

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12月19日から無期限です。	
運 用 方 針	主として、下記のマザーファンドの受益証券への投資を通じて、国内外の公社債、株式及び不動産投資信託証券に実質的に分散投資することです。リスクの低減をはかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。	
主要運用対象	SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	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。
	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。
	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。
	J-REITインデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
	グローバルREITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国の取引所に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券ならびに取引所に準ずる市場で取引されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	SBI資産設計オープン（つみたてNISA対応型）	株式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。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65%以下とします。
	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。
	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。
	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。
	J-REITインデックスマザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	グローバルREITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
分 配 方 針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。	

SBI資産設計オープン
(つみたてNISA対応型)
(愛称:スゴ6)

運用報告書(全体版)

第4期（決算日 2021年9月6日）

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			参 考 指 数		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 証 券 組 入 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
設定日 (2017年12月19日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	% —	% —	百万円 0.5
第1期 (2018年 9月 5日)	9,973	0	△0.3	9,949	△0.5	38.9	1.2	37.4	0.2	20.9	41
第2期 (2019年 9月 5日)	10,188	0	2.2	10,150	2.0	37.5	1.1	37.3	0.2	21.5	87
第3期 (2020年 9月 7日)	10,379	0	1.9	10,332	1.8	40.6	1.0	35.6	0.2	18.7	147
第4期 (2021年 9月 6日)	12,585	0	21.3	12,424	20.2	41.3	1.0	32.5	0.2	21.8	222

(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」には「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。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	投 資 信 託 証 券 組 入 率
		騰 落 率		騰 落 率					
(当 期 首) 2020年 9月7日	円 10,379	% —	10,332	% —	% 40.6	% 1.0	% 35.6	% 0.2	% 18.7
9月末	10,323	△0.5	10,267	△0.6	41.0	1.3	36.2	0.2	18.9
10月末	10,083	△2.9	10,036	△2.9	40.5	1.5	36.8	0.2	18.5
11月末	10,729	3.4	10,676	3.3	42.3	1.3	34.8	0.3	18.8
12月末	10,948	5.5	10,890	5.4	42.5	0.9	34.7	0.2	19.2
2021年 1月末	11,058	6.5	10,993	6.4	41.9	1.0	34.4	0.2	19.8
2月末	11,289	8.8	11,231	8.7	42.2	0.9	33.5	0.2	20.5
3月末	11,783	13.5	11,647	12.7	42.2	1.0	32.9	0.3	20.9
4月末	11,918	14.8	11,796	14.2	41.7	1.1	32.7	0.2	21.5
5月末	12,052	16.1	11,932	15.5	41.4	1.2	32.8	0.2	21.6
6月末	12,231	17.8	12,088	17.0	41.1	1.1	32.8	0.4	21.7
7月末	12,276	18.3	12,145	17.6	40.7	1.2	33.2	0.1	21.5
8月末	12,438	19.8	12,291	19.0	41.2	1.0	32.6	0.3	21.8
(当 期 末) 2021年 9月6日	12,585	21.3	12,424	20.2	41.3	1.0	32.5	0.2	21.8

(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」には「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。

参考指数は、NOMURA-BPI総合20%、TOPIX(東証株価指数)20%、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)20%、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)20%、東証REIT指数(配当込み)10%およびS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)10%を当社で独自に合成した指数で、設定日を10,000として指数化しております。

NOMURA-BPI総合

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

TOPIX(東証株価指数)

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。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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。

MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)

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。

東証REIT指数(配当込み)

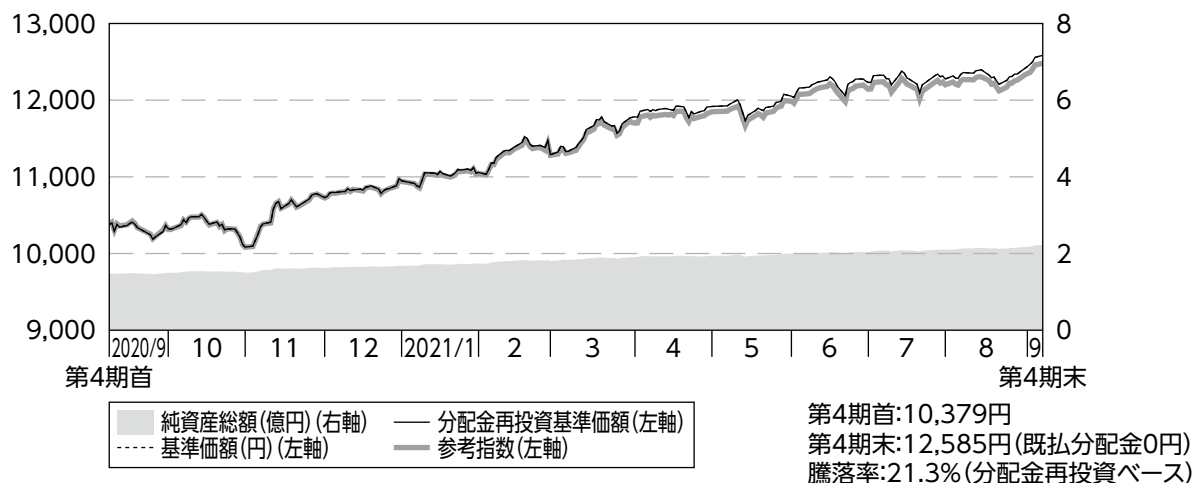
東証REIT指数とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT(不動産投資信託証券)全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出したものです。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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。

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及び参考指数は、2020年9月7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。

新型コロナウイルスの感染再拡大や中国の景気減速懸念などへの警戒感が高まる場面もありましたが、各国の大規模な金融緩和政策や財政出動による下支えと新型コロナウイルスのワクチン接種の進展が好感され、期を通じて見ると基準価額は大きく上昇しました。

組入ファンド	投資資産※	基本組入比率	当季成対象 期間末組入比率	騰落率
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	20.0%	15.1%	0.5%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	20.0%	20.8%	29.6%
外国債券インデックス マザーファンド	外国債券	20.0%	17.8%	2.7%
外国株式インデックス マザーファンド	外国株式	20.0%	21.6%	39.0%
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT	10.0%	10.4%	31.4%
グローバルREITインデックス マザーファンド	海外REIT	10.0%	11.3%	44.1%

※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、同様の表記をすることがあります。

投資環境

国内債券市場

国内債券は小幅に上昇しました。日銀による金融政策の再点検への警戒感から2021年2月頃に国内債券の利回りが一時的に上昇しましたが、日銀が緩和的な金融政策を継続する方針であることが確認され、利回りは低下に転じました。

国内株式市場

国内株式は上昇しました。当期前半は、新型コロナウイルスワクチン開発の進展や各国の追加経済対策に対する期待を背景に上昇しました。当期後半は、緊急事態宣言の長期化に伴う景気の先行き懸念が高まり、上値の重い展開でもみ合いました。

外国債券市場

外国債券は上昇しました。当期前半は、期待インフレ率の上昇や米国の国債増発懸念を受けて利回りが上昇しました。当期後半は、欧米の主要中央銀行が緩和的な姿勢を示したことから、利回りは低下に転じました。

外国株式市場

外国株式は上昇しました。各国の金融政策や財政政策に加え、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支えとなり、上昇基調が続きました。

投資環境

J-REIT市場

国内REITは上昇しました。FTSEグローバル株式指数へのJ-REIT組み入れによる資金流入やREIT関連施設再開への期待を背景に、上昇基調が続きました。

海外REIT市場

先進国REITは上昇しました。新型コロナウイルスワクチン接種の進展に伴い英国などで行動制限が緩和されたことや、REIT関連施設の再開が好材料となり、上昇基調が続きました。

当ファンドのポートフォリオ

○当ファンド

国内外の株式・公社債・REITへ実質的に分散投資することにより、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。

・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。

- ・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。

- ・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不動産投資信託証券(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。

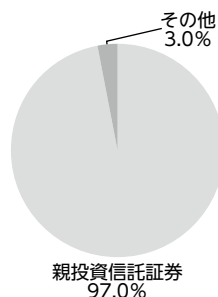
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

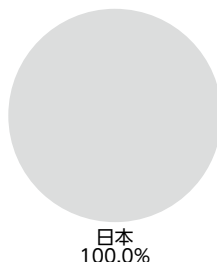
	当期末
	2021年9月6日
外国株式インデックス マザーファンド	21.6%
国内株式インデックス マザーファンド	20.8%
外国債券インデックス マザーファンド	17.8%
国内債券インデックス マザーファンド	15.1%
グローバルREITインデックス マザーファンド	11.3%
J-REITインデックス マザーファンド	10.4%
その他	3.0%
組入ファンド数	6

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

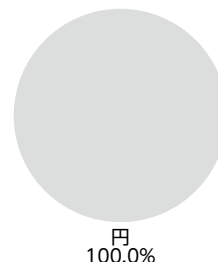
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

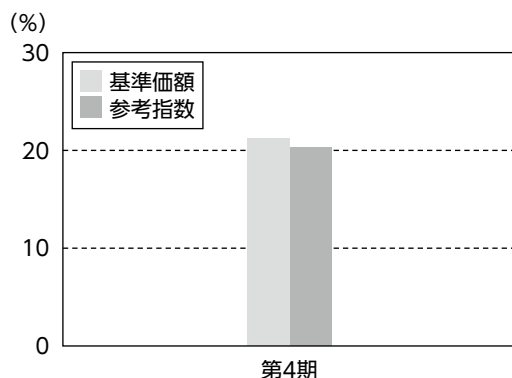


(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額（分配金込み）と参考指数の騰落率の対比です。



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4期
		2020年9月8日～2021年9月6日
当期分配金	(円)	—
(対基準価額比率)	(%)	(—)
当期の収益	(円)	—
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	2,584

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

○当ファンド

主として、下記のマザーファンド受益証券に投資し、国内外の公社債、株式及び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はかりながら、投資信託財産の中長期的な成長を目標に運用を行うことを基本とします。

各マザーファンド受益証券への基本組入比率は国内債券インデックス マザーファンド受益証券20%、国内株式インデックス マザーファンド受益証券20%、外国債券インデックス マザーファンド受益証券20%、外国株式インデックス マザーファンド受益証券20%、J-REITインデックス マザーファンド受益証券10%、グローバルREITインデックス マザーファンド受益証券10%とします。

・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。

・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。

・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。

・J-REITインデックス マザーファンド

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

・グローバルREITインデックス マザーファンド

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

1万口当たりの費用明細

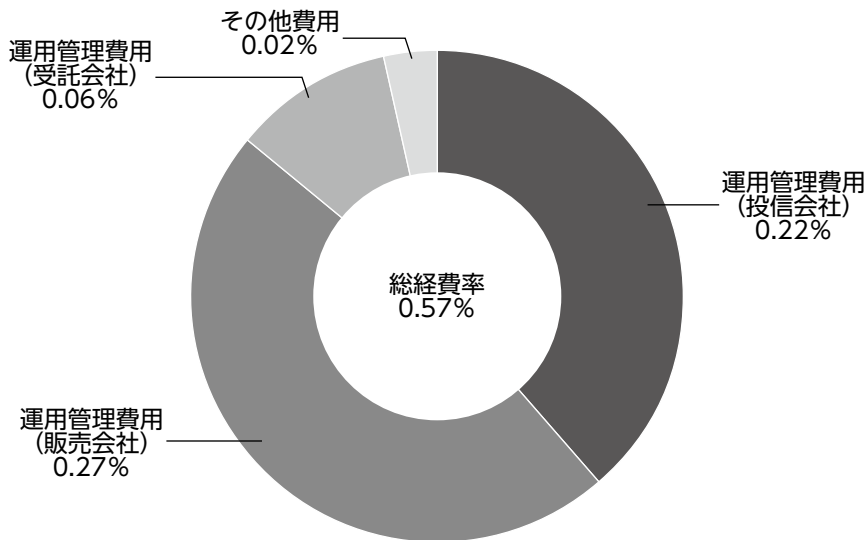
項目	当期		項目の概要
	(2020年9月8日～2021年9月6日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	63円	0.548%	(a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,427円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(25)	(0.219)	
(販売会社)	(31)	(0.274)	
(受託会社)	(6)	(0.055)	
(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)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(－)	(－)	
(オプション証券等)	(－)	(－)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(－)	(－)	
(公社債)	(－)	(－)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(d) その他費用	2	0.020	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(2)	(0.014)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	65	0.571	

- (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0.57%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	2,512	4,926	321	663
グローバルREITインデックス マザーファンド	2,624	4,926	331	663
国内株式インデックス マザーファンド	5,538	9,681	1,770	3,146
外国株式インデックス マザーファンド	2,474	8,154	1,544	5,301
国内債券インデックス マザーファンド	7,352	10,366	800	1,127
外国債券インデックス マザーファンド	3,625	10,940	439	1,327

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

<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	214,205,141千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	416,037,616千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.51

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	84,269,415千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	464,186,488千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.18

(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 0.000223	百万円 0.000223	% 100.0	百万円 0.000223	百万円 0.000223	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,217	7	0.6	1,216	7	0.6

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D C
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	637,627	3,744	0.6	635,989	3,744	0.6

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<グローバルREITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D C
為 替 直 物 取 引	百万円 7,242	百万円 —	% —	百万円 29,134	百万円 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	44,662	184	0.4	44,760	184	0.4

<平均保有割合 0.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 0.159183	百万円 0.159183	% 100.0	百万円 0.159183	百万円 0.159183	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	825,342	4,621	0.6	831,703	4,621	0.6

<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。

<外国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 36,572	百万円 －	% －	百万円 79,524	百万円 63	% 0.1
金 銭 信 託	0.039161	0.039161	100.0	0.039161	0.039161	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	192,421	905	0.5	192,132	905	0.5

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

<国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.056937	百万円 0.056937	% 100.0	百万円 0.056937	百万円 0.056937	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	315,609	845	0.3	315,549	845	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。

<外国債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 34,609	百万円 330	% 1.0	百万円 36,789	百万円 230	% 0.6
金 銭 信 託	0.155211	0.155211	100.0	0.155211	0.155211	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	865,760	4,619	0.5	864,392	4,619	0.5

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

■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	319百万円	149百万円	1,233百万円

(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－R E I Tインデックス マザーファンド	7,936	10,127	23,191
グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	8,195	10,488	25,006
国内株式インデックス マザーファンド	19,690	23,458	46,259
外国株式インデックス マザーファンド	11,023	11,954	47,990
国内債券インデックス マザーファンド	17,145	23,697	33,482
外国債券インデックス マザーファンド	9,633	12,819	39,529

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

J-REITインデックス マザーファンド	49,131,603千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	41,266,058千口
国内株式インデックス マザーファンド	252,855,267千口
外国株式インデックス マザーファンド	134,161,147千口
国内債券インデックス マザーファンド	469,252,648千口
外国債券インデックス マザーファンド	96,959,233千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
J－R E I Tインデックス マザーファンド	23,191	10.4
グローバルR E I Tインデックス マザーファンド	25,006	11.2
国内株式インデックス マザーファンド	46,259	20.8
外国株式インデックス マザーファンド	47,990	21.5
国内債券インデックス マザーファンド	33,482	15.0
外国債券インデックス マザーファンド	39,529	17.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,313	3.4
投 資 信 託 財 産 総 額	222,770	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(98,637,709千円)の投資信託財産総額(98,644,755千円)に対する比率は100.0%です。

(注2)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(538,409,544千円)の投資信託財産総額(538,845,230千円)に対する比率は99.9%です。

(注3)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(295,388,490千円)の投資信託財産総額(299,422,813千円)に対する比率は98.7%です。

(注4)外貨建資産は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売相場の仲値により邦貨換算したものです。

1米ドル=109.83円	1カナダドル=87.57円	1メキシコペソ=5.5136円
1ユーロ=130.43円	1イギリスポンド=152.13円	1スイスフラン=120.11円
1スウェーデンクローナ=12.83円	1ノルウェークローネ=12.65円	1デンマーククローネ=17.54円
1ポーランドズロチ=28.9372円	1オーストラリアドル=81.64円	1ニュージーランドドル=78.53円
1香港ドル=14.13円	1シンガポールドル=81.84円	1マレーシアリンギット=26.5052円
1韓国ウォン=0.0949円	1イスラエルシェケル=34.2728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9月6日現在
(A) 資 産	222,770,474円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,310,108
J－R E I Tインデックス マザーファンド(評価額)	23,191,196
グローバルR E I Tインデックス マザーファンド(評価額)	25,006,369
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	46,259,972
外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	47,990,978
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	33,482,285
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	39,529,566
(B) 負 債	589,177
未 払 解 約 金	29,741
未 払 信 託 報 酬	553,944
未 払 利 息	6
そ の 他 未 払 費 用	5,486
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	222,181,297
元 本	176,550,538
次 期 繰 越 損 益 金	45,630,759
(D) 受 益 権 総 口 数	176,550,538口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,585円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年9月8日 至 2021年9月6日
(A) 配 当 等 収 益	△1,769円
受 取 利 息	24
支 払 利 息	△1,793
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	34,214,018
売 買 益	36,486,384
売 買 損	△2,272,366
(C) 信 託 報 酬 等	△1,010,357
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	33,201,892
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	4,108,434
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,320,433
(配 当 等 相 当 額)	(5,061,497)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,258,936)
(G) 計 (D+E+F)	45,630,759
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	45,630,759
追 加 信 託 差 損 益 金	8,320,433
(配 当 等 相 当 額)	(5,099,527)
(売 買 損 益 相 当 額)	(3,220,906)
分 配 準 備 積 立 金	37,310,326

- (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142, 231, 158円、期中追加設定元本額は56, 921, 923円、期中一部解約元本額は22, 602, 543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)		3, 450, 076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)		29, 751, 816円
(C)	収益調整金額		8, 320, 433円
(D)	分配準備積立金額		4, 108, 434円
(E)	分配対象収益額(A+B+C+D)		45, 630, 759円
(F)	期末残存口数		176, 550, 538口
(G)	収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10, 000)		2, 584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		債 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
第17期(2017年5月29日)	円	%		%	%	%	百万円
	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 券 先 物 率 組 入 比 率	債 券 先 物 率 組 入 比 率
	騰 落 率	中 率	騰 落 率	中 率		
(当 期 首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%
	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。

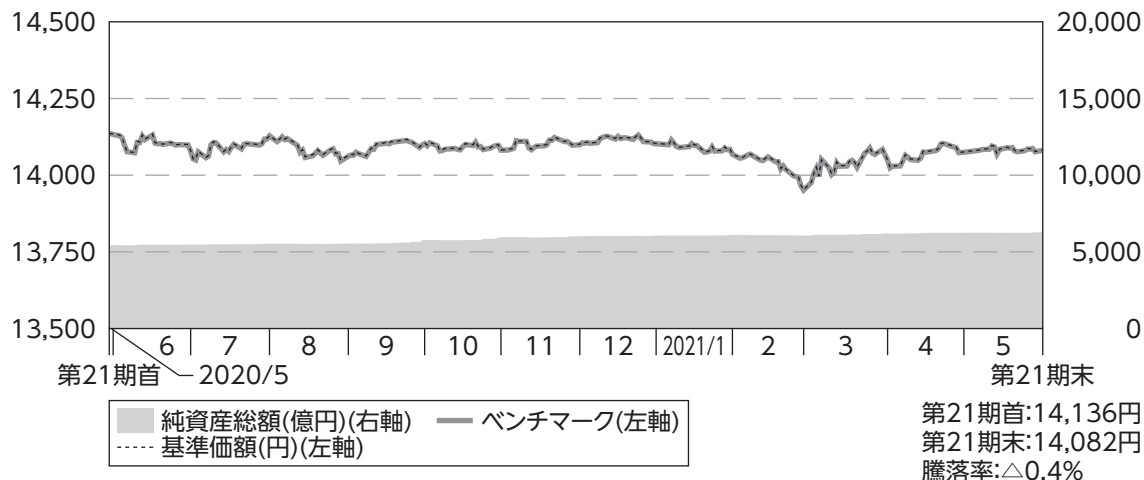
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

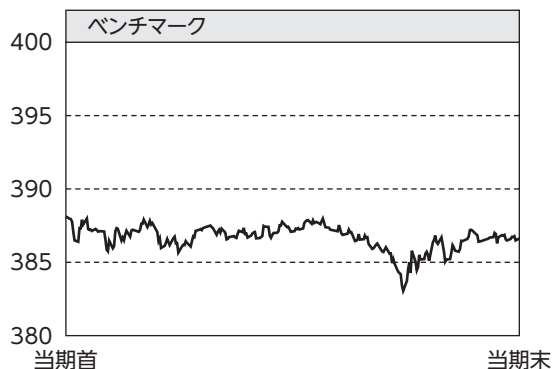


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

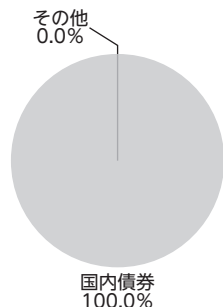
○上位10銘柄

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%

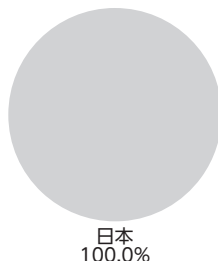
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第340回利付国債(10年)	日本	1.0%
9	第346回利付国債(10年)	日本	1.0%
10	第140回利付国債(5年)	日本	1.0%
組入銘柄数		982	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

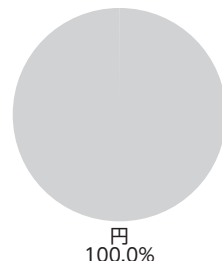
○資産別配分



○国別配分



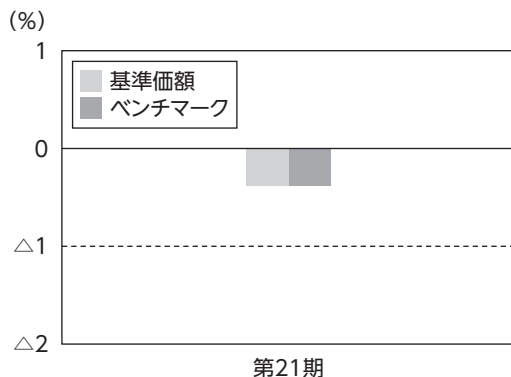
○通貨別配分



(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		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)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (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	千円		千円	
	地 方 債 証 券	152,657,851		75,390,085	
	特 殊 債 券	8,839,229		3,485,669	
	社 債 券(投 資 法 人 債 券 を 含 む)	12,721,866		9,396,590 (738,947)	
		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 ー	百万円 ー

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
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 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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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362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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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

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

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
地方債証券				
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	106,299	2024/3/19
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	107,560	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	132,500	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	131,132	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	127,316	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	126,274	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	300,000	343,203	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	115,002	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	116,258	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	99,770	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	233,296	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	232,900	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	200,000	2025/12/19
第716回東京都公募公債	0.77	100,000	101,183	2022/12/20
第717回東京都公募公債	0.63	100,000	101,117	2023/3/20
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	101,767	2023/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	200,000	203,678	2023/12/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	101,635	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,638	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,896	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,692	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	301,893	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	199,236	2029/12/20
平成24年度第14回北海道公募公債	0.8	100,000	101,363	2023/2/28
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,965	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,332	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	101,000	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	201,338	2028/12/28
第29回1号宮城県公募公債(10年)	0.68	100,000	101,610	2023/10/25
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	270,900	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	115,975	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	233,466	2030/11/12
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	116,280	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	114,412	2034/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	203,132	2024/12/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,841	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,809	2027/3/19
第227回神奈川県公募公債	0.18	100,000	100,692	2027/6/18
第243回神奈川県公募公債	0.075	200,000	199,152	2029/12/20
第6回大阪府公募公債(20年)	1.98	200,000	233,404	2030/9/13
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	200,000	233,532	2031/9/26
第10回大阪府公募公債(20年)	1.72	100,000	116,560	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 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第389回大阪府公債券(10年)	0.53	100,000	101,740	2024/10/30
第395回大阪府公債券(10年)	0.435	151,000	153,447	2025/4/28
第399回大阪府公債券(10年)	0.529	100,000	102,158	2025/8/28
第402回大阪府公債券(10年)	0.493	100,000	102,123	2025/11/27
第407回大阪府公債券(10年)	0.09	156,000	156,556	2026/4/27
第4110回大阪府公債券(10年)	0.001	200,000	199,494	2026/7/28
第439回大阪府公債券(10年)	0.193	500,000	503,270	2028/12/27
第440回大阪府公債券(10年)	0.2	100,000	100,718	2029/1/30
平成21年度第3回京都府公債券(20年)	2.19	100,000	117,170	2029/9/20
平成23年度第5回京都府公債券(20年)	1.79	100,000	116,408	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公債券	0.8	100,000	101,821	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公債券	0.553	100,000	102,199	2025/6/19
平成28年度第5回京都府公債券(20年)	0.327	100,000	99,454	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公債券(20年)	0.63	100,000	103,659	2037/8/14
第2回兵庫県公債券(12年)	1.1	100,000	103,315	2024/6/26
第2回兵庫県公債券(20年)	2.37	100,000	114,420	2027/9/17
第3回兵庫県公債券(12年)	0.56	100,000	102,091	2025/4/16
第6回兵庫県公債券(15年)	1.35	400,000	435,920	2028/7/14
第7回兵庫県公債券(15年)	1.12	100,000	107,655	2028/12/25
第8回兵庫県公債券(15年)	1.09	100,000	107,650	2029/4/16
第9回兵庫県公債券(20年)	2.25	400,000	471,052	2029/11/19
平成24年度第15回兵庫県公債券	0.75	200,000	201,764	2022/8/16
平成25年度第4回兵庫県公債券	0.82	100,000	101,773	2023/8/18
平成26年度第17回兵庫県公債券	0.46	100,000	101,645	2025/2/26
第35回兵庫県公債券(20年)	0.578	100,000	102,260	2038/5/28
令和元年度第17回兵庫県公債券	0.15	300,000	300,384	2030/1/28
第9回静岡県公債券(30年)	1.539	100,000	120,519	2045/6/20
第12回静岡県公債券(30年)	0.822	100,000	103,578	2048/3/19
第15回静岡県公債券(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15
第18回静岡県公債券(20年)	1.473	100,000	115,312	2034/7/10
平成24年度第10回静岡県公債券	0.678	100,000	101,208	2023/3/22
平成29年度第5回静岡県公債券	0.19	100,000	100,753	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公債券	0.21	100,000	100,873	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公債券	0.215	100,000	100,971	2027/9/17
平成29年度第14回静岡県公債券(5年)	0.04	100,000	100,053	2023/3/20
平成21年度第5回愛知県公債券(20年)	2.28	100,000	117,457	2029/6/20
平成24年度第18回愛知県公債券(10年)	0.801	150,000	152,073	2023/2/28
平成24年度第19回愛知県公債券(10年)	0.639	100,000	101,147	2023/3/28
平成25年度第2回愛知県公債券(10年)	0.576	100,000	101,077	2023/4/26
平成26年度第3回愛知県公債券(10年)	0.665	100,000	101,909	2024/4/30
平成26年度第5回愛知県公債券(10年)	0.66	200,000	203,888	2024/5/28
平成27年度第17回愛知県公債券(10年)	0.38	100,000	101,733	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公債券(10年)	0.07	100,000	100,151	2026/6/29
平成29年度第6回愛知県公債券(10年)	0.22	200,000	201,926	2027/7/28

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成29年度第12回愛知県公債券(20年)	0.606	300,000	309,552	2037/11/20
平成30年度第1回愛知県公債券(10年)	0.185	100,000	100,790	2028/4/27
平成30年度第6回愛知県公債券(30年)	0.777	100,000	102,341	2048/6/19
令和元年度第16回愛知県公債券(10年)	0.09	200,000	199,310	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公債券(10年)	0.145	100,000	100,020	2030/7/31
平成20年度第1回広島県公債券(20年)	2.34	100,000	116,466	2028/9/21
平成21年度第1回広島県公債券(20年)	2.21	200,000	233,352	2029/5/28
平成24年度第4回広島県公債券	0.81	100,000	101,197	2022/11/28
平成27年度第4回広島県公債券	0.476	125,230	127,847	2029/11/25
平成29年度第1回広島県公債券	0.175	100,000	100,715	2027/5/25
第3回埼玉県公債券(20年)	2.42	100,000	114,190	2027/6/18
第5回埼玉県公債券(20年)	2.35	100,000	115,494	2028/3/17
第6回埼玉県公債券(20年)	2.26	200,000	231,768	2028/9/21
第6回埼玉県公債券(30年)	0.957	100,000	107,202	2046/12/20
第7回埼玉県公債券(20年)	2.29	200,000	235,098	2029/6/22
第8回埼玉県公債券(15年)	0.367	200,000	200,484	2036/4/18
第10回埼玉県公債券(20年)	1.94	200,000	233,466	2030/11/12
第18回埼玉県公債券(20年)	0.323	200,000	199,094	2036/5/20
平成24年度第9回埼玉県公債券	0.844	100,000	101,394	2023/1/31
平成25年度第11回埼玉県公債券	0.655	100,000	101,818	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公債券	0.469	100,000	102,098	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公債券	0.085	100,000	100,239	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公債券	0.249	100,000	101,109	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公債券	0.19	100,000	100,755	2027/6/22
平成19年度第1回福岡県公債券(20年)	2.38	100,000	114,368	2027/8/20
平成20年度第2回福岡県公債券(20年)	2.05	100,000	114,744	2028/12/20
平成22年度第1回福岡県公債券(15年)	1.67	100,000	107,429	2025/11/21
平成23年度第1回福岡県公債券(20年)	2.008	100,000	118,145	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債券(15年)	1.491	100,000	107,953	2026/11/27
平成24年度第1回福岡県公債券(30年)	2.12	100,000	131,560	2042/9/19
平成26年度第4回福岡県公債券(20年)	1.249	100,000	112,663	2035/2/23
平成27年度第7回福岡県公債券	0.464	100,000	102,075	2025/12/25
平成30年度第1回福岡県公債券(30年)	0.777	100,000	102,341	2048/6/19
平成30年度第1回福岡県公債券(20年)	0.639	100,000	103,435	2038/8/20
令和2年度第1回福岡県公債券	0.155	300,000	300,408	2030/6/24
令和3年度第2回福岡県公債券	0.155	100,000	100,000	2031/5/30
第5回千葉県公債券(20年)	2.26	200,000	231,768	2028/9/21
第6回千葉県公債券(20年)	2.26	100,000	116,901	2029/4/20
第13回千葉県公債券(20年)	1.701	100,000	116,561	2032/10/15
平成25年度第5回千葉県公債券	0.84	100,000	101,856	2023/8/25
平成26年度第7回千葉県公債券	0.429	100,000	101,566	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公債券	0.549	100,000	102,143	2025/5/23
平成28年度第4回千葉県公債券	0.085	100,000	100,238	2026/9/25
平成28年度第6回千葉県公債券	0.18	120,000	120,844	2027/1/25
令和元年度第7回千葉県公債券	0.08	300,000	298,701	2030/2/25
令和3年度第1回長野県公債券(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145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回熊本県公債(10年)		0.8	200,000	202,222	2022/10/26
平成29年度第1回熊本県公債(5年)		0.01	100,000	99,997	2022/7/28
平成29年度第1回静岡市公債		0.22	100,000	101,033	2027/11/24
第13回大阪市公債(20年)		2.08	200,000	234,944	2030/6/14
第22回大阪市公債(20年)		0.347	300,000	299,661	2036/5/30
第24回大阪市公債(20年)		0.655	100,000	104,121	2037/4/21
令和3年度第2回大阪市公債		0.16	200,000	200,098	2031/5/21
第1回名古屋市公債(30年)		2.53	100,000	129,978	2035/3/20
第5回名古屋市公債(30年)		2.49	100,000	134,601	2039/3/18
第9回名古屋市公債(20年)		2.07	100,000	114,895	2028/12/20
第11回名古屋市公債(30年)		1.774	100,000	125,280	2044/9/20
第481回名古屋市公債(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回名古屋市公債(10年)		0.225	100,000	100,986	2027/3/26
第512回名古屋市公債(10年)		0.15	300,000	300,402	2030/6/20
平成24年度第2回京都市公債		0.849	122,500	123,780	2022/8/29
平成24年度第4回京都市公債		0.801	100,000	101,101	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債		0.854	100,000	101,410	2023/1/31
平成28年度第6回京都市公債		0.18	200,000	201,410	2027/1/27
平成18年度第3回神戸市公債(20年)		2.54	120,000	135,126	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公債(20年)		2.38	200,000	232,114	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公債(20年)		2.233	100,000	118,122	2030/1/29
平成24年度第12回神戸市公債(20年)		1.711	100,000	116,853	2032/12/17
令和2年度第9回神戸市公債(30年)		0.674	100,000	98,421	2050/6/20
第5回横浜市公債(20年)		2.17	100,000	108,755	2025/6/20
第20回横浜市公債(20年)		2.1	300,000	349,608	2029/10/19
平成28年度第4回横浜市公債		0.175	100,000	100,675	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公債		0.24	100,000	101,076	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公債		0.195	100,000	100,855	2028/4/17
平成30年度第4回横浜市公債		0.289	200,000	202,988	2028/10/17
第30回横浜市公債(20年)		1.376	200,000	228,428	2034/10/20
令和2年度第1回横浜市公債		0.15	300,000	300,399	2030/6/12
令和3年度第2回横浜市公債		0.16	100,000	100,049	2031/5/23
平成23年度第9回札幌市公債(15年)		1.493	100,000	108,176	2027/2/12
平成24年度第10回札幌市公債(10年)		0.8	100,000	101,229	2022/12/20
平成26年度第9回札幌市公債(10年)		0.43	100,000	101,491	2024/12/20
第11回川崎市公債(20年)		1.84	100,000	115,688	2030/10/18
第89回川崎市公債		0.16	100,000	100,581	2026/12/18
平成26年度第2回北九州市公債		0.451	100,000	101,534	2024/12/24
平成27年度第2回北九州市公債		0.484	100,000	102,109	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公債		0.08	100,000	100,309	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市公債(20年)		2.14	100,000	116,747	2029/9/18
平成25年度第6回福岡市公債(20年)		1.511	100,000	115,548	2034/2/17
平成26年度第5回福岡市公債		0.539	200,000	203,606	2024/10/28
平成30年度第5回福岡市公債(5年)		0.03	200,000	200,088	2023/8/17
平成30年度第9回福岡市公債(10年)		0.289	100,000	101,500	2028/10/30
平成25年度第3回広島市公債		0.67	150,000	152,706	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公債		0.456	100,000	101,589	2024/12/25
平成28年度第4回広島市公債		0.165	105,000	105,640	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公債		0.23	170,000	171,881	2028/2/25
令和元年度第6回広島市公債		0.115	550,000	549,285	2030/2/25
令和2年度第3回広島市公債(5年)		0.02	200,000	200,086	2025/10/24
令和元年度第5回千葉市公債		0.08	200,000	199,134	2030/2/25
平成24年度第1回徳島県公債		0.68	100,000	101,215	2023/3/24
平成24年度第2回岡山県公債(10年)		0.68	150,000	151,836	2023/3/29
平成24年度第1回岡山県公債(10年)		0.844	200,000	202,788	2023/1/31
平成26年度第1回岡山県公債(10年)		0.33	200,000	202,344	2025/1/30

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第5 1 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5 4 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5 7 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5 8 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7 9 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8 2 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9 1 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9 2 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9 5 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9 8 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9 9 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1 0 5 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1 1 1 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1 1 3 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1 1 9 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1 2 9 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1 4 回道路債券	1.91	100,000	102,956	2022/12/20
第1 7 回道路債券	1.54	100,000	102,381	2022/12/20
第2 2 1 回道路債券	2.75	100,000	129,097	2033/6/20
第2 7 回道路債券	2.42	400,000	426,888	2024/3/20
第2 8 回道路債券	2.83	200,000	262,004	2033/12/20
第3 3 回道路債券	2.91	200,000	265,924	2034/6/20
第3 4 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3 6 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3 7 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4 2 回道路債券	2.22	100,000	108,325	2025/3/21
第4 7 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9 5 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1 0 2 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1 0 4 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1 0 6 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1 1 2 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1 1 5 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1 3 1 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1 4 4 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1 5 3 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1 5 8 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1 8 8 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 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 0 8 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 (3 0 年)	2.39	300,000	376,761	2033/12/20
第3 回公営企業債券 (2 0 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 (1 5 年)	1.176	100,000	107,967	2029/1/26
第5 回公営企業債券 (3 0 年)	2.72	300,000	392,910	2034/9/22
第7 回公営企業債券 (2 0 年)	2.2	100,000	106,119	2024/3/22
第7 回公営企業債券 (3 0 年)	2.67	100,000	131,598	2035/6/20
第8 回公営企業債券 (2 0 年)	2.25	40,000	42,503	2024/3/22
第8 回公営企業債券 (3 0 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 (2 0 年)	2.043	200,000	233,596	2030/6/28
第1 1 回地方公共団体金融機構債券 (3 0 年)	0.633	200,000	194,342	2050/8/26
第1 9 回地方公共団体金融機構債券 (2 0 年)	1.84	200,000	233,480	2031/12/26
第2 4 回地方公共団体金融機構債券 (2 0 年)	1.702	100,000	116,056	2032/9/28
第3 8 回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	504,765	2022/7/28
第4 2 回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	101,183	2022/11/28
第4 4 回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	202,592	2023/1/27
第5 8 回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	102,029	2024/3/28
第6 5 回地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	305,262	2024/10/28
第6 7 回地方公共団体金融機構債券	0.501	100,000	101,716	2024/12/27
第6 9 回地方公共団体金融機構債券	0.478	100,000	101,714	2025/2/28
第7 6 回地方公共団体金融機構債券	0.505	200,000	204,190	2025/9/26
F 7 7 回地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	107,750	2026/10/20
F 8 8 回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	100,026	2026/9/28
F 9 5 回地方公共団体金融機構債券	1.336	100,000	104,848	2025/2/6
F 1 0 7 回地方公共団体金融機構債券	1.388	100,000	105,195	2025/3/19
第1 1 6 回地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,184	2029/1/26
F 1 3 2 回地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	104,452	2025/7/30
F 1 4 6 回地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	209,818	2025/10/28
F 2 0 8 回地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	103,927	2026/2/4
F 2 1 4 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2 2 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1 8 回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	119,185	2031/5/9
第8 5 回株式会社日本政策金融公社債	0.001	300,000	299,961	2022/8/8
第8 7 回株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,894	2024/3/11
第1 1 7 回都市再生債券	0.804	200,000	211,328	2030/11/20
第1 5 9 回都市再生債券	0.43	200,000	170,600	2059/3/19
第1 6 1 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3 4 4 回東京交通債券	1.67	100,000	102,842	2023/2/17
第3 4 6 回東京交通債券	1.13	20,000	20,453	2023/6/20
第5 9 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 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 銘 柄 名	期		末	
	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	87,273	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	175,507	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 銘 柄 名	期		末	
	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回中日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	100,020	2022/7/29
第83回中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 銘 柄 名	期		末	
	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	2028/10/25
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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第42回D I C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J X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J F E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回明治安田生命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回明治安田生命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	97,080	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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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212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

当 銘 柄 名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第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64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回株式会社日生物流無担保社債	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	率	
公 社 債	千円 626,968,264		% 97.2	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	18,254,472		2.8	
投 資 信 託 財 産 総 額	645,222,736		100.0	

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は382,125,773,582円、期中追加設定元本額は80,683,811,289円、期中一部解約元本額は16,603,725,270円です。

※担保に供している資産

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

国債証券 101,057,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	92,758,841,858円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	77,436,978,713円
DC日本債券インデックス・オープンP	69,290,781,589円
DCマイセクション50	27,468,404,443円
分散投資コア戦略ファンドS	26,474,515,732円
分散投資コア戦略ファンドA	26,190,440,582円
DCマイセクション25	24,259,996,622円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,498,916,841円
日本債券ファンド・シリーズ1	14,119,889,697円
DCマイセクションS50	12,370,734,258円
DCマイセクションS25	11,081,370,502円
DCマイセクション75	7,952,503,833円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,023,231,385円

SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,701,103,587円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,511,595,997円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,494,948,162円
DC世界経済インデックスファンド	2,900,386,752円
DCマイセクション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。

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		株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 騰 落 率	期 騰 落 率	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	1.8
第18期(2018年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	1.8
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	2.2
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	1.5

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	騰 落 率	中 騰 落 率	騰 落 率	中 騰 落 率		
(当 期 首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%
	14,762	－	1,563.67	－	97.0	1.7
6月末	14,738	△0.2	1,558.77	△0.3	98.7	1.2
7月末	14,145	△4.2	1,496.06	△4.3	98.8	1.3
8月末	15,300	3.6	1,618.18	3.5	99.0	1.0
9月末	15,498	5.0	1,625.49	4.0	98.2	1.7
10月末	15,059	2.0	1,579.33	1.0	98.4	1.6
11月末	16,740	13.4	1,754.92	12.2	98.1	1.3
12月末	17,238	16.8	1,804.68	15.4	99.2	0.8
2021年 1月末	17,277	17.0	1,808.78	15.7	99.0	0.8
2月末	17,815	20.7	1,864.49	19.2	99.4	0.6
3月末	18,831	27.6	1,954.00	25.0	98.4	1.6
4月末	18,299	24.0	1,898.24	21.4	98.5	1.5
(当 期 末) 2021年 5月31日	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	1.5

(注1)騰落率は期首比です。

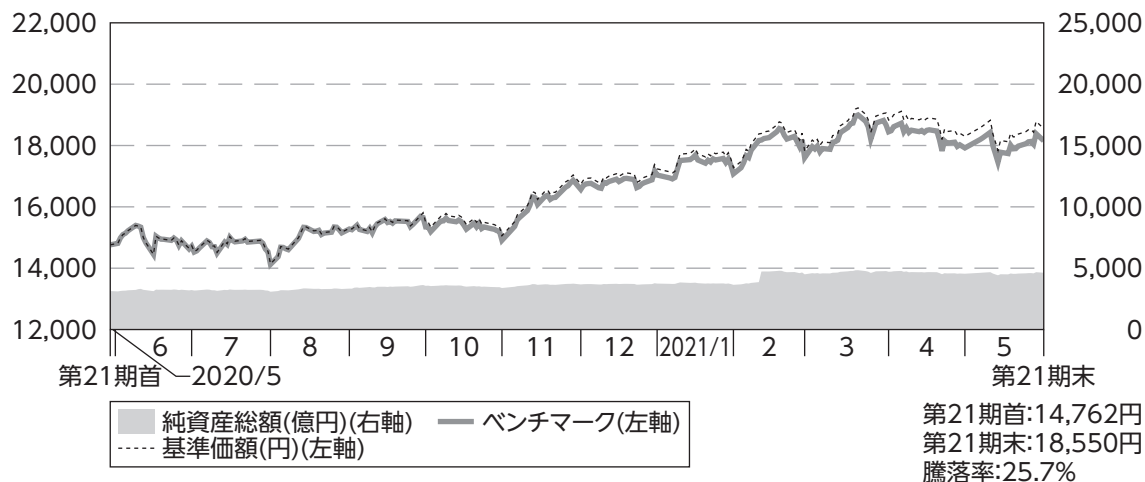
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

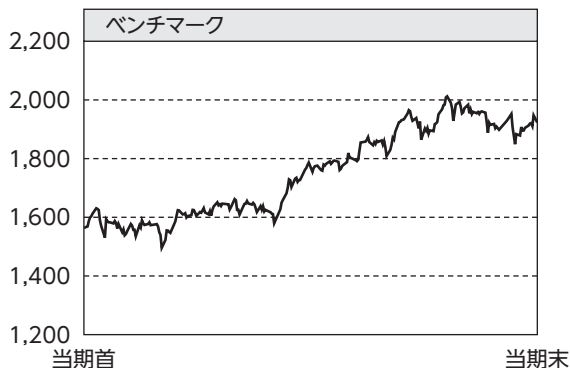


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

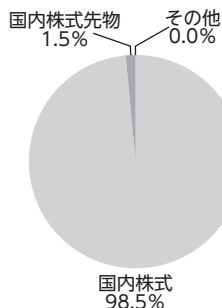
○上位10銘柄

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%

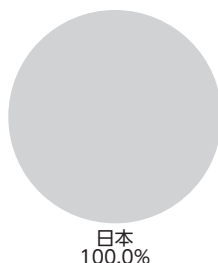
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	任天堂	日本	1.4%
8	リクルートホールディングス	日本	1.4%
9	信越化学工業	日本	1.3%
10	日本電信電話	日本	1.3%
組入銘柄数		2,115	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

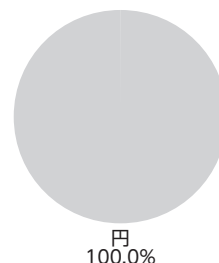
○資産別配分



○国別配分



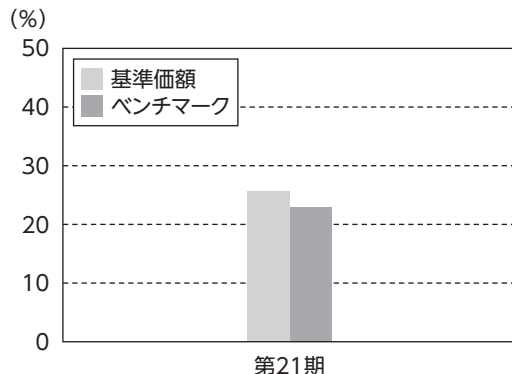
○通貨別配分



(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	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 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	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	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
ベステラ	3.2	4.5	7,110
R o b o t H o m e	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	当期首(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)
住友林業	110	127.4	282,318	
日本基礎技術	14.6	16.5	8,316	
巴コーポレーション	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)
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	
ユカ・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	93	116	468,060	
サントリー食品インターナショナル	7.1	9.8	48,412	
ダイドーグループホールディングス	42.2	52.6	318,756	
伊藤園	13.7	17	35,258	
キーコーヒー	3.6	5.2	5,189	
ユニカフェ	2	2.5	3,025	
ジャパンフーズ	17.9	22.2	66,555	
日清オイリオグループ				

銘柄	当期首(前期末)	当 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	当期首(前期末)	当 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	
小松マテレー	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	
クラウドディアホールディングス	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	
ワールド	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)	当 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)	当 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	
ダイキアクシス	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)	当 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	
マンドラム	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ヤパン	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)	当 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	
ショウ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	
ビオフェルミン製薬	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)	当 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	
サワイ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	
パンドー化学	24.4	30.4	25,262	
ガラス・土壌製品 (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)	当 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	
フジミ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	額 (千円)
シンニッタン	21.5	21	5,229	
新家工業	3.2	4.3	6,961	
非鉄金属(0.8%)				
大紀アルミニウム工業所	22.7	25.9	31,028	
日本軽金属ホールディングス	347.1	46.6	87,328	
三井金属鉱業	37	46.1	149,133	
東邦亜鉛	7.1	9.5	19,275	
三菱マテリアル	90.5	112.9	261,928	
住友金属鉱山	175.1	218.4	1,071,907	
DOWAホールディングス	34.7	43.3	196,365	
古河機械金属	24.4	28.3	35,573	
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.3	17.9	14,857	
東邦チタニウム	24.7	30.7	29,072	
UACJ	20.8	26	60,684	
CKサンエツ	2.9	3.6	12,996	
古河電気工業	42.6	53.1	154,680	
住友電気工業	512	596.3	999,696	
フジクラ	165.7	206.3	96,548	
昭和電線ホールディングス	15.9	16.6	28,153	
東京特殊電線	2.1	2.2	5,524	
タツタ電線	27.3	30.4	17,328	
カナレ電気	2.3	2.9	5,260	
平河ヒューテック	6.9	9.6	11,692	
リョービ	16.9	21.1	33,464	
アーレスティ	18.2	21.3	9,009	
アサヒホールディングス	24	64.2	153,373	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	7.7	9.6	14,208	
宮地エンジニアリンググループ	4.2	5.6	12,140	
トーカロ	38	44.1	61,872	
アルファC o	4.8	6	6,708	
SUMCO	162.7	217.9	553,683	
川田テクノロジーズ	2.8	3.5	13,475	
RS Technologies	3.9	5.5	29,315	
ジェイテックコーポレーション	—	1.9	5,795	
信和	7.9	9.1	6,997	
東洋製鐵グループホールディングス	87.2	108.8	163,200	
ホッカンホールディングス	7.5	8.7	12,206	
コロナ	7.6	9.4	8,751	
横河ブリッジホールディングス	25.5	29.3	58,600	
駒井ハルテック	2.6	3.5	6,034	
高田機工	1.3	1.6	4,288	
三和ホールディングス	129.1	161.1	213,618	
文化シャッター	40.3	50.3	54,575	
三協立山	17.6	22	17,314	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	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	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	
N C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	
レオン自動機	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	
日本エアーテック	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	
ワイエイシイホールディングス	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	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	
JUK I	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	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	
N T N	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	
T H K	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	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	
テクノメディカ	3.4	4.5	7,254	
日本電気	168	219.5	1,121,645	
富士通	133.5	155.5	2,765,567	
沖電気工業	56.4	70.3	68,753	
岩崎通信機	6.1	7.6	7,136	
電気興業	6.7	8.4	19,387	
サンケン電気	15.2	20.2	107,868	
ナカヨ	2.8	3.5	5,218	
アイホン	7.9	9.9	20,413	
ルネサスエレクトロニクス	663.2	744.7	829,595	
セイコーエプソン	171.9	214.4	414,864	
ワコム	94.1	126.6	84,315	
アルバック	25.5	31.8	163,770	
アクセル	6.4	8.3	7,486	
E I Z O	10.8	14.7	69,237	
日本信号	35.4	40.4	37,976	
京三製作所	32.7	37.5	15,937	
能美防災	18.6	23.4	48,040	
ホーチキ	10.4	13.4	16,254	
星和電機	7.6	10.4	5,772	
エレコム	15.4	40.1	83,728	
パナソニック	1,582.1	1,842.6	2,297,722	
シャープ	160.3	229.8	459,140	
アンリツ	89.2	103.9	217,254	

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
輸送用機器 (7.6%)			
トヨタ紡織	40.4	50.4	106,495
芦森工業	2.9	3.3	3,432
ユニプレス	26.9	28.4	26,809
豊田自動織機	112.1	139.8	1,305,732
モリタホールディングス	24.2	27.7	42,602
三櫻工業	17.6	24	26,400
デンソー	304.9	380.4	2,854,141
東海理化電機製作所	36.5	45.5	80,034
三井E&Sホールディングス	50	66.9	33,048
川崎重工業	107.7	134.4	353,740
名村造船所	44.6	51.9	8,667
日本車輛製造	5	6.3	13,784
三菱ロジスネクスト	18.3	22.9	23,358
近畿車輛	2.1	3	3,750
日産自動車	1,633	2,037.5	1,098,416
いすゞ自動車	401.2	458.7	661,904
トヨタ自動車	1,544.9	1,750.2	15,953,073
日野自動車	172.9	215.7	219,582
三菱自動車工業	512.5	639.5	194,408
エフテック	9.8	12.2	9,699
レシップホールディングス	5.4	6.8	3,984
GMB	2.6	3.2	2,937
ファルテック	2.5	3.1	2,387
武蔵精密工業	30.9	38.5	84,854
日産車体	27	25.3	17,937
新明和工業	37.3	48.8	47,433
極東開発工業	25.7	29.8	51,554
日信工業	28.2	—	—
トビー工業	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
大同金属工業	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・テクノロジー	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
H O Y A	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・ディ	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	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
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	
前田工繊	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	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
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	
リンテック	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	
コクヨ	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)	当 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	
丸和運輸機関	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)	当 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	
ファイブホールディングス	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	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	
エアロイティ	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)
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・ビット 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)
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	
A01 TYO Holdings	14.3	17.6	15,804	
マクロミル	28.1	35.1	29,905	
ビーグリー	2.8	3.6	4,640	

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
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J SAT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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
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・ビー	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	
オルパヘルスケ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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
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	
シップヘルスケ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	
佐島電機	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)
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	
ダイトロン	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)
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	
ＯＵＧ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	
ミツウ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	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Wismettac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	
J Kホールディングス	12.3	15.4	12,119	
日伝	12.3	14.1	28,059	
北沢産業	10.3	11.7	2,913	
杉本商事	7.4	8.6	19,023	
因幡電機産業	38.8	45.4	115,951	
東テク	4.5	5.6	15,545	
ミスミグループ本社	170.9	213.5	751,520	
アルテック	10.9	12.6	4,460	
タキヒヨー	4.1	5.7	10,311	
蔵王産業	2.6	3.3	4,821	
スズケン	57.8	72.1	249,466	
ジェコス	9.4	11.8	10,325	
グローセル	13.7	18.5	7,696	
小売業(4.5%)				
ローソン	34.5	43.1	212,483	
サンエー	11.4	13	55,185	
カワチ薬品	10.6	12	26,640	
エービーシー・マート	21.3	26.6	166,250	
ハードオフコーポレーション	5.7	8	6,080	

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ライフコーポレーション	10.4	17.1	57,541
リンガーハット	16.9	21	46,662
MrMaxHD	19.2	24	14,784
テナアライド	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
ブレナス	15.4	19.3	37,345

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

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

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
福島銀行	12.9	19.5	4,309	
大東銀行	7.1	8.2	4,969	
トモニホールディングス	105.6	131.7	39,114	
フィデアホールディングス	132.6	165.4	19,848	
池田泉州ホールディングス	157	195.9	31,344	
証券・商品先物取引業(0.8%)				
F P G	42.4	57.6	42,048	
ジャパシ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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
アルヒ	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	
ヒューリック	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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ハウズドゥ	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	当期首(前期末)	当 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	
U T 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	
C D S	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	
G C A	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	
N J S	3	4.2	8,790	
総合警備保障	52.7	65.7	329,157	
カカココム	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	当期首(前期末)	当 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	
パリュールコマース	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	
レッグス	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	
T A C	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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
リソー教育	60.9	84.7	26,087	
早稲田アカデミー	5.9	7.3	6,577	
ユー・エス・エス	148.2	185	354,090	
東京個別指導学院	4.9	15	8,895	
サイバーエージェント	81.5	407	894,586	
楽天グループ	616.8	770.7	967,228	
クリーク・アンド・リバー社	7	8.8	13,032	
モーニングスター	—	24.7	10,744	
テー・オー・ダブリュー	21.4	29.7	9,949	
山田コンサルティン グループ	8.7	9.8	11,485	
セントラルスポーツ	5	6.3	15,617	
フルキャストホールディングス	13.3	14.2	29,237	
エン・ジャパン	23.6	29.4	112,749	
リソルホールディングス	1.5	1.9	7,714	
テクノプロ・ホールディングス	26.4	33	259,380	
アトラグループ	3.5	3.8	1,284	
インターワークス	2.9	5.4	2,203	
アイ・アールジャパンホールディングス	5.4	6.7	92,460	
Keep Per 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сп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	
アビスト	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)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
エラン	7.9	23	32,085	
土木管理総合試験所	6.1	8.8	3,370	
ネットマーケティング	5.3	8.7	3,523	
日本郵政	1,084.6	1,249.3	1,137,862	
ベルシステム24ホールディングス	22.3	27.8	45,369	
鎌倉新書	10.1	16.9	20,618	
SMN	3	3.9	3,123	
一蔵	1.8	—	—	
L I T A L I C O	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-J a p a n	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	
キュービーネットホールディングス	5.5	7.7	13,860	
R P A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	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)
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)
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
	銘柄数<比率>	2,102	2,114
			455,964,175
			<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)
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		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 総 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率			
第17期(2017年5月29日)	円	%		%	%	%	百万円
	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 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
	騰 落 率	中 率	騰 落 率	中 率		
(当 期 首) 2020年 5月29日	円	%		%	%	%
	29,017	—	481,049	—	97.3	2.1
6月末	29,466	1.5	488,814	1.6	96.8	2.3
7月末	29,761	2.6	494,135	2.7	97.5	1.5
8月末	29,723	2.4	492,649	2.4	97.8	1.4
9月末	29,856	2.9	494,877	2.9	97.9	1.2
10月末	29,425	1.4	488,038	1.5	98.0	1.1
11月末	29,723	2.4	493,201	2.5	97.9	1.4
12月末	29,967	3.3	497,331	3.4	98.4	1.0
2021年 1月末	29,924	3.1	496,213	3.2	97.9	1.2
2月末	29,638	2.1	494,148	2.7	97.8	1.3
3月末	30,338	4.6	501,120	4.2	97.6	1.5
4月末	30,310	4.5	502,927	4.5	98.0	1.2
(当 期 末) 2021年 5月31日	30,717	5.9	510,445	6.1	98.1	1.1

(注1) 騰落率は期首比です。

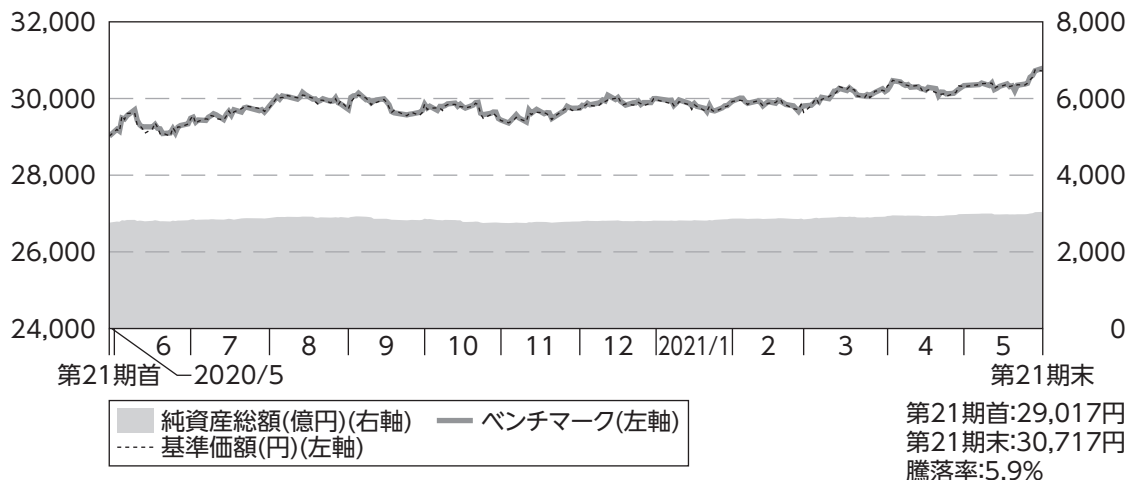
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

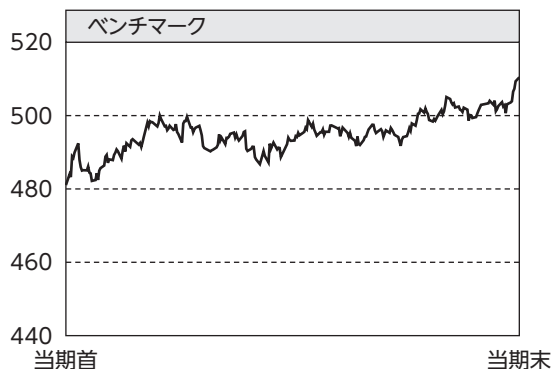


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2020年8月中旬にかけて、ユーロ圏の景気回復期待が高まったことから外国為替市場でユーロが対円で上昇し、基準価額は上昇しました。その後11月上旬にかけては、主要国の長期金利がレンジ内で上下動を繰り返す中、主要通貨に対しては円高推移となり、基準価額は緩やかに低下しました。11月中旬以降期末にかけては、基準価額は緩やかに上昇しました。米国の景気やインフレの上振れ可能性が意識されたことや欧米での新型コロナウイルスに対するワクチン接種の進捗で経済の早期正常化が期待されたことなどから、主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)したことが基準価額の下落要因となったものの、日米金利差の拡大が意識され円売り米ドル買いの動きが強まったこと、世界的な株高を受けたリ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

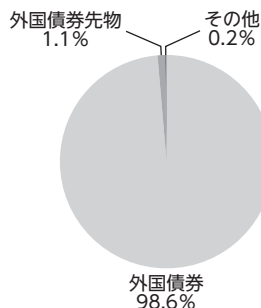
○上位10銘柄

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%

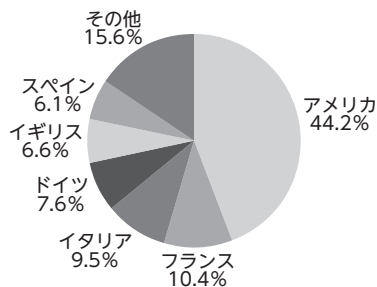
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 1.375% 11/15/40	アメリカ	0.4%
8	T 0.75% 03/31/26	アメリカ	0.4%
9	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.4%
10	T 2% 11/15/26	アメリカ	0.4%
組入銘柄数			779

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

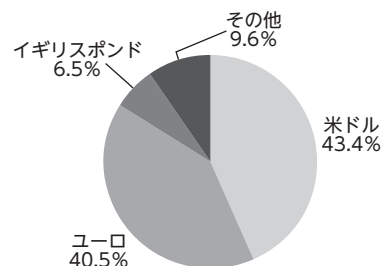
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

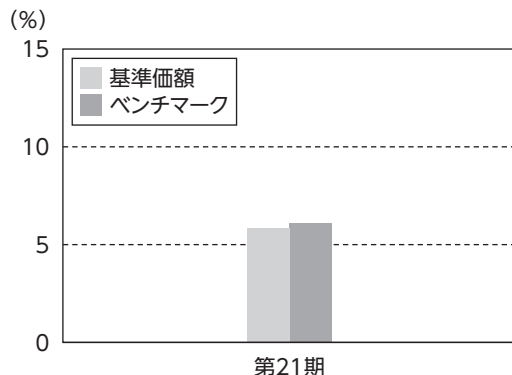


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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 (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)	0.001% (－) (－) (－) (－) (－) (－) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	7 (6) (－) (0)	0.022 (0.022) (－) (0.001)	(c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
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 国	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
	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 ー	百万円 ー

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
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

当		期		末		
銘柄	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(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		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
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	9,954	993,836	2051/2/15
T 1.875% 07/31/22	1.875	9,000	9,189	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	4,089	448,858	2022/8/31
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	6,293	690,767	2024/8/31
T 1.875% 09/30/22	1.875	2,660	2,723	298,901	2022/9/30
T 1.875% 10/31/22	1.875	7,450	7,637	838,266	2022/10/31
T 2% 02/15/23	2.0	5,000	5,160	566,400	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,937	980,946	2025/2/15
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,711	517,158	2050/2/15
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,540	717,888	2024/4/30
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,477	381,740	2024/5/31
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,784	634,854	2024/6/30
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,067	336,688	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	7,295	800,734	2025/8/15
T 2% 10/31/22	2.0	10,000	10,268	1,127,119	2022/10/31
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	10,818	1,187,474	2026/11/15
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,056	225,775	2022/11/30
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,362	588,617	2024/2/29
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,789	855,024	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,550	279,929	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,836	421,097	2026/5/31
T 2.125% 06/30/22	2.125	6,000	6,132	673,146	2022/6/30
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	5,070	556,483	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	8,000	8,463	928,912	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,808	308,278	2023/11/30
T 2.125% 12/31/22	2.125	5,320	5,489	602,501	2022/12/31
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	4,214	462,604	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	9,594	1,053,073	2027/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	8,036	882,405	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	5,500	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

外国債券インデックス マザーファンド ー第21期ー

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

当		期		末		
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
T 3.125%	11/15/41	3.125	1,750	2,031	222,947	2041/11/15
T 3.375%	05/15/44	3.375	3,010	3,645	400,169	2044/5/15
T 3.375%	11/15/48	3.375	5,300	6,534	717,252	2048/11/15
T 3.5%	02/15/39	3.5	770	940	103,187	2039/2/15
T 3.625%	02/15/44	3.625	2,400	3,015	331,008	2044/2/15
T 3.625%	08/15/43	3.625	2,000	2,506	275,154	2043/8/15
T 3.75%	08/15/41	3.75	2,000	2,532	277,950	2041/8/15
T 3.75%	11/15/43	3.75	4,500	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	174,042	2045/12/1
CAN 4.0%	06/01/41	4.0	1,050	1,417	128,731	2041/6/1
CAN 5.0%	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)			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	8,550	10,842	59,728	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24		10.0	29,660	33,631	185,265	2024/12/5
MBONO 5.75% 03/05/26		5.75	45,980	45,304	249,566	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22		6.5	33,080	33,671	185,486	2022/6/9
MBONO 6.75% 03/09/23		6.75	33,850	34,890	192,201	2023/3/9
MBONO 7.5% 06/03/27		7.5	38,910	41,258	227,281	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31		7.75	24,180	26,059	143,554	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42		7.75	24,190	24,838	136,828	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34		7.75	14,100	15,123	83,309	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24		8.0	34,470	36,777	202,593	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47		8.0	23,430	24,542	135,199	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23		8.0	34,870	37,086	204,299	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29		8.5	37,670	42,350	233,296	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38		8.5	26,220	29,125	160,441	2038/11/18
小 計					2,399,051	
(ドイツ)			千ユーロ	千ユーロ		
国債証券						
BKO 0% 06/10/22		—	900	906	121,182	2022/6/10
BKO 0% 12/15/22		—	4,950	5,001	668,931	2022/12/15
DBR 0% 02/15/30		—	3,570	3,657	489,178	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31		—	800	814	108,919	2031/2/15
DBR 0% 05/15/35		—	2,820	2,796	373,941	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36		—	620	608	81,405	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26		—	4,350	4,478	598,971	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29		—	3,500	3,592	480,503	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30		—	5,380	5,496	735,084	2030/8/15
DBR 0% 08/15/30		—	670	687	92,006	2030/8/15
DBR 0% 08/15/50		—	2,720	2,432	325,300	2050/8/15
DBR 0% 11/15/27		—	2,160	2,223	297,411	2027/11/15
DBR 0.25% 02/15/27		0.25	3,890	4,064	543,628	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29		0.25	3,890	4,078	545,407	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28		0.25	2,180	2,285	305,626	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25		0.5	3,000	3,130	418,737	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26		0.5	3,000	3,158	422,360	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28		0.5	2,390	2,544	340,347	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27		0.5	5,690	6,045	808,481	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24		1.0	2,000	2,109	282,073	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25		1.0	2,720	2,909	389,138	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48		1.25	3,580	4,419	591,122	2048/8/15
DBR 1.5% 02/15/23		1.5	2,960	3,071	410,842	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23		1.5	3,020	3,150	421,363	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24		1.5	2,290	2,439	326,306	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22		1.5	2,800	2,877	384,878	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24		1.75	1,650	1,760	235,460	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22		1.75	2,090	2,145	286,957	2022/7/4
DBR 2% 08/15/23		2.0	2,860	3,032	405,564	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44		2.5	3,540	5,344	714,780	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46		2.5	3,800	5,842	781,375	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42		3.25	2,580	4,217	564,086	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37		4.0	2,930	4,731	632,815	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39		4.25	2,720	4,742	634,325	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28		4.75	2,550	3,510	469,512	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34		4.75	3,390	5,548	742,081	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40		4.75	2,830	5,301	709,040	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31		5.5	2,840	4,441	594,059	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28		5.625	2,360	3,332	445,664	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24		6.25	3,230	3,819	510,881	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30		6.25	1,250	1,972	263,785	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27		6.5	980	1,407	188,286	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24		—	4,250	4,333	579,518	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26		—	4,070	4,184	559,666	2026/4/10

銘柄	利 率 (%)	期 額面金額	末 評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
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	2,040	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	2,555	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	129,460	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	2047/3/1
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	711,850	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	946,434	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	467,026	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	3,607	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	449,881	2030/7/30

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

当		期		末			
銘	柄	利 率 (%)	額面金額	評 価 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	1,406	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 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
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)		キスウェーデン クロナ	キスウェーデン クロナ			
国債証券						
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	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)		キノルウェー クロネ	キノルウェー クロネ			
国債証券						
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,000	2,928	38,419	2031/9/17	
NGB 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 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	5,740	5,853	76,799	2026/2/19	
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	5,360	5,526	72,506	2027/2/17	
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	4,770	4,915	64,488	2025/3/13	
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	7,640	7,853	103,041	2029/9/6	
NGB 2% 04/26/28	2.0	6,100	6,386	83,788	2028/4/26	
NGB 2% 05/24/23	2.0	11,260	11,587	152,031	2023/5/24	
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,360	7,818	102,583	2024/3/14	
小 計				750,250		
(デンマーク)		キデンマーク クローネ	キデンマーク クローネ			
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	164,437	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)		キポーランドズロチ	キポーランドズロチ			
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)		キオーストラリア ドル	キオーストラリア ドル			
国債証券						
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	326,259	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	価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
				償還年月日		
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)			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 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	66,636	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)			千イスラエル シェケル	千イスラエル シェケル		
国債証券						
ILGOV 0.15%	07/31/23	0.15	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	価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
ILGOV 0.75%	07/31/22	0.75	6,750	6,803	229,891	2022/7/31
ILGOV 1%	03/31/30	1.0	2,220	2,186	73,885	2030/3/31
ILGOV 1.5%	05/31/37	1.5	2,190	2,077	70,202	2037/5/31
ILGOV 1.5%	11/30/23	1.5	1,750	1,807	61,089	2023/11/30
ILGOV 1.75%	08/31/25	1.75	1,080	1,145	38,693	2025/8/31
ILGOV 2.25%	09/28/28	2.25	2,880	3,144	106,243	2028/9/28
ILGOV 3.75%	03/31/24	3.75	4,080	4,480	151,396	2024/3/31
ILGOV 3.75%	03/31/47	3.75	3,130	3,983	134,621	2047/3/31
ILGOV 5.5%	01/31/42	5.5	2,580	4,095	138,374	2042/1/31
ILGOV 6.25%	10/30/26	6.25	5,620	7,292	246,435	2026/10/30
小 計					1,356,443	
合 計					298,426,352	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	EURO-SCHATZ	299	—
	US 5YR NOTE	543	—
	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カナダドル=90.81円	1メキシコペソ=5.5087円
1ユーロ=133.74円	1イギリスポンド=155.60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ポーランドズロチ=29.8401円
1オーストラリアドル=84.58円	1シンガポールドル=82.91円	1マレーシアリンギット=26.4846円
1イスラエルシェケル=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	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。

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 式 組 入 率	株 式 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率					
	円	%		%	%	%	%	%	百万円
第17期(2017年5月29日)	22,222	17.5	596.68	15.6	95.1	2.5	2.5	2.5	306,484
第18期(2018年5月29日)	24,481	10.2	644.41	8.0	92.8	4.9	2.2	2.2	336,874
第19期(2019年5月29日)	25,011	2.2	644.69	0.0	95.0	2.5	2.7	2.7	345,116
第20期(2020年5月29日)	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5	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	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 式 組 入 率	株 式 先 比	式 物 率	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率				
(当 期 首) 2020年 5月29日	円 25,857	% －	652.38	% －	% 92.9	% 4.2	% 2.5	% 2.5
6月末	26,354	1.9	663.23	1.7	95.3	2.3	2.4	2.4
7月末	27,231	5.3	686.51	5.2	95.7	1.8	2.4	2.4
8月末	29,318	13.4	735.60	12.8	96.0	1.5	2.3	2.3
9月末	28,168	8.9	705.43	8.1	94.7	3.0	2.3	2.3
10月末	27,382	5.9	686.46	5.2	94.0	3.8	2.3	2.3
11月末	30,537	18.1	765.01	17.3	94.8	3.0	2.2	2.2
12月末	31,417	21.5	786.13	20.5	95.9	2.1	2.1	2.1
2021年 1月末	32,066	24.0	800.16	22.7	95.5	2.3	2.1	2.1
2月末	33,155	28.2	829.14	27.1	95.9	1.9	2.2	2.2
3月末	35,378	36.8	877.34	34.5	96.1	1.7	2.2	2.2
4月末	37,039	43.2	920.75	41.1	96.0	1.7	2.2	2.2
(当 期 末) 2021年 5月31日	円 37,583	% 45.3	934.05	% 43.2	% 95.3	% 2.5	% 2.2	% 2.2

(注1) 騰落率は期首比です。

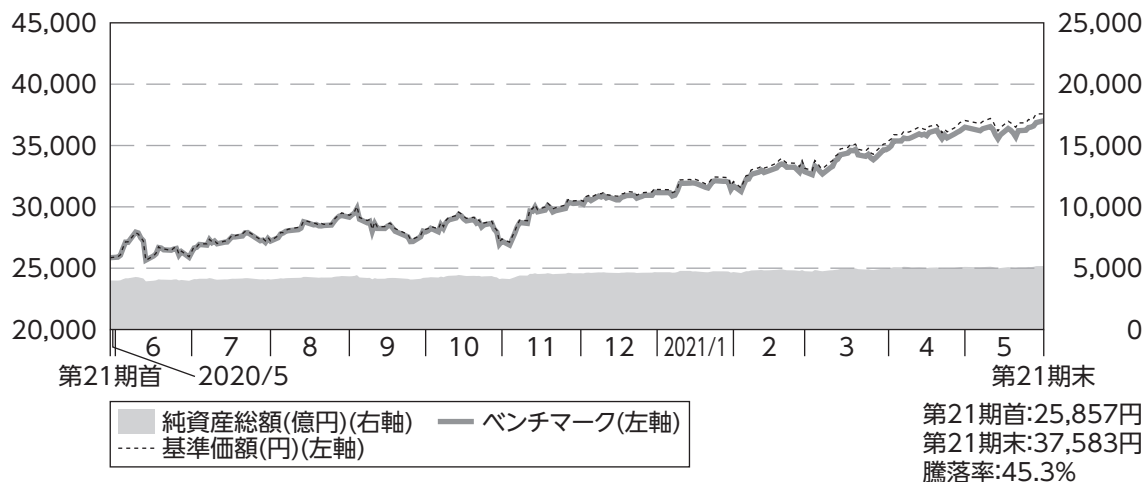
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

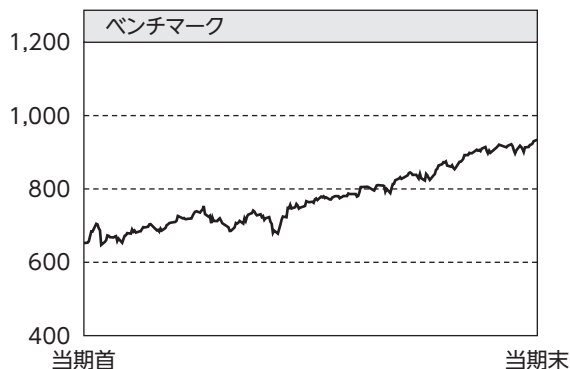


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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

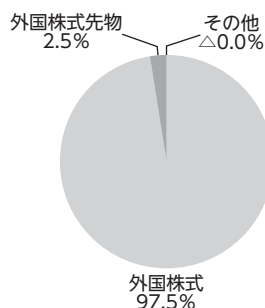
○上位10銘柄

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%

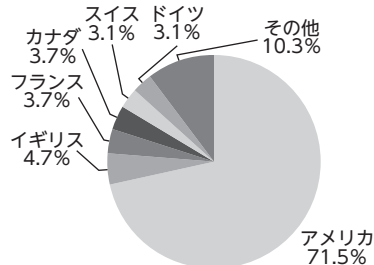
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.3%
8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	0.9%
9	TESLA INC	アメリカ	0.9%
10	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	0.8%
組入銘柄数			1,301

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

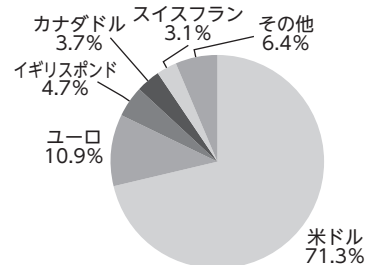
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

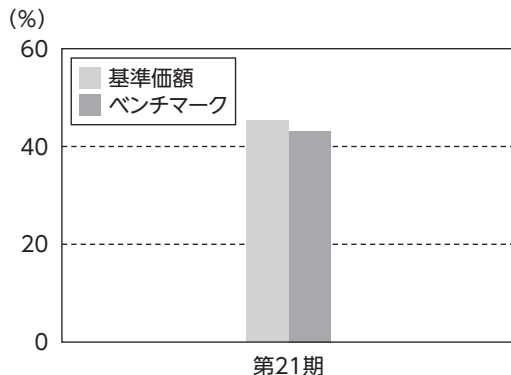


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (0) (0) (－) (－) (0) (－) (0)	0.003% (0.001) (0.000) (－) (－) (0.000) (－) (0.002)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	1 (1) (0) (－) (－) (－) (0)	0.003 (0.003) (0.000) (－) (－) (－) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	9 (9) (－) (0)	0.030 (0.028) (－) (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	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)
	イ ギ リ ス	12,672 (13,240)	千イギリスポンド 8,496 (6,616)	44,807 (6,945)	千イギリスポンド 22,681 (1,024)
	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
国					

		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		売却	
	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
	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 (17)	115 (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 (34)	511 (107)	30 (17)	538 (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 (174)	99 (340)	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	— (10)	— (18)	—	—
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	—	—	— (243)	— (403)
	SUNTEC REIT	—	—	173	245
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	365 (4)	746 (5)	96	202
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	— (—)	— (△2)	—	—
	小計	417 (189)	845 (361)	269 (243)	447 (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 首 (前期末)	株 数 (百株)	当 期 末 評 価 額 (千円)	業 種
(アメリカ)			千米ドル	
ABBOTT LABORATORIES	1,686	1,527	17,818	ヘルスケア機器・サービス
AES CORP	617	617	1,569	公益事業
INTL BUSINESS MACHINES CORP	844	774	11,132	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	432	386	6,570	保険
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	210	191	5,728	素材
ALLEGHANY CORP	12	12	914	保険
RALPH LAUREN CORPORATION	45	—	—	耐久消費財・アパレル
ALLSTATE CORP	309	264	3,609	保険
HONEYWELL INTL INC	694	—	—	資本財
HESS CORP	248	248	2,082	エネルギー
AMERICAN EXPRESS	663	594	9,514	各種金融
AMERICAN ELECTRIC POWER	471	—	—	公益事業
AFLAC	686	580	3,289	保険
AMERICAN INT'L GROUP	831	752	3,974	保険
JONES LANG LASALLE INC	44	—	—	不動産
VALERO ENERGY CORP	392	346	2,788	エネルギー
APACHE CORP	642	—	—	エネルギー
ALBEMARLE CORP	101	101	1,700	素材
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	521	483	3,215	食品・飲料・タバコ
PINNACLE WEST CAPITAL	107	107	911	公益事業
AMEREN CORPORATION	231	208	1,759	公益事業
ARROW ELECTRONICS INC	78	61	734	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AUTOLIV INC	101	67	718	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	22	19	2,793	小売
AVERY DENNISON CORP	74	74	1,644	素材
BALL CORP	291	279	2,294	素材
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,258	1,183	34,256	各種金融
BANK NEW YORK CO	792	712	3,713	各種金融
BAXTER INTERNATIONAL	462	440	3,615	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	258	251	6,074	ヘルスケア機器・サービス
AMETEK INC	222	196	2,656	資本財
VERIZON COMMUNICATIONS	3,944	3,569	20,162	電気通信サービス
WR BERKLEY CORP	140	117	913	保険
BEST BUY COMPANY INC	227	198	2,309	小売
BIO-RAD LABORATORIES-A	21	18	1,116	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	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	505	457	1,735	公益事業
BOEING CO	519	476	11,779	資本財
ROBERT HALF INTL INC	95	95	849	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	198	197	1,014	自動車・自動車部品
BOSTON BEER COMPANY INC-A	—	7	787	食品・飲料・タバコ
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,330	1,236	5,261	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	22	20	2,668	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	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	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	70	63	840	保険

銘柄	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)			
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		
FLOWERVE 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
ENTERGY 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	株数 (百株)	株数 (百株)	期末		業種
			評価額	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 VTG 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)	株数 (百株)	当期	期末	業種
			評価額	邦貨換算金額 (千円)	
			外貨建金額		
NUCOR CORP		290	2,621	287,728	素材
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		444	6,479	711,217	各種金融
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP		854	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	3,461	379,962	資本財
PPL CORPORATION		691	2,034	223,351	公益事業
PENTAIR PLC		135	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	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	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	7,146	784,357	銀行
BROWN & BROWN INC		229	1,043	114,559	保険
POLARIS INC		46	—	—	耐久消費財・アパレル
PPG INDUSTRIES INC		221	3,691	405,133	素材
QUEST DIAGNOSTICS		128	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	5,011	550,080	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE		472	2,687	294,945	公益事業
PULTE GROUP INC		219	1,434	157,421	耐久消費財・アパレル
GLOBAL PAYMENTS INC		286	4,899	537,748	ソフトウェア・サービス
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		119	1,368	150,245	各種金融
RENAISSANCE HOLDINGS LTD		51	749	82,280	保険
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		54	838	92,017	保険
RESMED INC		134	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	744	81,752	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		101	4,196	460,640	資本財
ROCKWELL AUTOMATION INC		112	2,620	287,664	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		152	1,797	197,242	消費者サービス
RPM INTERNATIONAL INC		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	15,565	1,708,453	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE		240	3,583	393,290	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES		586	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	3,076	337,684	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED		136	1,007	110,578	食品・飲料・タバコ
ANTHEM INC		241	8,385	920,416	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP		146	1,479	162,410	ヘルスケア機器・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		79	6,214	682,062	素材
CENTENE CORP		557	3,775	414,442	ヘルスケア機器・サービス
SMITH (A.O.) CORP		121	863	94,746	資本財
ACUITY BRANDS INC		35	—	—	資本財
SNAP-ON INC		49	1,247	136,940	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		376	3,728	409,186	保険

銘	柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種
		株	数	株	数	評 価 額			
						外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)		
		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	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種
			株 数 (百株)	評 価 額	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	190	190	1,014	111,297	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	118	101	2,646	290,476	各種金融
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	531	485	5,480	601,545	各種金融
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	159	—	—	—	耐久消費財・アパレル
LIVE NATION ENTERTAINMENT	126	139	1,253	137,556	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	25	23	3,291	361,261	消費者サービス
TRANSDIGM GROUP INC	46	44	2,871	315,133	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	856	765	27,591	3,028,491	ソフトウェア・サービス
HANESBRANDS INC	311	—	—	—	耐久消費財・アパレル
WESTERN UNION CO	387	387	948	104,094	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	104	86	921	101,162	資本財
LEIDOS HOLDINGS	128	112	1,152	126,537	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	113	—	—	—	資本財
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	84	—	—	—	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	109	97	1,553	170,529	ソフトウェア・サービス
DELTA AIR LINES INC	150	146	696	76,454	運輸
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	76	—	—	—	エネルギー
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	290	261	3,062	336,189	各種金融
TE CONNECTIVITY LTD	319	293	3,987	437,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONCHO RESOURCES INC	192	—	—	—	エネルギー
WABCO HOLDINGS INC	49	—	—	—	資本財
VMWARE INC-CLASS A	78	78	1,242	136,335	ソフトウェア・サービス
INVESCO LTD	309	357	1,020	111,996	各種金融
MSCI INC	79	72	3,386	371,748	各種金融
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,484	1,354	13,061	1,433,602	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,633	1,464	33,281	3,652,926	ソフトウェア・サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	169	154	2,397	263,119	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	620	571	3,534	387,922	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	128	128	1,321	145,045	資本財
KINDER MORGAN INC	1,946	1,794	3,290	361,186	エネルギー
XYLEM INC	175	152	1,796	197,182	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	255	226	2,553	280,264	素材
PVH CORP	72	—	—	—	耐久消費財・アパレル
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	35	761	83,581	資本財
EPAM SYSTEMS INC	52	47	2,270	249,158	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	259	232	5,002	549,093	ヘルスケア機器・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	80	71	1,963	215,496	ソフトウェア・サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	158	148	2,838	311,551	銀行
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	134	113	965	105,934	商業・専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	200	—	—	—	エネルギー
LEAR CORP	52	52	1,022	112,207	自動車・自動車部品
DOLLAR GENERAL CORP	245	209	4,254	466,968	小売
GENERAC HOLDINGS INC	—	58	1,906	209,265	資本財
GENERAL MOTORS CO	1,209	1,140	6,763	742,411	自動車・自動車部品
XPO LOGISTICS INC	80	80	1,175	129,032	運輸
ALLY FINANCIAL INC	360	314	1,720	188,826	各種金融
CAPRI HOLDINGS LTD	115	—	—	—	耐久消費財・アパレル
APTIV PLC	244	235	3,540	388,647	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	424	381	3,209	352,316	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	79	79	774	84,997	ソフトウェア・サービス
INGREDION INC	58	—	—	—	食品・飲料・タバコ

銘	柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種
		株数 (百株)	株数 (百株)	評 価 額		邦貨換算金額 (千円)			
				外 貨 建 金 額					
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	株数 (百株)	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	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)		
APPLIED MATERIALS		881	794	10,969	1,203,977	半導体・半導体製造装置	
AUTODESK INC		209	189	5,421	595,014	ソフトウェア・サービス	
AUTOMATIC DATA PROCESS		412	367	7,206	790,983	ソフトウェア・サービス	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		131	112	1,095	120,247	運輸	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE		107	97	1,806	198,334	メディア・娯楽	
VERISIGN INC		100	87	1,926	211,452	ソフトウェア・サービス	
SIRIUS XM HOLDINGS INC		1,484	995	622	68,289	メディア・娯楽	
CSX CORP		717	658	6,590	723,329	運輸	
SEAGATE TECHNOLOGY		228	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHECK POINT SOFTWARE TECH		119	104	1,226	134,637	ソフトウェア・サービス	
CITRIX SYSTEMS INC		124	104	1,200	131,782	ソフトウェア・サービス	
CERNER CORP		300	273	2,142	235,176	ヘルスケア機器・サービス	
CINCINNATI FINANCIAL CORP		148	127	1,556	170,873	保険	
CINTAS CORP		82	80	2,843	312,104	商業・専門サービス	
CISCO SYSTEMS		4,045	3,640	19,260	2,114,011	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COPART INC		197	180	2,330	255,831	商業・専門サービス	
COGNEX CORP		162	162	1,288	141,425	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MARRIOTT INTL A		265	243	3,497	383,913	消費者サービス	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A		522	460	3,292	361,358	ソフトウェア・サービス	
COSTAR GROUP INC		35	34	2,906	318,980	商業・専門サービス	
DOLLAR TREE INC		226	201	1,964	215,647	小売	
EBAY		739	593	3,612	396,514	小売	
E*TRADE FINANCIAL CORP		211	—	—	—	各種金融	
CADENCE DESIGN SYSTEMS		263	247	3,141	344,836	ソフトウェア・サービス	
DISH NETWORK CORPORATION-A		241	201	876	96,165	メディア・娯楽	
ELECTRONIC ARTS INC		278	249	3,565	391,321	メディア・娯楽	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A		21	21	435	47,816	保険	
EXPEDITORS INTL WASH INC		158	142	1,793	196,892	運輸	
FASTENAL CO		558	487	2,588	284,074	資本財	
FIFTH THIRD BANCORP		679	613	2,585	283,812	銀行	
FISERV INC		551	516	5,955	653,624	ソフトウェア・サービス	
FLIR SYSTEMS INC		116	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FLEX LTD		489	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DENTSPLY SIRONA INC		201	201	1,350	148,283	ヘルスケア機器・サービス	
GILEAD SCIENCES INC		1,206	1,079	7,138	783,491	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NVIDIA CORP		554	534	34,719	3,810,833	半導体・半導体製造装置	
HASBRO INC		124	124	1,196	131,333	耐久消費財・アパレル	
HENRY SCHEIN INC		140	117	893	98,042	ヘルスケア機器・サービス	
F5 NETWORKS INC		53	53	992	108,887	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HOLOGIC INC		244	216	1,367	150,105	ヘルスケア機器・サービス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		171	171	1,327	145,686	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC		83	70	1,209	132,776	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC		990	854	1,355	148,806	銀行	
BIOGEN INC		172	134	3,607	395,988	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTUIT INC		248	235	10,348	1,135,848	ソフトウェア・サービス	
IDEXX LABORATORIES INC		81	74	4,151	455,638	ヘルスケア機器・サービス	
IONIS PHARMACEUTICALS INC		128	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTEL CORP		4,148	3,504	20,015	2,196,942	半導体・半導体製造装置	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC		73	62	969	106,440	ソフトウェア・サービス	
INCYTE CORP		175	175	1,466	160,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KLA CORP		150	136	4,325	474,737	半導体・半導体製造装置	

銘	柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種
		株数 (百株)	株数 (百株)	評	価	額			
							外貨建金額		
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	邦貨換算金額 (千円)	
				外 貨 建 金 額		
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	業 種	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	ソフトウェア・サービス	99	99	1,339	146,996	ソフトウェア・サービス
NEWS CORP-CLASS A	メディア・娯楽	334	334	903	99,178	メディア・娯楽
HD SUPPLY HOLDINGS INC	資本財	152	—	—	—	資本財
CDW CORP/DE	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	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	運輸	99	—	—	—	運輸
KEURIG DR PEPPER INC	食品・飲料・タバコ	—	595	2,202	241,764	食品・飲料・タバコ
COUPA SOFTWARE INC	ソフトウェア・サービス	—	60	1,443	158,411	ソフトウェア・サービス
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	ソフトウェア・サービス	—	35	2,104	230,975	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	メディア・娯楽	186	186	834	91,610	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A	メディア・娯楽	63	63	278	30,592	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	メディア・娯楽	152	172	751	82,446	メディア・娯楽
OKTA INC	ソフトウェア・サービス	100	102	2,275	249,765	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	378	352	16,641	1,826,582	半導体・半導体製造装置
MONGODB INC	ソフトウェア・サービス	46	46	1,349	148,136	ソフトウェア・サービス
DOCUSIGN INC	ソフトウェア・サービス	101	155	3,133	343,897	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	ソフトウェア・サービス	50	50	1,301	142,896	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	242	288	788	86,590	ソフトウェア・サービス
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	各種金融	—	43	614	67,396	各種金融
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	ソフトウェア・サービス	—	175	5,816	638,440	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	耐久消費財・アパレル	—	217	2,397	263,171	耐久消費財・アパレル
NOVAVAX INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	メディア・娯楽	339	276	1,033	113,384	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	メディア・娯楽	150	150	547	60,097	メディア・娯楽
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	ソフトウェア・サービス	—	156	3,486	382,669	ソフトウェア・サービス
LYFT INC-A	運輸	—	212	1,215	133,394	運輸
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	各種金融	—	90	759	83,322	各種金融
CARLYLE GROUP INC/THE	各種金融	—	125	549	60,329	各種金融
10X GENOMICS INC-CLASS A	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	ソフトウェア・サービス	—	158	1,439	157,969	ソフトウェア・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	—	179	1,717	188,540	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PPD INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	ソフトウェア・サービス	241	—	—	—	ソフトウェア・サービス
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	ソフトウェア・サービス	—	139	802	88,116	ソフトウェア・サービス
LIBERTY MEDIA CORP -RIGHT	メディア・娯楽	20	—	—	—	メディア・娯楽
IAC/INTERACTIVECORP	メディア・娯楽	—	67	1,071	117,640	メディア・娯楽
AIRBNB INC-CLASS A	消費者サービス	—	46	654	71,889	消費者サービス
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	消費者サービス	—	175	1,886	207,097	消費者サービス
DRAFTKINGS INC - CL A	消費者サービス	—	156	782	85,932	消費者サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	半導体・半導体製造装置	—	704	3,402	373,431	半導体・半導体製造装置
HORIZON THERAPEUTICS PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	ソフトウェア・サービス	31	31	392	43,055	ソフトウェア・サービス
CDK GLOBAL INC	ソフトウェア・サービス	106	—	—	—	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	半導体・半導体製造装置	106	96	1,768	194,095	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-A	メディア・娯楽	—	25	417	45,874	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	メディア・娯楽	102	135	2,247	246,693	メディア・娯楽
BIO-TECHNE CORP	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	—	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	メディア・娯楽	—	54	650	71,370	メディア・娯楽
SOLAREDEGE TECHNOLOGIES INC	半導体・半導体製造装置	—	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	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)	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		569	550	1,652	150,086	素材
TELUS CORP		329	329	897	81,463	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFECO INC		237	237	883	80,229	保険
IMPERIAL OIL		247	247	987	89,634	エネルギー
ENBRIDGE		1,939	1,731	8,046	730,746	エネルギー
IGM FINANCIAL INC		76	76	341	31,034	各種金融
MANULIFE FINANCIAL CORP		1,901	1,630	4,115	373,731	保険
LOBLAW COMPANIES LTD		179	129	959	87,173	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC		279	232	2,828	256,837	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC		569	507	3,299	299,598	保険
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		26	21	1,210	109,904	保険
METRO INC		249	188	1,102	100,085	食品・生活必需品小売り
HUSKY ENERGY INC		314	—	—	—	エネルギー
EMERA INC		237	237	1,339	121,619	公益事業
METHANEX CORP		70	—	—	—	素材
ONEX CORP		66	66	584	53,072	各種金融
TC ENERGY CORP		885	823	5,082	461,569	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP		—	184	748	67,979	素材
POWER CORP OF CANADA		515	515	2,031	184,445	保険
QUEBECOR INC -CL B		152	152	499	45,315	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA		1,372	1,228	15,426	1,400,893	銀行
CP RAILWAY LIMITED		131	575	5,648	512,958	運輸
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		450	354	1,279	116,186	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY		1,473	1,321	3,687	334,893	エネルギー
LUNDIN MINING CORP		622	622	807	73,310	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B		456	405	1,208	109,763	素材
THOMSON REUTERS CORP		187	150	1,776	161,309	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD		—	77	845	76,798	資本財
TORONTO-DOMINION BANK		1,734	1,563	13,610	1,236,010	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD		43	78	725	65,845	素材
WESTON (GEORGE) LTD		68	68	813	73,911	食品・生活必需品小売り
KINROSS GOLD CORP		1,253	1,084	1,061	96,416	素材
INTACT FINANCIAL CORP		130	130	2,139	194,294	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		455	395	2,290	208,013	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC		19	16	2,879	261,530	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP		182	169	3,063	278,203	素材
B2GOLD CORP		—	902	557	50,644	素材
CI FINANCIAL CORP		186	—	—	—	各種金融
KEYERA CORP		186	186	557	50,623	エネルギー
PARKLAND CORP		110	140	557	50,601	エネルギー
ALTAS 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	株数 (百株)	当期首(前期末)	株数 (百株)	期 末		業 種
				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 ・ 金 額 銘 柄 数 <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 -PPD	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-PPD	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)	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)
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
PORSCHЕ 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
BRENNTAG 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		株 数 ・ 金 額	22,405	21,283	113,879	15,230,237
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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	48,369 19	46,163 20	23,612 —	3,157,956 <0.6%>	
(フランス)						
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
WORLDLINE 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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	19,456 27	16,910 29	67,037 —	8,965,637 <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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	49,159 23	39,636 20	31,754 —	4,246,861 <0.8%>	
(ベルギー)						
UMICORE		176	176	869	116,335	素材
KBC GROEP NV		240	210	1,414	189,144	銀行
SOFINA		—	12	417	55,797	各種金融
SOLVAY SA		69	69	767	102,612	素材
UCB (GROUPE)		124	118	915	122,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA		54	54	270	36,241	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		82	106	989	132,311	各種金融
AGEAS		160	160	853	114,130	保険

銘		柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種
			株数 (百株)	株数 (百株)	評 価 額					
					外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)				
PROXIMUS			131	131	219	29,393	電気通信サービス			
GALAPAGOS NV			43	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
ELIA GROUP SA/NV			—	29	261	34,933	公益事業			
TELENET GROUP HOLDING NV			49	—	—	—	メディア・娯楽			
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV			728	637	3,976	531,822	食品・飲料・タバコ			
国 小 計	株 数 ・ 金 額	1,860	1,706	10,955	1,465,202					
	銘 柄 数 <比 率>	11	11	—	<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	801	625	2,406	321,899					
	銘 柄 数 <比 率>	6	5	—	<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	2,507	2,212	3,955	529,046					
	銘 柄 数 <比 率>	5	5	—	<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	8,880	7,930	12,988	1,737,054					
	銘 柄 数 <比 率>	12	11	—	<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	2,909	1,298	8,596	1,149,749					
	銘 柄 数 <比 率>	7	5	—	<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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,100 3	2,998 3	1,979 —	264,760 <0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 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
ASHTHEAD 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		
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		株数・金額 銘柄数<比率>	281,854 94	256,015 84	150,692 —	23,447,822 <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		株数・金額 銘柄数<比率>	16,620 39	14,980 40	127,071 —	15,491,273 <3.0%>				

銘		柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種					
			株	数	株	数	評	価			額				
												外	貨	建	金
			株	数	株	数	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	23,444	28,992	467,083		6,165,495								
銘柄数<比率>			32	45	—		<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		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)		
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 10	5,356 11	81,272 —	1,066,293 <0.2%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG AS-B		103	86	9,700	174,420	食品・飲料・タバコ
A P MOLLER-MAERSK A/S-B		6	5	8,668	155,861	運輸
A P MOLLER - MAERSK A/S - A		2	2	4,816	86,607	運輸
GN STORE NORD A/S		—	119	6,210	111,671	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S		593	648	7,450	133,955	銀行
GENMAB A/S		63	51	12,954	232,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S		218	191	8,524	153,261	素材
ROCKWOOL INTL A/S-B SHS		—	7	2,287	41,131	資本財
DSV PANALPINA A S		204	181	27,004	485,538	運輸
DEMANT A/S		116	116	3,784	68,037	ヘルスケア機器・サービス
VESTAS WIND SYSYEMS A/S		176	873	20,865	375,155	資本財
NOVO NORDISK A/S-B		1,692	1,478	71,372	1,283,283	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S		48	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLOPLAST-B		112	92	8,928	160,526	ヘルスケア機器・サービス
TRYG A/S		98	297	4,315	77,591	保険
PANDORA A/S		84	94	7,767	139,652	耐久消費財・アパレル
CHR HANSEN HOLDING A/S		103	103	5,668	101,912	素材
AMBU A/S-B		—	135	3,156	56,762	ヘルスケア機器・サービス
ISS A/S		142	—	—	—	商業・専門サービス
ORSTED A/S		184	154	14,413	259,161	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3,952 17	4,640 18	227,889 —	4,097,445 <0.8%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
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)
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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	67,883 59	57,250 53	128,183 —	10,841,775 <2.1%>	

銘		柄	当期首(前期末)	当		期		末	業	種
			株数 (百株)	株数 (百株)	評		価	額		
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)				
(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・金額 銘柄数<比率>	7,137 8	6,238 7	5,090 —	404,179 <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			
WHEELOCK & 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・金額 銘柄数<比率>	82,106 34	68,995 30	346,355 —	4,897,472 <0.9%>				

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)
(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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	37,187 20	28,969 14	18,675 —	1,548,352 <0.3%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOLIM 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 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,313 8	3,992 8	16,307 —	551,031 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,036,450 1,248	947,412 1,233	— —	493,356,734 <95.3%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜外国投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	口	数 (千口)	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	1,955	214,656
BOSTON PROPERTIES		14	1,531	168,118
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		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 PTY	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	口 数 ・ 金 額	1,244	1,058	85,341	9,367,107
	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	口 数 ・ 金 額	51	24	820	74,489
	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	口 数 ・ 金 額	43	37	2,134	285,432
	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	口 数 ・ 金 額	244	252	1,988	309,350
	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 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 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	S&P 500 EMIN	9,571	—
	S&P/TSE 60	819	—
	SWISS MKT IX	473	—
	DJ EURO STOXX	1,016	—
	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イスラエルシェケル=33.7909円		

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

項 目	当 期 自 2020年5月30日 至 2021年5月31日
(A)配 当 等 収 益	8,039,244,093円
受 取 配 当 金	8,026,131,811
受 取 利 息	49,618
そ の 他 収 益 金	24,298,172
支 払 利 息	△11,235,508
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	161,089,371,491
売 益	166,992,668,445
売 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 ファンド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 ファンド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・イヤーファンド(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・イヤーファンド(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・イヤーファンド(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・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2,542,406円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	2,058,786円

お知らせ

該当事項はありません。

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2020年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万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		ベンチマーク		R E I T 先 物 率	投 信 託 証 券 率 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰	中 落 率	期 騰	中 落 率			
第 9 期 (2016年11月10日)	円	%		%	%	%	百万円
	15,287	6.0	15,167	5.9	1.8	98.2	68,806
第10期 (2017年11月10日)	14,567	△4.7	14,447	△4.7	2.0	98.0	82,590
第11期 (2018年11月12日)	16,899	16.0	16,737	15.9	2.5	97.5	103,475
第12期 (2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441
第13期 (2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598

(注) REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		R E I T 先 物 率	投 信 託 証 券 率 組 入 比 率
	騰	落 率	騰	落 率		
(当 期 首) 2019年11月11日	円	%		%	%	%
	21,338	—	21,125	—	2.6	97.4
11月末	21,895	2.6	21,676	2.6	2.6	97.4
12月末	21,256	△0.4	21,042	△0.4	2.6	97.4
2020年 1月末	22,014	3.2	21,792	3.2	2.5	97.4
2月末	20,151	△5.6	19,946	△5.6	2.5	97.4
3月末	15,949	△25.3	15,809	△25.2	3.7	96.3
4月末	15,805	△25.9	15,666	△25.8	3.5	96.5
5月末	17,106	△19.8	16,957	△19.7	3.4	96.5
6月末	16,815	△21.2	16,672	△21.1	3.4	96.8
7月末	16,859	△21.0	16,715	△20.9	3.4	96.6
8月末	17,814	△16.5	17,661	△16.4	3.3	96.6
9月末	17,644	△17.3	17,490	△17.2	3.2	96.8
10月末	16,759	△21.5	16,608	△21.4	3.4	96.6
(当 期 末) 2020年11月10日	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6

(注1) 騰落率は期首比です。

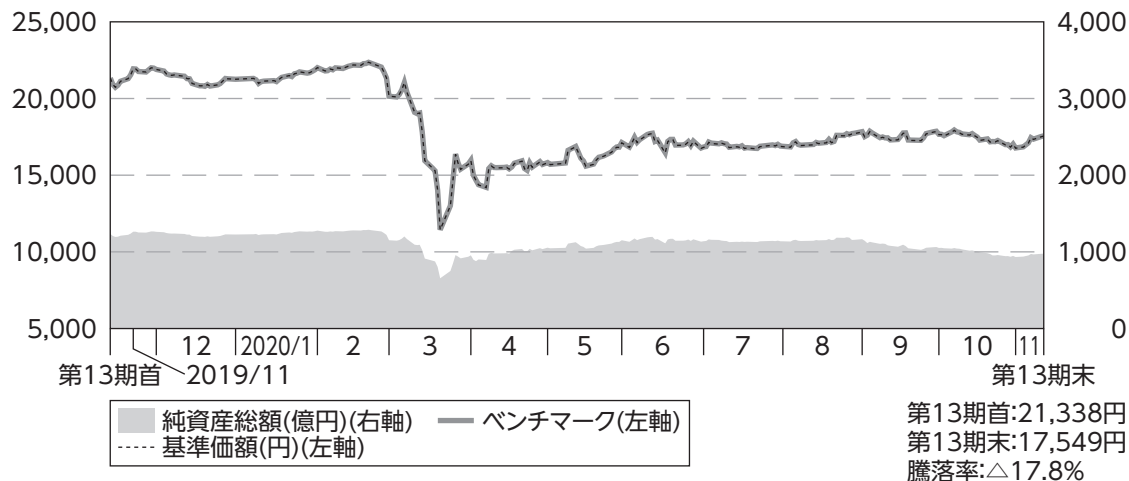
(注2) REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証REIT指数 (配当込み) です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

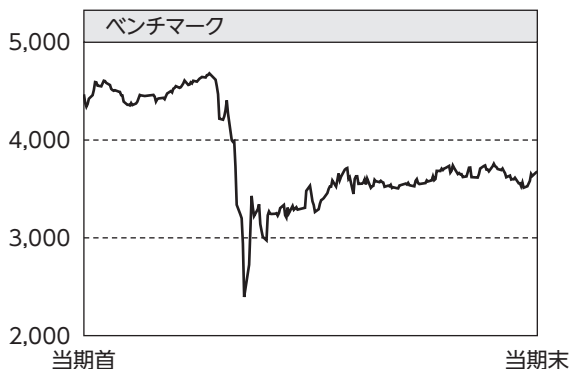


(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



当期のJ-REIT市場は大幅に下落しました。

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

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

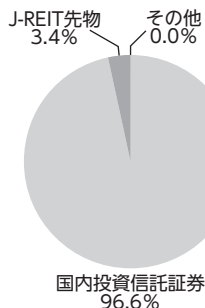
○上位10銘柄

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

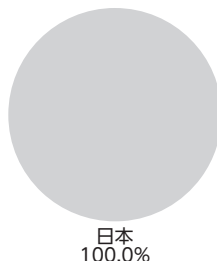
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日本リテールファンド投資法人	日本	3.4%
8	オリックス不動産投資法人	日本	3.4%
9	東証REIT指数先物 2012	日本	3.4%
10	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数		63	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

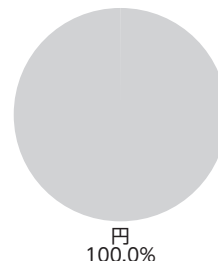
○資産別配分



○国別配分



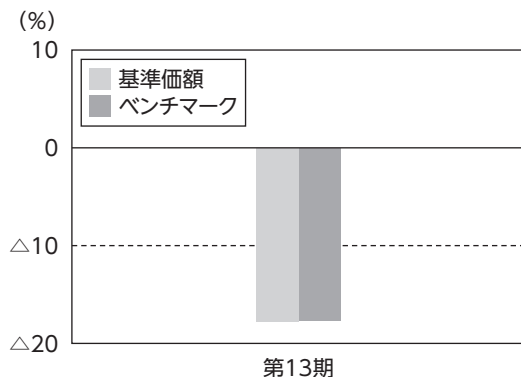
○通貨別配分



(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。
 (注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランズでJ-REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して3.4%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドの基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2019年11月12日～2020年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (－) (－) (－) (－) (1) (－) (0)	0.004% (－) (－) (－) (－) (0.003) (－) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	－ (－) (－) (－) (－) (－) (－)	(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	1	0.004	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(18,338円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当		期	
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国		口	千円	口	千円
	エスコンジャパンリート投資法人	1,051 (51)	112,040 (6,325)	530	57,293
	エスコンジャパンリート投資法人	51 (△51)	6,325 (△6,325)	—	—
	サンケイリアルエステート投資法人	1,733	164,128	780	77,311
	S O S i L A 物流リート投資法人	3,065	366,353	758	102,140
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,028	632,665	1,212	765,814
	MCUBS M i d C i t y 投資法人	4,979	442,068	5,249	437,990
	森ヒルズリート投資法人	3,849	549,348	4,237	605,359
	産業ファンド投資法人	6,104	1,001,447	4,889	872,465
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,922	913,615	3,434	1,076,189
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,323	417,384	2,357	439,835
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,546	580,518	1,824	775,644
	G L P 投資法人	12,577	1,875,737	9,975	1,582,142
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,485 (36)	467,252 (11,963)	1,545	488,920
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	36 (△36)	11,963 (△11,963)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	5,350	1,563,789	5,356	1,796,587
	星野リゾート・リート投資法人	466	191,471	550	278,429
	O n e リート投資法人	479	121,881	566	151,824
	イオンリート投資法人	3,313	378,027	4,584	546,821
	ヒューリックリート投資法人	2,615	357,830	3,556	515,030
	日本リート投資法人	1,001	341,913	1,181	444,921
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	19,921	304,977	23,484	368,471
	日本ヘルスケア投資法人	47 (△538)	9,597 (△108,223)	38	7,976
	積水ハウス・リート投資法人	9,112	646,413	10,554	814,642
	トーセイ・リート投資法人	700	73,033	784	88,006
	ケネディクス商業リート投資法人	1,181	222,019	1,587	341,808
	ヘルスケア&メディカル投資法人	654	76,638	772	95,993
	サムティ・レジデンシャル投資法人	603	57,204	794	80,515
	野村不動産マスターファンド投資法人	11,052	1,590,017	11,589	1,673,914
	いちごホテルリート投資法人	622	43,078	618	49,305
	ラサールロジポート投資法人	3,676 (1,048)	585,395 (185,157)	3,328	568,379
内					

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

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

(注1)金額は受渡代金です。

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

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

<先物取引の種類別取引状況>

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

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

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

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

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

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

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

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

①資産運用会社

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

②一般事務受託会社

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

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 証 券	94,277,687	96.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,705,589	3.8
投 資 信 託 財 産 総 額	97,983,276	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

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

■損益の状況

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

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は57,851,231,573円、期中追加設定元本額は16,846,850,301円、期中一部解約元本額は19,084,357,120円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

お知らせ

該当事項はありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2020年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万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	騰 落 率	ベンチマーク		投資信託証券 組入比率	純 資 産 額
			期 騰 落	中 率		
第 9 期 (2016年11月10日)	円	%	15,697	%	%	百万円
第10期 (2017年11月10日)	14,778	△10.1	19,040	△9.6	99.6	59,975
第11期 (2018年11月12日)	17,843	20.7	19,461	21.3	99.3	63,032
第12期 (2019年11月11日)	18,126	1.6	21,365	2.2	99.4	74,818
第13期 (2020年11月10日)	19,790	9.2	18,254	9.8	99.4	88,663
	16,838	△14.9		△14.6	99.6	80,213

当期中の基準価額と市況の推移

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

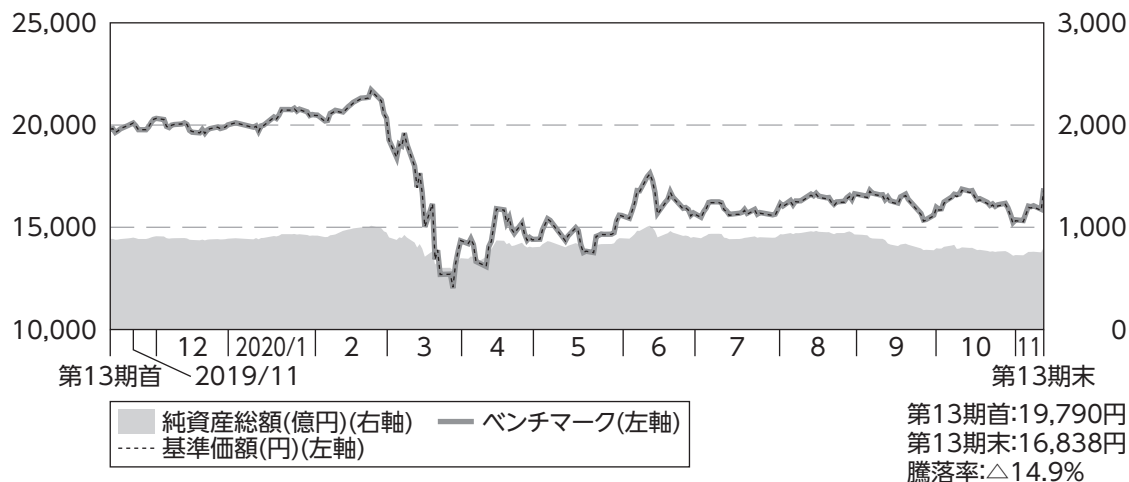
(注) 騰落率は期首比です。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

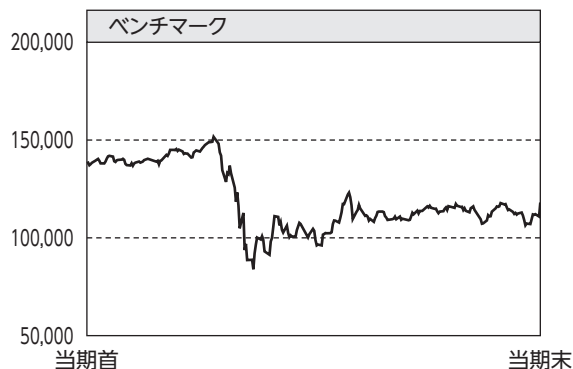


(注)ベンチマークは、2019年11月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



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

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

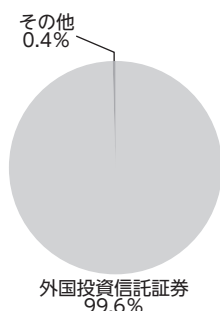
○上位10銘柄

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

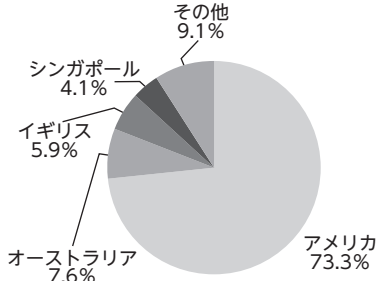
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	2.0%
8	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	2.0%
9	REALTY INCOME CORP	アメリカ	1.8%
10	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	アメリカ	1.7%
組入銘柄数		322	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

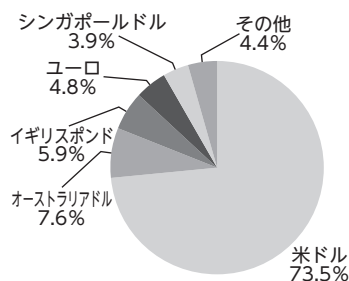
○資産別配分



○国別配分



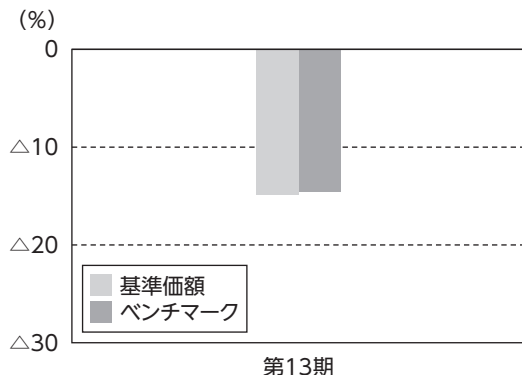
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当課税要因※(マイナス要因)です。

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

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

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(17,080円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外国	ア メ リ カ	百株 — (97)	千米ドル — (37)	百株 97	千米ドル 31

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

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

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	20,000 (△59,427)	13 (一)	6,603	13
	ESSEX PROPERTY TRUST	16,080	3,731	14,218	3,128
	EQUITY RESIDENTIAL PPTY	81,453	5,108	74,887	4,349
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	17,204	1,551	15,336	1,315
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	35,607	1,364	30,345	1,281
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	157,540	4,159	110,979	3,105
	EQUITY COMMONWEALTH	28,299	913	23,487	713
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,678	691	16,989	502
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,564	765	19,002	730
	SERVICE PROPERTIES TRUST	23,210	235	21,326	160
	WELLTOWER INC	108,049	5,789	86,178	5,008
	EASTGROUP PROPERTIES, INC	7,448	832	5,782	781
	KIMCO REALTY CORP	81,129	947	60,960	717
	KILROY REALTY CORPORATION	29,020	1,876	18,604	1,058
	LTC PROPERTIES INC	18,886	698	15,200	574
	DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37,000	128	38,000 (一)	141 (37)
	MONMOUTH REIT -CL A	31,652	430	25,060	361
	LIBERTY PROPERTY TRUST	— (△96,240)	— (△5,649)	—	—
	BRANDYWINE REALTY TRUST	48,222	556	45,380	487
	IRON MOUNTAIN INC	56,157	1,431	46,375	1,327
	MACERICH CO/THE	23,730 (4,667)	261 (34)	27,250	198
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	39,100	2,348	42,678	2,776
	ACADIA REALTY TRUST	19,260	237	19,710	224
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	144,716	1,681	143,932	1,692
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,530	2,955	23,622	2,811
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,800	72	14,000	86
	NATL HEALTH INVESTORS INC	8,885	511	8,091	510
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,510	190	—	—
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	5,000 (199)	62 (3)	—	—
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	30,000	27	61,970	36

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

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

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

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	28,800	233	24,000	245
	GLOBAL NET LEASE INC	31,482	504	24,490	409
	MANULIFE US REAL ESTATE INV	330,000 (一)	267 (△15)	300,000	223
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	48,660	577	42,540	515
	VICI PROPERTIES INC	148,496	3,095	85,891	2,008
	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	9,000	72	6,300	88
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	14,730	279	12,670	336
	COLONY CAPITAL INC	244,724	753	202,578	612
	小計	7,094,354 (△81,545)	208,716 (174)	5,193,803 (一)	172,455 (37)
	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,646	227	9,500	194
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	26,690	1,301	23,160	1,115
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	25,079	213	23,000	235
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	34,686	726	34,305	625
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	9,692	460	9,600	349
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	17,620	145	15,000	106
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	16,087	535	31,950	1,143
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,500	119	5,500	162
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	19,210	237	13,000	168
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	24,250	336	14,760	192
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	30,170	312	11,000	125
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	5,000	100	—	—
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	—	—	57,280	386
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	30,550	416	21,400	265
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	25,000	272	11,000	131
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,920	525	5,750	444
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,800	80	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	28,010	347	15,000	192
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	10,500	239	—	—
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	10,000	113	23,270	346
	PLAZA RETAIL REIT	25,000	90	—	—
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	128,715	2,343	53,900	905
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	32,500	598	9,000	149

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

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	COFINIMMO	6,137	760	4,450	553
	RETAIL ESTATES	4,600	318	1,200	68
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	4,000	87	3,000	65
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,200 (66,840)	726 (－)	23,710	686
	MONTEA	2,200	183	1,200	123
	AEDIFICA	10,934	1,020	4,640	470
	CARE PROPERTY INVEST	15,000	392	－	－
	AEDIFICA SA-RIGHTS	－ (17,260)	－ (－)	17,260	14
	XIOR STUDENT HOUSING NV	8,700	407	－	－
	小 計	85,771 (84,100)	4,118 (－)	57,660	2,056
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	－	－	440,770	843
	HIBERNIA REIT PLC	160,000	193	80,000	93
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	103,000	131	68,021	93
	小 計	263,000	325	588,791	1,030
	その他				
	CROMWELL EUROPEAN REIT	910,000	433	－	－
	小 計	910,000	433	－	－
	ユ ー ロ 計	1,656,285 (84,100)	13,540 (△225)	955,182	9,039
	イギリス	口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	156,060	623	136,000	479
	CAPITAL & REGIONAL PLC	－ (△261,000)	－ (－)	29,000	15
	DERWENT LONDON PLC	28,201	874	22,540	624
	BIG YELLOW GROUP PLC	35,176	355	28,600	308
	HAMMERSON PLC	2,861,500 (△465,280)	816 (－)	330,000	66
	WORKSPACE GROUP PLC	15,827	155	16,000	95
	UNITE GROUP PLC	166,292	1,668	80,850	752
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	309,367	480	254,530	386
	SHAFTESBURY PLC	39,753	232	21,190	106

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	SEGRO PLC	351,230	2,991	246,210	2,311
	LAND SECURITIES GROUP PLC	235,822	1,663	226,117	1,526
	ASSURA PLC	544,890	438	378,000	302
	STANDARD LIFE INV PROP INC	260,756	135	—	—
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	44,420	324	43,380	293
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	130,000	110	120,000	83
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	—	—	263,580	307
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	183,000	141	100,000	66
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	48,566	338	37,029	288
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	228,550	450	165,000	386
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	615,000	475	120,000	74
	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	700,297	1,172	155,000	188
	GCP STUDENT LIVING PLC	300,000	410	—	—
	NEWRIVER REIT PL	45,000	76	32,000	16
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	98,910	89	86,843	92
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	50,000	50	—	—
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	431,000	476	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	387,718	484	360,670	554
	CUSTODIAN REIT PLC	292,276	265	—	—
	HAMMERSON PLC-NIL PAID	— (2,791,680)	— (—)	2,791,680	196
	ELITE COMMERCIAL REIT	131,700	90	131,700	84
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	126,000	86	120,000	81
	AEW UK REIT PLC	46,000	36	—	—
	LXI REIT PLC	118,000	136	85,000	93
	REGIONAL REIT LTD	60,000	69	—	—
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	219,355	225	—	—
	小計	9,260,666 (2,065,400)	15,951 (—)	6,380,919	9,782
	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
	BWP TRUST	94,600	327	65,000	261
	MIRVAC GROUP	734,100	1,727	678,090	1,478
	CROMWELL PROPERTY GROUP	220,000	169	240,000	207
	CHARTER HALL RETAIL REIT	150,780	474	45,000	152

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	GPT GROUP	511,377	2,402	477,170	2,194
	CENTURIA CAPITAL GROUP	285,000 (19,000)	599 (42)	—	—
	ABACUS PROPERTY GROUP	52,000	123	73,847	210
	STOCKLAND	476,674	1,470	432,110	1,623
	DEXUS	292,730	3,038	269,850	2,657
	GOODMAN GROUP	417,344	5,937	335,016	5,844
	VICINITY CENTERS	1,408,500	2,219	947,110	1,370
	CHARTER HALL GROUP	82,064	769	78,900	1,004
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	100,900	294	75,000	249
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	64,000	273	—	—
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	308,830	767	162,000	355
	ARENA REIT	100,053	200	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	285,000	906	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	181,030 (12,656)	834 (67)	89,420	417
	NATIONAL STORAGE REIT	315,670	509	169,330	316
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	103,000	262	66,115	205
	GDI PROPERTY GROUP	160,000	159	122,000	129
	HOME CONSORTIUM	91,000	344	—	—
	RURAL FUNDS GROUP	82,950	160	60,000	136
	INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	340,000	459	—	—
	SCENTRE GROUP	1,109,033	2,492	1,080,210	2,464
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	111,450	324	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	168,000	391	70,000	147
	AVENTUS GROUP	230,000	560	—	—
	WAYPOINT REIT LTD	344,186	908	138,390	366
	小計	8,820,271 (31,656)	29,109 (110)	5,674,558	21,796
	ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
	AMP NZ OFFICE LTD	185,000	324	150,000	252
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	108,000	280	56,000	170
	GOODMAN PROPERTY TRUST	140,000	301	160,000	375
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	367,460	385	190,000	197

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	ARGOSY PROPERTY LTD	157,278	158	90,000	120
	小 計	957,738	1,449	646,000	1,116
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	549,300	37,376	496,500	32,109
	PROSPERITY REIT	170,000	412	—	—
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	348,000	1,307	240,000	917
	CHAMPION REIT	300,000	1,343	220,000	901
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	155,000	569	230,000	795
	FORTUNE REIT	321,000	2,447	152,000	1,009
	小 計	1,843,300	43,457	1,338,500	35,732
	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	677,100 (1,203,644)	1,281 (2,776)	695,800	1,370
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	604,300 (253,434)	1,797 (690)	649,300 (—)	2,119 (63)
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	615,300	1,026	708,800 (1,671,728)	1,202 (3,209)
	SUNTEC REIT	742,500 (—)	1,119 (△3)	811,200	1,218
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	960,800 (30,948)	1,656 (31)	1,162,900	2,264
	STARHILL GLOBAL REIT	403,100 (—)	203 (△1)	—	—
	ASCOTT TRUST	362,600 (345,477)	340 (444)	325,200	290
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	67,000 (—)	79 (△2)	— (479,300)	— (740)
	KEPPEL REIT	418,500	428	513,500	562
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	78,200 (148,633)	142 (347)	50,000	127
	ESR REIT	690,700	280	450,000	174
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	254,000 (—)	233 (△4)	295,100	308
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	238,300 (—)	308 (△17)	170,000	193
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200,100 (—)	162 (△12)	—	—

		当期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	130,000 (一)	184 (△1)	—	—
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	38,000 (一)	120 (△4)	30,000	125
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	— (一)	— (△5)	—	—
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	540,500 (一)	1,493 (△1)	460,900	1,397
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	527,100 (一)	1,032 (△8)	439,800	895
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	290,000 (一)	141 (△0.94042)	180,000	114
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	261,300 (一)	203 (△40)	280,000	259
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	—	—	— (435,000)	— (474)
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	300,000	125	240,000	133
	SPH REIT	424,500	392	160,000	140
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	310,500 (一)	93 (△1)	—	—
	EC WORLD REIT	180,000	121	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	215,800	135	170,000	127
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	540,000 (一)	227 (△1)	380,000	130
	ASCENDAS REAL ESTATE - RIGHT	— (253,434)	— (63)	— (253,434)	— (63)
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	555,000 (一)	419 (△2)	—	—
	IREIT GLOBAL-RIGHTS	— (104,420)	— (一)	— (104,420)	— (12)
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	— (一)	— (△0.07728)	—	—
	IREIT GLOBAL	230,000 (104,420)	165 (63)	—	—
	KEPPEL DC REIT	148,900	345	158,100	460
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	450,300 (590,976)	477 (646)	356,400	491
	小計	11,454,400 (3,035,386)	14,740 (4,953)	8,687,000 (2,943,882)	14,107 (4,564)

		当期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
韓国		口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	171,404	—	—
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	— (1,593)	— (10,233)	—	—
	LOTTE REIT CO LTD	69,030	403,376	—	—
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD-RTS	— (1,593)	— (—)	— (1,593)	— (898)
	小計	111,980 (3,186)	574,780 (10,233)	— (1,593)	— (898)
	イスラエル	口	千イスラエルシェケル	口	千イスラエルシェケル
	REIT 1 LTD	27,500	441	—	—
	小計	27,500	441	—	—

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

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為替直物取引	百万円 28,402	百万円 12	% 0.0	百万円 25,115	百万円 —	% —
金銭信託	26	26	100.0	26	26	100.0
コール・ローン	40,152	2,976	7.4	40,136	2,990	7.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期中(前期末)		期末		
	口数 (口)	口数 (口)	評価額		比率 (%)
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	69,760	75,111	11,572	1,217,527	1.5
ALEXANDER'S INC	1,490	1,490	401	42,236	0.1
BOSTON PROPERTIES	88,380	91,098	8,086	850,809	1.1
CEDAR REALTY TRUST INC	51,950	—	—	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	131,726	144,943	4,997	525,801	0.7
APARTMENT INVEST & MGMT	92,400	94,622	2,723	286,510	0.4
AGREE REALTY CORP	25,220	34,169	2,169	228,205	0.3
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	65	6,875	0.0
SL GREEN REALTY CORP	50,430	46,455	2,787	293,251	0.4
EPR PROPERTIES	47,560	47,882	1,584	166,696	0.2
PROLOGIS INC	385,530	476,036	47,417	4,988,842	6.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	85,620	90,976	14,982	1,576,344	2.0
LEXINGTON CORP PROPERTIES	156,266	174,408	1,738	182,944	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	59,830	62,413	6,153	647,454	0.8
CBL & ASSOCIATES PRYS	99,840	—	—	—	—
MACK-CALI REALTY CORP	55,140	61,336	764	80,470	0.1
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	103,650	111,205	4,281	450,445	0.6
COUSINS PROPERTIES INC	91,803	94,418	2,821	296,819	0.4
URSTADT BIDDLE - CL A	16,500	22,500	250	26,394	0.0
SITE CENTERS CORP	84,059	94,320	855	90,005	0.1
DUKE REALTY CORP	223,080	239,972	9,277	976,066	1.2
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	46,030	—	—	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST	40,370	42,232	10,745	1,130,579	1.4
EQUITY RESIDENTIAL PTY	213,740	220,306	13,059	1,374,015	1.7
FEDERAL REALTY INVS TRUST	42,060	43,928	4,024	423,390	0.5
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	75,500	80,762	3,290	346,166	0.4
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	302,010	348,571	10,146	1,067,555	1.3
EQUITY COMMONWEALTH	72,100	76,912	2,027	213,302	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	81,340	87,029	2,679	281,923	0.4
HIGHWOODS PROPERTIES INC	65,190	65,752	2,209	232,506	0.3
SERVICE PROPERTIES TRUST	101,860	103,744	1,082	113,842	0.1
WELLTOWER INC	247,760	269,631	17,973	1,891,002	2.4
EASTGROUP PROPERTIES, INC	23,570	25,236	3,404	358,170	0.4
KIMCO REALTY CORP	257,130	277,299	3,762	395,899	0.5
KILROY REALTY CORPORATION	56,750	67,166	3,734	392,899	0.5
LTC PROPERTIES INC	23,290	26,976	949	99,845	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	143,800	142,800	561	59,044	0.1
MONMOUTH REIT -CL A	55,460	62,052	890	93,683	0.1
LIBERTY PROPERTY TRUST	96,240	—	—	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	102,778	105,620	1,024	107,789	0.1
IRON MOUNTAIN INC	174,690	184,472	4,916	517,231	0.6
MACERICH CO/THE	66,650	67,797	611	64,338	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	112,360	108,782	6,328	665,867	0.8

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
ACADIA REALTY TRUST	54,390	53,940	681	71,732	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	450,520	451,304	6,155	647,650	0.8
MID-AMERICA APARTMENT COMM	70,220	73,128	9,185	966,417	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	17,850	21,650	162	17,106	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	27,450	28,244	1,782	187,564	0.2
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	6,389	8,899	617	64,967	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,000	13,199	207	21,815	0.0
PENN REAL ESTATE INVEST TST	31,970	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	19,000	21,985	603	63,446	0.1
PS BUSINESS PARKS INC	11,950	12,689	1,647	173,310	0.2
RPT REALTY	51,580	58,950	373	39,321	0.0
REALTY INCOME CORP	195,300	221,064	13,617	1,432,701	1.8
REGENCY CENTERS CORP	103,470	100,891	4,636	487,853	0.6
UDR INC	181,320	189,351	7,223	760,009	0.9
CORPORATE OFFICE PPTYS	66,720	74,559	1,795	188,892	0.2
CORECIVIC INC	78,130	84,463	525	55,273	0.1
SAUL CENTERS INC	6,700	8,800	248	26,145	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	188,510	195,908	15,496	1,630,368	2.0
LIFE STORAGE INC	29,250	29,766	3,160	332,521	0.4
PUBLIC STORAGE	91,770	98,128	21,792	2,292,764	2.9
SUN COMMUNITIES INC	56,160	63,122	8,553	899,864	1.1
TAUBMAN CENTERS INC	39,650	40,750	1,467	154,428	0.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	55,170	69,270	579	60,926	0.1
UMH PROPERTIES INC	20,000	27,000	382	40,252	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	15,000	25,650	448	47,145	0.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	7,870	8,473	491	51,739	0.1
VENTAS INC	228,590	239,651	11,227	1,181,260	1.5
VORNADO REALTY TRUST	95,930	100,291	3,880	408,242	0.5
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT	47,080	56,070	1,139	119,870	0.1
GEO GROUP INC/THE	79,390	76,306	640	67,436	0.1
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	72,920	77,345	1,513	159,250	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	84,080	88,380	3,536	372,124	0.5
KITE REALTY GROUP TRUST	49,930	61,020	777	81,789	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	79,200	83,586	8,937	940,263	1.2
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	53,800	78,973	368	38,718	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	135,100	147,497	1,454	153,009	0.2
CUBESMART	120,490	123,373	3,854	405,497	0.5
DIGITAL REALTY TRUST INC	127,790	173,526	23,984	2,523,436	3.1
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	120,700	125,540	864	91,003	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	271,770	338,528	6,496	683,481	0.9
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	100,710	108,820	3,078	323,890	0.4
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	70,630	79,115	1,010	106,293	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	76,840	81,079	1,098	115,585	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	65,470	76,470	613	64,524	0.1
TERRENO REALTY CORP	41,570	43,364	2,488	261,831	0.3
AMERICAN ASSETS TRUST INC	30,910	30,595	768	80,890	0.1
RLJ LODGING TRUST	100,640	112,691	1,290	135,753	0.2
AMERICOLD REALTY TRUST	117,100	130,640	4,571	480,924	0.6

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CORESITRE REALTY CORP	23,310	27,185	3,276	344,760	0.4
VEREIT INC	652,720	688,743	4,952	521,006	0.6
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	77,960	89,335	1,456	153,202	0.2
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	28,230	31,830	655	68,952	0.1
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	23,000	29,639	176	18,616	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	23,860	25,360	238	25,107	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	119,750	136,456	2,183	229,704	0.3
WHITESTONE REIT	22,610	38,340	273	28,760	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	95,020	96,900	2,188	230,301	0.3
STAG INDUSTRIAL INC	80,320	97,831	2,983	313,930	0.4
RETAIL PROPERTISE OF AME-A	129,080	145,774	1,033	108,738	0.1
CYRUSONE INC	68,960	75,076	5,201	547,225	0.7
WP CAREY INC	105,150	111,658	7,449	783,795	1.0
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	47,000	703	74,024	0.1
GLADSTONE LAND CORP	5,000	11,500	159	16,805	0.0
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	127,970	138,931	3,701	389,395	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	31,240	35,566	2,007	211,192	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	—	38,000	394	41,539	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	56,690	65,819	2,271	238,975	0.3
PHYSICIANS REALTY TRUST	115,670	131,899	2,350	247,289	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	68,780	79,195	3,750	394,608	0.5
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	156,030	170,668	4,963	522,159	0.7
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	50,000	65,538	852	89,707	0.1
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,040	13,638	1,978	208,139	0.3
JBG SMITH PROPERTIES	74,160	71,542	2,009	211,431	0.3
AMERICAN FINANCE TRUST INC	59,590	67,590	492	51,840	0.1
RETAIL VALUE	8,630	8,969	123	13,022	0.0
INVITATION HOMES INC	296,260	360,577	9,948	1,046,662	1.3
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	27,000	30,230	403	42,459	0.1
QTS REALTY TRUST INC	33,350	38,937	2,379	250,340	0.3
COREPOINT LODGING INC	22,000	22,000	132	13,957	0.0
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	—	470,000	329	34,614	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	95,920	90,335	682	71,756	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,400	15,900	204	21,512	0.0
SAFEHOLD INC	4,700	9,940	637	67,024	0.1
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	45,510	63,742	1,152	121,249	0.2
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	37,160	43,270	861	90,684	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	71,020	73,383	904	95,118	0.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	126,630	132,903	5,294	557,071	0.7
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	178,620	188,767	2,686	282,610	0.4
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	14,500	—	—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	42,700	35,200	542	57,032	0.1
EAGLE HOSPITALITY TRUST	—	295,000	40	4,252	0.0
PRIME US REIT	—	295,000	225	23,743	0.0
ARA US HOSPITALITY TRUST	287,500	—	—	—	—
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	—	6,500	60	6,325	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	9,000	14,850	134	14,201	0.0
FARMLAND PARTNERS INC	19,000	19,000	132	13,912	0.0

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
CITY OFFICE REIT INC	37,050	37,050	270	28,455	0.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	105,250	90,250	58	6,171	0.0
CARETRUST REIT INC	57,290	65,477	1,238	130,267	0.2
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	40,000	45,000	196	20,689	0.0
STORE CAPITAL CORP	128,230	145,678	4,336	456,278	0.6
PARAMOUNT GROUP INC	121,410	102,726	775	81,598	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	23,500	27,530	370	38,957	0.0
URBAN EDGE PROPERTIES	69,110	76,680	930	97,858	0.1
EQUINIX INC	51,900	57,071	42,415	4,462,559	5.6
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	45,300	53,268	1,118	117,634	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	68,110	69,830	829	87,280	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL	13,000	15,100	662	69,726	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	36,700	40,124	1,322	139,181	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	9,700	14,300	652	68,665	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	133,463	138,263	1,667	175,432	0.2
GLOBAL NET LEASE INC	51,900	58,892	915	96,348	0.1
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	45	4,738	0.0
MANULIFE US REAL ESTATE INV	856,564	886,564	642	67,624	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	149,874	155,994	2,254	237,155	0.3
VICI PROPERTIES INC	279,550	342,155	8,150	857,475	1.1
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	20,200	22,900	324	34,139	0.0
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	42,190	44,250	1,204	126,677	0.2
COLONY CAPITAL INC	283,360	325,506	1,220	128,424	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	14,537,882	16,356,888	557,971	58,704,163
	銘 柄 数<比 率>	156	155	—	<73.2%>
(カナダ)			千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	44,930	48,076	1,174	94,934	0.1
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	48,890	52,420	2,479	200,457	0.2
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	90,460	92,539	1,088	87,963	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	95,250	95,631	1,572	127,078	0.2
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	36,850	36,942	1,414	114,304	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	53,000	55,620	473	38,303	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	18,820	18,820	386	31,245	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE	15,863	—	—	—	—
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	14,060	14,060	429	34,685	0.0
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	43,830	43,830	422	34,152	0.0
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,367	32,577	448	36,232	0.0
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	34,000	43,490	579	46,823	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	39,000	58,170	691	55,905	0.1
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	7,890	12,890	189	15,357	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INV	57,280	—	—	—	—
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	33,800	42,950	538	43,499	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	33,000	47,000	652	52,730	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	16,450	18,620	1,419	114,715	0.1
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	15,000	25,800	150	12,137	0.0
CHOICE PROPERTIES REIT	95,660	108,670	1,409	113,925	0.1
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,600	15,100	273	22,103	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	41,000	27,730	400	32,388	0.0

銘 柄		当期首(前期末)		当 期 末		
		口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
				外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PLAZA RETAIL REIT		—	25,000	87	7,072	0.0
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN		—	74,815	1,107	89,499	0.1
WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I		—	23,500	410	33,146	0.0
SLATE GROCERY REIT		10,300	10,300	115	9,366	0.0
SLATE OFFICE REI		17,000	17,000	64	5,207	0.0
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E		—	12,000	124	10,077	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		25,500	35,850	625	50,565	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	918,800	1,089,400	18,729	1,513,883	
	銘 柄 数<比 率>	25	27	—	<1.9%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		44,000	45,000	395	49,110	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT -AG		97,000	110,000	1,413	175,655	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	141,000	155,000	1,808	224,765	
	銘 柄 数<比 率>	2	2	—	<0.3%>	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		33,790	33,790	96	11,946	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	33,790	33,790	96	11,946	
	銘 柄 数<比 率>	1	1	—	<0.0%>	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE		16,960	19,880	1,109	137,853	0.2
ALTAREA		2,000	2,730	348	43,357	0.1
KLEPIERRE		126,050	130,130	1,951	242,568	0.3
GECINA SA		33,970	34,685	4,484	557,322	0.7
COVIVIO(FP)		27,990	30,792	1,870	232,461	0.3
MERCIALYS		10,970	26,000	132	16,413	0.0
CARMILA		—	30,000	265	32,993	0.0
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		84,560	88,146	3,769	468,388	0.6
小 計	口 数 ・ 金 額	302,500	362,363	13,932	1,731,358	
	銘 柄 数<比 率>	7	8	—	<2.2%>	
(オランダ)				千ユーロ		
EUROCOMMERCIAL		25,340	19,690	232	28,873	0.0
VASTNED RETAIL		10,950	13,750	333	41,436	0.1
WERELDHAVE NV		24,970	28,770	262	32,606	0.0
NSI NV		9,300	12,300	370	46,084	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	70,560	74,510	1,199	149,000	
	銘 柄 数<比 率>	4	4	—	<0.2%>	
(スペイン)				千ユーロ		
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI		155,240	161,062	1,262	156,918	0.2
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		35,000	54,000	196	24,359	0.0
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		225,270	211,418	1,497	186,143	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	415,510	426,480	2,956	367,421	
	銘 柄 数<比 率>	3	3	—	<0.5%>	
(ベルギー)				千ユーロ		
BEFIMMO S. C. A.		13,310	16,110	579	71,971	0.1
COFINIMMO		15,330	17,017	2,144	266,452	0.3
RETAIL ESTATES		4,200	7,600	418	51,944	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		14,300	15,300	354	44,015	0.1
WAREHOUSES DE PAUW SCA		11,140	83,470	2,547	316,578	0.4

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末			
		口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
MONTEA		5,900	6,900	687	85,403	0.1
AEDIFICA		14,966	21,260	1,964	244,118	0.3
CARE PROPERTY INVEST		—	15,000	411	51,168	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		—	8,700	465	57,841	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	79,146	191,357	9,571	1,189,495	
	銘 柄 数<比 率>	7	9	—	<1.5%>	
(アイルランド)				千ユーロ		
GREEN REIT PLC		440,770	—	—	—	—
HIBERNIA REIT PLC		402,550	482,550	586	72,919	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		225,021	260,000	381	47,431	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	1,068,341	742,550	968	120,350	
	銘 柄 数<比 率>	3	2	—	<0.2%>	
(その他)				千ユーロ		
CROMWELL EUROPEAN REIT		—	910,000	404	50,323	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	—	910,000	404	50,323	
	銘 柄 数<比 率>	—	1	—	<0.1%>	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	2,110,847	2,896,050	30,937	3,844,662	
	銘 柄 数<比 率>	27	30	—	<4.8%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC		574,790	594,850	2,700	374,089	0.5
CAPITAL & REGIONAL PLC		290,000	—	—	—	—
DERWENT LONDON PLC		64,880	70,541	2,353	325,971	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC		94,570	101,146	1,160	160,703	0.2
HAMMERSON PLC		470,100	2,536,320	595	82,492	0.1
WORKSPACE GROUP PLC		78,220	78,047	545	75,623	0.1
INTU PROPERTIES PLC		521,960	521,960	9	1,284	0.0
UNITE GROUP PLC		175,240	260,682	2,579	357,305	0.4
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		785,700	840,537	1,255	173,948	0.2
SHAFTESBURY PLC		141,730	160,293	859	119,123	0.1
SEGRO PLC		656,550	761,570	6,892	954,708	1.2
LAND SECURITIES GROUP PLC		467,800	477,505	3,072	425,570	0.5
ASSURA PLC		1,540,150	1,707,040	1,287	178,290	0.2
STANDARD LIFE INV PROP INC		—	260,756	159	22,033	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		168,540	169,580	1,153	159,780	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM		350,000	350,000	121	16,774	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		320,000	330,000	231	32,135	0.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC		263,580	—	—	—	—
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		469,000	552,000	422	58,570	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		124,000	135,537	1,097	151,980	0.2
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		504,110	567,660	1,351	187,144	0.2
BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS		—	495,000	361	50,054	0.1
CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE		—	545,297	661	91,698	0.1
GCP STUDENT LIVING PLC		—	300,000	387	53,607	0.1
RDI REIT PLC		154,400	154,400	149	20,660	0.0
NEWRIVER REIT PL		173,000	186,000	128	17,777	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		368,000	380,067	415	57,595	0.1
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		223,286	273,286	310	42,966	0.1
SUPERMARKET INCOME REIT PLC		—	431,000	453	62,836	0.1

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	1,065,610	1,092,658	1,807	250,341	0.3
CUSTODIAN REIT PLC	—	292,276	259	35,951	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	370,000	376,000	235	32,552	0.0
AEW UK REIT PLC	72,000	118,000	87	12,095	0.0
LXI REIT PLC	297,000	330,000	382	53,025	0.1
REGIONAL REIT LTD	232,000	292,000	206	28,637	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	—	219,355	235	32,663	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	11,016,216	15,961,363	33,930	4,699,993
	銘 柄 数<比 率>	29	34	—	<5.9%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
BWP TRUST	298,560	328,160	1,374	105,269	0.1
MIRVAC GROUP	2,451,490	2,507,500	5,867	449,219	0.6
CROMWELL PROPERTY GROUP	1,242,633	1,222,633	1,149	87,988	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	218,380	324,160	1,183	90,584	0.1
GPT GROUP	1,203,310	1,237,517	5,308	406,453	0.5
CENTURIA CAPITAL GROUP	—	304,000	723	55,392	0.1
ABACUS PROPERTY GROUP	214,440	192,593	602	46,151	0.1
STOCKLAND	1,485,780	1,530,344	6,718	514,346	0.6
DEXUS	674,060	696,940	6,293	481,820	0.6
GOODMAN GROUP	986,690	1,069,018	21,348	1,634,425	2.0
VICINITY CENTERS	1,973,650	2,435,040	3,518	269,386	0.3
CHARTER HALL GROUP	292,530	295,694	4,074	311,956	0.4
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	172,860	198,760	713	54,629	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP	138,588	202,588	994	76,154	0.1
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	542,230	689,060	1,626	124,500	0.2
ARENA REIT	141,000	241,053	672	51,489	0.1
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	—	285,000	906	69,386	0.1
CHARTER HALL LONG WALE REIT	189,846	294,112	1,508	115,513	0.1
APN INDUSTRIA REIT	75,000	75,000	211	16,192	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	480,000	626,340	1,164	89,191	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	78,000	114,885	366	28,057	0.0
GDI PROPERTY GROUP	286,500	324,500	353	27,079	0.0
HOME CONSORTIUM	—	91,000	343	26,265	0.0
RURAL FUNDS GROUP	189,816	212,766	521	39,908	0.0
INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	—	340,000	408	31,236	0.0
SCENTRE GROUP	3,281,570	3,310,393	7,978	610,799	0.8
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	130,800	242,250	729	55,825	0.1
CENTURIA OFFICE REIT	151,000	249,000	525	40,223	0.1
AVENTUS GROUP	—	230,000	575	44,022	0.1
WAYPOINT REIT LTD	290,000	495,796	1,378	105,523	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	17,188,733	20,366,102	79,140	6,058,994
	銘 柄 数<比 率>	25	30	—	<7.6%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AMP NZ OFFICE LTD	615,000	650,000	1,144	82,150	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	187,460	239,460	708	50,899	0.1
GOODMAN PROPERTY TRUST	700,300	680,300	1,673	120,176	0.1
KIWI PROPERTY GROUP LTD	921,030	1,098,490	1,362	97,814	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD	495,000	562,278	826	59,354	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	2,918,790	3,230,528	5,715	410,395
	銘 柄 数<比 率>	5	5	—	<0.5%>

銘柄		当期首(前期末)	当 期 末			
		口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
				外 貨 建 金 額	邦貨換算金額 (千円)	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		1,285,000	1,337,800	84,281	1,143,698	1.4
PROSPERITY REIT		782,000	952,000	2,161	29,325	0.0
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT		860,000	968,000	3,552	48,208	0.1
CHAMPION REIT		1,223,000	1,303,000	5,329	72,318	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		636,000	561,000	1,952	26,492	0.0
FORTUNE REIT		813,000	982,000	6,441	87,416	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	5,599,000	6,103,800	103,718	1,407,459	
	銘 柄 数<比 率>	6	6	—	<1.8%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST		1,744,900	2,929,844	5,566	434,815	0.5
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		1,583,966	1,792,400	5,717	446,613	0.6
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		1,765,228	—	—	—	—
SUNTEC REIT		1,451,400	1,382,700	1,963	153,363	0.2
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		1,830,952	1,659,800	3,435	268,369	0.3
STARHILL GLOBAL REIT		706,300	1,109,400	488	38,128	0.0
ASCOTT TRUST		734,000	1,116,877	971	75,898	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		412,300	—	—	—	—
KEPPEL REIT		1,241,400	1,146,400	1,169	91,336	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		484,329	661,162	1,514	118,263	0.1
ESR REIT		1,163,365	1,404,065	512	40,030	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		458,300	417,200	450	35,194	0.0
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		399,429	467,729	584	45,667	0.1
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		338,000	538,100	226	17,653	0.0
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD		245,000	375,000	446	34,856	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		250,000	258,000	1,068	83,430	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST		954,000	954,000	80	6,259	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		972,460	1,052,060	3,366	262,964	0.3
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		1,362,873	1,450,173	2,813	219,749	0.3
ARA LOGOS LOGISTICS TRUST		591,000	701,000	410	32,031	0.0
SABANA SHARIAH COMP IND REI		478,540	478,540	169	13,269	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		1,390,800	1,372,100	1,221	95,385	0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		435,000	—	—	—	—
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		480,000	540,000	321	25,096	0.0
SPH REIT		462,300	726,800	563	43,997	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT		379,016	689,516	324	25,313	0.0
EC WORLD REIT		—	180,000	126	9,912	0.0
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME		250,000	295,800	229	17,906	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		1,363,644	1,523,644	510	39,868	0.0
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL		—	555,000	355	27,744	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		460,000	460,000	193	15,090	0.0
IREIT GLOBAL		—	334,420	202	15,803	0.0
KEPPEL DC REIT		804,003	794,803	2,344	183,142	0.2
FRASERS LOGISTICS & COMMERCI		977,820	1,662,696	2,228	174,030	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	26,170,325	29,029,229	39,574	3,091,187	
	銘 柄 数<比 率>	31	31	—	<3.9%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1		—	42,950	175,236	16,507	0.0

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

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

(注2) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

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

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

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

- 1米ドル=105.21円

1イギリスポンド=138.52円

1香港ドル=13.57円

1イスラエルシェケル=31.23円
- 1カナダドル=80.83円

1オーストラリアドル=76.56円

1シンガポールドル=78.11円
- 1ユーロ=124.27円

1ニュージーランドドル=71.81円

1韓国ウォン=0.0942円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	当 期 末 2020年11月10日現在
(A) 資 産	80,596,346,615円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	556,987,859
投 資 証 券 (評価額)	79,860,114,571
未 収 入 金	11,300,125
未 収 配 当 金	167,944,060
(B) 負 債	383,191,944
未 払 株 式 払 込 金	312,168,940
未 払 解 約 金	4,810,523
未 払 利 息	66,212,376
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	80,213,154,671
元 本	47,638,239,657
次 期 繰 越 損 益 金	32,574,915,014
(D) 受 益 権 総 口 数	47,638,239,657口
1万口当たり基準価額(C/D)	16.838円

■損益の状況

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

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は44,803,032,363円、期中追加設定元本額は19,491,484,634円、期中一部解約元本額は16,656,277,340円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

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

お知らせ

該当事項はありません。