

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2017年8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	SMT 8資産インデックス バランス・オープン	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式インデックス マザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
	外国株式インデックス マザーファンド	原則として、MSCIコクサイ・インデックスを構成している国の株式を主要投資対象とします。
	新興国株式インデックス マザーファンド	取引所に上場されている新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)を主要投資対象とします。
	国内債券インデックス マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国債券インデックス マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国債券インデックス マザーファンド	新興国の債券を主要投資対象とします。
	J-REITインデックス マザーファンド	わが国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組入制限	グローバルREITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国の取引所に上場している(上場予定を含みます。)不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	SMT 8資産インデックス バランス・オープン	株式、新株引受権証券及び新株予約権証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%以下とします。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。外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の75%以下とします。
	国内株式インデックス マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は、行いません。
	外国株式インデックス マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式インデックス マザーファンド	株式等への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	国内債券インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
	外国債券インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	新興国債券インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分配方針	J-REITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	グローバルREITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
	年2回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。	
	分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

SMT 8資産インデックス バランス・オープン

運用報告書(全体版)

第9期(決算日 2021年11月10日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	円	%										
第5期(2019年11月11日)	11,176	0	6.7	36.3	1.3	34.9	0.1	25.7	百万円	32			
第6期(2020年5月11日)	9,884	0	△11.6	37.4	1.5	33.5	0.2	25.2	38				
第7期(2020年11月10日)	11,058	0	11.9	38.6	1.7	33.7	0.1	24.4	58				
第8期(2021年5月10日)	12,622	0	14.1	37.7	1.7	32.9	0.1	26.2	83				
第9期(2021年11月10日)	13,229	0	4.8	37.7	1.6	32.5	0.1	26.6	104				

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

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

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		株 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率	債 組 比	券 入 率	債 先 比	券 物 率	投 信 託 証 券 組 入 比 率
	円	%									
(当期首) 2021年5月10日	12,622	—	37.7	1.7	32.9	0.1	26.2				
5月末	12,725	0.8	37.5	1.7	32.7	0.1	26.4				
6月末	12,935	2.5	37.5	1.8	32.2	0.3	26.8				
7月末	12,867	1.9	37.2	1.4	32.8	0.1	26.8				
8月末	12,992	2.9	37.2	1.6	32.6	0.2	27.0				
9月末	12,878	2.0	37.6	1.6	32.8	0.2	26.5				
10月末	13,253	5.0	37.7	1.6	32.3	0.1	27.0				
(当期末) 2021年11月10日	13,229	4.8	37.7	1.6	32.5	0.1	26.6				

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

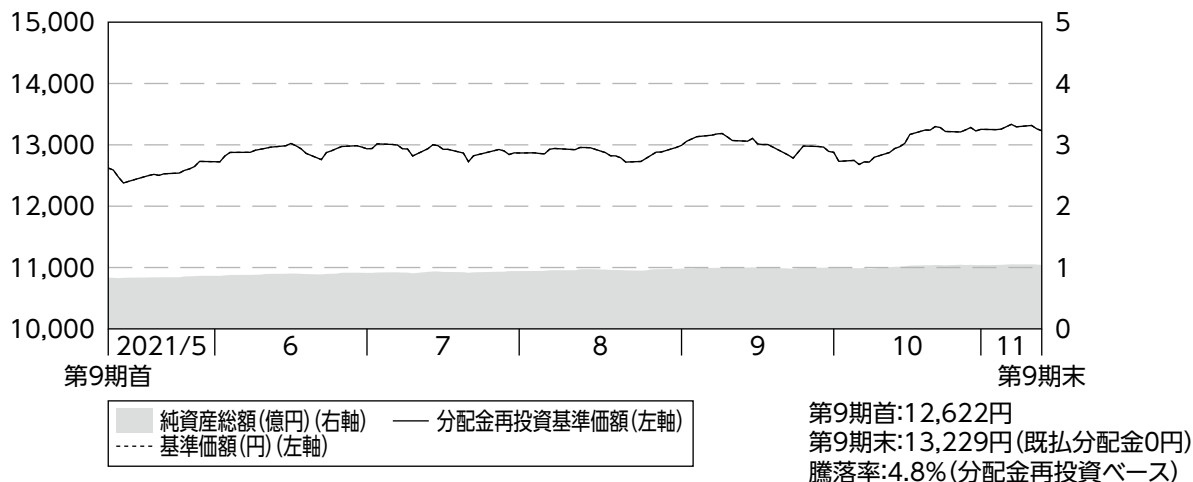
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2021年5月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

各国の金融政策や経済対策に加え、新型コロナウイルスワクチン接種による経済正常化期待から、株式やREITを中心としたリスク資産がプラスに寄与しました。

組入ファンド	投資資産*	基本組入比率	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	12.5%	12.6%	3.9%
外国株式インデックス マザーファンド	先進国株式	12.5%	14.5%	13.8%
新興国株式インデックス マザーファンド	新興国株式	12.5%	12.0%	△0.8%
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	12.5%	10.2%	0.2%
外国債券インデックス マザーファンド	先進国債券	12.5%	11.6%	2.9%
新興国債券インデックス マザーファンド	新興国債券	12.5%	11.3%	△0.1%
J-REITインデックス マザーファンド	国内REIT	12.5%	12.4%	1.8%
グローバルREITインデックス マザーファンド	先進国REIT	12.5%	14.4%	16.6%

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

投資環境

国内株式市場

国内株式市場は上昇しました。当期前半から比較的狭いレンジでの推移が続きました。2021年9月上旬にかけては菅首相の退陣表明を受けて次期政権の経済政策への期待が高まったことなどから上昇したものの、その後期末にかけては10月末に総選挙の投開票を控えて様子見気分が強まり、上値の重い展開となりました。

先進国株式市場

先進国株式市場は大幅に上昇しました。各国の金融政策や経済対策に加え、新型コロナウイルスワクチン接種の進展や良好な経済指標などがプラスに寄与しました。

新興国株式市場

新興国株式市場は概ね横ばいとなりました。多くの国における金融政策や経済対策による下支えがプラスに寄与したものの、中国当局による大手IT関連企業などを対象とした規制強化が相次いだことや中国大手不動産開発会社の債務危機問題が浮上し、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどがマイナスに影響しました。

国内債券市場

国内債券市場は概ね横ばいとなりました。日銀は緩和的な金融政策を続ける方針であり、国内債券の利回りは低い水準で概ね安定して推移しました。

先進国債券市場

先進国債券市場は上昇しました。当期前半は欧米の主要中央銀行が緩和的な姿勢を示したことから利回りが低下（価格は上昇）しましたが、当期後半は米国のテーパリング（量的金融緩和の段階的縮小）観測が高まったことなどから利回りは上昇に転じました。

投資環境

新興国債券市場

新興国債券市場は概ね横ばいとなりました。市場のリスク許容度の回復に加え、相対的に高い利回りを求める投資家の買い意欲がプラスに寄与したものの、欧米先進国の金融政策正常化へ向けた動きや先行きの物価上昇懸念などを背景に金利上昇圧力が強まったことがマイナスに影響しました。

国内REIT市場

国内REIT市場は上昇しました。経済正常化への期待や、株式と比較した国内REITの出遅れ感に着目した投資家の買いがプラスに寄与しました。

先進国REIT市場

先進国REIT市場は上昇しました。各国の金融政策や経済対策が下支えとなったほか、新型コロナウイルスワクチンの接種開始による各種施設の再開への期待が高まったことがプラスに寄与しました。

○当ファンド

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

・国内株式インデックス マザーファンド

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

・外国株式インデックス マザーファンド

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

・新興国株式インデックス マザーファンド

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

・国内債券インデックス マザーファンド

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

- **外国債券インデックス マザーファンド**

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

- **新興国債券インデックス マザーファンド**

ベンチマークであるJPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)に連動する投資成果を目標として、ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させた運用を行いました。

- **J-REITインデックス マザーファンド**

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

- **グローバルREITインデックス マザーファンド**

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

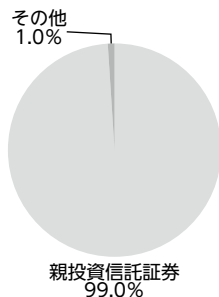
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

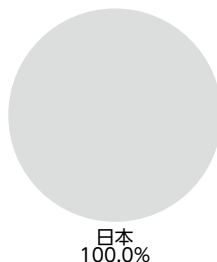
	当期末
	2021年11月10日
外国株式インデックス マザーファンド	14.5%
グローバルREITインデックス マザーファンド	14.4%
国内株式インデックス マザーファンド	12.6%
J-REITインデックス マザーファンド	12.4%
新興国株式インデックス マザーファンド	12.0%
外国債券インデックス マザーファンド	11.6%
新興国債券インデックス マザーファンド	11.3%
国内債券インデックス マザーファンド	10.2%
その他	1.0%
組入ファンド数	8

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

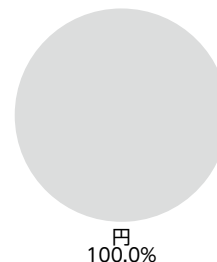
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第9期	
	2021年5月11日~2021年11月10日	
当期分配金 (円)	-	
(対基準価額比率) (%)	(-)	
当期の収益 (円)	-	
当期の収益以外 (円)	-	
翌期繰越分配対象額 (円)	3,269	

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

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

(注3)-印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

○当ファンド

主として、下記のマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内、先進国及び新興国の株式(DR(預託証券)を含みます。)及び債券、並びに国内及び先進国の不動産投資信託証券に実質的に分散投資することでリスクの低減を図ります。

各マザーファンド受益証券の基本配分比率は、8分の1ずつの均等配分とします。

・国内株式インデックス マザーファンド

原則として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。

・外国株式インデックス マザーファンド

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

・新興国株式インデックス マザーファンド

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

・国内債券インデックス マザーファンド

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

・外国債券インデックス マザーファンド

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

・新興国債券インデックス マザーファンド

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

・J-REITインデックス マザーファンド

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

・グローバルREITインデックス マザーファンド

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年5月11日~2021年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	36円	0.277%	(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12,941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)	(14)	(0.111)	
(販売会社)	(18)	(0.139)	
(受託会社)	(4)	(0.028)	
(b) 売買委託手数料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(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	0.001	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.001)	
(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	3	0.024	(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)	(3)	(0.021)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	39	0.304	

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

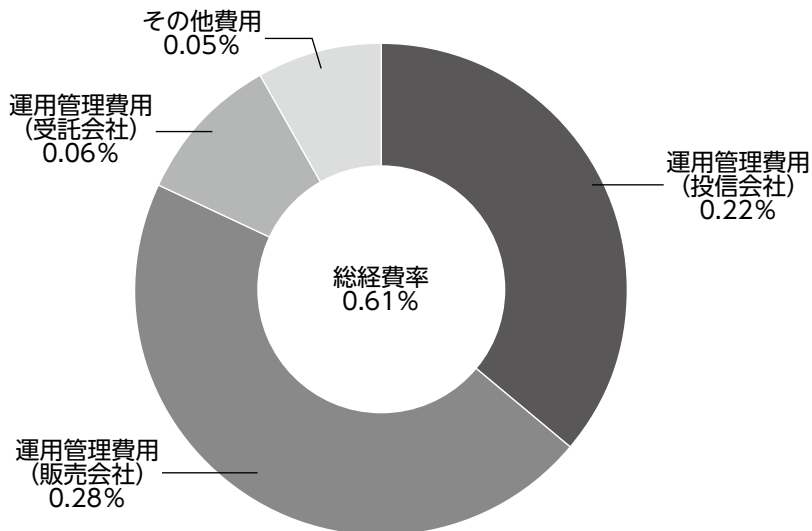
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は0.61%です。



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

(注2)各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	1,211	2,694	266	590
グローバルREITインデックス マザーファンド	1,155	2,629	469	1,100
新興国株式インデックス マザーファンド	730	2,694	161	590
国内株式インデックス マザーファンド	1,421	2,694	309	590
外国株式インデックス マザーファンド	674	2,627	263	1,054
国内債券インデックス マザーファンド	1,756	2,478	384	543
外国債券インデックス マザーファンド	876	2,694	191	590
新興国債券インデックス マザーファンド	1,526	2,694	336	590

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	12,654,072千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	94,790,765千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.13

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<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	55,952,681千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	471,301,085千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.11

(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	49,922,320千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	504,330,081千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.09

(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。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 109	百万円 0.257992	% 0.2	百万円 109	百万円 0.257992	% 0.2

(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。

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 408,504	百万円 1,026	% 0.3	百万円 407,871	百万円 1,026	% 0.3

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<グローバルREITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 18,263	百万円 19	% 0.1	百万円 18,165	百万円 19	% 0.1

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 13,590	百万円 30	% 0.2	百万円 13,570	百万円 30	% 0.2

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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
コール・ローン	百万円 426,425	百万円 911	% 0.2	百万円 426,322	百万円 911	% 0.2

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	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 13,769	百万円 -	% -	百万円 56,359	百万円 61	% 0.1
コール・ローン	113,606	178	0.2	114,425	178	0.2

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<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
コール・ローン	百万円 169,508	百万円 152	% 0.1	百万円 169,509	百万円 152	% 0.1

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	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 14,013	百万円 83	% 0.6	百万円 18,992	百万円 136	% 0.7
コール・ローン	495,109	1,136	0.2	494,512	1,136	0.2

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 146,635	百万円 317	% 0.2	百万円 147,659	百万円 317	% 0.2

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■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	56百万円	26百万円	1,272百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	4,954	5,899	12,916
グローバルREITインデックス マザーファンド	5,371	6,057	14,961
新興国株式インデックス マザーファンド	2,813	3,383	12,532
国内株式インデックス マザーファンド	5,621	6,733	13,168
外国株式インデックス マザーファンド	3,146	3,557	15,055
国内債券インデックス マザーファンド	6,168	7,539	10,642
外国債券インデックス マザーファンド	3,165	3,850	12,044
新興国債券インデックス マザーファンド	5,464	6,654	11,755

(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	50,752,359千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	41,344,855千口
新興国株式インデックス マザーファンド	28,114,813千口
国内株式インデックス マザーファンド	251,362,690千口
外国株式インデックス マザーファンド	126,848,172千口
国内債券インデックス マザーファンド	459,359,027千口
外国債券インデックス マザーファンド	97,161,984千口
新興国債券インデックス マザーファンド	44,796,605千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J-REITインデックス マザーファンド	12,916	12.3
グローバルREITインデックス マザーファンド	14,961	14.3
新興国株式インデックス マザーファンド	12,532	11.9
国内株式インデックス マザーファンド	13,168	12.5
外国株式インデックス マザーファンド	15,055	14.3
国内債券インデックス マザーファンド	10,642	10.1
外国債券インデックス マザーファンド	12,044	11.5
新興国債券インデックス マザーファンド	11,755	11.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,863	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	104,936	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(102,118,960千円)の投資信託財産総額(102,344,732千円)に対する比率は99.8%です。

(注2)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(104,056,110千円)の投資信託財産総額(104,261,383千円)に対する比率は99.8%です。

(注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(536,773,398千円)の投資信託財産総額(537,273,034千円)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(300,363,245千円)の投資信託財産総額(304,271,622千円)に対する比率は98.7%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(78,636,187千円)の投資信託財産総額(79,982,299千円)に対する比率は98.3%です。

(注6)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=112.86円

1ブラジルリアル=20.5709円

1ペルーヌエボソル=28.1042円

1ユーロ=130.83円

1スウェーデンクローナ=13.16円

1トルコリラ=11.5981円

1ポーランドズロチ=28.4806円

1ニューージーランドドル=80.42円

1マレーシアリンギット=27.1906円

1インドネシアルピア=0.008円

1インドルピー=1.53円

1カタールリアル=30.92円

1サウジアラビアリアル=30.14円

1カナダドル=90.70円

1チリペソ=0.142432円

1ウルグアイペソ=2.5927円

1イギリスポンド=152.97円

1ノルウェークローネ=13.27円

1チェココルナ=5.1812円

1ロシアルーブル=1.60円

1香港ドル=14.49円

1タイバーツ=3.44円

1韓国ウォン=0.0958円

1イスラエルシェケル=36.33円

1南アフリカランド=7.49円

1クウェート・ディナール=374.83円

1メキシコペソ=5.5529円

1コロンビアペソ=0.029149円

1ドミニカペソ=1.9947円

1スイスフラン=123.85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=0.362644円

1オーストラリアドル=83.21円

1シンガポールドル=83.79円

1フィリピンペソ=2.2521円

1新台幣ドル=4.0661円

1パキスタンルピー=0.66円

1アラブ首長国連邦ディールハム=30.78円

1香港・オフショア人民元=17.6645円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項	目	当 期 末 2021年11月10日現在
(A) 資産		104,936,719円
	コール・ローン等	947,570
	J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	12,916,237
	グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	14,961,211
	新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	12,532,833
	国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	13,168,269
	外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	15,055,002
	国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	10,642,039
	外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	12,044,273
	新興国債券インデックス マザーファンド(評価額)	11,755,301
	未収入金	913,984
(B) 負債		798,896
	未払解約金	533,103
	未払信託報酬	263,225
	未払利息	2
	その他未払費用	2,566
(C) 純資産総額(A-B)		104,137,823
	元本	78,719,863
	次期繰越損益金	25,417,960
(D) 受益権総口数		78,719,863口
	1万口当たり基準価額(C/D)	13,229円

■損益の状況

項	目	当 期 自 2021年 5月11日 至 2021年11月10日
(A) 配当等収益		△143円
	受取利息	1
	支払利息	△144
(B) 有価証券売買損益		4,576,757
	売買益	4,829,070
	売買損	△252,313
(C) 信託報酬等		△265,791
(D) 当期損益金(A+B+C)		4,310,823
(E) 前期繰越損益金		10,741,710
(F) 追加信託差損益金		10,365,427
	(配当等相当額)	(10,659,346)
	(売買損益相当額)	(△293,919)
(G) 計(D+E+F)		25,417,960
(H) 収益分配金		0
	次期繰越損益金(G+H)	25,417,960
	追加信託差損益金	10,365,427
	(配当等相当額)	(10,682,944)
	(売買損益相当額)	(△317,517)
	分配準備積立金	15,052,533

(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66,114,632円、期中追加設定元本額は18,347,554円、期中一部解約元本額は5,742,323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)		1,130,937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)		3,179,886円
(C)	収益調整金額		10,682,944円
(D)	分配準備積立金額		10,741,710円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		25,735,477円
(F)	期末残存口数		78,719,863口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)		3,269円
(H)	分配金額(1万口当たり)		－円
(I)	収益分配金金額(F×H/10,000)		－円

お知らせ

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第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。

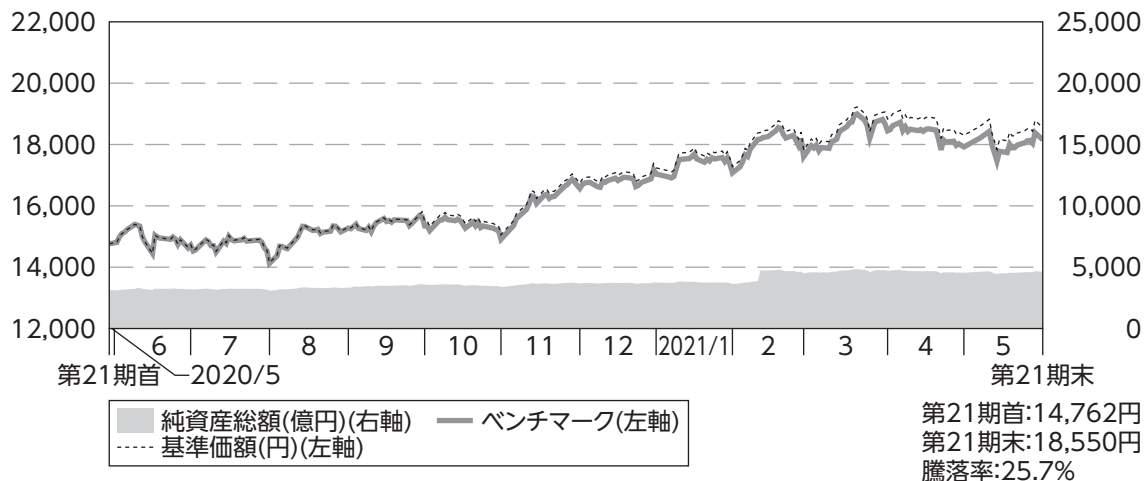
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

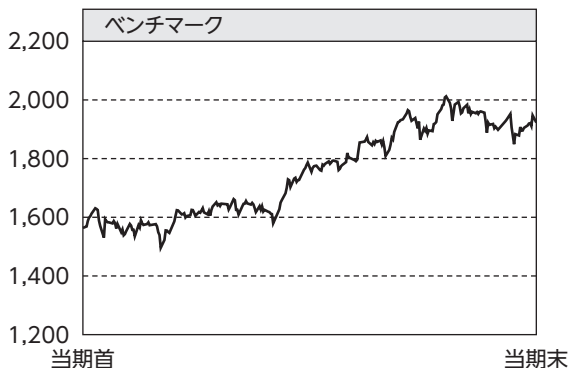


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

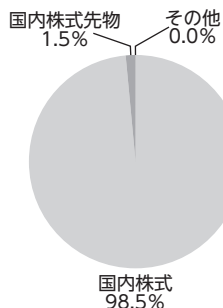
○上位10銘柄

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%

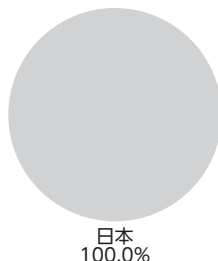
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	任天堂	日本	1.4%
8	リクルートホールディングス	日本	1.4%
9	信越化学工業	日本	1.3%
10	日本電信電話	日本	1.3%
組入銘柄数		2,115	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

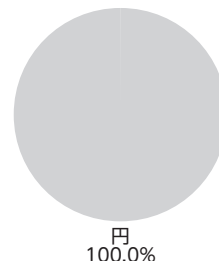
○資産別配分



○国別配分



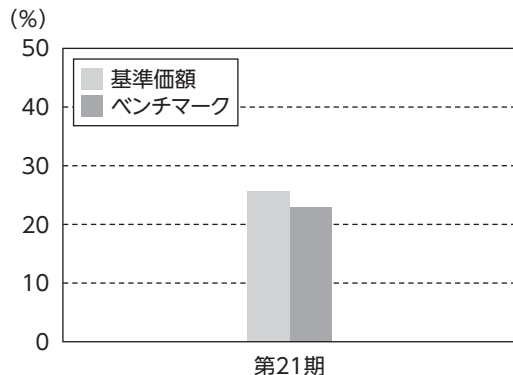
○通貨別配分



(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
サワグループホールディングス	—	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	
U A C J	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	
日本フィルコン	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)	額 (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	
フリュー	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	
ベガサスミシン製造	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)	額 (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 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
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 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
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)		
	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
TDK	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
TOA	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)		
	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
KOA	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
SCREEN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
MUTOH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	
オーブンドア	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 (千円)	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1 s t	—	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 (千円)	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йдマ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	
エーピーシー・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นม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	
京都市もの友禅	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	
P L A N T	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)	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	
テナアライド	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)	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	
ベルーナ	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	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	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
エブコ	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
パリュウコマース	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	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
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	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
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	
ベイカレント・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。

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
7月末	26,354	1.9	663.23	1.7	95.3	2.3	2.4	2.4	2.4
8月末	27,231	5.3	686.51	5.2	95.7	1.8	2.4	2.4	2.4
9月末	29,318	13.4	735.60	12.8	96.0	1.5	2.3	2.3	2.3
10月末	28,168	8.9	705.43	8.1	94.7	3.0	2.3	2.3	2.3
11月末	27,382	5.9	686.46	5.2	94.0	3.8	2.3	2.3	2.3
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
2月末	32,066	24.0	800.16	22.7	95.5	2.3	2.1	2.1	2.1
3月末	33,155	28.2	829.14	27.1	95.9	1.9	2.2	2.2	2.2
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)	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。

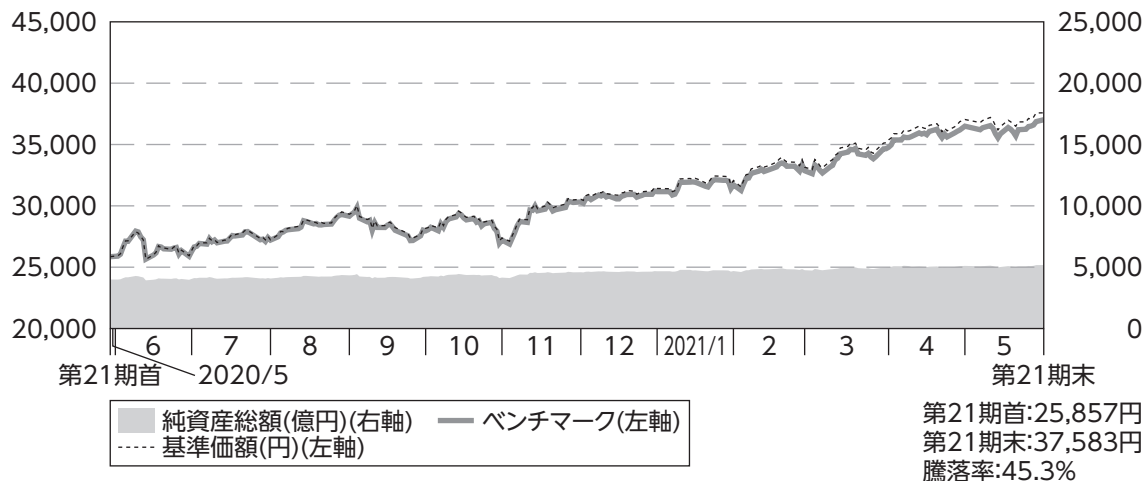
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

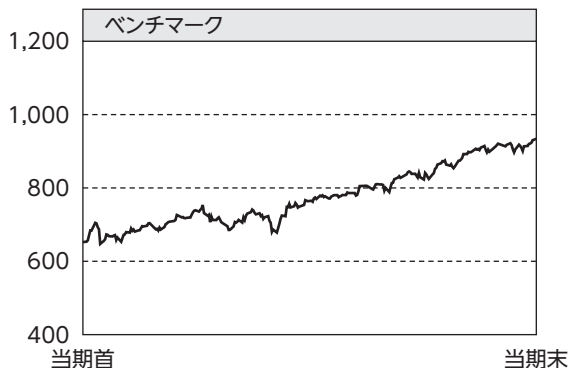


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

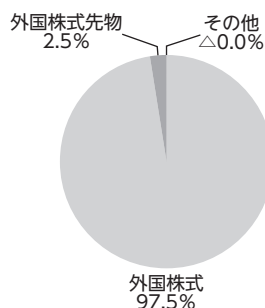
○上位10銘柄

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%

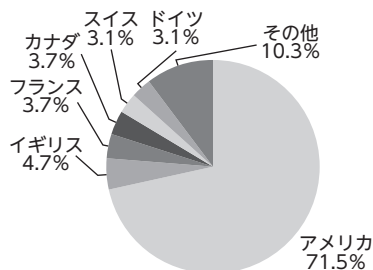
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
9	TESLA INC	アメリカ	0.9%
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
組入銘柄数		1,301	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

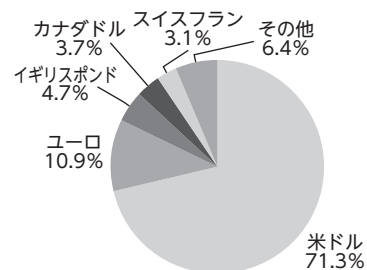
○資産別配分



○国別配分



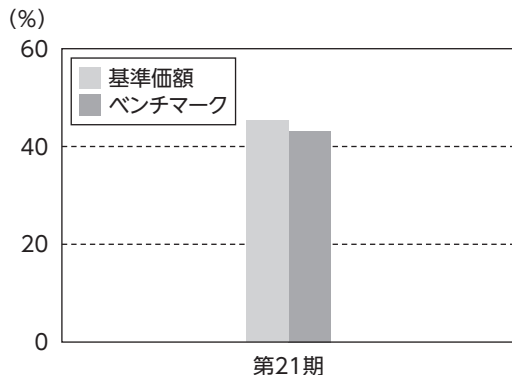
○通貨別配分



(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		業	種
	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		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)	
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		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	価 額		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	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		末		業 種
	当期首(前期末)	当	期 末		
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 外貨建金額	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		期 末		業 種
	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)		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)		
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 LIFE CO 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	株 数 銘柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	35,565	35,167	202,656	18,403,218	
(ドイツ)	82	89	—	<3.6%>	
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	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	24,744 67	22,705 64	129,756 —	17,353,631 <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)	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 SYSSEMS 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		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	
LENDLEASE 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 買 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。

新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

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

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1) 騰落率は期首比です。

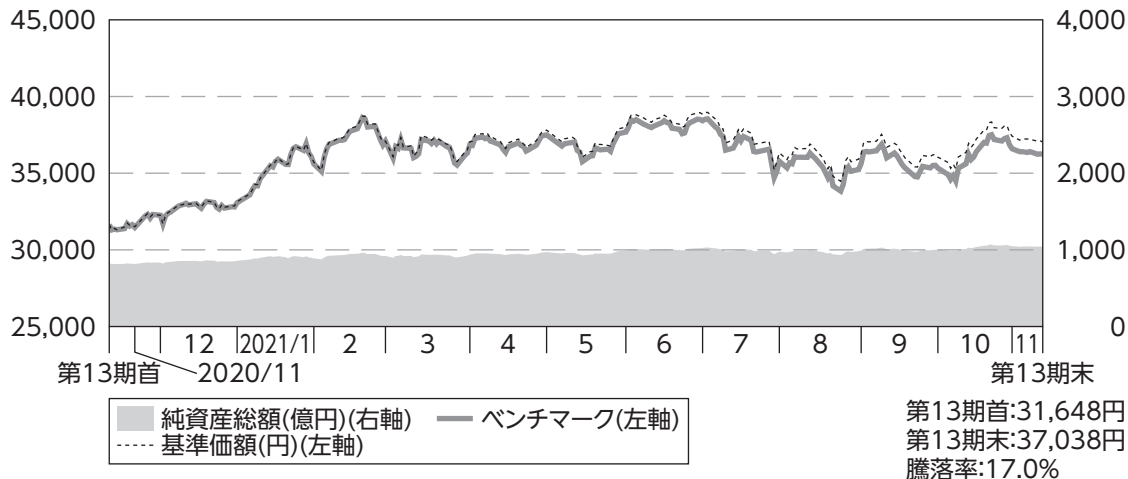
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

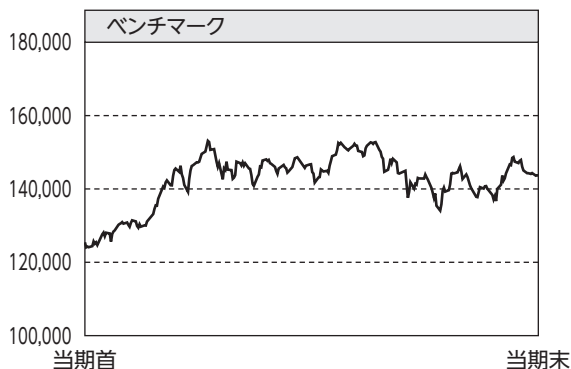


(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



新興国株式市場は上昇しました。

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

外国為替市場では、新興国通貨に対し総じて円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

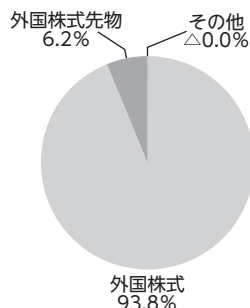
○上位10銘柄

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

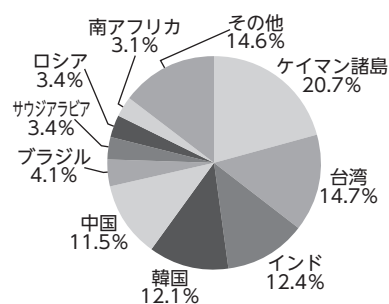
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.1%
8	INFOSYS LTD	インド	0.9%
9	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	インド	0.8%
10	JD.COM INC-ADR	ケイマン諸島	0.8%
組入銘柄数			1,249

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

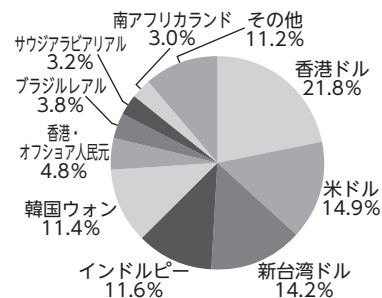
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

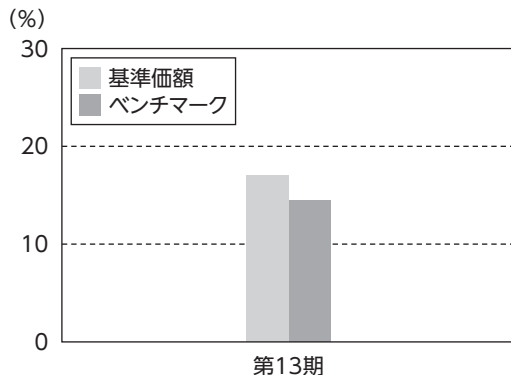


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して6.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当要因※(プラス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年11月1日~2021年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	9円	0.025%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(7)	(0.018)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(3)	(0.007)	
(b) 有価証券取引税	7	0.020	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(7)	(0.020)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	53	0.147	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(53)	(0.147)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	69	0.192	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(36,330円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

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

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

<新株予約権証券>

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	(—)	(△92)	—	—
	小 計	(—)	(△92)	—	—
	ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
	SUL AMERICA SA-UNITS	(2,167)	(—)	29,129	941
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	—	—	12,700	503
	BANCO INTER SA-UNITS	10,500 (21,000)	1,641 (—)	—	—
	GETNET ADQUIRENCIA E SERVICIO	(11,475)	(—)	11,475	82
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	29,900 (76,200)	918 (—)	—	—
	小 計	40,400 (110,842)	2,560 (—)	53,304	1,527
	南アフリカ	口	千南アフリカランド	口	千南アフリカランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	183,686	2,705	—	—
	小 計	183,686	2,705	—	—

(注1)金額は受渡代金です。

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

＜先物取引の種類別取引状況＞

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	株式先物取引	百万円 35,010	百万円 32,088	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	25,159,357千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	90,566,180千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.27

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

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

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式>

銘柄	当期末(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		
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	126	14,273	素材	
CREDICORP LTD	73	76	952	107,523	銀行	
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JOINT-SP ADR	398	398	365	41,200	電気通信サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	113	95	573	64,711	素材	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	147	—	—	—	電気通信サービス	
YPF S. A. -SPONSORED ADR	155	155	70	7,982	エネルギー	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	151	1,561	318	35,958	消費者サービス	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	474	527	612	69,078	小売	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	409	410	158	17,840	消費者サービス	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	20	20	87	9,823	各種金融	
ADECOAGRO SA	—	176	165	18,702	食品・飲料・タバコ	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	—	49	330	37,269	半導体・半導体製造装置	
BEST INC - ADR	141	—	—	—	運輸	
HUYA INC-ADR	82	82	73	8,293	メディア・娯楽	
NIO INC - ADR	963	1,475	5,995	676,683	自動車・自動車部品	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	390	648	515	58,226	メディア・娯楽	
AUTOHOME INC-ADR	65	65	248	28,040	メディア・娯楽	
GAOTU TECHEDU INC	78	163	47	5,335	消費者サービス	
ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	—	109	31	3,592	ソフトウェア・サービス	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	—	681	283	31,989	食品・飲料・タバコ	
DIDI GLOBAL INC	—	343	278	31,452	運輸	
KE HOLDINGS INC	100	355	704	79,490	不動産	
XPENG INC - ADR	—	407	1,807	203,972	自動車・自動車部品	
LUFAX HOLDING LTD	—	123	78	8,889	各種金融	
GLOBANT SA	38	44	1,593	179,809	ソフトウェア・サービス	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	2,020	—	—	—	小売	
YUM CHINA HOLDINGS INC	380	453	2,501	282,367	消費者サービス	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	389	447	1,244	140,463	運輸	
TRIP.COM GROUP LTD	524	556	1,692	191,032	消費者サービス	
SINA CORP	57	—	—	—	メディア・娯楽	
NETEASE INC-ADR	439	428	4,318	487,345	メディア・娯楽	
51JOB INC-ADR	27	27	145	16,470	商業・専門サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	293	300	4,861	548,724	メディア・娯楽	
VNET GROUP INC-ADR	—	74	124	14,037	ソフトウェア・サービス	
YANDEX NV-A	321	303	2,570	290,093	メディア・娯楽	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	139	191	882	99,550	消費者サービス	
JOYY INC	61	61	302	34,127	メディア・娯楽	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	76	90	534	60,292	ソフトウェア・サービス	
ZAI LAB LTD-ADR	51	76	665	75,110	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
360 DIGITECH INC	—	80	182	20,587	各種金融	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	121	182	1,414	159,639	メディア・娯楽	
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	—	106	72	8,138	各種金融	
I-MAB-SPONSORED ADR	—	29	169	19,091	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WEIBO CORP-SPON ADR	52	52	228	25,733	メディア・娯楽	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	—	55	119	13,436	ソフトウェア・サービス	
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	—	50	70	8,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	—	124	116	13,154	ソフトウェア・サービス	
DADA NEXUS LTD-ADR	—	76	161	18,213	小売	
JD.COM INC-ADR	912	941	7,270	820,586	小売	
AGORA INC-ADR	—	46	107	12,149	ソフトウェア・サービス	
LI AUTO INC - ADR	—	601	1,802	203,421	自動車・自動車部品	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	—	75	335	37,833	小売	
HELLO GROUP INC -SPN ADR	155	155	200	22,573	メディア・娯楽	
BAOZUN INC-SPN ADR	35	35	58	6,623	小売	
PINDUODUO INC-ADR	289	465	3,872	437,021	小売	
IQIYI INC-ADR	212	289	237	26,823	メディア・娯楽	
HUTCHMED CHINA-ADR	72	72	219	24,760	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BEIGENE LTD-ADR	—	49	1,822	205,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,040	—	—	—	エネルギー	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	544	544	47	5,387	不動産	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	432	440	4,446	501,817	エネルギー	
GAZPROM OAO-SPON ADR	6,573	6,553	6,444	727,300	エネルギー	
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	1,738	1,892	625	70,602	銀行	
SURGUTNEFTGAZ-SP ADR	1,232	1,232	590	66,605	エネルギー	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	108	105	2,654	299,633	エネルギー	
NOVOLIPET STEEL-GDR REG S	195	195	625	70,601	素材	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	704	722	2,247	253,676	素材	
ROSNEFT OJSC-GDR	1,465	1,340	1,190	134,337	エネルギー	
SEVERSTAL - GDR REG S	387	387	918	103,621	素材	
TATNEFT-SPONSORED ADR	269	299	1,364	153,963	エネルギー	
VTB BANK PJSC -GDR-REG S	3,780	3,780	535	60,414	銀行	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	472	399	752	84,939	食品・生活必需品小売り	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	—	193	383	43,323	メディア・娯楽	
SBERBANK-SPONSORED ADR	2,969	2,853	5,729	646,679	銀行	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	268	268	673	76,030	素材	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	—	140	1,582	178,550	銀行	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	79	79	820	92,634	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	32,869	36,076	85,356	9,633,307	
		56	72	—	<9.3%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	3,599	—	—	—	—	資本財
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	2,156	2,074	34,360	190,799	190,799	食品・飲料・タバコ
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,233	2,884	12,292	68,259	68,259	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,818	1,818	11,420	63,417	63,417	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
GRUMA S. A. B. -B	259	259	6,457	35,856	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	169	426	6,711	37,267	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	375	2,683	14,899	資本財
CEMEX SAB-SPONS	15,451	15,451	21,060	116,947	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	2,892	2,826	37,961	210,797	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	968	968	5,241	29,106	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	145	145	3,912	21,725	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,818	1,818	5,859	32,536	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	233	233	9,952	55,263	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	3,503	3,232	28,524	158,391	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	36,254	36,587	68,162	378,498	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	2,525	2,525	5,408	30,033	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	504	504	6,373	35,391	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	5,798	5,676	42,314	234,970	食品・生活必需品小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	436	436	12,458	69,182	運輸
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	314	314	1,862	10,339	メディア・娯楽
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	575	—	—	—	公益事業
TELESITES SAB DE CV	—	748	1,390	7,721	電気通信サービス
BECLÉ SAB DE CV	481	481	2,322	12,897	食品・飲料・タバコ
小 計	82,513	79,787	326,730	1,814,303	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	22	21	—	<1.7%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル		
BRF SA	525	525	1,235	25,422	食品・飲料・タバコ
VALE SA	3,957	4,303	28,379	583,784	素材
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	79	790	489	10,075	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	334	370	1,278	26,296	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	336	336	1,173	24,149	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	883	883	2,599	53,475	銀行
ITAUSA SA	5,058	5,031	5,051	103,920	銀行
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	957	—	—	—	小売
GERDAU SA-PREF	1,050	1,050	2,518	51,817	素材
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	197	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,230	3,751	10,334	212,579	エネルギー
VIBRA ENERGIA SA	760	1,346	3,079	63,351	小売
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	4,846	5,444	14,503	298,357	エネルギー
COGNA EDUCACAO	1,812	—	—	—	消費者サービス
CCR SA	1,256	1,256	1,459	30,022	運輸
WEG SA	928	1,711	6,296	129,522	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	4,839	5,318	10,263	211,135	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	1,466	1,613	2,701	55,567	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	630	630	1,342	27,617	素材
BRADESPAR SA -PREF	—	271	1,241	25,538	素材
SUZANO SA	626	900	4,413	90,797	素材
CPFL ENERGIA SA	338	437	1,178	24,244	公益事業
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	5,293	5,236	11,798	242,706	銀行

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
PORTO SEGURO SA	73	—	—	—	保険	
BRASKEM SA-PREF A	148	193	1,086	22,352	素材	
ENGIE BRASIL SA	292	292	1,160	23,875	公益事業	
ALPARGATAS SA - PREF	—	286	1,179	24,268	耐久消費財・アパレル	
LOCALIZA RENT A CAR	619	619	3,072	63,210	運輸	
LOJAS RENNEN S.A.	829	1,159	3,747	77,087	小売	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	984	20,248	エネルギー	
COSAN SA	184	1,183	2,486	51,152	エネルギー	
TOTVS SA	—	579	2,032	41,817	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,104	809	1,882	38,725	公益事業	
AMERICANAS SA	223	397	1,398	28,759	小売	
JBS SA	1,286	1,100	4,151	85,398	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	1,021	1,138	1,533	31,551	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	347	347	1,256	25,854	公益事業	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	454	—	—	—	不動産	
HYPERA SA	353	353	1,042	21,436	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	2,227	6,373	8,055	165,710	各種金融	
TELEFONICA BRASIL S.A.	523	—	—	—	電気通信サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	3,336	3,055	4,011	82,514	小売	
CIELO SA	992	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
TELEFONICA BRASIL S.A.	—	523	2,604	53,566	電気通信サービス	
RAIA DROGASIL SA	1,225	1,225	2,986	61,436	食品・生活必需品小売り	
VIA S/A	1,359	1,359	1,024	21,078	小売	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	690	1,617	33,270	保険	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	544	544	4,014	82,575	ヘルスケア機器・サービス	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	201	1,005	1,334	27,454	ヘルスケア機器・サービス	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	415	727	14,965	食品・生活必需品小売り	
AMBEV SA	5,177	5,349	9,569	196,850	食品・飲料・タバコ	
NATURA &CO HOLDING SA	809	1,003	4,086	84,063	家庭用品・パーソナル用品	
TIM SA	961	961	1,231	25,323	電気通信サービス	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	—	456	2,641	54,340	ヘルスケア機器・サービス	
RUMO SA	1,142	1,597	2,703	55,617	運輸	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	939	—	—	—	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	68,638	74,974	184,964	3,804,888	
	銘柄 数 <比率>	51	48	—	<3.7%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	62,798	62,798	244,285	34,794	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	54	57	168,389	23,984	銀行	
BANCO DE CHILE	48,626	48,626	367,323	52,318	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	210,609	29,997	素材	
EMPRESAS COPEC SA	447	447	288,508	41,092	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	225	73	54,649	7,783	食品・飲料・タバコ	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	185	—	—	—	電気通信サービス	
ENEL AMERICAS SA	39,900	34,913	347,036	49,429	公益事業	
COLBUN SA	12,156	12,156	69,415	9,886	公益事業	

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

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

銘柄	当期首(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)	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	785	525	2,044	29,630	家庭用品・パーソナル用品
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	3,080	—	—	—	運輸
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE-R	3,680	3,680	2,686	38,925	自動車・自動車部品
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	9,561	9,561	7,658	110,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	4,090	4,155	6,931	100,433	不動産
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	3,471	3,671	10,646	154,263	不動産
CITIC LTD	6,770	6,170	4,436	64,280	資本財
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	2,480	2,480	1,302	18,865	運輸
LENOVO GROUP LTD	7,320	7,320	5,841	84,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PETROCHINA CO LTD-H	23,820	21,480	7,539	109,247	エネルギー
CHINA UNICOM (HONG KONG)LTD-R	7,340	—	—	—	電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,840	1,840	2,097	30,398	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	27,394	29,154	11,020	159,682	エネルギー
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	1,107	16,048	ソフトウェア・サービス
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	2,420	3,110	7,930	114,912	ソフトウェア・サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	847	833	10,945	158,602	公益事業
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	3,600	3,600	2,476	35,888	公益事業
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,507	2,507	1,537	22,274	運輸
YUEXIU PROPERTY CO LTD	5,780	1,156	779	11,289	不動産
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,655	1,655	2,016	29,217	運輸
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	1,411	20,445	素材
WHARF HOLDINGS	1,000	1,540	4,158	60,249	不動産
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	1,279	1,279	1,142	16,552	運輸
CHINA EVERBRIGHT LTD-R	1,340	1,340	1,133	16,426	各種金融
CHINA GAS HOLDINGS LTD	2,862	3,056	5,610	81,300	公益事業
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	2,281	33,056	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	6,090	6,300	16,411	237,802	自動車・自動車部品
SHENZHEN INVESTMENT LTD	3,360	3,360	614	8,909	不動産
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	1,060	1,060	4,202	60,900	公益事業
BYD CO LTD-H	825	885	27,488	398,302	自動車・自動車部品
CHINA TELECOM CORP LTD-H	13,560	—	—	—	電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES-H	1,920	1,920	1,367	19,808	エネルギー
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	14,500	1,261	18,279	メディア・娯楽
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	3,850	3,850	1,975	28,623	商業・専門サービス
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	1,660	1,660	964	13,975	素材
CHINA YOUZAN LTD	—	14,560	1,324	19,198	ソフトウェア・サービス
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	6,892	6,892	4,818	69,814	保険
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,750	2,750	1,482	21,477	資本財
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	1,754	1,754	3,409	49,407	公益事業
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	3,527	3,527	11,623	168,418	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	8,710	9,180	12,539	181,702	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	7,290	7,727	111,970	素材
MMG LIMITED	—	3,040	951	13,787	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	2,440	2,440	2,908	42,143	ヘルスケア機器・サービス
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	3,735	—	—	—	半導体・半導体製造装置

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	2,118	2,897	41,983	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	860	—	—	—	エネルギー
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	5,570	—	—	—	素材
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD-R	380	—	—	—	資本財
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	640	—	—	—	運輸
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	2,280	3,461	50,150	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	460	680	4,443	64,390	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	3,200	3,200	3,308	47,944	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	1,660	1,660	585	8,490	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	1,620	1,480	9,161	132,745	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	880	880	607	8,798	運輸
CNOOC LTD-R	18,830	—	—	—	エネルギー
HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	—	1,010	1,458	21,132	素材
SINO BIOPHARMACEUTICAL	11,130	11,130	6,088	88,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	2,810	3,290	16,071	232,878	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	6,162	6,229	289,025	4,187,980	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	6,325	6,950	39,059	565,964	保険
LI NING CO LTD	2,170	2,375	22,028	319,187	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,720	24,925	公益事業
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	12,069	12,069	881	12,766	小売
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	2,743	39,759	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	2,140	2,140	1,221	17,705	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,836	26,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CORP-H	1,680	—	—	—	資本財
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	3,925	3,310	5,362	77,698	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	4,740	5,180	5,967	86,475	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	10,984	10,984	5,261	76,241	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	1,700	1,312	19,016	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	102,476	103,856	54,212	785,545	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	848	848	13,771	199,549	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	1,931	27,982	自動車・自動車部品
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	1,420	1,420	742	10,761	不動産
MINTH GROUP LTD	—	640	2,048	29,675	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	1,290	1,290	1,229	17,813	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	4,120	4,120	3,679	53,311	素材
BANK OF CHINA LTD-H	86,352	88,012	24,203	350,705	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	1,325	1,189	17,240	不動産
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	—	725	784	11,366	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	1,352	1,352	561	8,130	不動産
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,369	4,299	26,977	390,906	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	64,645	62,655	26,503	384,030	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	905	905	550	7,972	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	841	12,197	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,960	1,960	762	11,047	資本財
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	5,190	—	—	—	資本財

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	780	780	1,688	24,469	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	2,878	41,705	資本財
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	1,420	—	—	—	耐久消費財・アパレル
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	8,979	8,009	5,374	77,876	不動産
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	6,420	4,680	2,157	31,261	素材
CHINA CITIC BANK-H	9,512	9,512	3,234	46,861	銀行
KWG GROUP HOLDINGS LTD	1,525	1,525	942	13,656	不動産
SUNNY OPTICAL TECH	755	768	15,513	224,792	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,110	1,210	15,512	224,771	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	250	250	542	7,860	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	2,557	37,057	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	5,780	1,288	18,676	不動産
CHINA AOYUAN GROUP LTD	1,260	1,260	264	3,834	不動産
SINO-OCEAN GROUP HOLDINGS	5,285	—	—	—	不動産
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	1,940	4,380	2,522	36,556	耐久消費財・アパレル
SOHO CHINA LTD	2,915	—	—	—	不動産
KINGSOFT CORP LTD	920	920	2,999	43,458	メディア・娯楽
SINOTRUK HONG KONG LTD	975	545	578	8,386	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	4,740	4,740	1,749	25,343	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	501	7,268	食品・飲料・タバコ
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	850	605	1,576	22,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA RAILWAY CONSTRUCTIO-H	1,915	—	—	—	資本財
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,600	3,449	49,984	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	2,966	2,966	7,088	102,715	保険
CHINA EVERGRANDE GROUP	1,860	—	—	—	不動産
CRRC CORP LTD-H	5,110	—	—	—	資本財
SUN ART RETAIL GROUP LTD	2,590	2,590	833	12,084	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H	1,252	1,252	2,218	32,146	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	2,880	2,880	1,753	25,414	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,583	3,583	2,683	38,891	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	1,015	2,190	1,587	23,006	素材
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	—	1,780	857	12,431	不動産
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	1,510	1,510	413	5,995	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,310	3,390	5,796	83,997	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,748	25,340	ヘルスケア機器・サービス
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	2,510	3,270	4,519	65,482	不動産
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	3,566	—	—	—	不動産
ZOOLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	1,162	1,162	610	8,839	資本財
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	—	1,600	1,308	18,964	資本財
LONGFOR PROPERTIES	1,970	1,970	6,737	97,624	不動産
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	964	964	2,096	30,381	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	6,744	6,744	2,056	29,804	銀行
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	1,560	1,560	157	2,283	不動産
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	314	1,412	2,544	36,872	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	6,850	3,750	1,020	14,779	銀行

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	31,520	28,250	7,401	107,247	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	680	680	4,688	67,937	小売
FAR EAST HORIZON LTD	2,400	2,400	1,761	25,525	各種金融
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	—	660	2,319	33,615	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	2,485	2,485	4,701	68,126	各種金融
SEAZEN GROUP LTD	2,040	2,040	1,138	16,494	不動産
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	1,000	1,000	1,300	18,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	3,572	3,572	2,421	35,092	各種金融
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	2,288	33,153	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	9,390	9,390	2,197	31,838	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	555	730	2,675	38,767	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	2,760	5,640	2,227	32,280	不動産
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	715	—	—	—	資本財
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,830	4,830	2,101	30,444	各種金融
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	—	2,760	3,494	50,630	ソフトウェア・サービス
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	1,280	1,280	1,461	21,180	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	1,800	1,296	18,779	不動産
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	1,094	—	—	—	各種金融
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	10,590	10,590	5,951	86,238	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	480	480	2,160	31,298	食品・飲料・タバコ
GENSRIPT BIOTECH CORP	820	1,320	3,867	56,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	225	—	—	—	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	1,360	1,640	9,085	131,650	不動産
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	1,310	1,310	467	6,776	不動産
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	401	537	1,664	24,121	ヘルスケア機器・サービス
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	700	700	887	12,861	消費者サービス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	—	507	737	10,692	素材
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	300	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	415	415	879	12,748	不動産
CHINA TOWER CORP LTD-H	45,660	45,660	4,611	66,822	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	11,096	14,058	28,608	414,530	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WUXI APPTTEC CO LTD-H	267	422	6,520	94,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIMOB INC	—	1,490	1,473	21,352	ソフトウェア・サービス
MEITUAN-CLASS B	3,827	4,366	118,056	1,710,640	小売
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	684	684	1,202	17,423	消費者サービス
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	850	1,160	2,418	35,045	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	3,862	5,319	7,596	110,077	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	940	1,390	10,633	154,079	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	—	640	824	11,944	不動産
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	8,320	8,320	1,056	15,310	各種金融
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	—	540	2,138	30,985	小売
LOGAN GROUP CO LTD	1,500	1,500	1,074	15,562	不動産
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	1,595	1,595	6,021	87,246	資本財
POLY PROPERTY SERVICES CO LTD-H	80	80	324	4,700	不動産
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	—	1,240	1,319	19,117	ヘルスケア機器・サービス

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

銘柄	当期首(前期末)	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 INTERNATIONAL CAPITA-H	1,320	1,320	2,457	35,614	各種金融
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	1,080	3,900	40,014	579,802	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	—	262	3,953	57,287	素材
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	152	152	1,535	22,245	食品・飲料・タバコ
HUIZHAN DAIRY UNTRADE	4,350	4,350	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	6,500	6,500	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	979,813 206	948,379 213	1,559,573 —	22,598,214 <21.7%>
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	2,656	3,007	968	26,327	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD	140	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	6,351	6,505	3,265	88,801	銀行
DIGI.COM BERHAD	3,117	3,117	1,321	35,935	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,065	1,065	684	18,607	運輸
RHB BANK BHD	2,064	2,108	1,134	30,839	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	382	296	8,070	資本財
GAMUDA BHD	1,415	—	—	—	資本財
YTL CORPORATION BERHAD	2,607	—	—	—	公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	460	166	290	7,896	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	612	1,109	30,164	銀行
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	556	351	727	19,781	食品・飲料・タバコ
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	213	58	156	4,245	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	4,040	4,111	3,284	89,313	銀行
MISC BHD	1,250	1,250	872	23,731	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	69	72	964	26,233	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	734	734	1,306	35,523	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	251	509	13,854	エネルギー
PETRONAS GAS BHD	755	755	1,236	33,626	公益事業
TELECOM MALAYSIA BHD	705	705	391	10,646	電気通信サービス
TENAGA NATIONAL BHD	2,751	3,052	2,933	79,768	公益事業
QL RESOURCES BHD	1,248	1,248	605	16,457	食品・飲料・タバコ
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	1,199	32,618	エネルギー
PUBLIC BANK BERHAD	3,244	16,750	6,750	183,543	銀行
TOP GLOVE CORP BHD	5,049	5,049	1,176	31,987	ヘルスケア機器・サービス
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	132	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	1,282	1,282	282	7,668	ヘルスケア機器・サービス
SUPERMAX CORP BHD	1,582	1,617	276	7,519	ヘルスケア機器・サービス
GENTING BHD	3,072	1,885	968	26,344	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	1,183	32,167	消費者サービス
IOI CORPORATION BHD	2,703	2,703	1,029	28,006	食品・飲料・タバコ
SIME DARBY BERHAD	3,363	3,363	746	20,302	資本財
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,813	1,813	1,031	28,049	ヘルスケア機器・サービス
AXIATA GROUP BERHAD	2,852	2,852	1,106	30,097	電気通信サービス
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,229	33,435	電気通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,699	2,699	2,237	60,838	素材

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	2,293	1,478	40,214	ヘルスケア機器・サービス
WESTPORTS HOLDINGS BHD	700	700	298	8,127	運輸
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	1,443	2,886	1,532	41,668	素材
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	995	27,070	食品・飲料・タバコ
小 計	78,659	88,432	45,585	1,239,488	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	40	36	—	<1.2%>	
(タイ)			千タイパーツ		
BANGKOK BANK PUBLIC COMPANY LIMITED	519	—	—	—	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,776	1,776	6,171	21,230	食品・生活必需品小売り
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	5,176	17,805	銀行
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	543	543	2,402	8,265	公益事業
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	1,274	887	11,841	40,734	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	9,614	3,634	12,501	電気通信サービス
KASIKORN BANK PCL-NVDR	783	—	—	—	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	31,473	—	—	—	銀行
IRPC PCL - NVDR	8,295	—	—	—	エネルギー
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	360	169	2,957	10,173	公益事業
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	2,437	1,218	9,321	32,066	電気通信サービス
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	4,582	5,564	13,910	47,850	食品・飲料・タバコ
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,197	1,197	23,221	79,882	電気通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	7,435	4,710	7,159	24,629	小売
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	—	389	14,859	51,117	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PTT PCL-NVDR	12,532	11,974	45,800	157,553	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	4,497	1,849	3,753	12,911	食品・飲料・タバコ
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	1,015	1,015	5,988	20,600	各種金融
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	7,412	25,497	不動産
SIAM CEMENT PCL-NVDR	810	810	32,076	110,341	素材
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	4,281	5,270	35,309	121,462	運輸
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	1,264	—	—	—	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	2,263	2,263	13,408	46,124	不動産
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	10,837	11,769	28,245	97,164	ヘルスケア機器・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	328	827	12,777	43,953	ヘルスケア機器・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,627	3,627	12,333	42,425	消費者サービス
THAI OIL PCL-NVDR	1,201	1,201	6,605	22,722	エネルギー
CP ALL PCL-NVDR	6,571	6,917	45,133	155,258	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	8,095	8,095	7,852	27,011	運輸
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	1,344	1,344	16,060	55,249	エネルギー
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	660	—	—	—	電気通信サービス
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,064	2,064	8,926	30,708	素材
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	2,249	2,249	13,945	47,973	素材
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	1,855	1,294	8,411	28,933	公益事業
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	8,170	8,170	7,434	25,575	運輸
B GRIMM POWER PCL-NVDR	534	534	2,202	7,577	公益事業
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	2,882	2,882	12,104	41,639	公益事業
OSOTSPA PCL-NVDR	660	660	2,194	7,549	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(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)		
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	1,651	1,651	3,070	10,563	各種金融	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	8,103	8,103	3,808	13,100	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	1,822	1,822	6,604	22,720	小売	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	—	1,006	6,388	21,975	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	763	763	4,883	16,798	各種金融	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	—	736	2,042	7,025	ヘルスケア機器・サービス	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	—	2,890	7,514	25,848	小売	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	—	463	5,718	19,670	食品・飲料・タバコ	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	898	898	5,679	19,538	各種金融	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	682	682	5,132	17,654	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額	175,053	133,003	479,473	1,649,389	
	銘柄 数 <比 率>	43	42	—	<1.6%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND INC	9,429	7,941	30,175	67,958	不動産	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,379	2,379	12,158	27,382	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	598	2,125	20,358	45,850	銀行	
GLOBE TELECOM INC	46	46	16,049	36,144	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,445	961	18,837	42,424	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	3,035	3,035	18,635	41,969	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	610	610	15,850	35,696	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,612	1,612	8,403	18,924	銀行	
BDO UNIBANK INC	2,199	2,199	29,028	65,374	銀行	
MEGAWORLD CORP	6,380	—	—	—	不動産	
PLDT INC	104	104	17,154	38,633	電気通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	930	—	—	—	不動産	
SM PRIME HOLDINGS INC	11,561	10,031	36,113	81,330	不動産	
UNIVERSAL ROBINA CORP	955	955	12,891	29,031	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	228	228	22,440	50,537	資本財	
AYALA CORPORATION	282	282	25,423	57,256	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	23,557	23,557	9,469	21,327	各種金融	
ABOITIZ POWER CORP	895	—	—	—	公益事業	
MANILA ELECTRIC COMPANY	291	291	8,645	19,470	公益事業	
PUREGOLD PRICE CLUB INC	873	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	68	68	4,011	9,035	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	67,483	56,429	305,647	688,349	
	銘柄 数 <比 率>	21	17	—	<0.7%>	
(インドネシア)			千インドネシアルピア			
ANEKA TAMBANG TBK PT	—	9,858	2,306,772	18,454	素材	
BARITO PACIFIC TBK PT	28,825	28,825	2,796,025	22,368	素材	
UNITED TRACTORS TBK PT	2,009	2,009	4,630,745	37,045	エネルギー	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	4,291	4,291	2,724,785	21,798	食品・飲料・タバコ	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	21,527	22,184	12,977,640	103,821	自動車・自動車部品	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,923	7,923	4,872,645	38,981	食品・飲料・タバコ	
GUDANG GARAM TBK PT	596	596	1,957,860	15,662	食品・飲料・タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	9,179	—	—	—	食品・飲料・タバコ	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	1,900	1,900	2,408,250	19,266	素材
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,442	2,442	2,112,330	16,898	素材
BANK MANDIRI	20,475	21,637	14,876,097	119,008	銀行
UNILEVER INDONESIA TBK PT	7,464	7,464	3,306,552	26,452	家庭用品・パーソナル用品
PT BANK RAKYAT INDONESIA	58,996	68,047	28,919,983	231,359	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	7,915	—	—	—	公益事業
BANK NEGARA INDONESIA PT	8,102	8,102	5,711,910	45,695	銀行
KALBE FARMA TBK PT	27,559	27,559	4,464,558	35,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	3,456	3,456	3,335,040	26,680	素材
BANK CENTRAL ASIA PT	10,510	57,725	44,303,937	354,431	銀行
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	53,497	56,013	20,780,823	166,246	電気通信サービス
XL AXIATA TBK PT	3,870	—	—	—	電気通信サービス
ACE HARDWARE INDONESIA	9,057	—	—	—	小売
ADARO ENERGY PT	14,393	14,393	2,454,006	19,632	エネルギー
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	1,610	1,436,925	11,495	食品・飲料・タバコ
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	—	10,761	3,002,319	24,018	電気通信サービス
SARANA MENARA NUSANTARA PT	—	28,406	3,380,314	27,042	電気通信サービス
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	—	15,421	5,011,825	40,094	素材
小 計	305,596	400,622	177,771,343	1,422,170	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	22	22	—	<1.4%>	
(韓国)			千韓国ウォン		
SKC CO LTD	—	17	310,386	29,734	素材
CHEIL COMMUNICATIONS INC	50	50	117,370	11,244	メディア・娯楽
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	42	30	306,625	29,374	自動車・自動車部品
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	31	31	693,084	66,397	保険
DB INSURANCE CO LTD	42	42	245,805	23,548	保険
COWAY CO LTD	50	50	409,192	39,200	耐久消費財・アパレル
KT&G CORP	132	132	1,139,822	109,195	食品・飲料・タバコ
S-1 CORPORATION	23	8	69,888	6,695	商業・専門サービス
KOREA GAS CORPORATION	45	—	—	—	公益事業
CJ CORP	12	12	119,679	11,465	資本財
KAKAO CORP	60	344	4,329,373	414,753	メディア・娯楽
SK TELECOM	42	31	978,329	93,723	電気通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	32	—	—	—	資本財
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	310	310	278,204	26,651	各種金融
NCSOFT CORPORATION	17	16	1,030,161	98,689	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	221	221	317,493	30,415	電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	—	288	760,716	72,876	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	59	—	—	—	資本財
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	9	9	1,165,364	111,641	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	48	48	3,744,261	358,700	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	11	8	307,388	29,447	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	2	3	245,070	23,477	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	518	508	1,905,568	182,553	銀行
HMM CO LTD	—	253	675,750	64,736	運輸

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	91	—	—	—	保険
GS HOLDINGS CORP	65	65	290,421	27,822	エネルギー
LG DISPLAY CO LTD	240	240	493,455	47,273	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	102	106	2,194,123	210,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANA FINANCIAL GROUP	325	339	1,501,120	143,807	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	23	15	252,174	24,158	運輸
LOTTE SHOPPING CO	10	10	107,536	10,301	小売
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	74	74	502,130	48,104	保険
AMOREPACIFIC CORP	28	37	701,613	67,214	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	21	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	18	—	—	—	各種金融
SK INNOVATION CO LTD	55	55	1,298,745	124,419	エネルギー
CJ CHEILJEDANG CORP	7	7	290,237	27,804	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	168,900	16,180	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	14	302,102	28,941	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	39	35	867,468	83,103	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	441	428	2,393,094	229,258	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	106	71	214,883	20,585	資本財
BNK FINANCIAL GROUP INC	481	—	—	—	銀行
HANMI PHARM CO LTD	4	4	138,722	13,289	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FILA HOLDINGS CORPORATION	40	40	156,876	15,028	耐久消費財・アパレル
EMART	18	18	306,628	29,374	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	40	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	70	70	303,131	29,039	自動車・自動車部品
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOL	13	51	318,052	30,469	資本財
BGF RETAIL CO LTD/NEW	5	5	91,683	8,783	食品・生活必需品小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	29	31	359,759	34,464	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	—	11	177,837	17,036	素材
NETMARBLE CORP	24	24	324,147	31,053	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	594	594	787,129	75,407	銀行
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	—	31	308,190	29,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	—	15	226,500	21,698	素材
SK BIOSCIENCE CO LTD	—	21	466,200	44,661	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HYBE CO LTD	—	15	601,783	57,650	メディア・娯楽
SAMSUNG SDS CO LTD	37	37	584,825	56,026	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG C&T CORP	87	87	1,012,332	96,981	資本財
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	18	18	1,544,620	147,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOOSAN BOBCAT INC	43	43	190,629	18,262	資本財
CJ ENM CO LTD	8	8	142,677	13,668	小売
KMW CO LTD	19	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HLB INC	50	100	403,984	38,701	耐久消費財・アパレル
CELLTRION PHARM INC	12	19	220,911	21,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	19	38	193,435	18,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ECOPRO BM CO LTD	—	11	652,275	62,487	資本財
ALTEOGEN INC	18	28	221,882	21,256	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	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)	
PEARL ABYSS CORP	9	46	526,351	50,424	メディア・娯楽
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	75	86	720,274	69,002	ヘルスケア機器・サービス
小 計	16,389	16,732	123,813,019	11,861,287	
	銘柄数 <比率>	106	104	—	<11.4%>
(台湾)			千新台幣ドル		
ACCTON TECHNOLOGY CORP	480	480	13,920	56,600	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ACER INC	2,558	2,558	6,855	27,875	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASUSTEK COMPUTER INC	760	720	27,070	110,071	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	509	509	26,032	105,850	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT CORP	2,341	2,341	10,491	42,657	素材
WALSIN TECHNOLOGY CORP	270	270	4,293	17,455	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN BUSINESS BANK	5,004	—	—	—	銀行
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	600	600	9,570	38,912	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	—	1,180	22,715	92,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	617	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QUANTA COMPUTER INC	2,862	2,862	23,216	94,400	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	1,134	—	—	—	不動産
EVA AIRWAYS CORP	1,641	—	—	—	運輸
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	697	697	11,500	46,762	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,818	5,876	9,813	39,904	銀行
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	6,232	25,342	自動車・自動車部品
CHINA STEEL	12,662	12,662	43,686	177,631	素材
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	3,262	3,393	9,839	40,010	保険
ADVANTECH CO LTD	433	433	16,857	68,545	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COMPAL ELECTRONICS	4,317	4,317	10,513	42,748	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DELTA ELECTRONICS INC	2,099	2,179	57,962	235,680	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,540	1,150	7,900	32,124	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	3,973	4,103	45,750	186,024	電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	9,450	9,450	19,421	78,970	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN MOBILE CO LTD	1,782	1,922	18,989	77,212	電気通信サービス
EVERGREEN MARINE	3,590	2,660	32,456	131,972	運輸
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,480	10,406	42,311	資本財
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	434	434	9,906	40,279	耐久消費財・アパレル
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	199	12,659	51,476	耐久消費財・アパレル
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	580	580	26,758	108,803	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	4,138	4,418	47,496	193,123	素材
FORMOSA TAFFETA CO.	1,210	—	—	—	耐久消費財・アパレル
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	3,960	4,200	33,856	137,665	素材
GIANT MANUFACTURING	344	344	10,408	42,320	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,608	1,658	162,156	659,343	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	7,100	8,104	59,242	240,887	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	9,640	10,593	21,663	88,086	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	300	300	18,840	76,605	小売
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	1,570	1,570	9,891	40,217	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	11,701	10,561	25,559	103,925	各種金融

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

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
			株 数 (百株)	評 価 額		
						外 貨 建 金 額
SILERGY CORP	70	80	38,560	156,788	半導体・半導体製造装置	
MOMO.COM INC	—	50	8,675	35,273	小売	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	160	160	6,144	24,982	耐久消費財・アパレル	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	890	13,839	56,272	半導体・半導体製造装置	
PHISON ELECTRONICS CORP	115	225	8,723	35,469	半導体・半導体製造装置	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	320	11,168	45,410	半導体・半導体製造装置	
ONENESS BIOTECH CO LTD	—	200	5,080	20,655	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBALWAFERS CO LTD	240	240	18,696	76,019	半導体・半導体製造装置	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	354,982	358,137	3,628,887	14,755,420	
		87	87	—	<14.2%>	
(中国オフショア)				千香港・オフショア人民元		
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	373	—	—	—	—	商業・専門サービス
EVE ENERGY CO LTD-A	—	75	1,019	18,008	—	資本財
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	—	1,271	1,019	18,016	—	各種金融
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	103	103	353	6,242	—	食品・飲料・タバコ
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	—	327	457	8,087	—	半導体・半導体製造装置
FUJIAN STAR-NET COMMUNICAT-A	154	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GANFENG LITHIUM CO LTD-A	80	80	1,388	24,518	—	素材
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	183	183	501	8,866	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	134	134	333	5,884	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	80	80	1,130	19,977	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	22	22	600	10,612	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	471	471	1,157	20,447	—	資本財
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	261	261	445	7,860	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	163	163	716	12,657	—	メディア・娯楽
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	235	235	377	6,675	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	285	285	736	13,013	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YINTAI GOLD CO LTD-A	—	1,113	1,045	18,461	—	素材
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	41	41	46	829	—	素材
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	301	30	51	917	—	耐久消費財・アパレル
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	337	—	—	—	—	素材
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	—	55	768	13,578	—	ソフトウェア・サービス
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	825	14,582	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	615	615	444	7,854	—	メディア・娯楽
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	—	100	1,602	28,300	—	資本財
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	210	295	688	12,162	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	1,033	—	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	—	277	818	14,451	—	耐久消費財・アパレル
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	703	703	259	4,586	—	不動産
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	242	290	841	14,866	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	—	596	951	16,814	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	134	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	274	274	644	11,388	—	食品・飲料・タバコ
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	136	136	554	9,787	—	資本財
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	250	84	224	3,970	—	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)	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	—	784	1,066	18,834	ソフトウェア・サービス
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	288	288	408	7,218	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	170	170	1,115	19,705	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	264	58	347	6,131	資本財
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	—	180	632	11,176	ヘルスケア機器・サービス
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	239	335	1,911	33,770	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	99	1,272	22,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	53	53	133	2,365	食品・飲料・タバコ
ADDSINO CO LTD -A	347	58	95	1,688	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	228	—	—	—	メディア・娯楽
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	348	348	480	8,489	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	470	470	579	10,228	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	922	922	744	13,143	素材
NAVINFO CO LTD-A	332	332	427	7,547	耐久消費財・アパレル
BY-HEALTH CO LTD-A	297	297	703	12,433	家庭用品・パーソナル用品
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	378	378	527	9,315	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	204	3,618	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	188	188	558	9,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	323	484	765	13,530	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	244	4,324	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	—	49	1,099	19,424	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	197	197	623	11,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OFILM GROUP CO LTD-A	313	313	256	4,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	—	1,374	983	17,378	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	179	232	1,120	19,787	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	280	280	1,165	20,595	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	208	3,681	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	148	148	317	5,613	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	—	1,994	1,224	21,626	資本財
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	153	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	897	15,861	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	97	97	341	6,040	ヘルスケア機器・サービス
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	245	245	611	10,802	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	98	2,224	39,291	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	204	106	757	13,383	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	595	595	622	10,993	食品・飲料・タバコ
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDE-A	295	295	1,428	25,237	半導体・半導体製造装置
SONGCHEUNG PERFORMANCE DEVE-A	334	334	485	8,569	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	135	189	474	8,383	ソフトウェア・サービス
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	385	385	211	3,733	素材
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	617	10,912	各種金融
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	2,983	—	—	—	公益事業
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	536	536	533	9,420	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	594	464	1,853	32,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	226	226	127	2,255	資本財

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	1,044	18,443	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	417	7,370	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	303	303	743	13,134	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	557	557	397	7,025	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	635	11,227	ソフトウェア・サービス
GOERTEK INC -A	269	269	1,282	22,661	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	—	1,520	1,129	19,956	各種金融
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	806	806	572	10,108	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	240	240	883	15,605	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	—	168	362	6,407	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,020	1,020	635	11,225	耐久消費財・アパレル
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	199	199	143	2,534	各種金融
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	793	793	475	8,404	消費者サービス
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	—	333	695	12,282	自動車・自動車部品
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	12	12	36	652	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	71	71	626	11,070	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	170	—	—	—	資本財
EAST MONEY INFORMATION CO-A	152	418	1,402	24,775	各種金融
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,630	28,805	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	212	212	4,425	78,181	食品・飲料・タバコ
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	341	—	—	—	メディア・娯楽
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	641	641	417	7,382	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SUNING.COM CO LTD-A	458	458	202	3,575	小売
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	574	10,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	547	547	515	9,102	不動産
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	185	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	585	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PING AN BANK CO LTD-A	1,194	1,194	2,093	36,973	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	381	381	639	11,304	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	1,164	20,569	各種金融
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	978	17,283	不動産
ZTE CORP-A	126	126	396	7,008	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	801	801	563	9,946	資本財
WEICHAJ POWER CO LTD-A	432	432	677	11,965	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	1,210	21,387	各種金融
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	201	201	393	6,959	資本財
BYD CO LTD -A	—	97	3,110	54,948	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	500	500	328	5,793	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	—	124	1,901	33,594	素材
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	436	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	—	60	792	13,990	素材
LB GROUP CO LTD-A	—	153	413	7,308	素材
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	—	223	489	8,646	素材
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	165	165	119	2,113	メディア・娯楽
CHACHA FOOD CO LTD-A	100	100	560	9,892	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	31	31	1,253	22,133	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	277	277	295	5,225	食品・飲料・タバコ
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	224	224	468	8,282	半導体・半導体製造装置
PERFECT WORLD CO LTD-A	228	228	418	7,394	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	48	16	384	6,790	食品・飲料・タバコ
GUOCHENG MINING CO LTD-A	311	—	—	—	資本財
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	—	170	1,321	23,342	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	80	80	443	7,837	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	185	185	711	12,568	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	690	—	—	—	素材
YUNDA HOLDING CO LTD-A	218	218	372	6,577	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	825	825	337	5,960	半導体・半導体製造装置
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	—	233	2,033	35,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	—	161	1,290	22,788	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	38	2	76	1,346	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	—	56	1,178	20,813	食品・飲料・タバコ
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	248	248	192	3,391	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	137	203	1,223	21,615	運輸
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	—	63	909	16,073	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	602	602	429	7,592	各種金融
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	236	—	—	—	素材
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	455	455	329	5,819	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	269	269	333	5,892	ソフトウェア・サービス
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	—	28	514	9,092	耐久消費財・アパレル
CSC FINANCIAL CO LTD-A	241	241	689	12,175	各種金融
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	111	—	—	—	資本財
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	40	56	1,086	19,190	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	163	212	844	14,910	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	371	371	783	13,847	素材
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	437	437	553	9,772	各種金融
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	—	154	602	10,645	食品・生活必需品小売り
CHONGQING FULING ZHACAI-A	211	46	156	2,759	食品・飲料・タバコ
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	112	112	846	14,944	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	104	104	2,811	49,658	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	70	70	543	9,596	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUEWEI FOOD CO LTD-A	—	70	484	8,554	食品・飲料・タバコ
OPPEIN HOME GROUP INC-A	77	77	934	16,498	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	156	57	707	12,496	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	87	87	303	5,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	47	47	522	9,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	97	97	533	9,415	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	123	123	605	10,687	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	55	55	487	8,617	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	92	92	707	12,496	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	68	68	730	12,911	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)	期末			業種
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	441	441	448	7,930	各種金融
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	—	493	1,019	18,000	素材
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	28	28	311	5,508	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	427	427	412	7,286	各種金融
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	451	451	522	9,233	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	53	84	3,110	54,945	ヘルスケア機器・サービス
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	—	974	904	15,983	消費者サービス
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	50	50	149	2,639	素材
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	30	30	660	11,670	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	139	72	454	8,023	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	14	21	730	12,907	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	134	134	8,887	157,001	資本財
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	44	62	1,030	18,203	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD-A	88	164	2,090	36,929	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	1,047	—	—	—	自動車・自動車部品
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	42	42	490	8,670	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	18	10	333	5,885	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	—	792	1,139	20,132	素材
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	—	70	1,122	19,832	半導体・半導体製造装置
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	—	282	974	17,209	資本財
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	29	54	1,512	26,708	半導体・半導体製造装置
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	—	38	925	16,355	資本財
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	—	168	433	7,665	食品・飲料・タバコ
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	946	946	375	6,634	各種金融
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	—	3,086	1,052	18,588	銀行
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	2,201	2,201	818	14,463	素材
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	—	379	1,534	27,114	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	467	467	495	8,752	各種金融
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	1,067	1,067	482	8,519	運輸
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	—	16	1,129	19,956	資本財
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	1,415	1,415	755	13,347	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	—	794	1,040	18,387	各種金融
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	—	101	662	11,707	食品・飲料・タバコ
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	—	78	420	7,432	ヘルスケア機器・サービス
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	—	174	1,590	28,093	半導体・半導体製造装置
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	—	51	1,089	19,252	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	—	30	568	10,048	食品・飲料・タバコ
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	—	20	1,183	20,909	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	—	48	1,396	24,663	ソフトウェア・サービス
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	—	10	938	16,569	耐久消費財・アパレル
PETROCHINA CO LTD-A	1,000	1,000	485	8,567	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	2,612	2,612	1,211	21,408	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	3,536	1,032	18,238	銀行
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	200	200	389	6,871	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	1,049	1,049	5,356	94,614	銀行

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	668	668	3,319	58,633	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	952	952	1,743	30,791	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,383	1,383	1,181	20,863	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	2,736	2,736	1,058	18,703	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	944	16,675	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	76	76	13,604	240,309	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	989	989	457	8,088	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	432	432	1,105	19,520	各種金融
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	182	182	504	8,918	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	444	444	205	3,631	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,340	1,340	2,725	48,145	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,223	—	—	—	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,289	1,289	427	7,559	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,109	2,109	963	17,025	資本財
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	1,102	—	—	—	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,194	1,194	659	11,642	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	343	343	1,448	25,588	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	580	580	255	4,507	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	1,664	—	—	—	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	387	387	244	4,313	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	294	294	1,115	19,704	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	730	286	488	8,631	各種金融
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	818	818	1,026	18,134	不動産
CRRC CORP LTD-A	790	1,858	1,112	19,659	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	317	381	1,897	33,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	534	208	1,044	18,459	素材
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	632	—	—	—	資本財
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	315	315	490	8,663	各種金融
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	816	—	—	—	資本財
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	260	665	11,762	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	929	16,423	資本財
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	729	12,884	銀行
GEMDALE CORP-A	455	455	444	7,852	不動産
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	406	406	1,457	25,746	半導体・半導体製造装置
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	175	175	1,691	29,880	素材
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	182	182	62	1,099	不動産
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	823	—	—	—	メディア・娯楽
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	828	828	647	11,437	各種金融
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	676	676	679	12,000	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	486	583	2,224	39,301	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	148	122	2,776	49,053	小売
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	1,198	21,172	素材
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	1,225	1,225	476	8,417	各種金融
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,643	1,643	898	15,875	素材
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	28	28	41	726	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AIR CHINA LTD-A	259	259	232	4,103	運輸
TBEA CO LTD-A	—	225	559	9,881	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	—	3,309	1,250	22,094	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	1,155	20,410	資本財
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	—	552	1,166	20,599	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	265	4,691	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	160	160	465	8,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	1,140	1,140	543	9,605	各種金融
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	917	16,201	自動車・自動車部品
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	236	236	303	5,369	素材
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	710	12,545	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	505	505	475	8,394	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	104	104	140	2,474	ヘルスケア機器・サービス
ZHONGJIN GOLD CORP-A	340	340	290	5,135	素材
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	879	879	752	13,291	各種金融
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	72	72	145	2,571	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	1,789	31,605	資本財
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	409	—	—	—	素材
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	405	405	164	2,897	食品・生活必需品小売り
YANZHOU COAL MINING CO-A	612	612	1,402	24,767	エネルギー
YUTONG BUS CO LTD-A	443	443	512	9,046	資本財
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	1,500	1,500	922	16,295	公益事業
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	194	3,433	運輸
CHINA SPACESAT CO LTD -A	161	—	—	—	資本財
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	170	170	325	5,747	小売
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	—	603	865	15,284	食品・生活必需品小売り
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,400	—	—	—	不動産
SHANXI LU' AN ENVIRONMENTAL-A	878	878	1,005	17,758	エネルギー
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	966	—	—	—	資本財
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	91	127	778	13,745	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	388	131	429	7,584	ソフトウェア・サービス
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	3,746	—	—	—	資本財
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	373	185	872	15,414	自動車・自動車部品
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	600	600	294	5,193	素材
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	—	228	237	4,196	資本財
ZHANGZHOU PIENZTEHUANG PHA-A	39	39	1,649	29,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	195	195	229	4,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	67	93	2,832	50,040	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	208	208	366	6,473	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	909	1,090	449	7,938	エネルギー
KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A	—	304	384	6,793	素材
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	85	85	126	2,235	不動産
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	67	67	371	6,570	ソフトウェア・サービス
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	—	337	1,022	18,061	ヘルスケア機器・サービス
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	—	2,866	1,192	21,060	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	234	234	678	11,991	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	115	115	427	7,554	食品・飲料・タバコ
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	—	1,547	1,762	31,125	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	90	90	191	3,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	310	—	—	—	運輸
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	243	243	569	10,052	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	1,595	28,177	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	47	61	452	7,985	ソフトウェア・サービス
JCET GROUP CO LTD-A	—	298	955	16,886	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	356	75	487	8,607	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	79	79	1,218	21,517	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	—	262	1,464	25,871	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	100	100	163	2,886	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	—	179	498	8,809	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	180	114	951	16,802	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	432	98	193	3,422	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	—	107	597	10,561	食品・飲料・タバコ
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	163	336	3,129	55,275	半導体・半導体製造装置
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	383	383	451	7,969	エネルギー
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	141	184	2,207	38,987	食品・飲料・タバコ
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	173	173	940	16,606	食品・飲料・タバコ
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	293	293	575	10,165	自動車・自動車部品
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	—	188	1,438	25,405	資本財
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	—	723	1,236	21,839	各種金融
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	1,152	20,354	公益事業
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	22	22	139	2,459	食品・飲料・タバコ
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	434	564	286	5,052	各種金融
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	578	751	464	8,202	銀行
CHINA FILM CO LTD-A	170	—	—	—	メディア・娯楽
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	—	392	1,636	28,914	自動車・自動車部品
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	50	65	359	6,358	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	26	26	284	5,029	半導体・半導体製造装置
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	—	61	397	7,014	耐久消費財・アパレル
SDIC CAPITAL CO LTD-A	458	696	577	10,194	各種金融
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	47	20	441	7,795	ヘルスケア機器・サービス
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	—	108	1,412	24,953	半導体・半導体製造装置
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	78	101	496	8,776	食品・生活必需品小売り
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	82	82	586	10,360	資本財
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	86	86	393	6,947	食品・生活必需品小売り
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	317	317	422	7,469	各種金融
CHIPENG JILONG GOLD MINING-A	—	788	1,341	23,705	素材
SPRING AIRLINES CO LTD-A	83	83	485	8,574	運輸
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	36	36	53	943	各種金融
DAWNING INFORMATION INDUST-A	56	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	110	110	692	12,227	商業・専門サービス

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

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

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期 末		業 種	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
INDRAPRASTHA GAS LTD	132	267	13,201	20,198	公益事業	
TRENT LTD	—	192	21,708	33,213	小売	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	740	945	66,759	102,142	保険	
BHARAT ELECTRONICS LTD	—	1,162	25,676	39,284	資本財	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	40	40	10,945	16,746	各種金融	
BANDHAN BANK LTD	748	748	22,959	35,128	銀行	
ADANI TOTAL GAS LTD	—	269	42,447	64,944	公益事業	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	—	385	24,667	37,741	各種金融	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	—	310	33,588	51,390	各種金融	
AXIS BANK LTD	2,447	2,478	184,639	282,497	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	234	234	31,150	47,659	資本財	
BERGER PAINTS INDIA LTD	294	294	22,821	34,916	素材	
ADANI TRANSMISSION LTD	—	272	50,638	77,477	公益事業	
GRASIM INDUSTRIES LTD	417	315	58,765	89,910	素材	
AVENUE SUPERMARTS LTD	175	175	83,364	127,547	食品・生活必需品小売り	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	235	235	35,519	54,344	保険	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	317	317	20,667	31,620	保険	
INTERGLOBE AVIATION LTD	83	83	18,017	27,566	運輸	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	414	537	64,913	99,318	保険	
小 計	株 数 ・ 金 額	66,506	90,365	7,905,721	12,095,754	
	銘柄数 <比率>	86	101	—	<11.6%>	
(パキスタン)				千パキスタンルピー		
LUCKY CEMENT	—	313	24,087	15,897	素材	
MCB BANK LTD	533	533	8,358	5,516	銀行	
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	730	—	—	—	エネルギー	
HABIB BANK LTD	665	665	8,333	5,500	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,928	1,511	40,779	26,914	
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.0%>	
(カタール)				千カタールリアル		
QATAR NATIONAL BANK	4,897	4,844	10,173	314,559	銀行	
COMMERCIAL BANK QSC	2,039	2,039	1,325	40,997	銀行	
OOREDOO QSC	728	728	509	15,756	電気通信サービス	
QATAR FUEL QSC	573	604	1,129	34,929	エネルギー	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	624	624	1,061	32,810	公益事業	
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	985	985	959	29,672	銀行	
INDUSTRIES QATAR	1,967	1,967	3,101	95,894	資本財	
QATAR ISLAMIC BANK	1,142	1,142	2,086	64,529	銀行	
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	—	2,967	976	30,190	エネルギー	
MASRAF AL RAYAN	4,065	4,065	2,015	62,310	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	2,074	2,074	672	20,786	不動産	
MESALEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,439	4,439	1,047	32,393	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	23,538	26,484	25,059	774,833	
	銘柄数 <比率>	11	12	—	<0.7%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	—	146	2,919	21,865	素材	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
BIDVEST GROUP LTD	277	277	5,256	39,372	資本財	
CLICKS GROUP LTD	269	269	7,537	56,458	食品・生活必需品小売り	
DISCOVERY LIMITED	484	484	6,867	51,440	保険	
GOLD FIELDS LTD	971	971	13,876	103,937	素材	
REMGRO LTD	554	554	7,471	55,959	各種金融	
NORTHAM PLATINUM LTD	339	—	—	—	素材	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	563	563	3,062	22,940	素材	
EXXARO RESOURCES LTD	349	225	3,609	27,035	エネルギー	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	69	85	15,712	117,685	銀行	
MTN GROUP LTD	1,730	1,945	32,884	246,307	電気通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	447	394	11,261	84,351	素材	
FIRSTRAND LTD	5,258	5,603	32,986	247,066	各種金融	
NASPERS LTD-N SHS	468	232	59,207	443,462	小売	
NEDBANK GROUP LTD	380	444	7,471	55,964	銀行	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	73	61	9,374	70,213	素材	
SASOL LTD	572	572	15,469	115,865	素材	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	584	600	11,296	84,608	食品・生活必需品小売り	
MR PRICE GROUP LTD	285	285	5,781	43,305	小売	
STANDARD BANK GROUP LTD	1,426	1,502	20,247	151,651	銀行	
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	232	4,566	34,200	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,104	1,104	6,282	47,057	小売	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	372	372	8,319	62,313	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABSA GROUP LTD	732	732	10,300	77,149	銀行	
TIGER BRANDS LTD	130	130	2,500	18,728	食品・飲料・タバコ	
SANLAM LTD	2,210	2,140	13,183	98,744	保険	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	882	917	17,433	130,573	素材	
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,209	16,550	素材	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	1,565	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	680	—	—	—	保険	
RAND MERCHANT INVESTMENT HD	1,012	1,012	4,337	32,486	保険	
VODACOM GROUP	623	623	8,534	63,927	電気通信サービス	
NEPI ROCKCASTLE PLC	334	605	6,231	46,671	不動産	
OLD MUTUAL LTD	4,896	4,896	6,972	52,220	保険	
REINET INVESTMENTS SCA	171	171	4,672	34,995	各種金融	
PEPKOR HOLDINGS LTD	830	—	—	—	小売	
MULTICHOICE GROUP LTD	405	405	4,822	36,117	メディア・娯楽	
SIBANYE STILLWATER LTD	2,520	3,137	16,235	121,602	素材	
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	—	339	6,984	52,314	素材	
BID CORP LTD	392	350	11,349	85,004	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	34,258 38	32,444 36	407,229 —	3,050,151 <2.9%>	
(アラブ首長国連邦)				千アラブ首長国 連邦ディルハム		
DUBAI ISLAMIC BANK		2,159	2,159	1,157	35,626	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC		3,850	3,850	1,882	57,953	不動産

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
EMIRATES NBD PJSC	2,652	2,652	3,753	115,546	銀行
EMAAR MALLS PJSC	1,796	—	—	—	不動産
ABU DHABI ISLAMIC BANK	—	1,857	1,096	33,738	銀行
EMIRATES TELECOM GROUP CO	2,004	1,743	4,708	144,922	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	3,311	3,270	2,684	82,643	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	2,832	4,865	9,244	284,539	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC	5,094	3,675	1,539	47,400	不動産
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	—	2,714	1,167	35,921	小売
小 計	23,701	26,789	27,235	838,293	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	8	9	—	<0.8%>	
(サウジアラビア)			千サウジアラビリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	265	265	1,927	58,108	素材
JARIR MARKETING CO	71	71	1,461	44,046	小売
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	66	66	551	16,622	保険
ETHAD ETISALAT CO	344	344	1,027	30,961	電気通信サービス
SAUDI BRITISH BANK	717	944	3,119	94,034	銀行
AL RAJHI BANK	1,350	1,307	19,223	579,400	銀行
ARAB NATIONAL BANK	576	576	1,331	40,129	銀行
BANK ALBILAD	458	458	2,109	63,580	銀行
BANK AL-JAZIRA	358	358	679	20,487	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	690	675	3,224	97,196	銀行
RIYAD BANK	1,389	1,389	4,064	122,491	銀行
SAMBA FINANCIAL GROUP	1,016	—	—	—	銀行
SAUDI TELECOM CO	652	663	7,625	229,837	電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	239	242	4,225	127,342	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	975	973	12,422	374,406	素材
SAUDI CEMENT	74	74	446	13,452	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	922	922	2,411	72,684	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	210	210	726	21,897	素材
SAVOLA	253	253	904	27,261	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	319	319	775	23,384	素材
ALMARAI CO	301	301	1,572	47,403	食品・飲料・タバコ
EMAAR ECONOMIC CITY	461	461	548	16,537	不動産
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	322	322	1,415	42,666	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	98	98	705	21,275	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	661	661	1,268	38,219	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	470	470	435	13,129	不動産
RABIGH REFINING AND PETROCHE	235	235	640	19,313	エネルギー
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	—	268	358	10,795	電気通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	60	60	847	25,546	保険
ALINMA BANK	1,099	1,099	2,744	82,719	銀行
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	37	37	433	13,068	食品・生活必需品小売り
SAUDI ARABIAN MINING CO	449	449	3,553	107,109	素材
NATIONAL PETROCHEMICAL CO	—	136	589	17,752	素材
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	—	40	669	20,182	ヘルスケア機器・サービス

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

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国新株予約権証券>

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

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

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

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

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

投資信託財産の構成

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

(注1) 当期末における外貨建純資産(104,056,110千円)の投資信託財産総額(104,261,383千円)に対する比率は99.8%です。

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

1米ドル=112.86円	1メキシコペソ=5.5529円	1ブラジルリアル=20.5709円
1チリペソ=0.142432円	1コロンビアペソ=0.029149円	1ユーロ=130.83円
1イギリスポンド=152.97円	1トルコリラ=11.5981円	1チェココナ=5.1812円
1ハンガリーフォリント=0.362644円	1ポーランドズロチ=28.4806円	1香港ドル=14.49円
1マレーシアリンギット=27.1906円	1タイバーツ=3.44円	1フィリピンペソ=2.2521円
1インドネシアルピア=0.008円	1韓国ウォン=0.0958円	1新台幣ドル=4.0661円
1インドルピー=1.53円	1パキスタンルピー=0.66円	1カタールリアル=30.92円
1南アフリカランド=7.49円	1アラブ首長国連邦ディルハム=30.78円	1サウジアラビアリアル=30.14円
1クウェート・ディナール=374.83円	1香港・オフショア人民元=17.6645円	

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年11月10日現在
(A) 資 産	104,348,859,892円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,142,318,509
株 式(評価額)	97,437,385,523
新株予約権証券(評価額)	197,712
投資信託受益証券(評価額)	200,991,203
投資証券(評価額)	83,695,030
未 収 入 金	111,675,621
未 収 配 当 金	82,978,857
差 入 委 託 証 拠 金	1,289,617,437
(B) 負 債	216,411,975
未 払 金	196,104,538
未 払 解 約 金	20,307,222
未 払 利 息	215
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	104,132,447,917
元 本	28,114,813,263
次 期 繰 越 損 益 金	76,017,634,654
(D) 受 益 権 総 口 数	28,114,813,263口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,038円

■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は26,069,398,222円、期中追加設定元本額は4,711,515,456円、期中一部解約元本額は2,666,100,415円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第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。

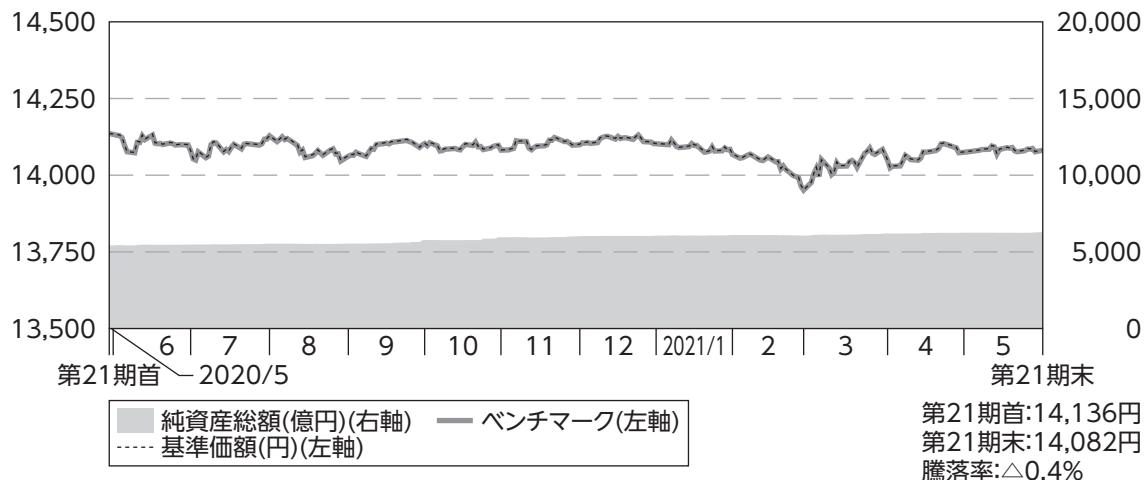
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

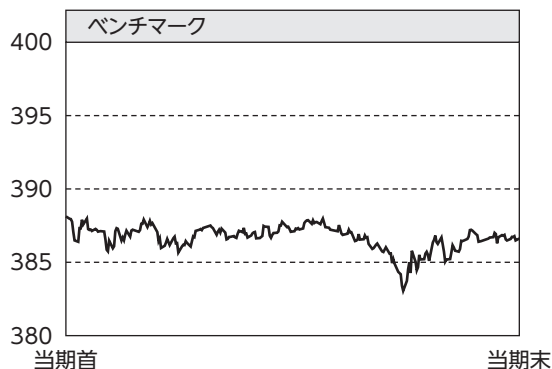


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

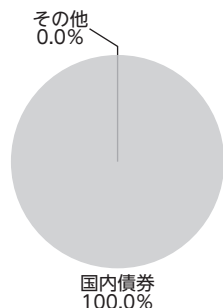
○上位10銘柄

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%

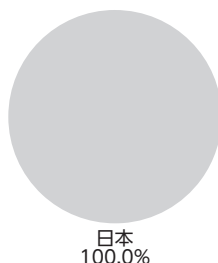
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第340回利付国債(10年)	日本	1.0%
9	第346回利付国債(10年)	日本	1.0%
10	第140回利付国債(5年)	日本	1.0%
組入銘柄数		982	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

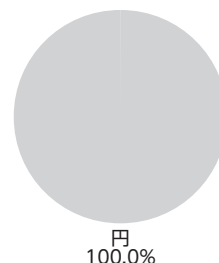
○資産別配分



○国別配分



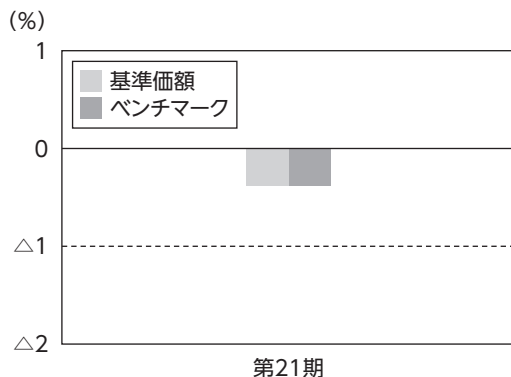
○通貨別配分



(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
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第52回利付国債(30年)	0.5	1,910,000	1,878,351	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	880,000	884,892	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	2,110,000	2,219,150	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,540,000	1,618,509	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,680,000	1,764,336	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,550,000	1,626,585	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	2,600,000	2,726,334	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	620,000	634,427	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	2,700,000	2,893,401	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,660,000	1,693,233	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	20,000	19,339	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,160,000	1,089,901	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	2,550,000	2,389,018	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	860,000	804,340	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	1,030,000	962,854	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,410,000	1,387,679	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,870,000	1,840,173	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	840,000	847,257	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	980,000	987,301	2051/3/20
第58回利付国債(20年)	1.9	300,000	307,935	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	200,000	205,680	2022/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	350,000	358,305	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	240,000	244,891	2023/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	326,121	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	207,942	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	335,011	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	231,411	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	346,272	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	137,395	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	202,410	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	414,378	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	430,940	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	214,246	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	676,393	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	387,234	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	215,844	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	141,016	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	290,819	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	313,466	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	183,982	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	293,306	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	239,885	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	425,677	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	657,486	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	319,255	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	515,265	2025/12/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	320,693	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	210,000	234,250	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,830,000	2,032,507	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	470,941	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	390,677	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	706,696	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	507,181	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	987,008	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	459,556	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	687,287	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	697,864	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,799,689	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	457,348	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	500,297	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,290,000	1,473,321	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	553,876	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	834,805	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,477,942	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	466,356	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	184,278	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,364,481	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	442,190	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	301,810	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	756,142	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	597,760	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,281,676	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,142,281	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	923,952	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	1,720,000	2,019,090	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,744,996	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	830,655	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,774,545	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,276,765	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	777,024	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	614,407	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,791,699	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,757,805	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,092,844	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,870,000	2,232,349	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	722,410	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,820,000	2,197,304	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	867,130	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,201,672	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,146,035	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	890,000	1,042,643	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,285,000	1,509,335	2031/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第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	

銘柄名	期		末	
	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回静岡県公債(30年)	1.539	100,000	120,519	2045/6/20	
第12回静岡県公債(30年)	0.822	100,000	103,578	2048/3/19	
第15回静岡県公債(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15	
第18回静岡県公債(20年)	1.473	100,000	115,312	2034/7/10	
平成24年度第10回静岡県公債(20年)	0.678	100,000	101,208	2023/3/22	
平成29年度第5回静岡県公債(20年)	0.19	100,000	100,753	2027/6/18	
平成29年度第8回静岡県公債(20年)	0.21	100,000	100,873	2027/6/18	
平成29年度第11回静岡県公債(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地方債	0.84	220,000	222,094	2022/7/25
第113回共同発行市場公募地方債	0.77	200,000	201,876	2022/8/25
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	101,175	2022/11/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	200,000	202,218	2022/12/22
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	400,000	405,488	2023/2/24
第121回共同発行市場公募地方債	0.57	100,000	101,064	2023/4/25
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	203,622	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	101,610	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,615	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	203,980	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,776	2024/2/23
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	305,490	2024/3/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	112,000	114,216	2024/5/24
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,991	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	101,893	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,795	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	101,724	2024/11/25
第141回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	203,088	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	204,318	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	128,225	2025/7/25
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	102,180	2025/11/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,456	2026/3/25
第157回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,357	2026/4/24
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	200,302	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	200,102	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	400,416	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	100,054	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,704	2027/1/25
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	101,087	2027/2/25
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	201,452	2027/6/25
第174回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	195,337	2027/9/24
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	100,988	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債	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	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	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	%	千円	%
コー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	626,968,264	97.2	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	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440,540	0.9	97.3	1.4	219,477
第18期(2018年5月29日)	26,619	△0.1	441,246	0.2	98.0	0.8	243,756
第19期(2019年5月29日)	27,366	2.8	454,282	3.0	97.3	1.4	310,994
第20期(2020年5月29日)	29,017	6.0	481,049	5.9	97.3	2.1	276,169
第21期(2021年5月31日)	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1	304,255

(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
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2020年 5月29日	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。

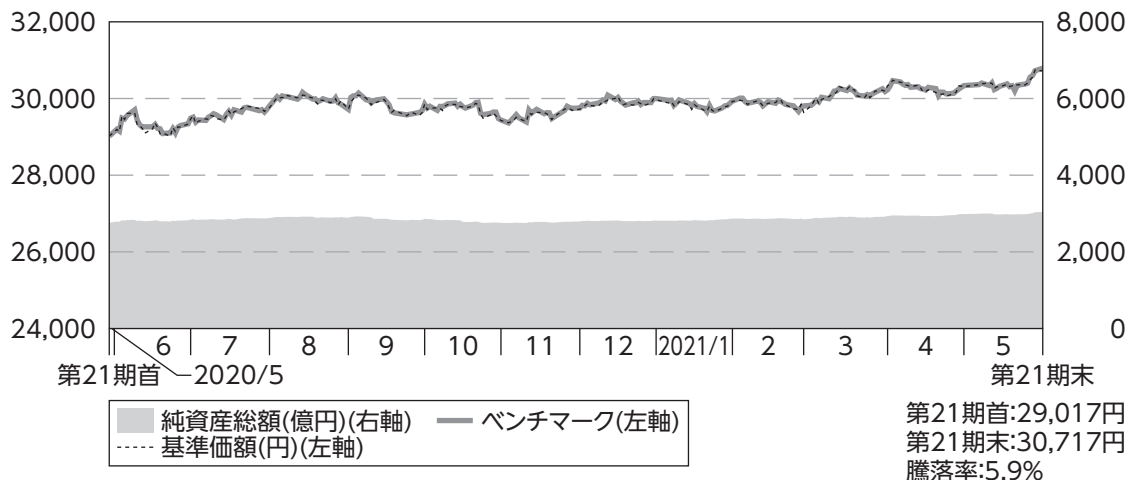
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

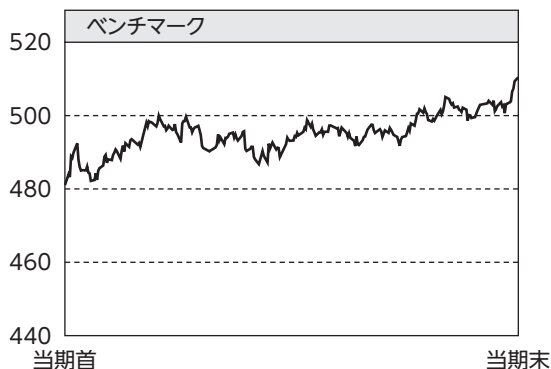


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

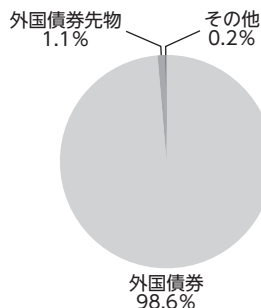
○上位10銘柄

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%

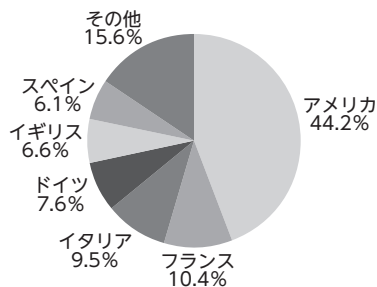
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 1.375% 11/15/40	アメリカ	0.4%
8	T 0.75% 03/31/26	アメリカ	0.4%
9	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.4%
10	T 2% 11/15/26	アメリカ	0.4%
組入銘柄数		779	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

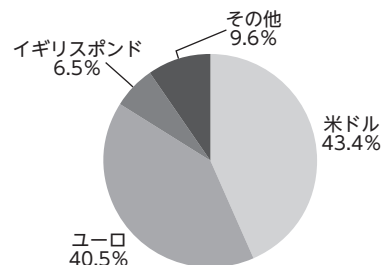
○資産別配分



○国別配分



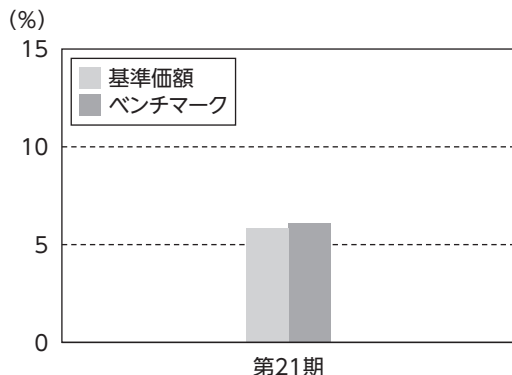
○通貨別配分



(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	2,020	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)	償還年月日	
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)	償還年月日	
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		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
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	2023/9/3
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		千ユーロ	千ユーロ		
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

銘柄	利 率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
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

銘柄	利 率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
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	売
		(百万円)		(百万円)	
外	EURO-SCHATZ	299		-	
	US 5YR NOTE	543		-	
国	EURO-BOBL FU	468		-	
	EURO-BUND	1,181		-	
	US 10YR NOTE	405		-	
	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 ファンド2045	41, 051, 209円
DCターゲット・イヤー 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 ファンド2055	523, 999円

お知らせ

該当事項はありません。

新興国債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
	期騰	期中落率	期騰	期中落率					
	円	%		%	%	%	%	百万円	
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	
第13期(2021年11月10日)	17,665	4.3	34,005.46	4.3	97.1	—	—	79,131	

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1)騰落率は期首比です。

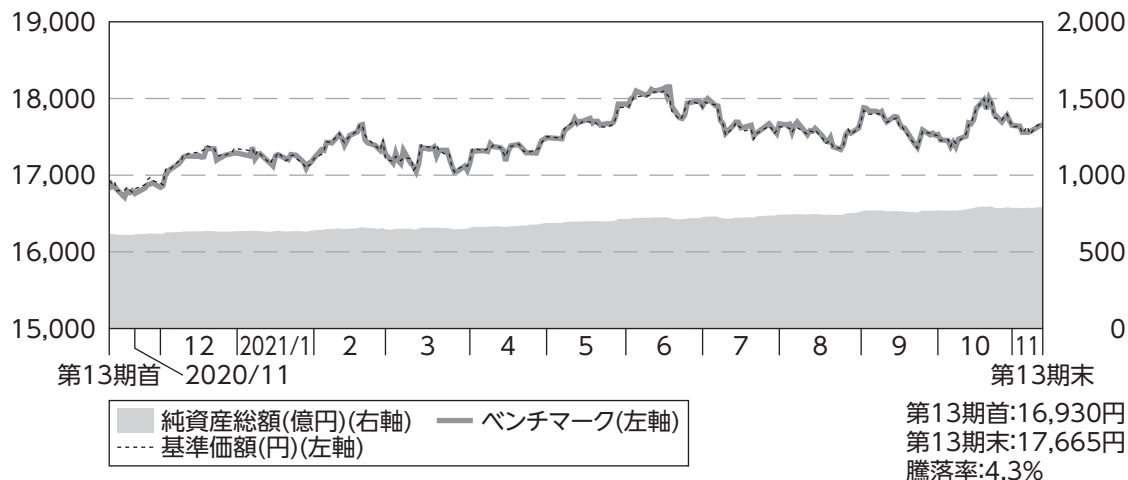
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。

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

投資環境



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

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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

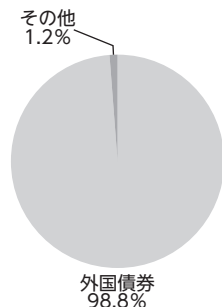
○上位10銘柄

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

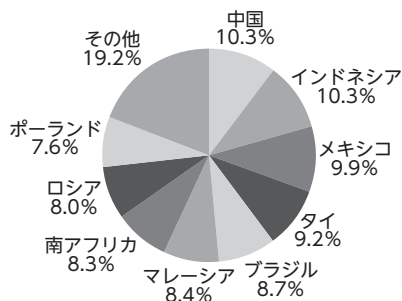
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MBONO 5.75% 03/05/26	メキシコ	1.1%
8	MGS 3.885% 08/15/29	マレーシア	1.1%
9	SAGB 8.75% 02/28/48	南アフリカ	1.0%
10	SAGB 8% 01/31/30	南アフリカ	1.0%
組入銘柄数		239	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

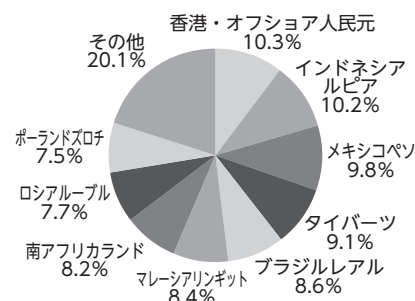
○資産別配分



○国別配分



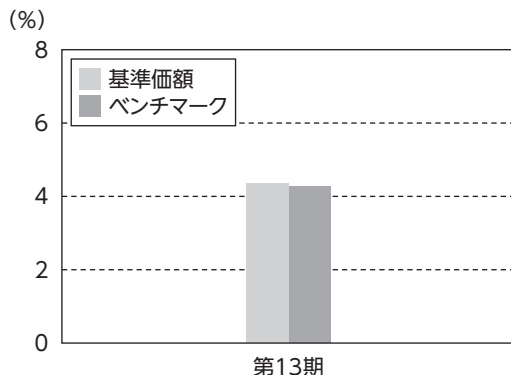
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年11月11日~2021年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	16 (16) (-) (0)	0.093 (0.091) (-) (0.002)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	16	0.093	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(17,467円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

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

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

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

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A) 債券種類別開示

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

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	当 期		末		
	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	31,800	39,275	218,091	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	100,250	108,505	602,520	2024/12/5
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	158,800	150,798	837,366	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	103,700	103,944	577,194	2022/6/9
MBONO 6.75% 03/09/23	6.75	92,600	92,963	516,219	2023/3/9
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	126,500	128,664	714,460	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	102,100	105,645	586,641	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	77,000	77,853	432,310	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	32,600	33,825	187,831	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	115,400	118,250	656,632	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	85,100	88,106	489,247	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	97,950	100,127	555,997	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	116,900	125,796	698,533	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	82,000	88,965	494,018	2038/11/18
小 計				7,567,065	
(ブラジル)		千ブラジルレアル	千ブラジルレアル		
国債証券					
BLTN 0% 01/01/24	—	92,100	72,169	1,484,601	2024/1/1
BLTN 0% 07/01/22	—	22,350	20,878	429,489	2022/7/1
BLTN 0% 07/01/23	—	70,000	57,946	1,192,018	2023/7/1
BLTN 0% 07/01/24	—	19,500	14,452	297,301	2024/7/1
BNTNF 10% 01/01/23	10.0	60,400	59,098	1,215,719	2023/1/1
BNTNF 10% 01/01/25	10.0	31,800	30,398	625,332	2025/1/1
BNTNF 10% 01/01/27	10.0	38,200	35,982	740,194	2027/1/1
BNTNF 10% 01/01/29	10.0	23,100	21,412	440,472	2029/1/1
BNTNF 10% 01/01/31	10.0	11,050	10,161	209,027	2031/1/1
BRAZIL 10.25% 01/10/28	10.25	1,400	1,346	27,701	2028/1/10
BRAZIL 8.5% 01/05/24	8.5	1,900	1,812	37,277	2024/1/5
小 計				6,699,136	
(チリ)		千チリペソ	千チリペソ		
国債証券					
BTPCL 2.3% 10/01/28	2.3	675,000	543,914	77,470	2028/10/1
BTPCL 2.5% 03/01/25	2.5	2,685,000	2,437,699	347,206	2025/3/1
BTPCL 4% 03/01/23	4.0	840,000	827,264	117,828	2023/3/1
BTPCL 4.5% 03/01/26	4.5	1,820,000	1,743,505	248,330	2026/3/1
BTPCL 4.7% 09/01/30	4.7	1,740,000	1,605,839	228,722	2030/9/1
BTPCL 5% 03/01/35	5.0	2,040,000	1,836,471	261,572	2035/3/1
BTPCL 5% 10/01/28	5.0	660,000	631,560	89,954	2028/10/1
BTPCL 6% 01/01/43	6.0	1,520,000	1,475,086	210,099	2043/1/1
小 計				1,581,186	
(コロンビア)		千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
国債証券					
COLOM 9.85% 06/28/27	9.85	62,800,000	72,319,224	2,108,033	2027/6/28
COLTES 6.25% 11/26/25	6.25	5,600,000	5,459,888	159,150	2025/11/26
COLTES 7.25% 10/18/34	7.25	33,300,000	31,349,952	913,819	2034/10/18
COLTES 7.25% 10/26/50	7.25	5,900,000	5,207,694	151,799	2050/10/26
小 計				3,332,802	
(ペルー)		千ペルーヌエボソル	千ペルーヌエボソル		
国債証券					
PERUGB 5.35% 08/12/40	5.35	4,500	3,851	108,240	2040/8/12

銘柄	当 期		末		
	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
PERUGB 5.4% 08/12/34	5.4	6,350	5,830	163,867	2034/8/12
PERUGB 5.7% 08/12/24	5.7	3,700	3,808	107,034	2024/8/12
PERUGB 5.94% 02/12/29	5.94	7,400	7,651	215,400	2029/2/12
PERUGB 6.15% 08/12/32	6.15	6,300	6,403	179,961	2032/8/12
PERUGB 6.35% 08/12/28	6.35	7,700	8,179	229,890	2028/8/12
PERUGB 6.9% 08/12/37	6.9	6,950	7,135	200,541	2037/8/12
PERUGB 6.95% 08/12/31	6.95	7,700	8,343	234,480	2031/8/12
PERUGB 8.2% 08/12/26	8.2	6,050	6,880	193,378	2026/8/12
小 計				1,632,435	
(ウルグアイ)		千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
国債証券					
URUGIA 8.25% 05/21/31	8.25	25,000	24,359	63,157	2031/5/21
URUGIA 8.5% 03/15/28	8.5	12,500	12,665	32,836	2028/3/15
小 計				95,994	
(ドミニカ共和国)		千ドミニカペソ	千ドミニカペソ		
国債証券					
DOMREP 8.9% 02/15/23	8.9	20,400	21,582	43,049	2023/2/15
DOMREP 9.75% 06/05/26	9.75	33,000	38,823	77,441	2026/6/5
小 計				120,491	
(トルコ)		千トルコリラ	千トルコリラ		
国債証券					
TURKGB 10.4% 03/20/24	10.4	3,950	3,410	39,559	2024/3/20
TURKGB 10.5% 08/11/27	10.5	8,650	6,264	72,661	2027/8/11
TURKGB 10.6% 02/11/26	10.6	11,050	8,643	100,249	2026/2/11
TURKGB 10.7% 08/17/22	10.7	8,650	8,323	96,540	2022/8/17
TURKGB 11% 02/24/27	11.0	7,400	5,569	64,597	2027/2/24
TURKGB 11.7% 11/13/30	11.7	16,600	11,808	136,957	2030/11/13
TURKGB 12.2% 01/18/23	12.2	9,900	9,424	109,302	2023/1/18
TURKGB 12.4% 03/08/28	12.4	4,700	3,660	42,449	2028/3/8
TURKGB 12.6% 10/01/25	12.6	17,400	14,775	171,368	2025/10/1
TURKGB 16.2% 06/14/23	16.2	7,100	7,016	81,378	2023/6/14
TURKGB 7.1% 03/08/23	7.1	6,200	5,500	63,791	2023/3/8
TURKGB 8% 03/12/25	8.0	8,300	6,267	72,694	2025/3/12
TURKGB 8.5% 09/14/22	8.5	5,100	4,802	55,700	2022/9/14
TURKGB 9% 07/24/24	9.0	15,600	12,773	148,145	2024/7/24
小 計				1,255,398	
(チェコ)		千チェココルナ	千チェココルナ		
国債証券					
CZGB 0.05% 11/29/29	0.05	31,100	25,165	130,389	2029/11/29
CZGB 0.25% 02/10/27	0.25	53,700	47,031	243,679	2027/2/10
CZGB 0.45% 10/25/23	0.45	47,000	44,693	231,567	2023/10/25
CZGB 0.95% 05/15/30	0.95	54,900	47,666	246,971	2030/5/15
CZGB 1% 06/26/26	1.0	72,800	67,045	347,374	2026/6/26
CZGB 1.2% 03/13/31	1.2	46,000	40,396	209,301	2031/3/13
CZGB 1.25% 02/14/25	1.25	53,000	50,175	259,967	2025/2/14
CZGB 1.5% 04/24/40	1.5	22,700	18,801	97,411	2040/4/24
CZGB 1.75% 06/23/32	1.75	28,000	25,844	133,907	2032/6/23
CZGB 2% 10/13/33	2.0	59,700	55,722	288,710	2033/10/13
CZGB 2.4% 09/17/25	2.4	51,900	50,868	263,561	2025/9/17
CZGB 2.5% 08/25/28	2.5	64,800	63,777	330,443	2028/8/25
CZGB 2.75% 07/23/29	2.75	50,300	50,266	260,439	2029/7/23
CZGB 4.2% 12/04/36	4.2	28,000	33,386	172,984	2036/12/4

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
CZGB 4.7%	09/12/22	4.7	35,800	36,350	188,339	2022/9/12
CZGB 5.7%	05/25/24	5.7	37,700	40,082	207,676	2024/5/25
小計					3,612,725	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォロント	千ハンガリーフォロント		
国債証券						
HGB 1%	11/26/25	1.0	475,000	438,600	159,055	2025/11/26
HGB 1.5%	04/22/26	1.5	610,500	566,806	205,548	2026/4/22
HGB 1.5%	08/23/23	1.5	322,500	320,213	116,123	2023/8/23
HGB 1.5%	08/26/26	1.5	394,000	362,913	131,608	2026/8/26
HGB 1.75%	10/26/22	1.75	275,000	274,692	99,615	2022/10/26
HGB 2%	05/23/29	2.0	343,000	304,896	110,568	2029/5/23
HGB 2.25%	04/20/33	2.25	512,000	435,783	158,034	2033/4/20
HGB 2.5%	10/24/24	2.5	548,000	543,824	197,214	2024/10/24
HGB 2.75%	12/22/26	2.75	470,500	456,723	165,628	2026/12/22
HGB 3%	06/26/24	3.0	402,500	406,291	147,339	2024/6/26
HGB 3%	08/21/30	3.0	555,000	524,219	190,105	2030/8/21
HGB 3%	10/27/27	3.0	592,000	575,572	208,727	2027/10/27
HGB 3%	10/27/38	3.0	380,000	325,736	118,126	2038/10/27
HGB 3.25%	10/22/31	3.25	692,000	661,275	239,807	2031/10/22
HGB 5.5%	06/24/25	5.5	660,000	716,575	259,861	2025/6/24
HGB 6.0%	11/24/23	6.0	471,000	506,254	183,590	2023/11/24
HGB 6.75%	10/22/28	6.75	382,000	455,061	165,025	2028/10/22
HGB 7%	06/24/22	7.0	205,000	211,601	76,735	2022/6/24
小計					2,932,716	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券						
POLGB 0.25%	10/25/26	0.25	14,000	12,358	351,985	2026/10/25
POLGB 0.75%	04/25/25	0.75	20,050	18,709	532,850	2025/4/25
POLGB 1.25%	10/25/30	1.25	15,800	13,857	394,662	2030/10/25
POLGB 2.25%	10/25/24	2.25	17,950	17,674	503,369	2024/10/25
POLGB 2.5%	01/25/23	2.5	19,900	19,895	566,622	2023/1/25
POLGB 2.5%	04/25/24	2.5	14,250	14,146	402,902	2024/4/25
POLGB 2.5%	07/25/26	2.5	24,100	23,799	677,830	2026/7/25
POLGB 2.5%	07/25/27	2.5	14,400	14,173	403,669	2027/7/25
POLGB 2.75%	04/25/28	2.75	18,800	18,742	533,796	2028/4/25
POLGB 2.75%	10/25/29	2.75	22,150	22,028	627,394	2029/10/25
POLGB 3.25%	07/25/25	3.25	13,250	13,453	383,164	2025/7/25
POLGB 4%	10/25/23	4.0	10,850	11,108	316,365	2023/10/25
POLGB 5.75%	09/23/22	5.75	7,500	7,745	220,606	2022/9/23
小計					5,915,219	
(ロシア)			千ロシアルーブル	千ロシアルーブル		
国債証券						
RFLB 4.5%	07/16/25	4.5	270,000	239,252	382,803	2025/7/16
RFLB 5.7%	05/17/28	5.7	219,000	193,486	309,578	2028/5/17
RFLB 6%	10/06/27	6.0	217,500	196,798	314,877	2027/10/6
RFLB 6.1%	07/18/35	6.1	214,500	182,779	292,447	2035/7/18
RFLB 6.5%	02/28/24	6.5	149,000	143,688	229,901	2024/2/28
RFLB 6.9%	05/23/29	6.9	158,000	148,670	237,872	2029/5/23
RFLB 6.9%	07/23/31	6.9	170,000	158,045	252,872	2031/7/23
RFLB 7%	01/25/23	7.0	71,200	70,252	112,403	2023/1/25
RFLB 7%	08/16/23	7.0	107,200	105,016	168,026	2023/8/16

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
RFLB 7.05%	01/19/28	7.05	230,500	219,816	351,706	2028/1/19
RFLB 7.1%	10/16/24	7.1	165,100	160,564	256,903	2024/10/16
RFLB 7.15%	11/12/25	7.15	210,400	203,454	325,527	2025/11/12
RFLB 7.25%	05/10/34	7.25	160,500	152,349	243,759	2034/5/10
RFLB 7.4%	07/17/24	7.4	202,200	198,457	317,531	2024/7/17
RFLB 7.4%	12/07/22	7.4	195,100	193,427	309,484	2022/12/7
RFLB 7.6%	07/20/22	7.6	117,700	117,430	187,888	2022/7/20
RFLB 7.65%	04/10/30	7.65	221,500	217,800	348,481	2030/4/10
RFLB 7.7%	03/16/39	7.7	133,500	131,203	209,926	2039/3/16
RFLB 7.7%	03/23/33	7.7	185,000	182,269	291,631	2033/3/23
RFLB 7.75%	09/16/26	7.75	141,500	139,875	223,800	2026/9/16
RFLB 7.95%	10/07/26	7.95	181,000	180,364	288,583	2026/10/7
RFLB 8.15%	02/03/27	8.15	170,000	170,804	273,286	2027/2/3
RFLB 8.5%	09/17/31	8.5	116,650	120,991	193,586	2031/9/17
小計					6,122,881	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券						
MGS 2.632%	04/15/31	2.632	8,700	8,109	220,500	2031/4/15
MGS 3.478%	06/14/24	3.478	5,150	5,262	143,095	2024/6/14
MGS 3.48%	03/15/23	3.48	17,600	17,893	486,541	2023/3/15
MGS 3.502%	05/31/27	3.502	10,950	11,089	301,530	2027/5/31
MGS 3.733%	06/15/28	3.733	25,250	25,804	701,639	2028/6/15
MGS 3.757%	04/20/23	3.757	4,850	4,956	134,757	2023/4/20
MGS 3.757%	05/22/40	3.757	12,650	12,013	326,656	2040/5/22
MGS 3.8%	08/17/23	3.8	7,100	7,283	198,043	2023/8/17
MGS 3.828%	07/05/34	3.828	8,200	8,032	218,403	2034/7/5
MGS 3.885%	08/15/29	3.885	29,800	30,584	831,598	2029/8/15
MGS 3.899%	11/16/27	3.899	14,800	15,272	415,258	2027/11/16
MGS 3.9%	11/30/26	3.9	8,050	8,358	227,276	2026/11/30
MGS 3.906%	07/15/26	3.906	8,700	9,009	244,982	2026/7/15
MGS 3.955%	09/15/25	3.955	26,000	26,959	733,056	2025/9/15
MGS 4.059%	09/30/24	4.059	10,900	11,316	307,702	2024/9/30
MGS 4.065%	06/15/50	4.065	9,250	8,986	244,344	2050/6/15
MGS 4.181%	07/15/24	4.181	7,600	7,896	214,705	2024/7/15
MGS 4.254%	05/31/35	4.254	12,950	13,261	360,597	2035/5/31
MGS 4.762%	04/07/37	4.762	7,350	7,794	211,939	2037/4/7
小計					6,522,629	
(タイ)			千タイバート	千タイバート		
国債証券						
THAIGB 0.75%	06/17/24	0.75	90,500	90,510	311,357	2024/6/17
THAIGB 0.95%	06/17/25	0.95	116,700	116,823	401,873	2025/6/17
THAIGB 1.45%	12/17/24	1.45	103,000	104,868	360,747	2024/12/17
THAIGB 1.585%	12/17/35	1.585	56,800	51,915	178,588	2035/12/17
THAIGB 1.6%	06/17/35	1.6	44,100	40,593	139,640	2035/6/17
THAIGB 1.6%	12/17/29	1.6	85,100	85,336	293,557	2029/12/17
THAIGB 1.875%	06/17/22	1.875	59,300	59,783	205,656	2022/6/17
THAIGB 2%	06/17/42	2.0	65,600	58,559	205,443	2042/6/17
THAIGB 2%	12/17/22	2.0	65,000	66,030	221,144	2022/12/17
THAIGB 2.125%	12/17/26	2.125	170,600	178,824	615,156	2026/12/17
THAIGB 2.4%	12/17/23	2.4	123,000	127,452	438,436	2023/12/17
THAIGB 2.875%	06/17/46	2.875	20,500	20,954	72,084	2046/6/17
THAIGB 2.875%	12/17/28	2.875	83,200	90,777	312,272	2028/12/17

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
THAIGB 3.3% 06/17/38	3.3	178,700	197,018	677,743	2038/6/17	
THAIGB 3.4% 06/17/36	3.4	129,200	144,878	498,381	2036/6/17	
THAIGB 3.625% 06/16/23	3.625	99,000	103,763	356,947	2023/6/16	
THAIGB 3.65% 06/20/31	3.65	107,500	124,437	428,065	2031/6/20	
THAIGB 3.775% 06/25/32	3.775	152,500	178,348	613,519	2032/6/25	
THAIGB 3.85% 12/12/25	3.85	97,400	108,439	373,031	2025/12/12	
THAIGB 4.875% 06/22/29	4.875	105,500	129,783	446,456	2029/6/22	
小計				7,152,106		
(フィリピン)		千フィリピンペソ	千フィリピンペソ			
国債証券						
PHILIP 3.9% 11/26/22	3.9	15,000	15,072	33,943	2022/11/26	
PHILIP 6.25% 01/14/36	6.25	30,000	35,020	78,869	2036/1/14	
小計				112,813		
(インドネシア)		千インドネシアルピア	千インドネシアルピア			
国債証券						
INDOGB 10.5% 08/15/30	10.5	7,300,000	9,342,394	74,739	2030/8/15	
INDOGB 11% 09/15/25	11.0	16,200,000	19,546,920	156,375	2025/9/15	
INDOGB 5.5% 04/15/26	5.5	36,500,000	37,149,325	297,194	2026/4/15	
INDOGB 5.625% 05/15/23	5.625	60,300,000	61,885,890	495,087	2023/5/15	
INDOGB 6.125% 05/15/28	6.125	45,000,000	46,092,150	368,737	2028/5/15	
INDOGB 6.25% 06/15/36	6.25	17,800,000	17,850,196	142,801	2036/6/15	
INDOGB 6.375% 04/15/32	6.375	16,000,000	16,448,320	131,586	2032/4/15	
INDOGB 6.5% 02/15/31	6.5	62,500,000	64,042,500	512,340	2031/2/15	
INDOGB 6.5% 06/15/25	6.5	66,300,000	69,929,262	559,434	2025/6/15	
INDOGB 6.625% 05/15/33	6.625	31,000,000	31,280,550	250,244	2033/5/15	
INDOGB 7% 05/15/27	7.0	40,800,000	43,870,608	350,964	2027/5/15	
INDOGB 7% 09/15/30	7.0	54,000,000	56,927,880	455,423	2030/9/15	
INDOGB 7.125% 06/15/42	7.125	17,300,000	18,097,703	144,781	2042/6/15	
INDOGB 7.5% 04/15/40	7.5	34,000,000	36,182,460	289,459	2040/4/15	
INDOGB 7.5% 05/15/38	7.5	21,000,000	22,077,720	176,621	2038/5/15	
INDOGB 7.5% 06/15/35	7.5	27,200,000	29,169,824	233,358	2035/6/15	
INDOGB 7.5% 08/15/32	7.5	21,900,000	23,565,714	188,525	2032/8/15	
INDOGB 8.125% 05/15/24	8.125	35,600,000	38,948,892	311,591	2024/5/15	
INDOGB 8.25% 05/15/29	8.25	31,700,000	35,810,856	286,486	2029/5/15	
INDOGB 8.25% 05/15/36	8.25	31,800,000	35,858,634	286,869	2036/5/15	
INDOGB 8.25% 06/15/32	8.25	18,400,000	20,951,712	167,613	2032/6/15	
INDOGB 8.375% 03/15/24	8.375	53,600,000	58,665,736	469,325	2024/3/15	
INDOGB 8.375% 03/15/34	8.375	52,000,000	59,179,640	473,437	2034/3/15	
INDOGB 8.375% 04/15/39	8.375	21,200,000	24,085,744	192,685	2039/4/15	
INDOGB 8.375% 09/15/26	8.375	29,100,000	32,966,226	263,729	2026/9/15	
INDOGB 8.75% 05/15/31	8.75	34,700,000	40,710,040	325,680	2031/5/15	
INDOGB 9% 03/15/29	9.0	19,700,000	23,075,792	184,606	2029/3/15	
INDOGB 9.5% 07/15/31	9.5	11,400,000	13,900,590	111,204	2031/7/15	
小計				7,900,906		
(南アフリカ)		千南アフリカランド	千南アフリカランド			
国債証券						
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	132,100	146,394	1,096,495	2026/12/21	
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	43,600	30,943	231,765	2036/3/31	
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	34,100	22,867	171,277	2041/2/28	
SAGB 7% 02/28/31	7.0	64,700	54,705	409,746	2031/2/28	
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	38,900	40,078	300,189	2023/2/28	

当		期		末		
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SAGB 8% 01/31/30	8.0	113,700	105,490	790,126	2030/1/31	
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	80,700	73,026	546,966	2032/3/31	
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	97,700	83,867	628,168	2037/1/31	
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	68,200	57,760	432,627	2044/1/31	
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	126,100	106,530	797,913	2048/2/28	
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	78,000	70,810	530,372	2035/2/28	
SAGB 9% 01/31/40	9.0	64,450	56,576	423,755	2040/1/31	
小計				6,359,403		
(中国オフショア)		千香港・オフショア人民元	千香港・オフショア人民元			
国債証券						
CGB 1.99% 04/09/25	1.99	20,000	19,530	344,991	2025/4/9	
CGB 2.36% 07/02/23	2.36	18,000	17,975	317,525	2023/7/2	
CGB 2.68% 05/21/30	2.68	27,300	26,700	471,655	2030/5/21	
CGB 2.69% 08/12/26	2.69	6,000	5,990	105,823	2026/8/12	
CGB 2.84% 04/08/24	2.84	11,700	11,780	208,092	2024/4/8	
CGB 2.85% 06/04/27	2.85	24,500	24,554	433,745	2027/6/4	
CGB 2.88% 11/05/23	2.88	16,900	17,023	300,715	2023/11/5	
CGB 3.01% 05/13/28	3.01	15,000	15,107	266,862	2028/5/13	
CGB 3.02% 05/27/31	3.02	8,500	8,590	151,754	2031/5/27	
CGB 3.02% 10/22/25	3.02	28,000	28,346	500,719	2025/10/22	
CGB 3.03% 03/11/26	3.03	17,500	17,728	313,169	2026/3/11	
CGB 3.12% 12/05/26	3.12	20,000	20,350	359,479	2026/12/5	
CGB 3.13% 11/21/29	3.13	20,700	20,964	370,328	2029/11/21	
CGB 3.19% 04/11/24	3.19	24,100	24,483	432,496	2024/4/11	
CGB 3.22% 12/06/25	3.22	12,000	12,236	216,156	2025/12/6	
CGB 3.25% 06/06/26	3.25	22,000	22,506	397,572	2026/6/6	
CGB 3.25% 11/22/28	3.25	14,900	15,234	269,117	2028/11/22	
CGB 3.27% 11/19/30	3.27	22,000	22,605	399,306	2030/11/19	
CGB 3.28% 12/03/27	3.28	20,000	20,532	362,691	2027/12/3	
CGB 3.29% 05/23/29	3.29	26,000	26,699	471,636	2029/5/23	
CGB 3.29% 10/18/23	3.29	16,000	16,263	287,284	2023/10/18	
CGB 3.72% 04/12/51	3.72	7,300	7,693	135,910	2051/4/12	
CGB 3.81% 09/14/50	3.81	22,700	24,172	426,991	2050/9/14	
小計				7,954,119		
合計				76,870,033		

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 76,870,033	% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,112,266	3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	79,982,299	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(78,636,187千円)の投資信託財産総額(79,982,299千円)に対する比率は98.3%です。

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

1米ドル=112.86円	1メキシコペソ=5.5529円	1ブラジルレアル=20.5709円
1チリペソ=0.142432円	1コロンビアペソ=0.029149円	1ペルーヌエボソル=28.1042円
1ウルグアイペソ=2.5927円	1ドミニカペソ=1.9947円	1トルコリラ=11.5981円
1チェココルナ=5.1812円	1ハンガリーフォリント=0.362644円	1ポーランドズロチ=28.4806円
1ロシアルーブル=1.60円	1マレーシアリンギット=27.1906円	1タイバーツ=3.44円
1フィリピンペソ=2.2521円	1インドネシアルピア=0.008円	1南アフリカランド=7.49円
1香港・オフショア人民元=17.6645円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年11月10日現在
(A) 資 産	79,982,299,898円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,806,182,607
公 社 債 (評価額)	76,870,033,652
未 収 利 息	1,162,577,426
前 払 費 用	143,506,213
(B) 負 債	850,342,340
未 払 金	799,248,799
未 払 解 約 金	51,092,326
未 払 利 息	1,215
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	79,131,957,558
元 本	44,796,605,697
次 期 繰 越 損 益 金	34,335,351,861
(D) 受 益 権 総 口 数	44,796,605,697口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,665円

■損益の状況

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

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は36,424,298,034円、期中追加設定元本額は10,248,651,738円、期中一部解約元本額は1,876,344,075円です。
 ※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

お知らせ

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2021年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT 先物 比率	投信証 託証券 組入比率	純資 産額
	円	%	円	%			
第10期(2017年11月10日)	14,567	△4.7	14,447	△4.7	2.0	98.0	百万円 82,590
第11期(2018年11月12日)	16,899	16.0	16,737	15.9	2.5	97.5	103,475
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441
第13期(2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598
第14期(2021年11月10日)	21,895	24.8	21,683	24.7	3.8	96.1	111,120

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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

(注1)騰落率は期首比です。

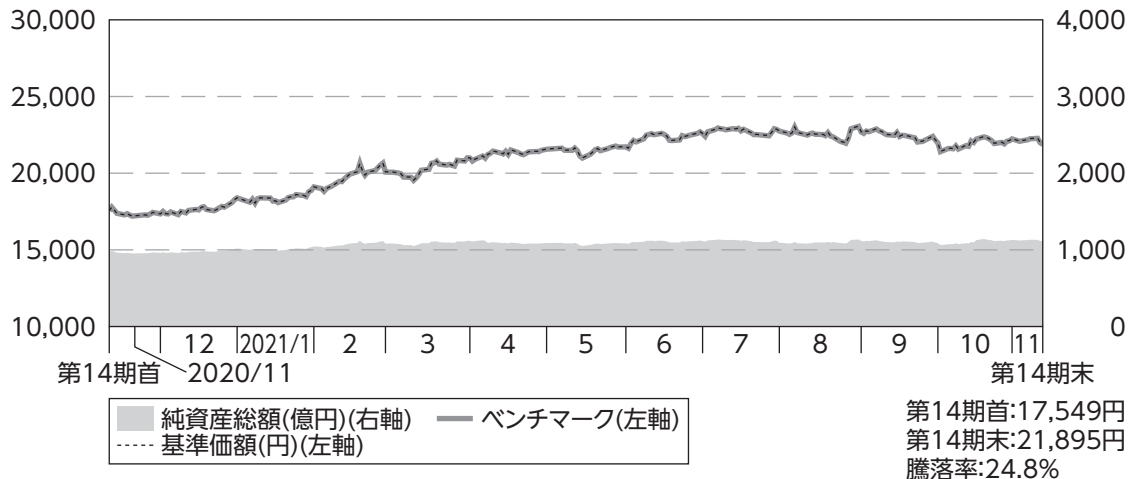
(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証REIT指数(配当込み)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

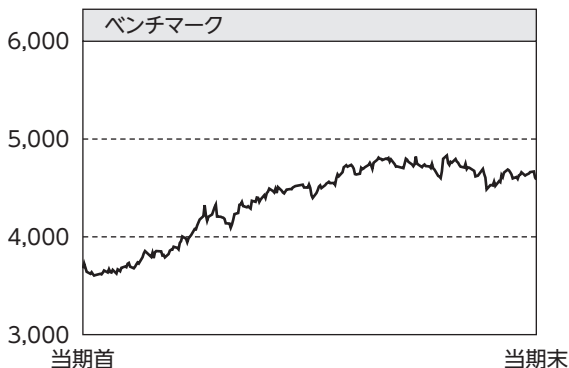


(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



J-REIT市場は上昇しました。

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

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

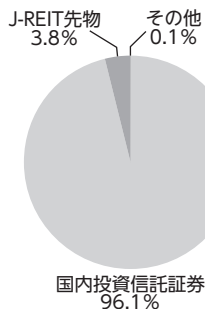
○上位10銘柄

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

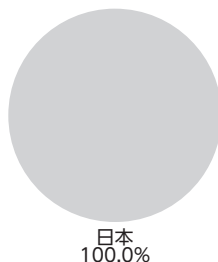
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	大和ハウスリート投資法人	日本	4.2%
8	東証REIT指数先物 2112	日本	3.8%
9	オリックス不動産投資法人	日本	3.1%
10	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数			62

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

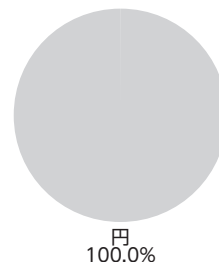
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

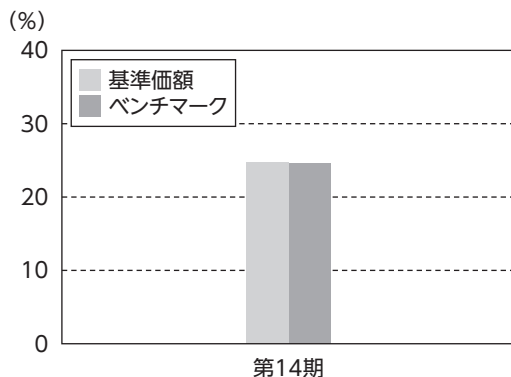


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドの基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(20,961円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当		期	
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	エスコンジャパンリート投資法人	490 (116)	68,287 (16,852)	390	51,955
	エスコンジャパンリート投資法人	116 (△116)	16,852 (△16,852)	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人	727 (319)	89,379 (38,703)	578	68,070
	サンケイリアルエステート投資法人	319 (△319)	38,703 (△38,703)	—	—
	S O S i L A物流リート投資法人	2,123 (145)	344,054 (17,139)	599	88,378
	S O S i L A物流リート投資法人	145 (△145)	17,139 (△17,139)	—	—
	東海道リート投資法人	750	81,539	24	2,583
	日本アコモデーションファンド投資法人	623	382,981	791	497,944
	MCUBS MidCity投資法人	412 (△12,345)	38,471 (△1,043,176)	738	69,006
	森ヒルズリート投資法人	1,696	259,775	2,715	415,444
	産業ファンド投資法人	2,049	415,855	3,232	634,058
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,653	588,393	2,013	688,326
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,322	277,069	1,605	337,947
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,016	465,011	1,154	541,709
	G L P投資法人	8,000	1,408,720	7,079	1,270,889
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	739 (27)	242,106 (7,630)	1,018	337,692
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	27 (△27)	7,630 (△7,630)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	2,914	1,038,362	3,568	1,243,226
	星野リゾート・リート投資法人	221	145,403	335	209,113
	O n eリート投資法人	398	118,068	367	110,260
	イオンリート投資法人	2,818	426,285	2,175	319,474
	ヒューリックリート投資法人	2,238	394,478	1,734	295,563
	日本リート投資法人	456	190,554	895	377,875
	インバスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6,548	128,413	73,076	1,611,711
	積水ハウス・リート投資法人	4,747 (359)	421,506 (31,439)	6,794	599,125
	積水ハウス・リート投資法人	359 (△359)	31,439 (△31,439)	—	—
内	トーセイ・リート投資法人	309	40,877	620	82,748
	ケネディクス商業リート投資法人	847	236,009	871	238,064
	ヘルスケア&メディカル投資法人	307	44,838	495	69,859

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	サムティ・レジデンシャル投資法人	476 (71)	57,674 (8,851)	392	45,537
	サムティ・レジデンシャル投資法人	71 (△71)	8,851 (△8,851)	—	—
	野村不動産マスターファンド投資法人	4,672	769,622	7,511	1,244,453
	いちごホテルリート投資法人	244	21,081	485	41,543
	ラサールロジポート投資法人	2,602	470,899	2,540	443,612
	スターアジア不動産投資法人	2,071	117,187	2,917	165,216
	マリモ地方創生リート投資法人	144	18,249	226	28,476
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	648	380,574	739	408,514
	大江戸温泉リート投資法人	236	18,629	377	29,944
	投資法人みらい	1,916	99,270	2,296	110,737
	森トラスト・ホテルリート投資法人	439	58,805	458	59,969
	三菱地所物流リート投資法人	620	275,763	541	244,319
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,500	279,599	655	116,530
	ザイマックス・リート投資法人	211	23,754	422	48,583
	タカラレーベン不動産投資法人	834 (443)	94,569 (49,800)	652	71,788
	タカラレーベン不動産投資法人	443 (△443)	49,800 (△49,800)	—	—
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,305	181,394	880	126,524
	日本ビルファンド投資法人	1,641	1,128,372	2,554	1,703,266
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,444	954,959	2,321	1,506,924
	日本都市ファンド投資法人	6,188 (31,301)	726,625 (1,043,176)	9,124	1,099,845
	オリックス不動産投資法人	2,880	548,708	4,629	880,248
	日本プライムリアルティ投資法人	1,101	445,410	1,319	522,663
	NTT都市開発リート投資法人	1,723 (95)	257,285 (14,252)	2,087	314,361
	NTT都市開発リート投資法人	95 (△95)	14,252 (△14,252)	—	—
	東急リアル・エステート投資法人	970	178,762	1,559	285,975
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,002	117,516	1,612	191,841
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,727	557,600	4,537	676,625
森トラスト総合リート投資法人	1,031	152,239	1,658	247,738	
インヴェンシブル投資法人	7,280	301,449	8,864	357,715	
フロンティア不動産投資法人	611 (61)	294,723 (31,063)	785	367,828	
フロンティア不動産投資法人	61 (△61)	31,063 (△31,063)	—	—	
内	平和不動産リート投資法人	1,122 (101)	176,563 (16,268)	1,437	222,533
	平和不動産リート投資法人	101 (△101)	16,268 (△16,268)	—	—

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	REIT先物取引	百万円 14,909	百万円 14,750	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 0.127193	百万円 0.127193	% 100.0	百万円 0.127193	百万円 0.127193	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	697,612	3,744	0.5	695,925	3,744	0.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

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

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

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

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

①資産運用会社

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

②一般事務受託会社

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

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	106,812,580	95.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,728,870	4.2
投 資 信 託 財 産 総 額	111,541,450	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は55,613,724,754円、期中追加設定元本額は7,731,734,385円、期中一部解約元本額は12,593,099,371円です。
 ※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	23,397,493,075円
SMT J-REITインデックス・オープン	15,835,438,347円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,886,625,627円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,657,099,646円
分散投資コア戦略ファンドS	1,541,414,897円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,286,420,154円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	878,687,418円
コア投資戦略ファンド(切替型)	778,199,200円
分散投資コア戦略ファンドA	720,122,850円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	665,888,004円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	488,222,662円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	416,146,403円
J-REIT パッシブ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	302,498,187円
J-REIT パッシブ・ファンド2018-11(適各機関投資家専用)	265,797,294円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	255,743,577円
グローバル経済コア	239,663,056円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	53,619,238円
SMT インデックスバランス・オープン	27,092,933円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	19,776,133円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	13,158,340円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,513,012円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,840,543円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,899,172円

お知らせ

該当事項はありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日 2021年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

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

当期中の基準価額と市況の推移

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

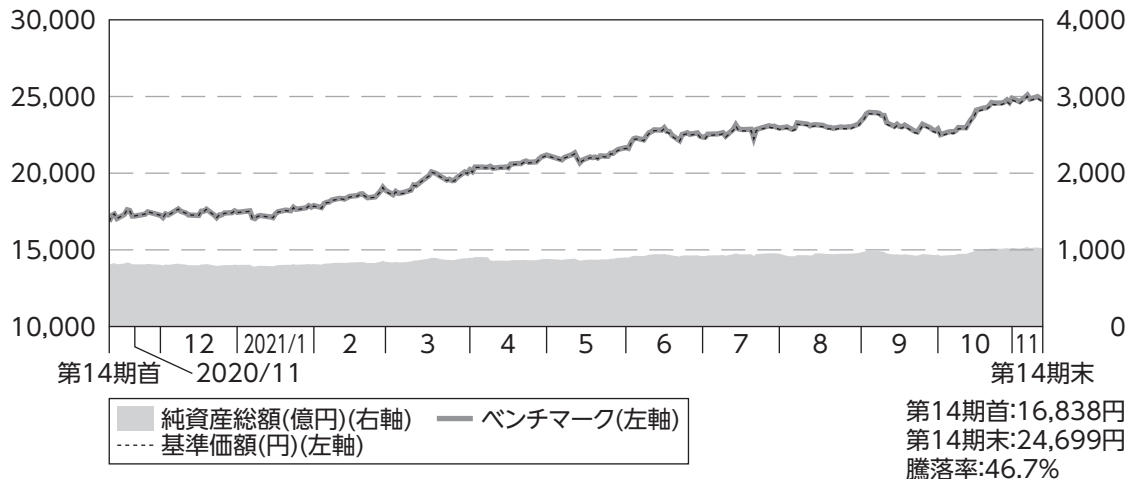
(注) 騰落率は期首比です。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

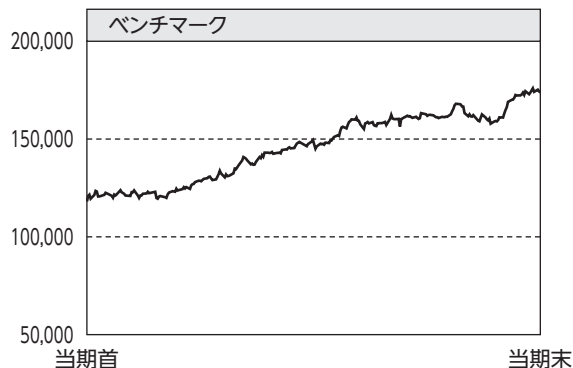


(注)ベンチマークは、2020年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

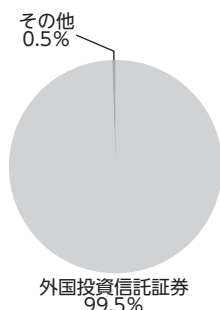
○上位10銘柄

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

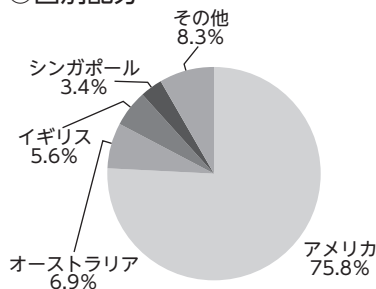
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	WELLTOWER INC	アメリカ	2.2%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.1%
9	GOODMAN GROUP	オーストラリア	1.8%
10	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	アメリカ	1.8%
組入銘柄数		329	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

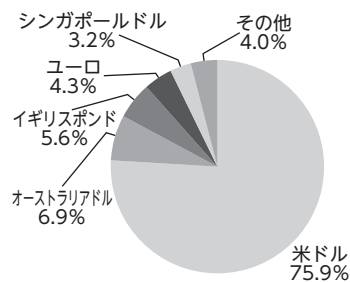
○資産別配分



○国別配分



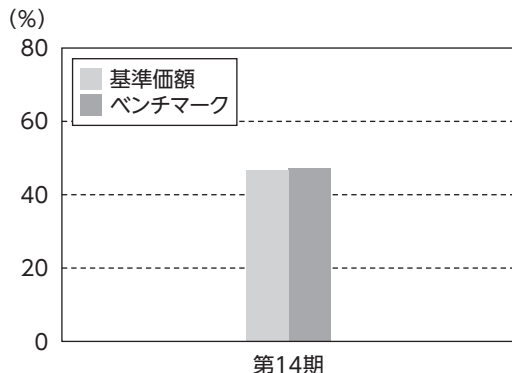
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2020年11月11日~2021年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.006%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(1)	(0.006)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(b) 有価証券取引税	1	0.005	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(1)	(0.005)	
(c) その他費用	8	0.037	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(8)	(0.037)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	10	0.048	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(20,860円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,885	2,946	14,308	2,591
ALEXANDER' S INC	—	—	300	88
BOSTON PROPERTIES	5,927	686	17,890	1,901
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	9,814	326	19,304	727
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,645 (△516)	112 (678)	31,000	211
AGREE REALTY CORP	6,136	418	2,200	151
SL GREEN REALTY CORP	4,920 (15)	369 (75)	13,515	955
EPR PROPERTIES	—	—	5,970	262
PROLOGIS INC	34,940	4,346	100,763	11,419
AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,174	1,361	19,885	3,838
LEXINGTON CORP PROPERTIES	—	—	21,500	245
CAMDEN PROPERTY TRUST	6,326	903	12,720	1,520
MACK-CALI REALTY CORP	—	—	19,100	284
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,439	305	20,026	896
COUSINS PROPERTIES INC	6,683	256	18,475	670
URSTADT BIDDLE - CL A	—	—	7,450	102
SITE CENTERS CORP	16,800	239	11,500	160
DUKE REALTY CORP	15,759	794	46,747	2,096
ESSEX PROPERTY TRUST	2,960	902	9,030	2,534
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	17,460	1,393	47,485	3,434
FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,700	329	7,078	751
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,365	290	14,274	700
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	21,526	725	70,204	2,278
EQUITY COMMONWEALTH	—	—	9,067	257
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,300	100	8,719	263
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,800	129	10,680	466
SERVICE PROPERTIES TRUST	—	—	9,575	122
WELLTOWER INC	21,874	1,786	57,597	4,279

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

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

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

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

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

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

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ベルギー				
BEFIMMO S. C. A.	—	—	2,100	73
COFINIMMO	2,568	336	3,818	494
RETAIL ESTATES	—	—	1,200	71
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	—	—	3,200	71
WAREHOUSES DE PAUW SCA	4,996	182	10,544	316
MONTEA NV	—	—	1,600	160
AEDIFICA	2,270	264	3,611	375
XIOR STUDENT HOUSING NV-RTS	— (8,700)	— (5)	— (8,700)	— (5)
XIOR STUDENT HOUSING NV	— (1,740)	— (79)	— (—)	— (5)
小 計	9,834 (10,440)	782 (85)	26,073 (8,700)	1,564 (11)
アイルランド				
HIBERNIA REIT PLC	—	—	117,000	142
小 計	—	—	117,000	142
その他				
CROMWELL REIT EUR	— (△640,000)	— (—)	110,000	55
小 計	— (△640,000)	— (—)	110,000	55
ユ ー ロ 計	94,204 (△628,467)	2,589 (△189)	476,467 (8,700)	7,442 (11)
イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	58,000	301	124,182	629
DERWENT LONDON PLC	3,300	124	11,059	363
BIG YELLOW GROUP PLC	18,400	256	22,500	279
HAMMERSON PLC	201,164	70	446,484	117
WORKSPACE GROUP PLC	—	—	7,700	64
UNITE GROUP PLC	9,000	109	49,110	531
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	—	—	111,649	166
SHAFTESBURY PLC	50,400	286	53,500	320
SEGRO PLC	54,600	659	146,806	1,505
LAND SECURITIES GROUP PLC	43,200	310	109,248	751
ASSURA PLC	—	—	240,000	176

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	23,800	175	51,600	369
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	98,000	77	160,000	123
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	—	—	19,500	154
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	—	—	70,000	153
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	—	—	60,000	44
	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	—	—	75,000	116
	GCP STUDENT LIVING PLC	25,000	53	67,000	120
	RDI REIT PLC	—	—	154,400	187
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	—	50,000	58
	PRS REIT PLC/THE	255,000	281	—	—
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	—	—	70,000	75
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	90,000	103	55,000	58
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	134,000	289	284,954	555
	CUSTODIAN REIT PLC	—	—	58,000	53
	HOME REIT PLC	132,934	148	—	—
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	—	—	70,000	60
	LXI REIT PLC	112,008	161	51,000	66
	REGIONAL REIT LTD	—	—	70,000	54
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	—	—	42,000	46
	小 計	1,308,806	3,408	2,730,692	7,205
	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
	BWP TRUST	56,500	237	122,500	515
	MIRVAC GROUP	131,210	390	447,984	1,169
	CROMWELL PROPERTY GROUP	—	—	360,000	308
	CHARTER HALL RETAIL REIT	—	—	28,000	103
	GPT GROUP	109,440	523	265,502	1,234
	CENTURIA CAPITAL GROUP	90,300	269	38,000	104
	ABACUS PROPERTY GROUP	(40,123)	(116)	—	—
	STOCKLAND	111,890	497	315,858	1,412
	DEXUS	48,360	507	148,872	1,476
	GOODMAN GROUP	67,650	1,496	197,025	3,849
	VICINITY CENTERS	107,770	170	386,477	617
	CHARTER HALL GROUP	11,700	193	48,025	666
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	—	—	32,000	103

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	—	—	45,800	232
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	—	—	104,000	252
	ARENA REIT	—	—	40,000	114
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	35,000	125	18,394	62
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	135,105 (25,369)	667 (117)	134,274	659
	DEXUS INDUSTRIA REIT	38,000	132	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	— (55,000)	— (110)	80,000	149
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	—	—	32,000	101
	HOME CONSORTIUM	16,500	122	— (—)	— (50)
	RURAL FUNDS GROUP	— (25,329)	— (62)	47,000	124
	IRONGATE GROUP	—	—	68,000	101
	SCENTRE GROUP	269,370	734	695,772	1,936
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	—	—	52,900	158
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	223,142 (45,500)	295 (50)	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	— (20,000)	— (50)	28,055	59
	AVENTUS GROUP	40,000	132	36,500	104
	WAYPOINT REIT LTD	— (△25,697)	— (△70)	80,000	197
	小 計	1,491,937 (185,624)	6,497 (436)	3,852,938 (—)	15,817 (50)
	ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
	AMP NZ OFFICE LTD	— (32,894)	— (50)	—	—
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	—	—	16,111	47
	GOODMAN PROPERTY TRUST	—	—	80,000	179
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	—	—	240,000	303
	ARGOSY PROPERTY LTD	—	—	60,000	92
	小 計	— (32,894)	— (50)	396,111	623
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	93,000	6,687	267,400	19,035

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	PROSPERITY REIT	—	—	200,000	476
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	—	—	150,000	581
	CHAMPION REIT	—	—	165,000	730
	FORTUNE REIT	—	—	226,000	1,690
	小 計	93,000	6,687	1,008,400	22,515
	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	510,000	1,054	634,800	1,350
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	315,200 (66,318)	963 (132)	326,600	1,002
	SUNTEC REIT	—	—	202,000	310
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	168,400 (—)	345 (△22)	247,500	502
	STARHILL GLOBAL REIT	—	—	250,000	110
	ASCOTT TRUST	— (—)	— (△12)	125,000	131
	KEPPEL REIT	190,000	218	285,000	327
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	276,100	682	303,000	708
	ESR REIT	— (44,930)	— (17)	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	— (—)	— (△6)	—	—
	CAPITALAND CHINA TRUST	92,800 (26,192)	129 (21)	79,000	103
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	— (—)	— (△17)	—	—
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	— (—)	— (△4)	100,000	118
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	22,500 (—)	107 (△5)	55,000	233
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	— (1,526,400)	— (88)	2,480,400	126
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	165,800 (46,103)	473 (120)	175,000	498
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	150,000 (—)	314 (△6)	358,700	752
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	140,000 (53,977)	121 (28)	150,000	107
	SABANA SHARIAH COMP IND REI	—	—	478,540	205

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

利害関係人^{*}との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	7,791	—	—	19,995	16	0.1
金 銭 信 託	0.000955	0.000955	100.0	0.000955	0.000955	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	36,595	184	0.5	36,443	184	0.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

< 外国投資信託受益証券、投資証券 >

銘 柄	当期首(前期末)		当 期		末	比 率 (%)
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)				千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	75,111	76,688	15,870	1,791,153	1.8	
ALEXANDER'S INC	1,490	1,190	328	37,105	0.0	
BOSTON PROPERTIES	91,098	79,135	9,299	1,049,502	1.0	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	144,943	135,453	3,857	435,380	0.4	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	94,622	79,751	640	72,275	0.1	
AGREE REALTY CORP	34,169	38,105	2,658	300,047	0.3	
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	101	11,449	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	46,455	37,875	2,903	327,645	0.3	
EPR PROPERTIES	47,882	41,912	2,184	246,584	0.2	
PROLOGIS INC	476,036	410,213	60,896	6,872,736	6.7	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	90,976	77,265	18,553	2,093,964	2.1	
LEXINGTON CORP PROPERTIES	174,408	152,908	2,267	255,924	0.3	
CAMDEN PROPERTY TRUST	62,413	56,019	9,128	1,030,219	1.0	
MACK-CALI REALTY CORP	61,336	42,236	815	91,998	0.1	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	111,205	97,618	4,476	505,247	0.5	
COUSINS PROPERTIES INC	94,418	82,626	3,293	371,701	0.4	
URSTADT BIDDLE - CL A	22,500	15,050	315	35,584	0.0	
SITE CENTERS CORP	94,320	99,620	1,670	188,547	0.2	
DUKE REALTY CORP	239,972	208,984	11,838	1,336,143	1.3	
ESSEX PROPERTY TRUST	42,232	36,162	12,318	1,390,234	1.4	
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	220,306	190,281	16,299	1,839,558	1.8	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	43,928	39,550	5,069	572,190	0.6	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	80,762	71,853	4,332	488,992	0.5	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	348,571	299,893	10,190	1,150,084	1.1	
EQUITY COMMONWEALTH	76,912	67,845	1,757	198,315	0.2	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	87,029	81,610	2,609	294,459	0.3	

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

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	65,752	57,872	2,707	305,605	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	103,744	94,169	1,105	124,771	0.1
WELLTOWER INC	269,631	233,908	19,973	2,254,198	2.2
EASTGROUP PROPERTIES, INC	25,236	22,299	4,421	498,979	0.5
KIMCO REALTY CORP	277,299	339,870	7,901	891,817	0.9
KILROY REALTY CORPORATION	67,166	58,949	4,220	476,353	0.5
LTC PROPERTIES INC	26,976	20,624	698	78,859	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	142,800	132,800	468	52,906	0.1
MONMOUTH REIT -CL A	62,052	54,952	1,156	130,487	0.1
BRANDYWINE REALTY TRUST	105,620	93,620	1,306	147,500	0.1
IRON MOUNTAIN INC	184,472	160,382	7,630	861,231	0.8
MACERICH CO/THE	67,797	118,542	2,543	287,105	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	108,782	94,155	7,953	897,606	0.9
ACADIA REALTY TRUST	53,940	46,940	1,053	118,932	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	451,304	401,344	7,356	830,269	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	73,128	64,502	13,064	1,474,502	1.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	21,650	21,650	253	28,636	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	28,244	25,030	1,407	158,843	0.2
CENTERSPACE	8,899	7,499	756	85,353	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	13,199	8,599	292	32,986	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	—	35,000	56	6,399	0.0
GETTY REALTY CORP	21,985	21,985	719	81,210	0.1
PS BUSINESS PARKS INC	12,689	11,172	1,974	222,808	0.2
RPT REALTY	58,950	43,950	610	68,847	0.1
REALTY INCOME CORP	221,064	307,228	21,800	2,460,449	2.4
REGENCY CENTERS CORP	100,891	84,860	6,254	705,846	0.7
UDR INC	189,351	153,803	8,493	958,520	0.9
CORPORATE OFFICE PPTYS	74,559	63,159	1,784	201,369	0.2
CORECIVIC INC	84,463	—	—	—	—
SAUL CENTERS INC	8,800	6,800	350	39,508	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	195,908	182,102	30,500	3,442,259	3.4
LIFE STORAGE INC	29,766	44,161	5,780	652,357	0.6
PUBLIC STORAGE	98,128	84,460	27,449	3,097,950	3.0
SUN COMMUNITIES INC	63,122	64,445	12,486	1,409,194	1.4
TAUBMAN CENTERS INC	40,750	—	—	—	—
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	69,270	57,370	1,157	130,661	0.1
UMH PROPERTIES INC	27,000	25,320	601	67,868	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	25,650	20,150	456	51,554	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	8,473	6,973	415	46,942	0.0
VENTAS INC	239,651	218,755	11,554	1,304,056	1.3
VORNADO REALTY TRUST	100,291	90,208	4,082	460,786	0.5
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	56,070	45,570	1,179	133,153	0.1
GEO GROUP INC/THE	76,306	64,306	601	67,858	0.1
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	77,345	—	—	—	—
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	88,380	76,794	4,151	468,536	0.5
KITE REALTY GROUP TRUST	61,020	118,586	2,557	288,684	0.3
EXTRA SPACE STORAGE INC	83,586	73,984	14,627	1,650,845	1.6
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	78,973	57,973	322	36,443	0.0

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	147,497	124,047	1,591	179,619	0.2
CUBESMART	123,373	111,990	6,057	683,653	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	173,526	156,521	24,597	2,776,048	2.7
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	125,540	114,240	1,182	133,443	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	338,528	334,846	7,132	804,942	0.8
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	108,820	97,197	3,489	393,810	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	79,115	69,259	1,258	142,027	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	81,079	67,924	1,281	144,578	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	76,470	63,470	651	73,566	0.1
TERRENO REALTY CORP	43,364	38,649	2,921	329,717	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,595	30,057	1,190	134,366	0.1
RLJ LODGING TRUST	112,691	92,291	1,394	157,385	0.2
AMERICOLD REALTY TRUST	130,640	143,840	4,208	475,000	0.5
CORESITE REALTY CORP	27,185	24,830	3,995	450,892	0.4
VEREIT INC	688,743	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	89,335	71,613	1,813	204,723	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	31,830	27,830	757	85,495	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	29,639	29,639	424	47,901	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,360	341	38,524	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	136,456	127,744	1,866	210,635	0.2
WHITESTONE REIT	38,340	19,090	185	20,898	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	96,900	84,730	2,251	254,079	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	97,831	91,978	3,895	439,619	0.4
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	145,774	—	—	—	—
CYRUSONE INC	75,076	68,096	5,541	625,430	0.6
WP CAREY INC	111,658	103,444	7,941	896,265	0.9
ALEXANDER & BALDWIN INC	47,000	41,570	1,055	119,166	0.1
GLADSTONE LAND CORP	11,500	15,500	386	43,610	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	138,931	121,604	4,087	461,271	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	35,566	30,696	2,806	316,710	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	38,000	30,500	464	52,459	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	65,819	66,382	3,238	365,453	0.4
PHYSICIANS REALTY TRUST	131,899	118,562	2,193	247,546	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	79,195	76,595	5,298	598,027	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	170,668	152,152	6,131	692,026	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	65,538	58,331	1,435	162,013	0.2
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,638	13,398	3,762	424,597	0.4
JBG SMITH PROPERTIES	71,542	65,943	1,978	223,344	0.2
AMERICAN FINANCE TRUST INC	67,590	59,590	514	58,106	0.1
RETAIL VALUE	8,969	9,529	59	6,689	0.0
INVITATION HOMES INC	360,577	320,490	12,989	1,465,990	1.4
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	30,230	—	—	—	—
QTS REALTY TRUST INC	38,937	—	—	—	—
COREPOINT LODGING INC	22,000	22,000	342	38,634	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	470,000	376	42,435	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	90,335	81,118	847	95,669	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	15,900	15,900	442	49,922	0.0
SAFEHOLD INC	9,940	8,340	620	70,019	0.1

銘 柄	当 期 首 (前 期 末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	63,742	68,320	2,003	226,074	0.2	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	43,270	38,922	1,003	113,200	0.1	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	73,383	66,258	1,268	143,201	0.1	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	132,903	124,303	6,038	681,520	0.7	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	188,767	164,985	4,071	459,546	0.5	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	28,700	156	17,717	0.0	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	35,200	—	—	—	—	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	40	4,561	0.0	
PRIME US REIT	295,000	295,000	246	27,800	0.0	
POSTAL REALTY TRUST INC- A	—	7,000	141	15,934	0.0	
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	—	5,700	108	12,190	0.0	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	6,500	13,000	106	12,001	0.0	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	14,850	14,850	207	23,446	0.0	
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	12,200	148	16,743	0.0	
CITY OFFICE REIT INC	37,050	25,050	471	53,263	0.1	
NETSTREIT CORP	—	20,992	500	56,528	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	17,000	242	27,397	0.0	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	90,250	—	—	—	—	
CARETRUST REIT INC	65,477	52,477	1,108	125,143	0.1	
INDUS REALTY TRUST INC	—	2,340	173	19,579	0.0	
APARTMENT INCOME REIT CO	—	87,139	4,647	524,572	0.5	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	—	86,966	2,265	255,680	0.3	
CTO REALTY GROWTH INC	—	2,800	155	17,503	0.0	
CEDAR REALTY TRUST INC	—	6,800	153	17,375	0.0	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	45,000	—	—	—	—	
STORE CAPITAL CORP	145,678	135,277	4,627	522,296	0.5	
PARAMOUNT GROUP INC	102,726	89,726	834	94,176	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	27,530	33,930	569	64,218	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	76,680	59,850	1,104	124,691	0.1	
EQUINIX INC	57,071	49,977	39,871	4,499,858	4.4	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	53,268	47,668	1,030	116,257	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	69,830	63,030	1,224	138,216	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	15,100	12,389	927	104,726	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,124	45,310	2,817	317,969	0.3	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	14,300	12,543	594	67,085	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	138,263	115,391	1,879	212,145	0.2	
GLOBAL NET LEASE INC	58,892	57,012	893	100,826	0.1	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	70	7,991	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	886,564	736,564	522	59,021	0.1	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	155,994	131,413	2,754	310,863	0.3	
VICI PROPERTIES INC	342,155	338,799	9,906	1,118,045	1.1	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	22,900	19,900	312	35,238	0.0	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	44,250	44,044	1,289	145,545	0.1	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	325,506	280,893	2,188	246,955	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	16,356,888	14,155,365	683,603	77,151,546	
	銘 柄 数 < 比 率 >	155	156	—	< 75.6% >	
(カナダ)				千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	48,076	41,476	1,335	121,169	0.1	

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	52,420	45,920	2,794	253,436	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	92,539	81,239	1,371	124,378	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVEST TR	95,631	89,131	2,039	184,966	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	36,942	33,942	1,520	137,887	0.1	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	55,620	47,120	547	49,618	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	13,820	335	30,434	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	11,360	622	56,442	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	40,330	487	44,187	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	32,577	26,577	501	45,510	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	43,490	34,090	628	56,984	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	58,170	60,470	819	74,316	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	12,890	247	22,435	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	8,700	83	7,583	0.0	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	42,950	58,250	1,001	90,872	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	—	20,000	83	7,528	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	47,000	47,000	1,090	98,899	0.1	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,620	18,705	1,884	170,909	0.2	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	25,800	192	17,503	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	108,670	86,170	1,322	119,969	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	15,100	11,100	255	23,135	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	27,730	509	46,202	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	25,000	25,000	114	10,339	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	—	23,900	108	9,841	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	74,815	57,505	1,097	99,515	0.1	
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	23,500	—	—	—	—	
SLATE GROCERY REIT	10,300	10,300	137	12,481	0.0	
NEXUS REAL ESTATE INVESTMENT	—	9,000	117	10,685	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	17,000	88	8,064	0.0	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	12,000	163	14,813	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	35,850	29,850	686	62,270	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,089,400	1,026,375	22,187	2,012,385	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	30	—	< 2.0% >	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	45,000	37,000	371	48,649	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	110,000	99,700	1,941	253,961	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	155,000	136,700	2,313	302,610	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.3% >	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	137	17,926	0.0	
COIMA RES SPA	—	11,900	87	11,427	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	33,790	45,690	224	29,353	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 0.0% >	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	19,880	18,140	1,244	162,805	0.2	
ALTAREA	2,730	1,880	352	46,092	0.0	
KLEPIERRE	130,130	107,485	2,382	311,760	0.3	
GECINA SA	34,685	30,292	3,713	485,876	0.5	
COVIVIO (FP)	30,792	26,753	2,021	264,537	0.3	

銘柄	当期首(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)		
MERCIALYS	26,000	28,000	269	35,277	0.0	
CARMILA	30,000	25,000	352	46,117	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	88,146	65,171	4,505	589,424	0.6	
小 計	口 数 ・ 金 額	362,363	302,721	14,842	1,941,891	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 1.9% >	
(オランダ)			千ユーロ			
EUROCOMMERCIAL	19,690	—	—	—	—	
VASTNED RETAIL	13,750	10,650	265	34,763	0.0	
WERELDHAVE NV	28,770	22,670	321	42,027	0.0	
NSI NV	12,300	10,050	357	46,742	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	—	20,783	432	56,569	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	74,510	64,153	1,376	180,103	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.2% >	
(スペイン)			千ユーロ			
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	161,062	143,462	1,229	160,851	0.2	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	54,000	34,000	184	24,153	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	211,418	187,486	1,810	236,850	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	426,480	364,948	3,224	421,855	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.4% >	
(ベルギー)			千ユーロ			
BEFIMMO S. C. A.	16,110	14,010	498	65,160	0.1	
COFINIMMO	17,017	15,767	2,232	292,091	0.3	
RETAIL ESTATES	7,600	6,400	449	58,863	0.1	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	15,300	12,100	326	42,742	0.0	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	83,470	77,922	3,132	409,820	0.4	
MONTEA NV	6,900	5,300	682	89,309	0.1	
AEDIFICA	21,260	19,919	2,302	301,253	0.3	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	15,000	408	53,476	0.1	
XIOR STUDENT HOUSING NV	8,700	10,440	537	70,342	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	191,357	176,858	10,571	1,383,060	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 1.4% >	
(アイルランド)			千ユーロ			
HIBERNIA REIT PLC	482,550	365,550	469	61,407	0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	260,000	260,000	426	55,785	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	742,550	625,550	895	117,193	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(その他)			千ユーロ			
CROMWELL REIT EUR	910,000	160,000	411	53,797	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	910,000	160,000	411	53,797	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.1% >	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	2,896,050	1,876,620	33,859	4,429,865	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 4.3% >	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	594,850	528,668	2,675	409,203	0.4	
DERWENT LONDON PLC	70,541	62,782	2,154	329,505	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	101,146	97,046	1,460	223,419	0.2	
HAMMERSON PLC	2,536,320	2,291,000	775	118,628	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	78,047	70,347	577	88,401	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,418	0.0
UNITE GROUP PLC	260,682	220,572	2,442	373,680	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	840,537	728,888	1,121	171,595	0.2
SHAFESBURY PLC	160,293	157,193	1,014	155,215	0.2
SEGRO PLC	761,570	669,364	8,865	1,356,190	1.3
LAND SECURITIES GROUP PLC	477,505	411,457	2,867	438,695	0.4
ASSURA PLC	1,707,040	1,467,040	1,071	163,933	0.2
STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	260,756	195	29,836	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	169,580	141,780	1,063	162,660	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	350,000	176	26,930	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD	330,000	330,000	320	49,066	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	552,000	490,000	380	58,165	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	135,537	116,037	1,431	219,037	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	567,660	497,660	1,341	205,238	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	495,000	435,000	432	66,142	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	545,297	470,297	799	122,300	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC	300,000	258,000	543	83,076	0.1
RDI REIT PLC	154,400	—	—	—	—
NEWRIVER REIT PL	186,000	186,000	140	21,538	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	380,067	330,067	309	47,359	0.0
PRS REIT PLC/THE	—	255,000	257	39,397	0.0
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	273,286	203,286	198	30,319	0.0
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	431,000	466,000	552	84,471	0.1
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,092,658	941,704	2,143	327,863	0.3
CUSTODIAN REIT PLC	292,276	234,276	230	35,335	0.0
HOME REIT PLC	—	132,934	152	23,283	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	376,000	306,000	272	41,613	0.0
AEW UK REIT PLC	118,000	118,000	129	19,747	0.0
LXI REIT PLC	330,000	391,008	561	85,890	0.1
REGIONAL REIT LTD	292,000	222,000	197	30,223	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	177,355	211	32,338	0.0
小 計	15,961,363	14,539,477	37,077	5,671,724	
銘 柄 数<比 率>	34	35	—	<5.6%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BWP TRUST	328,160	262,160	1,090	90,747	0.1
MIRVAC GROUP	2,507,500	2,190,726	6,265	521,350	0.5
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,222,633	862,633	720	59,936	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	324,160	296,160	1,255	104,488	0.1
GPT GROUP	1,237,517	1,081,455	5,569	463,437	0.5
CENTURIA CAPITAL GROUP	304,000	356,300	1,190	99,023	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	192,593	232,716	830	69,130	0.1
STOCKLAND	1,530,344	1,326,376	5,995	498,862	0.5
DEXUS	696,940	596,428	6,691	556,834	0.5
GOODMAN GROUP	1,069,018	939,643	22,128	1,841,320	1.8
VICINITY CENTERS	2,435,040	2,156,333	3,816	317,588	0.3
CHARTER HALL GROUP	295,694	259,369	4,964	413,081	0.4
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	198,760	166,760	703	58,557	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP	202,588	156,788	1,001	83,366	0.1

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	689,060	585,060	1,696	141,180	0.1	
ARENA REIT	241,053	201,053	908	75,617	0.1	
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	285,000	301,606	1,121	93,359	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	294,112	320,312	1,553	129,267	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	75,000	113,000	380	31,687	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	626,340	601,340	1,449	120,590	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	114,885	82,885	290	24,207	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	324,500	324,500	365	30,376	0.0	
HOME CONSORTIUM	91,000	107,500	856	71,292	0.1	
RURAL FUNDS GROUP	212,766	191,095	548	45,635	0.0	
IRONGATE GROUP	340,000	272,000	432	35,986	0.0	
SCENTRE GROUP	3,310,393	2,883,991	9,026	751,127	0.7	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	242,250	189,350	710	59,084	0.1	
HOMECO DAILY NEEDS REIT	—	268,642	397	33,083	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	249,000	240,945	566	47,115	0.0	
AVENTUS GROUP	230,000	233,500	810	67,420	0.1	
WAYPOINT REIT LTD	495,796	390,099	1,080	89,914	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	20,366,102	18,190,725	84,421	7,024,672	
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 6.9% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AMP NZ OFFICE LTD	650,000	682,894	1,092	87,869	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	239,460	223,349	661	53,166	0.1	
GOODMAN PROPERTY TRUST	680,300	600,300	1,440	115,862	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	1,098,490	858,490	978	78,705	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	562,278	502,278	758	60,993	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,230,528	2,867,311	4,931	396,597	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.4% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	1,337,800	1,163,400	80,856	1,171,607	1.1	
PROSPERITY REIT	952,000	752,000	2,271	32,907	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	968,000	818,000	2,756	39,944	0.0	
CHAMPION REIT	1,303,000	1,138,000	4,631	67,112	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	561,000	2,524	36,580	0.0	
FORTUNE REIT	982,000	756,000	6,146	89,059	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	6,103,800	5,188,400	99,186	1,437,211	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.4% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,929,844	2,805,044	6,030	505,324	0.5	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,792,400	1,847,318	5,726	479,839	0.5	
SUNTEC REIT	1,382,700	1,180,700	1,818	152,353	0.1	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,659,800	1,580,700	3,113	260,920	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	1,109,400	859,400	554	46,445	0.0	
ASCOTT TRUST	1,116,877	991,877	1,091	91,420	0.1	
KEPPEL REIT	1,146,400	1,051,400	1,209	101,311	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	661,162	634,262	1,490	124,890	0.1	
ESR REIT	1,404,065	1,448,995	688	57,670	0.1	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	417,200	417,200	529	44,395	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	467,729	507,721	604	50,624	0.0	

銘柄	当期末(前期末)		当期			比率 (%)
	口数 (口)	口数 (口)	評価額		比率	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	538,100	142	11,948	0.0	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	375,000	275,000	382	32,028	0.0	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	258,000	225,500	1,093	91,639	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	954,000	—	—	—	—	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	1,052,060	1,088,963	2,929	245,446	0.2	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	1,450,173	1,241,473	2,644	221,569	0.2	
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	701,000	744,977	666	55,867	0.1	
SABANA SHARIAH COMP IND REI	478,540	—	—	—	—	
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	1,372,100	1,222,100	1,209	101,375	0.1	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	540,000	342	28,731	0.0	
SPH REIT	726,800	576,800	588	49,296	0.0	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	689,516	—	—	—	—	
EC WORLD REIT	180,000	180,000	146	12,291	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	295,800	252	21,191	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,523,644	1,273,644	560	46,956	0.0	
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000	555,000	499	41,853	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	460,000	—	—	—	—	
IREIT GLOBAL	334,420	405,985	263	22,111	0.0	
KEPPEL DC REIT	794,803	709,903	1,668	139,784	0.1	
FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	1,662,696	1,610,096	2,431	203,714	0.2	
小計	口数・金額	29,029,229	24,807,958	38,680	3,241,001	
	銘柄数<比率>	31	27	—	<3.2%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	42,950	211,099	20,223	0.0	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	19,093	19,093	152,171	14,578	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	—	11,253	66,167	6,338	0.0	
LOTTE REIT CO LTD	69,030	72,480	406,612	38,953	0.0	
KORAMCO ENERGY PLUS REIT	—	20,000	135,000	12,933	0.0	
JR REIT XXVII	—	64,338	350,642	33,591	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	—	54,685	355,452	34,052	0.0	
小計	口数・金額	131,073	284,799	1,677,145	160,670	
	銘柄数<比率>	3	7	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD	131,500	103,500	2,157	78,399	0.1	
小計	口数・金額	131,500	103,500	2,157	78,399	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.1%>	
合計	口数・金額	95,295,933	83,040,530	—	101,604,075	
	銘柄数<比率>	322	329	—	<9.5%>	

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

(注2) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

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

(注1) 当期末における外貨建純資産(102,118,960千円)の投資信託財産総額(102,344,732千円)に対する比率は99.8%です。

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

1米ドル=112.86円

1イギリスポンド=152.97円

1香港ドル=14.49円

1イスラエルシェケル=36.33円

1カナダドル=90.70円

1オーストラリアドル=83.21円

1シンガポールドル=83.79円

1ユーロ=130.83円

1ニュージーランドドル=80.42円

1韓国ウォン=0.0958円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2021年11月10日現在
(A) 資 産	102,533,890,848円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	292,607,376
投 資 証 券(評価額)	101,604,075,350
未 収 入 金	526,355,608
未 収 配 当 金	110,852,514
(B) 負 債	415,617,846
未 払 金	189,168,171
未 払 解 約 金	226,449,174
未 払 利 息	501
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	102,118,273,002
元 本	41,344,855,558
次 期 繰 越 損 益 金	60,773,417,444
(D) 受 益 権 総 口 数	41,344,855,558口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,699円

■損益の状況

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

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は47,638,239,657円、期中追加設定元本額は5,806,807,418円、期中一部解約元本額は12,100,191,517円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	18,527,832,170円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	11,900,520,336円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,749,701,772円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,688,304,507円
分散投資コア戦略ファンドS	1,476,522,681円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,332,838,008円
コア投資戦略ファンド(安定型)	773,880,033円
コア投資戦略ファンド(切替型)	707,282,641円
分散投資コア戦略ファンドA	686,275,561円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	395,165,566円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	380,060,218円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	243,042,473円
グローバル経済コア	234,147,354円
SMT インデックスバランス・オープン	148,832,557円
FOFs用世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	120,780,943円
SMTAM海外バランスファンド2020-05(適格機関投資家専用)	117,898,872円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	115,466,049円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	114,483,266円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	113,795,776円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	111,276,286円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	109,554,738円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	102,813,861円
グローバル3資産バランスオープン	65,498,256円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	50,672,643円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	40,337,933円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	13,960,331円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	10,849,517円
SBI資産設計オープン(分配型)	7,003,794円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,057,416円

お知らせ

該当事項はありません。