/26	
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	30,900	31,257	146,285	2031/3/13	
CZGB 2% 10/13/33	2.0	49,200	54,234	253,818	2033/10/13	
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	39,500	42,921	200,870	2025/9/17	
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	47,800	53,661	251,136	2028/8/25	
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	48,700	56,160	262,830	2029/7/23	
CZGB 4.7% 09/12/22	4.7	35,800	38,932	182,202	2022/9/12	
CZGB 5.7% 05/25/24	5.7	37,700	44,959	210,410	2024/5/25	
小計				2,500,380		
(ハンガリー)						
国債証券		千ハンガリーフォリント	千ハンガリーフォリント			
HGB 1% 11/26/25	1.0	475,000	467,039	161,548	2025/11/26	
HGB 1.5% 08/23/23	1.5	322,500	325,660	112,645	2023/8/23	
HGB 1.75% 10/26/22	1.75	462,000	470,246	162,658	2022/10/26	
HGB 2.5% 10/24/24	2.5	548,000	575,361	199,017	2024/10/24	
HGB 2.75% 12/22/26	2.75	470,500	503,547	174,177	2026/12/22	
HGB 3% 06/26/24	3.0	402,500	428,328	148,158	2024/6/26	
HGB 3% 08/21/30	3.0	555,000	602,702	208,474	2030/8/21	
HGB 3% 10/27/27	3.0	592,000	643,344	222,532	2027/10/27	
HGB 3% 10/27/38	3.0	186,000	204,797	70,839	2038/10/27	
HGB 3.25% 10/22/31	3.25	452,000	501,453	173,452	2031/10/22	
HGB 5.5% 06/24/25	5.5	660,000	785,089	271,562	2025/6/24	
HGB 6.0% 11/24/23	6.0	531,000	607,671	210,193	2023/11/24	
HGB 6.75% 10/22/28	6.75	332,000	454,328	157,152	2028/10/22	
HGB 7% 06/24/22	7.0	280,000	308,848	106,830	2022/6/24	
小計				2,379,245		
(ポーランド)						
国債証券		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ			
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,350	4,353	120,557	2030/10/25	
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	12,000	12,390	343,082	2022/4/25	
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	10,850	11,729	324,789	2024/10/25	
POLGB 2.5% 01/25/23	2.5	19,900	20,981	580,979	2023/1/25	
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	19,850	21,496	595,234	2024/4/25	
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	19,400	21,483	594,885	2026/7/25	
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	14,950	16,635	460,635	2027/7/25	
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	14,200	16,071	445,025	2028/4/25	
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	15,050	17,158	475,114	2029/10/25	
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	13,250	15,027	416,114	2025/7/25	
POLGB 4% 10/25/23	4.0	14,050	15,688	434,410	2023/10/25	
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	10,850	12,011	332,586	2022/9/23	
小計				5,123,416		
(ロシア)						
国債証券		千ロシアルーブル	千ロシアルーブル			
RFLB 4.5% 07/16/25	4.5	82,500	80,642	110,480	2025/7/16	

銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
RFLB 6% 10/06/27	6.0	213,500	220,210	301,688	2027/10/6
RFLB 6.5% 02/28/24	6.5	163,100	171,401	234,820	2024/2/28
RFLB 6.9% 05/23/29	6.9	158,000	171,257	234,623	2029/5/23
RFLB 7% 01/25/23	7.0	71,200	74,893	102,604	2023/1/25
RFLB 7% 08/16/23	7.0	107,200	113,522	155,526	2023/8/16
RFLB 7% 12/15/21	7.0	132,500	136,198	186,591	2021/12/15
RFLB 7.05% 01/19/28	7.05	146,000	159,296	218,235	2028/1/19
RFLB 7.1% 10/16/24	7.1	164,100	176,620	241,970	2024/10/16
RFLB 7.15% 11/12/25	7.15	210,400	229,100	313,867	2025/11/12
RFLB 7.25% 05/10/34	7.25	160,500	177,418	243,063	2034/5/10
RFLB 7.4% 07/17/24	7.4	202,200	219,178	300,274	2024/7/17
RFLB 7.4% 12/07/22	7.4	165,100	174,698	239,337	2022/12/7
RFLB 7.6% 07/20/22	7.6	198,700	208,879	286,164	2022/7/20
RFLB 7.65% 04/10/30	7.65	226,500	257,795	353,179	2030/4/10
RFLB 7.7% 03/16/39	7.7	146,500	171,286	234,662	2039/3/16
RFLB 7.7% 03/23/33	7.7	158,000	180,034	246,647	2033/3/23
RFLB 7.75% 09/16/26	7.75	180,500	202,898	277,970	2026/9/16
RFLB 7.95% 10/07/26	7.95	181,000	205,424	281,431	2026/10/7
RFLB 8.15% 02/03/27	8.15	156,000	179,025	245,265	2027/2/3
RFLB 8.5% 09/17/31	8.5	132,150	159,351	218,311	2031/9/17
小計				5,026,716	
(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					
MCS 3.478% 06/14/24	3.478	5,150	5,415	138,529	2024/6/14
MCS 3.48% 03/15/23	3.48	22,850	23,747	607,456	2023/3/15
MCS 3.502% 05/31/27	3.502	9,450	10,151	259,667	2027/5/31
MCS 3.733% 06/15/28	3.733	6,950	7,555	193,274	2028/6/15
MCS 3.757% 04/20/23	3.757	4,850	5,069	129,673	2023/4/20
MCS 3.8% 08/17/23	3.8	8,650	9,103	232,856	2023/8/17
MCS 3.828% 07/05/34	3.828	7,500	8,239	210,777	2034/7/5
MCS 3.885% 08/15/29	3.885	24,350	26,802	685,602	2029/8/15
MCS 3.899% 11/16/27	3.899	13,500	14,805	378,713	2027/11/16
MCS 3.9% 11/30/26	3.9	8,050	8,790	224,851	2026/11/30
MCS 3.906% 07/15/26	3.906	8,400	9,153	234,156	2026/7/15
MCS 3.955% 09/15/25	3.955	9,400	10,234	261,799	2025/9/15
MCS 4.059% 09/30/24	4.059	13,800	14,863	380,210	2024/9/30
MCS 4.181% 07/15/24	4.181	9,450	10,185	260,552	2024/7/15
MCS 4.762% 04/07/37	4.762	5,850	6,855	175,354	2037/4/7
小計				4,373,475	
(タイ)		千タイバート	千タイバート		
国債証券					
THAIGB 1.45% 12/17/24	1.45	86,000	88,333	305,632	2024/12/17
THAIGB 1.6% 06/17/25	1.6	37,400	37,638	130,228	2035/6/17
THAIGB 1.6% 12/17/29	1.6	80,200	82,253	284,598	2029/12/17
THAIGB 1.875% 06/17/22	1.875	67,300	68,724	237,785	2022/6/17
THAIGB 2% 12/17/22	2.0	53,500	55,076	190,563	2022/12/17
THAIGB 2.125% 12/17/26	2.125	96,100	102,495	354,634	2026/12/17
THAIGB 2.4% 12/17/23	2.4	101,000	106,389	368,107	2023/12/17
THAIGB 2.875% 12/17/28	2.875	65,400	73,644	254,809	2028/12/17
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	157,100	192,412	665,748	2038/6/17
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	126,700	156,980	543,150	2036/6/17
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	84,000	90,499	313,129	2023/6/16
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	114,300	139,499	482,669	2031/6/20
THAIGB 3.65% 12/17/21	3.65	63,100	65,257	225,790	2021/12/17
THAIGB 3.775% 06/25/32	3.775	80,400	100,293	347,015	2032/6/25
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	82,400	94,544	327,125	2025/12/12
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	93,500	120,409	416,616	2029/6/22
小計				5,447,604	
(フィリピン)		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
国債証券					
PHILIP 3.9% 11/26/22	3.9	15,000	15,326	33,564	2022/11/26
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	30,000	38,873	85,132	2036/1/14
小計				118,696	
(インドネシア)		千インドネシアルピア	千インドネシアルピア		
国債証券					
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,300,000	9,353,052	70,147	2030/8/15
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	16,200,000	19,959,534	149,696	2025/9/15
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	47,700,000	48,980,745	367,355	2023/5/15

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)	
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	25,000,000	24,837,500	186,281	2028/5/15
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	7,000,000	7,133,140	53,498	2031/2/15
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	44,100,000	46,323,963	347,429	2025/6/15
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	24,000,000	23,660,640	177,454	2033/5/15
INDOGB 7% 05/15/22	7.0	85,900,000	37,534,168	281,506	2022/5/15
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	86,800,000	38,770,272	290,777	2027/5/15
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	54,000,000	57,208,140	429,601	2030/9/15
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	13,000,000	13,534,560	101,509	2040/4/15
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	19,300,000	19,966,815	149,751	2038/5/15
INDOGB 7.5% 06/15/35	7.5	20,200,000	21,633,998	162,254	2035/6/15
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	21,900,000	23,133,846	173,503	2032/8/15
INDOGB 8.125% 05/15/24	8.125	35,600,000	39,168,900	293,766	2024/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	31,700,000	35,839,069	268,973	2029/5/15
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	33,200,000	36,785,600	275,892	2036/5/15
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	30,400,000	33,697,488	252,731	2032/6/15
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	46,600,000	51,435,216	385,764	2024/3/15
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	52,000,000	59,043,920	442,829	2034/3/15
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	21,200,000	23,633,548	177,251	2039/4/15
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	44,100,000	49,806,099	373,455	2026/9/15
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	18,700,000	21,711,448	162,835	2031/5/15
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	33,700,000	39,371,710	295,287	2029/3/15
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	13,739,394	103,045	2031/7/15
小計				5,971,970	
(南アフリカ)		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券					
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	115,000	135,855	927,891	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	34,700	24,283	165,853	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	34,100	22,507	153,722	2041/2/28
SAGB 7% 02/28/31	7.0	41,800	35,598	243,140	2031/2/28
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	45,000	48,770	333,102	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	93,900	89,529	611,489	2030/1/31
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	49,200	44,117	301,323	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	68,700	57,054	389,683	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	68,200	55,728	380,624	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	89,300	72,358	494,211	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	61,700	54,646	373,235	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	35,000	29,787	203,445	2040/1/31
小計				4,577,723	
(中国オフショア)		千香港・オフショア人民元	千香港・オフショア人民元		
国債証券					
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	20,000	19,102	303,721	2025/4/9
CGB 2.36% 07/02/23	2.36	28,500	24,121	383,272	2023/7/2
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	24,900	27,616	439,103	2030/5/21
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	24,500	23,909	380,157	2027/6/4
CGB 2.94% 10/17/24	2.94	43,000	43,006	683,809	2024/10/17
CGB 3.12% 12/05/26	3.12	20,000	19,987	317,802	2026/12/5
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	20,700	20,535	326,513	2029/11/21
CGB 3.19% 04/11/24	3.19	14,000	14,116	224,447	2024/4/11
CGB 3.22% 12/06/25	3.22	12,000	12,126	192,818	2025/12/6
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	35,000	35,345	561,998	2026/6/6
CGB 3.25% 11/22/28	3.25	20,200	20,224	321,565	2028/11/22
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	26,000	26,134	415,545	2029/5/23
CGB 3.29% 10/18/23	3.29	16,000	16,190	257,422	2023/10/18
小計				4,808,433	
合計				59,928,600	

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 59,928,600	% 96.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,521,363	4.0
投 資 信 託 財 産 総 額	62,449,963	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(61,533,810千円)の投資信託財産総額(62,449,963千円)に対する比率は98.5%です。

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

1米ドル=105.21円	1メキシコペソ=5.16円	1ブラジルレアル=19.54円
1チリペソ=0.1391円	1コロンビアペソ=0.0288円	1ペルーヌエボソル=29.35円
1ウルグアイペソ=2.47円	1ドミニカペソ=1.80円	1トルコリラ=12.95円
1チェココルナ=4.68円	1ハンガリーフォリント=0.3459円	1ポーランドズロチ=27.69円
1ロシアルーブル=1.37円	1マレーシアリンギット=25.58円	1タイバーツ=3.46円
1フィリピンペソ=2.19円	1インドネシアルピア=0.0075円	1南アフリカランド=6.83円
1香港・オフショア人民元=15.90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 2020年11月10日現在
(A) 資 産	62,591,485,008円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,537,995,092
公 社 債(評価額)	59,928,600,984
未 収 入 金	186,858,417
未 収 利 息	880,175,773
前 払 費 用	57,854,742
(B) 負 債	924,413,785
未 払 金	828,301,240
未 払 解 約 金	96,112,220
未 払 利 息	325
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	61,667,071,223
元 本	36,424,298,034
次 期 繰 越 損 益 金	25,242,773,189
(D) 受 益 権 総 口 数	36,424,298,034口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,930円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	2,973,671,838円
受 取 利 息	2,973,959,363
支 払 利 息	△287,525
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,844,744,754
売 買 益	1,706,839,507
売 買 損	△6,551,584,261
(C) そ の 他 費 用	△53,655,997
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,924,728,913
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	23,064,467,283
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,926,264,600
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,823,229,781
(H) 計 (D+E+F+G)	25,242,773,189
次 期 繰 越 損 益 金(H)	25,242,773,189

(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30,670,496,451円、期中追加設定元本額は8,460,500,886円、期中一部解約元本額は2,706,699,303円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC世界経済インデックスファンド	8,171,516,227円
世界経済インデックスファンド	6,455,802,300円
DC新興国債券インデックス・オープン	4,706,190,913円
SMT 新興国債券インデックス・オープン	4,289,994,117円
外国債券SMTBセクション(SMA専用)	3,345,935,872円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	2,804,193,380円
新興国債券インデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,812,756,551円
グローバル経済コア	672,487,025円
分散投資コア戦略ファンドS	592,208,542円
コア投資戦略ファンド(成長型)	407,214,225円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	316,039,597円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	307,965,962円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	305,373,086円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	303,324,436円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	286,557,897円
分散投資コア戦略ファンドA	251,578,523円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	189,767,663円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	181,716,909円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	169,236,557円
SMT 世界経済インデックス・オープン	168,625,526円
SMT インデックスバランス・オープン	163,144,126円
コア投資戦略ファンド(安定型)	138,847,350円
FOFs用 新興国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	89,126,174円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	87,578,065円
コア投資戦略ファンド(切替型)	86,647,214円
新興国債券インデックス・オープン(SMA専用)	84,097,021円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	28,048,658円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,101,480円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	2,598,606円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	520,047円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	445,927円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	414,883円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	243,175円

お知らせ

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2020年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	REIT 物 率	投資 信託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
第9期(2016年11月10日)	円	%		%	%	%	百万円	
	15,287	6.0	15,167	5.9	1.8	98.2	68,806	
第10期(2017年11月10日)	14,567	△4.7	14,447	△4.7	2.0	98.0	82,590	
第11期(2018年11月12日)	16,899	16.0	16,737	15.9	2.5	97.5	103,475	
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441	
第13期(2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598	

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	REIT 物 率	投資 信託 証 券 組 入 比 率
	騰 落	率	騰 落	率			
(当期首) 2019年11月11日	円	%		%	%	%	%
	21,338	—	21,125	—	2.6	97.4	97.4
11月末	21,895	2.6	21,676	2.6	2.6	97.4	97.4
12月末	21,256	△0.4	21,042	△0.4	2.6	97.4	97.4
2020年 1月末	22,014	3.2	21,792	3.2	2.5	97.4	97.4
2月末	20,151	△5.6	19,946	△5.6	2.5	97.4	97.4
3月末	15,949	△25.3	15,809	△25.2	3.7	96.3	96.3
4月末	15,805	△25.9	15,666	△25.8	3.5	96.5	96.5
5月末	17,106	△19.8	16,957	△19.7	3.4	96.5	96.5
6月末	16,815	△21.2	16,672	△21.1	3.4	96.8	96.8
7月末	16,859	△21.0	16,715	△20.9	3.4	96.6	96.6
8月末	17,814	△16.5	17,661	△16.4	3.3	96.6	96.6
9月末	17,644	△17.3	17,490	△17.2	3.2	96.8	96.8
10月末	16,759	△21.5	16,608	△21.4	3.4	96.6	96.6
(当期末) 2020年11月10日	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	96.6

(注1)騰落率は期首比です。

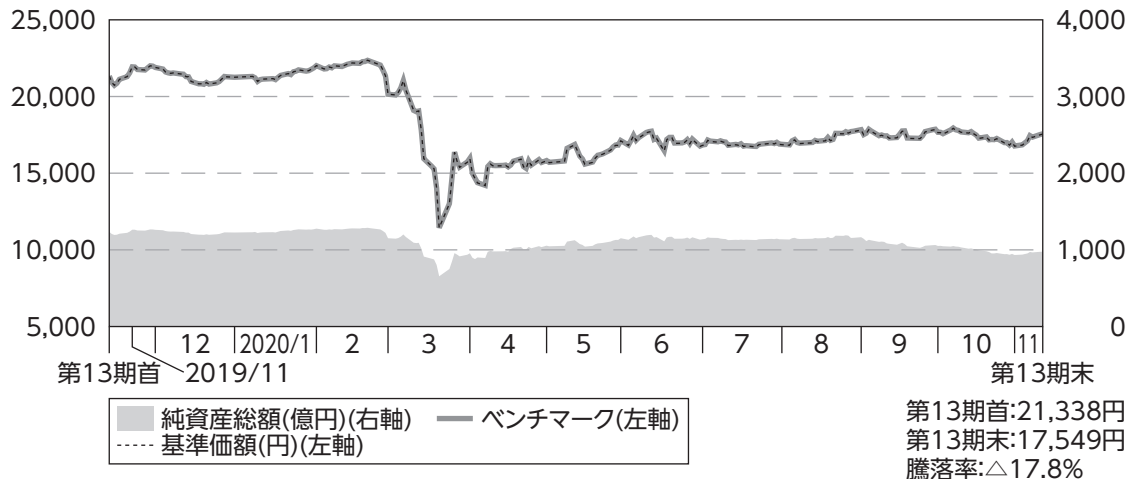
(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証REIT指数(配当込み)です。

東証REIT指数とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

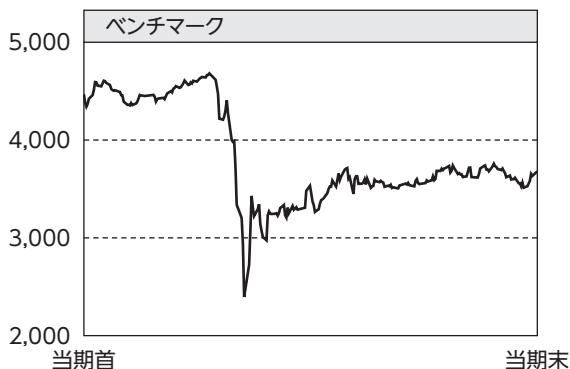


(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



当期のJ-REIT市場は大幅に下落しました。

当期初から2020年2月中旬にかけては、J-REITの業績の安定性や配当利回りの高さに着目した資金が流入したことなどから底堅く推移しました。しかし2月下旬以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて世界的に景気減速懸念が強まる中、リスク資産を圧縮する動きや、3月決算期末を控えた国内機関投資家勢による損切りとみられる売りが短期間に集中したことで、J-REIT市場は急落しました。3月下旬以降は、日銀によるJ-REITの買い入れ増額や投資口価格の急落により割安感が強まったとの見方などからやや下落幅を縮小しましたが、その後は国内で新型コロナウイルス感染が再拡大するなど先行きが不透明な市場環境が続く中、J-REIT市場はもみ合う展開となりました。

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

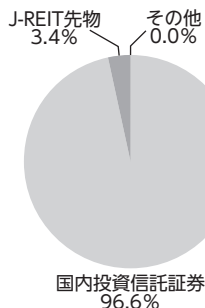
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.9%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.8%
3	日本プロロジスリート投資法人	日本	5.3%
4	GLP投資法人	日本	4.7%
5	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	4.7%
6	大和ハウスリート投資法人	日本	3.7%

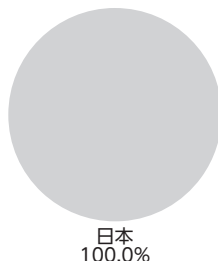
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本リテールファンド投資法人	日本	3.4%
8	オリックス不動産投資法人	日本	3.4%
9	東証REIT指数先物 2012	日本	3.4%
10	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数		63	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

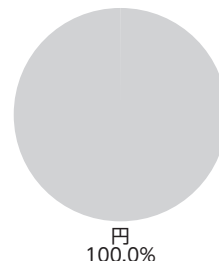
○資産別配分



○国別配分



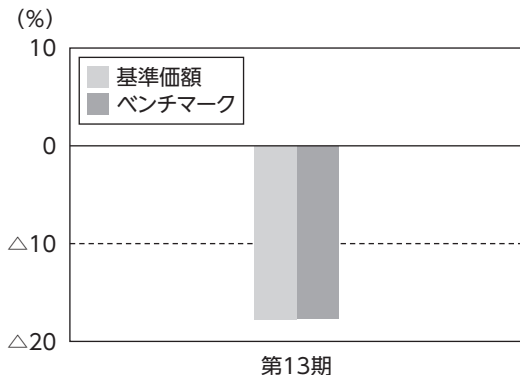
○通貨別配分



(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。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスでJ-REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.4%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドの基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.004%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(1)	(0.003)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	1	0.004	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(18,338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	1,051 (51)	112,040 (6,325)	530	57,293
	エスコンジャパンリート投資法人	51 (△51)	6,325 (△6,325)	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人	1,733	164,128	780	77,311
	S O S i L A 物流リート投資法人	3,065	366,353	758	102,140
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,028	632,665	1,212	765,814
	MCUBS M i d C i t y 投資法人	4,979	442,068	5,249	437,990
	森ヒルズリート投資法人	3,849	549,348	4,237	605,359
	産業ファンド投資法人	6,104	1,001,447	4,889	872,465
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,922	913,615	3,434	1,076,189
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,323	417,384	2,357	439,835
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,546	580,518	1,824	775,644
	G L P 投資法人	12,577	1,875,737	9,975	1,582,142
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,485 (36)	467,252 (11,963)	1,545	488,920
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	36 (△36)	11,963 (△11,963)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	5,350	1,563,789	5,356	1,796,587
	星野リゾート・リート投資法人	466	191,471	550	278,429
	O n e リート投資法人	479	121,881	566	151,824
	イオンリート投資法人	3,313	378,027	4,584	546,821
	ヒューリックリート投資法人	2,615	357,830	3,556	515,030
	日本リート投資法人	1,001	341,913	1,181	444,921
	インバスコ・オフィス・ジェリート投資法人	19,921	304,977	23,484	368,471
	日本ヘルスケア投資法人	47 (△538)	9,597 (△108,223)	38	7,976
	積水ハウス・リート投資法人	9,112	646,413	10,554	814,642
	トーセイ・リート投資法人	700	73,033	784	88,006
	ケネディクス商業リート投資法人	1,181	222,019	1,587	341,808
	ヘルスケア&メディカル投資法人	654	76,638	772	95,993
	サムティ・レジデンシャル投資法人	603	57,204	794	80,515
	野村不動産マスターファンド投資法人	11,052	1,590,017	11,589	1,673,914
内	いちごホテルリート投資法人	622	43,078	618	49,305
	ラサールロジポート投資法人	3,676 (1,048)	585,395 (185,157)	3,328	568,379

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	ラサールロジポート投資法人	1,048 (△1,048)	185,157 (△185,157)	—	—
	スターアジア不動産投資法人	1,232 (9,113)	95,500 (246,390)	3,326	166,033
	マリモ地方創生リート投資法人	440	47,473	408	43,411
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,844 (115)	897,939 (57,010)	1,032	526,425
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	115 (△115)	57,010 (△57,010)	—	—
	大江戸温泉リート投資法人	521	33,489	704	48,368
	さくら総合リート投資法人	593 (△2,746)	44,901 (△246,390)	207	18,506
	投資法人みらい	4,031	176,474	4,681	191,090
	森トラスト・ホテルリート投資法人	718	70,782	1,035	113,146
	三菱地所物流リート投資法人	787 (69)	300,917 (29,787)	674	279,506
	三菱地所物流リート投資法人	69 (△69)	29,787 (△29,787)	—	—
	CREロジスティクスファンド投資法人	2,175	325,521	880	133,274
	ザイマックス・リート投資法人	547	52,480	544	53,177
	タカラレーベン不動産投資法人	1,078	95,295	1,062	98,801
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	2,423 (161)	358,198 (18,732)	1,002	141,320
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	161 (△161)	18,732 (△18,732)	—	—
	日本ビルファンド投資法人	4,522	2,872,776	3,433	2,252,926
	ジャパンリアルエステイト投資法人	3,088	1,915,902	3,643	2,179,803
	日本リートールファンド投資法人	5,828	852,489	6,993	1,181,832
	オリックス不動産投資法人	6,147	966,885	7,252	1,220,746
	日本プライムリアルティ投資法人	2,242	802,676	2,701	908,107
	プレミアム投資法人	2,790	328,644	3,291	417,306
	東急リアル・エステート投資法人	2,066	306,239	2,438	375,757
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,142	213,732	2,527	273,825
	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,898	863,731	9,248	1,183,703
	森トラスト総合リート投資法人	2,208	304,519	2,604	376,694
インヴィンシブル投資法人	13,471	438,696	18,028	624,442	
フロンティア不動産投資法人	1,091	370,513	1,530	546,553	
平和不動産リート投資法人	1,920	202,165	2,360	281,403	
内	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,024	523,916	2,386	690,849
	福岡リート投資法人	1,594	198,824	1,880	267,251

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	ケネディクス・オフィス投資法人	955	582,240	1,127	741,685
	いちごオフィスリート投資法人	3,067	230,714	2,924	238,624
	大和証券オフィス投資法人	701	443,906	1,013	636,292
	阪急阪神リート投資法人	1,397	175,477	1,648	212,844
	スターツプロシード投資法人	477	90,226	563	113,470
	大和ハウスリート投資法人	4,936 (244)	1,297,285 (69,215)	5,114	1,380,439
	大和ハウスリート投資法人	244 (△244)	69,215 (△69,215)	—	—
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,940	445,501	11,727	642,421
	大和証券リビング投資法人	4,120 (1,102)	393,376 (108,223)	4,429	462,109
	ジャパンエクセレント投資法人	3,143	426,375	3,304	442,159

(注1)金額は受渡代金です。

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

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国 内	R E I T 先 物 取 引	百万円 15,666	百万円 15,333	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 644	百万円 644	% 100.0	百万円 644	百万円 644	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	588,325	73,642	12.5	589,043	74,212	12.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期		末	
	口	数 (口)	口	数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)
エスコンジャパンリート投資法人		1,120		1,692	191,872	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		1,581		2,534	248,078	0.3
SOS i L A物流リート投資法人		—		2,307	304,524	0.3
日本アコモデーションファンド投資法人		3,625		3,441	2,019,867	2.1
MCUBS M i d C i t y投資法人		12,941		12,671	1,066,898	1.1
森ヒルズリート投資法人		12,552		12,164	1,605,648	1.6
産業ファンド投資法人		13,423		14,638	2,583,607	2.6
アドバンス・レジデンス投資法人		10,348		9,836	2,995,062	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		6,790		6,756	1,173,517	1.2
アクティブア・プロパティーズ投資法人		5,467		5,189	2,091,167	2.1
GLP投資法人		27,173		29,775	4,579,395	4.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		4,543		4,519	1,364,738	1.4
日本プロロジスリート投資法人		15,675		15,669	5,178,604	5.3
星野リゾート・リート投資法人		1,660		1,576	817,944	0.8
Oneリート投資法人		1,701		1,614	399,949	0.4
イオンリート投資法人		11,774		10,503	1,302,372	1.3
ヒューリックリート投資法人		9,278		8,337	1,196,359	1.2
日本リート投資法人		3,544		3,364	1,204,312	1.2
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人		70,091		66,528	937,379	1.0
日本ヘルスケア投資法人		529		—	—	—
積水ハウス・リート投資法人		31,900		30,458	2,287,395	2.3
トーセイ・リート投資法人		2,375		2,291	247,886	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		4,214		3,808	817,577	0.8
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,327		2,209	279,217	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		2,184		1,993	204,880	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人		34,024		33,487	4,567,626	4.7
いちごホテルリート投資法人		1,807		1,811	136,006	0.1
ラサールロジポート投資法人		10,144		11,540	1,863,710	1.9
スターアジア不動産投資法人		3,621		10,640	502,208	0.5
マリモ地方創生リート投資法人		938		970	109,028	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		2,687		3,614	1,783,509	1.8
大江戸温泉リート投資法人		1,854		1,671	122,818	0.1
さくら総合リート投資法人		2,360		—	—	—
投資法人みらい		11,834		11,184	429,465	0.4
森トラスト・ホテルリート投資法人		2,560		2,243	264,674	0.3
三菱地所物流リート投資法人		2,148		2,330	971,610	1.0

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,531	2,826	437,182		0.4
ザイマックス・リート投資法人	1,584	1,587	145,686		0.1
タカラレーベン不動産投資法人	3,096	3,112	270,744		0.3
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,688	3,270	444,066		0.5
日本ビルファンド投資法人	10,565	11,654	6,701,050		6.9
ジャパンリアルエステイト投資法人	10,910	10,355	5,705,605		5.8
日本リートファンド投資法人	20,620	19,455	3,295,677		3.4
オリックス不動産投資法人	21,738	20,633	3,295,090		3.4
日本プライムリアルティ投資法人	6,906	6,447	2,017,911		2.1
プレミア投資法人	9,854	9,353	1,134,518		1.2
東急リアル・エステート投資法人	7,315	6,943	1,056,030		1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	7,576	7,191	719,819		0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	24,496	22,146	2,803,683		2.9
森トラスト総合リート投資法人	7,797	7,401	982,852		1.0
インヴィンシブル投資法人	47,856	43,299	1,656,186		1.7
フロンティア不動産投資法人	3,875	3,436	1,298,808		1.3
平和不動産リート投資法人	6,794	6,354	756,761		0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,128	6,766	1,964,846		2.0
福岡リート投資法人	5,642	5,356	743,948		0.8
ケネディクス・オフィス投資法人	3,375	3,203	2,027,499		2.1
いちごオフィスリート投資法人	8,448	8,591	619,411		0.6
大和証券オフィス投資法人	2,518	2,206	1,389,780		1.4
阪急阪神リート投資法人	4,928	4,677	580,883		0.6
スターツプロシード投資法人	1,699	1,613	322,922		0.3
大和ハウスリート投資法人	14,709	14,775	3,612,487		3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人	35,146	33,359	1,924,814		2.0
大和証券リビング投資法人	12,271	13,064	1,315,544		1.3
ジャパンエクセレント投資法人	9,770	9,609	1,204,968		1.2
合 計	口 数 ・ 金 額	630,627	622,043	94,277,687	
	銘 柄 数 <比 率>	63	62	<96.6%>	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	当 期		末
			買 建	額	売 建
			(百万円)		(百万円)
国内	東 証	R E I T 指 数	3,292		—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 94,277,687	% 96.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,705,589	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	97,983,276	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 2020年11月10日現在
(A)資 産	97,983,276,190円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,623,239,422
投 資 証 券(評価額)	94,277,687,970
未 収 入 金	270,717,896
未 収 配 当 金	1,171,592,742
差 入 委 託 証 拠 金	640,038,160
(B)負 債	384,882,177
未 払 金	12,474,160
未 払 解 約 金	372,405,712
未 払 利 息	2,305
(C)純 資 産 総 額(A-B)	97,598,394,013
元 本	55,613,724,754
次 期 繰 越 損 益 金	41,984,669,259
(D)受 益 権 総 口 数	55,613,724,754口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,549円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日
(A)配 当 等 収 益	4,607,242,669円
受 取 配 当 金	4,608,346,408
受 取 利 息	8,663
そ の 他 収 益 金	126,658
支 払 利 息	△1,239,060
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△23,616,370,308
売 買 益	2,531,429,599
売 買 損	△26,147,799,907
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△200,550,710
取 引 益	404,115,130
取 引 損	△604,665,840
(D)そ の 他 費 用	△5,468
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△19,209,683,817
(F)前 期 繰 越 損 益 金	65,590,586,296
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	11,150,814,862
(H)解 約 差 損 益 金	△15,547,048,082
(I) 計 (E+F+G+H)	41,984,669,259
次 期 繰 越 損 益 金(I)	41,984,669,259

(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57,851,231,573円、期中追加設定元本額は16,846,850,301円、期中一部解約元本額は19,084,357,120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)	26,740,638,748円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,396,534,493円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,736,524,900円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,915,131,391円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,636,726,739円
分散投資コア戦略ファンドS	1,039,209,557円
コア投資戦略ファンド(切替型)	997,686,526円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	910,045,907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)	772,093,017円
分散投資コア戦略ファンドA	527,813,690円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	468,709,116円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	409,944,935円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-11(適各機関投資家専用)	385,378,937円
J-REIT パッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	313,296,714円
グローバル経済コア	264,618,020円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	42,599,327円
SMT インデックスバランス・オープン	29,961,470円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	8,644,645円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,571,010円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,312,618円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	3,971,619円
J-REITパッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	311,375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13期（決算日 2020年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率		
第9期(2016年11月10日)	14,778	△10.1%	15,697	△9.6%	99.6%	百万円 59,975
第10期(2017年11月10日)	17,843	20.7%	19,040	21.3%	99.3%	63,032
第11期(2018年11月12日)	18,126	1.6%	19,461	2.2%	99.4%	74,818
第12期(2019年11月11日)	19,790	9.2%	21,365	9.8%	99.4%	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838	△14.9%	18,254	△14.6%	99.6%	80,213

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率	
(当期首) 2019年11月11日	19,790	—	21,365	—	99.4%
11月末	20,327	2.7%	21,945	2.7%	99.6%
12月末	20,110	1.6%	21,713	1.6%	99.6%
2020年1月末	20,467	3.4%	22,120	3.5%	99.3%
2月末	19,250	△2.7%	20,806	△2.6%	100.9%
3月末	14,415	△27.2%	15,589	△27.0%	99.9%
4月末	15,404	△22.2%	16,647	△22.1%	99.6%
5月末	15,555	△21.4%	16,819	△21.3%	99.9%
6月末	15,731	△20.5%	17,018	△20.3%	99.3%
7月末	16,022	△19.0%	17,321	△18.9%	99.5%
8月末	16,520	△16.5%	17,887	△16.3%	99.4%
9月末	15,842	△19.9%	17,151	△19.7%	99.3%
10月末	15,323	△22.6%	16,589	△22.4%	99.6%
(当期末) 2020年11月10日	16,838	△14.9%	18,254	△14.6%	99.6%

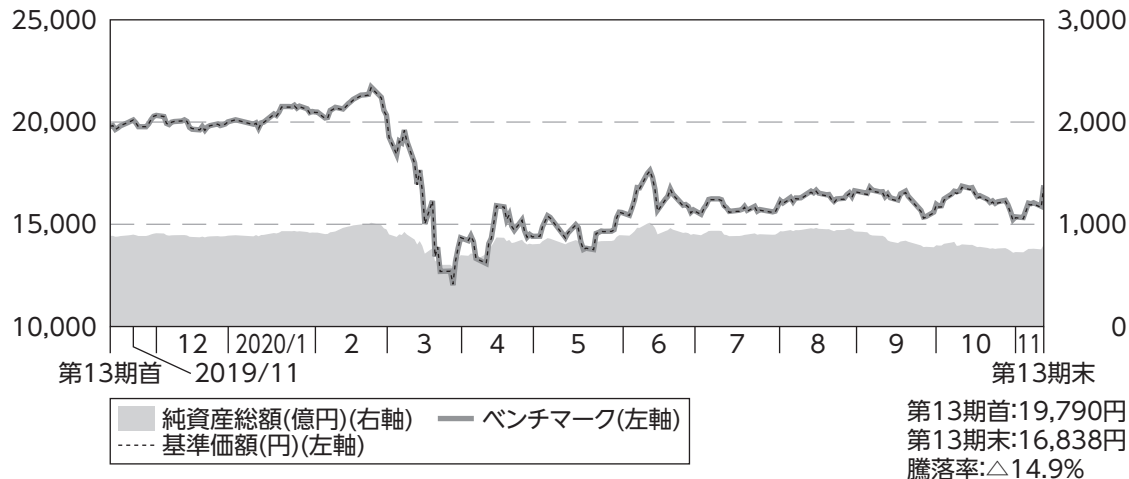
(注)騰落率は期首比です。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

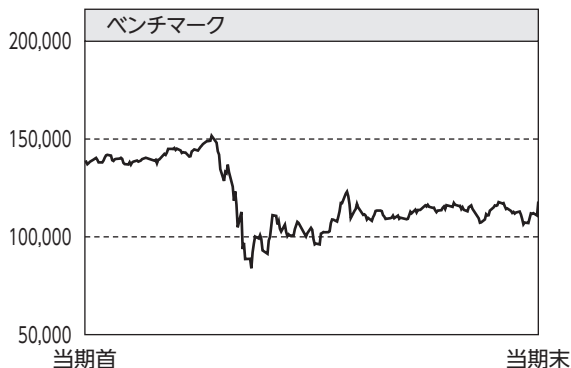


(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



海外REIT市場は、米中通商協議の進展期待や良好な経済指標などを背景に、2020年2月中旬まで堅調に推移しました。しかしその後、新型コロナウイルスの世界的な感染急拡大を受けた経済活動の停滞長期化への懸念や、REIT各社の業績悪化への警戒感などから、3月中旬にかけて大幅に下落しました。その後は各国の大型経済対策への期待やワクチン開発の進展期待などを背景に持ち直しましたが、6月中旬以降は各国中央銀行による金融緩和政策などが下支えとなった一方、欧州主要国で新型コロナウイルスの新規感染者数の増加を受けて経済活動への制限措置が強化されたことが重石となるなど、一進一退の動きとなりました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

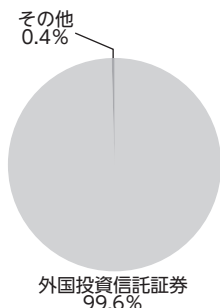
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	6.2%
2	EQUINIX INC	アメリカ	5.6%
3	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.1%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	2.9%
5	WELLTOWER INC	アメリカ	2.4%
6	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.0%

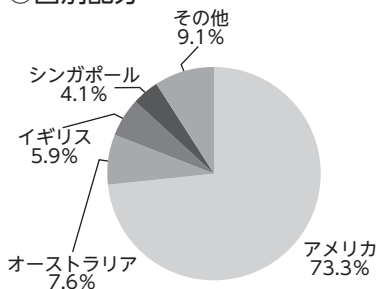
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	2.0%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.0%
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	1.8%
10	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	アメリカ	1.7%
組入銘柄数		322	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

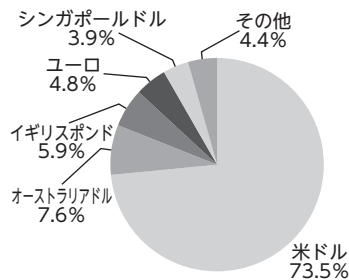
○資産別配分



○国別配分



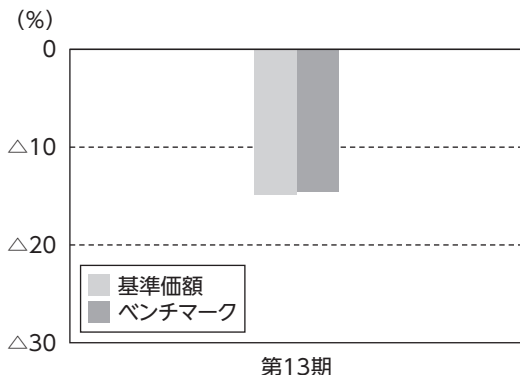
○通貨別配分



(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。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当課税要因※(マイナス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日~2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	2円 (0) (-) (-) (-) (2) (-) (-)	0.009% (0.000) (-) (-) (-) (0.009) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	3 (0) (-) (-) (-) (-) (3)	0.018 (0.000) (-) (-) (-) (-) (0.018)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	6 (6) (-) (0)	0.038 (0.038) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	11	0.065	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(17,080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 — (97)	千米ドル — (37)	百株 97	千米ドル 31

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	40,095	6,103	34,744	5,690
	BOSTON PROPERTIES	34,600	3,423	31,882	2,904
	CEDAR REALTY TRUST INC	—	—	51,950	43
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	55,683	1,750	42,466	1,365
	APARTMENT INVEST & MGMT	32,650	1,263	30,428	1,126
	AGREE REALTY CORP	16,936	1,130	7,987	522
	SL GREEN REALTY CORP	16,240	868	20,215	994
	EPR PROPERTIES	19,822	655	19,500	606
	PROLOGIS INC	182,729 (64,962)	15,598 (5,649)	157,185	15,451
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	36,492	5,917	31,136	5,041
	LEXINGTON CORP PROPERTIES	60,186	596	42,044	467
	CAMDEN PROPERTY TRUST	25,190	2,351	22,607	2,184
	CBL & ASSOCIATES PRYS	—	—	99,840	17
	MACK-CALI REALTY CORP	15,530	228	9,334	128
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	44,565	1,736	37,010	1,469
	COUSINS PROPERTIES INC	31,631	1,028	29,016	913
	URSTADT BIDDLE - CL A	6,000	72	—	—
	SITE CENTERS CORP	27,261	243	17,000	131
	DUKE REALTY CORP	87,560	2,957	70,668	2,682

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	20,000 (△59,427)	13 (-)	6,603	13
ESSEX PROPERTY TRUST	16,080	3,731	14,218	3,128
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	81,453	5,108	74,887	4,349
FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,204	1,551	15,336	1,315
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	35,607	1,364	30,345	1,281
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	157,540	4,159	110,979	3,105
EQUITY COMMONWEALTH	28,299	913	23,487	713
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,678	691	16,989	502
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,564	765	19,002	730
SERVICE PROPERTIES TRUST	23,210	235	21,326	160
WELLTOWER INC	108,049	5,789	86,178	5,008
EASTGROUP PROPERTIES, INC	7,448	832	5,782	781
KIMCO REALTY CORP	81,129	947	60,960	717
KILROY REALTY CORPORATION	29,020	1,876	18,604	1,058
LTC PROPERTIES INC	18,886	698	15,200	574
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37,000	128	38,000 (-)	141 (37)
MONMOUTH REIT -CL A	31,652	430	25,060	361
LIBERTY PROPERTY TRUST	- (△96,240)	- (△5,649)	-	-
BRANDYWINE REALTY TRUST	48,222	556	45,380	487
IRON MOUNTAIN INC	56,157	1,431	46,375	1,327
MACERICH CO/THE	23,730 (4,667)	261 (34)	27,250	198
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,100	2,348	42,678	2,776
ACADIA REALTY TRUST	19,260	237	19,710	224
HOST HOTELS AND RESORTS INC	144,716	1,681	143,932	1,692
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,530	2,955	23,622	2,811
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,800	72	14,000	86
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,885	511	8,091	510
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,510	190	-	-
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,000 (199)	62 (3)	-	-
PENN REAL ESTATE INVEST TST	30,000	27	61,970	36

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
GETTY REALTY CORP	6,485	161	3,500	91
PS BUSINESS PARKS INC	5,350	708	4,611	562
RPT REALTY	18,870	91	11,500	68
REALTY INCOME CORP	101,240	5,949	75,476	4,855
REGENCY CENTERS CORP	40,081	1,790	42,660	1,877
UDR INC	68,470	2,571	60,439	2,212
CORPORATE OFFICE PPTYS	22,139	553	14,300	339
CORECIVIC INC	31,263	419	24,930	305
SAUL CENTERS INC	2,100	62	—	—
SIMON PROPERTY GROUP	75,550	5,652	68,152	5,168
LIFE STORAGE INC	7,358	705	6,842	733
PUBLIC STORAGE	39,333	7,879	32,975	7,029
SUN COMMUNITIES INC	26,360	3,527	19,398	2,857
TAUBMAN CENTERS INC	8,890	395	7,790	293
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	35,600	202	21,500	119
UMH PROPERTIES INC	7,000	70	—	—
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	10,650	176	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,170	203	1,567	104
VENTAS INC	83,870	3,029	72,809	3,127
VORNADO REALTY TRUST	30,285	1,324	25,924	1,014
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	15,190	366	6,200	133
GEO GROUP INC/THE	31,696	438	34,780	441
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	37,960	765	33,535	667
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	26,566	885	22,266	759
KITE REALTY GROUP TRUST	11,090	113	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	30,200	2,929	25,814	2,716
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	25,173	167	—	—
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	59,782	614	47,385	456
CUBESMART	45,537	1,268	42,654	1,323
DIGITAL REALTY TRUST INC	97,449	13,274	51,713	7,631
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	46,840	248	42,000	222
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	145,952	2,661	79,194	1,440
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	31,845	1,011	23,735	635
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	27,140	257	18,655	212

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	25,115	444	20,876	298
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	25,000	92	14,000	82
TERRENO REALTY CORP	14,207	742	12,413	721
AMERICAN ASSETS TRUST INC	4,585	104	4,900	123
RLJ LODGING TRUST	38,799	431	26,748	256
AMERICOLD REALTY TRUST	48,950	1,661	35,410	1,337
CORESITE REALTY CORP	13,798	1,610	9,923	1,195
VEREIT INC	226,750	1,315	190,727	1,273
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,005	442	17,630	225
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	12,100	335	8,500	200
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,280	201	16,641	110
CHATHAM LODGING TRUST	13,500	148	12,000	90
SABRA HEALTH CARE REIT INC	68,016	1,038	51,310	876
WHITESTONE REIT	15,730	82	—	—
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	25,670	710	23,790	548
STAG INDUSTRIAL INC	40,010	1,139	22,499	710
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	51,250	457	34,556	309
CYRUSONE INC	25,460	1,675	19,344	1,512
WP CAREY INC	38,170	2,416	31,662	2,164
ALEXANDER & BALDWIN INC	47,000	563	—	—
GLADSTONE LAND CORP	6,500	87	—	—
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	48,886	1,272	37,925	988
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,250	628	7,924	289
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,000	319	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	37,689	1,440	28,560	1,140
PHYSICIANS REALTY TRUST	40,401	610	24,172	442
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	30,883	1,297	20,468	998
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	57,758	1,411	43,120	1,232
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	39,038	430	23,500	271
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	10,113	891	3,515	430
JBG SMITH PROPERTIES	17,752	570	20,370	559
AMERICAN FINANCE TRUST INC	24,000	206	16,000	89
RETAIL VALUE	— (339)	— (12)	—	—

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
INVITATION HOMES INC	186,690	4,993	122,373	3,515
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,530	113	7,300	97
QTS REALTY TRUST INC	25,008	1,457	19,421	1,204
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	343	—	—
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	14,415	122	20,000	120
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	11,500	165	—	—
SAFEHOLD INC	11,040	568	5,800	272
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	38,936	796	20,704	440
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,780	317	9,670	219
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	25,373	377	23,010	284
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	49,188 (3,955)	1,617 (150)	46,870	1,776
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	102,503	1,478	92,356	1,373
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	9,500	11	24,000	60
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	—	7,500	99
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	163	—	—
PRIME US REIT	295,000 (—)	289 (△5)	—	—
ARA US HOSPITALITY TRUST	— (—)	— (△4)	287,500	95
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,500	73	—	—
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	17,850	129	12,000	101
WASHINGTON PRIME GROUP INC	90,000	71	105,000	68
CARETRUST REIT INC	15,470	277	7,283	138
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	23,000	111	18,000	75
STORE CAPITAL CORP	45,798	1,057	28,350	783
PARAMOUNT GROUP INC	43,826	418	62,510	469
GLOBAL MEDICAL REIT INC	10,930	93	6,900	92
URBAN EDGE PROPERTIES	34,310	378	26,740	269
EQUINIX INC	23,579	15,256	18,408	13,700
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	20,138	493	12,170	289
XENIA HOTELS & RESORTS INC	27,340	242	25,620	230
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,500	119	2,400	99
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,110	353	9,686	322
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	6,600	278	2,000	96

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	28,800	233	24,000	245
	GLOBAL NET LEASE INC	31,482	504	24,490	409
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	330,000 (-)	267 (△15)	300,000	223
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	48,660	577	42,540	515
	VICI PROPERTIES INC	148,496	3,095	85,891	2,008
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	9,000	72	6,300	88
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	14,730	279	12,670	336
	COLONY CAPITAL INC	244,724	753	202,578	612
	小 計	7,094,354 (△81,545)	208,716 (174)	5,193,803 (-)	172,455 (37)
	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,646	227	9,500	194
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	26,690	1,301	23,160	1,115
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	25,079	213	23,000	235
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34,686	726	34,305	625
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	9,692	460	9,600	349
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	17,620	145	15,000	106
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	16,087	535	31,950	1,143
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,500	119	5,500	162
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,210	237	13,000	168
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	24,250	336	14,760	192
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	30,170	312	11,000	125
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	5,000	100	-	-
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	-	-	57,280	386
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	30,550	416	21,400	265
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	25,000	272	11,000	131
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,920	525	5,750	444
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,800	80	-	-
	CHOICE PROPERTIES REIT	28,010	347	15,000	192
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	10,500	239	-	-
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,000	113	23,270	346
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	90	-	-
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	128,715	2,343	53,900	905
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	32,500	598	9,000	149

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	124	—	—
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	18,400	345	8,050	138
	小 計	566,025	10,214	395,425	7,379
	ドイツ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	HAMBORNER REIT AG	15,000	119	14,000	119
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	36,690 (—)	498 (△63)	23,690	276
	小 計	51,690 (—)	618 (△63)	37,690	396
	フランス				
	ICADE	4,420	345	1,500	79
	ALTAREA	730 (—)	81 (△22)	—	—
	KLEPIERRE	55,160 (—)	1,227 (△131)	51,080	923
	GECINA SA	11,580	1,451	10,865	1,222
	COVIVIO (FP)	11,392	828	8,590	588
	MERCIALYS	25,480	152	10,450	58
	CARMILA	30,000	204	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,322	2,275	28,736	1,471
	小 計	171,084 (—)	6,566 (△153)	111,221	4,343
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL	7,550	77	13,200	122
	VASTNED RETAIL	2,800	68	—	—
	WERELDHAVE NV	10,000	72	6,200	43
	NSI NV	3,000	116	—	—
	小 計	23,350	335	19,400	165
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	58,742 (—)	441 (△8)	52,920	407
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	19,000	98	—	—
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	73,648	603	87,500	639
	小 計	151,390 (—)	1,143 (△8)	140,420	1,046
	ベルギー				
	BEFIMMO S. C. A.	5,000	222	2,200	73

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	COFINIMMO	6,137	760	4,450	553
	RETAIL ESTATES	4,600	318	1,200	68
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	4,000	87	3,000	65
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,200 (66,840)	726 (-)	23,710	686
	MONTEA	2,200	183	1,200	123
	AEDIFICA	10,934	1,020	4,640	470
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	392	-	-
	AEDIFICA SA-RIGHTS	- (17,260)	- (-)	17,260	14
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,700	407	-	-
	小 計	85,771 (84,100)	4,118 (-)	57,660	2,056
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	-	-	440,770	843
	HIBERNIA REIT PLC	160,000	193	80,000	93
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	103,000	131	68,021	93
	小 計	263,000	325	588,791	1,030
	その他				
	CROMWELL EUROPEAN REIT	910,000	433	-	-
	小 計	910,000	433	-	-
	ユ ー ロ 計	1,656,285 (84,100)	13,540 (△225)	955,182	9,039
	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	156,060	623	136,000	479
	CAPITAL & REGIONAL PLC	- (△261,000)	- (-)	29,000	15
	DERWENT LONDON PLC	28,201	874	22,540	624
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,176	355	28,600	308
	HAMMERSON PLC	2,861,500 (△465,280)	816 (-)	330,000	66
	WORKSPACE GROUP PLC	15,827	155	16,000	95
	UNITE GROUP PLC	166,292	1,668	80,850	752
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	309,367	480	254,530	386
	SHAFTESBURY PLC	39,753	232	21,190	106

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	SEGRO PLC	351,230	2,991	246,210	2,311
	LAND SECURITIES GROUP PLC	235,822	1,663	226,117	1,526
	ASSURA PLC	544,890	438	378,000	302
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	135	—	—
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	44,420	324	43,380	293
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	130,000	110	120,000	83
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	—	—	263,580	307
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	183,000	141	100,000	66
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	48,566	338	37,029	288
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	228,550	450	165,000	386
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	615,000	475	120,000	74
	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	700,297	1,172	155,000	188
	GCP STUDENT LIVING PLC	300,000	410	—	—
	NEWRIVER REIT PL	45,000	76	32,000	16
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,910	89	86,843	92
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	50,000	50	—	—
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	431,000	476	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	387,718	484	360,670	554
	CUSTODIAN REIT PLC	292,276	265	—	—
	HAMMERSON PLC-NIL PAID	— (2,791,680)	— (—)	2,791,680	196
	ELITE COMMERCIAL REIT	131,700	90	131,700	84
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	126,000	86	120,000	81
	AEW UK REIT PLC	46,000	36	—	—
	LXI REIT PLC	118,000	136	85,000	93
	REGIONAL REIT LTD	60,000	69	—	—
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	225	—	—
	小 計	9,260,666 (2,065,400)	15,951 (—)	6,380,919	9,782
	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	94,600	327	65,000	261
	MIRVAC GROUP	734,100	1,727	678,090	1,478
	CROMWELL PROPERTY GROUP	220,000	169	240,000	207
	CHARTER HALL RETAIL REIT	150,780	474	45,000	152

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
GPT GROUP	511,377	2,402	477,170	2,194
CENTURIA CAPITAL GROUP	285,000 (19,000)	599 (42)	—	—
ABACUS PROPERTY GROUP	52,000	123	73,847	210
STOCKLAND	476,674	1,470	432,110	1,623
DEXUS	292,730	3,038	269,850	2,657
GOODMAN GROUP	417,344	5,937	335,016	5,844
VICINITY CENTERS	1,408,500	2,219	947,110	1,370
CHARTER HALL GROUP	82,064	769	78,900	1,004
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	100,900	294	75,000	249
INGENIA COMMUNITIES GROUP	64,000	273	—	—
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	308,830	767	162,000	355
ARENA REIT	100,053	200	—	—
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	285,000	906	—	—
CHARTER HALL LONG WALE REIT	181,030 (12,656)	834 (67)	89,420	417
NATIONAL STORAGE REIT	315,670	509	169,330	316
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	103,000	262	66,115	205
GDI PROPERTY GROUP	160,000	159	122,000	129
HOME CONSORTIUM	91,000	344	—	—
RURAL FUNDS GROUP	82,950	160	60,000	136
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	340,000	459	—	—
SCENTRE GROUP	1,109,033	2,492	1,080,210	2,464
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	111,450	324	—	—
CENTURIA OFFICE REIT	168,000	391	70,000	147
AVENTUS GROUP	230,000	560	—	—
WAYPOINT REIT LTD	344,186	908	138,390	366
小 計	8,820,271 (31,656)	29,109 (110)	5,674,558	21,796
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	185,000	324	150,000	252
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	108,000	280	56,000	170
GOODMAN PROPERTY TRUST	140,000	301	160,000	375
KIWI PROPERTY GROUP LTD	367,460	385	190,000	197

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ARGOSY PROPERTY LTD	157,278	158	90,000	120
	小 計	957,738	1,449	646,000	1,116
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	549,300	37,376	496,500	32,109
	PROSPERITY REIT	170,000	412	—	—
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	348,000	1,307	240,000	917
	CHAMPION REIT	300,000	1,343	220,000	901
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	155,000	569	230,000	795
	FORTUNE REIT	321,000	2,447	152,000	1,009
	小 計	1,843,300	43,457	1,338,500	35,732
	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	677,100 (1,203,644)	1,281 (2,776)	695,800	1,370
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	604,300 (253,434)	1,797 (690)	649,300 (—)	2,119 (63)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	615,300	1,026	708,800 (1,671,728)	1,202 (3,209)
	SUNTEC REIT	742,500 (—)	1,119 (△3)	811,200	1,218
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	960,800 (30,948)	1,656 (31)	1,162,900	2,264
	STARHILL GLOBAL REIT	403,100 (—)	203 (△1)	—	—
	ASCOTT TRUST	362,600 (345,477)	340 (444)	325,200	290
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	67,000 (—)	79 (△2)	— (479,300)	— (740)
	KEPPEL REIT	418,500	428	513,500	562
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	78,200 (148,633)	142 (347)	50,000	127
	ESR REIT	690,700	280	450,000	174
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	254,000 (—)	233 (△4)	295,100	308
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	238,300 (—)	308 (△17)	170,000	193
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200,100 (—)	162 (△12)	—	—

		当期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000 (-)	184 (△1)	-	-	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	38,000 (-)	120 (△4)	30,000	125	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	- (-)	- (△5)	-	-	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	540,500 (-)	1,493 (△1)	460,900	1,397	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	527,100 (-)	1,032 (△8)	439,800	895	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	290,000 (-)	141 (△0.94042)	180,000	114	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	261,300 (-)	203 (△40)	280,000	259	
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	-	-	(435,000)	(474)	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	300,000	125	240,000	133	
SPH REIT	424,500	392	160,000	140	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	310,500 (-)	93 (△1)	-	-	
EC WORLD REIT	180,000	121	-	-	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	215,800	135	170,000	127	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	540,000 (-)	227 (△1)	380,000	130	
ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	- (253,434)	- (63)	(253,434)	(63)	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000 (-)	419 (△2)	-	-	
IREIT GLOBAL-RIGHTS	- (104,420)	- (-)	(104,420)	(12)	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	- (-)	- (△0.07728)	-	-	
IREIT GLOBAL	230,000 (104,420)	165 (63)	-	-	
KEPPEL DC REIT	148,900	345	158,100	460	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	450,300 (590,976)	477 (646)	356,400	491	
小計	11,454,400 (3,035,386)	14,740 (4,953)	8,687,000 (2,943,882)	14,107 (4,564)	

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	171,404	—	—
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	— (1,593)	— (10,233)	—	—
LOTTE REIT CO LTD	69,030	403,376	—	—
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	— (1,593)	— (—)	— (1,593)	— (898)
小 計	111,980 (3,186)	574,780 (10,233)	— (1,593)	— (898)
イスラエル	口	千イスラエルシェケル	口	千イスラエルシェケル
REIT 1 LTD	27,500	441	—	—
小 計	27,500	441	—	—

(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	28,402	12	0.0	25,115	—	—
金 銭 信 託	26	26	100.0	26	26	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	40,152	2,976	7.4	40,136	2,990	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

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当		期		比	率 (%)
	当期首(前期末)		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)				千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	69,760	75,111	11,572	1,217,527	1.5	
ALEXANDER'S INC	1,490	1,490	401	42,236	0.1	
BOSTON PROPERTIES	88,380	91,098	8,086	850,809	1.1	
CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	—	—	—	—	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	131,726	144,943	4,997	525,801	0.7	
APARTMENT INVEST & MGMT	92,400	94,622	2,723	286,510	0.4	
AGREE REALTY CORP	25,220	34,169	2,169	228,205	0.3	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	65	6,875	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	50,430	46,455	2,787	293,251	0.4	
EPR PROPERTIES	47,560	47,882	1,584	166,696	0.2	
PROLOGIS INC	385,530	476,036	47,417	4,988,842	6.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,620	90,976	14,982	1,576,344	2.0	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	156,266	174,408	1,738	182,944	0.2	
CAMDEN PROPERTY TRUST	59,830	62,413	6,153	647,454	0.8	
CBL & ASSOCIATES PRYS	99,840	—	—	—	—	
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	61,336	764	80,470	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	103,650	111,205	4,281	450,445	0.6	
COUSINS PROPERTIES INC	91,803	94,418	2,821	296,819	0.4	
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	22,500	250	26,394	0.0	
SITE CENTERS CORP	84,059	94,320	855	90,005	0.1	
DUKE REALTY CORP	223,080	239,972	9,277	976,066	1.2	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	—	—	—	—	
ESSEX PROPERTY TRUST	40,370	42,232	10,745	1,130,579	1.4	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	213,740	220,306	13,059	1,374,015	1.7	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,060	43,928	4,024	423,390	0.5	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,500	80,762	3,290	346,166	0.4	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	302,010	348,571	10,146	1,067,555	1.3	
EQUITY COMMONWEALTH	72,100	76,912	2,027	213,302	0.3	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,340	87,029	2,679	281,923	0.4	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	65,190	65,752	2,209	232,506	0.3	
SERVICE PROPERTIES TRUST	101,860	103,744	1,082	113,842	0.1	
WELLTOWER INC	247,760	269,631	17,973	1,891,002	2.4	
EASTGROUP PROPERTIES, INC	23,570	25,236	3,404	358,170	0.4	
KIMCO REALTY CORP	257,130	277,299	3,762	395,899	0.5	
KILROY REALTY CORPORATION	56,750	67,166	3,734	392,899	0.5	
LTC PROPERTIES INC	23,290	26,976	949	99,845	0.1	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	143,800	142,800	561	59,044	0.1	
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	62,052	890	93,683	0.1	
LIBERTY PROPERTY TRUST	96,240	—	—	—	—	
BRANDYWINE REALTY TRUST	102,778	105,620	1,024	107,789	0.1	
IRON MOUNTAIN INC	174,690	184,472	4,916	517,231	0.6	
MACERICH CO/THE	66,650	67,797	611	64,338	0.1	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,360	108,782	6,328	665,867	0.8	

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)			
ACADIA REALTY TRUST	54,390	53,940	681	71,732	0.1		
HOST HOTELS AND RESORTS INC	450,520	451,304	6,155	647,650	0.8		
MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,220	73,128	9,185	966,417	1.2		
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	21,650	162	17,106	0.0		
NATL HEALTH INVESTORS INC	27,450	28,244	1,782	187,564	0.2		
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,389	8,899	617	64,967	0.1		
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	13,199	207	21,815	0.0		
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	—	—	—	—		
GETTY REALTY CORP	19,000	21,985	603	63,446	0.1		
PS BUSINESS PARKS INC	11,950	12,689	1,647	173,310	0.2		
RPT REALTY	51,580	58,950	373	39,321	0.0		
REALTY INCOME CORP	195,300	221,064	13,617	1,432,701	1.8		
REGENCY CENTERS CORP	103,470	100,891	4,636	487,853	0.6		
UDR INC	181,320	189,351	7,223	760,009	0.9		
CORPORATE OFFICE PPTYS	66,720	74,559	1,795	188,892	0.2		
CORECIVIC INC	78,130	84,463	525	55,273	0.1		
SAUL CENTERS INC	6,700	8,800	248	26,145	0.0		
SIMON PROPERTY GROUP	188,510	195,908	15,496	1,630,368	2.0		
LIFE STORAGE INC	29,250	29,766	3,160	332,521	0.4		
PUBLIC STORAGE	91,770	98,128	21,792	2,292,764	2.9		
SUN COMMUNITIES INC	56,160	63,122	8,553	899,864	1.1		
TAUBMAN CENTERS INC	39,650	40,750	1,467	154,428	0.2		
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	69,270	579	60,926	0.1		
UMH PROPERTIES INC	20,000	27,000	382	40,252	0.1		
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	25,650	448	47,145	0.1		
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	8,473	491	51,739	0.1		
VENTAS INC	228,590	239,651	11,227	1,181,260	1.5		
VORNADO REALTY TRUST	95,930	100,291	3,880	408,242	0.5		
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	56,070	1,139	119,870	0.1		
GEO GROUP INC/THE	79,390	76,306	640	67,436	0.1		
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	72,920	77,345	1,513	159,250	0.2		
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	84,080	88,380	3,536	372,124	0.5		
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	61,020	777	81,789	0.1		
EXTRA SPACE STORAGE INC	79,200	83,586	8,937	940,263	1.2		
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	78,973	368	38,718	0.0		
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	135,100	147,497	1,454	153,009	0.2		
CUBESMART	120,490	123,373	3,854	405,497	0.5		
DIGITAL REALTY TRUST INC	127,790	173,526	23,984	2,523,436	3.1		
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	120,700	125,540	864	91,003	0.1		
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	271,770	338,528	6,496	683,481	0.9		
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	100,710	108,820	3,078	323,890	0.4		
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	70,630	79,115	1,010	106,293	0.1		
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	76,840	81,079	1,098	115,585	0.1		
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	76,470	613	64,524	0.1		
TERRENO REALTY CORP	41,570	43,364	2,488	261,831	0.3		
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,910	30,595	768	80,890	0.1		
RLJ LODGING TRUST	100,640	112,691	1,290	135,753	0.2		
AMERICOLD REALTY TRUST	117,100	130,640	4,571	480,924	0.6		

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)	
CORESITE REALTY CORP	23,310	27,185	3,276	344,760	0.4
VEREIT INC	652,720	688,743	4,952	521,006	0.6
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	77,960	89,335	1,456	153,202	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	28,230	31,830	655	68,952	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	29,639	176	18,616	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	25,360	238	25,107	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	119,750	136,456	2,183	229,704	0.3
WHITESTONE REIT	22,610	38,340	273	28,760	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	95,020	96,900	2,188	230,301	0.3
STAG INDUSTRIAL INC	80,320	97,831	2,983	313,930	0.4
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	129,080	145,774	1,033	108,738	0.1
CYRUSONE INC	68,960	75,076	5,201	547,225	0.7
WP CAREY INC	105,150	111,658	7,449	783,795	1.0
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	47,000	703	74,024	0.1
GLADSTONE LAND CORP	5,000	11,500	159	16,805	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	127,970	138,931	3,701	389,395	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31,240	35,566	2,007	211,192	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	—	38,000	394	41,539	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	56,690	65,819	2,271	238,975	0.3
PHYSICIANS REALTY TRUST	115,670	131,899	2,350	247,289	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	68,780	79,195	3,750	394,608	0.5
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	156,030	170,668	4,963	522,159	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	65,538	852	89,707	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,040	13,638	1,978	208,139	0.3
JBG SMITH PROPERTIES	74,160	71,542	2,009	211,431	0.3
AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	67,590	492	51,840	0.1
RETAIL VALUE	8,630	8,969	123	13,022	0.0
INVITATION HOMES INC	296,260	360,577	9,948	1,046,662	1.3
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	30,230	403	42,459	0.1
QTS REALTY TRUST INC	33,350	38,937	2,379	250,340	0.3
COREPOINT LODGING INC	22,000	22,000	132	13,957	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	—	470,000	329	34,614	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	95,920	90,335	682	71,756	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,400	15,900	204	21,512	0.0
SAFEHOLD INC	4,700	9,940	637	67,024	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,510	63,742	1,152	121,249	0.2
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,160	43,270	861	90,684	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	71,020	73,383	904	95,118	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	126,630	132,903	5,294	557,071	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	178,620	188,767	2,686	282,610	0.4
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	—	—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	35,200	542	57,032	0.1
EAGLE HOSPITALITY TRUST	—	295,000	40	4,252	0.0
PRIME US REIT	—	295,000	225	23,743	0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	—	—	—	—
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	—	6,500	60	6,325	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	14,850	134	14,201	0.0
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	19,000	132	13,912	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)		
CITY OFFICE REIT INC	37,050	37,050	270	28,455	0.0	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	90,250	58	6,171	0.0	
CARETRUST REIT INC	57,290	65,477	1,238	130,267	0.2	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	45,000	196	20,689	0.0	
STORE CAPITAL CORP	128,230	145,678	4,336	456,278	0.6	
PARAMOUNT GROUP INC	121,410	102,726	775	81,598	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	23,500	27,530	370	38,957	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	76,680	930	97,858	0.1	
EQUINIX INC	51,900	57,071	42,415	4,462,559	5.6	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	45,300	53,268	1,118	117,634	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	69,830	829	87,280	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,000	15,100	662	69,726	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	36,700	40,124	1,322	139,181	0.2	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	14,300	652	68,665	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	133,463	138,263	1,667	175,432	0.2	
GLOBAL NET LEASE INC	51,900	58,892	915	96,348	0.1	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	45	4,738	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	856,564	886,564	642	67,624	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	149,874	155,994	2,254	237,155	0.3	
VICI PROPERTIES INC	279,550	342,155	8,150	857,475	1.1	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	20,200	22,900	324	34,139	0.0	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,190	44,250	1,204	126,677	0.2	
COLONY CAPITAL INC	283,360	325,506	1,220	128,424	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,537,882	16,356,888	557,971	58,704,163	
	銘 柄 数 < 比 率 >	156	155	—	< 73.2% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	44,930	48,076	1,174	94,934	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,890	52,420	2,479	200,457	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	90,460	92,539	1,088	87,963	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	95,250	95,631	1,572	127,078	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	36,850	36,942	1,414	114,304	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	55,620	473	38,303	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	18,820	386	31,245	0.0	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	—	—	—	—	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	14,060	429	34,685	0.0	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	43,830	422	34,152	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,367	32,577	448	36,232	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,000	43,490	579	46,823	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	39,000	58,170	691	55,905	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	12,890	189	15,357	0.0	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	57,280	—	—	—	—	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	33,800	42,950	538	43,499	0.1	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	33,000	47,000	652	52,730	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,450	18,620	1,419	114,715	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	25,800	150	12,137	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	95,660	108,670	1,409	113,925	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,600	15,100	273	22,103	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	41,000	27,730	400	32,388	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)		
PLAZA RETAIL REIT	—	25,000	87	7,072	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	—	74,815	1,107	89,499	0.1	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	—	23,500	410	33,146	0.0	
SLATE GROCERY REIT	10,300	10,300	115	9,366	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	17,000	64	5,207	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	—	12,000	124	10,077	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	25,500	35,850	625	50,565	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	918,800	1,089,400	18,729	1,513,883	
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	27	—	< 1.9 % >	
(ドイツ)			千ユーロ			
HAMBORNER REIT AG	44,000	45,000	395	49,110	0.1	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	97,000	110,000	1,413	175,655	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	141,000	155,000	1,808	224,765	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.3 % >	
(イタリア)			千ユーロ			
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	96	11,946	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	33,790	33,790	96	11,946	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0 % >	
(フランス)			千ユーロ			
ICADE	16,960	19,880	1,109	137,853	0.2	
ALTAREA	2,000	2,730	348	43,357	0.1	
KLEPIERRE	126,050	130,130	1,951	242,568	0.3	
GECINA SA	33,970	34,685	4,484	557,322	0.7	
COVIVIO(FP)	27,990	30,792	1,870	232,461	0.3	
MERCIALYS	10,970	26,000	132	16,413	0.0	
CARMILA	—	30,000	265	32,993	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	84,560	88,146	3,769	468,388	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	302,500	362,363	13,932	1,731,358	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	8	—	< 2.2 % >	
(オランダ)			千ユーロ			
EUROCOMMERCIAL	25,340	19,690	232	28,873	0.0	
VASTNED RETAIL	10,950	13,750	333	41,436	0.1	
WERELDHAVE NV	24,970	28,770	262	32,606	0.0	
NSI NV	9,300	12,300	370	46,084	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	70,560	74,510	1,199	149,000	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.2 % >	
(スペイン)			千ユーロ			
IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	155,240	161,062	1,262	156,918	0.2	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	35,000	54,000	196	24,359	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	225,270	211,418	1,497	186,143	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	415,510	426,480	2,956	367,421	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.5 % >	
(ベルギー)			千ユーロ			
BEFIMMO S. C. A.	13,310	16,110	579	71,971	0.1	
COFINIMMO	15,330	17,017	2,144	266,452	0.3	
RETAIL ESTATES	4,200	7,600	418	51,944	0.1	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	14,300	15,300	354	44,015	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	11,140	83,470	2,547	316,578	0.4	

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)		
MONTEA	5,900	6,900	687	85,403	0.1	
AEDIFICA	14,966	21,260	1,964	244,118	0.3	
CARE PROPERTY INVEST	—	15,000	411	51,168	0.1	
XIOR STUDENT HOUSING NV	—	8,700	465	57,841	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	79,146	191,357	9,571	1,189,495	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	9	—	< 1.5% >	
(アイルランド)				千ユーロ		
GREEN REIT PLC	440,770	—	—	—	—	
HIBERNIA REIT PLC	402,550	482,550	586	72,919	0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	225,021	260,000	381	47,431	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,068,341	742,550	968	120,350	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	2	—	< 0.2% >	
(その他)				千ユーロ		
CROMWELL EUROPEAN REIT	—	910,000	404	50,323	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	—	910,000	404	50,323	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	< 0.1% >	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	2,110,847	2,896,050	30,937	3,844,662	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	30	—	< 4.8% >	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	574,790	594,850	2,700	374,089	0.5	
CAPITAL & REGIONAL PLC	290,000	—	—	—	—	
DERWENT LONDON PLC	64,880	70,541	2,353	325,971	0.4	
BIG YELLOW GROUP PLC	94,570	101,146	1,160	160,703	0.2	
HAMMERSON PLC	470,100	2,536,320	595	82,492	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	78,220	78,047	545	75,623	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,284	0.0	
UNITE GROUP PLC	175,240	260,682	2,579	357,305	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	785,700	840,537	1,255	173,948	0.2	
SHAFTESBURY PLC	141,730	160,293	859	119,123	0.1	
SEGRO PLC	656,550	761,570	6,892	954,708	1.2	
LAND SECURITIES GROUP PLC	467,800	477,505	3,072	425,570	0.5	
ASSURA PLC	1,540,150	1,707,040	1,287	178,290	0.2	
STANDARD LIFE INV PROP INC	—	260,756	159	22,033	0.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	168,540	169,580	1,153	159,780	0.2	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	350,000	121	16,774	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	320,000	330,000	231	32,135	0.0	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	263,580	—	—	—	—	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	469,000	552,000	422	58,570	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	124,000	135,537	1,097	151,980	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	504,110	567,660	1,351	187,144	0.2	
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	—	495,000	361	50,054	0.1	
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	—	545,297	661	91,698	0.1	
GCP STUDENT LIVING PLC	—	300,000	387	53,607	0.1	
RDI REIT PLC	154,400	154,400	149	20,660	0.0	
NEWRIVER REIT PL	173,000	186,000	128	17,777	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	368,000	380,067	415	57,595	0.1	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	223,286	273,286	310	42,966	0.1	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	—	431,000	453	62,836	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)		
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,065,610	1,092,658	1,807	250,341	0.3	
CUSTODIAN REIT PLC	—	292,276	259	35,951	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	370,000	376,000	235	32,552	0.0	
AEW UK REIT PLC	72,000	118,000	87	12,095	0.0	
LXI REIT PLC	297,000	330,000	382	53,025	0.1	
REGIONAL REIT LTD	232,000	292,000	206	28,637	0.0	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	—	219,355	235	32,663	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	11,016,216	15,961,363	33,930	4,699,993	
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	34	—	< 5.9% >	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST	298,560	328,160	1,374	105,269	0.1	
MIRVAC GROUP	2,451,490	2,507,500	5,867	449,219	0.6	
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,242,633	1,222,633	1,149	87,988	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	218,380	324,160	1,183	90,584	0.1	
GPT GROUP	1,203,310	1,237,517	5,308	406,453	0.5	
CENTURIA CAPITAL GROUP	—	304,000	723	55,392	0.1	
ABACUS PROPERTY GROUP	214,440	192,593	602	46,151	0.1	
STOCKLAND	1,485,780	1,530,344	6,718	514,346	0.6	
DEXUS	674,060	696,940	6,293	481,820	0.6	
GOODMAN GROUP	986,690	1,069,018	21,348	1,634,425	2.0	
VICINITY CENTERS	1,973,650	2,435,040	3,518	269,386	0.3	
CHARTER HALL GROUP	292,530	295,694	4,074	311,956	0.4	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	172,860	198,760	713	54,629	0.1	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	138,588	202,588	994	76,154	0.1	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	542,230	689,060	1,626	124,500	0.2	
ARENA REIT	141,000	241,053	672	51,489	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	—	285,000	906	69,386	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	189,846	294,112	1,508	115,513	0.1	
APN INDUSTRIA REIT	75,000	75,000	211	16,192	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	480,000	626,340	1,164	89,191	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	114,885	366	28,057	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	286,500	324,500	353	27,079	0.0	
HOME CONSORTIUM	—	91,000	343	26,265	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	189,816	212,766	521	39,908	0.0	
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	—	340,000	408	31,236	0.0	
SCENTRE GROUP	3,281,570	3,310,393	7,978	610,799	0.8	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	130,800	242,250	729	55,825	0.1	
CENTURIA OFFICE REIT	151,000	249,000	525	40,223	0.1	
AVENTUS GROUP	—	230,000	575	44,022	0.1	
WAYPOINT REIT LTD	290,000	495,796	1,378	105,523	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	17,188,733	20,366,102	79,140	6,058,994	
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	30	—	< 7.6% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
AMP NZ OFFICE LTD	615,000	650,000	1,144	82,150	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	239,460	708	50,899	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	700,300	680,300	1,673	120,176	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	921,030	1,098,490	1,362	97,814	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	495,000	562,278	826	59,354	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,918,790	3,230,528	5,715	410,395	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.5% >	

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)		
(香港)						
LINK REIT	1,285,000	1,337,800	千香港ドル 84,281	1,143,698	1.4	
PROSPERITY REIT	782,000	952,000	2,161	29,325	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	860,000	968,000	3,552	48,208	0.1	
CHAMPION REIT	1,223,000	1,303,000	5,329	72,318	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	636,000	561,000	1,952	26,492	0.0	
FORTUNE REIT	813,000	982,000	6,441	87,416	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,599,000	6,103,800	103,718	1,407,459	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<1.8%>	
(シンガポール)						
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	1,744,900	2,929,844	千シンガポールドル 5,566	434,815	0.5	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,583,966	1,792,400	5,717	446,613	0.6	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	1,765,228	—	—	—	—	
SUNTEC REIT	1,451,400	1,382,700	1,963	153,363	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,830,952	1,659,800	3,435	268,369	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	706,300	1,109,400	488	38,128	0.0	
ASCOTT TRUST	734,000	1,116,877	971	75,898	0.1	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	412,300	—	—	—	—	
KEPPEL REIT	1,241,400	1,146,400	1,169	91,336	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	484,329	661,162	1,514	118,263	0.1	
ESR REIT	1,163,365	1,404,065	512	40,030	0.0	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	458,300	417,200	450	35,194	0.0	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	399,429	467,729	584	45,667	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	338,000	538,100	226	17,653	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	245,000	375,000	446	34,856	0.0	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	250,000	258,000	1,068	83,430	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	954,000	80	6,259	0.0	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	972,460	1,052,060	3,366	262,964	0.3	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,362,873	1,450,173	2,813	219,749	0.3	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	591,000	701,000	410	32,031	0.0	
SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	478,540	169	13,269	0.0	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,390,800	1,372,100	1,221	95,385	0.1	
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	435,000	—	—	—	—	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	480,000	540,000	321	25,096	0.0	
SPH REIT	462,300	726,800	563	43,997	0.1	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	379,016	689,516	324	25,313	0.0	
EC WORLD REIT	—	180,000	126	9,912	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	250,000	295,800	229	17,906	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,363,644	1,523,644	510	39,868	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	—	555,000	355	27,744	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	460,000	193	15,090	0.0	
IREIT GLOBAL	—	334,420	202	15,803	0.0	
KEPPEL DC REIT	804,003	794,803	2,344	183,142	0.2	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	977,820	1,662,696	2,228	174,030	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	26,170,325	29,029,229	39,574	3,091,187	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	<3.9%>	
(韓国)						
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	—	42,950	千韓国ウォン 175,236	16,507	0.0	

銘柄	当期末(前期末)		当 期		比 率 (%)	
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	17,500	19,093	137,278	12,931	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	—	69,030	372,071	35,049	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	17,500	131,073	684,586	64,488	
	銘柄 数<比 率>	1	3	—	<0.1%>	
(イスラエル) REIT 1 LTD		104,000	131,500	千イスラエルシェケル 2,077	64,886	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	104,000	131,500	2,077	64,886	
	銘柄 数<比 率>	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	80,582,093	95,295,933	—	79,860,114	
	銘柄 数<比 率>	306	322	—	<99.6%>	

(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) 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	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円	%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	79,860,114	99.1
投 資 信 託 財 産 総 額	727,242	0.9
	80,587,356	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(80,205,416千円)の投資信託財産総額(80,587,356千円)に対する比率は99.5%です。

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

1米ドル=105.21円

1イギリスポンド=138.52円

1香港ドル=13.57円

1イスラエルシェケル=31.23円

1カナダドル=80.83円

1オーストラリアドル=76.56円

1シンガポールドル=78.11円

1ユーロ=124.27円

1ニュージーランドドル=71.81円

1韓国ウォン=0.0942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 2020年11月10日現在
(A) 資 産	80,596,346,615円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	556,987,859
投 資 証 券 (評 価 額)	79,860,114,571
未 収 入 金	11,300,125
未 収 配 当 金	167,944,060
(B) 負 債	383,191,944
未 払 株 式 払 込 金	312,168,940
未 払 解 約 金	4,810,523
未 払 利 息	66,212,376
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	80,213,154,671
元 本	47,638,239,657
次 期 繰 越 損 益 金	32,574,915,014
(D) 受 益 権 総 口 数	47,638,239,657口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,838円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2019年11月12日 至 2020年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	3,181,817,986円
受 取 配 当 金	3,181,560,558
受 取 利 息	483,569
支 払 利 息	△226,141
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△14,724,853,158
売 買 益	5,671,360,285
売 買 損	△20,396,213,443
(C) そ の 他 費 用	△32,211,484
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△11,575,246,656
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	43,860,417,464
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	11,635,106,594
(G) 解 約 差 損 益 金	△11,345,362,388
(H) 計 (D+E+F+G)	32,574,915,014
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	32,574,915,014

- (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44,803,032,363円、期中追加設定元本額は19,491,484,634円、期中一部解約元本額は16,656,277,340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)	23,397,867,868円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,341,799,220円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,990,280,342円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,664,464,366円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,407,724,679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)	1,305,493,065円
分散投資コア戦略ファンドS	1,071,882,269円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,015,767,319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)	707,568,892円
分散投資コア戦略ファンドA	523,397,906円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	469,998,388円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	437,112,171円
グローバル経済コア	270,139,777円
SMT インデックスバランス・オープン	179,628,173円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	157,579,732円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	155,685,640円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	151,919,427円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	142,414,037円
グローバル3資産バランスオープン	96,683,160円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	83,533,855円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	48,565,023円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	8,887,820円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,501,529円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,344,999円

お知らせ

該当事項はありません。

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13期(決算日 2021年5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上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債組入比率	債券先物率	純資産額
	円騰落	中率%	期騰落	中率%			
第9期(2017年5月26日)	3,184	△0.7	3,752	0.3	97.4	—	百万円 20,748
第10期(2018年5月28日)	3,357	5.4	3,993	6.4	98.4	—	22,475
第11期(2019年5月27日)	2,958	△11.9	3,456	△13.5	98.2	—	21,487
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

(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		債組入比率	債券先物率
	円騰落	率%	期騰落	率%		
(当期首) 2020年5月26日	2,494	—	2,711	—	97.8	—
5月末	2,494	0.0	2,707	△0.2	97.5	—
6月末	2,566	2.9	2,776	2.4	97.9	—
7月末	2,652	6.3	2,863	5.6	97.7	—
8月末	2,827	13.4	3,090	14.0	98.6	—
9月末	2,753	10.4	2,981	10.0	98.1	—
10月末	2,745	10.1	3,004	10.8	98.4	—
11月末	2,878	15.4	3,117	15.0	98.8	—
12月末	2,960	18.7	3,200	18.0	98.9	—
2021年1月末	3,081	23.5	3,351	23.6	98.8	—
2月末	3,397	36.2	3,712	36.9	98.9	—
3月末	3,377	35.4	3,674	35.5	98.6	—
4月末	3,603	44.5	3,939	45.3	98.9	—
(当期末) 2021年5月26日	3,665	47.0	3,985	47.0	98.3	—

(注1)騰落率は期首比です。

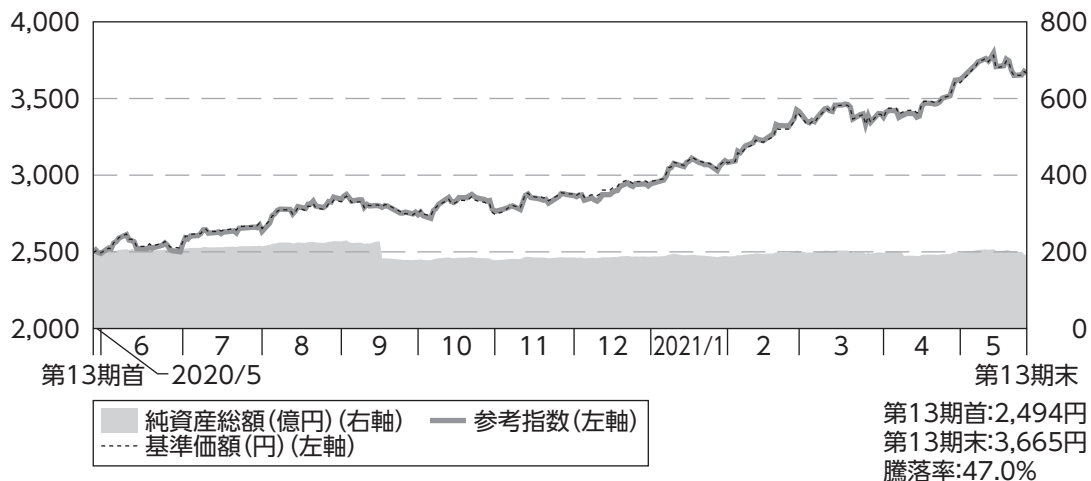
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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.)およびその関係会社(総称して、「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、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 IndexSM)および「ブルームバーグ(Bloomberg[®])」は、ブルームバーグ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 IndexSM)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・シーおよびその関係会社(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、ブルームバーグおよびUBSは、当ファンドを承認し、是認し、レビューまたは推奨するものではありません。ブルームバーグおよびUBSのいずれも、ブルームバーグ商品指数(Bloomberg Commodity IndexSM)に関連するいかなるデータまたは情報の適時性、正確性また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

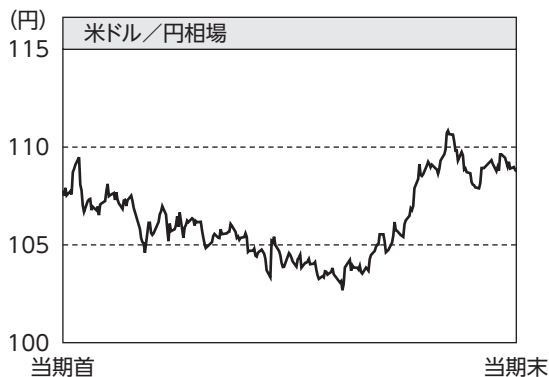
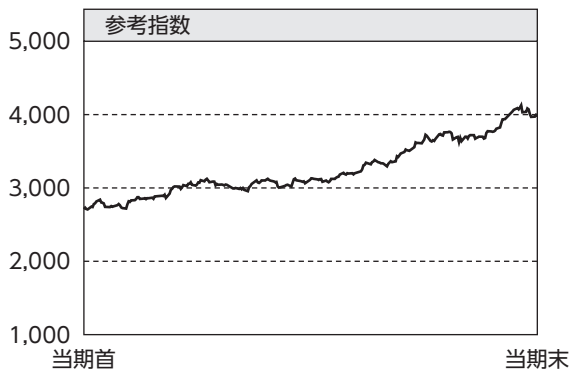


(注)参考指数は、2020年5月26日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、ブルームバーク商品指数(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、各国中央銀行による大規模な金融緩和や新型コロナウイルスワクチンの実用化、米国の追加経済対策成立などを受けて景気回復と商品需要拡大への期待が高まり、エネルギーセクター、穀物セクターをはじめとして全般的に上昇しました。

外国為替市場は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けたFRB(米連邦準備理事会)による大規模な金融緩和政策や低金利政策の長期化などを背景に、円高・米ドル安が進行しました。しかし2021年1月上旬以降は、米国の追加経済対策成立を受けて米長期金利が上昇し日米金利差拡大が意識されたことなどから、通期では円安・米ドル高となりました。

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

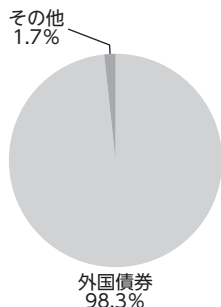
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 008 10/22/21	アイルランド	41.9%
2	SG ISSUER 023 03/31/22	ルクセンブルク	12.9%
3	SG ISSUER 020 06/30/21	ルクセンブルク	11.8%
4	SG ISSUER 022 01/31/22	ルクセンブルク	9.5%
5	SG ISSUER 021 11/30/21	ルクセンブルク	7.6%
6	CS USD COM 017 07/30/21	イギリス	5.2%

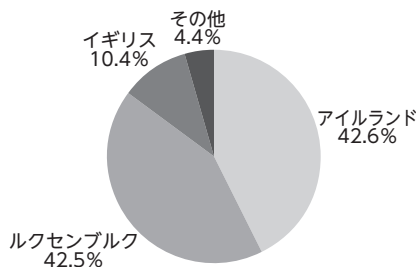
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	BAR USD COM 038 08/31/21	イギリス	5.0%
8	IPATH DOW COMM 06/12/36	アメリカ	2.2%
9	ETFS ALL COMMODITIES	ジャージー	2.1%
10	—	—	—
組入銘柄数			9

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

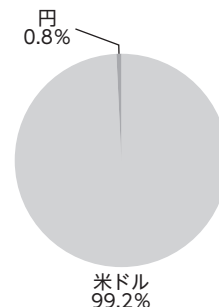
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

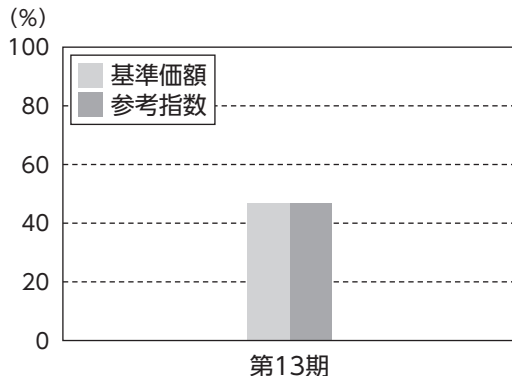


(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

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		項目の概要
	(2020年5月27日~2021年5月26日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	1 (1) (-) (0)	0.029 (0.029) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	1	0.029	

(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(2,944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 175,766	千米ドル 250,673

(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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 53	百万円 53	% 100.0	百万円 53	百万円 53	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	60,495	2,948	4.9	59,752	3,003	5.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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 B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千米ドル (注4)	千米ドル 173,777	千円 18,898,332	% 98.3	% —	% 4.4	% —	% 93.9
合 計	(注4)	173,777	18,898,332	98.3	—	4.4	—	93.9

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(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

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)	
(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 038 08/31/21	—	7,000	8,918	969,840	2021/8/31
CS USD COM 017 07/30/21	—	7,000	9,197	1,000,206	2021/7/30
ETFS ALL COMMODITIES	—	(注2)40,000	3,784	411,510	—(注3)
IPATH DOW COMM 06/12/36	—	(注4)15,000	3,937	428,203	2036/6/12
SG ISSUER 020 06/30/21	—	15,000	20,784	2,260,260	2021/6/30
SG ISSUER 021 11/30/21	—	11,000	13,445	1,462,176	2021/11/30
SG ISSUER 022 01/31/22	—	15,000	16,837	1,831,078	2022/1/31
SG ISSUER 023 03/31/22	—	21,000	22,829	2,482,664	2022/3/31
STAR HELIOS 008 10/22/21	—	59,000	74,045	8,052,393	2021/10/22
合 計				18,898,332	

(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) 無額面のため、取引数量を表示しております。

(注3) 当銘柄は、償還期限の定めがありません。

(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
公 社 債	18,898,332	94.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,158,155	5.8
投 資 信 託 財 産 総 額	20,056,487	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(19,083,459千円)の投資信託財産総額(20,056,487千円)に対する比率は95.1%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=108.75円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年5月26日現在
(A)資 産	20,056,487,337円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	313,906,850
公 社 債(評価額)	18,898,332,487
未 収 入 金	844,248,000
(B)負 債	828,753,830
未 払 解 約 金	828,753,020
未 払 利 息	810
(C)純 資 産 総 額(A-B)	19,227,733,507
元 本	52,456,537,645
次 期 繰 越 損 益 金	△33,228,804,138
(D)受 益 権 総 口 数	52,456,537,645口
1万口当たり基準価額(C/D)	3,665円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月27日 至 2021年5月26日
(A)配 当 等 収 益	△123,860円
受 取 利 息	816
支 払 利 息	△124,676
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	7,659,925,795
売 買 益	7,791,076,232
売 買 損	△131,150,437
(C)そ の 他 費 用	△5,995,737
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	7,653,806,198
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△59,135,981,782
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△4,469,242,439
(G)解 約 差 損 益 金	22,722,613,885
(H) 計 (D+E+F+G)	△33,228,804,138
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△33,228,804,138

(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78,780,483,845円、期中追加設定元本額は6,213,591,718円、期中一部解約元本額は32,537,537,918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)	38,369,694,499円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,864,539,915円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,678,129,478円
コモディティ・オープン(適格機関投資家専用)	2,454,943,199円
SMTAMコモディティ・オープン	1,779,232,622円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,531,251,194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)	1,045,504,308円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	663,375,528円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	69,866,902円

お知らせ

該当事項はありません。

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

運用報告書

第4期(決算日 2021年7月12日)

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2017年10月11日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	別に定める金現物に投資する上場投資信託証券(以下「投資対象上場投資信託証券」といいます。)を主要投資対象とします。 別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。 iShares Gold Trust SPDR Gold Shares
組入制限	株式(新株引受権証券及び新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		投 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率		
設定日(2017年10月11日)	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	百万円 3,000
第1期(2018年7月10日)	9,520	△4.8	9,624	△3.8	100.0	17,516
第2期(2019年7月10日)	10,200	7.1	10,341	7.5	99.8	27,180
第3期(2020年7月10日)	12,833	25.8	13,346	29.1	99.0	28,966
第4期(2021年7月12日)	12,644	△1.5	13,227	△0.9	98.9	36,114

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。

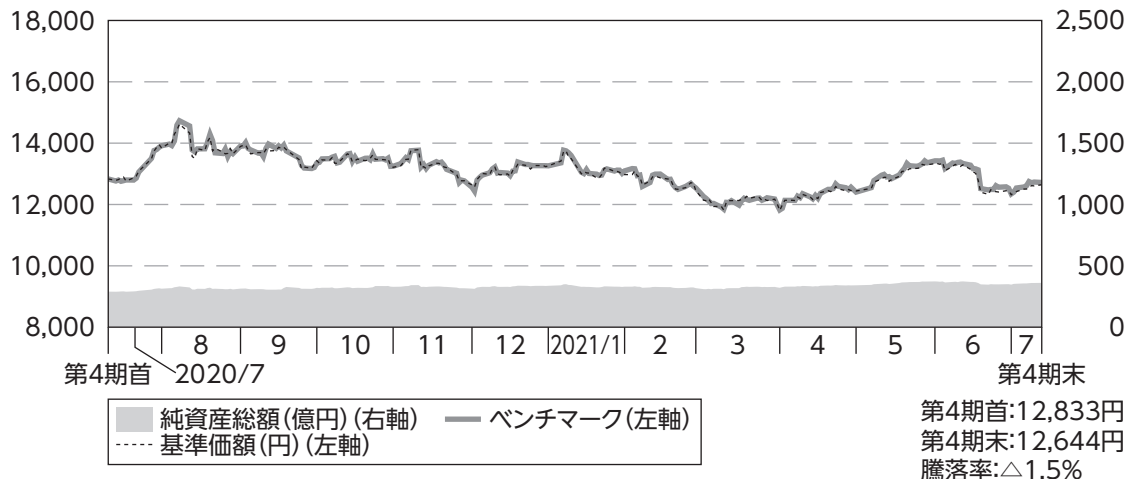
当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		投資信託証券 組入比率
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %	
(当 期 首) 2020年 7月10日	12,833	—	13,346	—	99.0
7月末	13,839	7.8	14,471	8.4	96.6
8月末	13,894	8.3	14,463	8.4	99.0
9月末	13,431	4.7	13,886	4.0	99.7
10月末	13,213	3.0	13,775	3.2	98.9
11月末	12,636	△1.5	13,063	△2.1	98.9
12月末	13,260	3.3	13,789	3.3	98.9
2021年 1月末	12,975	1.1	13,620	2.1	101.2
2月末	12,455	△2.9	13,041	△2.3	100.7
3月末	11,806	△8.0	12,294	△7.9	102.6
4月末	12,440	△3.1	12,899	△3.3	98.2
5月末	13,332	3.9	13,960	4.6	99.5
6月末	12,318	△4.0	12,837	△3.8	100.7
(当 期 末) 2021年 7月12日	12,644	△1.5	13,227	△0.9	98.9

(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

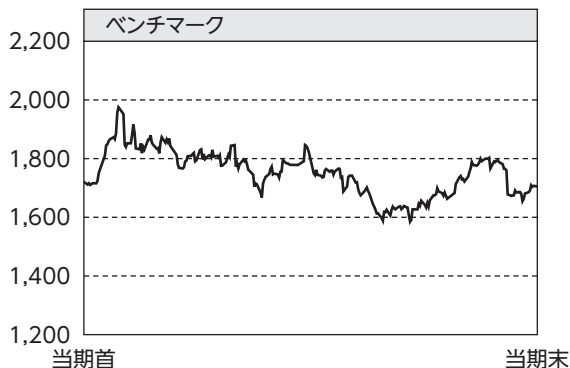


(注)ベンチマークは、2020年7月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、基準価額は下落しました。

投資環境



金価格は下落しました。

米中が互いの総領事館を封鎖するなど両国の対立激化懸念が高まったことなどから金に対する安全資産需要が高まり、金価格は大幅に上昇して始まりましたが、その後は一部の堅調な米経済指標が好感されたことや、新型コロナウイルスワクチンの早期実用化による経済正常化への期待が高まり金に対する安全資産需要が減退したこと、米長期金利が大幅に上昇したことなどを背景に2021年3月末にかけて金価格は軟調に推移しました。4月以降は米国の金融緩和政策が維持されるとの見方が広がり、ドル安が進行したことなどから上昇しましたが、期末にかけてはFOMC(米連邦公開市場委員会)参加者による利上げ予想時期の前倒しなどを受けてドル高が進行したことなどを背景に上昇幅を縮小しました。

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

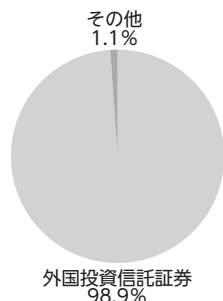
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	98.9%
2	――	――	――
3	――	――	――
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――

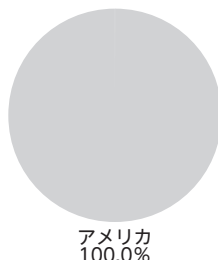
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数		1	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

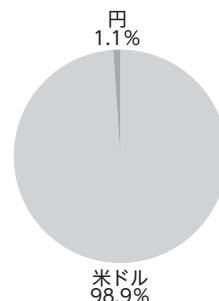
○資産別配分



○国別配分



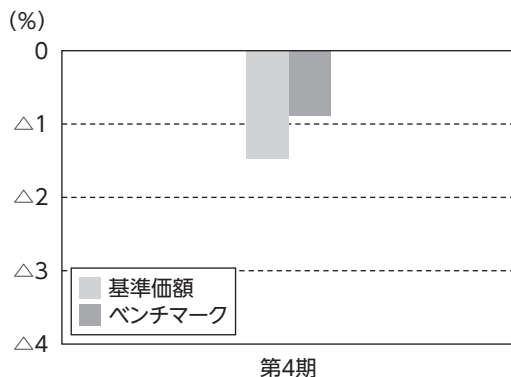
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

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、コスト要因およびキャッシュ要因(いずれもマイナス要因)などです。

今後の運用方針

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

別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

別に定める「ベンチマーク」とは、次のものをいいます。

LBMA金価格(円ヘッジベース)

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年7月11日~2021年7月12日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (-) (-) (-) (1) (-) (-)	0.004% (-) (-) (-) (0.004) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	0 (-) (-) (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (2) (-) (0)	0.015 (0.015) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	3	0.019	

(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(12,966円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES GOLD TRUST	5,027	92,830	1,771 (9,358)	32,755 (-)
小 計	5,027	92,830	1,771 (9,358)	32,755 (-)

(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	%
金 銭 信 託	0.005240	0.005240	100.0	0.005240	0.005240	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	38,210	554	1.4	38,126	548	1.4

(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。

組入資産の明細

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末			
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ) ISHARES GOLD TRUST	15,519	9,416	千米ドル 324,216	35,718,965	
合 計	15,519	9,416	324,216	35,718,965	
口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	-	<98.9%>	

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

(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	35,718,965	98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	401,050	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	36,120,015	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(35,725,685千円)の投資信託財産総額(36,120,015千円)に対する比率は98.9%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=110.17円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■ 資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年7月12日現在
(A)資 産	70,855,733,211円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	113,422,822
投資信託受益証券(評価額)	35,718,965,831
未 収 入 金	35,023,344,558
(B)負 債	34,741,567,791
未 払 金	34,735,717,340
未 払 解 約 金	5,850,289
未 払 利 息	162
(C)純 資 産 総 額(A-B)	36,114,165,420
元 本	28,562,552,203
次 期 繰 越 損 益 金	7,551,613,217
(D)受 益 権 総 口 数	28,562,552,203口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,644円

■ 損益の状況

項 目	当 期 自 2020年7月11日 至 2021年7月12日
(A)配 当 等 収 益	△59,464円
受 取 利 息	438
支 払 利 息	△59,902
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△567,736,201
売 買 益	3,277,565,695
売 買 損	△3,845,301,896
(C)そ の 他 費 用	△4,858,677
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△572,654,342
(E)前 期 繰 越 損 益 金	6,394,161,392
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	3,060,207,794
(G)解 約 差 損 益 金	△1,330,101,627
(H)計 (D+E+F+G)	7,551,613,217
次 期 繰 越 損 益 金(H)	7,551,613,217

(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22,572,469,512円、期中追加設定元本額は9,867,819,725円、期中一部解約元本額は3,877,737,034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	12,026,495,095円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,329,169,406円
分散投資コア戦略ファンドA	3,137,168,962円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,248,503,799円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	2,241,421,226円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	1,720,394,122円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,376,230,479円
グローバル経済コア	1,187,625,868円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	557,552,669円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	531,632,248円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	138,698,918円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	67,659,411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1期（決算日 2021年3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上げます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	債 券 先 物 率	純 資 産 額
設定日(2020年10月6日)	円 10,000	% —	百万円 0.4
第1期(2021年3月10日)	9,132	△8.7	17,580

(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 先 物 率
(設 定 日) 2020年10月6日	円 10,000	% —
10月末	9,968	△0.3
11月末	9,421	△5.8
12月末	9,331	△6.7
2021年1月末	9,315	△6.9
2月末	9,162	△8.4
(当 期 末) 2021年3月10日	9,132	△8.7

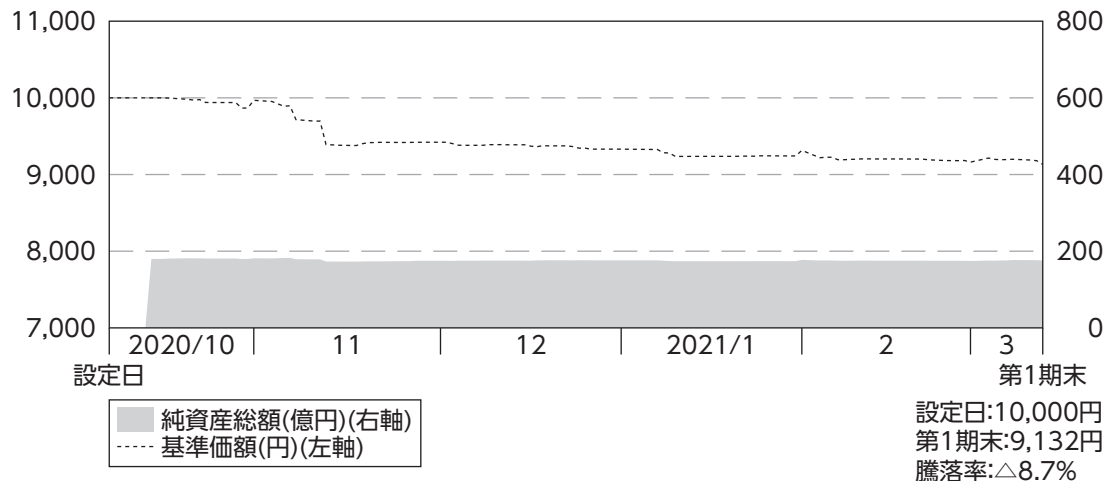
(注1)騰落率は設定日比です。

(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※のリターンがマイナスとなったことから、当ファンドの基準価額は設定来で下落しました。

※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は解消する戦略です。

投資環境

米国株式市場は、2020年10月上旬は追加経済対策の部分合意への期待などから上昇したものの、下旬にかけては与野党協議の行き詰まりによる追加経済対策成立の遅れや新型コロナウイルスの感染再拡大が懸念され下落しました。11月上旬にかけては新型コロナウイルスワクチンの良好な治験結果が示されたことを受けてワクチンの早期実用化による経済正常化への期待が高まったことなどを背景に急上昇しました。その後もFRB(米連邦準備理事会)議長が金融緩和政策の長期化を示唆したことや、議会選挙で民主党が上下両院で多数を確保し大型経済対策実現への期待が高まったことなどを背景に、堅調に推移しました。

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

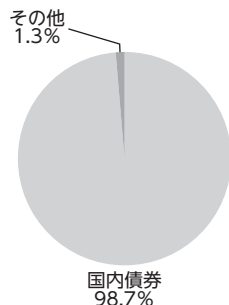
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 10/18/21	アイルランド	98.7%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

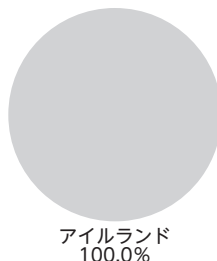
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

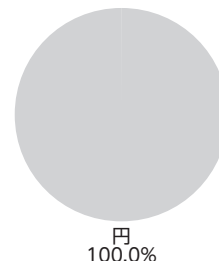
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

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

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		項目の概要
	(2020年10月6日~2021年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	1 (1) (-) (-)	0.007 (0.007) (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	1	0.007	

(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(9,439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 18,957,882	千円 -

(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			期 末		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.011066	百万円 0.011066	% 100.0	百万円 0.011066	百万円 0.011066	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	81,190	275	0.3	80,955	275	0.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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				期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	千円 19,020,000 (19,020,000)	千円 17,346,240 (17,346,240)	% 98.7 (98.7)	% - (-)	% - (-)	% - (-)	% 98.7 (98.7)
合 計	19,020,000 (19,020,000)	17,346,240 (17,346,240)	98.7 (98.7)	- (-)	- (-)	- (-)	98.7 (98.7)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2)()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期		期 末		償 還 年 月 日
	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%	10/18/21	19,020,000	17,346,240	2021/10/18	
合 計		19,020,000	17,346,240		

※ 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
公 社 債	17,346,240	98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	234,609	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	17,580,849	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年3月10日現在
(A)資 産	17,580,849,030円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	234,609,030
公 社 債(評価額)	17,346,240,000
(B)負 債	474,623
未 払 解 約 金	474,451
未 払 利 息	172
(C)純 資 産 総 額(A-B)	17,580,374,407
元 本	19,250,812,921
次 期 繰 越 損 益 金	△1,670,438,514
(D)受 益 権 総 口 数	19,250,812,921口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,132円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年10月 6日 至 2021年 3月10日
(A)配 当 等 収 益	△78,462円
受 取 利 息	692
支 払 利 息	△79,154
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,611,642,000
売 買 損 益	△1,611,642,000
(C)そ の 他 費 用	△1,324,977
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,613,045,439
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	△65,997,612
(F)解 約 差 損 益 金	8,604,537
(G) 計 (D+E+F)	△1,670,438,514
次 期 繰 越 損 益 金(G)	△1,670,438,514

- (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495,000円、期中追加設定元本額は19,375,607,672円、期中一部解約元本額は125,289,751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	8,107,349,741円
ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	6,500,000,000円
分散投資コア戦略ファンドA	1,915,318,548円
コア投資戦略ファンド(成長型)	755,000,000円
コア投資戦略ファンド(安定型)	620,000,000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)	347,087,314円
コア投資戦略ファンド(切替型)	280,000,000円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	252,091,312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)	206,719,065円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	159,246,941円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	100,000,000円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	8,000,000円

お知らせ

該当事項はありません。