

# JP4 資産バランスファンド（DC）

## 運用報告書（全体版）

第5期（決算日 2022年1月17日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
「JP4 資産バランスファンド（DC）」は、2022年1月17日に第5期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。  
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

### 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   | 無期限（2017年8月31日設定）                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                  |      |      |
| 運用方針   | 日本と海外の債券と株式に資産を分散することで、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。海外債券は、信用力の高い先進国の債券に、海外株式は、より安定的な先進国の株式に投資します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。<br>＜基本組入比率＞                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                  |      |      |
|        | 日本株式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 日本債券                                                                                                                                                             | 海外株式 | 海外債券 |
|        | 30%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 40%                                                                                                                                                              | 20%  | 10%  |
| 主な投資対象 | JP4資産バランスファンド（DC）                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 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）、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）、野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）、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）を主要投資対象とします。 |      |      |
|        | 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）                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 日本株式を主要投資対象とします。                                                                                                                                                 |      |      |
|        | 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）                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 日本債券を主要投資対象とします。                                                                                                                                                 |      |      |
|        | 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用）                                                                                                                                                                                                                                                                         | 海外株式を主要投資対象とします。                                                                                                                                                 |      |      |
|        | 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）                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 海外債券を主要投資対象とします。                                                                                                                                                 |      |      |
| 主な投資制限 | 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。<br>株式への直接投資は行いません。<br>外貨建資産への直接投資は行いません。<br>外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。<br>デリバティブの直接利用は行いません。<br>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。 |                                                                                                                                                                  |      |      |
|        | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。<br>分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。<br>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。                                                                                                        |                                                                                                                                                                  |      |      |
| 分配方針   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                  |      |      |

JP投信株式会社

東京都中央区日本橋本町一丁目5番11号

<照会先>

ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp

サポートダイヤル：0120-104-017

（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

---

## 目 次

---

|                             |   |
|-----------------------------|---|
| J P 4 資産バランスファンド（D C） ..... | 1 |
|-----------------------------|---|

（ご参考）投資対象先の直近の内容

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 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） ..... | 12 |
|-----------------------------------------|----|

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 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） ..... | 61 |
|-----------------------------------------|----|

|                                                      |    |
|------------------------------------------------------|----|
| 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド（適格機関投資家専用） ..... | 96 |
|------------------------------------------------------|----|

|                                       |     |
|---------------------------------------|-----|
| 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） ... | 146 |
|---------------------------------------|-----|

---

## 【運用報告書の表記について】

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

## ○設定以来の運用実績

| 決 算 期          | 基 準<br>(分配落) | 価 額   |       |         | 参 考 指 数<br>期 騰 落 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 | 純 資 産 額<br>総 計 |
|----------------|--------------|-------|-------|---------|--------------------|----------------------|----------------|
|                |              | 税 込 分 | み 金   | 期 騰 落 率 |                    |                      |                |
| (設定日)          | 円            | 円     | 円     | %       | %                  | %                    | 百万円            |
| 2017年8月31日     | 10,000       | —     | —     | —       | 10,000             | —                    | 1              |
| 1期(2018年1月15日) | 10,707       | 0     | 7.1   | 10,771  | 7.7                | 88.1                 | 8              |
| 2期(2019年1月15日) | 9,949        | 0     | △ 7.1 | 9,899   | △ 8.1              | 99.5                 | 57             |
| 3期(2020年1月15日) | 11,053       | 0     | 11.1  | 10,992  | 11.0               | 99.6                 | 161            |
| 4期(2021年1月15日) | 11,733       | 0     | 6.2   | 11,536  | 4.9                | 99.5                 | 297            |
| 5期(2022年1月17日) | 12,673       | 0     | 8.0   | 12,657  | 9.7                | 99.7                 | 481            |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

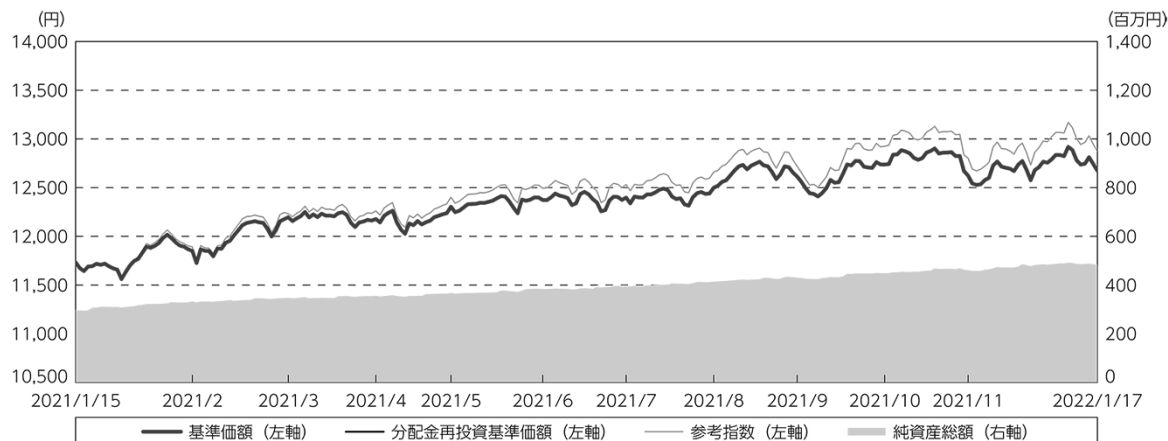
| 年 月 日      | 基 準<br>騰 落 率 | 参 考 指 数<br>騰 落 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 |
|------------|--------------|------------------|----------------------|
|            |              |                  |                      |
| (期 首)      | 円            | %                | %                    |
| 2021年1月15日 | 11,733       | —                | 99.5                 |
| 1月末        | 11,658       | △0.6             | 99.3                 |
| 2月末        | 11,850       | 1.0              | 97.9                 |
| 3月末        | 12,196       | 3.9              | 99.5                 |
| 4月末        | 12,177       | 3.8              | 99.4                 |
| 5月末        | 12,303       | 4.9              | 99.6                 |
| 6月末        | 12,373       | 5.5              | 99.6                 |
| 7月末        | 12,397       | 5.7              | 99.5                 |
| 8月末        | 12,499       | 6.5              | 99.5                 |
| 9月末        | 12,614       | 7.5              | 99.5                 |
| 10月末       | 12,737       | 8.6              | 99.5                 |
| 11月末       | 12,623       | 7.6              | 99.5                 |
| 12月末       | 12,835       | 9.4              | 99.2                 |
| (期 末)      | 円            | %                | %                    |
| 2022年1月17日 | 12,673       | 8.0              | 99.7                 |

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2021年1月16日～2022年1月17日)

## 期中の基準価額等の推移



期 首 : 11,733円

期 末 : 12,673円 (既払分配金(税込み) : 0円)

騰落率 : 8.0% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額および参考指数は、期首(2021年1月15日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

## ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首11,733円から期末12,673円となり、値上がり額は940円となりました。

投資対象とする4本の組入投資信託証券の当期間の値動きは、海外株式、日本株式、海外債券が上昇した一方で、日本債券が下落しました。海外株式、日本株式の上昇が主な値上がり要因となりました。

## 投資環境

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 日本債券市場 | <p>期を通じて、日本債券市場は利回りが上昇(価格が下落)しました。2021年1月中旬から2月下旬は、日銀の政策点検で長期金利の上昇が容認されるとの警戒感や、欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種の進展などによって景気回復期待が高まり米長期金利が上昇したことなどから債券は売られました。その後3月には、日銀の政策点検の結果、長期金利の上昇余地は限られるとの見方が優勢となり債券は買い戻されました。4月から8月上旬にかけては、変異株によって世界的に感染が再拡大し、国内では二度の緊急事態宣言が発出され、経済活動停滞への警戒感が高まったことなどから債券は買われました。その後8月中旬から10月にかけては、国内の株式市場が上昇し投資家のリスク選好姿勢が強まったことや、物価上昇懸念を背景に米長期金利が上昇したことなどから債券は売られました。11月以降は、感染力の強いオミクロン株の発生を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから買われる場面もありましたが、期末にかけてFRB(米連邦準備制度理事会)による量的引き締め観測の強まりなどを背景に米長期金利が急上昇したことから債券は売られました。</p> |
| 日本株式市場 | <p>期を通じて、日本株式市場は上昇しました。2021年1月中旬から3月にかけては、米国での追加経済対策の成立や国内の緊急事態宣言の解除などから経済正常化期待が高まり堅調に推移しました。4月から8月中旬にかけては、国内で緊急事態宣言が二度発出され経済活動停滞への警戒感が高まったことなどから下落する一方、米国株式市場が堅調に推移したことや、国内の新型コロナウイルスのワクチン接種が加速し経済正常化への期待が高まったことなどから上昇する場面もあり一進一退の展開となりました。8月下旬から10月上旬にかけては、菅首相が自民党総裁選への不出馬を表明し次期首相の政策への期待から上昇する場面もありましたが、その後中国恒大集団の債務問題や世界的な物価上昇懸念を背景にリスク回避姿勢が強まると上げ幅を縮めました。10月中旬以降は、好決算を背景に米国株式市場が上昇したことや、円安ドル高の進展などから上昇する一方、感染力の強いオミクロン株の発生やFRBの金融政策の正常化観測の強まりなどから下落する場面もあり、一進一退の展開となりました。</p>                                |
| 海外債券市場 | <p>期を通じて、海外債券市場は利回りが上昇(価格が下落)しました。2021年1月中旬から3月下旬にかけては、欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や米追加経済対策の成立などから景気回復期待が強まり債券は売られました。4月から8月にかけては、米国の物価上昇への警戒感から売られる場面もありましたが、FRBの金融緩和が長期化すると見方が強まったことや、変異株による世界的な感染再拡大を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから債券の買いが優勢となりました。9月から10月にかけては、米国で物価上昇を背景に金融政策の正常化が早まるとの見方が強まったことなどから債券は売られました。11月以降は、感染力の強いオミクロン株の発生を受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから買われる場面もありましたが、期末にかけてFRBによる量的引き締め観測が強まったことなどから債券は売られました。</p>                                                                                                       |
| 海外株式市場 | <p>期を通じて、海外株式市場は上昇しました。2021年1月中旬から3月下旬にかけては、欧米での新型コロナウイルスのワクチン接種の進展や米追加経済対策の成立などから景気回復期待が強まり上昇しました。4月から8月にかけては、米国の物価上昇への警戒感や変異株による世界的な感染再拡大を受けて一時下落する場面もありましたが、ワクチン接種の進展を背景に欧米で経済活動の正常化が進んだことなどから堅調に推移しました。9月から10月上旬にかけては、中国恒大集団の債務問題や世界的な物価上昇懸念を背景にリスク回避姿勢が強まり下落しましたが、10月中旬から11月中旬にかけては、好調な企業決算が相次いだことなどから再び上昇に転じました。11月下旬以降は、感染力の強いオミクロン株の発生や、FRBの金融政策の正常化観測の強まりなどから売られる一方、消費の堅調さが確認されたことなどから上昇する場面もあり、一進一退の展開となりました。</p>                                                                                       |

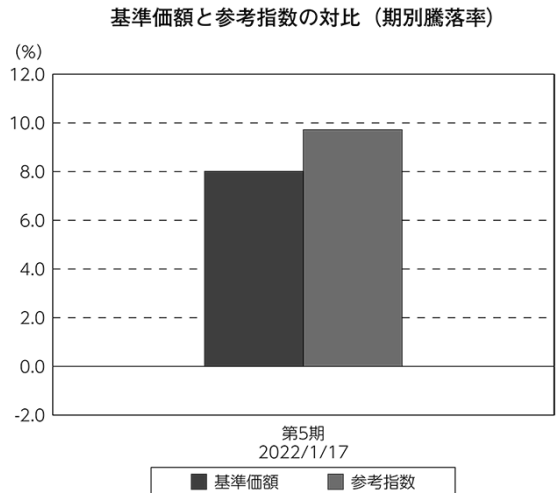
## 当ファンドのポートフォリオ

組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、当ファンドにおける日々の追加設定解約に対応した投資信託証券の売買を行うことなどにより、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

## 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。

グラフは、基準価額と参考指数の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

## 分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案した結果、見送らせていただきました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

### ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目                | 第5期                       |
|--------------------|---------------------------|
|                    | 2021年1月16日～<br>2022年1月17日 |
| 当期分配金<br>（対基準価額比率） | —<br>— %                  |
| 当期の収益              | —                         |
| 当期の収益以外            | —                         |
| 翌期繰越分配対象額          | 2,672                     |

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

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

### ○今後の運用方針

引き続き、組入投資信託証券を通じて、日本株式、日本債券、海外株式、海外債券に分散投資を行い、信託財産の着実な成長を目指します。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年1月16日～2022年1月17日)

| 項 目                   | 当 期     |            | 項 目 の 概 要                                     |
|-----------------------|---------|------------|-----------------------------------------------|
|                       | 金 額     | 比 率        |                                               |
| (a) 信 託 報 酬           | 円<br>26 | %<br>0.210 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                      |
| ( 投 信 会 社 )           | (11)    | (0.088)    | 委託した資金の運用の対価                                  |
| ( 販 売 会 社 )           | (11)    | (0.088)    | 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<br>情報提供等の対価 |
| ( 受 託 会 社 )           | ( 4 )   | (0.033)    | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                       |
| (b) そ の 他 費 用         | 1       | 0.004      | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                 |
| ( 監 査 費 用 )           | ( 1 )   | (0.004)    | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                   |
| 合 計                   | 27      | 0.214      |                                               |
| 期中の平均基準価額は、12,355円です。 |         |            |                                               |

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

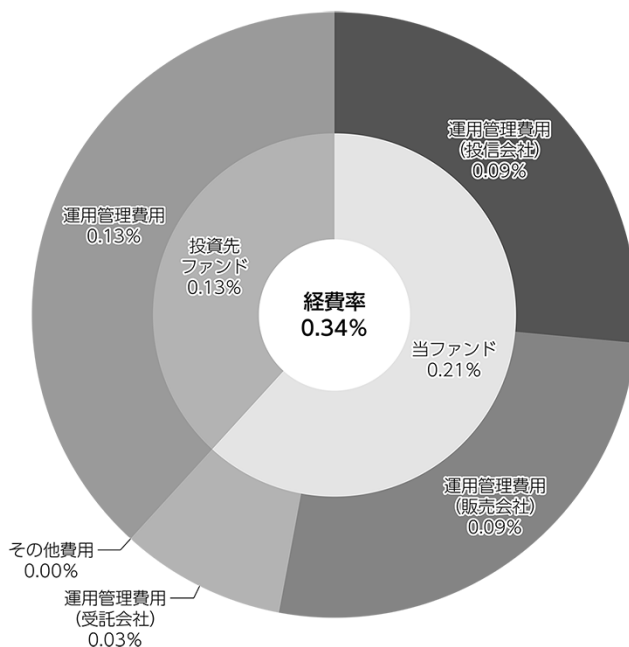
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## （参考情報）

## ○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

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、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は0.34%です。



(単位: %)

|                    |      |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②)          | 0.34 |
| ①当ファンドの費用の比率       | 0.21 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.13 |

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年1月16日～2022年1月17日)

## 投資信託証券

| 銘 柄 |                                                | 買 付         |         | 売 付        |        |
|-----|------------------------------------------------|-------------|---------|------------|--------|
|     |                                                | 口 数         | 金 額     | 口 数        | 金 額    |
| 国 内 | 野村Fof用・外国株式MSCI-TOKUSAI インデックスファンド (適格機関投資家専用) | 口           | 千円      | 口          | 千円     |
|     | 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)             | 13,271,314  | 25,468  | 4,283,967  | 8,029  |
|     | 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)             | 83,249,223  | 82,902  | 3,805,287  | 3,791  |
|     | 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)             | 38,534,055  | 53,816  | 5,991,811  | 8,419  |
|     | 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)             | 19,525,352  | 19,227  | 1,057,973  | 1,045  |
| 合 計 |                                                | 154,579,944 | 181,413 | 15,139,038 | 21,284 |

(注) 金額は受け渡し代金。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年1月16日～2022年1月17日)

該当事項はございません。

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

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年1月16日～2022年1月17日)

該当事項はございません。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年1月16日～2022年1月17日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年 1 月17日現在)

## ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘                                             | 柄 | 期首(前期末)     | 当 期 末       |         |      |
|-----------------------------------------------|---|-------------|-------------|---------|------|
|                                               |   | 口 数         | 口 数         | 評 価 額   | 比 率  |
|                                               |   | 口           | 口           | 千円      | %    |
| 野村Fof用・外国株式MSCI-KOKUSAI インデックスファンド(適格機関投資家専用) |   | 35,681,778  | 44,669,125  | 96,056  | 20.0 |
| 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)             |   | 116,551,792 | 195,995,728 | 193,624 | 40.2 |
| 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)             |   | 67,935,848  | 100,478,092 | 142,648 | 29.6 |
| 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)             |   | 29,579,492  | 48,046,871  | 47,287  | 9.8  |
| 合 計                                           |   | 249,748,910 | 389,189,816 | 479,617 | 99.7 |

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## ○投資信託財産の構成

(2022年 1 月17日現在)

| 項 目          | 当 期 末   |       |
|--------------|---------|-------|
|              | 評 価 額   | 比 率   |
|              | 千円      | %     |
| 投資信託受益証券     | 479,617 | 99.0  |
| コール・ローン等、その他 | 4,938   | 1.0   |
| 投資信託財産総額     | 484,555 | 100.0 |

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する評価額の割合です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月17日現在)

| 項 目             | 当 期 末        |
|-----------------|--------------|
|                 | 円            |
| (A) 資産          | 484,555,096  |
| コール・ローン等        | 3,207,954    |
| 投資信託受益証券(評価額)   | 479,617,142  |
| 未収入金            | 1,730,000    |
| (B) 負債          | 3,298,523    |
| 未払解約金           | 2,812,773    |
| 未払信託報酬          | 468,416      |
| 未払利息            | 8            |
| その他未払費用         | 17,326       |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 481,256,573  |
| 元本              | 379,757,004  |
| 次期繰越損益金         | 101,499,569  |
| (D) 受益権総口数      | 379,757,004口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D) | 12,673円      |

(注) 当ファンドの期首元本額は253,281,796円、期中追加設定元本額は153,946,544円、期中一部解約元本額は27,471,336円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,2673円です。

## ○損益の状況 (2021年1月16日～2022年1月17日)

| 項 目              | 当 期           |
|------------------|---------------|
|                  | 円             |
| (A) 配当等収益        | 4,809,041     |
| 受取配当金            | 4,812,141     |
| 支払利息             | △ 3,100       |
| (B) 有価証券売買損益     | 22,540,357    |
| 売買益              | 25,548,383    |
| 売買損              | △ 3,008,026   |
| (C) 信託報酬等        | △ 846,055     |
| (D) 当期損益金(A＋B＋C) | 26,503,343    |
| (E) 前期繰越損益金      | 25,770,856    |
| (F) 追加信託差損益金     | 49,225,370    |
| (配当等相当額)         | ( 44,495,719) |
| (売買損益相当額)        | ( 4,729,651)  |
| (G) 計(D＋E＋F)     | 101,499,569   |
| (H) 収益分配金        | 0             |
| 次期繰越損益金(G＋H)     | 101,499,569   |
| 追加信託差損益金         | 49,225,370    |
| (配当等相当額)         | ( 44,495,719) |
| (売買損益相当額)        | ( 4,729,651)  |
| 分配準備積立金          | 52,274,199    |

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2021年1月16日～2022年1月17日)は以下の通りです。

| 項 目                          | 2021年1月16日～<br>2022年1月17日 |
|------------------------------|---------------------------|
| a. 配当等収益(経費控除後)              | 4,660,305円                |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 21,843,038円               |
| c. 信託約款に定める収益調整金             | 49,225,370円               |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金           | 25,770,856円               |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)           | 101,499,569円              |
| f. 分配対象収益(1万口当たり)            | 2,672円                    |
| g. 分配金                       | 0円                        |
| h. 分配金(1万口当たり)               | 0円                        |

## ○分配金のお知らせ

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

## ○お知らせ

2021年1月16日から2022年1月17日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

### 合成指数について

合成指数は、下記の指数と基本組入比率をもとに J P 投信が計算したものです。

| 資 産     | 指 数                                 | 基 本 組 入 比 率 |
|---------|-------------------------------------|-------------|
| 日 本 株 式 | TOPIX（東証株価指数、配当なし）                  | 30%         |
| 日 本 債 券 | NOMURA-BPI総合                        | 40%         |
| 海 外 株 式 | MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・配当込み・為替ヘッジなし） | 20%         |
| 海 外 債 券 | FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）     | 10%         |

- \* 「TOPIX（東証株価指数、配当なし）」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、ファンドの設定また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。
- \* 「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、一定の組み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 J P 投信株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- \* 「MSCI-KOKUSAI指数」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およ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および公表を停止する権利を有しています。
- \* 「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）」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。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。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |                                                                                                                                                                |                                           |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／国内／株式／インデックス型                                                                                                                                            |                                           |
| 信 託 期 間 | 信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。                                                                                                                                 |                                           |
| 運 用 方 針 | 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  | FOFs用 国内株式<br>インデックス・ファンドP<br>(適格機関投資家専用)                                                                                                                      | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。                |
|         | 国内株式<br>インデックス<br>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。             |
| 組 入 制 限 | FOFs用 国内株式<br>インデックス・ファンドP<br>(適格機関投資家専用)                                                                                                                      | 株式への実質投資割合には制限を設けません。<br>外貨建資産への投資は行いません。 |
|         | 国内株式<br>インデックス<br>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。<br>外貨建資産への投資は、行いません。  |
| 分 配 方 針 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。<br>②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                                           |

# FOFs用 国内株式インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

## 運 用 報 告 書 (全 体 版)

第32期 (決算日 2021年 9月7日)  
第33期 (決算日 2021年11月8日)  
第34期 (決算日 2022年 1月7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。
- ・－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作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期              | 基準価額        |        |           | ベンチマーク |           | 株式組入率     | 株式先物比率   | 純資産総額         |
|-----|------------------|-------------|--------|-----------|--------|-----------|-----------|----------|---------------|
|     |                  | (分配落)       | 税込分配金  | 期中騰落率     |        | 期中騰落率     |           |          |               |
| 第8  | 第20期(2019年 9月9日) | 円<br>11,132 | 円<br>2 | %<br>△1.7 | 11,030 | %<br>△1.7 | %<br>98.9 | %<br>1.0 | 百万円<br>81,080 |
|     | 第21期(2019年11月7日) | 12,193      | 111    | 10.5      | 12,075 | 9.5       | 98.3      | 2.0      | 79,038        |
|     | 第22期(2020年 1月7日) | 12,383      | 18     | 1.7       | 12,267 | 1.6       | 99.0      | 1.0      | 74,910        |
| 第9  | 第23期(2020年 3月9日) | 9,973       | 2      | △19.4     | 9,877  | △19.5     | 98.7      | 1.3      | 62,196        |
|     | 第24期(2020年 5月7日) | 10,244      | 125    | 4.0       | 10,145 | 2.7       | 98.6      | 2.2      | 69,182        |
|     | 第25期(2020年 7月7日) | 11,283      | 15     | 10.3      | 11,176 | 10.2      | 98.6      | 0.9      | 74,337        |
| 第10 | 第26期(2020年 9月7日) | 11,553      | 1      | 2.4       | 11,447 | 2.4       | 99.1      | 0.8      | 75,893        |
|     | 第27期(2020年11月9日) | 12,076      | 97     | 5.4       | 11,960 | 4.5       | 98.9      | 1.6      | 78,219        |
|     | 第28期(2021年 1月7日) | 13,112      | 17     | 8.7       | 12,987 | 8.6       | 99.3      | 0.7      | 80,449        |
| 第11 | 第29期(2021年 3月8日) | 13,592      | 5      | 3.7       | 13,465 | 3.7       | 99.4      | 0.6      | 77,897        |
|     | 第30期(2021年 5月7日) | 13,876      | 121    | 3.0       | 13,746 | 2.1       | 99.2      | 1.4      | 78,715        |
|     | 第31期(2021年 7月7日) | 13,908      | 22     | 0.4       | 13,779 | 0.2       | 99.3      | 0.8      | 79,538        |
| 第12 | 第32期(2021年 9月7日) | 14,806      | 5      | 6.5       | 14,673 | 6.5       | 99.4      | 0.5      | 85,216        |
|     | 第33期(2021年11月8日) | 14,609      | 112    | △0.6      | 14,472 | △1.4      | 99.3      | 1.3      | 83,324        |
|     | 第34期(2022年 1月7日) | 14,327      | 17     | △1.8      | 14,191 | △1.9      | 99.3      | 0.6      | 83,491        |

(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」は実質比率を記載しております。

(注3) 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。

設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。



## 当作成期中の基準価額と市況の推移

| 決算期  | 年 月 日           | 基 準 価 額     |        | ベンチマーク |        | 株 式<br>組 入 率 | 株 式<br>先 物 率 |
|------|-----------------|-------------|--------|--------|--------|--------------|--------------|
|      |                 |             | 騰落率    |        | 騰落率    |              |              |
| 第32期 | (期 首)2021年 7月7日 | 円<br>13,908 | %<br>— | 13,779 | %<br>— | %<br>99.3    | %<br>0.8     |
|      | 7月末             | 13,646      | △1.9   | 13,519 | △1.9   | 99.2         | 0.8          |
|      | 8月末             | 14,076      | 1.2    | 13,943 | 1.2    | 99.2         | 0.7          |
|      | (期 末)2021年 9月7日 | 14,811      | 6.5    | 14,673 | 6.5    | 99.4         | 0.5          |
| 第33期 | (期 首)2021年 9月7日 | 14,806      | —      | 14,673 | —      | 99.4         | 0.5          |
|      | 9月末             | 14,681      | △0.8   | 14,436 | △1.6   | 98.6         | 1.4          |
|      | 10月末            | 14,472      | △2.3   | 14,230 | △3.0   | 98.6         | 1.4          |
|      | (期 末)2021年11月8日 | 14,721      | △0.6   | 14,472 | △1.4   | 99.3         | 1.3          |
| 第34期 | (期 首)2021年11月8日 | 14,609      | —      | 14,472 | —      | 99.3         | 1.3          |
|      | 11月末            | 13,839      | △5.3   | 13,713 | △5.3   | 98.8         | 1.3          |
|      | 12月末            | 14,320      | △2.0   | 14,167 | △2.1   | 98.8         | 1.1          |
|      | (期 末)2022年 1月7日 | 14,344      | △1.8   | 14,191 | △1.9   | 99.3         | 0.6          |

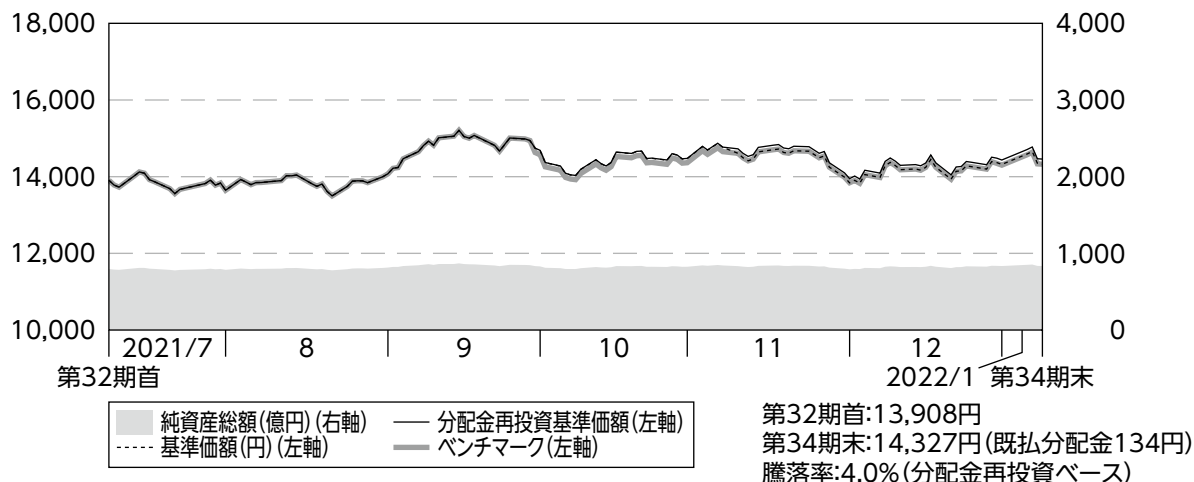
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当作成期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

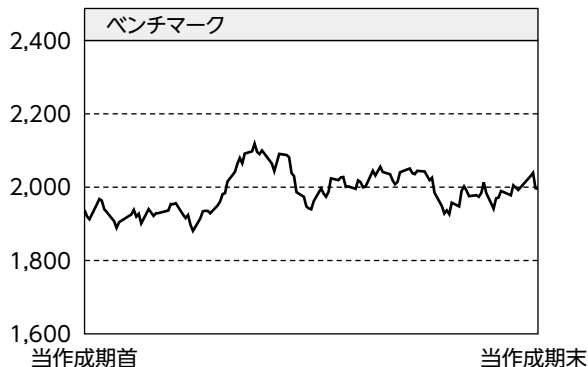


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2021年7月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

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、当作成期末は当作成期首比で上昇しました。

## 投資環境



当作成期の国内株式市場は上昇しました。

当作成期初は堅調な米国株式市場が下支えとなる一方で、国内の新型コロナウイルス新規感染者数の増加などから、軟調に推移しました。9月に入ると、菅首相の自民党総裁選不出馬の報道を受け、新政権による経済対策への期待などから大幅に上昇した後、中国大手不動産開発会社の債務問題や米長期金利の上昇、原油高によるインフレ懸念の高まりなどから急落しました。その後は、国内企業の好決算や岸田政権の大規模な経済対策などが好感されたものの、世界的に金融引き締めが意識されたことや新型コロナウイルス・オミクロン株への警戒感などから、当作成期末にかけて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

株式への投資は「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

### 【「国内株式インデックス マザーファンド」の運用経過】

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

### ○組入ファンド

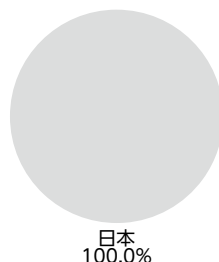
|                    | 当作成期末     |
|--------------------|-----------|
|                    | 2022年1月7日 |
| 国内株式インデックス マザーファンド | 100.1%    |
| その他                | △0.1%     |
| 組入ファンド数            | 1         |

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

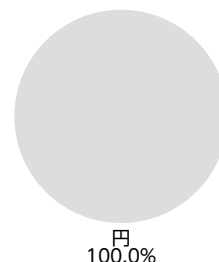
### ○資産別配分



### ○国別配分



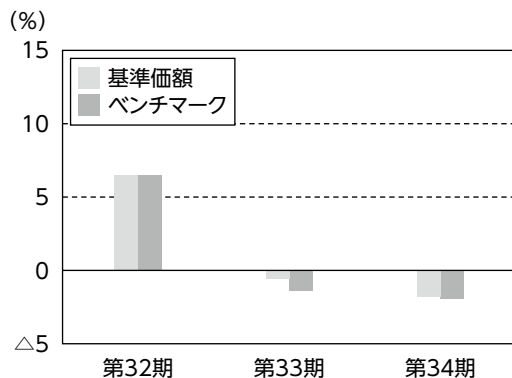
### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当作成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)および信託報酬要因(マイナス)です。

## 分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通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32期                    | 第33期                     | 第34期                     |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 2021年7月8日～<br>2021年9月7日 | 2021年9月8日～<br>2021年11月8日 | 2021年11月9日～<br>2022年1月7日 |
| 当期分配金 (円)     | 5                       | 112                      | 17                       |
| (対基準価額比率) (%) | (0.034)                 | (0.761)                  | (0.119)                  |
| 当期の収益 (円)     | 5                       | 112                      | 17                       |
| 当期の収益以外 (円)   | —                       | —                        | —                        |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 6,791                   | 6,795                    | 6,795                    |

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

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

(注3)―印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

国内株式インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所市場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)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               | 当作成期                  |         | 項目の概要                                                                                                                                                                                            |
|------------------|-----------------------|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                  | (2021年7月8日～2022年1月7日) |         |                                                                                                                                                                                                  |
|                  | 金額                    | 比率      |                                                                                                                                                                                                  |
| (a) 信託報酬         | 9円                    | 0.061%  | (a) 信託報酬＝〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は14,172円です。<br>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。<br>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<br>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、<br>購入後の情報提供等の対価<br>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)           | (6)                   | (0.044) |                                                                                                                                                                                                  |
| (販売会社)           | (1)                   | (0.006) |                                                                                                                                                                                                  |
| (受託会社)           | (2)                   | (0.011) |                                                                                                                                                                                                  |
| (b) 売買委託手数料      | 0                     | 0.000   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$<br>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)                   | (0.000) |                                                                                                                                                                                                  |
| (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)) | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (投資信託証券)         | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (商品)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (先物・オプション)       | (0)                   | (0.000) |                                                                                                                                                                                                  |
| (c) 有価証券取引税      | －                     | －       | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                                                                                                |
| (株式)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (新株予約権証券)        | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (オプション証券等)       | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (公社債)            | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (投資信託証券)         | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (d) その他費用        | 0                     | 0.001   | (d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$<br>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<br>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<br>その他は、金銭信託預入に係る手数料等                              |
| (保管費用)           | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| (監査費用)           | (0)                   | (0.001) |                                                                                                                                                                                                  |
| (その他)            | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                  |
| 合計               | 9                     | 0.062   |                                                                                                                                                                                                  |

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

# 売買および取引の状況

## <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

|                    | 当 作 成 期     |             |             |             |
|--------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
|                    | 設 定         |             | 解 約         |             |
|                    | 口 数         | 金 額         | 口 数         | 金 額         |
| 国内株式インデックス マザーファンド | 2,093,102千口 | 3,972,818千円 | 1,723,049千口 | 3,395,775千円 |

# 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 作 成 期       |
|-------------------------------------|---------------|
| (a) 当 作 成 期 中 の 株 式 売 買 金 額         | 57,241,135千円  |
| (b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額 | 477,305,132千円 |
| (c) 売 買 高 比 率(a)／(b)                | 0.11          |

(注1) (b) 当作成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 作 成 期      |                    |                           |
|---------------|--------------|--------------------|---------------------------|
|               | 買付額等A        | うち利害関係人<br>との取引状況B | 売付額等C                     |
|               |              | $\frac{B}{A}$      | うち利害関係人<br>との取引状況D        |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 百万円<br>8,746 | 百万円<br>13<br>0.1   | 百万円<br>8,750<br>13<br>0.1 |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <国内株式インデックス マザーファンド>

| 区 分           | 当 作 成 期        |                    |                              |
|---------------|----------------|--------------------|------------------------------|
|               | 買付額等A          | うち利害関係人<br>との取引状況B | 売付額等C                        |
|               |                | $\frac{B}{A}$      | うち利害関係人<br>との取引状況D           |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 百万円<br>414,224 | 百万円<br>911<br>0.2  | 百万円<br>414,293<br>911<br>0.2 |

<平均保有割合 16.8%>

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

※ 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。

■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 作 成 期 |       |          |
|-----|---------|-------|----------|
|     | 買 付 額   | 売 付 額 | 当作成期末保有額 |
| 株 式 | 61百万円   | 23百万円 | 1,388百万円 |

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当作成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＞

|                    | 前作成期末      | 当 作 成 期 末  |            |
|--------------------|------------|------------|------------|
|                    | 口 数        | 口 数        | 評 価 額      |
|                    | 千口         | 千口         | 千円         |
| 国内株式インデックス マザーファンド | 42,550,248 | 42,920,301 | 83,548,659 |

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、254,910,801千口です。

投資信託財産の構成

| 項 目                     | 当 作 成 期 末        |           |
|-------------------------|------------------|-----------|
|                         | 評 価 額            | 比 率       |
| 国内株式インデックス マザーファンド      | 千円<br>83,548,659 | %<br>99.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 58,584           | 0.1       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 83,607,243       | 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                       | 第 32 期 末<br>2021年9月7日現在 | 第 33 期 末<br>2021年11月8日現在 | 第 34 期 末<br>2022年1月7日現在 |
|---------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産                   | 85,630,428,228円         | 83,999,582,020円          | 83,607,243,520円         |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 253,673,484             | 58,814,105               | 58,106,897              |
| 国内株式インデックス マザーファンド(評価額)   | 85,203,479,619          | 83,920,993,344           | 83,548,659,534          |
| 未 収 入 金                   | 173,275,125             | 19,774,571               | 477,089                 |
| (B) 負 債                   | 413,558,403             | 675,294,445              | 115,831,610             |
| 未 払 収 益 分 配 金             | 28,777,230              | 638,814,115              | 99,070,649              |
| 未 払 解 約 金                 | 368,034,998             | 18,999,999               | —                       |
| 未 払 信 託 報 酬               | 16,419,136              | 17,150,047               | 16,442,129              |
| 未 払 利 息                   | 203                     | 123                      | 30                      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 326,836                 | 330,161                  | 318,802                 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B)       | 85,216,869,825          | 83,324,287,575           | 83,491,411,910          |
| 元 本                       | 57,554,461,970          | 57,036,974,625           | 58,276,852,873          |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | 27,662,407,855          | 26,287,312,950           | 25,214,559,037          |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 57,554,461,970口         | 57,036,974,625口          | 58,276,852,873口         |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 14,806円                 | 14,609円                  | 14,327円                 |

### ■損益の状況

| 項 目                   | 第 32 期<br>自 2021年7月8日<br>至 2021年9月7日 | 第 33 期<br>自 2021年 9月8日<br>至 2021年11月8日 | 第 34 期<br>自 2021年11月9日<br>至 2022年 1月7日 |
|-----------------------|--------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益         | △6,829円                              | △6,859円                                | △4,872円                                |
| 受 取 利 息               | 134                                  | 56                                     | 90                                     |
| 支 払 利 息               | △6,963                               | △6,915                                 | △4,962                                 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | 5,222,618,766                        | △436,920,118                           | △1,464,357,137                         |
| 売 買 益                 | 5,256,398,021                        | 18,258,529                             | 1,107,277                              |
| 売 買 損                 | △33,779,255                          | △455,178,647                           | △1,465,464,414                         |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △16,745,972                          | △17,480,208                            | △16,760,931                            |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 5,205,865,965                        | △454,407,185                           | △1,481,122,940                         |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | 12,908,047,196                       | 17,749,186,509                         | 16,618,124,032                         |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | 9,577,271,924                        | 9,631,347,741                          | 10,176,628,594                         |
| (配 当 等 相 当 額)         | (21,001,498,211)                     | (20,986,101,737)                       | (21,868,988,491)                       |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△11,424,226,287)                    | (△11,354,753,996)                      | (△11,692,359,897)                      |
| (G) 計 (D+E+F)         | 27,691,185,085                       | 26,926,127,065                         | 25,313,629,686                         |
| (H) 収 益 分 配 金         | △28,777,230                          | △638,814,115                           | △99,070,649                            |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)   | 27,662,407,855                       | 26,287,312,950                         | 25,214,559,037                         |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | 9,577,271,924                        | 9,631,347,741                          | 10,176,628,594                         |
| (配 当 等 相 当 額)         | (21,001,595,591)                     | (20,986,115,681)                       | (21,869,134,434)                       |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△11,424,323,667)                    | (△11,354,767,940)                      | (△11,692,505,840)                      |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 18,085,135,931                       | 17,770,731,145                         | 17,735,641,187                         |
| 繰 越 損 益 金             | —                                    | △1,114,765,936                         | △2,697,710,744                         |

(注1) (B) 有価証券売買損益は各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＞

※当ファンドの第32期首元本額は57,188,653,261円、第32～34期中追加設定元本額は2,879,657,183円、第32～34期中一部解約元本額は1,791,457,571円です。

※分配金の計算過程

| 項 目                             | 第 32 期          | 第 33 期          | 第 34 期          |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| (A) 配当等収益額(費用控除後)               | 30,313,141円     | 660,358,751円    | 104,354,538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)  | 5,175,552,824円  | －円              | －円              |
| (C) 収益調整金額                      | 21,001,595,591円 | 20,986,115,681円 | 21,869,134,434円 |
| (D) 分配準備積立金額                    | 12,908,047,196円 | 17,749,186,509円 | 17,730,357,298円 |
| (E) 分配対象収益額(A+B+C+D)            | 39,115,508,752円 | 39,395,660,941円 | 39,703,846,270円 |
| (F) 期末残存口数                      | 57,554,461,970口 | 57,036,974,625口 | 58,276,852,873口 |
| (G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) | 6,796円          | 6,907円          | 6,812円          |
| (H) 分配金額(1万口当たり)                | 5円              | 112円            | 17円             |
| (I) 収益分配金金額(F×H/10,000)         | 28,777,230円     | 638,814,115円    | 99,070,649円     |

## 分配金のお知らせ

|           | 第32期 | 第33期 | 第34期 |
|-----------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金 | 5円   | 112円 | 17円  |

(注) 分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

## お知らせ

2022年4月4日に東京証券取引所(以下「東証」といいます。)は、「市場第一部・市場第二部・マザーズ・JASDAQ(スタンダード・グロース)」の4つの市場区分を「プライム市場・スタンダード市場・グロース市場」の3つの市場区分に見直すこととしております。これに伴い東証の市場区分に関する記載内容を変更する予定です。詳細は日本取引所グループのホームページをご確認ください。

# 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。<br>外貨建資産への投資は、行いません。             |

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準 価 額 |         | ベンチマーク   |         | 株 式 先 物 率<br>純 資 産 額 | 株 式 先 物 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 |
|------------------|---------|---------|----------|---------|----------------------|----------------|----------------|
|                  | 期 騰 落 率 | 中 騰 落 率 | 期 騰 落 率  | 中 騰 落 率 |                      |                |                |
| 第17期(2017年5月29日) | 円       | %       |          | %       | %                    | %              | 百万円            |
|                  | 13,812  | 17.5    | 1,570.21 | 14.9    | 98.2                 | 1.8            | 162,440        |
| 第18期(2018年5月29日) | 15,832  | 14.6    | 1,761.85 | 12.2    | 98.1                 | 1.8            | 205,946        |
| 第19期(2019年5月29日) | 14,134  | △10.7   | 1,536.41 | △12.8   | 97.8                 | 2.2            | 272,283        |
| 第20期(2020年5月29日) | 14,762  | 4.4     | 1,563.67 | 1.8     | 97.0                 | 1.7            | 313,448        |
| 第21期(2021年5月31日) | 18,550  | 25.7    | 1,922.98 | 23.0    | 98.5                 | 1.5            | 462,835        |

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                  | 基 準 価 額 |         | ベンチマーク   |         | 株 式 先 物 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 |
|------------------------|---------|---------|----------|---------|----------------|----------------|
|                        | 騰 落 率   | 中 騰 落 率 | 騰 落 率    | 中 騰 落 率 |                |                |
| (当 期 首)<br>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)<br>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。

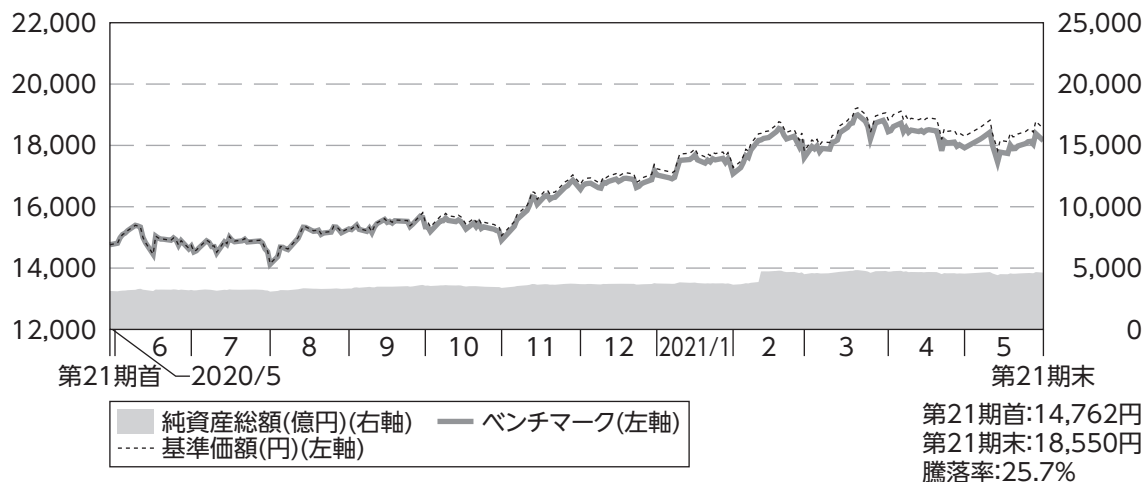
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

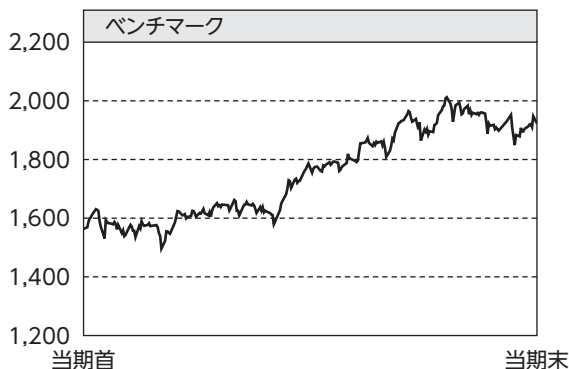


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 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

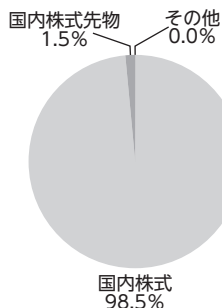
### ○上位10銘柄

| 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% |

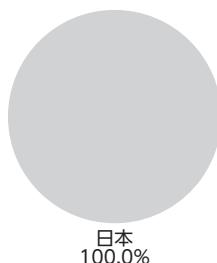
| 順位    | 銘柄名           | 国・地域  | 組入比率 |
|-------|---------------|-------|------|
| 7     | 任天堂           | 日本    | 1.4% |
| 8     | リクルートホールディングス | 日本    | 1.4% |
| 9     | 信越化学工業        | 日本    | 1.3% |
| 10    | 日本電信電話        | 日本    | 1.3% |
| 組入銘柄数 |               | 2,115 |      |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

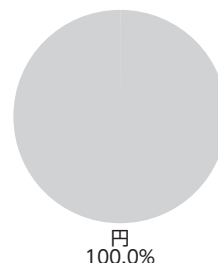
### ○資産別配分



### ○国別配分



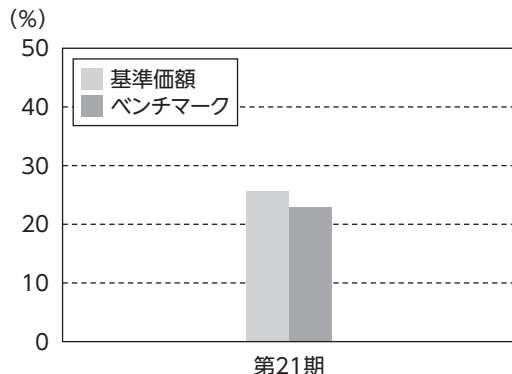
### ○通貨別配分



(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<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(投資信託証券)<br>(商品)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(0)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(0) | 0.002%<br>(0.002)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$<br>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<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(公社債)<br>(投資信託証券)              | －<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)         | －<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)                     | (b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$<br>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<br><br>(保管費用)<br><br>(監査費用)<br>(その他)                                                       | 0<br><br>(－)<br><br>(－)<br>(0)                      | 0.000<br><br>(－)<br><br>(－)<br>(0.000)                          | (c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$<br>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<br>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<br>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<br>67,361<br>(△15,660) | 千円<br>155,537,538<br>(－) | 千株<br>32,910 | 千円<br>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<br>－ | 千円<br>－ | 証券<br>－<br>(38,100) | 千円<br>－<br>(－) |

(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<br>48,757 | 百万円<br>48,214 | 百万円<br>－  | 百万円<br>－ |

(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<sup>※</sup>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<br>A      | 売付額等C      | うち利害関係人との取引状況D | D<br>C      |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>13 | 百万円<br>13      | %<br>100. 0 | 百万円<br>735 | 百万円<br>735     | %<br>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

## &lt; 国内株式(上場株式) &gt;

| 銘柄                  | 当期中(前期末)    | 当 期 末       |               |
|---------------------|-------------|-------------|---------------|
|                     | 株 数<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(千円) |
| <b>水産・農林業(0.1%)</b> |             |             |               |
| 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         |
| <b>鉱業(0.2%)</b>     |             |             |               |
| 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        |
| <b>建設業(2.3%)</b>    |             |             |               |
| ヒノキヤグループ            | 4.7         | 5.8         | 14,494        |
| ショーボンドホールディングス      | 29.3        | 33.5        | 153,262       |
| ミライト・ホールディングス       | 55.9        | 81.3        | 156,909       |
| タマホーム               | 10.1        | 14.2        | 29,876        |
| サンヨーホームズ            | 1.6         | 2.7         | 1,930         |
| 日本アクア               | 7.5         | 9.3         | 5,003         |
| ファーストコーポレーション       | 5.7         | 7.2         | 5,407         |
| ベステラ                | 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            | 当期中(前期末)    | 当 期 末       |               |
|---------------|-------------|-------------|---------------|
|               | 株 数<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(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    |        |
| 寿スビリッツ           | 13.4        | 16.7        | 116,065   |        |
| カルビー             | 63.3        | 79          | 199,475   |        |
| 森永乳業             | 25.7        | 32.1        | 181,686   |        |
| 六甲バター            | 9.2         | 11.5        | 17,549    |        |
| ヤクルト本社           | 95.6        | 119.3       | 705,063   |        |
| 明治ホールディングス       | 91.9        | 114.7       | 779,960   |        |
| 雪印メグミルク          | 33.5        | 41.7        | 87,695    |        |
| プリマハム            | 21.7        | 24.4        | 73,322    |        |
| 日本ハム             | 53.1        | 66.3        | 290,062   |        |
| 林兼産業             | 4.6         | 5.7         | 3,482     |        |
| 丸大食品             | 14.8        | 17.1        | 28,591    |        |
| S F o o d s      | 11.1        | 15.6        | 50,154    |        |
| 柿安本店             | 4.8         | 6           | 14,922    |        |
| 伊藤ハム米久ホールディングス   | 89.5        | 111.6       | 79,124    |        |
| サッポロホールディングス     | 47.4        | 59.2        | 127,102   |        |
| アサヒグループホールディングス  | 291         | 378.8       | 1,976,957 |        |
| キリンホールディングス      | 589.4       | 735.4       | 1,626,337 |        |
| 宝ホールディングス        | 103         | 128.5       | 186,325   |        |
| オエノンホールディングス     | 36.7        | 49.3        | 18,586    |        |
| 養命酒製造            | 4.3         | 5.3         | 9,439     |        |
| コカ・コーラ ボトラーズ     | 97.5        | 132.8       | 239,571   |        |
| ジャパンホールディングス     | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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    |           |
| <b>繊維製品 (0.5%)</b> |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| トーア紡コーポレーション        | 5.4         | 6.7         | 3,061     |           |
| 帝国繊維                | 15.5        | 19.3        | 39,159    |           |
| 帝人                  | 110.9       | 159.5       | 281,836   |           |
| 東レ                  | 982.7       | 1,225.8     | 871,053   |           |
| サカイオーベックス           | 3.8         | 4.6         | 13,606    |           |
| 住江織物                | 3           | 3.7         | 7,030     |           |
| 日本フェルト              | 8.6         | 10.7        | 4,825     |           |
| イチカワ                | 2.3         | 2.6         | 3,562     |           |
| 日東製網                | 1.6         | 1.8         | 2,750     |           |
| アツギ                 | 11.3        | 13.3        | 8,272     |           |
| ダイニック               | 5.1         | 6.4         | 5,024     |           |
| セーレン                | 33.7        | 41.8        | 84,895    |           |
| ソトー                 | 5.5         | 7           | 5,579     |           |
| 東海染工                | 2           | 2.3         | 2,589     |           |
| 小松マテーレ              | 22.4        | 28          | 25,452    |           |
| ワコールホールディングス        | 35.4        | 42.3        | 105,750   |           |
| ホギメディカル             | 15.5        | 22.9        | 75,455    |           |
| クラウドピ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     |           |
| <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |             |             |           |           |
| 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    |           |
| <b>化学 (7.4%)</b>    |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(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     |        |
| 日本バーカライジング     | 68.4        | 85.4        | 93,256    |        |
| 高压ガス工業         | 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<br>(千株) | 株 数<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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ャパン     | 3.1         | 3.9         | 3,978     |           |
| 新日本製薬            | —           | 4.7         | 9,667     |           |
| エステー             | 8.9         | 11.1        | 19,169    |           |
| アグロ カネショウ        | 5.8         | 6.5         | 9,353     |           |
| コニシ              | 22.7        | 28.4        | 43,480    |           |
| 長谷川香料            | 23.9        | 29.8        | 62,788    |           |
| 星光PMC            | 7.9         | 9.9         | 7,712     |           |
| 小林製薬             | 38.8        | 48.4        | 470,448   |           |
| 荒川化学工業           | 12.4        | 14.4        | 17,121    |           |
| メック              | 9.5         | 11.8        | 33,382    |           |
| 日本高純度化学          | 3.8         | 4.7         | 13,484    |           |
| タカラバイオ           | 36.2        | 45.2        | 135,012   |           |
| JCU              | 16.8        | 19.4        | 69,258    |           |
| 新田ゼラチン           | 8.7         | 10.8        | 6,955     |           |
| OATアグリオ          | 2.4         | 3.3         | 4,847     |           |
| デクセリアルズ          | 35.8        | 48.3        | 107,805   |           |
| アース製薬            | 10.4        | 13          | 81,900    |           |
| 北興化学工業           | 14.2        | 16.1        | 14,731    |           |
| 大成ラミック           | 4.5         | 5.3         | 14,553    |           |
| クミアイ化学工業         | 57.3        | 71.4        | 59,190    |           |
| 日本農薬             | 24.7        | 30.8        | 16,077    |           |
| アキレス             | 9.5         | 11.9        | 16,517    |           |
| 有沢製作所            | 21.9        | 24          | 21,864    |           |
| 日東電工             | 95.5        | 104.4       | 886,356   |           |
| レック              | 14.8        | 20.5        | 22,591    |           |
| 三光合成             | 15.8        | 18.1        | 7,457     |           |
| きもと              | 23.5        | 26.4        | 6,758     |           |
| 藤森工業             | 12.4        | 15.5        | 63,937    |           |
| 前澤化成工業           | 8.8         | 11          | 13,574    |           |
| 未来工業             | 7.4         | 6.2         | 10,719    |           |

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

| 銘柄                     | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |           |
|------------------------|-------------|-------------|-----------|-----------|
|                        | 株 数<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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    |           |
| サウイグループホールディングス        | —           | 37.8        | 180,684   |           |
| <b>石油・石炭製品 (0.4%)</b>  |             |             |           |           |
| 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   |           |
| <b>ゴム製品 (0.7%)</b>     |             |             |           |           |
| 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   |           |
| 藤倉コンボジット               | 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    |           |
| <b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b> |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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    |           |
| <b>鉄鋼 (0.8%)</b>   |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| シンニッタン            | 21.5        | 21          | 5,229     |           |
| 新家工業              | 3.2         | 4.3         | 6,961     |           |
| <b>非鉄金属(0.8%)</b> |             |             |           |           |
| 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   |           |
| <b>金属製品(0.6%)</b> |             |             |           |           |
| 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     |           |
| 東洋製罐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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価     | 額<br>(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  |           |
| <b>機械(5.6%)</b> |             |             |         |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| パンチ工業          | 12.5        | 14.4        | 8,280     |           |
| 富士ダイス          | 6.2         | 8.7         | 5,689     |           |
| 豊和工業           | 7.7         | 9.7         | 7,847     |           |
| OKK            | 5.9         | 6.6         | 2,554     |           |
| 東洋機械金属         | 10          | 12.4        | 6,485     |           |
| 津田駒工業          | 2.8         | 3.3         | 2,917     |           |
| エンシュウ          | 3.4         | 4.4         | 3,770     |           |
| 島精機製作所         | 21.6        | 25.1        | 53,161    |           |
| オプトラン          | 15.3        | 21.5        | 58,243    |           |
| NCホールディングス     | 4.3         | 5.3         | 5,029     |           |
| イワキポンプ         | 8.8         | 11          | 10,395    |           |
| フリュー           | 13.5        | 16.8        | 19,068    |           |
| ヤマシンフィルタ       | 29.8        | 34.6        | 27,749    |           |
| 日阪製作所          | 17          | 21.2        | 17,129    |           |
| やまびこ           | 26.6        | 33.2        | 40,470    |           |
| 平田機工           | 6.5         | 8.1         | 52,407    |           |
| ベガスサミシン製造      | 14.1        | 17.5        | 8,575     |           |
| マルマエ           | 5.1         | 7.1         | 13,518    |           |
| タツモ            | 6.4         | 7.3         | 11,899    |           |
| ナブテスコ          | 80.7        | 100.7       | 505,514   |           |
| 三井海洋開発         | 14.6        | 18.2        | 38,656    |           |
| レオン自動機         | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| クボタ             | 734.7       | 907.6       | 2,258,108 |           |
| 荏原実業            | 3.5         | 4.4         | 28,028    |           |
| 三菱化工機           | 4.8         | 5.6         | 15,265    |           |
| 月島機械            | 25.6        | 32          | 37,088    |           |
| 帝国電機製作所         | 11.5        | 12.1        | 15,173    |           |
| 新東工業            | 33          | 41.3        | 32,090    |           |
| 澁谷工業            | 12.1        | 15.2        | 50,084    |           |
| アイチ コーポレーション    | 24.1        | 29.6        | 25,781    |           |
| 小森コーポレーション      | 35.3        | 44.1        | 34,971    |           |
| 鶴見製作所           | 10.7        | 13.4        | 23,155    |           |
| 住友精密工業          | 2.1         | 2.6         | 6,385     |           |
| 日本ギア工業          | 5.8         | 7.2         | 2,354     |           |
| 酒井重工業           | 2.7         | 3.1         | 6,342     |           |
| 荏原製作所           | 57.3        | 71.7        | 387,180   |           |
| 石井鐵工所           | 1.8         | 2.5         | 7,425     |           |
| 西島製作所           | 14.1        | 17.7        | 15,664    |           |
| 北越工業            | 14.3        | 17.9        | 20,244    |           |
| ダイキン工業          | 176.4       | 220.1       | 4,755,260 |           |
| オルガノ            | 5           | 5.6         | 35,840    |           |
| トーヨーカネツ         | 6.1         | 6.6         | 15,655    |           |
| 栗田工業            | 75          | 93.5        | 470,305   |           |
| 椿本チエイン          | 19.8        | 24.7        | 75,952    |           |
| 大同工業            | 6.8         | 8.4         | 9,181     |           |
| 木村化工機           | 11.8        | 14.6        | 13,388    |           |
| アネスト岩田          | 21.6        | 29.2        | 29,492    |           |
| ダイフク            | 70.8        | 95.1        | 874,920   |           |
| サムコ             | 3.5         | 4.3         | 13,674    |           |
| 加藤製作所           | 7.7         | 9.7         | 9,593     |           |
| 油研工業            | 2.4         | 3           | 5,202     |           |
| タダノ             | 67          | 83.6        | 88,448    |           |
| フジテック           | 50.4        | 59.5        | 143,276   |           |
| CKD             | 38          | 40.1        | 104,500   |           |
| キトー             | 10.5        | 14.6        | 24,747    |           |
| 平和              | 38.7        | 48.2        | 87,772    |           |
| 理想科学工業          | 12.3        | 12.7        | 21,958    |           |
| SANKYO          | 30.8        | 41.1        | 109,654   |           |
| 日本金銭機械          | 15.4        | 19.3        | 10,788    |           |
| マースグループホールディングス | 8.8         | 11          | 17,611    |           |
| フクシマガリレイ        | 8.6         | 11.9        | 50,218    |           |
| オーイズミ           | 6           | 7.5         | 2,902     |           |
| ダイコク電機          | 6.4         | 8           | 7,136     |           |
| 竹内製作所           | 23.2        | 28.9        | 83,752    |           |
| アマノ             | 36.3        | 45.3        | 129,784   |           |
| JUKI            | 19.3        | 24          | 18,480    |           |
| 蛇の目ミシン工業        | 12.8        | 15.8        | 12,877    |           |

| 銘柄            | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |           |
|---------------|-------------|-------------|-----------|-----------|
|               | 株 数<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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         |
| ノーリツ銅機      | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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       |
| <b>その他製品 (2.6%)</b> |             |             |               |
| 中本バックス              | 3.5         | 4.4         | 7,040         |
| スノーピーク              | 7.4         | 10.2        | 35,904        |
| パラマウントベッドホールディングス   | 14.6        | 33.1        | 66,365        |
| トランザクション            | 7.6         | 9.5         | 12,967        |
| 粧美堂                 | 4           | 5           | 2,110         |
| ニホンフラッシュ            | 12.9        | 14.8        | 18,633        |
| 前田工織                | 15.3        | 19          | 65,075        |
| 永大産業                | 18.1        | 22.6        | 6,847         |
| アートネイチャー            | 14.8        | 16.6        | 10,690        |
| バンダイナムコホールディングス     | 143.1       | 142.9       | 1,120,478     |
| アイフィスジャパン           | 3.5         | 4.4         | 3,163         |
| 共立印刷                | 23.1        | 28.9        | 4,074         |
| SHOEI               | 12.1        | 16.2        | 63,747        |
| フランスベッドホールディングス     | 19.6        | 22.2        | 20,535        |
| パイロットコーポレーション       | 22.6        | 29.2        | 99,718        |
| 萩原工業                | 7.7         | 9.6         | 13,737        |
| トッパン・フォームズ          | 29.7        | 30.8        | 33,818        |
| フジシールインターナショナル      | 31          | 35.5        | 84,099        |
| タカラトミー              | 62.1        | 77.5        | 73,780        |
| 廣済堂                 | 9.6         | 12          | 13,416        |
| エステールホールディングス       | 3.7         | 4.6         | 2,948         |
| アーク                 | 52.8        | —           | —             |
| タカノ                 | 5.4         | 5.9         | 3,681         |
| プロネクス               | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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        |
| <b>電気・ガス業 (1.2%)</b> |             |             |               |
| 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        |
| <b>陸運業 (3.3%)</b>    |             |             |               |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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   |           |
| <b>海運業(0.3%)</b> |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| 乾汽船                   | 7.6         | 11.2        | 12,476    |           |
| <b>空運業(0.5%)</b>      |             |             |           |           |
| 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     |           |
| <b>倉庫・運輸関連業(0.2%)</b> |             |             |           |           |
| 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     |           |
| <b>情報・通信業(9.0%)</b>   |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価     | 額<br>(千円) |
| GMOグローバルサイン・ホールディングス  | 2.6         | 3.8         | 19,304  |           |
| SRAホールディングス           | 7.3         | 9.1         | 23,632  |           |
| システムインテグレータ           | 4.6         | 5.4         | 3,380   |           |
| 朝日ネット                 | 9.9         | 14.3        | 10,024  |           |
| eBASE                 | 16.5        | 20.7        | 17,967  |           |
| アバント                  | 13.2        | 18.4        | 27,618  |           |
| アドソル日進                | 4.9         | 6.2         | 14,960  |           |
| ODKソリューションズ           | —           | 4           | 3,476   |           |
| フリービット                | 7.4         | 10.5        | 9,408   |           |
| コムチュア                 | 15.3        | 15.7        | 35,890  |           |
| サイバーコム                | 2.6         | 3.3         | 4,953   |           |
| アステリア                 | 8.8         | 12.7        | 10,452  |           |
| アイル                   | 7.7         | 9.6         | 14,937  |           |
| マークラインズ               | 6.9         | 7.2         | 21,211  |           |
| メディカル・データ・ビジョン        | 10.6        | 19.5        | 39,390  |           |
| gumi                  | —           | 23.8        | 27,132  |           |
| ショーケース                | 3.6         | 4.2         | 3,179   |           |
| モバイルファクトリー            | 3.3         | 4.1         | 5,198   |           |
| テラスカイ                 | 5           | 5.6         | 14,061  |           |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジー | 5.5         | 7.7         | 16,016  |           |
| PCIホールディングス           | 5.4         | 6.7         | 8,509   |           |
| パイブドHD                | 1.9         | 3.7         | 5,816   |           |
| アイビーシー                | 2.5         | 3.1         | 3,093   |           |
| ネオジャパン                | 2.8         | 3.4         | 5,671   |           |
| PR TIMES              | 1.3         | 3.7         | 12,025  |           |
| ラクス                   | —           | 51.2        | 103,731 |           |
| ランドコンピュータ             | 2.3         | 2.9         | 3,062   |           |
| ダブルスタンダード             | 1.8         | 2.3         | 11,166  |           |
| オーブンドア                | 6.9         | 10.2        | 26,866  |           |
| マイネット                 | 4.4         | 5.5         | 4,053   |           |
| アカツキ                  | 4.9         | 6.9         | 24,219  |           |
| ベネフィットジャパン            | 1.2         | 1.5         | 3,048   |           |
| Ubicomホールディングス        | 3.2         | 4.6         | 14,283  |           |
| LINE                  | 31.2        | —           | —       |           |
| カナミックネットワーク           | 12.7        | 18.7        | 12,342  |           |
| ノムラシステムコーポレーション       | 3.5         | 8.7         | 2,557   |           |
| チェンジ                  | 4.8         | 31.3        | 92,835  |           |
| シンクロ・フード              | 6.5         | 11.1        | 4,218   |           |
| オークネット                | 8.6         | 9.2         | 12,622  |           |
| キャピタル・アセット・プランニング     | —           | 3.7         | 3,944   |           |
| セグエグループ               | 3.3         | 4.7         | 5,419   |           |
| エイトレッド                | 2.4         | 3.4         | 7,612   |           |
| AOI TYO Holdings      | 14.3        | 17.6        | 15,804  |           |
| マクロミル                 | 28.1        | 35.1        | 29,905  |           |
| ビーグリー                 | 2.8         | 3.6         | 4,640   |           |



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

| 銘柄                   | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |            |        |
|----------------------|-------------|-------------|------------|--------|
|                      | 株 数<br>(千株) | 株 数<br>(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      |        |
| アイド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<br>(千株) | 株 数<br>(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  |        |
| ビーバンドットコム           | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価     | 価 額<br>(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   |             |
| 立花エレクトック            | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価     | 価 額<br>(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   |             |
| バ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   |             |
| アーランドサービスホールディングス | 10.1        | 14.4        | 32,731  |             |
| J、フロント リテイリング     | 163.1       | 203.5       | 218,966 |             |
| ドトール・日レスホールディングス  | 19.7        | 27.2        | 44,363  |             |
| マツモトキヨシホールディングス   | 56.4        | 70.4        | 332,640 |             |
| ブロンコビリー           | 7.2         | 9.1         | 20,911  |             |
| ZOZO              | 93.9        | 100.4       | 371,982 |             |
| トレジャー・ファクトリー      | 4.3         | 5.4         | 5,578   |             |
| 物語コーポレーション        | 3.7         | 9.1         | 60,060  |             |
| ココカラファイン          | 14.3        | 15.2        | 120,688 |             |
| 三越伊勢丹ホールディングス     | 238.7       | 298.2       | 234,087 |             |
| Hamee             | 5           | 4.6         | 6,872   |             |
| マーケットエンタープライズ     | —           | 1.4         | 1,516   |             |
| ウエルシアホールディングス     | 40.6        | 90.1        | 301,384 |             |
| クリエイトSDホールディングス   | 23          | 25.2        | 81,144  |             |
| 丸善CHIホールディングス     | 15.9        | 19.9        | 7,960   |             |
| ミサワ               | —           | 4           | 2,756   |             |
| ティーライフ            | 2.2         | 2.6         | 3,720   |             |

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

| 銘柄                  | 当期首(前期末)    | 当 期 末       |           |        |
|---------------------|-------------|-------------|-----------|--------|
|                     | 株 数<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額 (千円) |
| ミニストップ              | 10.2        | 12.7        | 17,119    |        |
| アークス                | 28          | 32.6        | 77,848    |        |
| パローホールディングス         | 30.3        | 34.9        | 77,582    |        |
| ベルク                 | 6.8         | 8.5         | 46,835    |        |
| 大庄                  | 7.4         | 9.5         | 9,338     |        |
| ファーストリテイリング         | 18.2        | 22.8        | 2,033,076 |        |
| サンドラッグ              | 51.4        | 64.1        | 235,247   |        |
| サックスパー ホールディングス     | 11.9        | 15.1        | 9,271     |        |
| ヤマザワ                | 3.3         | 4.2         | 7,140     |        |
| やまや                 | 2.9         | 3.5         | 7,973     |        |
| ベルーナ                | 29.7        | 36.9        | 40,147    |        |
| <b>銀行業(5.2%)</b>    |             |             |           |        |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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    |           |
| <b>証券・商品先物取引業(0.8%)</b>   |             |             |           |           |
| F P G                     | 42.4        | 57.6        | 42,048    |           |
| ジャパシ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    |           |
| <b>保険業(2.0%)</b>          |             |             |           |           |
| 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     |           |
| <b>その他金融業(1.1%)</b>       |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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    |           |
| <b>不動産業(2.0%)</b> |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| ハウスドゥ              | 6.7         | 8.4         | 8,778     |           |
| シーアールイー            | 4.9         | 5.5         | 8,206     |           |
| グッドコムアセット          | 4.5         | 9.2         | 12,502    |           |
| ジェイ・エス・ビー          | 3.7         | 3.6         | 12,510    |           |
| テンポイノベーション         | 5.6         | 6.6         | 5,643     |           |
| フェイスネットワーク         | —           | 2.5         | 3,320     |           |
| パーク24              | 74.3        | 92.1        | 210,540   |           |
| パラカ                | 4.7         | 5.3         | 8,538     |           |
| 三井不動産              | 674.5       | 777.2       | 1,981,471 |           |
| 三菱地所               | 958         | 1,120.2     | 1,986,674 |           |
| 平和不動産              | 25.7        | 29.5        | 122,277   |           |
| 東京建物               | 145.3       | 169.2       | 275,457   |           |
| ダイビル               | 37.1        | 44.4        | 55,455    |           |
| 京阪神ビルディング          | 23.3        | 30.5        | 41,358    |           |
| 住友不動産              | 307.7       | 383.4       | 1,395,192 |           |
| テオーシー              | 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   |           |
| <b>サービス業(5.6%)</b> |             |             |           |           |
| 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(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    |           |
| KeepPer 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         | —           | —         |           |
| パリュールHR             | 5.3         | 6.7         | 11,101    |           |
| M&Aキャピタルパートナーズ      | 10.8        | 13.6        | 62,900    |           |
| ライドオンエクスプレスホールディングス | 5.1         | 6.6         | 9,609     |           |
| ERIホールディングス         | 3.9         | 5.1         | 2,993     |           |
| アビスト                | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価       | 額<br>(千円) |
| エラン                        | 7.9         | 23          | 32,085    |           |
| 土木管理総合試験所                  | 6.1         | 8.8         | 3,370     |           |
| ネットマーケティング                 | 5.3         | 8.7         | 3,523     |           |
| 日本郵政                       | 1,084.6     | 1,249.3     | 1,137,862 |           |
| ベルシステム24ホールディングス           | 22.3        | 27.8        | 45,369    |           |
| 鎌倉新書                       | 10.1        | 16.9        | 20,618    |           |
| SMN                        | 3           | 3.9         | 3,123     |           |
| 一蔵                         | 1.8         | —           | —         |           |
| LITALICO                   | 4.6         | —           | —         |           |
| グローバルキッズCOMPANY            | 2.6         | 3.3         | 3,296     |           |
| エアトリ                       | 6.9         | 10.3        | 30,148    |           |
| アトラエ                       | 4           | 11.6        | 19,290    |           |
| ストライク                      | 5           | 6.3         | 26,460    |           |
| ソラスト                       | 36.6        | 40.7        | 53,113    |           |
| セラク                        | 4.3         | 5.3         | 11,241    |           |
| インソース                      | 5.5         | 16.1        | 34,518    |           |
| ベイカレント・コンサルティング            | 8           | 10.8        | 360,720   |           |
| Orchestra Holdings         | 2.9         | 3.8         | 11,084    |           |
| アイモバイル                     | 4.9         | 4.9         | 6,757     |           |
| キャリアインデックス                 | 5.8         | 7.2         | 4,946     |           |
| MS-Japan                   | 4.4         | 7           | 7,518     |           |
| 船場                         | 2.3         | 3.6         | 2,980     |           |
| グレイステクノロジー                 | 6.1         | 16.9        | 32,988    |           |
| ジャパンエレベーター<br>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    |           |
| RPAホールディングス                | 10.2        | 19.6        | 14,386    |           |
| スプリックス                     | 3.9         | 4.9         | 6,242     |           |
| マネジメントソリューションズ             | 5.9         | 8.2         | 16,564    |           |
| プロレド・パートナーズ                | 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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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<br>(千株) | 株 数<br>(千株) | 評 価 額<br>(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<br>(証券) | 証 券 数<br>(証券) | 評 価 額<br>(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<br>(百万円) | 売 建 額<br>(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<br>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<br>自 2020年5月30日<br>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。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |                                                                                                                                                                      |                                |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／国内／債券／インデックス型                                                                                                                                                  |                                |
| 信 託 期 間 | 信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。                                                                                                                                       |                                |
| 運 用 方 針 | 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  | FOFs用 国内債券<br>インデックス・ファンドP<br>(適格機関投資家専用)                                                                                                                            | 下記のマザーファンド受益証券<br>を主要投資対象とします。 |
|         | 国内債券<br>インデックス<br>マザーファンド                                                                                                                                            | わが国の公社債を主要投資対象<br>とします。        |
| 組 入 制 限 | FOFs用 国内債券<br>インデックス・ファンドP<br>(適格機関投資家専用)                                                                                                                            | 外貨建資産への投資は行いま<br>せん。           |
|         | 国内債券<br>インデックス<br>マザーファンド                                                                                                                                            | 外貨建資産への投資は、行いま<br>せん。          |
| 分 配 方 針 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>(1) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。<br>(2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                                |

FOFs用 国内債券インデックス・  
ファンドP(適格機関投資家専用)

運 用 報 告 書 (全 体 版)

第32期 (決算日 2021年 9月7日)  
第33期 (決算日 2021年11月8日)  
第34期 (決算日 2022年 1月7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。
- ・－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作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期              | 基準価額   |       |       | ベンチマーク |       | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額   |
|-----|------------------|--------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|---------|
|     |                  | (分配落)  | 税込分配金 | 期中騰落率 |        | 期中騰落率 |        |        |         |
| 第8  |                  | 円      | 円     | %     |        | %     | %      | %      | 百万円     |
|     | 第20期(2019年 9月9日) | 10,325 | 11    | 1.0   | 10,593 | 1.0   | 99.8   | —      | 113,705 |
|     | 第21期(2019年11月7日) | 10,164 | 8     | △1.5  | 10,439 | △1.5  | 99.7   | —      | 111,255 |
| 第9  | 第22期(2020年 1月7日) | 10,115 | 7     | △0.4  | 10,398 | △0.4  | 99.7   | 0.0    | 109,216 |
|     | 第23期(2020年 3月9日) | 10,256 | 11    | 1.5   | 10,555 | 1.5   | 99.2   | —      | 109,693 |
|     | 第24期(2020年 5月7日) | 10,072 | 7     | △1.7  | 10,375 | △1.7  | 99.7   | —      | 99,971  |
| 第10 | 第25期(2020年 7月7日) | 9,994  | 9     | △0.7  | 10,306 | △0.7  | 99.7   | 0.0    | 101,147 |
|     | 第26期(2020年 9月7日) | 9,982  | 9     | △0.0  | 10,305 | △0.0  | 99.7   | —      | 102,869 |
|     | 第27期(2020年11月9日) | 10,008 | 8     | 0.3   | 10,341 | 0.3   | 99.7   | —      | 105,244 |
| 第11 | 第28期(2021年 1月7日) | 9,986  | 7     | △0.1  | 10,329 | △0.1  | 99.8   | —      | 106,985 |
|     | 第29期(2021年 3月8日) | 9,927  | 8     | △0.5  | 10,277 | △0.5  | 99.6   | 0.0    | 107,463 |
|     | 第30期(2021年 5月7日) | 9,958  | 9     | 0.4   | 10,321 | 0.4   | 99.7   | —      | 108,385 |
| 第12 | 第31期(2021年 7月7日) | 9,978  | 8     | 0.3   | 10,352 | 0.3   | 99.8   | —      | 110,092 |
|     | 第32期(2021年 9月7日) | 9,970  | 9     | 0.0   | 10,355 | 0.0   | 99.7   | —      | 111,001 |
|     | 第33期(2021年11月8日) | 9,952  | 7     | △0.1  | 10,346 | △0.1  | 99.8   | —      | 112,137 |
|     | 第34期(2022年 1月7日) | 9,890  | 7     | △0.6  | 10,293 | △0.5  | 99.8   | —      | 113,770 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

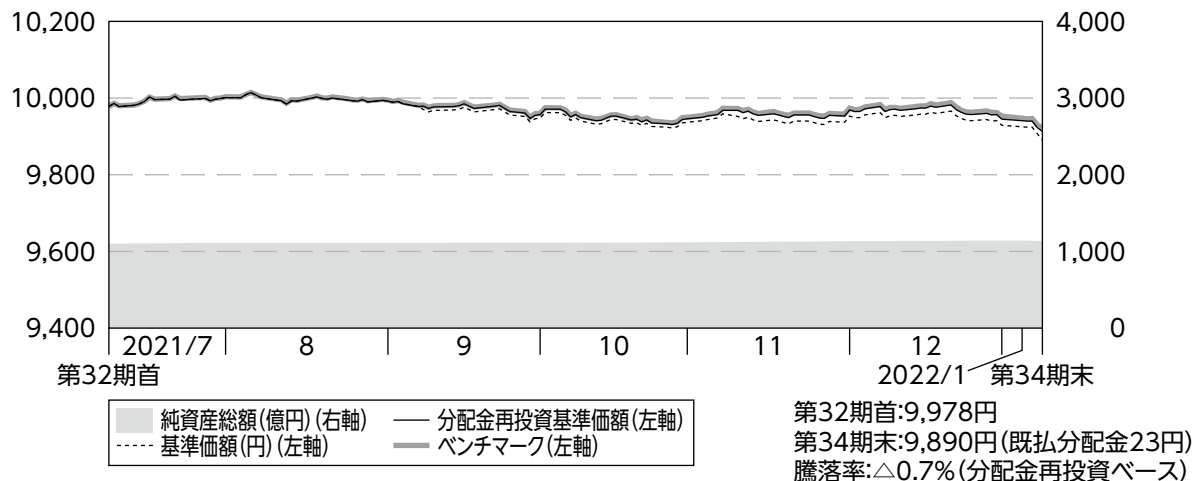
# 当作成期中の基準価額と市況の推移

| 決算期  | 年 月 日           | 基 準 価 額    |        | ベンチマーク |        | 債 券<br>組入比率 | 債券先物<br>比 率 |
|------|-----------------|------------|--------|--------|--------|-------------|-------------|
|      |                 |            | 騰 落 率  |        | 騰 落 率  |             |             |
| 第32期 | (期 首)2021年 7月7日 | 円<br>9,978 | %<br>— | 10,352 | %<br>— | %<br>99.8   | %<br>—      |
|      | 7月末             | 10,001     | 0.2    | 10,378 | 0.3    | 99.7        | —           |
|      | 8月末             | 9,992      | 0.1    | 10,369 | 0.2    | 99.7        | —           |
|      | (期 末)2021年 9月7日 | 9,979      | 0.0    | 10,355 | 0.0    | 99.7        | —           |
| 第33期 | (期 首)2021年 9月7日 | 9,970      | —      | 10,355 | —      | 99.7        | —           |
|      | 9月末             | 9,948      | △0.2   | 10,333 | △0.2   | 99.9        | —           |
|      | 10月末            | 9,937      | △0.3   | 10,322 | △0.3   | 99.8        | —           |
|      | (期 末)2021年11月8日 | 9,959      | △0.1   | 10,346 | △0.1   | 99.8        | —           |
| 第34期 | (期 首)2021年11月8日 | 9,952      | —      | 10,346 | —      | 99.8        | —           |
|      | 11月末            | 9,953      | 0.0    | 10,347 | 0.0    | 99.8        | —           |
|      | 12月末            | 9,929      | △0.2   | 10,326 | △0.2   | 99.8        | —           |
|      | (期 末)2022年 1月7日 | 9,897      | △0.6   | 10,293 | △0.5   | 99.8        | —           |

(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、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。  
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当作成期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

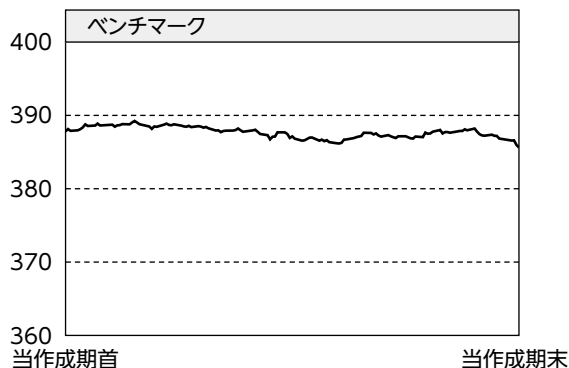


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2021年7月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

2021年8月上旬にかけて、欧米の長期金利が低下した影響や東京都で4度目の緊急事態宣言が発出されたことから国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額(分配金再投資ベース)は上昇しました。8月中旬から10月下旬にかけては、菅首相の事実上の退陣表明を受けて国内株式が上昇したことにより国債の売りが優勢となる中、岸田新政権の経済対策による国債増発に対する警戒感が高まったことなどにより国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。11月上旬には、欧米の長期金利が低下した影響から国内金利が低下し、基準価額は上昇しました。その後12月中旬にかけては、消費者物価の高騰による米長期金利上昇に影響されて国内金利が一旦上昇したものの、各国で新型コロナウイルス・オミクロン株の感染者が相次ぎ確認されて投資家のリスク回避姿勢が強まったことから低下するなど、国内金利は方向感を欠いた展開となり、基準価額はもみ合い推移となりました。12月下旬以降は、過度な警戒感が和らいだことから国内金利が上昇し、基準価額は下落しました。

## 投資環境



国内金利は、2021年8月上旬にかけて、東京都で緊急事態宣言が発出されたことから、低下しました。8月中旬から10月下旬にかけては、国内株式が上昇したことにより国債の売りが優勢となる中、岸田新政権の国債増発に対する警戒感が高まったことなどにより、上昇しました。11月上旬には、欧米の長期金利低下の影響から低下しましたが、11月下旬にかけては、米長期金利上昇に影響されて上昇しました。12月中旬にかけて、各国で新型コロナウイルス・オミクロン株の感染者が相次ぎ確認されて投資家のリスク回避姿勢が強まったことから低下した後、12月下旬以降は、過度な警戒感が和らいだことから、上昇しました。

## 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、主要投資対象である「国内債券インデックスマザーファンド」への投資を通じて、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。

### 【「国内債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

#### (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。

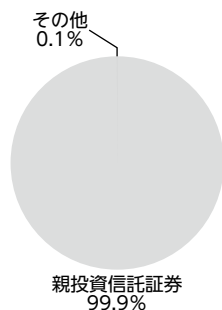
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

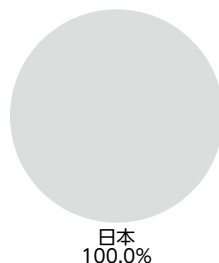
|                    | 当作成期末     |
|--------------------|-----------|
|                    | 2022年1月7日 |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 99.9%     |
| その他                | 0.1%      |
| 組入ファンド数            | 1         |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

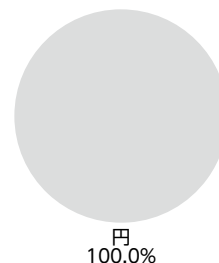
### ○資産別配分



### ○国別配分



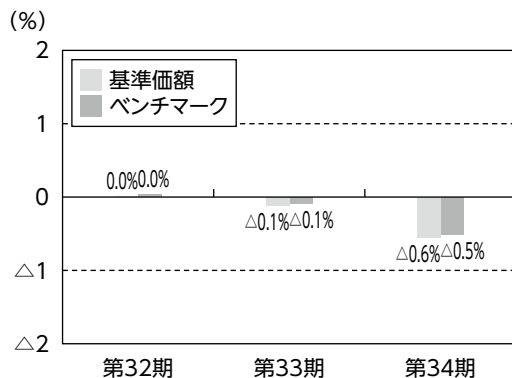
### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額（分配金込み）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の主な要因は、信託報酬によるものです。

## 分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通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32期                    | 第33期                     | 第34期                     |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 2021年7月8日～<br>2021年9月7日 | 2021年9月8日～<br>2021年11月8日 | 2021年11月9日～<br>2022年1月7日 |
| 当期分配金 (円)     | 9                       | 7                        | 7                        |
| (対基準価額比率) (%) | (0.090)                 | (0.070)                  | (0.071)                  |
| 当期の収益 (円)     | 9                       | 7                        | 7                        |
| 当期の収益以外 (円)   | —                       | —                        | —                        |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 593                     | 596                      | 599                      |

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

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

(注3)－印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

国内債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合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               | 当作成期                  |         | 項目の概要                                                                                                                                                                                           |
|------------------|-----------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                  | (2021年7月8日～2022年1月7日) |         |                                                                                                                                                                                                 |
|                  | 金額                    | 比率      |                                                                                                                                                                                                 |
| (a) 信託報酬         | 6円                    | 0.055%  | (a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は9,960円です。<br>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。<br>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<br>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、<br>購入後の情報提供等の対価<br>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)           | (4)                   | (0.039) |                                                                                                                                                                                                 |
| (販売会社)           | (1)                   | (0.006) |                                                                                                                                                                                                 |
| (受託会社)           | (1)                   | (0.011) |                                                                                                                                                                                                 |
| (b) 売買委託手数料      | 0                     | 0.000   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                                                                                |
| (株式)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権証券)        | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (オプション証券等)       | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (投資信託証券)         | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (商品)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (先物・オプション)       | (0)                   | (0.000) |                                                                                                                                                                                                 |
| (c) 有価証券取引税      | －                     | －       | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                                                                                 |
| (株式)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権証券)        | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (オプション証券等)       | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (公社債)            | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (投資信託証券)         | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (d) その他費用        | 0                     | 0.001   | (d) その他費用＝ $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>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<br>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<br>その他は、金銭信託預入に係る手数料等               |
| (保管費用)           | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (監査費用)           | (0)                   | (0.001) |                                                                                                                                                                                                 |
| (その他)            | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| 合計               | 6                     | 0.056   |                                                                                                                                                                                                 |

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

# 売買および取引の状況

## <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

|                       | 当 作 成 期     |             |          |          |
|-----------------------|-------------|-------------|----------|----------|
|                       | 設 定         |             | 解 約      |          |
|                       | 口 数         | 金 額         | 口 数      | 金 額      |
| 国内債券インデックス<br>マザーファンド | 千口          | 千円          | 千口       | 千円       |
|                       | 3, 484, 673 | 4, 918, 956 | 406, 642 | 574, 440 |

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

| 区 分     | 当 作 成 期       |                    |               |               |                    |               |
|---------|---------------|--------------------|---------------|---------------|--------------------|---------------|
|         | 買付額等A         | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C         | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| コール・ローン | 百万円<br>9, 050 | 百万円<br>19          | %<br>0. 2     | 百万円<br>9, 072 | 百万円<br>19          | %<br>0. 2     |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <国内債券インデックス マザーファンド>

| 区 分     | 当 作 成 期         |                    |               |                 |                    |               |
|---------|-----------------|--------------------|---------------|-----------------|--------------------|---------------|
|         | 買付額等A           | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C           | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| コール・ローン | 百万円<br>159, 406 | 百万円<br>152         | %<br>0. 1     | 百万円<br>159, 281 | 百万円<br>152         | %<br>0. 1     |

<平均保有割合 17.2%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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



組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

|                    | 前作成期末            | 当 作 成 期 末        |                   |
|--------------------|------------------|------------------|-------------------|
|                    | 口 数              | 口 数              | 評 価 額             |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 千口<br>77,897,098 | 千口<br>80,975,129 | 千円<br>113,713,374 |

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、462,148,202千口です。

投資信託財産の構成

| 項 目                     | 当 作 成 期 末         |           |
|-------------------------|-------------------|-----------|
|                         | 評 価 額             | 比 率       |
| 国内債券インデックス マザーファンド      | 千円<br>113,713,374 | %<br>99.9 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 158,320           | 0.1       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 113,871,694       | 100.0     |

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                       | 第 32 期 末<br>2021年9月7日現在 | 第 33 期 末<br>2021年11月8日現在 | 第 34 期 末<br>2022年1月7日現在 |
|---------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産                   | 111,122,453,912円        | 112,237,881,350円         | 113,871,694,441円        |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 81,334,601              | 76,694,391               | 116,614,136             |
| 国内債券インデックス マザーファンド(評価額)   | 110,945,685,267         | 112,081,748,317          | 113,713,374,296         |
| 未 収 入 金                   | 95,434,044              | 79,438,642               | 41,706,009              |
| (B) 負 債                   | 121,275,974             | 100,064,264              | 101,382,422             |
| 未 払 収 益 分 配 金             | 100,200,091             | 78,874,397               | 80,521,404              |
| 未 払 信 託 報 酬               | 20,720,013              | 20,833,334               | 20,514,321              |
| 未 払 利 息                   | 65                      | 161                      | 60                      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 355,805                 | 356,372                  | 346,637                 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B)       | 111,001,177,938         | 112,137,817,086          | 113,770,312,019         |
| 元 本                       | 111,333,434,936         | 112,677,711,035          | 115,030,577,949         |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | △332,256,998            | △539,893,949             | △1,260,265,930          |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 111,333,434,936口        | 112,677,711,035口         | 115,030,577,949口        |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 9,970円                  | 9,952円                   | 9,890円                  |

### ■損益の状況

| 項 目                   | 第 32 期<br>自 2021年7月8日<br>至 2021年9月7日 | 第 33 期<br>自 2021年 9月8日<br>至 2021年11月8日 | 第 34 期<br>自 2021年11月9日<br>至 2022年 1月7日 |
|-----------------------|--------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益         | △7,060円                              | △5,667円                                | △5,884円                                |
| 受 取 利 息               | 204                                  | 33                                     | 169                                    |
| 支 払 利 息               | △7,264                               | △5,700                                 | △6,053                                 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | 37,384,746                           | △100,870,498                           | △605,402,820                           |
| 売 買 益                 | 39,409,779                           | 245,681                                | 98,500                                 |
| 売 買 損                 | △2,025,033                           | △101,116,179                           | △605,501,320                           |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △21,075,818                          | △21,189,706                            | △20,860,958                            |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 16,301,868                           | △122,065,871                           | △626,269,662                           |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | △592,499,628                         | △675,881,654                           | △875,390,330                           |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | 344,140,853                          | 336,927,973                            | 321,915,466                            |
| (配 当 等 相 当 額)         | (3,499,849,093)                      | (3,582,429,549)                        | (3,728,300,711)                        |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△3,155,708,240)                     | (△3,245,501,576)                       | (△3,406,385,245)                       |
| (G) 計 (D+E+F)         | △232,056,907                         | △461,019,552                           | △1,179,744,526                         |
| (H) 収 益 分 配 金         | △100,200,091                         | △78,874,397                            | △80,521,404                            |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)   | △332,256,998                         | △539,893,949                           | △1,260,265,930                         |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | 344,140,853                          | 336,927,973                            | 321,915,466                            |
| (配 当 等 相 当 額)         | (3,500,204,636)                      | (3,582,753,876)                        | (3,729,219,053)                        |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△3,156,063,783)                     | (△3,245,825,903)                       | (△3,407,303,587)                       |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 3,112,945,946                        | 3,141,762,794                          | 3,165,331,387                          |
| 繰 越 損 益 金             | △3,789,343,797                       | △4,018,584,716                         | △4,747,512,783                         |

(注1) (B) 有価証券売買損益は各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＞

※当ファンドの第32期首元本額は110,340,555,854円、第32～34期中追加設定元本額は5,277,898,587円、第32～34期中一部解約元本額は587,876,492円です。

※分配金の計算過程

| 項 目                             | 第 32 期           | 第 33 期           | 第 34 期           |
|---------------------------------|------------------|------------------|------------------|
| (A) 配当等収益額(費用控除後)               | 109,708,715円     | 110,066,908円     | 109,219,574円     |
| (B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)  | －円               | －円               | －円               |
| (C) 収益調整金額                      | 3,500,204,636円   | 3,582,753,876円   | 3,729,219,053円   |
| (D) 分配準備積立金額                    | 3,103,437,322円   | 3,110,570,283円   | 3,136,633,217円   |
| (E) 分配対象収益額(A+B+C+D)            | 6,713,350,673円   | 6,803,391,067円   | 6,975,071,844円   |
| (F) 期末残存口数                      | 111,333,434,936口 | 112,677,711,035口 | 115,030,577,949口 |
| (G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) | 602円             | 603円             | 606円             |
| (H) 分配金額(1万口当たり)                | 9円               | 7円               | 7円               |
| (I) 収益分配金金額(F×H/10,000)         | 100,200,091円     | 78,874,397円      | 80,521,404円      |

## 分配金のお知らせ

|           | 第32期 | 第33期 | 第34期 |
|-----------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金 | 9円   | 7円   | 7円   |

(注) 分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

## 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<br>組 入 比 率 | 債 券 先 物 率<br>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<br>組 入 比 率 | 債 券 先 物 率<br>組 入 比 率 |
|------------------------|---------|------|---------|------|----------------------|----------------------|
|                        | 騰 落 率   | 中 率  | 騰 落 率   | 中 率  |                      |                      |
| (当 期 首)<br>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)<br>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。

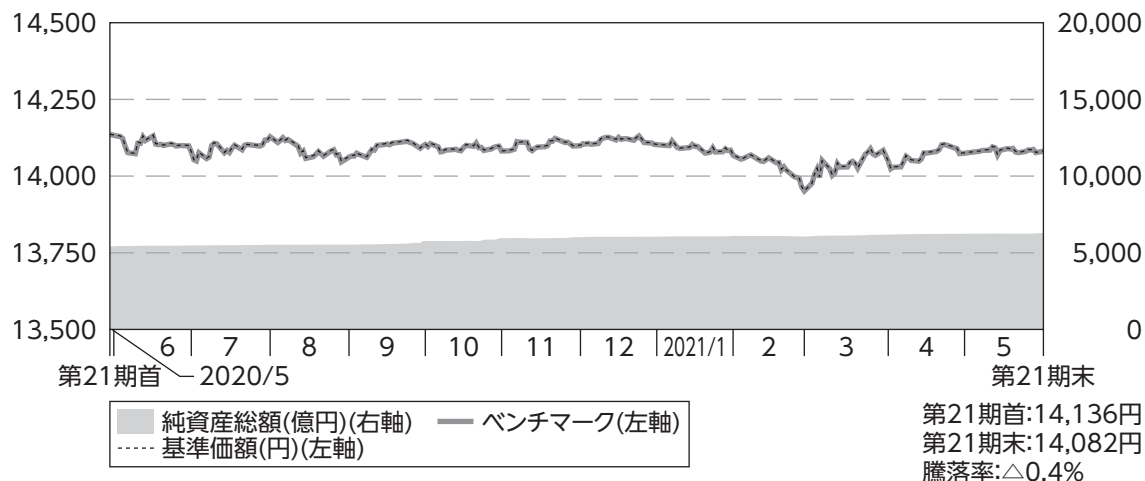
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

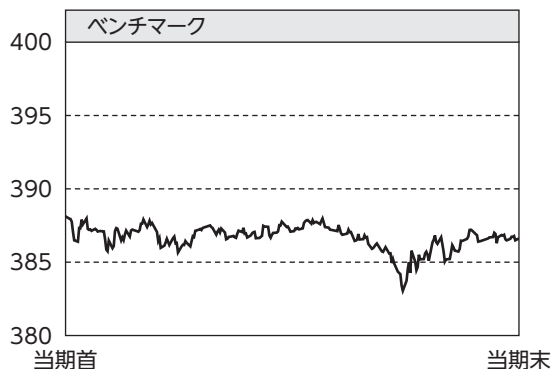


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 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

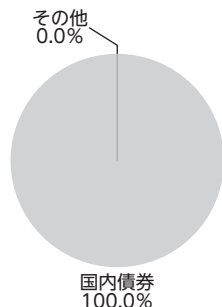
## ○上位10銘柄

| 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% |

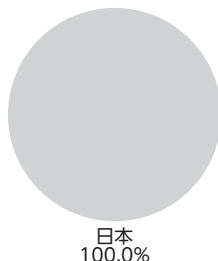
| 順位    | 銘柄名            | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|----------------|------|------|
| 7     | 第144回利付国債(5年)  | 日本   | 1.0% |
| 8     | 第340回利付国債(10年) | 日本   | 1.0% |
| 9     | 第346回利付国債(10年) | 日本   | 1.0% |
| 10    | 第140回利付国債(5年)  | 日本   | 1.0% |
| 組入銘柄数 |                | 982  |      |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

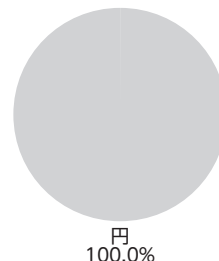
## ○資産別配分



## ○国別配分



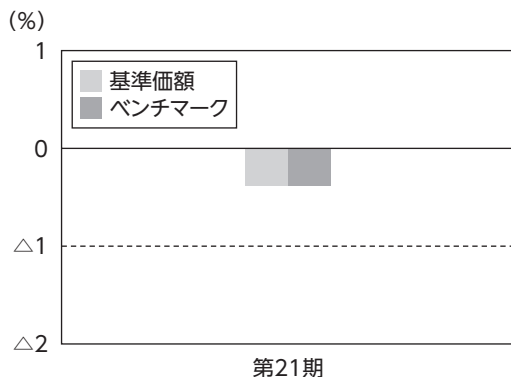
## ○通貨別配分



(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<br>(2020年5月30日~2021年5月31日)                |                                                      | 項目の概要                                                                                                                                                                              |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                      | 金額                                           | 比率                                                   |                                                                                                                                                                                    |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(投資信託証券)<br>(商品)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0) | 0.000%<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>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<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(公社債)<br>(投資信託証券)              | -<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)         | -<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)                 | (b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>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<br><br>(保管費用)<br><br>(監査費用)<br>(その他)                                                       | 0<br>(-)<br>(-)<br>(0)                       | 0.000<br>(-)<br>(-)<br>(0.000)                       | (c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>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<br>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<br>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<br><br><br>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<br>(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<br>内 | 債 券 先 物 取 引 | 百万円<br>28, 690 | 百万円<br>28, 688 | 百万円<br>－  | 百万円<br>－ |

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人<sup>※</sup>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<br>との取引状況B | B<br>A     | 売付額等C      | うち利害関係人<br>との取引状況D | D<br>C     |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>1 | 百万円<br>1           | %<br>100.0 | 百万円<br>510 | 百万円<br>510         | %<br>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

## &lt; 国内(邦貨建)公社債 &gt;

## (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<br>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<br>(4,080,000)   | 525,432,430<br>(4,097,299)   | 83.6<br>(0.7)  | —<br>(—)             | 55.7<br>(—)       | 20.4<br>(—)   | 7.4<br>(0.7) |
| 地 方 債 証 券                          | 32,321,430<br>(32,321,430)   | 34,036,521<br>(34,036,521)   | 5.4<br>(5.4)   | —<br>(—)             | 3.5<br>(3.5)      | 1.3<br>(1.3)  | 0.6<br>(0.6) |
| 特 殊 債 証 券<br>(除 く 金 融 債)           | 35,448,599<br>(35,448,599)   | 36,934,695<br>(36,934,695)   | 5.9<br>(5.9)   | —<br>(—)             | 3.4<br>(3.4)      | 1.3<br>(1.3)  | 1.2<br>(1.2) |
| 金 融 債 証 券                          | 2,400,000<br>(2,400,000)     | 2,403,743<br>(2,403,743)     | 0.4<br>(0.4)   | —<br>(—)             | —<br>(—)          | 0.3<br>(0.3)  | 0.1<br>(0.1) |
| 普 通 社 債 証 券<br>(含 む 投 資 法 人 債 証 券) | 27,826,000<br>(27,826,000)   | 28,160,874<br>(28,160,874)   | 4.5<br>(4.5)   | —<br>(—)             | 2.3<br>(2.3)      | 1.9<br>(1.9)  | 0.3<br>(0.3) |
| 合 計                                | 589,566,029<br>(102,076,029) | 626,968,264<br>(105,633,133) | 99.8<br>(16.8) | —<br>(—)             | 65.0<br>(9.2)     | 25.1<br>(4.7) | 9.7<br>(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<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(千円) | 償還年月日      |
| <b>国債証券</b>   |           |              |               |            |
| 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<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名     | 期         |              | 末             |            |
|----------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名    | 期         |              | 末             |            |
|---------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|               | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名    | 期         |              | 末             |            |
|---------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|               | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名     | 期         |              | 末             |            |
|----------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名     | 期         |              | 末             |            |
|----------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名         | 期         |              | 末             |            |
|--------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                    | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(千円) | 償還年月日      |
| <b>地方債証券</b>       |           |              |               |            |
| 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<br>銘 柄 名            | 期         |              | 末             |            |
|-----------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                       | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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410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1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<br>銘 柄 名            | 期         |              | 末             |            |
|-----------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                       | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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       | 2025/11/25 |
| 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<br>銘 柄 名          | 期         |              | 末             |            |
|---------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                     | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名            | 期         |              | 末             |            |
|-----------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                       | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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回横浜市の公債(20年)        | 2.17      | 100,000      | 108,755       | 2025/6/20  |
| 第20回横浜市の公債(20年)       | 2.1       | 300,000      | 349,608       | 2029/10/19 |
| 平成28年度第4回横浜市の公債       | 0.175     | 100,000      | 100,675       | 2027/1/22  |
| 平成29年度第2回横浜市の公債       | 0.24      | 100,000      | 101,076       | 2027/7/16  |
| 平成30年度第1回横浜市の公債       | 0.195     | 100,000      | 100,855       | 2028/4/17  |
| 平成30年度第4回横浜市の公債       | 0.289     | 200,000      | 202,988       | 2028/10/17 |
| 第30回横浜市の公債(20年)       | 1.376     | 200,000      | 228,428       | 2034/10/20 |
| 令和2年度第1回横浜市の公債        | 0.15      | 300,000      | 300,399       | 2030/6/12  |
| 令和3年度第2回横浜市の公債        | 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回札幌市の公債(10年) | 0.8       | 100,000      | 101,229       | 2022/12/20 |
| 平成26年度第9回札幌市の公債(10年)  | 0.43      | 100,000      | 101,491       | 2024/12/20 |
| 第11回川崎市の公債(20年)       | 1.84      | 100,000      | 115,688       | 2030/10/18 |
| 第89回川崎市の公債            | 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回福岡市の公債(20年)  | 2.14      | 100,000      | 116,747       | 2029/9/18  |
| 平成35年度第6回福岡市の公債(20年)  | 1.511     | 100,000      | 115,548       | 2034/2/17  |
| 平成26年度第5回福岡市の公債       | 0.539     | 200,000      | 203,606       | 2024/10/28 |
| 平成30年度第5回福岡市の公債(5年)   | 0.03      | 200,000      | 200,088       | 2023/8/17  |
| 平成30年度第9回福岡市の公債(10年)  | 0.289     | 100,000      | 101,500       | 2028/10/30 |
| 平成25年度第3回広島市の公債       | 0.67      | 150,000      | 152,706       | 2024/2/23  |
| 平成26年度第2回広島市の公債       | 0.456     | 100,000      | 101,589       | 2024/12/25 |
| 平成28年度第4回広島市の公債       | 0.165     | 105,000      | 105,640       | 2026/12/25 |
| 平成29年度第6回広島市の公債       | 0.23      | 170,000      | 171,881       | 2028/2/25  |
| 令和元年度第6回広島市の公債        | 0.115     | 550,000      | 549,285       | 2030/2/25  |
| 令和2年度第3回広島市の公債(5年)    | 0.02      | 200,000      | 200,086       | 2025/10/24 |
| 令和元年度第5回千葉市の公債        | 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回岡山市の公債(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<br>銘 柄 名                 | 期         |              | 末             |            |
|----------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                            | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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    |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         |           |              |               |            |
| 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<br>銘 柄 名                 | 期         |              | 末             |            |
|----------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                            | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名                | 期         |              | 末             |            |
|---------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                           | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名                 | 期         |              | 末             |            |
|----------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                            | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名             | 期         |              | 末             |            |
|------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                        | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名            | 期         |              | 末             |            |
|-----------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                       | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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      | 122,828       | 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<br>銘 柄 名             | 期         |              | 末             |            |
|------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                        | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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回東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    |            |
| <b>金融債券</b>            |           |              |               |            |
| 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<br>銘 柄 名             | 期         |              | 末             |            |
|------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                        | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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     |            |
| <b>普通社債券（含む投資法人債券）</b> |           |              |               |            |
| 第503回中部電力株式会社社債        | 0.584     | 100,000      | 101,878       | 2025/3/25  |
| 第507回中部電力株式会社社債        | 0.605     | 100,000      | 102,251       | 2026/1/23  |
| 第511回中部電力株式会社社債        | 0.21      | 100,000      | 100,306       | 2026/7/24  |
| 第519回中部電力株式会社社債        | 0.84      | 100,000      | 104,330       | 2037/1/23  |
| 第540回中部電力株式会社社債        | 0.53      | 100,000      | 98,234        | 2040/2/24  |
| 第508回関西電力株式会社社債        | 0.455     | 100,000      | 101,397       | 2027/4/23  |
| 第510回関西電力株式会社社債        | 0.49      | 200,000      | 203,172       | 2027/7/23  |
| 第511回関西電力株式会社社債        | 0.41      | 100,000      | 101,085       | 2027/9/17  |
| 第524回関西電力株式会社社債        | 0.514     | 100,000      | 101,657       | 2028/10/25 |
| 第536回関西電力株式会社社債        | 0.44      | 100,000      | 100,832       | 2030/12/20 |
| 第538回関西電力株式会社社債        | 0.39      | 100,000      | 100,327       | 2031/1/24  |
| 第385回中国電力株式会社社債        | 0.728     | 100,000      | 102,553       | 2025/7/25  |
| 第398回中国電力株式会社社債        | 0.425     | 100,000      | 101,376       | 2027/7/23  |
| 第400回中国電力株式会社社債        | 0.34      | 100,000      | 100,842       | 2027/9/24  |
| 第402回中国電力株式会社社債        | 0.25      | 100,000      | 100,576       | 2024/10/25 |
| 第416回中国電力株式会社社債        | 0.355     | 200,000      | 201,316       | 2029/5/25  |
| 第425回中国電力株式会社社債        | 0.37      | 100,000      | 100,664       | 2030/6/25  |
| 第307回北陸電力株式会社社債        | 1.055     | 100,000      | 104,578       | 2026/6/25  |
| 第322回北陸電力株式会社社債        | 0.38      | 100,000      | 101,171       | 2027/6/25  |
| 第330回北陸電力株式会社社債        | 0.34      | 200,000      | 201,160       | 2029/5/25  |
| 第471回東北電力株式会社社債        | 1.168     | 126,000      | 129,548       | 2023/12/25 |
| 第481回東北電力株式会社社債        | 0.803     | 100,000      | 102,863       | 2025/7/25  |
| 第496回東北電力株式会社社債        | 0.355     | 100,000      | 100,967       | 2027/9/24  |
| 第508回東北電力株式会社社債        | 0.465     | 100,000      | 101,544       | 2029/4/25  |
| 第521回東北電力株式会社社債        | 0.45      | 200,000      | 202,446       | 2030/5/24  |
| 第527回東北電力株式会社社債        | 0.32      | 100,000      | 100,000       | 2031/2/25  |
| 第253回四国電力株式会社社債        | 1.0       | 100,000      | 101,968       | 2023/6/23  |
| 第309回四国電力株式会社社債        | 0.4       | 100,000      | 100,918       | 2030/5/24  |
| 第314回四国電力株式会社社債        | 0.29      | 100,000      | 99,952        | 2031/5/23  |
| 第449回九州電力株式会社社債        | 0.43      | 200,000      | 202,856       | 2027/4/23  |
| 第465回九州電力株式会社社債        | 0.38      | 100,000      | 100,970       | 2028/7/25  |
| 第468回九州電力株式会社社債        | 0.435     | 100,000      | 101,324       | 2028/8/25  |
| 第484回九州電力株式会社社債        | 0.375     | 200,000      | 201,240       | 2029/11/22 |
| 第489回九州電力株式会社社債        | 0.44      | 100,000      | 101,047       | 2030/5/24  |
| 第326回北海道電力株式会社社債       | 0.789     | 100,000      | 102,948       | 2025/12/25 |
| 第340回北海道電力株式会社社債       | 0.48      | 100,000      | 101,542       | 2027/4/23  |
| 第350回北海道電力株式会社社債       | 0.754     | 100,000      | 102,028       | 2038/3/25  |
| 第39回大成建設株式会社無担保社債      | 0.37      | 100,000      | 99,923        | 2030/6/14  |
| 第24回清水建設株式会社無担保社債      | 0.365     | 100,000      | 100,134       | 2027/11/30 |



| 当<br>銘 柄 名                   | 期         |              | 末             |            |
|------------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                              | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>銘 柄 名                       | 期         |              | 末             |            |
|----------------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                                  | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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 (劣後特交付)   | 2.91      | 100,000      | 117,956       | 2029/10/16 |

| 銘柄名                            | 当 期       |              | 期 末           |            |
|--------------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                                | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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ズ株式会社無担保社債     | 0.19      | 200,000      | 199,832       | 2023/3/20  |
| 第30回株式会社ジャックス無担保社債             | 0.28      | 100,000      | 100,258       | 2026/1/27  |
| 第55回日立キャピタル株式会社無担保社債           | 0.963     | 100,000      | 104,117       | 2026/9/18  |
| 第77回日立キャピタル株式会社無担保社債           | 0.21      | 100,000      | 100,337       | 2023/12/20 |
| 第87回日立キャピタル株式会社無担保社債           | 0.06      | 200,000      | 199,906       | 2024/1/19  |
| 第21回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債    | 0.18      | 200,000      | 200,534       | 2023/11/27 |
| 第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債          | 0.15      | 100,000      | 100,186       | 2023/10/25 |
| 第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債          | 0.375     | 200,000      | 201,946       | 2027/7/13  |
| 第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債          | 0.455     | 100,000      | 101,478       | 2028/1/18  |
| 第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債          | 0.474     | 100,000      | 101,412       | 2028/10/18 |
| 第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債        | 0.41      | 100,000      | 100,190       | 2027/8/27  |
| 第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債         | 0.3       | 200,000      | 200,304       | 2023/9/4   |
| 第66回三井不動産株式会社無担保社債             | 0.28      | 200,000      | 201,292       | 2026/3/13  |
| 第120回三菱地所株式会社無担保社債             | 0.24      | 200,000      | 200,610       | 2027/6/18  |
| 第131回三菱地所株式会社無担保社債             | 0.59      | 100,000      | 97,476        | 2039/8/5   |
| 第97回住友不動産株式会社無担保社債             | 0.904     | 100,000      | 102,275       | 2024/4/26  |
| 第100回住友不動産株式会社無担保社債            | 0.809     | 100,000      | 102,238       | 2024/9/9   |
| 第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債       | 1.168     | 100,000      | 101,897       | 2023/6/26  |
| 第105回東武鉄道株式会社無担保社債             | 1.081     | 100,000      | 104,199       | 2026/6/17  |

| 銘柄名                       | 当 期       |              | 期 末           |            |
|---------------------------|-----------|--------------|---------------|------------|
|                           | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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74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<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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回株式会社エス・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<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評 価 額<br>(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<br>626,968,264 |   | %<br>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<br>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<br>自 2020年5月30日<br>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3              | 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。

## 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）

第32期～第34期(2021年7月8日～2022年1月7日)

## ○当ファンドの仕組み

| 商品分類   | －                                                                                                                                                       |                                              |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------|
| 信託期間   | 2016年2月17日以降、無期限とします。                                                                                                                                   |                                              |
| 運用方針   | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。 |                                              |
| 主な投資対象 | 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド                                                                                                                      | マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。 |
|        | マザーファンド                                                                                                                                                 | 外国の株式を主要投資対象とします。                            |
| 主な投資制限 | 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド                                                                                                                      | 株式への実質投資割合には制限を設けません。                        |
|        | 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。                          |
| 分配方針   | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。                                     |                                              |

## ○最近15期の運用実績

| 決算期             | 基準価額<br>(円) | 標準価額 |       | ベンチマーク |       | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 | 純資産額       |
|-----------------|-------------|------|-------|--------|-------|--------|--------|------------|------------|
|                 |             | 税込み  | 騰落率   | 騰落率    | 騰落率   |        |        |            |            |
| 20期(2019年9月9日)  | 13,654      | 円 40 | △ 2.4 | 148.99 | △ 2.3 | 96.0   | 1.1    | 2.8        | 百万円 47,978 |
| 21期(2019年11月7日) | 14,385      | 35   | 5.6   | 157.38 | 5.6   | 96.3   | 1.0    | 2.7        | 47,357     |
| 22期(2020年1月7日)  | 15,043      | 30   | 4.8   | 164.96 | 4.8   | 95.9   | 1.3    | 2.7        | 44,771     |
| 23期(2020年3月9日)  | 12,858      | 60   | △14.1 | 141.65 | △14.1 | 95.3   | 1.8    | 2.9        | 37,378     |
| 24期(2020年5月7日)  | 12,496      | 25   | △ 2.6 | 138.13 | △ 2.5 | 96.0   | 0.9    | 2.5        | 41,386     |
| 25期(2020年7月7日)  | 14,264      | 65   | 14.7  | 158.43 | 14.7  | 96.0   | 1.5    | 2.5        | 46,430     |
| 26期(2020年9月7日)  | 15,021      | 40   | 5.6   | 167.29 | 5.6   | 96.3   | 1.2    | 2.4        | 46,454     |
| 27期(2020年11月9日) | 14,979      | 30   | △ 0.1 | 167.40 | 0.1   | 96.2   | 1.4    | 2.3        | 46,493     |
| 28期(2021年1月7日)  | 16,325      | 40   | 9.3   | 182.84 | 9.2   | 96.4   | 1.4    | 2.1        | 48,397     |
| 29期(2021年3月8日)  | 17,361      | 40   | 6.6   | 195.08 | 6.7   | 96.5   | 1.4    | 2.1        | 48,692     |
| 30期(2021年5月7日)  | 19,036      | 35   | 9.8   | 214.58 | 10.0  | 95.8   | 1.9    | 2.2        | 50,029     |
| 31期(2021年7月7日)  | 19,854      | 90   | 4.8   | 225.08 | 4.9   | 96.5   | 1.2    | 2.3        | 50,171     |
| 32期(2021年9月7日)  | 20,561      | 45   | 3.8   | 233.57 | 3.8   | 95.9   | 1.7    | 2.3        | 51,083     |
| 33期(2021年11月8日) | 21,757      | 45   | 6.0   | 247.94 | 6.2   | 96.8   | 0.9    | 2.2        | 53,461     |
| 34期(2022年1月7日)  | 21,909      | 50   | 0.9   | 250.34 | 1.0   | 95.9   | 1.7    | 2.3        | 53,024     |

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* ベンチマーク（＝MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし））は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲付）で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。

\* MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関しはいかなる保証も行なわず、いかなる責任も負いません。

請求目録見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

（出所）MSCI

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決 算 期 | 年 月 日      | 基 準 価 額 |       | ベンチマーク |       | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|-------|------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-----------|---------------------|
|       |            |         | 騰 落 率 |        | 騰 落 率 |             |           |                     |
| 第32期  | (期 首)      | 円       | %     |        | %     | %           | %         | %                   |
|       | 2021年7月7日  | 19,854  | —     | 225.08 | —     | 96.5        | 1.2       | 2.3                 |
|       | 7月末        | 20,029  | 0.9   | 227.08 | 0.9   | 96.3        | 1.4       | 2.3                 |
|       | 8月末        | 20,520  | 3.4   | 232.70 | 3.4   | 96.0        | 1.7       | 2.3                 |
|       | (期 末)      |         |       |        |       |             |           |                     |
| 第33期  | 2021年9月7日  | 20,606  | 3.8   | 233.57 | 3.8   | 95.9        | 1.7       | 2.3                 |
|       | (期 首)      |         |       |        |       |             |           |                     |
|       | 2021年9月7日  | 20,561  | —     | 233.57 | —     | 95.9        | 1.7       | 2.3                 |
|       | 9月末        | 19,998  | △2.7  | 227.33 | △2.7  | 95.8        | 1.9       | 2.2                 |
|       | 10月末       | 21,458  | 4.4   | 243.99 | 4.5   | 96.0        | 1.4       | 2.3                 |
| 第34期  | (期 末)      |         |       |        |       |             |           |                     |
|       | 2021年11月8日 | 21,802  | 6.0   | 247.94 | 6.2   | 96.8        | 0.9       | 2.2                 |
|       | (期 首)      |         |       |        |       |             |           |                     |
|       | 2021年11月8日 | 21,757  | —     | 247.94 | —     | 96.8        | 0.9       | 2.2                 |
|       | 11月末       | 21,328  | △2.0  | 242.95 | △2.0  | 95.6        | 2.0       | 2.3                 |
| 第34期  | 12月末       | 22,195  | 2.0   | 253.00 | 2.0   | 95.7        | 1.9       | 2.3                 |
|       | (期 末)      |         |       |        |       |             |           |                     |
|       | 2022年1月7日  | 21,959  | 0.9   | 250.34 | 1.0   | 95.9        | 1.7       | 2.3                 |

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

\* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

\* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ○当作成期中の運用経過と今後の運用方針

## 【基準価額の推移】

当作成期の基準価額の騰落率は+11.1%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの+11.2%を0.1ポイント下回りました。新型コロナウイルスの経口治療薬の早期実用化への期待が台頭したことや堅調な欧米企業の決算発表が続いたこと、主要通貨である米ドルが上昇（円安）したことを受けて、基準価額は上昇しました。

## 【運用経過】

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】受益証券を主要な投資対象とし、当作成期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】の運用につきましては、株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、当作成期を通じて高位に維持しました。MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行ない、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## 【分配金】

収益分配金は、経費控除後の配当等収益の水準等を勘案して決定させていただきました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

## 【今後の運用方針】

主要投資対象である【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】受益証券を高位に組み入れ、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）\*の中長期的な動きを捉える投資成果を目指します。

【外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド】の運用につきましては、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）\*の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

※野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）のベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）」は、主要投資対象である外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドのベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」と同一の指数です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年7月8日～2022年1月7日)

| 項 目                     | 第32期～第34期 |            | 項 目 の 概 要                                                                  |
|-------------------------|-----------|------------|----------------------------------------------------------------------------|
|                         | 金 額       | 比 率        |                                                                            |
| (a) 信 託 報 酬             | 円<br>19   | %<br>0.089 | (a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率                                                 |
| ( 投 信 会 社 )             | (15)      | (0.072)    | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等                                 |
| ( 販 売 会 社 )             | ( 1 )     | (0.006)    | 口座内でのファンドの管理および事務手続き等                                                      |
| ( 受 託 会 社 )             | ( 2 )     | (0.011)    | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等                                                |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料       | 0         | 0.001      | (b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数<br>※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 )     | (0.000)    |                                                                            |
| ( 投 資 信 託 証 券 )         | ( 0 )     | (0.000)    |                                                                            |
| ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )     | ( 0 )     | (0.000)    |                                                                            |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税       | 0         | 0.002      | (c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| ( 株 式 )                 | ( 0 )     | (0.002)    |                                                                            |
| ( 投 資 信 託 証 券 )         | ( 0 )     | (0.000)    |                                                                            |
| (d) そ の 他 費 用           | 3         | 0.015      | (d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数                                          |
| ( 保 管 費 用 )             | ( 0 )     | (0.002)    | 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 )             | ( 0 )     | (0.002)    | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用                                                |
| ( そ の 他 )               | ( 2 )     | (0.010)    | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                                         |
| 合 計                     | 22        | 0.107      |                                                                            |
| 作成期間の平均基準価額は、20,921円です。 |           |            |                                                                            |

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

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、この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。

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

## ○売買及び取引の状況

(2021年7月8日～2022年1月7日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘<br>柄                  | 第32期～第34期      |                   |                   |                   |
|-------------------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|                         | 設 定            |                   | 解 約               |                   |
|                         | 口 数            | 金 額               | 口 数               | 金 額               |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 千口<br>402, 375 | 千円<br>1, 703, 618 | 千口<br>1, 000, 940 | 千円<br>4, 413, 624 |

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2021年7月8日～2022年1月7日)

## 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                  | 第32期～第34期               |
|----------------------|-------------------------|
|                      | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド |
| (a) 当作成期中の株式売買金額     | 76, 680, 562千円          |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 1, 094, 441, 053千円      |
| (c) 売買高比率 (a) / (b)  | 0. 07                   |

\*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年7月8日～2022年1月7日)

該当事項はございません。

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

## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2021年7月8日～2022年1月7日)

| 第32期首残高<br>(元本) | 設定元本     | 解約元本     | 第34期末残高<br>(元本) | 取 引 の 理 由   |
|-----------------|----------|----------|-----------------|-------------|
| 百万円<br>1        | 百万円<br>— | 百万円<br>— | 百万円<br>1        | 当初設定時における取得 |

## ○組入資産の明細

(2022年1月7日現在)

## 親投資信託残高

| 銘<br>柄                  | 第31期末              | 第34期末              |                    |
|-------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|
|                         | 口 数                | 口 数                | 評 価 額              |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 千口<br>12, 126, 506 | 千口<br>11, 527, 942 | 千円<br>53, 019, 313 |

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年 1 月 7 日現在)

| 項 目                     | 第34期末            |           |
|-------------------------|------------------|-----------|
|                         | 評 価 額            | 比 率       |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 千円<br>53,019,313 | %<br>99.4 |
| コール・ローン等、その他            | 310,999          | 0.6       |
| 投資信託財産総額                | 53,330,312       | 100.0     |

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第34期末における外貨建純資産（1,224,983,029千円）の投資信託財産総額（1,226,199,855千円）に対する比率は99.9%です。

\*外貨建資産は、第34期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝115.98円、1カナダドル＝91.17円、1英ポンド＝156.91円、1スイスフラン＝125.81円、1スウェーデンクローナ＝12.68円、1ノルウェークローネ＝13.03円、1デンマーククローネ＝17.60円、1ユーロ＝130.93円、1香港ドル＝14.87円、1シンガポールドル＝85.18円、1豪ドル＝83.08円、1ニュージーランドドル＝78.17円、1新シェケル＝37.2735円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項 目                          | 第32期末           | 第33期末           | 第34期末           |
|------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
|                              | 2021年 9 月 7 日現在 | 2021年11月 8 日現在  | 2022年 1 月 7 日現在 |
|                              | 円               | 円               | 円               |
| (A) 資産                       | 51,276,805,920  | 53,782,435,601  | 53,330,312,381  |
| コール・ローン等                     | 37,413,880      | 19,878,291      | 20,398,889      |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 51,078,580,943  | 53,456,300,085  | 53,019,313,605  |
| 未収入金                         | 160,811,097     | 306,257,225     | 290,599,887     |
| (B) 負債                       | 193,117,092     | 320,800,488     | 305,665,536     |
| 未払収益分配金                      | 111,801,742     | 110,575,495     | 121,009,606     |
| 未払解約金                        | 65,999,996      | 194,610,997     | 169,129,997     |
| 未払信託報酬                       | 15,033,470      | 15,326,627      | 15,240,198      |
| 未払利息                         | 25              | 17              | 2               |
| その他未払費用                      | 281,859         | 287,352         | 285,733         |
| (C) 純資産総額(A－B)               | 51,083,688,828  | 53,461,635,113  | 53,024,646,845  |
| 元本                           | 24,844,831,578  | 24,572,332,305  | 24,201,921,272  |
| 次期繰越損益金                      | 26,238,857,250  | 28,889,302,808  | 28,822,725,573  |
| (D) 受益権総口数                   | 24,844,831,578口 | 24,572,332,305口 | 24,201,921,272口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)              | 20,561円         | 21,757円         | 21,909円         |

(注) 第32期首元本額は25,269,808,699円、第32～34期中追加設定元本額は867,954,331円、第32～34期中一部解約元本額は1,935,841,758円、1口当たり純資産額は、第32期2.0561円、第33期2.1757円、第34期2.1909円です。

## ○損益の状況

| 項 目                   | 第32期                    | 第33期                     | 第34期                     |
|-----------------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
|                       | 2021年7月8日～<br>2021年9月7日 | 2021年9月8日～<br>2021年11月8日 | 2021年11月9日～<br>2022年1月7日 |
|                       | 円                       | 円                        | 円                        |
| (A) 配当等収益             | △ 665                   | △ 596                    | △ 433                    |
| 支払利息                  | △ 665                   | △ 596                    | △ 433                    |
| (B) 有価証券売買損益          | 1,883,694,831           | 3,085,468,174            | 527,640,786              |
| 売買益                   | 1,906,361,102           | 3,130,504,369            | 547,810,890              |
| 売買損                   | △ 22,666,271            | △ 45,036,195             | △ 20,170,104             |
| (C) 信託報酬等             | △ 15,315,329            | △ 15,613,979             | △ 15,525,931             |
| (D) 当期損益金 (A + B + C) | 1,868,378,837           | 3,069,853,599            | 512,114,422              |
| (E) 前期繰越損益金           | 16,905,520,590          | 18,207,076,766           | 20,597,121,151           |
| (F) 追加信託差損益金          | 7,576,759,565           | 7,722,947,938            | 7,834,499,606            |
| (配当等相当額)              | ( 9,290,931,443)        | ( 9,439,785,836)         | ( 9,548,457,926)         |
| (売買損益相当額)             | (△ 1,714,171,878)       | (△ 1,716,837,898)        | (△ 1,713,958,320)        |
| (G) 計 (D + E + F)     | 26,350,658,992          | 28,999,878,303           | 28,943,735,179           |
| (H) 収益分配金             | △ 111,801,742           | △ 110,575,495            | △ 121,009,606            |
| 次期繰越損益金 (G + H)       | 26,238,857,250          | 28,889,302,808           | 28,822,725,573           |
| 追加信託差損益金              | 7,576,759,565           | 7,722,947,938            | 7,834,499,606            |
| (配当等相当額)              | ( 9,291,355,377)        | ( 9,440,615,153)         | ( 9,549,044,257)         |
| (売買損益相当額)             | (△ 1,714,595,812)       | (△ 1,717,667,215)        | (△ 1,714,544,651)        |
| 分配準備積立金               | 18,662,097,685          | 21,166,354,870           | 20,988,225,967           |

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

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

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

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

## 運用報告書

第19期（決算日2021年3月31日）

作成対象期間（2020年4月1日～2021年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |                                                             |
|--------|-------------------------------------------------------------|
| 運用方針   | MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 |
| 主な投資対象 | 外国の株式を主要投資対象とします。                                           |
| 主な投資制限 | 株式への投資割合には制限を設けません。<br>外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。              |

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<http://www.nomura-am.co.jp/>



## ○最近 5 期の運用実績

| 決 算 期           | 基 準 価 額 |         | ベ ン チ マ ー ク                          |         | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|-----------------|---------|---------|--------------------------------------|---------|-------------|-----------|-------------------|---------|
|                 |         | 騰 落 中 率 | MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・<br>為替ヘッジなし) | 騰 落 中 率 |             |           |                   |         |
|                 | 円       | %       |                                      | %       | %           | %         | %                 | 百万円     |
| 15期(2017年3月31日) | 23,082  | 14.6    | 246.86                               | 15.0    | 95.0        | 2.4       | 2.5               | 364,352 |
| 16期(2018年4月2日)  | 24,752  | 7.2     | 265.15                               | 7.4     | 95.6        | 1.9       | 2.3               | 454,743 |
| 17期(2019年4月1日)  | 27,269  | 10.2    | 293.26                               | 10.6    | 95.6        | 1.7       | 2.6               | 566,435 |
| 18期(2020年3月31日) | 24,094  | △11.6   | 260.14                               | △11.3   | 95.8        | 1.5       | 2.7               | 556,023 |
| 19期(2021年3月31日) | 37,781  | 56.8    | 408.16                               | 56.9    | 95.9        | 1.9       | 2.2               | 927,648 |

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数（米ドルベース）をもとに、営業日当日の米ドル為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。（以下同じ）

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。

ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日      | 基 準 価 額 |       | ベ ン チ マ ー ク                          |       | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|--------------------------------------|-------|-------------|-----------|-------------------|
|            |         | 騰 落 率 | MSCI-KOKUSAI指数<br>(円ベース・<br>為替ヘッジなし) | 騰 落 率 |             |           |                   |
| (期 首)      | 円       | %     |                                      | %     | %           | %         | %                 |
| 2020年3月31日 | 24,094  | —     | 260.14                               | —     | 95.8        | 1.5       | 2.7               |
| 4月末        | 26,460  | 9.8   | 285.29                               | 9.7   | 96.0        | 1.3       | 2.6               |
| 5月末        | 27,600  | 14.6  | 297.62                               | 14.4  | 94.9        | 2.5       | 2.5               |
| 6月末        | 28,131  | 16.8  | 303.46                               | 16.7  | 95.9        | 1.6       | 2.5               |
| 7月末        | 29,070  | 20.7  | 313.19                               | 20.4  | 96.3        | 1.2       | 2.5               |
| 8月末        | 31,303  | 29.9  | 337.76                               | 29.8  | 95.8        | 1.0       | 2.3               |
| 9月末        | 30,075  | 24.8  | 324.53                               | 24.8  | 96.3        | 1.3       | 2.3               |
| 10月末       | 29,243  | 21.4  | 315.51                               | 21.3  | 96.3        | 1.3       | 2.3               |
| 11月末       | 32,609  | 35.3  | 352.10                               | 35.4  | 95.6        | 1.5       | 2.2               |
| 12月末       | 33,554  | 39.3  | 362.28                               | 39.3  | 96.3        | 1.5       | 2.2               |
| 2021年1月末   | 34,249  | 42.1  | 370.12                               | 42.3  | 96.3        | 1.5       | 2.2               |
| 2月末        | 35,409  | 47.0  | 383.43                               | 47.4  | 96.2        | 1.1       | 2.2               |
| (期 末)      |         |       |                                      |       |             |           |                   |
| 2021年3月31日 | 37,781  | 56.8  | 408.16                               | 56.9  | 95.9        | 1.9       | 2.2               |

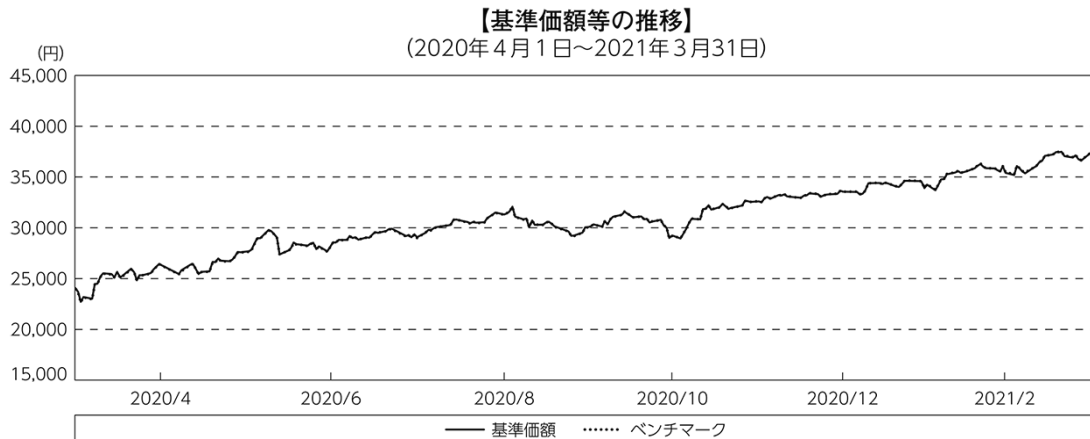
\*騰落率は期首比です。

\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から欧米で新型コロナウイルス感染拡大の勢いが鈍化しつつあるとの見方や、FRB（米連邦準備制度理事会）の緊急資金供給策の発表などを受けて上昇しました。その後も、各国で経済活動の再開が段階的に進んだことや、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などを背景に上昇しました。2020年9月以降は、主要株価指数が史上最高値を更新したことで利益確定の動きが広がったとの見方や、欧米で新型コロナウイルス新規感染者数が急増したことなどから軟調に推移しましたが、11月に入ると、米大手製薬会社が新型コロナウイルスワクチンの臨床試験による高い有効性を発表したことや、米大統領・議会選挙の結果を受けて再び上昇しました。その後も、新型コロナウイルスのワクチン実用化による経済正常化への期待や米国新政権による経済対策への期待が高まったこと、欧米の経済指標が市場予想を上回ったことなどを受けて上昇しました。

為替市場は、期首から新型コロナウイルス感染拡大の責任を巡る米中対立への懸念や、世界的な経済活動再開への期待などから、主要通貨は対円で一進一退となりました。2020年6月中旬以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）でゼロ金利政策の維持が表明され、米国の低金利が長期化するとの観測や、新型コロナウイルスの世界的な感染再拡大などが懸念される中、下落（円高）しました。2021年1月以降は、米長期金利が上昇し日米金利差の拡大が意識されたことや、米国で新型コロナウイルスの新規感染者数の減少傾向が見られたことなどから上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+56.8%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の+56.9%を0.1ポイント下回りました。

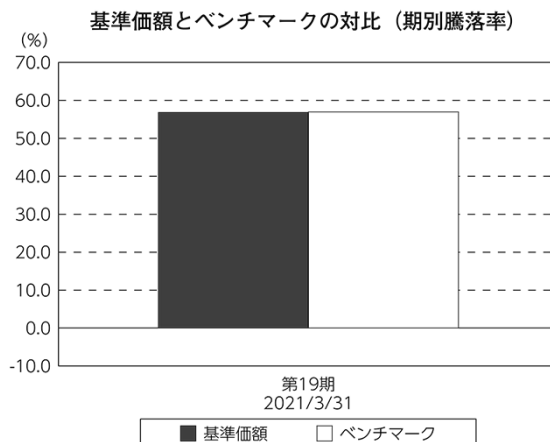
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他、差異を生じた要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



（注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年4月1日～2021年3月31日)

| 項 目                   | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                                              |
|-----------------------|--------|------------|------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額    | 比 率        |                                                                        |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 円<br>1 | %<br>0.002 | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※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)    |                                                                        |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                        |
| (先物・オプション)            | (0)    | (0.001)    |                                                                        |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 2      | 0.006      | (b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>※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)                 | (2)    | (0.005)    |                                                                        |
| (新株予約権証券)             | (0)    | (0.000)    |                                                                        |
| (投資信託証券)              | (0)    | (0.000)    |                                                                        |
| (c) そ の 他 費 用         | 3      | 0.009      | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                                          |
| (保 管 費 用)             | (2)    | (0.008)    |                                                                        |
| (そ の 他)               | (0)    | (0.001)    |                                                                        |
| 合 計                   | 6      | 0.017      |                                                                        |
| 期中の平均基準価額は、30,149円です。 |        |            |                                                                        |

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

## ○売買及び取引の状況

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## 株式

|     |         | 買 付                       |                                  | 売 付                      |                                  |
|-----|---------|---------------------------|----------------------------------|--------------------------|----------------------------------|
|     |         | 株 数                       | 金 額                              | 株 数                      | 金 額                              |
| 外 国 | アメリカ    | 百株<br>79,265<br>( 31,411) | 千米ドル<br>749,342<br>( 18,392)     | 百株<br>53,899<br>( 3,468) | 千米ドル<br>399,285<br>( 28,262)     |
|     | カナダ     | 14,061<br>(△ 950)         | 千カナダドル<br>54,569<br>( ー)         | 9,065<br>( 439)          | 千カナダドル<br>23,633<br>( 978)       |
|     | イギリス    | 58,322<br>( 27,201)       | 千英ポンド<br>32,903<br>( 12,718)     | 47,971<br>(18,850)       | 千英ポンド<br>18,858<br>( 2,488)      |
|     | スイス     | 4,537<br>( 58)            | 千スイスフラン<br>32,105<br>(△ 232)     | 2,921<br>( 116)          | 千スイスフラン<br>16,682<br>( 760)      |
|     | スウェーデン  | 8,077<br>( 390)           | 千スウェーデンクローナ<br>140,085<br>( 273) | 3,784<br>( ー)            | 千スウェーデンクローナ<br>51,047<br>( 273)  |
|     | ノルウェー   | 1,556                     | 千ノルウェークローネ<br>25,531             | 784                      | 千ノルウェークローネ<br>11,654             |
|     | デンマーク   | 1,328<br>( 2,286)         | 千デンマーククローネ<br>62,169<br>( 4,458) | 657<br>( 1,960)          | 千デンマーククローネ<br>30,755<br>( 1,028) |
|     | ユーロ     |                           | 千ユーロ                             |                          | 千ユーロ                             |
|     | ドイツ     | 5,870<br>( 704)           | 32,171<br>(△ 511)                | 3,151<br>( 99)           | 12,699<br>( ー)                   |
|     | イタリア    | 13,005<br>( 1,689)        | 8,944<br>( 1,178)                | 9,367<br>( 910)          | 3,674<br>( ー)                    |
|     | フランス    | 5,163<br>(△ 366)          | 27,505<br>(△ 93)                 | 2,870<br>( 397)          | 14,636<br>( 993)                 |
|     | イギリス    | ー<br>( 2,399)             | ー<br>( 10,629)                   | ー<br>( 2,399)            | ー<br>( 10,629)                   |
|     | オランダ    | 2,542<br>( 230)           | 15,630<br>(△ 9,460)              | 2,283<br>( 1,689)        | 6,383<br>( 1,178)                |
|     | スペイン    | 9,215<br>( 72,268)        | 5,679<br>( 1,555)                | 18,448<br>(69,600)       | 5,130<br>( 1,160)                |
|     | ベルギー    | 400<br>( 53)              | 2,883<br>( 347)                  | 230                      | 1,249                            |
|     | オーストリア  | 222                       | 521                              | 289                      | 815                              |
|     | ルクセンブルグ | 294<br>( 194)             | 382<br>( ー)                      | 410                      | 186                              |
|     | フィンランド  | 2,479                     | 3,627                            | 1,561                    | 2,275                            |
|     | アイルランド  | 388<br>( 87)              | 2,454<br>( 630)                  | 2,738                    | 1,182                            |

|     |          | 買 付                 |                              | 売 付                |                              |
|-----|----------|---------------------|------------------------------|--------------------|------------------------------|
|     |          | 株 数                 | 金 額                          | 株 数                | 金 額                          |
| 外 国 | ユーロ      | 百株                  | 千ユーロ                         | 百株                 | 千ユーロ                         |
|     | ポルトガル    | 825<br>( 4,524)     | 333<br>( 150)                | 290<br>( 4,170)    | 126<br>( 33)                 |
|     | 香港       | 21,168<br>(△ 2,737) | 千香港ドル<br>84,642<br>( ー)      | 16,737<br>( 1,340) | 千香港ドル<br>56,690<br>( 3,681)  |
|     | シンガポール   | 10,124<br>( 4,583)  | 千シンガポールドル<br>3,503<br>( 825) | 19,153<br>( 1,155) | 千シンガポールドル<br>3,773<br>( 132) |
|     | オーストラリア  | 20,689<br>( 2,210)  | 千豪ドル<br>36,530<br>( 469)     | 17,558<br>( 932)   | 千豪ドル<br>16,453<br>( 52)      |
|     | ニュージーランド | 1,020               | 千ニュージーランドドル<br>1,178         | 1,580              | 千ニュージーランドドル<br>813           |
|     | イスラエル    | 33                  | 千新シェケル<br>1,999              | 8                  | 千新シェケル<br>636                |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 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

|     |      | 買 付                  |                      | 売 付          |               |
|-----|------|----------------------|----------------------|--------------|---------------|
|     |      | 証 券 数                | 金 額                  | 証 券 数        | 金 額           |
| 外 国 | アメリカ | 証券<br>ー<br>( 17,750) | 千米ドル<br>ー<br>(82)    | 証券<br>17,750 | 千米ドル<br>77    |
|     | スイス  | ー<br>(170,600)       | 千スイスフラン<br>ー<br>(18) | 170,600      | 千スイスフラン<br>30 |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了などによる増減分です。

## 投資信託証券

| 銘 柄 | 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          | 口 千米ドル  |
|     | AGNC INVESTMENT CORP                 | 13,000                | 184             | —       |
|     | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT         | 4,500                 | 713             | —       |
|     | AMERICAN TOWER CORP                  | 7,300                 | 1,731           | 3,000   |
|     | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT            | 46,000                | 300             | 22,000  |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC            | 3,300                 | 524             | 2,500   |
|     | BOSTON PROPERTIES                    | 2,400                 | 180             | 2,100   |
|     | CAMDEN PROPERTY TRUST                | 1,500                 | 128             | —       |
|     | CROWN CASTLE INTL CORP               | 10,100                | 1,630           | 2,500   |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC             | 7,200                 | 1,050           | 2,700   |
|     | DUKE REALTY CORP                     | 5,600                 | 228             | —       |
|     | EQUINIX INC                          | 2,330                 | 1,781           | 770     |
|     | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES          | 2,900                 | 179             | —       |
|     | EQUITY RESIDENTIAL                   | 5,600                 | 335             | 3,000   |
|     | ESSEX PROPERTY TRUST INC             | 1,430                 | 312             | 800     |
|     | FEDERAL REALTY INVS TRUST            | —                     | —               | 11,100  |
|     | HEALTHPEAK PROPERTIES INC            | 12,300                | 335             | —       |
|     | INVITATION HOMES INC                 | 7,000                 | 203             | —       |
|     | IRON MOUNTAIN INC                    | 5,900                 | 162             | —       |
|     | KIMCO REALTY CORP                    | —                     | —               | 65,000  |
|     | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC         | 16,000                | 352             | —       |
|     | MID-AMERICA APARTMENT COMM           | 1,700                 | 210             | —       |
|     | NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC       | —                     | —               | 27,900  |
|     | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS           | 4,300                 | 138             | —       |
|     | PROLOGIS INC                         | 16,700                | 1,685           | 8,500   |
|     | PUBLIC STORAGE                       | 4,500                 | 1,014           | 2,500   |
|     | REALTY INCOME CORP                   | 5,700                 | 334             | —       |
|     | SBA COMMUNICATIONS CORP              | 2,400                 | 709             | 2,070   |
|     | SL GREEN REALTY CORP                 | —                     | —               | 12,500  |
|     | SIMON PROPERTY GROUP INC             | 6,900                 | 536             | —       |
|     | SUN COMMUNITIES INC                  | 3,500                 | 530             | —       |
|     | UDR INC                              | 4,700                 | 158             | 4,900   |
|     | VENTAS INC                           | 14,900                | 604             | 7,800   |
|     | VEREIT INC                           | 25,000                | 165             | —       |
|     | VEREIT INC                           | (△185,000)            | (△ 962)         | —       |
|     | VEREIT INC                           | ( 37,000)             | ( 962)          | —       |
|     | VICI PROPERTIES INC                  | 19,000                | 406             | —       |
|     | WELLTOWER INC                        | 10,800                | 631             | 5,900   |
|     | WEYERHAEUSER CO                      | 6,000                 | 180             | —       |
|     | 小 計                                  | 280,460<br>(△148,000) | 17,643<br>( — ) | 187,540 |
|     | カナダ                                  | 千カナダドル                | 千カナダドル          | 千カナダドル  |
|     | CAN APARTMENT PROP REAL ESTA         | 3,400                 | 153             | —       |
|     | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT | —                     | —               | 16,000  |
|     | H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS         | —                     | —               | 20,000  |
|     | SMARTCENTRES REAL ESTATE INV         | —                     | —               | 11,000  |
|     | 小 計                                  | 3,400                 | 153             | 47,000  |
|     | イギリス                                 | 千英ポンド                 | 千英ポンド           | 千英ポンド   |
|     | SEGRO PLC                            | 17,000                | 162             | —       |
|     | 小 計                                  | 17,000                | 162             | —       |



| 銘 柄 |                                        | 買 付         |           | 売 付         |             |
|-----|----------------------------------------|-------------|-----------|-------------|-------------|
|     |                                        | 口 数         | 金 額       | 口 数         | 金 額         |
| 外 国 | ユーロ                                    | 口           | 千ユーロ      | 口           | 千ユーロ        |
|     | フランス                                   |             |           |             |             |
|     | ICADE                                  | —           | —         | 5,200       | 322         |
|     | KLEPIERRE                              | —           | —         | —           | —           |
|     |                                        | ( — )       | ( △ 27 )  | —           | —           |
|     | COVIVIO                                | 1,900       | 109       | —           | —           |
|     | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              | 2,800       | 176       | —           | —           |
|     | 小 計                                    | 4,700       | 286       | 5,200       | 322         |
|     |                                        | ( — )       | ( △ 27 )  |             |             |
|     | ユ ー ロ 計                                | 4,700       | 286       | 5,200       | 322         |
|     |                                        | ( — )       | ( △ 27 )  |             |             |
|     | 香港                                     |             | 千香港ドル     |             | 千香港ドル       |
|     | LINK REIT                              | 62,000      | 3,986     | 39,000      | 2,594       |
|     | HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS            | 100,000     | 746       | —           | —           |
|     | 小 計                                    | 162,000     | 4,733     | 39,000      | 2,594       |
|     | シンガポール                                 |             | 千シンガポールドル |             | 千シンガポールドル   |
|     | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | —           | —         | —           | —           |
|     |                                        | ( 316,779 ) | ( 547 )   | —           | —           |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT           | 139,200     | 446       | 60,000      | 196         |
|     |                                        | ( 19,240 )  | ( 44 )    | —           | —           |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE-RTS               | —           | —         | —           | —           |
|     |                                        | ( 19,240 )  | ( 56 )    | ( 19,240 )  | ( 0.58799 ) |
|     | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST            | —           | —         | —           | —           |
|     |                                        | —           | —         | ( 439,972 ) | ( 655 )     |
|     | MAPLETREE LOGISTICS TRUST              | 420,000     | 861       | —           | —           |
|     |                                        | ( 7,980 )   | ( 12 )    | —           | —           |
|     | MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS          | —           | —         | —           | —           |
|     |                                        | ( 7,980 )   | ( 15 )    | ( 7,980 )   | ( 0.04308 ) |
|     | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST             | —           | —         | —           | —           |
|     |                                        | ( — )       | ( △ 2 )   | —           | —           |
|     | 小 計                                    | 559,200     | 1,307     | 60,000      | 196         |
|     |                                        | ( 371,219 ) | ( 674 )   | ( 467,192 ) | ( 656 )     |
|     | オーストラリア                                |             | 千豪ドル      |             | 千豪ドル        |
|     | GPT GROUP                              | 45,000      | 175       | —           | —           |
|     | LENDLEASE GROUP                        | 23,000      | 297       | —           | —           |
|     | STOCKLAND TRUST GROUP                  | 112,000     | 393       | 60,000      | 236         |
|     | GOODMAN GROUP                          | 43,000      | 729       | 14,000      | 180         |
|     | SCENTRE GROUP                          | 220,000     | 566       | 270,000     | 762         |
|     | VICINITY CENTRES                       | 200,000     | 283       | —           | —           |
|     | 小 計                                    | 643,000     | 2,446     | 344,000     | 1,180       |

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 |        | 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<br>128,672 | 百万円<br>124,008 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

\*単位未満は切り捨て。

\*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○株式売買比率

(2020年4月1日～2021年3月31日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目                 | 当 期           |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額       | 169,458,786千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 712,894,879千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.23          |

\*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年4月1日～2021年3月31日)

該当事項はございません。

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

## ○組入資産の明細

(2021年3月31日現在)

## 外国株式

| 銘柄                           | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等                   |
|------------------------------|--------|---------|---------|------------|-------------------------|
|                              |        | 株 数     | 評 価 額   |            |                         |
|                              |        |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                         |
| (アメリカ)                       | 百株     | 百株      | 千米ドル    | 千円         |                         |
| AFLAC INC                    | 1,147  | 1,089   | 5,644   | 624,879    | 保険                      |
| AES CORP                     | 1,010  | 1,100   | 2,956   | 327,347    | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| AT & T INC                   | 11,424 | 11,810  | 36,292  | 4,017,901  | 各種電気通信サービス              |
| ABBOTT LABORATORIES          | 2,768  | 2,937   | 35,170  | 3,893,734  | ヘルスケア機器・用品              |
| ABBVIE INC                   | 2,316  | 2,926   | 31,246  | 3,459,328  | バイオテクノロジー               |
| ABIOMED INC                  | 72     | 72      | 2,231   | 247,009    | ヘルスケア機器・用品              |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      | 1,208  | 1,290   | 11,953  | 1,323,332  | 娯楽                      |
| ACUITY BRANDS INC            | 62     | —       | —       | —          | 電気設備                    |
| ADOBE INC                    | 757    | 794     | 36,999  | 4,096,205  | ソフトウェア                  |
| ADVANCE AUTO PARTS           | 109    | 109     | 2,028   | 224,537    | 専門小売り                   |
| ADVANCED MICRO DEVICES       | 1,663  | 1,993   | 15,146  | 1,676,902  | 半導体・半導体製造装置             |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     | 490    | 519     | 6,479   | 717,311    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AIRBNB INC-CLASS A           | —      | 87      | 1,592   | 176,357    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AIR PRODUCTS                 | 347    | 363     | 10,258  | 1,135,745  | 化学                      |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          | 258    | 274     | 2,772   | 306,924    | 情報技術サービス                |
| ALBEMARLE CORP               | 167    | 197     | 2,864   | 317,093    | 化学                      |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  | 342    | 369     | 5,662   | 626,873    | バイオテクノロジー               |
| ALIGN TECHNOLOGY INC         | 118    | 125     | 6,590   | 729,670    | ヘルスケア機器・用品              |
| ALLEGHANY CORP               | 23     | 23      | 1,478   | 163,693    | 保険                      |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   | 66     | —       | —       | —          | 情報技術サービス                |
| ALLIANT ENERGY CORP          | 376    | 409     | 2,215   | 245,238    | 電力                      |
| ALLSTATE CORP                | 506    | 496     | 5,808   | 643,076    | 保険                      |
| ALLY FINANCIAL INC           | 574    | 630     | 2,898   | 320,837    | 消費者金融                   |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC  | 175    | 187     | 2,526   | 279,756    | バイオテクノロジー               |
| ALPHABET INC-CL C            | 483    | 492     | 101,132 | 11,196,386 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALPHABET INC-CL A            | 468    | 498     | 101,955 | 11,287,453 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| ALTICE USA INC-A             | 200    | 360     | 1,188   | 131,523    | メディア                    |
| ALTRIA GROUP INC             | 2,931  | 3,105   | 15,916  | 1,762,085  | タバコ                     |
| AMAZON.COM INC               | 658    | 706     | 215,917 | 23,904,209 | インターネット販売・通信販売          |
| AMERCO                       | 11     | 17      | 1,052   | 116,537    | 陸運・鉄道                   |
| AMEREN CORPORATION           | 391    | 415     | 3,375   | 373,667    | 総合公益事業                  |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC  | 146    | —       | —       | —          | 旅客航空輸送業                 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      | 777    | 834     | 7,066   | 782,330    | 電力                      |
| AMERICAN EXPRESS CO          | 1,079  | 1,136   | 16,300  | 1,804,624  | 消費者金融                   |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 125    | 125     | 1,454   | 161,069    | 保険                      |
| AMERICAN INTL GROUP          | 1,378  | 1,450   | 6,864   | 759,946    | 保険                      |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC  | 283    | 306     | 4,493   | 497,487    | 水道                      |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       | 239    | 257     | 3,059   | 338,755    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     | 203    | 192     | 4,469   | 494,847    | 資本市場                    |
| AMETEK INC                   | 355    | 373     | 4,753   | 526,261    | 電気設備                    |
| AMGEN INC                    | 930    | 961     | 24,000  | 2,657,147  | バイオテクノロジー               |
| AMPHENOL CORP-CL A           | 464    | 1,004   | 6,585   | 729,051    | 電子装置・機器・部品              |
| ANALOG DEVICES INC           | 581    | 618     | 9,431   | 1,044,139  | 半導体・半導体製造装置             |
| ANSYS INC                    | 134    | 145     | 4,812   | 532,781    | ソフトウェア                  |
| ANTHEM INC                   | 394    | 409     | 14,891  | 1,648,613  | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION           | 541    | —       | —       | —          | 石油・ガス・消耗燃料              |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | —      | 275     | 1,296   | 143,549    | 資本市場                    |
| APPLE INC                    | 6,940  | 28,174  | 337,806 | 37,398,531 | コンピュータ・周辺機器             |

| 銘柄                                 | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|------------------------------------|--------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                                    |        | 株 数     | 評 価 額  | 業 種 等     |                         |
|                                    |        |         | 外貨建金額  |           |                         |
| (アメリカ)                             | 百株     | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |
| APPLIED MATERIALS                  | 1,436  | 1,507   | 19,102 | 2,114,863 | 半導体・半導体製造装置             |
| ARAMARK                            | 410    | 390     | 1,494  | 165,410   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ARCHER DANIELS MIDLAND             | 884    | 938     | 5,431  | 601,268   | 食品                      |
| ARCONIC INC                        | 570    | —       | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| ARISTA NETWORKS INC                | 81     | 96      | 2,869  | 317,633   | 通信機器                    |
| ARROW ELECTRS INC                  | 121    | 121     | 1,324  | 146,604   | 電子装置・機器・部品              |
| ASSURANT INC                       | 90     | 102     | 1,476  | 163,412   | 保険                      |
| ATMOS ENERGY CORP                  | 184    | 202     | 1,997  | 221,151   | ガス                      |
| AUTODESK INC.                      | 342    | 367     | 9,851  | 1,090,646 | ソフトウェア                  |
| AUTOLIV INC                        | 119    | 140     | 1,306  | 144,640   | 自動車部品                   |
| AUTOMATIC DATA PROCESS             | 679    | 706     | 13,265 | 1,468,571 | 情報技術サービス                |
| AUTOZONE                           | 36     | 37      | 5,373  | 594,912   | 専門小売り                   |
| AVALARA INC                        | —      | 131     | 1,640  | 181,592   | ソフトウェア                  |
| AVANTOR INC                        | —      | 840     | 2,389  | 264,574   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AVERY DENNISON CORP                | 134    | 134     | 2,481  | 274,717   | 容器・包装                   |
| BAKER HUGHES CO                    | 1,010  | 1,110   | 2,412  | 267,035   | エネルギー設備・サービス            |
| BALL CORP                          | 475    | 551     | 4,657  | 515,643   | 容器・包装                   |
| BANK OF AMERICA CORP               | 13,370 | 12,900  | 50,297 | 5,568,391 | 銀行                      |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP        | 1,279  | 1,343   | 6,427  | 711,599   | 資本市場                    |
| BAXTER INTERNATIONAL INC.          | 755    | 855     | 7,317  | 810,075   | ヘルスケア機器・用品              |
| BECTON, DICKINSON                  | 420    | 484     | 11,867 | 1,313,817 | ヘルスケア機器・用品              |
| BEIGENE, LTD ADR                   | 63     | —       | —      | —         | バイオテクノロジー               |
| WR BERKLEY CORP                    | 217    | 239     | 1,824  | 201,940   | 保険                      |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B        | 2,055  | 2,272   | 58,660 | 6,494,333 | 各種金融サービス                |
| BEST BUY COMPANY INC               | 363    | 393     | 4,547  | 503,486   | 専門小売り                   |
| BIO-RAD LABORATORIES-A             | 36     | 36      | 2,053  | 227,343   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC        | 280    | 306     | 2,293  | 253,943   | バイオテクノロジー               |
| BIOGEN INC                         | 283    | 252     | 6,955  | 770,038   | バイオテクノロジー               |
| BLACK KNIGHT INC                   | 242    | 270     | 1,966  | 217,731   | 情報技術サービス                |
| BLACKROCK INC                      | 181    | 254     | 19,053 | 2,109,433 | 資本市場                    |
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A         | 1,040  | 1,126   | 8,360  | 925,596   | 資本市場                    |
| BOEING CO                          | 838    | 885     | 22,302 | 2,469,152 | 航空宇宙・防衛                 |
| BOOKING HOLDINGS INC               | 65     | 67      | 15,760 | 1,744,845 | インターネット販売・通信販売          |
| BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS       | 226    | 226     | 1,825  | 202,090   | 情報技術サービス                |
| BORGWARNER INC                     | 296    | 404     | 1,879  | 208,113   | 自動車部品                   |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP             | 2,193  | 2,350   | 9,155  | 1,013,616 | ヘルスケア機器・用品              |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO            | 3,670  | 3,742   | 23,690 | 2,622,786 | 医薬品                     |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | 179    | 194     | 2,967  | 328,566   | 情報技術サービス                |
| BROADCOM INC                       | 622    | 668     | 30,498 | 3,376,528 | 半導体・半導体製造装置             |
| BROWN & BROWN INC                  | 388    | 388     | 1,785  | 197,638   | 保険                      |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B             | 478    | 527     | 3,689  | 408,409   | 飲料                      |
| BURLINGTON STORES INC              | 105    | 114     | 3,473  | 384,572   | 専門小売り                   |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC            | 179    | 179     | 1,739  | 192,622   | 資本市場                    |
| CBRE GROUP INC                     | 483    | 548     | 4,335  | 480,013   | 不動産管理・開発                |
| CDK GLOBAL INC                     | 200    | —       | —      | —         | ソフトウェア                  |
| CDW CORPORATION                    | 224    | 239     | 3,939  | 436,108   | 電子装置・機器・部品              |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC         | 353    | 353     | 1,603  | 177,543   | 化学                      |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC       | 201    | 220     | 2,151  | 238,227   | 航空貨物・物流サービス             |
| CIGNA CORP                         | 580    | 595     | 14,625 | 1,619,144 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CME GROUP INC                      | 562    | 600     | 12,296 | 1,361,334 | 資本市場                    |
| CMS ENERGY CORP                    | 433    | 482     | 2,941  | 325,616   | 総合公益事業                  |
| CSX CORP                           | 1,162  | 1,279   | 12,325 | 1,364,580 | 陸運・鉄道                   |
| CVS HEALTH CORP                    | 2,040  | 2,184   | 16,615 | 1,839,543 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CABLE ONE INC                      | —      | 8       | 1,451  | 160,727   | メディア                    |

| 銘柄                            | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |        |
|-------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|--------|
|                               |       | 株数      | 評 価 額  | 外貨建金額     |                         | 邦貨換算金額 |
|                               |       |         | 株数     |           |                         |        |
| (アメリカ)                        | 百株    | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |        |
| CABOT OIL & GAS CORP          | 640   | 640     | 1,202  | 133,135   | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CADENCE DESIGN SYS INC        | 446   | 469     | 6,137  | 679,516   | ソフトウェア                  |        |
| CAMPBELL SOUP CO              | 248   | 309     | 1,587  | 175,767   | 食品                      |        |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP    | 723   | 766     | 9,847  | 1,090,238 | 消費者金融                   |        |
| CARDINAL HEALTH INC           | 443   | 472     | 2,939  | 325,444   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CARMAX INC                    | 261   | 279     | 3,789  | 419,552   | 専門小売り                   |        |
| CARLYLE GROUP INC/THE         | —     | 220     | 816    | 90,385    | 資本市場                    |        |
| CARNIVAL CORP                 | 621   | 1,290   | 3,437  | 380,604   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| CARRIER GLOBAL CORP           | —     | 1,390   | 5,888  | 651,864   | 建設関連製品                  |        |
| CARVANA CO                    | —     | 102     | 2,595  | 287,392   | 専門小売り                   |        |
| CATALENT INC                  | —     | 280     | 2,899  | 321,054   | 医薬品                     |        |
| CATERPILLAR INC DEL           | 868   | 899     | 20,953 | 2,319,805 | 機械                      |        |
| CELANESE CORP-SERIES A        | 196   | 195     | 2,954  | 327,043   | 化学                      |        |
| CENTENE CORP                  | 921   | 975     | 6,374  | 705,726   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |        |
| CENTERPOINT ENERGY INC        | 754   | 940     | 2,143  | 237,273   | 総合公益事業                  |        |
| CENTURYLINK INC               | 1,480 | —       | —      | —         | 各種電気通信サービス              |        |
| CERIDIAN HCM HOLDING INC      | —     | 216     | 1,769  | 195,874   | ソフトウェア                  |        |
| CERNER CORP                   | 499   | 520     | 3,725  | 412,425   | ヘルスケア・テクノロジー            |        |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A  | 235   | 230     | 14,583 | 1,614,539 | メディア                    |        |
| CHENIERE ENERGY INC           | 364   | 364     | 2,628  | 290,954   | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CHEVRON CORP                  | 2,960 | 3,190   | 33,791 | 3,741,075 | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CHEWY INC - CLASS A           | —     | 123     | 988    | 109,456   | インターネット販売・通信販売          |        |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC    | 41    | 44      | 6,272  | 694,398   | ホテル・レストラン・レジャー          |        |
| CHURCH & DWIGHT CO INC        | 375   | 398     | 3,499  | 387,398   | 家庭用品                    |        |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP     | 246   | 246     | 2,584  | 286,181   | 保険                      |        |
| CISCO SYSTEMS                 | 6,638 | 7,002   | 36,249 | 4,013,165 | 通信機器                    |        |
| CINTAS CORP                   | 134   | 143     | 4,823  | 534,013   | 商業サービス・用品               |        |
| CITIGROUP                     | 3,421 | 3,457   | 25,222 | 2,792,357 | 銀行                      |        |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP      | 700   | 700     | 3,134  | 347,031   | 銀行                      |        |
| CITRIX SYSTEMS INC            | 199   | 198     | 2,740  | 303,358   | ソフトウェア                  |        |
| CLOROX CO                     | 193   | 213     | 4,128  | 457,098   | 家庭用品                    |        |
| CLOUDFLARE INC - CLASS A      | —     | 329     | 2,164  | 239,667   | ソフトウェア                  |        |
| COCA COLA CO                  | 6,368 | 6,765   | 35,955 | 3,980,685 | 飲料                      |        |
| COGNEX CORP                   | 278   | 278     | 2,273  | 251,666   | 電子装置・機器・部品              |        |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 866   | 875     | 6,874  | 761,117   | 情報技術サービス                |        |
| COLGATE PALMOLIVE CO.         | 1,265 | 1,363   | 10,812 | 1,197,071 | 家庭用品                    |        |
| COMCAST CORP-CL A             | 7,104 | 7,566   | 41,597 | 4,605,299 | メディア                    |        |
| COMERICA INC                  | 230   | —       | —      | —         | 銀行                      |        |
| CONAGRA BRANDS INC            | 769   | 821     | 3,146  | 348,301   | 食品                      |        |
| CONCHO RESOURCES INC          | 310   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CONOCOPHILLIPS                | 1,710 | 2,231   | 11,920 | 1,319,688 | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| CONSOLIDATED EDISON INC       | 525   | 570     | 4,239  | 469,372   | 総合公益事業                  |        |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A    | 259   | 283     | 6,620  | 732,987   | 飲料                      |        |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK  | 139   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |        |
| THE COOPER COMPANIES, INC.    | 75    | 91      | 3,502  | 387,761   | ヘルスケア機器・用品              |        |
| COPART INC                    | 319   | 358     | 3,803  | 421,113   | 商業サービス・用品               |        |
| CORNING INC                   | 1,190 | 1,290   | 5,624  | 622,677   | 電子装置・機器・部品              |        |
| CORTEVA INC                   | 1,150 | 1,217   | 5,712  | 632,441   | 化学                      |        |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION  | 691   | 733     | 25,640 | 2,838,623 | 食品・生活必需品小売り             |        |
| COSTAR GROUP INC              | 58    | 66      | 5,293  | 585,990   | 専門サービス                  |        |
| COTY INC-CL A                 | 490   | —       | —      | —         | パーソナル用品                 |        |
| COUPA SOFTWARE INC            | —     | 114     | 2,720  | 301,198   | ソフトウェア                  |        |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A  | —     | 290     | 5,083  | 562,752   | ソフトウェア                  |        |
| CROWN HOLDINGS INC            | 212   | 228     | 2,212  | 244,972   | 容器・包装                   |        |

| 銘柄                          | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|-----------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                             |       | 株 数     | 評 価 額  |           |                         |
|                             |       |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                      | 百株    | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |
| CUMMINS INC                 | 226   | 249     | 6,561  | 726,440   | 機械                      |
| DR HORTON INC               | 538   | 561     | 5,006  | 554,254   | 家庭用耐久財                  |
| DTE ENERGY COMPANY          | 305   | 328     | 4,379  | 484,885   | 総合公益事業                  |
| DXC TECHNOLOGY CO           | 378   | —       | —      | —         | 情報技術サービス                |
| DANAHER CORP                | 981   | 1,060   | 23,638 | 2,616,962 | ヘルスケア機器・用品              |
| DARDEN RESTAURANTS INC      | 198   | 220     | 3,191  | 353,335   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DATADOG INC - CLASS A       | —     | 293     | 2,266  | 250,973   | ソフトウェア                  |
| DAVITA INC                  | 148   | 125     | 1,368  | 151,506   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY             | 471   | 494     | 18,471 | 2,044,996 | 機械                      |
| DELL TECHNOLOGIES-C         | 266   | 407     | 3,605  | 399,177   | コンピュータ・周辺機器             |
| DELTA AIR LINES INC         | 252   | 252     | 1,232  | 136,425   | 旅客航空輸送業                 |
| DENTSPLY SIRONA INC         | 352   | 352     | 2,236  | 247,614   | ヘルスケア機器・用品              |
| DEVON ENERGY CORP           | 624   | 1,000   | 2,200  | 243,562   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DEXCOM INC                  | 144   | 161     | 5,589  | 618,860   | ヘルスケア機器・用品              |
| DIAMONDBACK ENERGY INC      | 231   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| DISNEY (WALT) CO            | 2,820 | 3,000   | 55,659 | 6,162,007 | 娯楽                      |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 496   | 500     | 4,763  | 527,311   | 消費者金融                   |
| DISCOVERY INC - A           | 245   | 245     | 1,064  | 117,826   | メディア                    |
| DISCOVERY INC - C           | 570   | 491     | 1,817  | 201,181   | メディア                    |
| DISH NETWORK CORP-A         | 371   | 384     | 1,377  | 152,492   | メディア                    |
| DOCUSIGN INC                | 166   | 293     | 5,770  | 638,834   | ソフトウェア                  |
| DOLLAR GENERAL CORP         | 397   | 418     | 8,433  | 933,634   | 複合小売り                   |
| DOLLAR TREE INC             | 376   | 382     | 4,439  | 491,550   | 複合小売り                   |
| DOMINION ENERGY INC         | 1,278 | 1,340   | 10,121 | 1,120,498 | 総合公益事業                  |
| DOMINOS PIZZA INC           | 59    | 63      | 2,322  | 257,168   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DOVER CORP                  | 229   | 243     | 3,362  | 372,277   | 機械                      |
| DOW INC                     | 1,152 | 1,245   | 8,043  | 890,545   | 化学                      |
| DRAFTKINGS INC - CL A       | —     | 277     | 1,689  | 187,066   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| DROPBOX INC-CLASS A         | 390   | 510     | 1,338  | 148,213   | ソフトウェア                  |
| DUKE ENERGY CORP            | 1,138 | 1,230   | 11,837 | 1,310,531 | 電力                      |
| DUPONT DE NEMOURS INC       | 1,150 | 877     | 6,868  | 760,429   | 化学                      |
| DYNATRACE INC               | —     | 290     | 1,354  | 149,998   | ソフトウェア                  |
| EOG RESOURCES INC           | 904   | 981     | 7,186  | 795,651   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| E*TRADE FINANCIAL CORP      | 350   | —       | —      | —         | 資本市場                    |
| EAST WEST BANCORP INC       | 207   | —       | —      | —         | 銀行                      |
| EASTMAN CHEMICAL CO.        | 208   | 230     | 2,564  | 283,941   | 化学                      |
| EATON VANCE CORP            | 164   | —       | —      | —         | 資本市場                    |
| EBAY INC                    | 1,200 | 1,128   | 6,804  | 753,281   | インターネット販売・通信販売          |
| ECOLAB INC                  | 401   | 430     | 9,245  | 1,023,513 | 化学                      |
| EDISON INTERNATIONAL        | 555   | 612     | 3,637  | 402,732   | 電力                      |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP   | 325   | 1,042   | 8,632  | 955,756   | ヘルスケア機器・用品              |
| ELANCO ANIMAL HEALTH INC    | 600   | 740     | 2,131  | 235,945   | 医薬品                     |
| ELECTRONIC ARTS             | 461   | 485     | 6,519  | 721,813   | 娯楽                      |
| EMERSON ELEC                | 938   | 982     | 8,949  | 990,848   | 電気設備                    |
| ENPHASE ENERGY INC          | —     | 195     | 2,936  | 325,122   | 半導体・半導体製造装置             |
| ENTERGY CORP                | 313   | 336     | 3,314  | 367,000   | 電力                      |
| EPAM SYSTEMS INC            | 84    | 95      | 3,643  | 403,354   | 情報技術サービス                |
| EQUIFAX INC                 | 185   | 197     | 3,610  | 399,731   | 専門サービス                  |
| EQUITABLE HOLDINGS INC      | 620   | 690     | 2,236  | 247,579   | 各種金融サービス                |
| ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A | 37    | 44      | 979    | 108,443   | 保険                      |
| ESSENTIAL UTILITIES INC     | 349   | 396     | 1,748  | 193,558   | 水道                      |
| ETSY INC                    | —     | 209     | 4,156  | 460,153   | インターネット販売・通信販売          |
| EVERGY INC                  | 359   | 359     | 2,131  | 235,965   | 電力                      |
| EVERSOURCE ENERGY           | 503   | 564     | 4,866  | 538,798   | 電力                      |

| 銘柄                                 | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等                   |
|------------------------------------|--------|---------|---------|------------|-------------------------|
|                                    |        | 株 数     | 評 価 額   | 業 種 等      |                         |
|                                    |        |         | 外貨建金額   |            |                         |
| (アメリカ)                             | 百株     | 百株      | 千米ドル    | 千円         |                         |
| EXACT SCIENCES CORP                | 226    | 258     | 3,190   | 353,183    | バイオテクノロジー               |
| EXELON CORPORATION                 | 1,515  | 1,637   | 7,120   | 788,360    | 電力                      |
| EXPEDIA GROUP INC                  | 207    | 223     | 3,921   | 434,193    | インターネット販売・通信販売          |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC  | 273    | 271     | 2,906   | 321,745    | 航空貨物・物流サービス             |
| EXXON MOBIL CORP                   | 6,621  | 7,007   | 39,722  | 4,397,698  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| FLIR SYSTEMS INC                   | 207    | —       | —       | —          | 電子装置・機器・部品              |
| FMC CORP                           | 196    | 212     | 2,353   | 260,569    | 化学                      |
| FACEBOOK INC-A                     | 3,761  | 3,984   | 114,739 | 12,702,776 | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC       | 59     | 64      | 1,992   | 220,598    | 資本市場                    |
| FAIR ISAAC CORP                    | —      | 46      | 2,240   | 248,092    | ソフトウェア                  |
| FASTENAL CO                        | 874    | 969     | 4,905   | 543,041    | 商社・流通業                  |
| FEDEX CORPORATION                  | 391    | 417     | 11,922  | 1,319,980  | 航空貨物・物流サービス             |
| F5 NETWORKS INC                    | 93     | 104     | 2,159   | 239,061    | 通信機器                    |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION      | 964    | 1,035   | 14,749  | 1,632,948  | 情報技術サービス                |
| FNF GROUP                          | 405    | 454     | 1,855   | 205,371    | 保険                      |
| FIFTH THIRD BANCORP                | 1,120  | 1,200   | 4,574   | 506,431    | 銀行                      |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA             | 257    | 290     | 4,874   | 539,603    | 銀行                      |
| FISERV INC                         | 908    | 952     | 11,496  | 1,272,761  | 情報技術サービス                |
| FIRSTENERGY CORP                   | 834    | 866     | 2,986   | 330,672    | 電力                      |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC          | 138    | 135     | 3,734   | 413,476    | 情報技術サービス                |
| FLOWSERVE CORP                     | 206    | —       | —       | —          | 機械                      |
| FORD MOTOR COMPANY                 | 6,070  | 6,560   | 8,173   | 904,916    | 自動車                     |
| FORTINET INC                       | 228    | 224     | 4,061   | 449,680    | ソフトウェア                  |
| FORTIVE CORP                       | 476    | 518     | 3,699   | 409,520    | 機械                      |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 216    | 234     | 2,246   | 248,698    | 建設関連製品                  |
| FOX CORP-CLASS A                   | 528    | 580     | 2,152   | 238,289    | メディア                    |
| FOX CORP-CLASS B                   | 254    | 254     | 910     | 100,783    | メディア                    |
| FRANKLIN RESOURCES INC             | 434    | 510     | 1,495   | 165,603    | 資本市場                    |
| FREEPORT-MCMORAN INC               | 2,250  | 2,390   | 7,810   | 864,702    | 金属・鉱業                   |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO            | 297    | 319     | 4,007   | 443,681    | 保険                      |
| GAP INC                            | 315    | —       | —       | —          | 専門小売り                   |
| GARTNER INC                        | 141    | 141     | 2,562   | 283,682    | 情報技術サービス                |
| GENERAC HOLDINGS INC               | —      | 102     | 3,241   | 358,816    | 電気設備                    |
| GENERAL DYNAMICS                   | 383    | 410     | 7,466   | 826,571    | 航空宇宙・防衛                 |
| GENERAL ELEC CO                    | 13,550 | 14,530  | 19,324  | 2,139,459  | コングロマリット                |
| GENERAL MILLS                      | 943    | 1,028   | 6,352   | 703,231    | 食品                      |
| GENERAL MOTORS CO                  | 1,990  | 2,153   | 12,597  | 1,394,636  | 自動車                     |
| GENUINE PARTS CO                   | 232    | 232     | 2,727   | 301,975    | 販売                      |
| GILEAD SCIENCES INC                | 1,982  | 2,082   | 13,637  | 1,509,763  | バイオテクノロジー               |
| GLOBAL PAYMENTS INC                | 473    | 492     | 10,055  | 1,113,298  | 情報技術サービス                |
| GLOBE LIFE INC                     | 157    | 157     | 1,543   | 170,894    | 保険                      |
| GODADDY INC - CLASS A              | 269    | 269     | 2,043   | 226,186    | 情報技術サービス                |
| GOLDMAN SACHS GROUP                | 501    | 543     | 18,028  | 1,995,895  | 資本市場                    |
| GRAINGER(W.W.) INC                 | 70     | 74      | 2,966   | 328,377    | 商社・流通業                  |
| GRUBHUB INC                        | 145    | —       | —       | —          | インターネット販売・通信販売          |
| GUIDEWIRE SOFTWARE INC             | 121    | 136     | 1,367   | 151,423    | ソフトウェア                  |
| HCA HEALTHCARE INC                 | 424    | 454     | 8,559   | 947,646    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HD SUPPLY HOLDINGS INC             | 268    | —       | —       | —          | 商社・流通業                  |
| HP INC                             | 2,320  | 2,250   | 7,101   | 786,151    | コンピュータ・周辺機器             |
| HALLIBURTON CO                     | 1,280  | 1,500   | 3,225   | 357,039    | エネルギー設備・サービス            |
| HANESBRANDS INC                    | 510    | —       | —       | —          | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| HARLEY-DAVIDSON INC                | 224    | —       | —       | —          | 自動車                     |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES        | 545    | 589     | 3,988   | 441,524    | 保険                      |
| HASBRO INC                         | 196    | 214     | 2,073   | 229,527    | レジャー用品                  |

| 銘柄                                | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|-----------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                                   |       | 株 数     | 評 価 額  | 業 種 等     |                         |
|                                   |       |         | 外貨建金額  |           |                         |
| (アメリカ)                            | 百株    | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |
| HEICO CORP                        | 63    | 63      | 779    | 86,347    | 航空宇宙・防衛                 |
| HEICO CORP-CLASS A                | 124   | 123     | 1,411  | 156,231   | 航空宇宙・防衛                 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC       | 117   | 127     | 1,948  | 215,683   | 情報技術サービス                |
| HERSHEY CO/THE                    | 235   | 251     | 3,987  | 441,443   | 食品                      |
| HESS CORP                         | 432   | 473     | 3,360  | 372,006   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE        | 2,020 | 2,200   | 3,471  | 384,340   | コンピュータ・周辺機器             |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN      | 416   | 468     | 5,712  | 632,420   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HOLLYFRONTIER CORP                | 236   | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HOLOGIC INC                       | 433   | 434     | 3,205  | 354,931   | ヘルスケア機器・用品              |
| HOME DEPOT                        | 1,706 | 1,784   | 54,379 | 6,020,397 | 専門小売り                   |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC       | 1,120 | 1,165   | 25,407 | 2,812,862 | コングロマリット                |
| HORMEL FOODS CORP                 | 456   | 500     | 2,408  | 266,589   | 食品                      |
| HOWMET AEROSPACE INC              | —     | 660     | 2,096  | 232,065   | 航空宇宙・防衛                 |
| HUBSPOT INC                       | —     | 70      | 3,066  | 339,529   | ソフトウェア                  |
| HUMANA INC                        | 204   | 217     | 9,237  | 1,022,728 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HUNT J B TRANSPORT SVCS INC       | 132   | 132     | 2,235  | 247,468   | 陸運・鉄道                   |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC         | 1,540 | 1,720   | 2,753  | 304,864   | 銀行                      |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE      | 65    | 65      | 1,336  | 148,003   | 航空宇宙・防衛                 |
| IAC/INTERACTIVE CORP              | —     | 136     | 2,801  | 310,165   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IAC/INTERACTIVE CORP              | 126   | —       | —      | —         | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| IPG PHOTONICS CORP                | 59    | 59      | 1,207  | 133,642   | 電子装置・機器・部品              |
| IDEX CORP                         | 123   | 123     | 2,588  | 286,590   | 機械                      |
| IDEXX LABORATORIES INC            | 136   | 142     | 6,801  | 752,974   | ヘルスケア機器・用品              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC           | 500   | 529     | 11,889 | 1,316,320 | 機械                      |
| ILLUMINA INC                      | 228   | 244     | 9,013  | 997,905   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| INCYTE CORP                       | 285   | 312     | 2,503  | 277,126   | バイオテクノロジー               |
| INGERSOLL-RAND INC                | 528   | 580     | 2,902  | 321,315   | 機械                      |
| INGREDION INC                     | 96    | —       | —      | —         | 食品                      |
| INSULET CORP                      | 98    | 106     | 2,770  | 306,736   | ヘルスケア機器・用品              |
| INTEL CORP                        | 6,802 | 6,791   | 43,306 | 4,794,430 | 半導体・半導体製造装置             |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC     | 876   | 930     | 10,344 | 1,145,227 | 資本市場                    |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES   | 1,388 | 1,485   | 20,005 | 2,214,855 | 情報技術サービス                |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 155   | 371     | 5,195  | 575,207   | 化学                      |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO)        | 598   | 601     | 3,305  | 365,951   | 容器・包装                   |
| INTERPUBLIC GROUP                 | 580   | 670     | 1,963  | 217,408   | メディア                    |
| INTUIT INC                        | 404   | 433     | 16,179 | 1,791,230 | ソフトウェア                  |
| INTUITIVE SURGICAL INC            | 181   | 194     | 14,115 | 1,562,749 | ヘルスケア機器・用品              |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC         | 214   | 214     | 956    | 105,926   | バイオテクノロジー               |
| IQVIA HOLDINGS INC                | 252   | 322     | 6,143  | 680,140   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| JPMORGAN CHASE & CO               | 4,903 | 5,051   | 78,027 | 8,638,463 | 銀行                      |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC      | 200   | 213     | 2,729  | 302,146   | 建設・土木                   |
| JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC     | 430   | —       | —      | —         | 各種金融サービス                |
| JOHNSON & JOHNSON                 | 4,114 | 4,362   | 71,977 | 7,968,613 | 医薬品                     |
| JONES LANG LASALLE INC            | 76    | —       | —      | —         | 不動産管理・開発                |
| JUNIPER NETWORKS INC              | 530   | 530     | 1,349  | 149,448   | 通信機器                    |
| KLA CORP                          | 244   | 255     | 8,085  | 895,121   | 半導体・半導体製造装置             |
| KKR & CO INC-A                    | 784   | 855     | 4,205  | 465,618   | 資本市場                    |
| KANSAS CITY SOUTHERN              | 151   | 151     | 3,920  | 434,028   | 陸運・鉄道                   |
| KELLOGG CO                        | 400   | 433     | 2,760  | 305,649   | 食品                      |
| KEURIG DR PEPPER INC              | —     | 920     | 3,211  | 355,569   | 飲料                      |
| KEYCORP                           | 1,580 | 1,580   | 3,174  | 351,417   | 銀行                      |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC         | 289   | 304     | 4,302  | 476,364   | 電子装置・機器・部品              |
| KIMBERLY-CLARK CORP               | 533   | 572     | 7,911  | 875,863   | 家庭用品                    |
| KINDER MORGAN INC                 | 3,150 | 3,440   | 5,717  | 632,960   | 石油・ガス・消耗燃料              |



| 銘柄                                       | 株数    | 期首(前期末) | 当期末    |           | 業種等                     |
|------------------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                                          |       | 株数      | 評価額    | 業種等       |                         |
|                                          |       |         | 外貨建金額  |           |                         |
| (アメリカ)                                   | 百株    | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC | 208   | 208     | 1,020  | 112,996   | 陸運・鉄道                   |
| KOHL'S CORP                              | 253   | —       | —      | —         | 複合小売り                   |
| KRAFT HEINZ CO/THE                       | 1,041 | 1,090   | 4,390  | 486,074   | 食品                      |
| KROGER CO                                | 1,269 | 1,260   | 4,798  | 531,195   | 食品・生活必需品小売り             |
| LKQ CORP                                 | 450   | 490     | 2,100  | 232,506   | 販売                      |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC                | 344   | 344     | 6,985  | 773,414   | 航空宇宙・防衛                 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS             | 149   | 158     | 4,005  | 443,496   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH                             | 224   | 237     | 13,586 | 1,504,200 | 半導体・半導体製造装置             |
| LAMB WESTON HOLDINGS INC                 | 217   | 239     | 1,886  | 208,819   | 食品                      |
| LAS VEGAS SANDS CORP                     | 538   | 586     | 3,587  | 397,171   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A              | 344   | 378     | 11,155 | 1,235,071 | パーソナル用品                 |
| LEAR CORP                                | 84    | 97      | 1,723  | 190,776   | 自動車部品                   |
| LEGGETT & PLATT INC                      | 189   | —       | —      | —         | 家庭用耐久財                  |
| LEIDOS HOLDINGS INC                      | 215   | 215     | 2,078  | 230,100   | 情報技術サービス                |
| LENNAR CORP-A                            | 430   | 465     | 4,732  | 523,964   | 家庭用耐久財                  |
| LENNOX INTERNATIONAL INC                 | 51    | 57      | 1,802  | 199,574   | 建設関連製品                  |
| LIBERTY BROADBAND CORP-A                 | —     | 40      | 588    | 65,159    | メディア                    |
| LIBERTY BROADBAND CORP-C                 | 167   | 259     | 3,942  | 436,473   | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP                   | 129   | 129     | 571    | 63,253    | メディア                    |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C                   | 267   | 299     | 1,325  | 146,775   | メディア                    |
| LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C             | 293   | 340     | 1,478  | 163,664   | 娯楽                      |
| ELI LILLY & CO.                          | 1,353 | 1,427   | 26,470 | 2,930,587 | 医薬品                     |
| LINCOLN NATIONAL CORP                    | 299   | 299     | 1,875  | 207,584   | 保険                      |
| LIVE NATION ENTERTAINMENT IN             | 230   | 266     | 2,220  | 245,868   | 娯楽                      |
| LOCKHEED MARTIN                          | 397   | 420     | 15,562 | 1,722,944 | 航空宇宙・防衛                 |
| LOEWS CORP                               | 433   | 431     | 2,270  | 251,320   | 保険                      |
| LOWES COS INC                            | 1,205 | 1,214   | 23,068 | 2,553,905 | 専門小売り                   |
| LULULEMON ATHLETICA INC                  | 172   | 208     | 6,595  | 730,184   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| LUMEN TECHNOLOGIES INC                   | —     | 1,470   | 1,944  | 215,309   | 各種電気通信サービス              |
| M & T BANK CORP                          | 200   | 217     | 3,338  | 369,658   | 銀行                      |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL                | 790   | 800     | 3,056  | 338,418   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MSCI INC                                 | 131   | 137     | 5,728  | 634,173   | 資本市場                    |
| MANPOWERGROUP INC                        | 96    | —       | —      | —         | 専門サービス                  |
| MARATHON OIL CORP                        | 1,230 | —       | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARATHON PETROLEUM CORP                  | 985   | 1,060   | 5,681  | 629,009   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| MARKEL CORP                              | 21    | 23      | 2,693  | 298,239   | 保険                      |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC                 | 58    | 61      | 3,038  | 336,441   | 資本市場                    |
| MARSH & MCLENNAN COS                     | 794   | 848     | 10,304 | 1,140,855 | 保険                      |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA               | 432   | 464     | 6,877  | 761,449   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS                | 97    | 105     | 3,608  | 399,454   | 建設資材                    |
| MASCO CORP                               | 428   | 425     | 2,550  | 282,357   | 建設関連製品                  |
| MASIMO CORP                              | —     | 82      | 1,854  | 205,285   | ヘルスケア機器・用品              |
| MASTERCARD INC                           | 1,403 | 1,474   | 52,798 | 5,845,341 | 情報技術サービス                |
| MATCH GROUP INC                          | 84    | —       | —      | —         | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| MATCH GROUP INC                          | —     | 416     | 5,469  | 605,535   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS                | 424   | 452     | 4,064  | 449,967   | 半導体・半導体製造装置             |
| MCCORMICK & CO INC.                      | 189   | 402     | 3,613  | 400,103   | 食品                      |
| MCDONALD'S CORP                          | 1,179 | 1,236   | 27,807 | 3,078,571 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MCKESSON CORP                            | 256   | 262     | 5,149  | 570,055   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MELCO RESORTS & ENTERT-ADR               | 340   | 340     | 681    | 75,433    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MERCADOLIBRE INC                         | 69    | 74      | 10,610 | 1,174,662 | インターネット販売・通信販売          |
| MERCK & CO INC                           | 3,983 | 4,193   | 32,269 | 3,572,537 | 医薬品                     |
| METLIFE INC                              | 1,206 | 1,254   | 7,704  | 852,973   | 保険                      |
| METTLER-TOLEDO INTL                      | 38    | 38      | 4,447  | 492,402   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |

| 銘柄                           | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等                   |
|------------------------------|--------|---------|---------|------------|-------------------------|
|                              |        | 株数      | 評 価 額   | 業 種 等      |                         |
|                              |        |         | 外貨建金額   |            |                         |
| (アメリカ)                       | 百株     | 百株      | 千米ドル    | 千円         |                         |
| MICROSOFT CORP               | 11,321 | 11,902  | 275,947 | 30,550,188 | ソフトウェア                  |
| MICROCHIP TECHNOLOGY         | 373    | 427     | 6,409   | 709,617    | 半導体・半導体製造装置             |
| MICRON TECHNOLOGY            | 1,740  | 1,845   | 15,966  | 1,767,665  | 半導体・半導体製造装置             |
| MIDDLEBY CORP                | 87     | —       | —       | —          | 機械                      |
| MODERNA INC                  | —      | 463     | 5,486   | 607,364    | バイオテクノロジー               |
| MOHAWK INDUSTRIES            | 87     | 102     | 1,989   | 220,236    | 家庭用耐久財                  |
| MOLINA HEALTHCARE INC        | —      | 97      | 2,281   | 252,578    | ヘルスケア・プロバイダー・ヘルスケア・サービス |
| MOLSON COORS BEVERAGE CO-B   | 284    | 314     | 1,643   | 181,949    | 飲料                      |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC   | 2,259  | 2,386   | 14,024  | 1,552,697  | 食品                      |
| MONGODB INC                  | 74     | 88      | 2,285   | 253,002    | 情報技術サービス                |
| MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | —      | 69      | 2,363   | 261,704    | 半導体・半導体製造装置             |
| MONSTER BEVERAGE CORP        | 638    | 666     | 6,039   | 668,683    | 飲料                      |
| MOODYS CORP                  | 268    | 283     | 8,420   | 932,189    | 資本市場                    |
| MORGAN STANLEY               | 1,910  | 2,331   | 18,435  | 2,041,036  | 資本市場                    |
| DAIRY FARM INTL HLDGS LTD    | 450    | —       | —       | —          | 食品・生活必需品小売り             |
| MOSAIC CO/THE                | 560    | 560     | 1,755   | 194,300    | 化学                      |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       | 268    | 276     | 5,150   | 570,204    | 通信機器                    |
| NRG ENERGY INC               | 405    | 405     | 1,502   | 166,302    | 電力                      |
| NVR INC                      | 5      | 5       | 2,630   | 291,246    | 家庭用耐久財                  |
| NASDAQ INC                   | 184    | 184     | 2,713   | 300,365    | 資本市場                    |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   | 580    | —       | —       | —          | エネルギー設備・サービス            |
| NETAPP INC                   | 352    | 352     | 2,542   | 281,440    | コンピュータ・周辺機器             |
| NETFLIX INC                  | 685    | 732     | 37,585  | 4,161,066  | 娯楽                      |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC   | 142    | 142     | 1,338   | 148,184    | バイオテクノロジー               |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD   | 1,840  | 1,840   | 916     | 101,445    | 不動産管理・開発                |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD   | 354    | 354     | 2,336   | 258,662    | コングロマリット                |
| JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD  | 333    | 403     | 1,331   | 147,456    | コングロマリット                |
| NEWELL BRANDS INC            | 660    | 660     | 1,762   | 195,093    | 家庭用耐久財                  |
| NEWMONT CORP                 | 1,276  | 1,317   | 7,886   | 873,080    | 金属・鉱業                   |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I       | 550    | 670     | 1,721   | 190,557    | メディア                    |
| NEXTERA ENERGY INC           | 765    | 3,252   | 24,136  | 2,672,134  | 電力                      |
| NIKE INC-B                   | 1,952  | 2,083   | 27,693  | 3,065,945  | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NISOURCE INC                 | 582    | 650     | 1,559   | 172,635    | 総合公益事業                  |
| NOBLE ENERGY INC             | 710    | —       | —       | —          | 石油・ガス・消耗燃料              |
| NORDSON CORP                 | —      | 87      | 1,775   | 196,517    | 機械                      |
| NORDSTROM INC                | 150    | —       | —       | —          | 複合小売り                   |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        | 403    | 418     | 11,298  | 1,250,815  | 陸運・鉄道                   |
| NORTHERN TRUST CORP          | 321    | 321     | 3,435   | 380,326    | 資本市場                    |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        | 251    | 260     | 8,389   | 928,821    | 航空宇宙・防衛                 |
| NORTONLIFELOCK INC           | 980    | 910     | 1,920   | 212,574    | ソフトウェア                  |
| NUCOR CORP                   | 467    | 509     | 4,091   | 453,008    | 金属・鉱業                   |
| NVIDIA CORP                  | 909    | 1,025   | 52,815  | 5,847,189  | 半導体・半導体製造装置             |
| OGE ENERGY CORP              | 325    | 325     | 1,054   | 116,757    | 電力                      |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC,      | 119    | 118     | 6,023   | 666,807    | 専門小売り                   |
| OCCIDENTAL PETE CORP         | 1,420  | 1,580   | 4,318   | 478,061    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| OKTA INC                     | 165    | 203     | 4,335   | 479,935    | 情報技術サービス                |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE    | 153    | 153     | 3,681   | 407,560    | 陸運・鉄道                   |
| OMNICOM GROUP                | 345    | 345     | 2,603   | 288,180    | メディア                    |
| ON SEMICONDUCTOR CORPORATION | 590    | 680     | 2,711   | 300,152    | 半導体・半導体製造装置             |
| ONEOK INC                    | 670    | 740     | 3,719   | 411,757    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ORACLE CORPORATION           | 3,598  | 3,230   | 22,787  | 2,522,820  | ソフトウェア                  |
| OTIS WORLDWIDE CORP          | —      | 696     | 4,853   | 537,375    | 機械                      |
| OWENS CORNING INC            | 168    | 168     | 1,546   | 171,187    | 建設関連製品                  |
| PG&E CORP                    | —      | 2,370   | 2,723   | 301,477    | 電力                      |

| 銘<br>柄                        | 期首(前期末) | 当 期 末 |                 | 業 種 等     |                         |
|-------------------------------|---------|-------|-----------------|-----------|-------------------------|
|                               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額           |           |                         |
|                               |         |       | 外貨建金額<br>邦貨換算金額 |           |                         |
| (アメリカ)                        | 百株      | 百株    | 千米ドル<br>千円      |           |                         |
| PNC FINANCIAL                 | 689     | 698   | 12,397          | 1,372,568 | 銀行                      |
| PPG INDUSTRIES                | 368     | 398   | 6,081           | 673,232   | 化学                      |
| PPL CORPORATION               | 1,148   | 1,290 | 3,750           | 415,165   | 電力                      |
| PPD INC                       | —       | 200   | 754             | 83,497    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| PVH CORP                      | 116     | —     | —               | —         | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| PTC INC                       | 170     | 187   | 2,468           | 273,276   | ソフトウェア                  |
| PACCAR                        | 538     | 583   | 5,440           | 602,323   | 機械                      |
| PACKAGING CORP OF AMERICA     | 145     | 161   | 2,180           | 241,430   | 容器・包装                   |
| PALO ALTO NETWORKS INC        | 152     | 156   | 4,960           | 549,227   | ソフトウェア                  |
| PARKER HANNIFIN CORP          | 201     | 216   | 6,854           | 758,842   | 機械                      |
| PAYCHEX INC                   | 505     | 548   | 5,437           | 602,019   | 情報技術サービス                |
| PAYCOM SOFTWARE INC           | 75      | 81    | 2,917           | 323,000   | ソフトウェア                  |
| PAYPAL HOLDINGS INC           | 1,747   | 1,845 | 43,641          | 4,831,564 | 情報技術サービス                |
| PELOTON INTERACTIVE INC-A     | —       | 402   | 4,308           | 476,964   | レジャー用品                  |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC  | 710     | —     | —               | —         | 銀行                      |
| PEPSICO INC                   | 2,182   | 2,290 | 32,641          | 3,613,758 | 飲料                      |
| PERKINELMER INC               | 174     | 188   | 2,401           | 265,850   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| PFIZER INC                    | 8,658   | 9,210 | 33,257          | 3,681,916 | 医薬品                     |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   | 2,437   | 2,586 | 23,105          | 2,558,055 | タバコ                     |
| PHILLIPS 66                   | 703     | 711   | 5,852           | 647,901   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP    | 170     | 191   | 1,541           | 170,687   | 電力                      |
| PINTEREST INC- CLASS A        | 460     | 847   | 5,870           | 649,929   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  | 261     | 335   | 5,380           | 595,705   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| PLUG POWER INC                | —       | 776   | 2,641           | 292,440   | 電気設備                    |
| POLARIS INC                   | 83      | —     | —               | —         | レジャー用品                  |
| POOL CORP                     | —       | 65    | 2,225           | 246,374   | 販売                      |
| T ROWE PRICE GROUP INC        | 366     | 382   | 6,578           | 728,339   | 資本市場                    |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     | 444     | 444   | 2,692           | 298,077   | 保険                      |
| PROCTER & GAMBLE CO           | 3,899   | 4,109 | 55,656          | 6,161,720 | 家庭用品                    |
| PROGRESSIVE CO                | 920     | 961   | 9,182           | 1,016,578 | 保険                      |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      | 630     | 666   | 6,132           | 678,932   | 保険                      |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE         | 781     | 858   | 5,131           | 568,130   | 総合公益事業                  |
| PULTEGROUP INC                | 379     | 430   | 2,268           | 251,117   | 家庭用耐久財                  |
| QORVO INC                     | 176     | 194   | 3,446           | 381,509   | 半導体・半導体製造装置             |
| QUALCOMM INC                  | 1,791   | 1,868 | 24,304          | 2,690,756 | 半導体・半導体製造装置             |
| QUEST DIAGNOSTICS INC         | 205     | 219   | 2,813           | 311,530   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| RPM INTERNATIONAL INC         | 211     | 211   | 1,976           | 218,811   | 化学                      |
| RALPH LAUREN CORPORATION      | 78      | —     | —               | —         | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   | 196     | 196   | 2,406           | 266,422   | 資本市場                    |
| RAYTHEON COMPANY              | 433     | —     | —               | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP    | —       | 2,506 | 19,501          | 2,159,032 | 航空宇宙・防衛                 |
| REGENERON PHARMACEUTICALS     | 127     | 175   | 8,246           | 912,929   | バイオテクノロジー               |
| REGIONS FINANCIAL CORP        | 1,500   | 1,620 | 3,387           | 375,021   | 銀行                      |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA  | 90      | 105   | 1,347           | 149,235   | 保険                      |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A    | 343     | 361   | 3,625           | 401,381   | 商業サービス・用品               |
| RESMED INC                    | 225     | 245   | 4,638           | 513,483   | ヘルスケア機器・用品              |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A       | 119     | 125   | 3,584           | 396,826   | ソフトウェア                  |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 171     | 203   | 1,574           | 174,309   | 専門サービス                  |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       | 178     | 196   | 5,245           | 580,756   | 電気設備                    |
| ROKU INC                      | 142     | 175   | 5,484           | 607,162   | 娯楽                      |
| ROLLINS INC                   | 239     | 358   | 1,216           | 134,626   | 商業サービス・用品               |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        | 164     | 175   | 7,088           | 784,817   | コングロマリット                |
| ROSS STORES INC               | 561     | 598   | 7,198           | 796,970   | 専門小売り                   |
| S&P GLOBAL INC                | 384     | 396   | 13,970          | 1,546,628 | 資本市場                    |

| 銘柄                                | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |        |           | 業 種 等                   |
|-----------------------------------|---------|-------|-------|--------|-----------|-------------------------|
|                                   |         | 株 数   | 株 数   | 評 価 額  |           |                         |
|                                   |         |       |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                            |         | 百株    | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                         |
| SEI INVESTMENTS COMPANY           |         | 191   | 191   | 1,171  | 129,707   | 資本市場                    |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS        |         | 367   | 370   | 2,537  | 280,881   | ソフトウェア                  |
| SVB FINANCIAL GROUP               |         | 81    | 87    | 4,268  | 472,592   | 銀行                      |
| SABRE CORP                        |         | 420   | —     | —      | —         | 情報技術サービス                |
| SALESFORCE.COM INC                |         | 1,304 | 1,508 | 31,668 | 3,505,964 | ソフトウェア                  |
| SAREPTA THERAPEUTICS INC          |         | 112   | 126   | 921    | 101,970   | バイオテクノロジー               |
| HENRY SCHEIN INC                  |         | 231   | 231   | 1,593  | 176,383   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD                  |         | 2,140 | 2,340 | 6,369  | 705,165   | エネルギー設備・サービス            |
| SCHWAB (CHARLES) CORP             |         | 1,797 | 2,539 | 16,442 | 1,820,356 | 資本市場                    |
| SEAGEN INC                        |         | —     | 207   | 2,846  | 315,131   | バイオテクノロジー               |
| SEALED AIR CORP                   |         | 219   | 265   | 1,234  | 136,627   | 容器・包装                   |
| SEATTLE GENETICS INC              |         | 187   | —     | —      | —         | バイオテクノロジー               |
| SEMPRA ENERGY                     |         | 436   | 473   | 6,223  | 688,977   | 総合公益事業                  |
| SERVICENOW INC                    |         | 296   | 323   | 15,763 | 1,745,137 | ソフトウェア                  |
| SHERWIN-WILLIAMS                  |         | 129   | 134   | 10,021 | 1,109,506 | 化学                      |
| SIGNATURE BANK                    |         | 89    | —     | —      | —         | 銀行                      |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC            |         | 2,290 | 1,750 | 1,071  | 118,570   | メディア                    |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC            |         | 272   | 271   | 4,837  | 535,573   | 半導体・半導体製造装置             |
| SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A       |         | —     | 761   | 3,082  | 341,213   | ソフトウェア                  |
| SMITH (A.O.) CORP                 |         | 218   | 218   | 1,508  | 166,988   | 建設関連製品                  |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW             |         | 174   | 186   | 2,391  | 264,710   | 食品                      |
| SNAP-ON INC                       |         | 84    | 84    | 1,949  | 215,788   | 機械                      |
| SNAP INC-A                        |         | 1,170 | 1,522 | 7,550  | 835,931   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SNOWFLAKE INC-CLASS A             |         | —     | 39    | 866    | 95,882    | 情報技術サービス                |
| SOLAREdge TECHNOLOGIES INC        |         | —     | 82    | 2,223  | 246,174   | 半導体・半導体製造装置             |
| SOUTHERN CO.                      |         | 1,647 | 1,767 | 10,874 | 1,203,873 | 電力                      |
| SOUTHWEST AIRLINES                |         | 198   | 249   | 1,541  | 170,665   | 旅客航空輸送業                 |
| SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A      |         | 146   | —     | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| SPLUNK INC                        |         | 237   | 270   | 3,562  | 394,420   | ソフトウェア                  |
| SPRINT CORP                       |         | 1,290 | —     | —      | —         | 無線通信サービス                |
| SQUARE INC - A                    |         | 531   | 636   | 13,535 | 1,498,569 | 情報技術サービス                |
| STANLEY BLACK & DECKER INC        |         | 239   | 259   | 5,190  | 574,653   | 機械                      |
| STARBUCKS CORP                    |         | 1,852 | 1,949 | 21,491 | 2,379,337 | ホテル・レストラン・レジャー          |
| STATE STREET CORP                 |         | 559   | 596   | 5,144  | 569,500   | 資本市場                    |
| STEEL DYNAMICS                    |         | 334   | 334   | 1,712  | 189,618   | 金属・鉱業                   |
| STRYKER CORP                      |         | 529   | 565   | 13,735 | 1,520,618 | ヘルスケア機器・用品              |
| SUNRUN INC                        |         | —     | 185   | 1,071  | 118,627   | 電気設備                    |
| SYNOPSYS INC                      |         | 239   | 255   | 6,109  | 676,415   | ソフトウェア                  |
| SYNCHRONY FINANCIAL               |         | 940   | 860   | 3,531  | 390,934   | 消費者金融                   |
| SYSCO CORP                        |         | 758   | 813   | 6,495  | 719,067   | 食品・生活必需品小売り             |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP        |         | 412   | —     | —      | —         | 資本市場                    |
| TJX COS INC                       |         | 1,898 | 2,003 | 13,323 | 1,475,095 | 専門小売り                   |
| T-MOBILE US INC                   |         | 530   | 931   | 11,603 | 1,284,677 | 無線通信サービス                |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC |         | 181   | 194   | 3,435  | 380,349   | 娯楽                      |
| TAPESTRY INC                      |         | 450   | —     | —      | —         | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| TARGET CORP                       |         | 788   | 836   | 16,690 | 1,847,831 | 複合小売り                   |
| TARGA RESOURCES CORP              |         | 348   | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TELADOC HEALTH INC                |         | —     | 193   | 3,372  | 373,367   | ヘルスケア・テクノロジー            |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC         |         | 57    | 58    | 2,349  | 260,126   | 航空宇宙・防衛                 |
| TELEFLEX INC                      |         | 71    | 75    | 3,135  | 347,165   | ヘルスケア機器・用品              |
| 10X GENOMICS INC-CLASS A          |         | —     | 100   | 1,682  | 186,236   | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| TERADYNE INC                      |         | 250   | 272   | 3,154  | 349,191   | 半導体・半導体製造装置             |
| TESLA INC                         |         | 212   | 1,256 | 79,872 | 8,842,630 | 自動車                     |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR        |         | 1,670 | 1,730 | 1,960  | 217,001   | 医薬品                     |

| 銘柄                           | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|------------------------------|-------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                              |       | 株 数     | 評 価 額  |           |                         |
|                              |       |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                         |
| (アメリカ)                       | 百株    | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                         |
| TEXAS INSTRUMENTS INC        | 1,465 | 1,521   | 28,281 | 3,131,041 | 半導体・半導体製造装置             |
| TEXTRON INC                  | 335   | 379     | 2,095  | 231,991   | 航空宇宙・防衛                 |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A  | —     | 68      | 4,293  | 475,337   | ソフトウェア                  |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 628   | 655     | 29,571 | 3,273,836 | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| 3M CORP                      | 902   | 956     | 18,607 | 2,060,045 | コングロマリット                |
| TIFFANY & CO                 | 169   | —       | —      | —         | 専門小売り                   |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY       | 178   | 195     | 3,452  | 382,223   | 専門小売り                   |
| TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A | —     | 164     | 1,201  | 133,014   | 資本市場                    |
| TRANSDIGM GROUP INC          | 76    | 86      | 5,074  | 561,807   | 航空宇宙・防衛                 |
| TRUNSONIC                    | 290   | 311     | 2,788  | 308,741   | 専門サービス                  |
| TRAVELERS COS INC/THE        | 408   | 426     | 6,561  | 726,443   | 保険                      |
| TRIMBLE INC                  | 388   | 422     | 3,208  | 355,255   | 電子装置・機器・部品              |
| TRIPADVISOR INC              | 146   | —       | —      | —         | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRUIST FINANCIAL CORP        | 2,085 | 2,253   | 13,243 | 1,466,147 | 銀行                      |
| TWILIO INC - A               | 186   | 233     | 7,483  | 828,549   | 情報技術サービス                |
| TWITTER INC                  | 1,147 | 1,328   | 8,365  | 926,097   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TYLER TECHNOLOGIES INC       | 61    | 65      | 2,700  | 298,988   | ソフトウェア                  |
| TYSON FOODS INC-CL A         | 469   | 501     | 3,805  | 421,262   | 食品                      |
| UGI CORP                     | 309   | 360     | 1,495  | 165,600   | ガス                      |
| US BANCORP                   | 2,305 | 2,231   | 12,464 | 1,379,955 | 銀行                      |
| UBER TECHNOLOGIES INC        | 655   | 1,615   | 8,633  | 955,846   | 陸運・鉄道                   |
| ULTA BEAUTY INC              | 85    | 86      | 2,648  | 293,248   | 専門小売り                   |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A     | 240   | —       | —      | —         | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C     | 250   | —       | —      | —         | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| UNION PAC CORP               | 1,088 | 1,113   | 24,611 | 2,724,768 | 陸運・鉄道                   |
| UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | 92    | —       | —      | —         | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B   | 1,099 | 1,174   | 19,798 | 2,191,873 | 航空貨物・物流サービス             |
| UNITED RENTALS INC           | 112   | 122     | 4,065  | 450,054   | 商社・流通業                  |
| UNITED TECHNOLOGIES          | 1,286 | —       | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC       | 1,482 | 1,572   | 58,723 | 6,501,293 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B  | 118   | 130     | 1,770  | 196,008   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP                   | 312   | —       | —      | —         | 保険                      |
| V F CORP                     | 525   | 563     | 4,511  | 499,448   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| VAIL RESORTS INC             | 60    | 67      | 1,944  | 215,228   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| VALERO ENERGY CORP           | 628   | 665     | 4,773  | 528,459   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC   | 142   | 153     | 2,707  | 299,695   | ヘルスケア機器・用品              |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A    | 207   | 227     | 5,662  | 626,846   | ヘルスケア・テクノロジー            |
| VERISIGN INC                 | 162   | 176     | 3,429  | 379,703   | 情報技術サービス                |
| VERIZON COMMUNICATIONS       | 6,468 | 6,857   | 40,175 | 4,447,792 | 各種電気通信サービス              |
| VERISK ANALYTICS INC         | 242   | 260     | 4,574  | 506,465   | 専門サービス                  |
| VERTEX PHARMACEUTICALS       | 404   | 436     | 9,286  | 1,028,093 | バイオテクノロジー               |
| VIACOMCBS INC-CLASS B        | 880   | 951     | 4,432  | 490,734   | メディア                    |
| VIATRIS INC                  | —     | 2,007   | 2,840  | 314,441   | 医薬品                     |
| VISA INC-CLASS A SHARES      | 2,678 | 2,804   | 59,416 | 6,578,029 | 情報技術サービス                |
| VISTRA CORP                  | 590   | 700     | 1,246  | 138,022   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| VMWARE INC - CLASS A         | 130   | 142     | 2,132  | 236,110   | ソフトウェア                  |
| VOYA FINANCIAL INC           | 217   | 217     | 1,381  | 152,913   | 各種金融サービス                |
| VULCAN MATERIALS CO          | 208   | 223     | 3,840  | 425,207   | 建設資材                    |
| WABCO HOLDINGS INC           | 81    | —       | —      | —         | 機械                      |
| WEC ENERGY GROUP INC         | 498   | 536     | 5,005  | 554,181   | 総合公益事業                  |
| WABTEC CORP                  | 288   | 288     | 2,295  | 254,183   | 機械                      |
| WALMART INC                  | 2,225 | 2,348   | 31,871 | 3,528,521 | 食品・生活必需品小売り             |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 1,182 | 1,203   | 6,373  | 705,609   | 食品・生活必需品小売り             |
| WASTE CONNECTIONS INC        | 403   | 445     | 4,794  | 530,791   | 商業サービス・用品               |

| 銘柄                                 | 株数    | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                |        |
|------------------------------------|-------|---------|--------|-----------|----------------------|--------|
|                                    |       | 株 数     | 評 価 額  | 外貨建金額     |                      | 邦貨換算金額 |
|                                    |       |         | 株 数    |           |                      |        |
| (アメリカ)                             | 百株    | 百株      | 千米ドル   | 千円        |                      |        |
| WASTE MANAGEMENT INC               | 668   | 693     | 8,959  | 991,862   | 商業サービス・用品            |        |
| WATERS CORP                        | 103   | 105     | 2,966  | 328,405   | ライフサイエンス・ツール/サービス    |        |
| WAYFAIR INC - CLASS A              | 86    | 115     | 3,645  | 403,618   | インターネット販売・通信販売       |        |
| WELLS FARGO CO                     | 6,291 | 6,500   | 25,603 | 2,834,563 | 銀行                   |        |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES       | 118   | 124     | 3,451  | 382,106   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| WESTERN DIGITAL CORP               | 476   | 516     | 3,377  | 373,949   | コンピュータ・周辺機器          |        |
| WESTERN UNION CO                   | 660   | 660     | 1,639  | 181,502   | 情報技術サービス             |        |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP             | 50    | —       | —      | —         | 化学                   |        |
| WESTROCK CO                        | 387   | 432     | 2,299  | 254,533   | 容器・包装                |        |
| WHIRLPOOL CORP                     | 94    | 103     | 2,268  | 251,142   | 家庭用耐久財               |        |
| WILLIAMS COS                       | 1,910 | 1,980   | 4,688  | 519,079   | 石油・ガス・消耗燃料           |        |
| WORKDAY INC-CLASS A                | 254   | 291     | 7,077  | 783,604   | ソフトウェア               |        |
| WYNN RESORTS LTD                   | 155   | 171     | 2,145  | 237,494   | ホテル・レストラン・レジャー       |        |
| XPO LOGISTICS INC                  | 143   | 143     | 1,774  | 196,405   | 航空貨物・物流サービス          |        |
| XCEL ENERGY INC                    | 812   | 885     | 5,841  | 646,755   | 電力                   |        |
| XILINX INC                         | 399   | 412     | 4,956  | 548,718   | 半導体・半導体製造装置          |        |
| XYLEM INC                          | 278   | 303     | 3,177  | 351,821   | 機械                   |        |
| XEROX HOLDINGS CORP                | 289   | —       | —      | —         | コンピュータ・周辺機器          |        |
| YUM BRANDS INC                     | 471   | 508     | 5,576  | 617,353   | ホテル・レストラン・レジャー       |        |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A       | 84    | 89      | 4,225  | 467,859   | 電子装置・機器・部品           |        |
| ZENDESK INC                        | —     | 188     | 2,399  | 265,663   | ソフトウェア               |        |
| ZILLOW GROUP INC - A               | —     | 98      | 1,240  | 137,312   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |        |
| ZILLOW GROUP INC - C               | 202   | 246     | 3,044  | 337,056   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |        |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC         | 319   | 349     | 5,626  | 622,918   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| ZIONS BANCORP NA                   | 275   | —       | —      | —         | 銀行                   |        |
| ZOETIS INC                         | 740   | 794     | 12,468 | 1,380,440 | 医薬品                  |        |
| ZSCALER INC                        | —     | 119     | 1,972  | 218,419   | ソフトウェア               |        |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A        | —     | 323     | 10,116 | 1,119,946 | ソフトウェア               |        |
| ALLEGION PLC                       | 148   | 148     | 1,854  | 205,288   | 建設関連製品               |        |
| ALLERGAN PLC                       | 510   | —       | —      | —         | 医薬品                  |        |
| AMCOR PLC                          | 2,500 | 2,680   | 3,146  | 348,329   | 容器・包装                |        |
| AON PLC                            | —     | 375     | 8,703  | 963,550   | 保険                   |        |
| AON PLC                            | 369   | —       | —      | —         | 保険                   |        |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD             | 639   | 650     | 2,545  | 281,801   | 保険                   |        |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A         | 212   | 212     | 1,066  | 118,033   | 保険                   |        |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD         | 292   | 360     | 1,064  | 117,853   | 化学                   |        |
| ACCENTURE PLC-CL A                 | 995   | 1,050   | 29,247 | 3,238,018 | 情報技術サービス             |        |
| BUNGE LIMITED                      | 220   | 220     | 1,755  | 194,386   | 食品                   |        |
| CAPRI HOLDINGS LTD                 | 199   | —       | —      | —         | 繊維・アパレル・贅沢品          |        |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS        | 351   | 326     | 1,681  | 186,123   | 飲料                   |        |
| EATON CORP PLC                     | 645   | 654     | 9,133  | 1,011,199 | 電気設備                 |        |
| EVEREST RE GROUP LTD               | 62    | 62      | 1,576  | 174,545   | 保険                   |        |
| HORIZON THERAPEUTICS PLC           | —     | 359     | 3,127  | 346,297   | 医薬品                  |        |
| IHS MARKIT LTD                     | 593   | 638     | 6,182  | 684,504   | 専門サービス               |        |
| INVESCO LTD                        | 580   | 680     | 1,692  | 187,378   | 資本市場                 |        |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC           | 90    | 90      | 1,498  | 165,888   | 医薬品                  |        |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | 1,200 | 1,185   | 7,196  | 796,725   | 建設関連製品               |        |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A               | 240   | 240     | 609    | 67,435    | 各種電気通信サービス           |        |
| LIBERTY GLOBAL PLC-C               | 640   | 640     | 1,616  | 178,978   | 各種電気通信サービス           |        |
| LINDE PLC                          | 842   | 872     | 24,351 | 2,695,951 | 化学                   |        |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD       | 990   | 1,128   | 5,338  | 591,061   | 半導体・半導体製造装置          |        |
| MEDTRONIC PLC                      | 2,099 | 2,230   | 26,499 | 2,933,714 | ヘルスケア機器・用品           |        |
| APTIV PLC                          | 392   | 454     | 6,232  | 690,051   | 自動車部品                |        |
| NIELSEN HOLDINGS PLC               | 540   | —       | —      | —         | 専門サービス               |        |

| 銘柄                                     |         | 期首(前期末) | 当期      |           | 業種等         |                    |
|----------------------------------------|---------|---------|---------|-----------|-------------|--------------------|
|                                        |         | 株数      | 株数      | 評価額       |             |                    |
|                                        |         |         |         | 外貨建金額     |             | 邦貨換算金額             |
| (アメリカ)                                 |         | 百株      | 百株      | 千米ドル      | 千円          |                    |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN           |         | 330     | —       | —         | —           | ホテル・レストラン・レジャー     |
| NOVOCURE LTD                           |         | —       | 140     | 1,753     | 194,129     | ヘルスケア機器・用品         |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD             |         | 67      | 78      | 1,284     | 142,181     | 保険                 |
| ROYALTY PHARMA PLC-CL A                |         | —       | 289     | 1,260     | 139,595     | 医薬品                |
| SEAGATE TECHNOLOGY                     |         | 373     | 373     | 2,823     | 312,601     | コンピュータ・周辺機器        |
| PENTAIR PLC                            |         | 232     | 275     | 1,707     | 189,004     | 機械                 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING           |         | 245     | 245     | 1,419     | 157,101     | 電気設備               |
| STERIS PLC                             |         | 129     | 138     | 2,622     | 290,327     | ヘルスケア機器・用品         |
| TECHNIPPMC PLC                         |         | 610     | —       | —         | —           | エネルギー設備・サービス       |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC                 |         | 376     | 403     | 6,728     | 744,866     | 建設関連製品             |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC               |         | 202     | 218     | 5,064     | 560,675     | 保険                 |
| PERRIGO CO PLC                         |         | 196     | —       | —         | —           | 医薬品                |
| CHUBB LTD                              |         | 712     | 743     | 12,000    | 1,328,541   | 保険                 |
| GARMIN LTD                             |         | 205     | 242     | 3,163     | 350,249     | 家庭用耐久財             |
| TE CONNECTIVITY LTD                    |         | 524     | 554     | 7,062     | 781,877     | 電子装置・機器・部品         |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. |         | 189     | 187     | 2,139     | 236,901     | ソフトウェア             |
| CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL           |         | 55      | 71      | 904       | 100,102     | ソフトウェア             |
| WIX.COM LTD                            |         | 77      | 94      | 2,509     | 277,849     | 情報技術サービス           |
| AERCAP HOLDINGS NV                     |         | 170     | —       | —         | —           | 商社・流通業             |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A               |         | 421     | 452     | 4,747     | 525,579     | 化学                 |
| MYLAN NV                               |         | 770     | —       | —         | —           | 医薬品                |
| NXP SEMICONDUCTORS NV                  |         | 432     | 468     | 9,255     | 1,024,691   | 半導体・半導体製造装置        |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD            |         | 266     | 386     | 3,294     | 364,735     | ホテル・レストラン・レジャー     |
| FLEX LTD                               |         | 760     | —       | —         | —           | 電子装置・機器・部品         |
| 小計                                     | 株数・金額   | 465,696 | 519,005 | 5,756,681 | 637,322,181 |                    |
|                                        | 銘柄数<比率> | 608     | 593     | —         | <68.7%>     |                    |
| (カナダ)                                  |         |         |         | 千カナダドル    |             |                    |
| AGNICO EAGLE MINES LTD                 |         | 377     | 410     | 2,938     | 257,938     | 金属・鉱業              |
| AIR CANADA                             |         | 204     | 320     | 853       | 74,943      | 旅客航空輸送業            |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES            |         | 850     | 970     | 1,918     | 168,419     | 総合公益事業             |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B             |         | 1,342   | 1,450   | 5,955     | 522,743     | 食品・生活必需品小売り        |
| ALTAGAS LTD                            |         | 420     | 420     | 878       | 77,127      | ガス                 |
| ATCO LTD CL1                           |         | 130     | 130     | 545       | 47,848      | 総合公益事業             |
| AURORA CANNABIS INC                    |         | 2,000   | —       | —         | —           | 医薬品                |
| BCE INC                                |         | 227     | 256     | 1,474     | 129,436     | 各種電気通信サービス         |
| BALLARD POWER SYSTEMS INC              |         | —       | 370     | 1,064     | 93,408      | 電気設備               |
| BANK OF MONTREAL                       |         | 990     | 1,056   | 11,950    | 1,049,037   | 銀行                 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX            |         | 1,893   | 1,994   | 15,862    | 1,392,390   | 銀行                 |
| BARRICK GOLD                           |         | 2,770   | 2,990   | 7,367     | 646,706     | 金属・鉱業              |
| BAUSCH HEALTH COS INC                  |         | 510     | 510     | 2,000     | 175,624     | 医薬品                |
| BLACKBERRY LTD                         |         | 710     | 940     | 1,107     | 97,200      | ソフトウェア             |
| BOMBARDIER B SHEARS                    |         | 2,800   | —       | —         | —           | 航空宇宙・防衛            |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A           |         | 1,402   | 2,108   | 12,076    | 1,060,095   | 資本市場               |
| BROOKFIELD RENEWABLE COR-A             |         | —       | 187     | 1,094     | 96,069      | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| B2GOLD CORP                            |         | —       | 1,750   | 931       | 81,723      | 金属・鉱業              |
| CAE INC                                |         | 410     | 500     | 1,791     | 157,213     | 航空宇宙・防衛            |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B              |         | 247     | 247     | 1,721     | 151,077     | 容器・包装              |
| CGI INC                                |         | 384     | 372     | 3,869     | 339,701     | 情報技術サービス           |
| CI FINANCIAL CORP                      |         | 336     | —       | —         | —           | 資本市場               |
| CAMECO CORP                            |         | 560     | 720     | 1,460     | 128,172     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE     |         | 696     | 750     | 9,312     | 817,407     | 銀行                 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO               |         | 1,124   | 1,186   | 17,378    | 1,525,481   | 陸運・鉄道              |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD         |         | 1,870   | 1,990   | 7,709     | 676,718     | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD           |         | 213     | 221     | 10,326    | 906,474     | 陸運・鉄道              |



| 銘<br>柄                              | 期首(前期末) | 当 期 末 |        |           | 業 種 等              |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|--------------------|
|                                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |           |                    |
|                                     |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                    |
| (カナダ)                               | 百株      | 百株    | 千カナダドル | 千円        |                    |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A            | 86      | 102   | 1,811  | 158,970   | 複合小売り              |
| CANADIAN UTILITIES LTD A            | 203     | 203   | 689    | 60,514    | 総合公益事業             |
| CANOPY GROWTH CORP                  | 330     | 350   | 1,406  | 123,445   | 医薬品                |
| CENOVUS ENERGY INC                  | 1,560   | 2,160 | 2,075  | 182,210   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC          | 32      | 34    | 5,956  | 522,896   | ソフトウェア             |
| CRONOS GROUP INC                    | 250     | —     | —      | —         | 医薬品                |
| DOLLARAMA INC                       | 466     | 466   | 2,434  | 213,690   | 複合小売り              |
| EMERA INC                           | 379     | 425   | 2,374  | 208,431   | 電力                 |
| EMPIRE CO LTD A                     | 260     | 260   | 1,027  | 90,150    | 食品・生活必需品小売り        |
| ENBRIDGE INC                        | 3,178   | 3,330 | 15,397 | 1,351,629 | 石油・ガス・消耗燃料         |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD         | 41      | 41    | 2,301  | 202,055   | 保険                 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD          | 990     | 930   | 2,250  | 197,557   | 金属・鉱業              |
| FIRSTSERVICE CORP                   | —       | 60    | 1,106  | 97,151    | 不動産管理・開発           |
| FORTIS INC                          | 682     | —     | —      | —         | 電力                 |
| FORTIS INC                          | —       | 753   | 4,109  | 360,764   | 電力                 |
| FRANCO-NEVADA CORP                  | 293     | 323   | 5,048  | 443,184   | 金属・鉱業              |
| GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT      | —       | 300   | 1,294  | 113,631   | 商業サービス・用品          |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC               | 318     | 318   | 1,227  | 107,748   | 繊維・アパレル・贅沢品        |
| GREAT-WEST LIFE CO INC              | 420     | 420   | 1,411  | 123,875   | 保険                 |
| HUSKY ENERGY INC                    | 520     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| HYDRO ONE LTD                       | 490     | 550   | 1,625  | 142,664   | 電力                 |
| IGM FINANCIAL INC                   | 150     | 150   | 575    | 50,548    | 資本市場               |
| IA FINANCIAL CORP INC               | 183     | 183   | 1,267  | 111,241   | 保険                 |
| IMPERIAL OIL                        | 375     | 375   | 1,164  | 102,241   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| INTACT FINANCIAL CORP               | 215     | 245   | 3,773  | 331,258   | 保険                 |
| INTER PIPELINE LTD                  | 600     | 750   | 1,356  | 119,095   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| KEYERA CORP                         | 340     | 340   | 889    | 78,075    | 石油・ガス・消耗燃料         |
| KINROSS GOLD CORP                   | 1,980   | 2,170 | 1,768  | 155,243   | 金属・鉱業              |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD              | 441     | 427   | 1,720  | 151,052   | 金属・鉱業              |
| LOBLAW COMPANIES                    | 285     | 285   | 2,000  | 175,621   | 食品・生活必需品小売り        |
| LUNDIN MINING CORP                  | 950     | 1,180 | 1,522  | 133,618   | 金属・鉱業              |
| MAGNA INTERNATIONAL INC             | 451     | 482   | 5,398  | 473,913   | 自動車部品              |
| MANULIFE FINANCIAL CORP             | 3,030   | 3,260 | 8,883  | 779,793   | 保険                 |
| METHANEX CORP                       | 86      | —     | —      | —         | 化学                 |
| METRO INC                           | 396     | 435   | 2,522  | 221,430   | 食品・生活必需品小売り        |
| NATIONAL BANK OF CANADA             | 523     | 550   | 4,716  | 414,040   | 銀行                 |
| NORTHLAND POWER INC                 | —       | 300   | 1,344  | 118,055   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NUTRIEN LTD                         | 900     | 961   | 6,617  | 580,879   | 化学                 |
| ONEX CORPORATION                    | 132     | 132   | 1,037  | 91,085    | 各種金融サービス           |
| OPEN TEXT CORP                      | 417     | 470   | 2,812  | 246,879   | ソフトウェア             |
| OVINTIV INC                         | 410     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PAN AMERICAN SILVER CORP            | —       | 353   | 1,307  | 114,773   | 金属・鉱業              |
| PARKLAND FUEL CORP                  | 217     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PARKLAND CORP                       | —       | 217   | 832    | 73,088    | 石油・ガス・消耗燃料         |
| PEMBINA PIPELINE CORP               | 880     | 880   | 3,173  | 278,550   | 石油・ガス・消耗燃料         |
| POWER CORPORATION OF CANADA         | 869     | 970   | 3,218  | 282,516   | 保険                 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD              | 310     | —     | —      | —         | 石油・ガス・消耗燃料         |
| QUEBECOR INC-CL B                   | 270     | 270   | 935    | 82,075    | メディア               |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 433     | 494   | 4,096  | 359,612   | ホテル・レストラン・レジャー     |
| RITCHIE BROS. AUCTIONEERS           | —       | 183   | 1,344  | 117,988   | 商業サービス・用品          |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B          | 555     | 582   | 3,471  | 304,688   | 無線通信サービス           |
| ROYAL BANK OF CANADA                | 2,248   | 2,348 | 27,504 | 2,414,342 | 銀行                 |
| SSR MINING INC                      | —       | 340   | 592    | 52,050    | 金属・鉱業              |
| SAPUTO INC                          | 366     | 410   | 1,545  | 135,681   | 食品                 |



| 銘柄                           |  | 期首(前期末)   | 当 期 末   |        | 業 種 等     |                |
|------------------------------|--|-----------|---------|--------|-----------|----------------|
|                              |  | 株 数       | 株 数     | 評 価 額  |           |                |
|                              |  |           |         | 外貨建金額  |           | 邦貨換算金額         |
| (カナダ)                        |  | 百株        | 百株      | 千カナダドル | 千円        |                |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    |  | 770       | 770     | 2,562  | 224,941   | メディア           |
| SHOPIFY INC - CLASS A        |  | 163       | 182     | 24,159 | 2,120,762 | 情報技術サービス       |
| STARS GROUP INC/THE          |  | 380       | —       | —      | —         | ホテル・レストラン・レジャー |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       |  | 923       | 988     | 6,332  | 555,831   | 保険             |
| SUNCOR ENERGY INC            |  | 2,440     | 2,490   | 6,635  | 582,494   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TMX GROUP LTD                |  | —         | 95      | 1,228  | 107,874   | 資本市場           |
| TC ENERGY CORP               |  | 1,470     | 1,580   | 9,222  | 809,547   | 石油・ガス・消耗燃料     |
| TECK RESOURCES LTD-CLS B     |  | 820       | 790     | 1,926  | 169,135   | 金属・鉱業          |
| TELUS CORP                   |  | 586       | 586     | 1,481  | 130,037   | 各種電気通信サービス     |
| THOMSON REUTERS CORP         |  | 317       | 278     | 3,076  | 270,066   | 専門サービス         |
| TOROMONT INDUSTRIES LTD      |  | —         | 128     | 1,220  | 107,111   | 商社・流通業         |
| TORONTO DOMINION BANK        |  | 2,841     | 3,007   | 24,846 | 2,181,055 | 銀行             |
| WSP GLOBAL INC               |  | 157       | 198     | 2,356  | 206,896   | 建設・土木          |
| WEST FRASER TIMBER           |  | 84        | 140     | 1,169  | 102,651   | 紙製品・林産品        |
| WESTON(GEORGE)LTD            |  | 123       | 123     | 1,376  | 120,871   | 食品・生活必需品小売り    |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP |  | 716       | 761     | 3,622  | 317,970   | 金属・鉱業          |
| YAMANA GOLD INC              |  | —         | 1,640   | 877    | 77,018    | 金属・鉱業          |
| 小 計                          |  | 株 数 ・ 金 額 | 62,765  | 66,371 | 364,630   | 32,007,240     |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                |  |           | 84      | 87     | —         | <3.5%>         |
| (イギリス)                       |  |           |         | 千英ポンド  |           |                |
| ANTOFAGASTA PLC              |  | 590       | 620     | 1,048  | 159,600   | 金属・鉱業          |
| ASHTED GROUP PLC             |  | 687       | 735     | 3,174  | 483,248   | 商社・流通業         |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC     |  | 1,590     | 1,590   | 1,203  | 183,277   | 家庭用耐久財         |
| AVIVA PLC                    |  | 6,040     | 6,700   | 2,761  | 420,419   | 保険             |
| DIAGEO PLC                   |  | 3,681     | 3,901   | 11,820 | 1,799,363 | 飲料             |
| SCHRODERS PLC                |  | 197       | 197     | 678    | 103,313   | 資本市場           |
| DCC PLC                      |  | 160       | 160     | 1,009  | 153,691   | コングロマリット       |
| BAE SYSTEMS PLC              |  | 5,020     | 5,470   | 2,806  | 427,174   | 航空宇宙・防衛        |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC |  | 3,597     | 3,830   | 10,609 | 1,615,023 | タバコ            |
| HALMA PLC                    |  | 590       | 650     | 1,532  | 233,223   | 電子装置・機器・部品     |
| STANDARD CHARTERED PLC       |  | 4,140     | 4,430   | 2,275  | 346,361   | 銀行             |
| IMPERIAL BRANDS PLC          |  | 1,490     | 1,610   | 2,409  | 366,777   | タバコ            |
| HSBC HOLDINGS PLC            |  | 31,810    | 33,620  | 14,478 | 2,204,054 | 銀行             |
| LEGAL & GENERAL              |  | 9,400     | 10,100  | 2,884  | 439,116   | 保険             |
| MEGGITT PLC                  |  | 1,110     | —       | —      | —         | 航空宇宙・防衛        |
| MORRISON SUPERMARKETS        |  | 3,700     | 3,700   | 673    | 102,539   | 食品・生活必需品小売り    |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC |  | 541       | 620     | 1,501  | 228,500   | 食品             |
| PEARSON                      |  | 1,260     | 1,260   | 976    | 148,652   | メディア           |
| PERSIMMON PLC                |  | 480       | 526     | 1,565  | 238,297   | 家庭用耐久財         |
| PRUDENTIAL PLC               |  | 4,100     | 4,280   | 6,751  | 1,027,811 | 保険             |
| RIO TINTO PLC-REG            |  | 1,749     | 1,850   | 10,319 | 1,570,907 | 金属・鉱業          |
| ST JAMES S PLACE PLC         |  | 810       | 950     | 1,214  | 184,894   | 資本市場           |
| SSE PLC                      |  | 1,650     | 1,770   | 2,539  | 386,521   | 電力             |
| BP PLC                       |  | 31,780    | 33,390  | 10,067 | 1,532,512 | 石油・ガス・消耗燃料     |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     |  | 110,500   | 115,900 | 4,995  | 760,432   | 銀行             |
| TAYLOR WIMPEY PLC            |  | 5,000     | 6,200   | 1,134  | 172,767   | 家庭用耐久財         |
| TESCO PLC                    |  | 15,300    | —       | —      | —         | 食品・生活必需品小売り    |
| SMITH & NEPHEW PLC           |  | 1,370     | 1,500   | 2,064  | 314,316   | ヘルスケア機器・用品     |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          |  | 7,820     | 8,270   | 10,808 | 1,645,437 | 医薬品            |
| WEIR GROUP PLC               |  | 380       | —       | —      | —         | 機械             |
| ASTRAZENECA PLC              |  | 2,055     | 2,179   | 15,882 | 2,417,828 | 医薬品            |
| BT GROUP PLC                 |  | 12,900    | 15,300  | 2,351  | 357,985   | 各種電気通信サービス     |
| CARNIVAL PLC                 |  | 229       | —       | —      | —         | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC          |  | 3,100     | —       | —      | —         | 複合小売り          |

| 銘柄                                | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                   |
|-----------------------------------|--------|---------|--------|-----------|-------------------------|
|                                   |        | 株 数     | 評 価 額  |           |                         |
|                                   |        |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                         |
| (イギリス)                            | 百株     | 百株      | 千英ポンド  | 千円        |                         |
| BARCLAYS PLC                      | 27,400 | 29,200  | 5,522  | 840,749   | 銀行                      |
| INTERTEK GROUP PLC                | 256    | 256     | 1,433  | 218,236   | 専門サービス                  |
| BURBERRY GROUP PLC                | 660    | 660     | 1,277  | 194,513   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NEXT PLC                          | 198    | 219     | 1,758  | 267,640   | 複合小売り                   |
| KINGFISHER PLC                    | 3,080  | 3,490   | 1,140  | 173,623   | 専門小売り                   |
| ITV PLC                           | 5,000  | —       | —      | —         | メディア                    |
| SAINSBURY                         | 2,550  | 2,990   | 730    | 111,242   | 食品・生活必需品小売り             |
| G4S PLC                           | 2,190  | —       | —      | —         | 商業サービス・用品               |
| ADMIRAL GROUP PLC                 | 308    | 308     | 936    | 142,489   | 保険                      |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS         | 195    | 195     | 872    | 132,750   | 家庭用耐久財                  |
| CENTRICA PLC                      | 9,200  | —       | —      | —         | 総合公益事業                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS       | 6,560  | 6,760   | 9,774  | 1,488,042 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B           | 5,860  | 6,100   | 8,348  | 1,270,886 | 石油・ガス・消耗燃料              |
| BUNZLE                            | 500    | 550     | 1,266  | 192,738   | 商社・流通業                  |
| RENTOKIL INTIAL PLC               | 2,850  | 3,180   | 1,544  | 235,123   | 商業サービス・用品               |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC         | —      | 296     | 651    | 99,132    | 医薬品                     |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC   | 492    | 532     | 3,678  | 559,939   | 資本市場                    |
| UNILEVER PLC                      | 1,742  | 4,342   | 17,637 | 2,684,911 | パーソナル用品                 |
| TUI AG-DI                         | 700    | —       | —      | —         | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EXPERIAN PLC                      | 1,411  | 1,529   | 3,837  | 584,226   | 専門サービス                  |
| MONDI PLC                         | 750    | 840     | 1,606  | 244,621   | 紙製品・林産品                 |
| SEVERN TRENT PLC                  | 370    | 370     | 848    | 129,209   | 水道                      |
| WHITBREAD PLC                     | 211    | 316     | 1,090  | 166,079   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           | 520    | 520     | 808    | 123,093   | 資本市場                    |
| SMITHS GROUP PLC                  | 610    | 610     | 937    | 142,679   | コングロマリット                |
| ANGLO AMERICAN PLC                | 1,600  | 2,060   | 5,911  | 899,857   | 金属・鉱業                   |
| 3I GROUP PLC                      | 1,550  | 1,670   | 1,949  | 296,806   | 資本市場                    |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       | 1,102  | 1,190   | 7,725  | 1,176,049 | 家庭用品                    |
| RELX PLC                          | 3,000  | 3,240   | 5,900  | 898,163   | 専門サービス                  |
| FRESNILLO PLC                     | —      | 300     | 257    | 39,156    | 金属・鉱業                   |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        | 1,060  | 1,060   | 972    | 148,099   | 水道                      |
| OCADO GROUP PLC                   | 720    | 830     | 1,684  | 256,492   | インターネット販売・通信販売          |
| GLENCORE PLC                      | 17,000 | 16,800  | 4,805  | 731,562   | 金属・鉱業                   |
| ENTAIN PLC                        | 870    | 1,020   | 1,562  | 237,880   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          | 2,770  | 13,800  | 1,497  | 228,039   | 航空宇宙・防衛                 |
| EVRAZ PLC                         | 760    | 760     | 435    | 66,339    | 金属・鉱業                   |
| NMC HEALTH PLC                    | 133    | 133     | 3      | 485       | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EASYJET PLC                       | 210    | —       | —      | —         | 旅客航空輸送業                 |
| NATWEST GROUP PLC                 | 7,700  | 7,700   | 1,519  | 231,269   | 銀行                      |
| SAGE GROUP PLC (THE)              | 1,750  | 1,750   | 1,060  | 161,493   | ソフトウェア                  |
| WPP PLC                           | 2,000  | 2,000   | 1,894  | 288,445   | メディア                    |
| COCA-COLA HBC AG-DI               | 290    | 340     | 796    | 121,269   | 飲料                      |
| AVEVA GROUP PLC                   | 112    | 199     | 669    | 101,843   | ソフトウェア                  |
| COMPASS GROUP PLC                 | 2,510  | 2,920   | 4,311  | 656,321   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| NATIONAL GRID PLC                 | 5,480  | 5,910   | 5,064  | 771,025   | 総合公益事業                  |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC        | 3,660  | 3,660   | 1,063  | 161,911   | 資本市場                    |
| PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC        | —      | 890     | 658    | 100,258   | 保険                      |
| BHP GROUP PLC                     | 3,290  | 3,470   | 7,306  | 1,112,205 | 金属・鉱業                   |
| VODAFONE GROUP PLC                | 42,100 | 45,000  | 6,033  | 918,494   | 無線通信サービス                |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 258    | 288     | 1,442  | 219,649   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC     | 481    | —       | —      | —         | ソフトウェア                  |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           | 193    | 223     | 1,419  | 216,108   | 化学                      |
| FERGUSON PLC                      | 346    | 366     | 3,218  | 489,968   | 商社・流通業                  |
| M&G PLC                           | 3,780  | 4,400   | 921    | 140,258   | 各種金融サービス                |

| 銘柄                               |              | 期首(前期末) | 当 期 末   |         | 業 種 等      |                      |
|----------------------------------|--------------|---------|---------|---------|------------|----------------------|
|                                  |              | 株 数     | 株 数     | 評 価 額   |            |                      |
|                                  |              |         |         | 外貨建金額   |            | 邦貨換算金額               |
| (イギリス)                           |              | 百株      | 百株      | 千英ポンド   | 千円         |                      |
| RSA INSURANCE GROUP PLC          |              | 1,620   | 1,620   | 1,103   | 167,992    | 保険                   |
| TESCO PLC                        |              | —       | 13,026  | 2,994   | 455,890    | 食品・生活必需品小売り          |
| INFORMA PLC                      |              | 1,860   | 2,480   | 1,410   | 214,663    | メディア                 |
| AUTO TRADER GROUP PLC            |              | 1,410   | 1,710   | 950     | 144,734    | インタラクティブ・メディアおよびサービス |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC     |              | 116     | 116     | 1,333   | 202,986    | 機械                   |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP      |              | 2,190   | 2,190   | 690     | 105,082    | 保険                   |
| JD SPORTS FASHION PLC            |              | 760     | 930     | 776     | 118,214    | 専門小売り                |
| MELROSE INDUSTRIES PLC           |              | 7,300   | 8,500   | 1,459   | 222,236    | コングロマリット             |
| JOHNSON MATTHEY PLC              |              | 302     | 302     | 933     | 142,149    | 化学                   |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 468,722 | 487,424 | 278,981 | 42,469,387 |                      |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 93      | 86      | —       | <4.6%>     |                      |
| (スイス)                            |              |         |         | 千スイスフラン |            |                      |
| SGS SA-REG                       |              | 9       | 9       | 2,665   | 313,074    | 専門サービス               |
| BARRY CALLEBAUT AG               |              | 4       | 4       | 984     | 115,617    | 食品                   |
| SWISSCOM AG-REG                  |              | 40      | 44      | 2,258   | 265,298    | 各種電気通信サービス           |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC       |              | 1       | 1       | 1,470   | 172,753    | 食品                   |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG      |              | 0.17    | 0.16    | 1,406   | 165,181    | 食品                   |
| GIVAUDAN-REG                     |              | 14      | 15      | 5,607   | 658,647    | 化学                   |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG        |              | 235     | 251     | 10,322  | 1,212,344  | 保険                   |
| NOVARTIS AG-REG                  |              | 3,361   | 3,670   | 30,042  | 3,528,505  | 医薬品                  |
| ABB LTD                          |              | 2,850   | 3,030   | 8,641   | 1,014,951  | 電気設備                 |
| ROCHE HOLDINGS AG-BEARER         |              | —       | 53      | 1,691   | 198,697    | 医薬品                  |
| ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)    |              | 1,098   | 1,164   | 35,368  | 4,153,988  | 医薬品                  |
| ADECCO GROUP AG-REG              |              | 249     | 249     | 1,609   | 189,040    | 専門サービス               |
| LAFARGEHOLCIM LTD                |              | 774     | 884     | 4,955   | 582,047    | 建設資材                 |
| CLARIANT AG-REG                  |              | 320     | 320     | 618     | 72,668     | 化学                   |
| NESTLE SA-REG                    |              | 4,652   | 4,774   | 50,575  | 5,940,122  | 食品                   |
| BALOISE HOLDING AG               |              | 74      | 74      | 1,209   | 142,102    | 保険                   |
| TEMENOS AG-REG                   |              | 104     | 104     | 1,417   | 166,426    | ソフトウェア               |
| SONOVA HOLDING AG-REG            |              | 88      | 88      | 2,231   | 262,069    | ヘルスケア機器・用品           |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG         |              | 16      | 17      | 2,063   | 242,401    | ヘルスケア機器・用品           |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG       |              | 3,960   | 4,120   | 4,290   | 503,975    | 資本市場                 |
| THE SWATCH GROUP AG-B            |              | 47      | 47      | 1,306   | 153,460    | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| THE SWATCH GROUP AG-REG          |              | 74      | 74      | 398     | 46,846     | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| LONZA AG-REG                     |              | 115     | 121     | 6,438   | 756,183    | ライフサイエンス・ツール/サービス    |
| SWISS LIFE HOLDING AG            |              | 51      | 52      | 2,454   | 288,274    | 保険                   |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG        |              | 12      | 14      | 1,215   | 142,744    | 化学                   |
| SWISS PRIME SITE-REG             |              | 114     | 135     | 1,190   | 139,847    | 不動産管理・開発             |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES |              | 58      | —       | —       | —          | 各種金融サービス             |
| DUFREY AG-REG                    |              | 65      | —       | —       | —          | 専門小売り                |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG        |              | 29      | 31      | 3,868   | 454,412    | 資本市場                 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT      |              | 61      | 67      | 1,881   | 220,965    | 機械                   |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG         |              | 30      | 30      | 823     | 96,684     | 機械                   |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG       |              | 84      | 84      | 2,283   | 268,251    | 海運業                  |
| LOGITECH INTERNATIONAL-REG       |              | —       | 270     | 2,614   | 307,094    | コンピュータ・周辺機器          |
| GEBERIT AG-REG                   |              | 56      | 62      | 3,799   | 446,239    | 建設関連製品               |
| JULIUS BAER GROUP LTD            |              | 358     | 358     | 2,195   | 257,832    | 資本市場                 |
| SWISS RE LTD                     |              | 462     | 483     | 4,567   | 536,423    | 保険                   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A    |              | 815     | 857     | 7,934   | 931,860    | 繊維・アパレル・贅沢品          |
| SIKA AG-REG                      |              | 199     | 238     | 6,392   | 750,820    | 化学                   |
| ALCON INC                        |              | 659     | 827     | 5,507   | 646,893    | ヘルスケア機器・用品           |
| BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG     |              | —       | 54      | 505     | 59,427     | 銀行                   |
| UBS GROUP AG                     |              | 6,010   | 6,020   | 8,843   | 1,038,654  | 資本市場                 |

| 銘柄                                  |               | 期首(前期末) |        | 当 期 末       |            | 業 種 等          |
|-------------------------------------|---------------|---------|--------|-------------|------------|----------------|
|                                     |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額       |            |                |
|                                     |               |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額     |                |
| (スイス)                               |               | 百株      | 百株     | 千スイスフラン     | 千円         |                |
| VIFOR PHARMA AG                     |               | 67      | 76     | 983         | 115,460    | 医薬品            |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 27,221  | 28,779 | 234,638     | 27,558,293 |                |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 39      | 40     | —           | <3.0%>     |                |
| (スウェーデン)                            |               |         |        | 千スウェーデンクローナ |            |                |
| LUNDBERGS AB-B SHS                  |               | 126     | 126    | 6,002       | 76,173     | 各種金融サービス       |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB    |               | 2,510   | 2,670  | 29,757      | 377,618    | 銀行             |
| SWEDBANK AB                         |               | 1,370   | 1,480  | 22,999      | 291,859    | 銀行             |
| SWEDISH MATCH AB                    |               | 260     | 260    | 17,643      | 223,897    | タバコ            |
| SECURITAS AB-B SHS                  |               | 450     | 540    | 8,059       | 102,275    | 商業サービス・用品      |
| INVESTOR AB-B SHS                   |               | 715     | 767    | 53,429      | 678,016    | 各種金融サービス       |
| HENNES&MAURITZ AB-B                 |               | 1,270   | 1,300  | 26,442      | 335,548    | 専門小売り          |
| ERICSSON LM-B                       |               | 4,740   | 4,910  | 56,956      | 722,771    | 通信機器           |
| TELIA CO AB                         |               | 4,300   | 4,280  | 16,169      | 205,195    | 各種電気通信サービス     |
| SKANSKA AB-B SHS                    |               | 510     | 600    | 13,830      | 175,502    | 建設・土木          |
| LUNDIN ENERGY AB                    |               | 288     | 288    | 8,127       | 103,136    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| ALFA LAVAL AB                       |               | 510     | 510    | 13,739      | 174,352    | 機械             |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR |               | 158     | —      | —           | —          | 無線通信サービス       |
| FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS         |               | —       | 151    | 6,570       | 83,373     | 不動産管理・開発       |
| ICA GRUPPEN AB                      |               | 138     | 171    | 7,281       | 92,398     | 食品・生活必需品小売り    |
| HUSQVARNA AB-B SHS                  |               | 550     | 730    | 9,011       | 114,360    | 家庭用耐久財         |
| ELECTROLUX AB-B                     |               | 340     | 340    | 8,136       | 103,248    | 家庭用耐久財         |
| SKF AB-B SHARES                     |               | 580     | 600    | 14,844      | 188,370    | 機械             |
| VOLVO AB-B SHS                      |               | 2,340   | 2,330  | 51,819      | 657,585    | 機械             |
| SANDVIK AB                          |               | 1,780   | 1,840  | 44,086      | 559,456    | 機械             |
| INDUSTRIVARDEN AB-A SHS             |               | —       | 150    | 4,872       | 61,825     | 各種金融サービス       |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS             |               | 250     | 250    | 7,735       | 98,157     | 各種金融サービス       |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B              |               | —       | 1,000  | 16,190      | 205,451    | 紙製品・林産品        |
| HEXAGON AB-B SHS                    |               | 423     | 456    | 36,270      | 460,269    | 電子装置・機器・部品     |
| TELE 2 AB-B SHS                     |               | 780     | 780    | 9,090       | 115,363    | 無線通信サービス       |
| ATLAS COPCO AB-A                    |               | 1,045   | 1,129  | 60,266      | 764,775    | 機械             |
| ATLAS COPCO AB-B                    |               | 627     | 627    | 28,653      | 363,617    | 機械             |
| EPIROC AB - A                       |               | 1,030   | 1,130  | 22,068      | 280,054    | 機械             |
| EPIROC AB - B                       |               | 580     | 690    | 12,361      | 156,865    | 機械             |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B                 |               | 925     | 1,030  | 28,160      | 357,352    | 家庭用品           |
| EQT AB                              |               | —       | 420    | 11,915      | 151,206    | 資本市場           |
| BOLIDEN AB                          |               | 440     | 440    | 14,449      | 183,365    | 金属・鉱業          |
| EVOLUTION GAMING GROUP              |               | —       | 273    | 34,520      | 438,069    | ホテル・レストラン・レジャー |
| KINNEVIK AB - B                     |               | 390     | —      | —           | —          | 各種金融サービス       |
| KINNEVIK AB - B                     |               | —       | 390    | 16,440      | 208,629    | 各種金融サービス       |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A             |               | 2,430   | 2,670  | 25,583      | 324,660    | 銀行             |
| ASSA ABLOY AB-B                     |               | 1,590   | 1,700  | 42,534      | 539,756    | 建設関連製品         |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS            |               | —       | 510    | 13,708      | 173,964    | 建設関連製品         |
| NORDEA BANK ABP                     |               | 5,150   | 5,480  | 47,599      | 604,034    | 銀行             |
| INVESTMENT AB LATOUR-B SHS          |               | —       | 260    | 5,876       | 74,566     | コングロマリット       |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 38,595  | 43,278 | 853,201     | 10,827,128 |                |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 32      | 38     | —           | <1.2%>     |                |
| (ノルウェー)                             |               |         |        | 千ノルウェークローネ  |            |                |
| DNB ASA                             |               | 1,450   | 1,550  | 28,287      | 366,606    | 銀行             |
| TELENOR ASA                         |               | 1,160   | 1,160  | 17,469      | 226,406    | 各種電気通信サービス     |
| SCHIBSTED ASA-CL A                  |               | —       | 106    | 3,826       | 49,592     | メディア           |
| EQUINOR ASA                         |               | 1,580   | 1,600  | 26,976      | 349,608    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| YARA INTERNATIONAL ASA              |               | 262     | 296    | 13,237      | 171,553    | 化学             |
| MOWI ASA                            |               | 690     | 700    | 14,756      | 191,237    | 食品             |
| NORSK HYDRO                         |               | 2,180   | 2,180  | 11,645      | 150,926    | 金属・鉱業          |

| 銘柄                               |               | 期首(前期末) |       | 当 期 末      |           | 業 種 等                   |
|----------------------------------|---------------|---------|-------|------------|-----------|-------------------------|
|                                  |               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額      |           |                         |
|                                  |               |         |       | 外貨建金額      | 邦貨換算金額    |                         |
| (ノルウェー)                          |               | 百株      | 百株    | 千ノルウェークローネ | 千円        |                         |
| AKER AB ASA                      |               | 180     | —     | —          | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ORKLA ASA                        |               | 1,150   | 1,330 | 11,278     | 146,168   | 食品                      |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA        |               | 310     | 310   | 6,212      | 80,512    | 保険                      |
| ADEVINTA ASA                     |               | —       | 450   | 5,710      | 74,008    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| SCHIBSTED ASA-B SHS              |               | 129     | 181   | 5,654      | 73,281    | メディア                    |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 9,091   | 9,863 | 145,054    | 1,879,901 |                         |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 10      | 11    | —          | <0.2%>    |                         |
| (デンマーク)                          |               |         |       | 千デンマーククローネ |           |                         |
| CARLSBERG B                      |               | 162     | 168   | 16,574     | 289,231   | 飲料                      |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B           |               | 10      | 10    | 15,262     | 266,321   | 海運業                     |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A        |               | 6       | 5     | 7,683      | 134,071   | 海運業                     |
| GN STORE NORD A/S                |               | —       | 212   | 10,472     | 182,750   | ヘルスケア機器・用品              |
| DANSKE BANK AS                   |               | 970     | 1,090 | 13,134     | 229,197   | 銀行                      |
| GENMAB A/S                       |               | 100     | 110   | 22,330     | 389,660   | バイオテクノロジー               |
| ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS |               | —       | 11    | 2,947      | 51,439    | 建設関連製品                  |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S          |               | 298     | 332   | 41,334     | 721,278   | 電気設備                    |
| H LUNDBECK A/S                   |               | 105     | 105   | 2,283      | 39,851    | 医薬品                     |
| DSV PANALPINA A S                |               | 325     | 338   | 41,016     | 715,734   | 航空貨物・物流サービス             |
| PANDORA A/S                      |               | 160     | 160   | 10,854     | 189,409   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| CHR HANSEN HOLDING A/S           |               | 167     | 182   | 10,326     | 180,200   | 化学                      |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES           |               | 337     | 337   | 13,530     | 236,108   | 化学                      |
| COLOPLAST-B                      |               | 185     | 194   | 18,433     | 321,671   | ヘルスケア機器・用品              |
| AMBU A/S-B                       |               | —       | 290   | 8,146      | 142,149   | ヘルスケア機器・用品              |
| NOVO NORDISK A/S-B               |               | 2,772   | 2,842 | 122,404    | 2,135,966 | 医薬品                     |
| ISS A/S                          |               | 218     | —     | —          | —         | 商業サービス・用品               |
| TRYG A/S-NEW                     |               | —       | 326   | 4,893      | 85,389    | 保険                      |
| TRYG A/S                         |               | 199     | 280   | 4,194      | 73,192    | 保険                      |
| ORSTED A/S                       |               | 300     | 318   | 31,761     | 554,244   | 電力                      |
| DEMANT A/S                       |               | 160     | 160   | 4,248      | 74,127    | ヘルスケア機器・用品              |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額     | 6,474   | 7,472 | 401,833    | 7,011,995 |                         |
|                                  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 17      | 20    | —          | <0.8%>    |                         |
| (ユーロ…ドイツ)                        |               |         |       | 千ユーロ       |           |                         |
| ADIDAS AG                        |               | 281     | 313   | 8,294      | 1,076,626 | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| FRESENIUS SE & CO KGAA           |               | 642     | 673   | 2,563      | 332,736   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE     |               | 168     | 168   | 563        | 73,160    | 各種電気通信サービス              |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD           |               | 105     | 105   | 437        | 56,805    | 化学                      |
| HANNOVER RUECK SE                |               | 96      | 96    | 1,509      | 195,883   | 保険                      |
| GEA GROUP AG                     |               | 242     | 242   | 848        | 110,097   | 機械                      |
| CONTINENTAL AG                   |               | 175     | 189   | 2,144      | 278,317   | 自動車部品                   |
| DEUTSCHE POST AG-REG             |               | 1,534   | 1,659 | 7,730      | 1,003,476 | 航空貨物・物流サービス             |
| MERCK KGAA                       |               | 199     | 211   | 3,079      | 399,724   | 医薬品                     |
| RWE AG                           |               | 931     | 1,085 | 3,515      | 456,298   | 総合公益事業                  |
| SAP SE                           |               | 1,539   | 1,724 | 17,853     | 2,317,415 | ソフトウェア                  |
| E.ON SE                          |               | 3,550   | 3,800 | 3,708      | 481,303   | 総合公益事業                  |
| HENKEL AG & CO KGAA              |               | 163     | 180   | 1,518      | 197,075   | 家庭用品                    |
| PUMA SE                          |               | 126     | 163   | 1,341      | 174,167   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| BAYER AG-REG                     |               | 1,543   | 1,616 | 8,686      | 1,127,442 | 医薬品                     |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG       |               | 277     | 289   | 2,779      | 360,792   | 家庭用品                    |
| BASF SE                          |               | 1,445   | 1,512 | 10,868     | 1,410,699 | 化学                      |
| BEIERSDORF AG                    |               | 160     | 160   | 1,440      | 186,995   | パーソナル用品                 |
| HOCHTIEF AG                      |               | 38      | 38    | 286        | 37,140    | 建設・土木                   |
| HEIDELBERGCEMENT AG              |               | 226     | 249   | 1,951      | 253,261   | 建設資材                    |
| FRESENIUS MEDICAL CARE           |               | 333     | 366   | 2,307      | 299,482   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE-REG                   |               | 654     | 680   | 14,895     | 1,933,422 | 保険                      |

| 銘柄                                | 株数           | 期首(前期末) | 当 期 末  |           | 業 種 等                |        |
|-----------------------------------|--------------|---------|--------|-----------|----------------------|--------|
|                                   |              | 株 数     | 評 価 額  | 外貨建金額     |                      | 邦貨換算金額 |
|                                   |              |         |        |           |                      |        |
| (ユーロ…ドイツ)                         | 百株           | 百株      | 千ユーロ   | 千円        |                      |        |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG            | 420          | 560     | 640    | 83,191    | 旅客航空輸送業              |        |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG        | 228          | 229     | 6,068  | 787,691   | 保険                   |        |
| VOLKSWAGEN AG                     | 51           | 51      | 1,608  | 208,788   | 自動車                  |        |
| VOLKSWAGEN AG-PREF                | 289          | 312     | 7,505  | 974,169   | 自動車                  |        |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES      | 1,403        | 1,431   | 10,867 | 1,410,538 | 自動車                  |        |
| NEMETSCHKE SE                     | —            | 92      | 496    | 64,484    | ソフトウェア               |        |
| THYSSENKRUPP AG                   | 620          | —       | —      | —         | 金属・鉱業                |        |
| SIEMENS AG                        | 1,201        | 1,263   | 17,818 | 2,312,828 | コングロマリット             |        |
| DEUTSCHE BANK AG-REG              | 3,140        | 3,340   | 3,440  | 446,537   | 資本市場                 |        |
| BAYER MOTOREN WERK                | 521          | 559     | 4,963  | 644,316   | 自動車                  |        |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD      | 78           | 102     | 691    | 89,698    | 自動車                  |        |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG              | 5,180        | 5,580   | 9,550  | 1,239,612 | 各種電気通信サービス           |        |
| SARTORIUS AG-VORZUG               | 53           | 57      | 2,426  | 314,896   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG          | 1,990        | 2,188   | 7,775  | 1,009,202 | 半導体・半導体製造装置          |        |
| RATIONAL AG                       | —            | 8       | 568    | 73,743    | 機械                   |        |
| CARL ZEISS MEDITEC AG-BR          | 60           | 72      | 920    | 119,436   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| BECHTLE AG                        | —            | 44      | 696    | 90,465    | 情報技術サービス             |        |
| DEUTSCHE BOERSE AG                | 295          | 320     | 4,528  | 587,734   | 資本市場                 |        |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE      | 227          | 254     | 2,342  | 304,041   | 自動車                  |        |
| FRAPORT AG                        | 63           | —       | —      | —         | 運送インフラ               |        |
| WIRECARD AG                       | 180          | —       | —      | —         | 情報技術サービス             |        |
| LANXESS                           | 120          | 127     | 813    | 105,567   | 化学                   |        |
| MTU AERO ENGINES AG               | 84           | 92      | 1,851  | 240,384   | 航空宇宙・防衛              |        |
| DEUTSCHE WOHNEN SE                | 562          | 555     | 2,200  | 285,562   | 不動産管理・開発             |        |
| SYMRISE AG                        | 198          | 209     | 2,146  | 278,606   | 化学                   |        |
| BRENNTAG SE                       | 238          | 268     | 1,972  | 256,027   | 商社・流通業               |        |
| EVONIK INDUSTRIES AG              | 330          | 330     | 1,005  | 130,558   | 化学                   |        |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 1,500        | 1,500   | 374    | 48,558    | 各種電気通信サービス           |        |
| COMMERZBANK AG                    | 1,580        | 1,580   | 838    | 108,899   | 銀行                   |        |
| LEG IMMOBILIEN SE                 | —            | 125     | 1,408  | 182,855   | 不動産管理・開発             |        |
| KION GROUP AG                     | 99           | 110     | 918    | 119,221   | 機械                   |        |
| VONOVIA SE                        | 795          | 878     | 4,883  | 633,869   | 不動産管理・開発             |        |
| KNORR-BREMSE AG                   | 71           | 127     | 1,348  | 175,066   | 機械                   |        |
| SIEMENS HEALTHINEERS AG           | 239          | 460     | 2,096  | 272,149   | ヘルスケア機器・用品           |        |
| METRO AG                          | 250          | —       | —      | —         | 食品・生活必需品小売り          |        |
| TEAMVIEWER AG                     | —            | 252     | 898    | 116,577   | ソフトウェア               |        |
| SIEMENS ENERGY AG                 | —            | 660     | 2,002  | 259,916   | 電気設備                 |        |
| ZALANDO SE                        | 215          | 249     | 2,059  | 267,288   | インターネット販売・通信販売       |        |
| SCOUT24 AG                        | —            | 171     | 1,102  | 143,162   | インタラクティブ・メディアおよびサービス |        |
| COVESTRO AG                       | 269          | 305     | 1,775  | 230,407   | 化学                   |        |
| HELLOFRESH SE                     | —            | 240     | 1,466  | 190,338   | インターネット販売・通信販売       |        |
| QIAGEN N.V.                       | 354          | 394     | 1,609  | 208,962   | ライフサイエンス・ツール/サービス    |        |
| UNIPER SE                         | 311          | 311     | 965    | 125,301   | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者   |        |
| DELIVERY HERO SE                  | 179          | 221     | 2,418  | 313,966   | インターネット販売・通信販売       |        |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額    | 37,820  | 41,145 | 217,387   | 28,216,956           |        |
|                                   | 銘柄 数 < 比 率 > | 58      | 62     | —         | <3.0%>               |        |
| (ユーロ…イタリア)                        |              |         |        |           |                      |        |
| ASSICURAZIONI GENERALI            | 1,750        | 1,880   | 3,222  | 418,257   | 保険                   |        |
| INTESA SANPAOLO                   | 23,300       | 27,800  | 6,459  | 838,421   | 銀行                   |        |
| MEDIOBANCA S.P.A.                 | 880          | 1,070   | 1,032  | 133,997   | 銀行                   |        |
| ENEL SPA                          | 12,630       | 13,580  | 11,452 | 1,486,471 | 電力                   |        |
| ENI SPA                           | 4,030        | 4,110   | 4,279  | 555,457   | 石油・ガス・消耗燃料           |        |
| SNAM SPA                          | 3,200        | 3,500   | 1,653  | 214,565   | ガス                   |        |
| TENARIS SA                        | 710          | 710     | 685    | 89,006    | エネルギー設備・サービス         |        |

| 銘柄                                  |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |        | 業 種 等     |                         |
|-------------------------------------|---------------|---------|--------|--------|-----------|-------------------------|
|                                     |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額  |           |                         |
|                                     |               |         |        | 外貨建金額  |           | 邦貨換算金額                  |
| (ユーロ…イタリア)                          |               | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                         |
| TELECOM ITALIA SPA                  |               | 15,500  | 11,700 | 538    | 69,934    | 各種電気通信サービス              |
| TELECOM ITALIA-RNC                  |               | 8,800   | 8,800  | 431    | 55,992    | 各種電気通信サービス              |
| ATLANTIA SPA                        |               | 790     | 790    | 1,262  | 163,862   | 運送インフラ                  |
| TERNA SPA                           |               | 2,220   | 2,220  | 1,434  | 186,148   | 電力                      |
| RECORDATI SPA                       |               | 168     | 168    | 764    | 99,175    | 医薬品                     |
| LEONARDO SPA                        |               | 640     | —      | —      | —         | 航空宇宙・防衛                 |
| AMPLIFON SPA                        |               | —       | 203    | 649    | 84,265    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PRYSMIAN SPA                        |               | 370     | 430    | 1,168  | 151,646   | 電気設備                    |
| DIASORIN SPA                        |               | —       | 40     | 550    | 71,493    | ヘルスケア機器・用品              |
| FERRARI NV                          |               | 189     | 213    | 3,731  | 484,382   | 自動車                     |
| CNH INDUSTRIAL NV                   |               | 1,540   | 1,700  | 2,289  | 297,118   | 機械                      |
| MONCLER SPA                         |               | 281     | 321    | 1,579  | 205,037   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| NEXI SPA                            |               | —       | 740    | 1,082  | 140,572   | 情報技術サービス                |
| STELLANTIS NV                       |               | —       | 3,340  | 5,044  | 654,778   | 自動車                     |
| FINECOBANK BANCA FINECO SPA         |               | 910     | 1,010  | 1,414  | 183,537   | 銀行                      |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV        |               | 1,700   | —      | —      | —         | 自動車                     |
| UNICREDIT SPA                       |               | 3,130   | 3,610  | 3,299  | 428,327   | 銀行                      |
| EXOR NV                             |               | 172     | 172    | 1,228  | 159,404   | 各種金融サービス                |
| POSTE ITALIANE SPA                  |               | 770     | 880    | 955    | 123,990   | 保険                      |
| INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL        |               | —       | 550    | 516    | 66,999    | 各種電気通信サービス              |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA           |               | 910     | —      | —      | —         | 飲料                      |
| PIRELLI & C. SPA                    |               | 530     | —      | —      | —         | 自動車部品                   |
| 小 計                                 | 株 数 ・ 金 額     | 85,120  | 89,537 | 56,724 | 7,362,843 |                         |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 24      | 25     | —      | <0.8%>    |                         |
| (ユーロ…フランス)                          |               |         |        |        |           |                         |
| BOUYGUES                            |               | 348     | 400    | 1,377  | 178,812   | 建設・土木                   |
| AIRBUS SE                           |               | 918     | 968    | 9,457  | 1,227,565 | 航空宇宙・防衛                 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                |               | 820     | 870    | 1,875  | 243,468   | 総合公益事業                  |
| LOREAL-ORD                          |               | 394     | 420    | 13,767 | 1,787,034 | パーソナル用品                 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE |               | 435     | 460    | 26,381 | 3,424,253 | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| DASSAULT AVIATION SA                |               | 3       | 3      | 311    | 40,371    | 航空宇宙・防衛                 |
| THALES SA                           |               | 163     | 186    | 1,584  | 205,696   | 航空宇宙・防衛                 |
| CAPGEMINI SA                        |               | 245     | 273    | 3,958  | 513,813   | 情報技術サービス                |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA        |               | 83      | —      | —      | —         | 食品・生活必需品小売り             |
| INGENICO GROUP                      |               | 95      | —      | —      | —         | 電子装置・機器・部品              |
| PUBLICIS GROUPE                     |               | 321     | 380    | 2,020  | 262,305   | メディア                    |
| FAURECIA                            |               | 105     | 150    | 673    | 87,400    | 自動車部品                   |
| BOLLORE                             |               | 1,380   | 1,380  | 563    | 73,082    | 娯楽                      |
| MICHELIN (CGDE)                     |               | 267     | 287    | 3,709  | 481,489   | 自動車部品                   |
| PERNOD RICARD SA                    |               | 335     | 343    | 5,530  | 717,907   | 飲料                      |
| RENAULT SA                          |               | 281     | 337    | 1,268  | 164,669   | 自動車                     |
| REMY COINTREAU                      |               | 40      | 39     | 622    | 80,742    | 飲料                      |
| SEB SA                              |               | 38      | 41     | 630    | 81,872    | 家庭用耐久財                  |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               |               | 869     | 887    | 11,375 | 1,476,575 | 電気設備                    |
| VIVENDI SA                          |               | 1,300   | 1,400  | 3,907  | 507,180   | 娯楽                      |
| ORANGE SA                           |               | 3,120   | 3,250  | 3,432  | 445,473   | 各種電気通信サービス              |
| HERMES INTERNATIONAL                |               | 50      | 53     | 5,049  | 655,443   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| DASSAULT SYSTEMES SA                |               | 209     | 223    | 4,032  | 523,477   | ソフトウェア                  |
| KERING SA                           |               | 117     | 127    | 7,498  | 973,250   | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| CNP ASSURANCES                      |               | 280     | 280    | 461    | 59,894    | 保険                      |
| CARREFOUR SUPERMARCHE               |               | 950     | 950    | 1,457  | 189,219   | 食品・生活必需品小売り             |
| ATOS SE                             |               | 153     | 153    | 1,009  | 131,072   | 情報技術サービス                |
| SANOFI                              |               | 1,767   | 1,869  | 15,673 | 2,034,411 | 医薬品                     |
| ACCOR SA                            |               | 262     | 320    | 1,041  | 135,241   | ホテル・レストラン・レジャー          |

| 銘柄                         |              | 期首(前期末) | 当 期 末  |         | 業 種 等      |                         |
|----------------------------|--------------|---------|--------|---------|------------|-------------------------|
|                            |              | 株 数     | 株 数    | 評 価 額   |            |                         |
|                            |              |         |        | 外貨建金額   |            | 邦貨換算金額                  |
| (ユーロ…フランス)                 |              | 百株      | 百株     | 千ユーロ    | 千円         |                         |
| STMICROELECTRONICS NV      |              | 1,050   | 1,078  | 3,439   | 446,498    | 半導体・半導体製造装置             |
| SOCIETE GENERALE           |              | 1,270   | 1,290  | 2,910   | 377,832    | 銀行                      |
| TELEPERFORMANCE            |              | 90      | 96     | 2,966   | 385,038    | 専門サービス                  |
| EURAZEO SE                 |              | 59      | 59     | 389     | 50,495     | 各種金融サービス                |
| SODEXO                     |              | 132     | 138    | 1,139   | 147,884    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| AXA SA                     |              | 3,010   | 3,170  | 7,338   | 952,543    | 保険                      |
| PEUGEOT CITROEN            |              | 880     | —      | —       | —          | 自動車                     |
| JC DECAUX SA               |              | 150     | —      | —       | —          | メディア                    |
| ESSILORLUXOTTICA           |              | 439     | 478    | 6,596   | 856,212    | 繊維・アパレル・贅沢品             |
| CREDIT AGRICOLE SA         |              | 1,840   | 1,840  | 2,296   | 298,062    | 銀行                      |
| BNP PARIBAS                |              | 1,739   | 1,850  | 9,734   | 1,263,564  | 銀行                      |
| ORPEA                      |              | —       | 93     | 925     | 120,158    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) |              | 790     | 828    | 4,250   | 551,773    | 建設関連製品                  |
| WENDEL                     |              | 43      | 43     | 455     | 59,162     | 各種金融サービス                |
| ILIAD SA                   |              | 24      | 24     | 387     | 50,279     | 各種電気通信サービス              |
| SES FDR                    |              | 560     | 560    | 381     | 49,515     | メディア                    |
| SAFRAN SA                  |              | 508     | 538    | 6,270   | 813,896    | 航空宇宙・防衛                 |
| ENGIE                      |              | 2,900   | 3,080  | 3,706   | 481,140    | 総合公益事業                  |
| ALSTOM                     |              | 303     | 433    | 1,849   | 240,044    | 機械                      |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS    |              | 241     | —      | —       | —          | メディア                    |
| ELECTRICITE DE FRANCE      |              | 940     | 1,090  | 1,235   | 160,369    | 電力                      |
| IPSEN                      |              | 55      | 55     | 385     | 49,973     | 医薬品                     |
| ARKEMA                     |              | 99      | 116    | 1,205   | 156,515    | 化学                      |
| LEGRAND SA                 |              | 410     | 452    | 3,570   | 463,489    | 電気設備                    |
| EIFFAGE SA                 |              | 121     | 141    | 1,225   | 159,115    | 建設・土木                   |
| TOTAL SE                   |              | 3,762   | 4,159  | 16,739  | 2,172,848  | 石油・ガス・消耗燃料              |
| ADP                        |              | 47      | 47     | 479     | 62,226     | 運送インフラ                  |
| NATIXIS                    |              | 1,580   | 1,580  | 640     | 83,100     | 資本市場                    |
| UBISOFT ENTERTAINMENT      |              | 144     | 144    | 921     | 119,586    | 娯楽                      |
| SCOR SE                    |              | 232     | 232    | 689     | 89,497     | 保険                      |
| VINCI                      |              | 810     | 873    | 7,717   | 1,001,708  | 建設・土木                   |
| DANONE                     |              | 972     | 1,038  | 6,103   | 792,226    | 食品                      |
| AIR LIQUIDE SA             |              | 734     | 791    | 10,998  | 1,427,651  | 化学                      |
| BUREAU VERITAS SA          |              | 470     | 470    | 1,136   | 147,573    | 専門サービス                  |
| GETLINK                    |              | 720     | 720    | 952     | 123,642    | 運送インフラ                  |
| SUEZ                       |              | 520     | 520    | 936     | 121,492    | 総合公益事業                  |
| EDENRED                    |              | 382     | 424    | 1,892   | 245,622    | 情報技術サービス                |
| VALEO SA                   |              | 373     | 373    | 1,094   | 142,099    | 自動車部品                   |
| BIOMERIEUX                 |              | 69      | 69     | 735     | 95,473     | ヘルスケア機器・用品              |
| LA FRANCAISE DES JEUX SAEM |              | —       | 154    | 599     | 77,877     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| FAURECIA                   |              | —       | 56     | 253     | 32,854     | 自動車部品                   |
| WORLDLINE SA               |              | 198     | 386    | 2,738   | 355,436    | 情報技術サービス                |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH   |              | 41      | 45     | 1,564   | 203,070    | ライフサイエンス・ツール/サービス       |
| AMUNDI SA                  |              | 100     | 100    | 702     | 91,184     | 資本市場                    |
| 小 計                        | 株 数 ・ 金 額    | 44,157  | 45,686 | 248,231 | 32,220,466 |                         |
|                            | 銘柄 数 < 比 率 > | 70      | 68     | —       | <3.5%>     |                         |
| (ユーロ…オランダ)                 |              |         |        |         |            |                         |
| ASM INTERNATIONAL NV       |              | —       | 78     | 1,866   | 242,276    | 半導体・半導体製造装置             |
| RANDSTAD NV                |              | 184     | 184    | 1,116   | 144,875    | 専門サービス                  |
| WOLTERS KLUWER             |              | 418     | 444    | 3,270   | 424,511    | 専門サービス                  |
| VOPAK                      |              | 114     | 114    | 483     | 62,784     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| AEGON NV                   |              | 2,930   | 2,930  | 1,214   | 157,602    | 保険                      |
| KONINKLIJKE KPN NV         |              | 5,600   | 5,600  | 1,624   | 210,795    | 各種電気通信サービス              |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV     |              | 1,426   | 1,527  | 7,384   | 958,517    | ヘルスケア機器・用品              |



| 銘柄                                    |              | 株数     | 期首(前期末) | 当 期 末   |            | 業 種 等          |
|---------------------------------------|--------------|--------|---------|---------|------------|----------------|
|                                       |              |        | 株数      | 評 価 額   |            |                |
|                                       |              |        |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額     |                |
| (ユーロ…オランダ)                            |              | 百株     | 百株      | 千ユーロ    | 千円         |                |
| HEINEKEN NV                           |              | 400    | 438     | 3,880   | 503,712    | 飲料             |
| HEINEKEN HOLDING NV                   |              | 172    | 200     | 1,536   | 199,372    | 飲料             |
| KONINKLIJKE DSM NV                    |              | 285    | 291     | 4,300   | 558,267    | 化学             |
| UNILEVER NV                           |              | 2,276  | —       | —       | —          | パーソナル用品        |
| ASML HOLDING NV                       |              | 666    | 703     | 36,342  | 4,717,237  | 半導体・半導体製造装置    |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV         |              | 1,706  | 1,860   | 4,454   | 578,220    | 食品・生活必需品小売り    |
| AKZO NOBEL                            |              | 324    | 312     | 2,984   | 387,400    | 化学             |
| PROSUS NV                             |              | 768    | 816     | 7,747   | 1,005,574  | インターネット販売・通信販売 |
| JDE PEET'S BV                         |              | —      | 110     | 347     | 45,047     | 食品             |
| DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV              |              | —      | 910     | 881     | 114,361    | 飲料             |
| NN GROUP NV                           |              | 470    | 470     | 1,988   | 258,116    | 保険             |
| ARGENX SE                             |              | —      | 76      | 1,779   | 231,033    | バイオテクノロジー      |
| ARCELOMITTAL                          |              | 990    | 1,190   | 2,905   | 377,118    | 金属・鉱業          |
| JUST EAT TAKEAWAY.COM NV              |              | 175    | 206     | 1,596   | 207,225    | インターネット販売・通信販売 |
| ABN AMRO BANK NV-CVA                  |              | 700    | 700     | 726     | 94,267     | 銀行             |
| ALTICE EUROPE N.V.                    |              | 990    | —       | —       | —          | 各種電気通信サービス     |
| ADYEN NV                              |              | 16     | 30      | 5,726   | 743,283    | 情報技術サービス       |
| ING GROEP NV                          |              | 6,170  | 6,390   | 6,694   | 868,902    | 銀行             |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額    | 26,781 | 25,580  | 100,851 | 13,090,504 |                |
|                                       | 銘柄 数 < 比 率 > | 21     | 23      | —       | <1.4%>     |                |
| (ユーロ…スペイン)                            |              |        |         |         |            |                |
| ENDESA S. A.                          |              | 500    | 500     | 1,142   | 148,296    | 電力             |
| BANKINTER S. A.                       |              | 910    | —       | —       | —          | 銀行             |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A. |              | 10,560 | 10,900  | 4,903   | 636,527    | 銀行             |
| NATURGY ENERGY GROUP SA               |              | 490    | 500     | 1,045   | 135,705    | ガス             |
| REPSOL SA                             |              | 2,204  | 2,448   | 2,613   | 339,172    | 石油・ガス・消耗燃料     |
| BANCO SANTANDER SA                    |              | 26,140 | 28,500  | 8,383   | 1,088,149  | 銀行             |
| TELEFONICA SA                         |              | 7,320  | 8,200   | 3,147   | 408,501    | 各種電気通信サービス     |
| ENAGAS SA                             |              | 390    | 390     | 720     | 93,549     | ガス             |
| SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA    |              | 380    | 380     | 1,188   | 154,285    | 電気設備           |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV          |              | 403    | 370     | 1,026   | 133,291    | 建設・土木          |
| FERROVIAL SA                          |              | 770    | 797     | 1,771   | 229,919    | 建設・土木          |
| MAPFRE SA                             |              | 1,630  | —       | —       | —          | 保険             |
| BANCO DE SABADELL SA                  |              | 8,019  | —       | —       | —          | 銀行             |
| CAIXABANK                             |              | 5,300  | 6,000   | 1,611   | 209,185    | 銀行             |
| IBERDROLA SA                          |              | 9,660  | 10,220  | 11,134  | 1,445,282  | 電力             |
| AMADEUS IT GROUP SA                   |              | 667    | 760     | 4,604   | 597,609    | 情報技術サービス       |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA          |              | 700    | 700     | 1,045   | 135,653    | 電力             |
| INDITEX SA                            |              | 1,680  | 1,840   | 5,216   | 677,088    | 専門小売り          |
| AENA SME SA                           |              | 107    | 117     | 1,609   | 208,967    | 運送インフラ         |
| CELLNEX TELECOM SA                    |              | 386    | 539     | 2,538   | 329,521    | 各種電気通信サービス     |
| GRIFOLS SA                            |              | 468    | 468     | 1,051   | 136,497    | バイオテクノロジー      |
| BANKIA SA                             |              | 1,510  | —       | —       | —          | 銀行             |
| 小 計                                   | 株 数 ・ 金 額    | 80,196 | 73,631  | 54,755  | 7,107,206  |                |
|                                       | 銘柄 数 < 比 率 > | 22     | 18      | —       | <0.8%>     |                |
| (ユーロ…ベルギー)                            |              |        |         |         |            |                |
| KBC GROEP NV                          |              | 382    | 409     | 2,596   | 337,003    | 銀行             |
| SOFINA SA                             |              | —      | 23      | 664     | 86,278     | 各種金融サービス       |
| SOLVAY SA                             |              | 114    | 116     | 1,260   | 163,667    | 化学             |
| UCB SA                                |              | 195    | 206     | 1,674   | 217,386    | 医薬品            |
| COLRUYT SA                            |              | 87     | 87      | 441     | 57,253     | 食品・生活必需品小売り    |
| GROUPE BRUXELLES LAM                  |              | 124    | 195     | 1,733   | 225,065    | 各種金融サービス       |
| PROXIMUS                              |              | 260    | 260     | 487     | 63,260     | 各種電気通信サービス     |
| GALAPAGOS NV                          |              | 70     | 70      | 452     | 58,713     | バイオテクノロジー      |

| 銘柄                               |              | 期首(前期末) | 当 期 末  |        | 業 種 等     |                   |
|----------------------------------|--------------|---------|--------|--------|-----------|-------------------|
|                                  |              | 株 数     | 株 数    | 評 価 額  |           |                   |
|                                  |              | 外貨建金額   | 邦貨換算金額 |        |           |                   |
| (ユーロ…ベルギー)                       |              | 百株      | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                   |
| ELIA GROUP SA/NV                 |              | —       | 48     | 444    | 57,631    | 電力                |
| TELENET GROUP HOLDING NV         |              | 67      | —      | —      | —         | メディア              |
| AGEAS                            |              | 289     | 289    | 1,502  | 194,988   | 保険                |
| UMICORE                          |              | 310     | 343    | 1,550  | 201,236   | 化学                |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV       |              | 1,201   | 1,277  | 7,004  | 909,163   | 飲料                |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 3,099   | 3,323  | 19,812 | 2,571,649 |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 11      | 12     | —      | <0.3%>    |                   |
| (ユーロ…オーストリア)                     |              |         |        |        |           |                   |
| OMV AG                           |              | 210     | 250    | 1,091  | 141,676   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| VERBUND AG                       |              | 110     | 110    | 666    | 86,524    | 電力                |
| VOESTALPINE AG                   |              | 200     | 200    | 710    | 92,261    | 金属・鉱業             |
| ERSTE GROUP BANK AG              |              | 480     | 490    | 1,433  | 186,035   | 銀行                |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG |              | 201     | 201    | 378    | 49,074    | 銀行                |
| ANDRITZ AG                       |              | 117     | —      | —      | —         | 機械                |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 1,318   | 1,251  | 4,280  | 555,573   |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 6       | 5      | —      | <0.1%>    |                   |
| (ユーロ…ルクセンブルグ)                    |              |         |        |        |           |                   |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE           |              | 17      | —      | —      | —         | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AROUNDTOWN SA                    |              | 1,850   | 1,730  | 1,057  | 137,292   | 不動産管理・開発          |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE           |              | —       | 216    | 1,752  | 227,518   | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 1,867   | 1,946  | 2,810  | 364,810   |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 2       | 2      | —      | <0.0%>    |                   |
| (ユーロ…フィンランド)                     |              |         |        |        |           |                   |
| KESKO OYJ-B SHS                  |              | —       | 440    | 1,134  | 147,234   | 食品・生活必需品小売り       |
| WARTSILA OYJ                     |              | 630     | 660    | 592    | 76,964    | 機械                |
| UPM-KYMMENE OYJ                  |              | 832     | 910    | 2,987  | 387,781   | 紙製品・林産品           |
| STORA ENSO OYJ-R                 |              | 850     | 960    | 1,612  | 209,341   | 紙製品・林産品           |
| SAMPO OYJ-A SHS                  |              | 682     | 804    | 3,118  | 404,809   | 保険                |
| FORTUM OYJ                       |              | 720     | 720    | 1,648  | 213,920   | 電力                |
| ELISA OYJ                        |              | 221     | 221    | 1,141  | 148,190   | 各種電気通信サービス        |
| METSO OYJ                        |              | 162     | —      | —      | —         | 機械                |
| NOKIA OYJ                        |              | 8,800   | 9,230  | 3,150  | 408,955   | 通信機器              |
| NESTE OYJ                        |              | 668     | 714    | 3,295  | 427,797   | 石油・ガス・消耗燃料        |
| NOKIAN RENKAAT OYJ               |              | 210     | —      | —      | —         | 自動車部品             |
| KONE OYJ                         |              | 540     | 574    | 4,006  | 520,046   | 機械                |
| ORION OYJ                        |              | 165     | 165    | 561    | 72,924    | 医薬品               |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 14,480  | 15,398 | 23,250 | 3,017,967 |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 12      | 11     | —      | <0.3%>    |                   |
| (ユーロ…アイルランド)                     |              |         |        |        |           |                   |
| CRH PLC                          |              | 1,253   | 1,322  | 5,233  | 679,346   | 建設資材              |
| KINGSPAN GROUP PLC               |              | 245     | 264    | 1,842  | 239,185   | 建設関連製品            |
| KERRY GROUP PLC-A                |              | 244     | 259    | 2,807  | 364,421   | 食品                |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD   |              | 1,398   | 1,398  | —      | —         | 銀行                |
| SMURFIT KAPPA GROUP PLC          |              | 353     | 423    | 1,710  | 222,037   | 容器・包装             |
| BANK OF IRELAND GROUP PLC        |              | 1,330   | —      | —      | —         | 銀行                |
| AIB GROUP PLC                    |              | 1,250   | —      | —      | —         | 銀行                |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC        |              | 121     | 266    | 4,931  | 640,126   | ホテル・レストラン・レジャー    |
| 小 計                              | 株 数 ・ 金 額    | 6,194   | 3,932  | 16,526 | 2,145,117 |                   |
|                                  | 銘柄 数 < 比 率 > | 8       | 6      | —      | <0.2%>    |                   |
| (ユーロ…ポルトガル)                      |              |         |        |        |           |                   |
| ENERGIAS DE PORTUGAL             |              | 3,870   | 4,760  | 2,280  | 296,010   | 電力                |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS      |              | 810     | 810    | 805    | 104,507   | 石油・ガス・消耗燃料        |

| 銘柄                                     |              | 期首(前期末) | 当 期 末   |           | 業 種 等      |                |
|----------------------------------------|--------------|---------|---------|-----------|------------|----------------|
|                                        |              | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |            |                |
|                                        |              | 外貨建金額   | 邦貨換算金額  |           |            |                |
| (ユーロ…ポルトガル)                            |              | 百株      | 百株      | 千ユーロ      | 千円         |                |
| JERONIMO MARTINS                       |              | 380     | 380     | 523       | 67,968     | 食品・生活必需品小売り    |
| 小 計                                    | 株 数 ・ 金 額    | 5,060   | 5,950   | 3,609     | 468,486    |                |
|                                        | 銘柄 数 < 比 率 > | 3       | 3       | —         | <0.1%>     |                |
| ユ ー ロ 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 306,092 | 307,381 | 748,240   | 97,121,583 |                |
|                                        | 銘柄 数 < 比 率 > | 237     | 235     | —         | <10.5%>    |                |
| (香港)                                   |              |         |         | 千香港ドル     |            |                |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY                 |              | 480     | 480     | 4,800     | 68,352     | 半導体・半導体製造装置    |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD               |              | 3,100   | 3,600   | 7,326     | 104,322    | 不動産管理・開発       |
| BANK OF EAST ASIA                      |              | 2,200   | 2,200   | 3,679     | 52,394     | 銀行             |
| CLP HLDGS                              |              | 2,530   | 2,810   | 21,327    | 303,709    | 電力             |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD     |              | 1,887   | 1,983   | 91,931    | 1,309,109  | 資本市場           |
| MTR CORP                               |              | 2,430   | 2,720   | 12,131    | 172,748    | 陸運・鉄道          |
| HANG SENG BANK                         |              | 1,190   | 1,310   | 19,715    | 280,748    | 銀行             |
| HENDERSON LAND                         |              | 2,294   | 2,294   | 8,248     | 117,458    | 不動産管理・開発       |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD              |              | 2,250   | 2,250   | 10,316    | 146,903    | 電力             |
| HONG KONG & CHINA GAS                  |              | 15,603  | 17,403  | 21,545    | 306,811    | ガス             |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L           |              | 3,350   | 3,560   | 25,667    | 365,506    | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES                       |              | 1,140   | —       | —         | —          | 不動産管理・開発       |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD             |              | 5,690   | 6,100   | 17,354    | 247,128    | 銀行             |
| NWS HOLDINGS LTD                       |              | 2,205   | —       | —         | —          | コングロマリット       |
| PCCW LTD                               |              | 7,500   | 7,500   | 3,360     | 47,846     | 各種電気通信サービス     |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG               |              | 970     | —       | —         | —          | 繊維・アパレル・贅沢品    |
| NEW WORLD DEVELOPMENT                  |              | 9,396   | —       | —         | —          | 不動産管理・開発       |
| SINO LAND CO.LTD                       |              | 4,800   | 4,800   | 5,328     | 75,870     | 不動産管理・開発       |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES                |              | 2,480   | 2,220   | 27,084    | 385,676    | 不動産管理・開発       |
| SWIRE PACIFIC-A                        |              | 750     | 750     | 4,380     | 62,371     | 不動産管理・開発       |
| VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED |              | 1,300   | —       | —         | —          | 食品             |
| WHEELOCK & COMPANY LTD                 |              | 1,340   | —       | —         | —          | 不動産管理・開発       |
| TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED  |              | 2,120   | 2,330   | 30,453    | 433,652    | 機械             |
| XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD            |              | —       | 2,800   | 7,224     | 102,869    | 建設関連製品         |
| SJM HOLDINGS LIMITED                   |              | 2,700   | 2,700   | 2,770     | 39,447     | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD                         |              | 2,280   | 2,280   | 3,451     | 49,155     | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIA GROUP LTD                          |              | 18,930  | 19,980  | 191,907   | 2,732,768  | 保険             |
| HKT TRUST AND HKT LTD                  |              | 5,996   | 5,996   | 6,823     | 97,165     | 各種電気通信サービス     |
| SANDS CHINA LTD                        |              | 3,840   | 3,840   | 14,822    | 211,070    | ホテル・レストラン・レジャー |
| SWIRE PROPERTIES LTD                   |              | 1,730   | 1,730   | 4,221     | 60,109     | 不動産管理・開発       |
| WHARF REAL ESTATE INVESTMENT           |              | 1,830   | 2,790   | 12,680    | 180,571    | 不動産管理・開発       |
| ESR CAYMAN LTD                         |              | —       | 2,600   | 6,565     | 93,485     | 不動産管理・開発       |
| BUDWEISER BREWING CO APAC LT           |              | 2,160   | 2,900   | 6,800     | 96,839     | 飲料             |
| WH GROUP LIMITED                       |              | 14,600  | 16,100  | 11,624    | 165,528    | 食品             |
| NEW WORLD DEVELOPMENT                  |              | —       | 2,689   | 10,931    | 155,663    | 不動産管理・開発       |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD              |              | 4,250   | 4,600   | 28,637    | 407,797    | コングロマリット       |
| CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD         |              | 1,070   | 1,070   | 5,007     | 71,308     | 電力             |
| CK ASSET HOLDINGS LTD                  |              | 4,090   | 4,450   | 21,317    | 303,560    | 不動産管理・開発       |
| 小 計                                    | 株 数 ・ 金 額    | 140,483 | 140,837 | 649,434   | 9,247,951  |                |
|                                        | 銘柄 数 < 比 率 > | 35      | 32      | —         | <1.0%>     |                |
| (シンガポール)                               |              |         |         | 千シンガポールドル |            |                |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING             |              | 2,490   | 2,490   | 971       | 79,892     | 航空宇宙・防衛        |
| DBS GROUP HLDGS                        |              | 2,840   | 3,020   | 8,758     | 720,520    | 銀行             |
| CITY DEVELOPMENTS LTD                  |              | 700     | 700     | 558       | 45,956     | 不動産管理・開発       |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD             |              | 140     | —       | —         | —          | 販売             |
| SATS LTD                               |              | 1,150   | —       | —         | —          | 運送インフラ         |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD                 |              | 1,290   | 1,290   | 1,283     | 105,597    | 資本市場           |
| CAPITALAND LIMITED                     |              | 3,800   | 4,300   | 1,621     | 133,367    | 不動産管理・開発       |

| 銘柄                                   |              | 期首(前期末) |        | 当 期 末     |           | 業 種 等                   |
|--------------------------------------|--------------|---------|--------|-----------|-----------|-------------------------|
|                                      |              | 株 数     | 株 数    | 評 価       | 額         |                         |
|                                      |              |         |        | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |                         |
| (シンガポール)                             |              | 百株      | 百株     | 千シンガポールドル | 千円        |                         |
| COMFORTDELGRO CORP LTD               |              | 3,100   | —      | —         | —         | 陸運・鉄道                   |
| SINGAPORE AIRLINES LTD               |              | 770     | 2,400  | 1,346     | 110,768   | 旅客航空輸送業                 |
| UNITED OVERSEAS BANK                 |              | 2,000   | 1,900  | 4,926     | 405,319   | 銀行                      |
| UOL GROUP LIMITED                    |              | 650     | 870    | 695       | 57,188    | 不動産管理・開発                |
| VENTURE CORP LTD                     |              | 450     | 450    | 908       | 74,746    | 電子装置・機器・部品              |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS             |              | 2,400   | —      | —         | —         | メディア                    |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED |              | 12,900  | 14,000 | 3,444     | 283,337   | 各種電気通信サービス              |
| SEBMCORP INDUSTRIES LTD              |              | 1,400   | —      | —         | —         | 総合公益事業                  |
| OCBC-ORD                             |              | 5,240   | 5,590  | 6,635     | 545,888   | 銀行                      |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD             |              | 2,890   | 3,400  | 1,866     | 153,565   | 食品                      |
| KEPPEL CORP.                         |              | 2,320   | 2,320  | 1,238     | 101,922   | コングロマリット                |
| YANGZIJANG SHIPBUILDING              |              | 4,400   | —      | —         | —         | 機械                      |
| GENTING SINGAPORE LTD                |              | 8,700   | 11,300 | 1,056     | 86,922    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| 小 計                                  | 株 数 ・ 金 額    | 59,630  | 54,030 | 35,310    | 2,904,994 |                         |
|                                      | 銘柄 数 < 比 率 > | 20      | 14     | —         | <0.3%>    |                         |
| (オーストラリア)                            |              |         |        | 千豪ドル      |           |                         |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD               |              | 250     | 295    | 1,946     | 164,224   | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK         |              | 4,390   | 4,750  | 13,347    | 1,125,995 | 銀行                      |
| WESTPAC BANKING CORP                 |              | 5,630   | 5,940  | 14,469    | 1,220,675 | 銀行                      |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD           |              | 2,190   | 2,760  | 5,547     | 467,995   | 金属・鉱業                   |
| TELSTRA CORP LTD                     |              | 6,500   | 7,300  | 2,503     | 211,229   | 各種電気通信サービス              |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD        |              | 920     | —      | —         | —         | 銀行                      |
| COCA-COLA AMATIL LTD                 |              | 770     | 770    | 1,034     | 87,302    | 飲料                      |
| ASX LTD                              |              | 307     | 307    | 2,164     | 182,636   | 資本市場                    |
| BHP GROUP LIMITED                    |              | 4,580   | 4,860  | 21,826    | 1,841,263 | 金属・鉱業                   |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED             |              | 400     | —      | —         | —         | 石油・ガス・消耗燃料              |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD           |              | 971     | —      | —         | —         | 複合小売り                   |
| COMPUTERSHARE LTD                    |              | 760     | 760    | 1,127     | 95,144    | 情報技術サービス                |
| COMPUTERSHARE LTD-RIGHTS             |              | —       | 86     | 11        | 928       | 情報技術サービス                |
| CSL LIMITED                          |              | 712     | 758    | 19,909    | 1,679,576 | バイオテクノロジー               |
| REA GROUP LTD                        |              | 88      | 88     | 1,225     | 103,352   | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| TRANSURBAN GROUP                     |              | 4,340   | 4,620  | 5,996     | 505,886   | 運送インフラ                  |
| COCHLEAR LTD                         |              | 89      | 103    | 2,152     | 181,601   | ヘルスケア機器・用品              |
| ORIGIN ENERGY LTD                    |              | 2,650   | 2,650  | 1,221     | 103,058   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA       |              | 2,778   | 2,951  | 25,201    | 2,126,001 | 銀行                      |
| BORAL LTD                            |              | 2,000   | —      | —         | —         | 建設資材                    |
| RIO TINTO LTD                        |              | 575     | 607    | 6,652     | 561,223   | 金属・鉱業                   |
| APA GROUP                            |              | 1,800   | 2,050  | 2,045     | 172,592   | ガス                      |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD               |              | 880     | 990    | 3,327     | 280,698   | ホテル・レストラン・レジャー          |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD        |              | 3,610   | 4,300  | 1,990     | 167,952   | 保険                      |
| TPG TELECOM LTD                      |              | 520     | —      | —         | —         | 各種電気通信サービス              |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD       |              | 73      | —      | —         | —         | ホテル・レストラン・レジャー          |
| ORICA LTD                            |              | 590     | 590    | 823       | 69,482    | 化学                      |
| BLUESCOPE STEEL LTD                  |              | 880     | 900    | 1,730     | 146,001   | 金属・鉱業                   |
| WORLEY LTD                           |              | 470     | —      | —         | —         | エネルギー設備・サービス            |
| SUNCORP GROUP LTD                    |              | 1,903   | 2,220  | 2,164     | 182,597   | 保険                      |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK              |              | 4,560   | 5,410  | 14,017    | 1,182,500 | 銀行                      |
| NEWCREST MINING                      |              | 1,170   | 1,320  | 3,252     | 274,379   | 金属・鉱業                   |
| OIL SEARCH LTD                       |              | 2,040   | 3,500  | 1,442     | 121,647   | 石油・ガス・消耗燃料              |
| INCITEC PIVOT LTD                    |              | 2,330   | —      | —         | —         | 化学                      |
| AMP LIMITED                          |              | 5,300   | 5,300  | 681       | 57,453    | 各種金融サービス                |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED               |              | 1,080   | 1,700  | 850       | 71,706    | 旅客航空輸送業                 |
| QBE INSURANCE                        |              | 1,950   | 2,440  | 2,308     | 194,723   | 保険                      |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD          |              | —       | 1,940  | 1,891     | 159,566   | 金属・鉱業                   |

| 銘柄                                       |               | 期首(前期末) | 当 期 末   |             | 業 種 等      |                         |
|------------------------------------------|---------------|---------|---------|-------------|------------|-------------------------|
|                                          |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額       |            |                         |
|                                          |               |         |         | 外貨建金額       |            | 邦貨換算金額                  |
| (オーストラリア)                                |               | 百株      | 百株      | 千豪ドル        | 千円         |                         |
| CHALLENGER LIMITED                       |               | 800     | —       | —           | —          | 各種金融サービス                |
| SANTOS LTD.                              |               | 2,610   | 3,100   | 2,210       | 186,460    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| SONIC HEALTHCARE LTD                     |               | 690     | 780     | 2,746       | 231,684    | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| WASHINGTON H. SOUL PATTINSON             |               | 170     | 170     | 527         | 44,457     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TABCORP HOLDINGS                         |               | 3,400   | 3,709   | 1,713       | 144,559    | ホテル・レストラン・レジャー          |
| WESFARMERS LIMITED                       |               | 1,750   | 1,902   | 9,936       | 838,205    | 複合小売り                   |
| ALUMINA LTD                              |               | 3,500   | —       | —           | —          | 金属・鉱業                   |
| WOODSIDE PETROLEUM                       |               | 1,520   | 1,630   | 3,925       | 331,116    | 石油・ガス・消耗燃料              |
| WOOLWORTHS GROUP LTD                     |               | 1,970   | 2,120   | 8,533       | 719,843    | 食品・生活必需品小売り             |
| MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD             |               | 192     | 192     | 864         | 72,887     | 資本市場                    |
| SEEK LTD                                 |               | 480     | 600     | 1,677       | 141,522    | インタラクティブ・メディアおよびサービス    |
| BRAMBLES LTD                             |               | 2,510   | 2,470   | 2,573       | 217,120    | 商業サービス・用品               |
| MACQUARIE GROUP LIMITED                  |               | 530     | 568     | 8,551       | 721,430    | 資本市場                    |
| CROWN RESORTS LTD                        |               | 550     | 550     | 646         | 54,564     | ホテル・レストラン・レジャー          |
| EVOLUTION MINING LTD                     |               | —       | 2,720   | 1,136       | 95,913     | 金属・鉱業                   |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC              |               | 670     | 730     | 2,860       | 241,342    | 建設資材                    |
| TREASURY WINE ESTATES LTD                |               | 1,110   | 1,110   | 1,148       | 96,916     | 飲料                      |
| SYDNEY AIRPORT                           |               | 1,680   | 2,006   | 1,195       | 100,869    | 運送インフラ                  |
| AURIZON HOLDINGS LTD                     |               | 3,050   | 3,050   | 1,174       | 99,059     | 陸運・鉄道                   |
| XERO LIMITED                             |               | —       | 198     | 2,487       | 209,826    | ソフトウェア                  |
| AFTERPAY LTD                             |               | —       | 348     | 3,515       | 296,596    | 情報技術サービス                |
| AMPOL LTD                                |               | —       | 400     | 986         | 83,178     | 石油・ガス・消耗燃料              |
| TPG TELECOM LTD                          |               | —       | 520     | 327         | 27,636     | 各種電気通信サービス              |
| AUSNET SERVICES                          |               | 3,300   | 3,300   | 598         | 50,527     | 電力                      |
| MEDIBANK PRIVATE LTD                     |               | 4,500   | 4,500   | 1,264       | 106,673    | 保険                      |
| AGL ENERGY LTD                           |               | 1,050   | 1,050   | 1,030       | 86,895     | 総合公益事業                  |
| SOUTH32 LTD                              |               | 7,800   | 7,800   | 2,184       | 184,242    | 金属・鉱業                   |
| CIMIC GROUP LTD                          |               | 180     | 180     | 313         | 26,421     | 建設・土木                   |
| COLES GROUP LTD                          |               | 1,760   | 2,270   | 3,570       | 301,225    | 食品・生活必需品小売り             |
| WISETECH GLOBAL LTD                      |               | 210     | 210     | 591         | 49,869     | ソフトウェア                  |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 116,038 | 120,448 | 231,157     | 19,500,444 |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 61      | 58      | —           | <2.1%>     |                         |
| (ニュージーランド)                               |               |         |         | 千ニュージーランドドル |            |                         |
| RYMAN HEALTHCARE LTD                     |               | 580     | 740     | 1,115       | 86,349     | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| A2 MILK CO LTD                           |               | 1,170   | 1,170   | 999         | 77,316     | 食品                      |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L |               | 860     | 930     | 2,982       | 230,786    | ヘルスケア機器・用品              |
| FLETCHER BUILDING LTD                    |               | 1,500   | —       | —           | —          | 建設資材                    |
| SPARK NEW ZEALAND LTD                    |               | 3,070   | 3,070   | 1,399       | 108,325    | 各種電気通信サービス              |
| MERCURY NZ LTD                           |               | 1,000   | 1,000   | 620         | 47,975     | 電力                      |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD                |               | 1,520   | 2,230   | 1,710       | 132,351    | 運送インフラ                  |
| MERIDIAN ENERGY LTD                      |               | 2,010   | 2,010   | 1,074       | 83,132     | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者      |
| 小 計                                      | 株 数 ・ 金 額     | 11,710  | 11,150  | 9,902       | 766,238    |                         |
|                                          | 銘 柄 数 < 比 率 > | 8       | 7       | —           | <0.1%>     |                         |
| (イスラエル)                                  |               |         |         | 千新シェケル      |            |                         |
| BANK HAPOLIM BM                          |               | 1,830   | 1,830   | 4,758       | 157,918    | 銀行                      |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL                     |               | 2,380   | 2,380   | 5,236       | 173,782    | 銀行                      |
| ELBIT SYSTEMS LTD                        |               | 36      | 50      | 2,328       | 77,282     | 航空宇宙・防衛                 |
| ISRAEL DISCOUNT BANK-A                   |               | 1,720   | 1,720   | 2,385       | 79,179     | 銀行                      |
| ICL GROUP LTD                            |               | 1,250   | 1,250   | 2,475       | 82,145     | 化学                      |
| NICE LTD                                 |               | 95      | 106     | 7,689       | 255,205    | ソフトウェア                  |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD                 |               | 230     | 230     | 2,004       | 66,520     | 銀行                      |

| 銘柄            |              | 期首(前期末)   | 当 期 末     |        | 業 種 等       |
|---------------|--------------|-----------|-----------|--------|-------------|
|               |              | 株 数       | 株 数       | 評 価 額  |             |
|               |              |           |           | 外貨建金額  | 邦貨換算金額      |
| (イスラエル)       |              | 百株        | 百株        | 千新シェケル | 千円          |
| AZRIELI GROUP |              | 65        | 65        | 1,356  | 45,023      |
| 小 計           | 株 数 ・ 金 額    | 7,606     | 7,631     | 28,233 | 937,058     |
|               | 銘柄 数 < 比 率 > | 8         | 8         | —      | <0.1%>      |
| 合 計           | 株 数 ・ 金 額    | 1,720,128 | 1,803,673 | —      | 889,554,397 |
|               | 銘柄 数 < 比 率 > | 1,252     | 1,229     | —      | <95.9%>     |

\* 邦貨換算金額は、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。

\* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

| 銘 柄                            | 期首(前期末)       |           | 当 期 末     |           |            |
|--------------------------------|---------------|-----------|-----------|-----------|------------|
|                                | 口 数           | 口 数       | 評 価 額     |           | 比 率        |
|                                |               |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |            |
| (アメリカ)                         | 口             | 口         | 千米ドル      | 千円        | %          |
| AGNC INVESTMENT CORP           | 80,000        | 93,000    | 1,570     | 173,899   | 0.0        |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT   | 17,900        | 22,400    | 3,724     | 412,333   | 0.0        |
| AMERICAN TOWER CORP            | 69,400        | 73,700    | 17,477    | 1,934,984 | 0.2        |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT      | 214,000       | 238,000   | 2,075     | 229,763   | 0.0        |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC      | 21,900        | 22,700    | 4,253     | 470,882   | 0.0        |
| BOSTON PROPERTIES              | 24,700        | 25,000    | 2,575     | 285,105   | 0.0        |
| CAMDEN PROPERTY TRUST          | 14,500        | 16,000    | 1,777     | 196,762   | 0.0        |
| CROWN CASTLE INTL CORP         | 64,500        | 72,100    | 12,328    | 1,364,874 | 0.1        |
| DIGITAL REALTY TRUST INC       | 40,700        | 45,200    | 6,384     | 706,777   | 0.1        |
| DUKE REALTY CORP               | 56,600        | 62,200    | 2,642     | 292,524   | 0.0        |
| EQUINIX INC                    | 13,250        | 14,810    | 9,994     | 1,106,477 | 0.1        |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES    | 26,500        | 29,400    | 1,902     | 210,655   | 0.0        |
| EQUITY RESIDENTIAL             | 57,700        | 60,300    | 4,391     | 486,199   | 0.1        |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC       | 10,070        | 10,700    | 2,975     | 329,460   | 0.0        |
| EXTRA SPACE STORAGE INC        | 20,700        | 20,700    | 2,753     | 304,795   | 0.0        |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST      | 11,100        | —         | —         | —         | —          |
| HEALTHPEAK PROPERTIES INC      | 75,700        | 88,000    | 2,814     | 311,564   | 0.0        |
| HOST HOTELS & RESORTS INC      | 109,000       | 109,000   | 1,885     | 208,765   | 0.0        |
| INVITATION HOMES INC           | 85,000        | 92,000    | 2,967     | 328,476   | 0.0        |
| IRON MOUNTAIN INC              | 43,100        | 49,000    | 1,820     | 201,585   | 0.0        |
| KIMCO REALTY CORP              | 65,000        | —         | —         | —         | —          |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC   | 83,000        | 99,000    | 2,101     | 232,686   | 0.0        |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM     | 17,600        | 19,300    | 2,843     | 314,821   | 0.0        |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 27,900        | —         | —         | —         | —          |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS     | 32,200        | 36,500    | 1,355     | 150,079   | 0.0        |
| PROLOGIS INC                   | 114,500       | 122,700   | 13,099    | 1,450,240 | 0.2        |
| PUBLIC STORAGE                 | 24,500        | 26,500    | 6,546     | 724,740   | 0.1        |
| REALTY INCOME CORP             | 49,900        | 55,600    | 3,565     | 394,689   | 0.0        |
| REGENCY CENTERS CORP           | 26,200        | 26,200    | 1,495     | 165,537   | 0.0        |
| SBA COMMUNICATIONS CORP        | 17,770        | 18,100    | 4,999     | 553,543   | 0.1        |
| SL GREEN REALTY CORP           | 12,500        | —         | —         | —         | —          |
| SIMON PROPERTY GROUP INC       | 47,900        | 54,800    | 6,323     | 700,060   | 0.1        |
| SUN COMMUNITIES INC            | 14,300        | 17,800    | 2,666     | 295,240   | 0.0        |
| UDR INC                        | 46,300        | 46,100    | 2,046     | 226,605   | 0.0        |
| VENTAS INC                     | 56,800        | 63,900    | 3,496     | 387,109   | 0.0        |
| VEREIT INC                     | 160,000       | —         | —         | —         | —          |
| VEREIT INC                     | —             | 37,000    | 1,433     | 158,648   | 0.0        |
| VICI PROPERTIES INC            | 68,000        | 87,000    | 2,454     | 271,712   | 0.0        |
| VORNADO REALTY TRUST           | 27,000        | 27,000    | 1,257     | 139,205   | 0.0        |
| WP CAREY INC                   | 27,400        | 27,400    | 1,936     | 214,434   | 0.0        |
| WELLTOWER INC                  | 63,100        | 68,000    | 4,959     | 549,037   | 0.1        |
| WEYERHAEUSER CO                | 115,000       | 121,000   | 4,289     | 474,885   | 0.1        |
| 小 計                            | 口 数 ・ 金 額     | 2,153,190 | 2,098,110 | 153,185   | 16,959,169 |
|                                | 銘 柄 数 < 比 率 > | 41        | 37        | —         | <1.8%>     |
| (カナダ)                          |               |           | 千カナダドル    |           |            |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA   | 11,500        | 14,900    | 803       | 70,549    | 0.0        |

| 銘                                      |               | 柄 | 期首(前期末)   |           | 当 期 末     |            |     |
|----------------------------------------|---------------|---|-----------|-----------|-----------|------------|-----|
|                                        |               |   | 口 数       | 口 数       | 評 価 額     |            | 比 率 |
|                                        |               |   |           |           | 外貨建金額     | 邦貨換算金額     |     |
| (カナダ)                                  |               |   | 口         | 口         | 千カナダドル    | 千円         | %   |
| FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT   |               |   | 16,000    | —         | —         | —          | —   |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS           |               |   | 20,000    | —         | —         | —          | —   |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR            |               |   | 22,000    | 22,000    | 428       | 37,638     | 0.0 |
| SMARTCENTRES REAL ESTATE INV           |               |   | 11,000    | —         | —         | —          | —   |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     |   | 80,500    | 36,900    | 1,232     | 108,187    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 5         | 2         | —         | <0.0%>     |     |
| (イギリス)                                 |               |   |           |           | 千英ポンド     |            |     |
| BRITISH LAND                           |               |   | 128,000   | 128,000   | 668       | 101,713    | 0.0 |
| SEGRO PLC                              |               |   | 176,000   | 193,000   | 1,821     | 277,350    | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC              |               |   | 111,000   | 111,000   | 781       | 118,958    | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     |   | 415,000   | 432,000   | 3,271     | 498,023    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 3         | 3         | —         | <0.1%>     |     |
| (ユーロ…フランス)                             |               |   |           |           | 千ユーロ      |            |     |
| ICADE                                  |               |   | 5,200     | —         | —         | —          | —   |
| KLEPIERRE                              |               |   | 32,300    | 32,300    | 655       | 85,066     | 0.0 |
| GECINA SA                              |               |   | 7,100     | 7,100     | 836       | 108,562    | 0.0 |
| COVIVIO                                |               |   | 6,600     | 8,500     | 621       | 80,651     | 0.0 |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD              |               |   | 21,400    | 24,200    | 1,675     | 217,431    | 0.0 |
| ユ ー ロ 計                                | 口 数 ・ 金 額     |   | 72,600    | 72,100    | 3,788     | 491,711    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 5         | 4         | —         | <0.1%>     |     |
| (香港)                                   |               |   |           |           | 千香港ドル     |            |     |
| LINK REIT                              |               |   | 330,000   | 353,000   | 25,627    | 364,939    | 0.0 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS            |               |   | 370,000   | 470,000   | 3,647     | 51,936     | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     |   | 700,000   | 823,000   | 29,275    | 416,876    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 2         | 2         | —         | <0.0%>     |     |
| (シンガポール)                               |               |   |           |           | 千シンガポールドル |            |     |
| CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST |               |   | 390,000   | 706,779   | 1,540     | 126,759    | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT           |               |   | 440,800   | 539,240   | 1,655     | 136,195    | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST            |               |   | 439,972   | —         | —         | —          | —   |
| SUNTEC REIT                            |               |   | 300,000   | 300,000   | 474       | 38,995     | 0.0 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST              |               |   | —         | 427,980   | 834       | 68,659     | 0.0 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST             |               |   | 370,000   | 370,000   | 795       | 65,445     | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     |   | 1,940,772 | 2,343,999 | 5,300     | 436,056    |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 5         | 5         | —         | <0.0%>     |     |
| (オーストラリア)                              |               |   |           |           | 千豪ドル      |            |     |
| MIRVAC GROUP                           |               |   | 660,000   | 660,000   | 1,597     | 134,739    | 0.0 |
| GPT GROUP                              |               |   | 285,000   | 330,000   | 1,488     | 125,552    | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP                        |               |   | 88,000    | 111,000   | 1,428     | 120,514    | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP                  |               |   | 348,000   | 400,000   | 1,720     | 145,099    | 0.0 |
| DEXUS                                  |               |   | 171,000   | 171,000   | 1,633     | 137,764    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                          |               |   | 254,000   | 283,000   | 5,105     | 430,684    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                          |               |   | 870,000   | 820,000   | 2,304     | 194,382    | 0.0 |
| VICINITY CENTRES                       |               |   | 470,000   | 670,000   | 1,092     | 92,129     | 0.0 |
| 小 計                                    | 口 数 ・ 金 額     |   | 3,146,000 | 3,445,000 | 16,368    | 1,380,866  |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 8         | 8         | —         | <0.1%>     |     |
| 合 計                                    | 口 数 ・ 金 額     |   | 8,508,062 | 9,251,109 | —         | 20,290,891 |     |
|                                        | 銘 柄 数 < 比 率 > |   | 69        | 61        | —         | <2.2%>     |     |

\* 邦貨換算金額は、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。

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。



先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 |        |          | 当 期     | 末     |
|-------|--------|----------|---------|-------|
|       |        |          | 買 建 額   | 売 建 額 |
| 外 国   | 株式先物取引 | CAN60    | 百万円 625 | 百万円 — |
|       |        | EUR050   | 1,924   | —     |
|       |        | FT100    | 850     | —     |
|       |        | SPI200   | 410     | —     |
|       |        | SPEMINI  | 12,893  | —     |
|       |        | SWISSMKT | 542     | —     |
|       |        |          |         |       |

\* 単位未満は切り捨て。  
\* 邦貨換算金額は、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 (2021年3月31日現在)

| 項 目          | 当 期         | 末     |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 株式           | 889,554,397 | 95.9  |
| 投資証券         | 20,290,891  | 2.2   |
| コール・ローン等、その他 | 18,223,764  | 1.9   |
| 投資信託財産総額     | 928,069,052 | 100.0 |

\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 当期末における外貨建て純資産（924,695,878千円）の投資信託財産総額（928,069,052千円）に対する比率は99.6%です。  
\* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=110.71円、1カナダドル=87.78円、1英ポンド=152.23円、1スイスフラン=117.45円、1スウェーデンクローナ=12.69円、1ノルウェークローネ=12.96円、1デンマーククローネ=17.45円、1ユーロ=129.80円、1香港ドル=14.24円、1シンガポールドル=82.27円、1豪ドル=84.36円、1ニュージーランドドル=77.38円、1新シェケル=33.19円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年3月31日現在)

| 項 目             | 当 期 末            |
|-----------------|------------------|
|                 | 円                |
| (A) 資産          | 930,897,307,010  |
| コール・ローン等        | 11,360,420,610   |
| 株式(評価額)         | 889,554,397,361  |
| 投資証券(評価額)       | 20,290,891,015   |
| 未収入金            | 2,928,620,789    |
| 未収配当金           | 1,068,206,289    |
| 差入委託証拠金         | 5,694,770,946    |
| (B) 負債          | 3,249,055,909    |
| 未払金             | 2,860,485,021    |
| 未払解約金           | 385,126,122      |
| 未払利息            | 3,166            |
| その他未払費用         | 3,441,600        |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 927,648,251,101  |
| 元本              | 245,531,591,330  |
| 次期繰越損益金         | 682,116,659,771  |
| (D) 受益権総口数      | 245,531,591,330口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 37,781円          |

(注) 期首元本額は230,777,414,749円、期中追加設定元本額は55,380,942,946円、期中一部解約元本額は40,626,766,365円、1口当たり純資産額は3.7781円です。

## ○損益の状況 (2020年4月1日～2021年3月31日)

| 項 目                | 当 期              |
|--------------------|------------------|
|                    | 円                |
| (A) 配当等収益          | 13,052,106,182   |
| 受取配当金              | 13,036,907,012   |
| 受取利息               | 680,215          |
| その他収益金             | 20,299,141       |
| 支払利息               | △ 5,780,186      |
| (B) 有価証券売買損益       | 309,639,022,800  |
| 売買益                | 315,409,403,936  |
| 売買損                | △ 5,770,381,136  |
| (C) 先物取引等取引損益      | 4,156,399,219    |
| 取引益                | 4,706,021,361    |
| 取引損                | △ 549,622,142    |
| (D) 保管費用等          | △ 64,488,873     |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 326,783,039,328  |
| (F) 前期繰越損益金        | 325,246,401,340  |
| (G) 追加信託差損益金       | 115,522,734,190  |
| (H) 解約差損益金         | △ 85,435,515,087 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 682,116,659,771  |
| 次期繰越損益金(I)         | 682,116,659,771  |

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名                                         | 当期末<br>元本額     |
|-----------------------------------------------|----------------|
|                                               | 円              |
| 野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)       | 74,442,669,963 |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)                  | 45,981,765,212 |
| 野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI               | 26,522,667,082 |
| 野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用) | 13,216,423,125 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け)                            | 8,813,350,365  |
| マイバランス70(確定拠出年金向け)                            | 8,195,934,986  |
| のむらップ・ファンド(普通型)                               | 7,413,821,765  |
| 野村つみたて外国株投信                                   | 7,140,146,927  |
| のむらップ・ファンド(積極型)                               | 5,874,675,457  |
| 野村インデックスファンド・外国株式                             | 5,178,091,514  |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース)                            | 4,908,070,670  |
| 野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)           | 4,311,126,171  |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース)                            | 4,032,789,678  |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース)                            | 3,834,191,486  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)            | 2,627,138,869  |
| マイバランス30(確定拠出年金向け)                            | 2,466,653,600  |
| NET FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信 | 2,021,283,487  |
| 野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)                  | 1,908,713,316  |

| ファンド名                              | 当期末<br>元本額    |
|------------------------------------|---------------|
|                                    | 円             |
| マイバランスDC50                         | 1,903,591,578 |
| ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式             | 1,857,341,281 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)   | 1,678,880,730 |
| マイバランスDC70                         | 1,540,701,049 |
| マイ・ロード                             | 1,087,359,782 |
| 野村6資産均等バランス                        | 983,476,455   |
| マイバランスDC30                         | 858,222,247   |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)   | 842,367,196   |
| のむらップ・ファンド(保守型)                    | 819,498,259   |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース)               | 676,118,737   |
| のむらップ・ファンド(やや積極型)                  | 487,897,427   |
| 野村外国株式インデックスファンド                   | 477,100,665   |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け)              | 350,614,763   |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け)              | 289,956,615   |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け)              | 260,136,200   |
| 野村DC運用戦略ファンド                       | 253,010,969   |
| ノムラFoFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用) | 196,334,939   |
| 野村スリーゼロ先進国株式投信                     | 178,508,014   |

| ファンド名                               | 当期末         |
|-------------------------------------|-------------|
|                                     | 元本額         |
|                                     | 円           |
| グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用)   | 176,662,260 |
| のむらッ・ファンド (やや保守型)                   | 174,692,702 |
| マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)              | 139,042,389 |
| バランスセレクト70                          | 134,470,714 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス              | 129,529,492 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用) | 120,394,293 |
| バランスセレクト50                          | 115,756,756 |
| マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)              | 102,922,540 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)   | 81,695,228  |
| マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)              | 71,722,146  |
| マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)              | 57,114,645  |
| 野村資産設計ファンド2040                      | 50,195,153  |
| 世界6資産分散ファンド                         | 43,897,531  |
| バランスセレクト30                          | 39,135,026  |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用) | 34,314,793  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース              | 34,161,289  |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)            | 32,976,146  |
| 野村資産設計ファンド2030                      | 31,475,054  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)  | 30,559,867  |
| インデックス・ブレンド (タイプV)                  | 29,572,851  |
| 野村資産設計ファンド2035                      | 25,928,039  |
| 野村資産設計ファンド2025                      | 23,182,058  |
| 野村DC運用戦略ファンド (マイルド)                 | 20,090,323  |
| インデックス・ブレンド (タイプIII)                | 19,291,406  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース              | 13,989,553  |
| ネクストコア                              | 13,056,429  |
| 野村資産設計ファンド2015                      | 12,330,327  |
| 野村資産設計ファンド2020                      | 12,272,666  |

| ファンド名                                            | 当期末        |
|--------------------------------------------------|------------|
|                                                  | 元本額        |
|                                                  | 円          |
| 野村資産設計ファンド2050                                   | 12,050,256 |
| 野村外国株式インデックスファンド (適格機関投資家専用)                     | 10,025,453 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)                            | 9,925,325  |
| バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)                            | 9,896,292  |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)                  | 9,541,976  |
| 野村資産設計ファンド2045                                   | 7,896,295  |
| インデックス・ブレンド (タイプIV)                              | 7,664,466  |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース                         | 6,945,648  |
| マイターゲット2065 (確定拠出年金向け)                           | 6,582,277  |
| 野村資産設計ファンド2060                                   | 5,888,132  |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用)              | 5,574,893  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030                    | 5,432,214  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040                    | 4,681,040  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型                 | 4,139,055  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050                    | 3,987,021  |
| インデックス・ブレンド (タイプII)                              | 3,031,339  |
| インデックス・ブレンド (タイプI)                               | 2,325,239  |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060                    | 2,237,410  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型                 | 2,097,616  |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用)               | 1,908,206  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型 (適格機関投資家専用)                | 1,868,065  |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)                            | 1,615,748  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型                 | 1,598,417  |
| 野村VPIs用・ターゲット・リターン・8資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 1,285,977  |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型                 | 1,270,861  |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用)                | 1,019,172  |
| 多資産分散投資ファンド (バランス10) (確定拠出年金向け)                  | 40,682     |

## ○お知らせ

該当事項はございません。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|         |                                                                                                                                                                      |                             |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／海外／債券／インデックス型                                                                                                                                                  |                             |
| 信 託 期 間 | 信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。                                                                                                                                       |                             |
| 運 用 方 針 | 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  | FOFs用 外国債券<br>インデックス・ファンドP<br>(適格機関投資家専用)                                                                                                                            | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。  |
|         | 外国債券<br>インデックス<br>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。 |
| 組 入 制 限 | FOFs用 外国債券<br>インデックス・ファンドP<br>(適格機関投資家専用)                                                                                                                            | 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。   |
|         | 外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド                                                                                                                                            | 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。     |
| 分 配 方 針 | 毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。<br>(1) 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。<br>(2) 分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                             |

# FOFs用 外国債券インデックス・ ファンドP(適格機関投資家専用)

## 運 用 報 告 書 (全 体 版)

第32期（決算日 2021年 9月7日）  
第33期（決算日 2021年11月8日）  
第34期（決算日 2022年 1月7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。
- ・－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作成期の運用実績

| 作成期 | 決算期              | 基準価額       |         |          | ベンチマーク |          | 債組比       | 券入率       | 債先比      | 券物率      | 純資産総額         |
|-----|------------------|------------|---------|----------|--------|----------|-----------|-----------|----------|----------|---------------|
|     |                  | (分配落)      | 税込分配金   | 期中騰落率    |        | 期中騰落率    |           |           |          |          |               |
| 第8  | 第20期(2019年 9月9日) | 円<br>9,337 | 円<br>28 | %<br>0.7 | 9,951  | %<br>0.8 | %<br>98.4 | %<br>98.4 | %<br>0.6 | %<br>0.6 | 百万円<br>32,456 |
|     | 第21期(2019年11月7日) | 9,389      | 27      | 0.8      | 10,050 | 1.0      | 98.4      | 98.4      | 0.6      | 0.6      | 31,711        |
|     | 第22期(2020年 1月7日) | 9,382      | 24      | 0.2      | 10,050 | 0.0      | 98.1      | 98.1      | 0.8      | 0.8      | 30,957        |
| 第9  | 第23期(2020年 3月9日) | 9,286      | 30      | △0.7     | 10,329 | 2.8      | 98.4      | 98.4      | 0.8      | 0.8      | 30,384        |
|     | 第24期(2020年 5月7日) | 9,265      | 26      | 0.1      | 9,989  | △3.3     | 97.9      | 97.9      | 1.2      | 1.2      | 29,172        |
|     | 第25期(2020年 7月7日) | 9,651      | 28      | 4.5      | 10,477 | 4.9      | 98.0      | 98.0      | 1.1      | 1.1      | 30,347        |
| 第10 | 第26期(2020年 9月7日) | 9,802      | 28      | 1.9      | 10,638 | 1.5      | 98.4      | 98.4      | 0.8      | 0.8      | 30,965        |
|     | 第27期(2020年11月9日) | 9,577      | 24      | △2.1     | 10,433 | △1.9     | 98.3      | 98.3      | 0.9      | 0.9      | 30,480        |
|     | 第28期(2021年 1月7日) | 9,686      | 24      | 1.4      | 10,609 | 1.7      | 97.9      | 97.9      | 1.2      | 1.2      | 31,003        |
| 第11 | 第29期(2021年 3月8日) | 9,737      | 23      | 0.8      | 10,648 | 0.4      | 98.2      | 98.2      | 1.0      | 1.0      | 31,452        |
|     | 第30期(2021年 5月7日) | 9,822      | 21      | 1.1      | 10,793 | 1.4      | 98.1      | 98.1      | 1.2      | 1.2      | 31,903        |
|     | 第31期(2021年 7月7日) | 9,919      | 25      | 1.2      | 10,947 | 1.4      | 98.2      | 98.2      | 1.1      | 1.1      | 32,471        |
| 第12 | 第32期(2021年 9月7日) | 9,917      | 23      | 0.2      | 10,963 | 0.1      | 98.1      | 98.1      | 1.2      | 1.2      | 32,712        |
|     | 第33期(2021年11月8日) | 10,060     | 23      | 1.7      | 11,128 | 1.5      | 98.0      | 98.0      | 1.3      | 1.3      | 33,434        |
|     | 第34期(2022年 1月7日) | 9,946      | 20      | △0.9     | 11,021 | △1.0     | 97.7      | 97.7      | 1.6      | 1.6      | 33,674        |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

## 当作成期中の基準価額と市況の推移

| 決算期  | 年 月 日           | 基 準 価 額    |        | ベンチマーク |        | 債 券<br>組 入<br>率 | 債 券<br>先 物<br>比 率 |
|------|-----------------|------------|--------|--------|--------|-----------------|-------------------|
|      |                 |            | 騰落率    |        | 騰落率    |                 |                   |
| 第32期 | (期 首)2021年 7月7日 | 円<br>9,919 | %<br>— | 10,947 | %<br>— | %<br>98.2       | %<br>1.1          |
|      | 7月末             | 9,950      | 0.3    | 10,987 | 0.4    | 98.7            | 0.5               |
|      | 8月末             | 9,951      | 0.3    | 10,970 | 0.2    | 97.2            | 1.9               |
|      | (期 末)2021年 9月7日 | 9,940      | 0.2    | 10,963 | 0.1    | 98.1            | 1.2               |
| 第33期 | (期 首)2021年 9月7日 | 9,917      | —      | 10,963 | —      | 98.1            | 1.2               |
|      | 9月末             | 9,857      | △0.6   | 10,898 | △0.6   | 97.6            | 1.6               |
|      | 10月末            | 10,059     | 1.4    | 11,099 | 1.2    | 98.2            | 1.0               |
|      | (期 末)2021年11月8日 | 10,083     | 1.7    | 11,128 | 1.5    | 98.0            | 1.3               |
| 第34期 | (期 首)2021年11月8日 | 10,060     | —      | 11,128 | —      | 98.0            | 1.3               |
|      | 11月末            | 9,932      | △1.3   | 10,980 | △1.3   | 96.9            | 2.3               |
|      | 12月末            | 9,990      | △0.7   | 11,065 | △0.6   | 97.4            | 2.1               |
|      | (期 末)2022年 1月7日 | 9,966      | △0.9   | 11,021 | △1.0   | 97.7            | 1.6               |

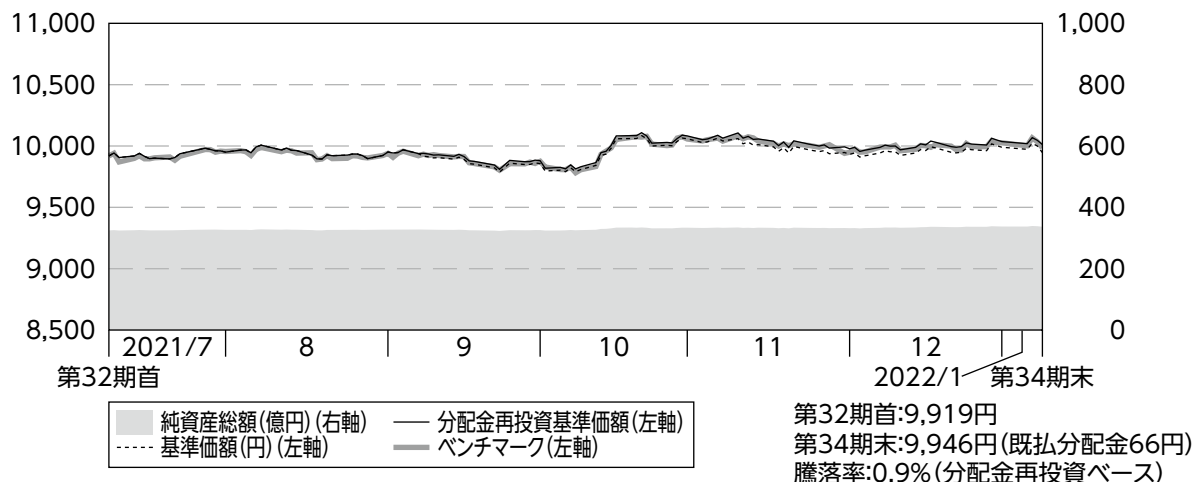
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当作成期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



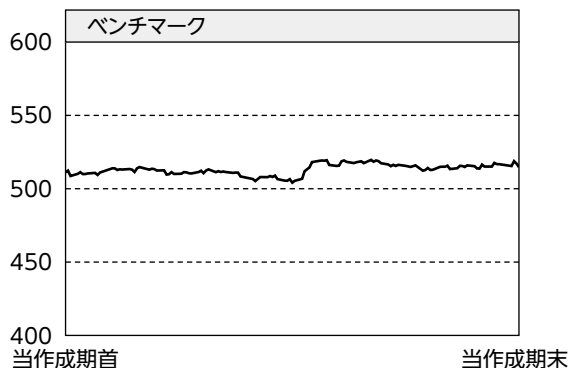
- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2021年7月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

2021年8月上旬にかけて、FRB(米連邦準備理事会)が量的金融緩和の早期縮小に慎重な姿勢を維持したことやECB(欧州中央銀行)が金融緩和姿勢の継続を示したことなどから主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額(分配金再投資ベース)は緩やかな上昇となりました。8月中旬から10月上旬にかけては、米国ではFOMC(米連邦公開市場委員会)で年内の量的金融緩和の縮小開始が強く示唆されたこと、またユーロ圏ではECBが新型コロナウイルス感染拡大対応の金融緩和策を縮小するとの観測が高まったことなどから主要国の長期金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬には、米国の債務上限問題が先送りとなりリスク回避姿勢が和らいだほか、エネルギー価格高騰による日本の貿易収支悪化への懸念が高まったことなどから、外国為替市場で主要通貨に対して円安の動きが加速し、基準価額は上昇しました。10月下旬以降は、主要国の長期金利や米ドル/円相場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。



## 投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2021年8月上旬にかけて、FRBやECBが金融緩和姿勢の継続を示したことから低下しました。8月中旬から10月中旬にかけては、主要中央銀行が新型コロナウイルス感染拡大対応の金融緩和策を縮小するとの観測が高まったことなどから上昇しました。その後は、レンジ内推移となりました。

外国為替市場では、2021年8月上旬にかけて、円は対米ドルでもみ合い推移、対ユーロや英ポンドで円高となりました。8月中旬以降10月中旬にかけては、円安が進行しました。その後は、円は対米ドルでもみ合い推移、対ユーロや英ポンドでは11月に円高となった後、当作成期末にかけて円安となりました。

## 当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

### 【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

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。

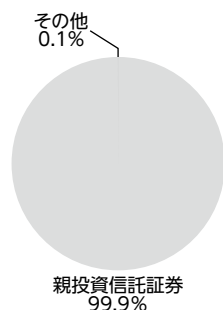
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

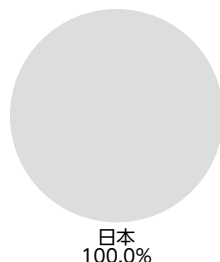
|                    | 当作成期末     |
|--------------------|-----------|
|                    | 2022年1月7日 |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 99.9%     |
| その他                | 0.1%      |
| 組入ファンド数            | 1         |

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

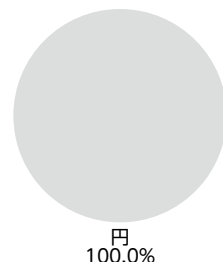
### ○資産別配分



### ○国別配分



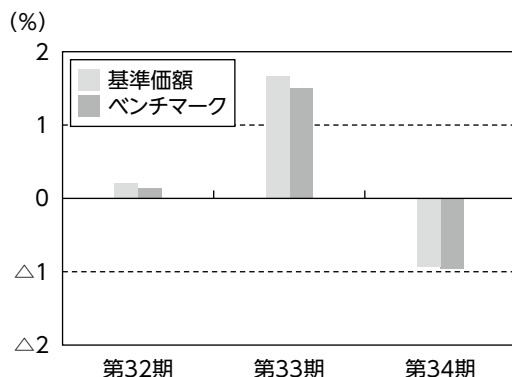
### ○通貨別配分



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

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)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、信託報酬および為替評価差要因\*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。

## 分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通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32期                    | 第33期                     | 第34期                     |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 2021年7月8日～<br>2021年9月7日 | 2021年9月8日～<br>2021年11月8日 | 2021年11月9日～<br>2022年1月7日 |
| 当期分配金 (円)     | 23                      | 23                       | 20                       |
| (対基準価額比率) (%) | (0.231)                 | (0.228)                  | (0.201)                  |
| 当期の収益 (円)     | 23                      | 23                       | 20                       |
| 当期の収益以外 (円)   | —                       | —                        | —                        |
| 翌期繰越分配対象額 (円) | 1,049                   | 1,186                    | 1,190                    |

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

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

(注3)－印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

外国債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、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)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               | 当作成期                  |         | 項目の概要                                                                                                                                                                                           |
|------------------|-----------------------|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                  | (2021年7月8日~2022年1月7日) |         |                                                                                                                                                                                                 |
|                  | 金額                    | 比率      |                                                                                                                                                                                                 |
| (a) 信託報酬         | 7円                    | 0.067%  | (a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は9,956円です。<br>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。<br>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<br>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、<br>購入後の情報提供等の対価<br>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)           | (5)                   | (0.050) |                                                                                                                                                                                                 |
| (販売会社)           | (1)                   | (0.006) |                                                                                                                                                                                                 |
| (受託会社)           | (1)                   | (0.011) |                                                                                                                                                                                                 |
| (b) 売買委託手数料      | 0                     | 0.000   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                                                                                |
| (株式)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権証券)        | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (オプション証券等)       | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (投資信託証券)         | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (商品)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (先物・オプション)       | (0)                   | (0.000) |                                                                                                                                                                                                 |
| (c) 有価証券取引税      | －                     | －       | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金                                                                                 |
| (株式)             | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権証券)        | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (オプション証券等)       | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (公社債)            | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (投資信託証券)         | (－)                   | (－)     |                                                                                                                                                                                                 |
| (d) その他費用        | 1                     | 0.014   | (d) その他費用＝ $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$<br>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<br>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<br>その他は、金銭信託預入に係る手数料等               |
| (保管費用)           | (1)                   | (0.011) |                                                                                                                                                                                                 |
| (監査費用)           | (0)                   | (0.003) |                                                                                                                                                                                                 |
| (その他)            | (0)                   | (0.000) |                                                                                                                                                                                                 |
| 合計               | 8                     | 0.081   |                                                                                                                                                                                                 |

- (注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。  
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- (注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

# 売買および取引の状況

## <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

|                    | 当 作 成 期       |                 |               |               |
|--------------------|---------------|-----------------|---------------|---------------|
|                    | 設 定           |                 | 解 約           |               |
|                    | 口 数           | 金 額             | 口 数           | 金 額           |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 千口<br>405,729 | 千円<br>1,255,040 | 千口<br>123,214 | 千円<br>383,219 |

# 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 作 成 期      |                |          |              |                |          |
|---------------|--------------|----------------|----------|--------------|----------------|----------|
|               | 買付額等A        | うち利害関係人との取引状況B | B<br>A   | 売付額等C        | うち利害関係人との取引状況D | D<br>C   |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 百万円<br>2,530 | 百万円<br>5       | %<br>0.2 | 百万円<br>2,522 | 百万円<br>5       | %<br>0.2 |

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## <外国債券インデックス マザーファンド>

| 区 分           | 当 作 成 期       |                |          |               |                |          |
|---------------|---------------|----------------|----------|---------------|----------------|----------|
|               | 買付額等A         | うち利害関係人との取引状況B | B<br>A   | 売付額等C         | うち利害関係人との取引状況D | D<br>C   |
| 為 替 直 物 取 引   | 百万円<br>14,020 | 百万円<br>60      | %<br>0.4 | 百万円<br>18,806 | 百万円<br>198     | %<br>1.1 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 516,281       | 1,136          | 0.2      | 514,941       | 1,136          | 0.2      |

<平均保有割合 10.9%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<親投資信託残高>

|                    | 前作成期末      | 当 作 成 期 末  |            |
|--------------------|------------|------------|------------|
|                    | 口 数        | 口 数        | 評 価 額      |
|                    | 千口         | 千口         | 千円         |
| 外国債券インデックス マザーファンド | 10,546,864 | 10,829,378 | 33,657,709 |

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、99,529,666千口です。

投資信託財産の構成

| 項 目                     | 当 作 成 期 末  |       |
|-------------------------|------------|-------|
|                         | 評 価 額      | 比 率   |
|                         | 千円         | %     |
| 外国債券インデックス マザーファンド      | 33,657,709 | 99.7  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 92,144     | 0.3   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 33,749,853 | 100.0 |

(注1)外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(304,579,029千円)の投資信託財産総額(309,520,200千円)に対する比率は98.4%です。

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

|                      |                     |                       |
|----------------------|---------------------|-----------------------|
| 1米ドル=115.98円         | 1カナダドル=91.17円       | 1メキシコペソ=5.6622円       |
| 1ユーロ=130.93円         | 1イギリスポンド=156.91円    | 1スウェーデンクローナ=12.68円    |
| 1ノルウェークローネ=13.03円    | 1デンマーククローネ=17.60円   | 1ポーランドズロチ=28.7554円    |
| 1オーストラリアドル=83.08円    | 1シンガポールドル=85.18円    | 1マレーシアリングgit=27.5252円 |
| 1香港・オフショア人民元=18.146円 | 1イスラエルシェケル=37.2735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                       | 第 32 期 末<br>2021年9月7日現在 | 第 33 期 末<br>2021年11月8日現在 | 第 34 期 末<br>2022年1月7日現在 |
|---------------------------|-------------------------|--------------------------|-------------------------|
| (A) 資 産                   | 32,795,756,287円         | 33,518,411,800円          | 33,749,853,455円         |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等           | 31,632,513              | 24,272,273               | 31,265,003              |
| 外国債券インデックス マザーファンド(評価額)   | 32,695,934,403          | 33,417,671,745           | 33,657,709,851          |
| 未 収 入 金                   | 68,189,371              | 76,467,782               | 60,878,601              |
| (B) 負 債                   | 83,470,019              | 84,093,295               | 75,249,471              |
| 未 払 収 益 分 配 金             | 75,867,548              | 76,439,822               | 67,715,355              |
| 未 払 信 託 報 酬               | 7,319,742               | 7,370,508                | 7,259,783               |
| 未 払 利 息                   | 25                      | 51                       | 16                      |
| そ の 他 未 払 費 用             | 282,704                 | 282,914                  | 274,317                 |
| (C) 純 資 産 総 額 (A-B)       | 32,712,286,268          | 33,434,318,505           | 33,674,603,984          |
| 元 本                       | 32,985,890,495          | 33,234,705,605           | 33,857,677,648          |
| 次 期 繰 越 損 益 金             | △273,604,227            | 199,612,900              | △183,073,664            |
| (D) 受 益 権 総 口 数           | 32,985,890,495口         | 33,234,705,605口          | 33,857,677,648口         |
| 1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D) | 9,917円                  | 10,060円                  | 9,946円                  |

### ■損益の状況

| 項 目                   | 第 32 期<br>自 2021年7月8日<br>至 2021年9月7日 | 第 33 期<br>自 2021年 9月8日<br>至 2021年11月8日 | 第 34 期<br>自 2021年11月9日<br>至 2022年 1月7日 |
|-----------------------|--------------------------------------|----------------------------------------|----------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益         | △1,850円                              | △1,644円                                | △1,663円                                |
| 受 取 利 息               | 57                                   | 10                                     | 38                                     |
| 支 払 利 息               | △1,907                               | △1,654                                 | △1,701                                 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | 75,128,089                           | 559,966,108                            | △305,309,051                           |
| 売 買 益                 | 79,952,323                           | 565,510,437                            | 4,210                                  |
| 売 買 損                 | △4,824,234                           | △5,544,329                             | △305,313,261                           |
| (C) 信 託 報 酬 等         | △7,602,446                           | △7,653,422                             | △7,534,100                             |
| (D) 当 期 損 益 金 (A+B+C) | 67,523,793                           | 552,311,042                            | △312,844,814                           |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | 2,042,586,855                        | 2,029,061,106                          | 2,504,898,835                          |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | △2,307,847,327                       | △2,305,319,426                         | △2,307,412,330                         |
| (配 当 等 相 当 額)         | (1,406,504,351)                      | (1,437,935,443)                        | (1,511,983,157)                        |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△3,714,351,678)                     | (△3,743,254,869)                       | (△3,819,395,487)                       |
| (G) 計 (D+E+F)         | △197,736,679                         | 276,052,722                            | △115,358,309                           |
| (H) 収 益 分 配 金         | △75,867,548                          | △76,439,822                            | △67,715,355                            |
| 次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)   | △273,604,227                         | 199,612,900                            | △183,073,664                           |
| 追 加 信 託 差 損 益 金       | △2,307,847,327                       | △2,305,319,426                         | △2,307,412,330                         |
| (配 当 等 相 当 額)         | (1,406,594,600)                      | (1,438,040,142)                        | (1,512,166,463)                        |
| (売 買 損 益 相 当 額)       | (△3,714,441,927)                     | (△3,743,359,568)                       | (△3,819,578,793)                       |
| 分 配 準 備 積 立 金         | 2,054,477,546                        | 2,504,932,326                          | 2,520,091,346                          |
| 繰 越 損 益 金             | △20,234,446                          | —                                      | △395,752,680                           |

(注1) (B) 有価証券売買損益は各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＞

※当ファンドの第32期首元本額は32,734,819,325円、第32～34期中追加設定元本額は1,300,464,410円、第32～34期中一部解約元本額は177,606,087円です。

※分配金の計算過程

| 項 目                             | 第 32 期          | 第 33 期          | 第 34 期          |
|---------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| (A) 配当等収益額(費用控除後)               | 87,758,239円     | 93,024,051円     | 82,907,866円     |
| (B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)  | －円              | 439,104,089円    | －円              |
| (C) 収益調整金額                      | 1,406,594,600円  | 1,438,040,142円  | 1,512,166,463円  |
| (D) 分配準備積立金額                    | 2,042,586,855円  | 2,049,244,008円  | 2,504,898,835円  |
| (E) 分配対象収益額(A+B+C+D)            | 3,536,939,694円  | 4,019,412,290円  | 4,099,973,164円  |
| (F) 期末残存口数                      | 32,985,890,495口 | 33,234,705,605口 | 33,857,677,648口 |
| (G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) | 1,072円          | 1,209円          | 1,210円          |
| (H) 分配金額(1万口当たり)                | 23円             | 23円             | 20円             |
| (I) 収益分配金金額(F×H/10,000)         | 75,867,548円     | 76,439,822円     | 67,715,355円     |

## 分配金のお知らせ

|           | 第32期 | 第33期 | 第34期 |
|-----------|------|------|------|
| 1万口当たり分配金 | 23円  | 23円  | 20円  |

(注) 分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

## 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 額 |
|------------------|---------|------|---------|-----|-------------|-------------|---------|
|                  | 期 騰 落 率 | 中 率  | 期 騰 落 率 | 中 率 |             |             |         |
|                  | 円       | %    |         | %   | %           | %           | 百万円     |
| 第17期(2017年5月29日) | 26,633  | 0.2  | 440,540 | 0.9 | 97.3        | 1.4         | 219,477 |
| 第18期(2018年5月29日) | 26,619  | △0.1 | 441,246 | 0.2 | 98.0        | 0.8         | 243,756 |
| 第19期(2019年5月29日) | 27,366  | 2.8  | 454,282 | 3.0 | 97.3        | 1.4         | 310,994 |
| 第20期(2020年5月29日) | 29,017  | 6.0  | 481,049 | 5.9 | 97.3        | 2.1         | 276,169 |
| 第21期(2021年5月31日) | 30,717  | 5.9  | 510,445 | 6.1 | 98.1        | 1.1         | 304,255 |

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

| 年 月 日                  | 基 準 価 額     |        | ベンチマーク  |        | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 率 比 |
|------------------------|-------------|--------|---------|--------|-------------|-------------|
|                        | 騰 落 率       | 中 率    | 騰 落 率   | 中 率    |             |             |
| (当 期 首)<br>2020年 5月29日 | 円<br>29,017 | %<br>— | 481,049 | %<br>— | %<br>97.3   | %<br>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)<br>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。

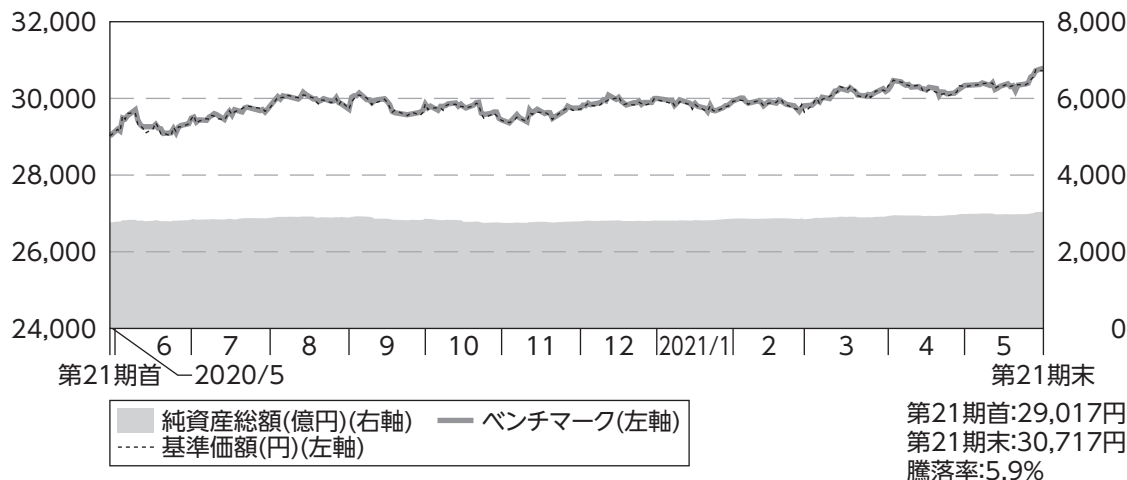
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

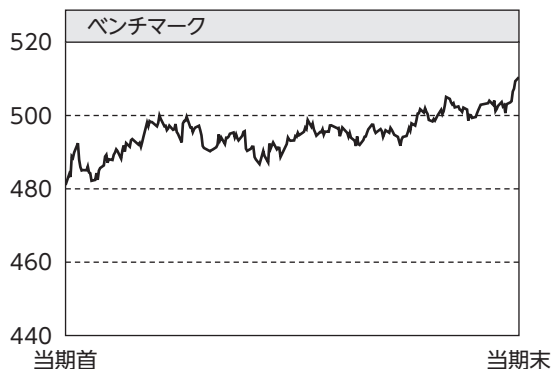


(注)ベンチマークは、2020年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 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

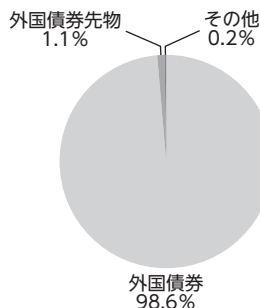
### ○上位10銘柄

| 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% |

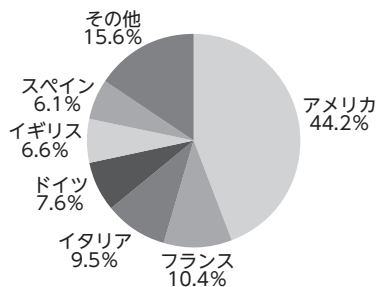
| 順位    | 銘柄名               | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|-------------------|------|------|
| 7     | T 1.375% 11/15/40 | アメリカ | 0.4% |
| 8     | T 0.75% 03/31/26  | アメリカ | 0.4% |
| 9     | T 2.625% 02/15/29 | アメリカ | 0.4% |
| 10    | T 2% 11/15/26     | アメリカ | 0.4% |
| 組入銘柄数 |                   |      |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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

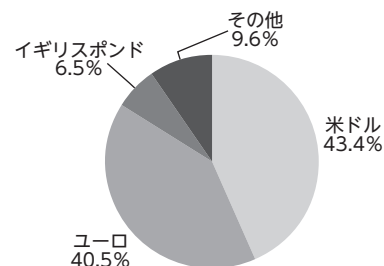
### ○資産別配分



### ○国別配分



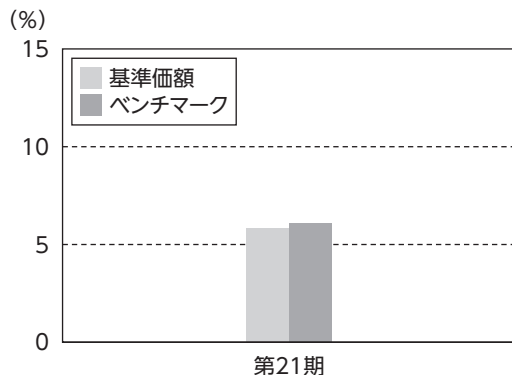
### ○通貨別配分



(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<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(投資信託証券)<br>(商品)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(0) | 0.001%<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(0.001) | (a) 売買委託手数料＝ $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$<br>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<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(公社債)<br>(投資信託証券)              | －<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)         | －<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)<br>(－)                 | (b) 有価証券取引税＝ $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$<br>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<br><br>(保管費用)<br><br>(監査費用)<br>(その他)                                                       | 7<br><br>(6)<br><br>(－)<br>(0)                      | 0.022<br><br>(0.022)<br><br>(－)<br>(0.001)                  | (c) その他費用＝ $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]}\times 10,000$<br>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<br>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<br>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<br>457,488       | 千米ドル<br>342,694       |
|     | カ ナ ダ         | 国 債 証 券 | 千カナダドル<br>34,089      | 千カナダドル<br>29,278      |
|     | メ キ シ コ       | 国 債 証 券 | 千メキシコペソ<br>96,120     | 千メキシコペソ<br>92,129     |
|     | ド イ ツ         | 国 債 証 券 | 千ユーロ<br>49,238        | 千ユーロ<br>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<br>35,739    | 千イギリスポンド<br>29,642    |
|     | ス ウ ェ ー デ ン   | 国 債 証 券 | 千スウェーデンクローナ<br>19,122 | 千スウェーデンクローナ<br>2,802  |
|     | ノ ル ウ ェ ー     | 国 債 証 券 | 千ノルウェークローネ<br>11,757  | 千ノルウェークローネ<br>13,795  |
|     | デ ン マ ー ク     | 国 債 証 券 | 千デンマーククローネ<br>19,833  | 千デンマーククローネ<br>16,230  |
|     | ポ ー ラ ン ド     | 国 債 証 券 | 千ポーランドズロチ<br>23,002   | 千ポーランドズロチ<br>18,494   |
|     | オ ー ス ト ラ リ ア | 国 債 証 券 | 千オーストラリアドル<br>33,163  | 千オーストラリアドル<br>28,254  |
|     | シ ン ガ ポ ー ル   | 国 債 証 券 | 千シンガポールドル<br>4,115    | 千シンガポールドル<br>3,776    |
| 国   | マ レ ー シ ア     | 国 債 証 券 | 千マレーシアリンギット<br>13,174 | 千マレーシアリンギット<br>11,432 |
|     | イ ス ラ エ ル     | 国 債 証 券 | 千イスラエルシェケル<br>13,044  | 千イスラエルシェケル<br>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<br>43,703 | 百万円<br>46,247 | 百万円<br>ー  | 百万円<br>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<br>との取引状況B | B<br>A   | 売付額等C         | うち利害関係人<br>との取引状況D | D<br>C   |
| 為 替 直 物 取 引   | 百万円<br>34,594 | 百万円<br>398         | %<br>1.2 | 百万円<br>21,411 | 百万円<br>131         | %<br>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B B 格<br>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<br>1,162,010     | 千米ドル<br>1,203,672     | 千円<br>132,115,094 | %<br>43.4 | %<br>—            | %<br>19.1         | %<br>16.7 | %<br>7.6 |
| カ ナ ダ   | 千カナダドル<br>65,030      | 千カナダドル<br>68,165      | 6,190,083         | 2.0       | —                 | 0.9               | 0.6       | 0.5      |
| メ キ シ コ | 千メキシコペソ<br>409,160    | 千メキシコペソ<br>435,502    | 2,399,051         | 0.8       | —                 | 0.4               | 0.3       | 0.1      |
| ド イ ツ   | 千ユーロ<br>145,240       | 千ユーロ<br>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<br>106,280   | 千イギリスポンド<br>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<br>76,250 | 千スウェーデンクローナ<br>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<br>55,570  | 千ノルウェークローネ<br>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<br>71,160  | 千デンマーククローネ<br>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<br>60,380   | 千ポーランドズロチ<br>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<br>73,260  | 千オーストラリアドル<br>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<br>14,300   | 千シンガポールドル<br>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<br>51,060 | 千マレーシアリンギット<br>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<br>35,400  | 千イスラエルシェケル<br>40,142  | 1,356,443         | 0.4       | —                 | 0.3               | 0.1       | 0.1      |
| 合 計     | —                     | —                     | 298,426,352       | 98.1      | —                 | 54.0              | 30.4      | 13.6     |

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

## (B) 個別銘柄開示

| 銘柄                | 利 率<br>(%) | 期      |        | 末              |            |
|-------------------|------------|--------|--------|----------------|------------|
|                   |            | 額面金額   | 評 価    | 額              | 償還年月日      |
|                   |            |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額<br>(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<br>(%) | 期      |        | 末              |            |
|-------------------|------------|--------|--------|----------------|------------|
|                   |            | 額面金額   | 評 価    | 額              | 償還年月日      |
|                   |            |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額<br>(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  | 9,054  | 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 |

| 銘柄       | 当 期      | 利 率<br>(%) | 額面金額   | 未 評 価 額 |           |                | 償還年月日 |
|----------|----------|------------|--------|---------|-----------|----------------|-------|
|          |          |            |        | 外貨建金額   |           | 邦貨換算金額<br>(千円) |       |
|          |          |            |        |         |           |                |       |
| T 2.25%  | 12/31/24 | 2.25       | 8,400  | 8,941   | 981,408   | 2024/12/31     |       |
| T 2.375% | 01/31/23 | 2.375      | 5,000  | 5,188   | 569,455   | 2023/1/31      |       |
| T 2.375% | 02/29/24 | 2.375      | 5,760  | 6,095   | 669,088   | 2024/2/29      |       |
| T 2.375% | 04/30/26 | 2.375      | 2,600  | 2,802   | 307,604   | 2026/4/30      |       |
| T 2.375% | 05/15/27 | 2.375      | 10,750 | 11,598  | 1,273,023 | 2027/5/15      |       |
| T 2.375% | 05/15/29 | 2.375      | 8,010  | 8,610   | 945,115   | 2029/5/15      |       |
| T 2.375% | 08/15/24 | 2.375      | 5,000  | 5,324   | 584,407   | 2024/8/15      |       |
| T 2.375% | 11/15/49 | 2.375      | 7,500  | 7,674   | 842,300   | 2049/11/15     |       |
| T 2.5%   | 01/31/24 | 2.5        | 3,470  | 3,679   | 403,882   | 2024/1/31      |       |
| T 2.5%   | 01/31/25 | 2.5        | 5,000  | 5,371   | 589,617   | 2025/1/31      |       |
| T 2.5%   | 02/15/45 | 2.5        | 3,210  | 3,362   | 369,065   | 2045/2/15      |       |
| T 2.5%   | 02/15/46 | 2.5        | 4,000  | 4,188   | 459,688   | 2046/2/15      |       |
| T 2.5%   | 03/31/23 | 2.5        | 4,050  | 4,225   | 463,819   | 2023/3/31      |       |
| T 2.5%   | 05/15/24 | 2.5        | 7,900  | 8,418   | 923,973   | 2024/5/15      |       |
| T 2.5%   | 05/15/46 | 2.5        | 5,050  | 5,288   | 580,443   | 2046/5/15      |       |
| T 2.5%   | 08/15/23 | 2.5        | 4,550  | 4,783   | 525,080   | 2023/8/15      |       |
| T 2.625% | 01/31/26 | 2.625      | 4,690  | 5,103   | 560,179   | 2026/1/31      |       |
| T 2.625% | 02/15/29 | 2.625      | 9,990  | 10,928  | 1,199,470 | 2029/2/15      |       |
| T 2.625% | 02/28/23 | 2.625      | 1,400  | 1,461   | 160,383   | 2023/2/28      |       |
| T 2.625% | 03/31/25 | 2.625      | 7,250  | 7,835   | 860,011   | 2025/3/31      |       |
| T 2.625% | 06/30/23 | 2.625      | 4,900  | 5,152   | 565,555   | 2023/6/30      |       |
| T 2.625% | 12/31/23 | 2.625      | 3,500  | 3,716   | 407,959   | 2023/12/31     |       |
| T 2.625% | 12/31/25 | 2.625      | 5,820  | 6,329   | 694,773   | 2025/12/31     |       |
| T 2.75%  | 02/15/24 | 2.75       | 3,000  | 3,203   | 351,660   | 2024/2/15      |       |
| T 2.75%  | 02/15/28 | 2.75       | 6,550  | 7,218   | 792,281   | 2028/2/15      |       |
| T 2.75%  | 04/30/23 | 2.75       | 3,600  | 3,780   | 414,915   | 2023/4/30      |       |
| T 2.75%  | 05/31/23 | 2.75       | 3,880  | 4,082   | 448,052   | 2023/5/31      |       |
| T 2.75%  | 06/30/25 | 2.75       | 5,500  | 5,987   | 657,209   | 2025/6/30      |       |
| T 2.75%  | 07/31/23 | 2.75       | 1,000  | 1,056   | 115,912   | 2023/7/31      |       |
| T 2.75%  | 08/15/42 | 2.75       | 1,300  | 1,425   | 156,432   | 2042/8/15      |       |
| T 2.75%  | 08/15/47 | 2.75       | 4,950  | 5,436   | 596,666   | 2047/8/15      |       |
| T 2.75%  | 08/31/23 | 2.75       | 7,500  | 7,934   | 870,855   | 2023/8/31      |       |
| T 2.75%  | 08/31/25 | 2.75       | 6,900  | 7,521   | 825,504   | 2025/8/31      |       |
| T 2.75%  | 11/15/23 | 2.75       | 6,120  | 6,502   | 713,766   | 2023/11/15     |       |
| T 2.75%  | 11/15/42 | 2.75       | 2,820  | 3,088   | 338,976   | 2042/11/15     |       |
| T 2.75%  | 11/15/47 | 2.75       | 3,050  | 3,349   | 367,617   | 2047/11/15     |       |
| T 2.875% | 04/30/25 | 2.875      | 4,000  | 4,366   | 479,308   | 2025/4/30      |       |
| T 2.875% | 05/15/28 | 2.875      | 7,260  | 8,060   | 884,698   | 2028/5/15      |       |
| T 2.875% | 05/15/43 | 2.875      | 4,150  | 4,637   | 509,061   | 2043/5/15      |       |
| T 2.875% | 05/15/49 | 2.875      | 5,570  | 6,287   | 690,076   | 2049/5/15      |       |
| T 2.875% | 05/31/25 | 2.875      | 3,820  | 4,173   | 458,116   | 2025/5/31      |       |
| T 2.875% | 07/31/25 | 2.875      | 5,460  | 5,975   | 655,894   | 2025/7/31      |       |
| T 2.875% | 08/15/28 | 2.875      | 8,920  | 9,910   | 1,087,826 | 2028/8/15      |       |
| T 2.875% | 08/15/45 | 2.875      | 4,300  | 4,814   | 528,419   | 2045/8/15      |       |
| T 2.875% | 09/30/23 | 2.875      | 4,750  | 5,047   | 554,067   | 2023/9/30      |       |
| T 2.875% | 10/31/23 | 2.875      | 2,500  | 2,661   | 292,171   | 2023/10/31     |       |
| T 2.875% | 11/30/23 | 2.875      | 4,020  | 4,288   | 470,656   | 2023/11/30     |       |
| T 2.875% | 11/30/25 | 2.875      | 7,500  | 8,234   | 903,783   | 2025/11/30     |       |
| T 3%     | 02/15/47 | 3.0        | 2,800  | 3,216   | 352,995   | 2047/2/15      |       |
| T 3%     | 02/15/48 | 3.0        | 4,450  | 5,119   | 561,925   | 2048/2/15      |       |
| T 3%     | 02/15/49 | 3.0        | 7,000  | 8,080   | 886,929   | 2049/2/15      |       |
| T 3%     | 05/15/42 | 3.0        | 1,620  | 1,846   | 202,621   | 2042/5/15      |       |
| T 3%     | 05/15/45 | 3.0        | 3,500  | 3,999   | 438,962   | 2045/5/15      |       |
| T 3%     | 05/15/47 | 3.0        | 5,710  | 6,561   | 720,200   | 2047/5/15      |       |
| T 3%     | 08/15/48 | 3.0        | 5,450  | 6,278   | 689,135   | 2048/8/15      |       |
| T 3%     | 09/30/25 | 3.0        | 4,200  | 4,626   | 507,847   | 2025/9/30      |       |
| T 3%     | 10/31/25 | 3.0        | 5,000  | 5,512   | 605,052   | 2025/10/31     |       |
| T 3%     | 11/15/44 | 3.0        | 4,050  | 4,624   | 507,595   | 2044/11/15     |       |
| T 3.125% | 02/15/42 | 3.125      | 1,050  | 1,220   | 133,957   | 2042/2/15      |       |
| T 3.125% | 02/15/43 | 3.125      | 3,500  | 4,067   | 446,465   | 2043/2/15      |       |
| T 3.125% | 05/15/48 | 3.125      | 5,930  | 6,981   | 766,305   | 2048/5/15      |       |
| T 3.125% | 08/15/44 | 3.125      | 4,140  | 4,825   | 529,631   | 2044/8/15      |       |
| T 3.125% | 11/15/28 | 3.125      | 8,400  | 9,486   | 1,041,265 | 2028/11/15     |       |

| 当             |          | 期       |        | 末      |             |            |
|---------------|----------|---------|--------|--------|-------------|------------|
| 銘             | 柄        | 利 率 (%) | 額面金額   | 評 価 額  |             | 償還年月日      |
|               |          |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額 (千円) |            |
| T 3.125%      | 11/15/41 | 3.125   | 1,750  | 2,031  | 222,947     | 2041/11/15 |
| T 3.375%      | 05/15/44 | 3.375   | 3,010  | 3,645  | 400,169     | 2044/5/15  |
| T 3.375%      | 11/15/48 | 3.375   | 5,300  | 6,534  | 717,252     | 2048/11/15 |
| T 3.5%        | 02/15/39 | 3.5     | 770    | 940    | 103,187     | 2039/2/15  |
| T 3.625%      | 02/15/44 | 3.625   | 2,400  | 3,015  | 331,008     | 2044/2/15  |
| T 3.625%      | 08/15/43 | 3.625   | 2,000  | 2,506  | 275,154     | 2043/8/15  |
| T 3.75%       | 08/15/41 | 3.75    | 2,000  | 2,532  | 277,950     | 2041/8/15  |
| T 3.75%       | 11/15/43 | 3.75    | 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)<br>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      | 2046/12/1  |
| 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<br>(%) | 額面金額    | 評 価 額   |                | 償還年月日      |
|             |          |            |         | 外貨建金額   | 邦貨換算金額<br>(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   | 5,510   | 469,512        | 2028/7/4   |
| DBR 4.75%   | 07/04/34 | 4.75       | 3,390   | 5,548   | 742,081        | 2034/7/4   |
| DBR 4.75%   | 07/04/40 | 4.75       | 2,830   | 5,301   | 709,040        | 2040/7/4   |
| DBR 5.5%    | 01/04/31 | 5.5        | 2,840   | 4,441   | 594,059        | 2031/1/4   |
| DBR 5.625%  | 01/04/28 | 5.625      | 2,360   | 3,332   | 445,664        | 2028/1/4   |
| DBR 6.25%   | 01/04/24 | 6.25       | 3,230   | 3,819   | 510,881        | 2024/1/4   |
| DBR 6.25%   | 01/04/30 | 6.25       | 1,250   | 1,972   | 263,785        | 2030/1/4   |
| DBR 6.5%    | 07/04/27 | 6.5        | 980     | 1,407   | 188,286        | 2027/7/4   |
| OBL 0%      | 04/05/24 | —          | 4,250   | 4,333   | 579,518        | 2024/4/5   |
| OBL 0%      | 04/10/26 | —          | 4,070   | 4,184   | 559,666        | 2026/4/10  |

| 当          |          | 期       |       | 末     |             |            |
|------------|----------|---------|-------|-------|-------------|------------|
| 銘          | 柄        | 利 率 (%) | 額面金額  | 評 価 額 |             |            |
|            |          |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 (千円) |            |
| OBL 0%     | 04/11/25 | —       | 3,750 | 3,843 | 514,083     | 2025/4/11  |
| OBL 0%     | 04/14/23 | —       | 2,220 | 2,249 | 300,789     | 2023/4/14  |
| OBL 0%     | 10/07/22 | —       | 4,160 | 4,198 | 561,493     | 2022/10/7  |
| OBL 0%     | 10/10/25 | —       | 4,340 | 4,458 | 596,271     | 2025/10/10 |
| OBL 0%     | 10/13/23 | —       | 1,510 | 1,535 | 205,358     | 2023/10/13 |
| OBL 0%     | 10/18/24 | —       | 3,490 | 3,569 | 477,361     | 2024/10/18 |
| (イタリア)     |          |         |       |       |             |            |
| 国債証券       |          |         |       |       |             |            |
| BTPS 0%    | 01/15/24 | —       | 1,000 | 1,005 | 134,480     | 2024/1/15  |
| BTPS 0%    | 04/15/24 | —       | 500   | 502   | 67,184      | 2024/4/15  |
| BTPS 0.05% | 01/15/23 | 0.05    | 2,030 | 2,043 | 273,322     | 2023/1/15  |
| BTPS 0.25% | 03/15/28 | 0.25    | 1,680 | 1,654 | 221,220     | 2028/3/15  |
| BTPS 0.3%  | 08/15/23 | 0.3     | 1,850 | 1,873 | 250,576     | 2023/8/15  |
| BTPS 0.35% | 02/01/25 | 0.35    | 580   | 588   | 78,734      | 2025/2/1   |
| BTPS 0.5%  | 02/01/26 | 0.5     | 3,710 | 3,776 | 505,032     | 2026/2/1   |
| BTPS 0.6%  | 06/15/23 | 0.6     | 1,110 | 1,131 | 151,260     | 2023/6/15  |
| BTPS 0.6%  | 08/01/31 | 0.6     | 1,850 | 1,794 | 239,984     | 2031/8/1   |
| BTPS 0.65% | 10/15/23 | 0.65    | 2,170 | 2,217 | 296,626     | 2023/10/15 |
| BTPS 0.85% | 01/15/27 | 0.85    | 2,250 | 2,320 | 310,357     | 2027/1/15  |
| BTPS 0.9%  | 04/01/31 | 0.9     | 2,500 | 2,508 | 335,530     | 2031/4/1   |
| BTPS 0.9%  | 08/01/22 | 0.9     | 3,180 | 3,228 | 431,825     | 2022/8/1   |
| BTPS 0.95% | 03/01/23 | 0.95    | 2,000 | 2,045 | 273,498     | 2023/3/1   |
| BTPS 0.95% | 03/01/37 | 0.95    | 1,020 | 961   | 128,539     | 2037/3/1   |
| BTPS 0.95% | 03/15/23 | 0.95    | 2,580 | 2,638 | 352,926     | 2023/3/15  |
| BTPS 0.95% | 08/01/30 | 0.95    | 2,230 | 2,261 | 302,445     | 2030/8/1   |
| BTPS 0.95% | 09/15/27 | 0.95    | 2,380 | 2,462 | 329,311     | 2027/9/15  |
| BTPS 1%    | 07/15/22 | 1.0     | 2,160 | 2,194 | 293,538     | 2022/7/15  |
| BTPS 1.25% | 12/01/26 | 1.25    | 1,950 | 2,056 | 275,053     | 2026/12/1  |
| BTPS 1.35% | 04/01/30 | 1.35    | 1,940 | 2,040 | 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<br>率<br>(%) | 額面金額  | 評 価 額 |                | 償還年月日      |
|            |          |               |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額<br>(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 | 449,811   | 2030/7/30   |

| 当        |                | 期       |       | 未     |             |            |
|----------|----------------|---------|-------|-------|-------------|------------|
| 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% 03/28/42    | 4.0     | 1,080 | 1,530 | 204,705     | 2032/3/28  |
| BGB      | 4.25% 03/28/41 | 4.25    | 2,400 | 4,003 | 535,381     | 2041/3/28  |
| BGB      | 4.25% 09/28/22 | 4.25    | 2,100 | 2,238 | 299,359     | 2022/9/28  |
| BGB      | 4.5% 03/28/26  | 4.5     | 1,140 | 1,417 | 189,617     | 2026/3/28  |
| BGB      | 5% 03/28/35    | 5.0     | 2,690 | 4,384 | 586,442     | 2035/3/28  |
| BGB      | 5.5% 03/28/28  | 5.5     | 2,780 | 3,890 | 520,382     | 2028/3/28  |
| (オーストリア) |                |         |       |       |             |            |
| 国債証券     |                |         |       |       |             |            |
| RAGB     | 0% 02/20/30    | —       | 1,130 | 1,135 | 151,850     | 2030/2/20  |
| RAGB     | 0% 02/20/31    | —       | 590   | 587   | 78,591      | 2031/2/20  |
| RAGB     | 0% 04/20/25    | —       | 930   | 949   | 126,981     | 2025/4/20  |
| RAGB     | 0% 07/15/23    | —       | 1,500 | 1,520 | 203,376     | 2023/7/15  |
| RAGB     | 0% 07/15/24    | —       | 1,350 | 1,374 | 183,883     | 2024/7/15  |
| RAGB     | 0% 09/20/22    | —       | 320   | 322   | 43,159      | 2022/9/20  |
| RAGB     | 0% 10/20/40    | —       | 420   | 380   | 50,942      | 2040/10/20 |
| RAGB     | 0.5% 02/20/29  | 0.5     | 1,770 | 1,860 | 248,816     | 2029/2/20  |
| RAGB     | 0.5% 04/20/27  | 0.5     | 890   | 936   | 125,203     | 2027/4/20  |
| RAGB     | 0.75% 02/20/28 | 0.75    | 1,620 | 1,731 | 231,575     | 2028/2/20  |

| 銘柄          | 利 率 (%)  | 期     |       | 評 価 額       |             | 償還年月日      |
|-------------|----------|-------|-------|-------------|-------------|------------|
|             |          | 額面金額  | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 (千円) |             |            |
|             |          |       |       |             |             |            |
| 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<br>(%) | 額面金額           | 評 価<br>外貨建金額   | 額<br>邦貨換算金額<br>(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<br>クロナ | キスウェーデン<br>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<br>クロナ  | キノルウェー<br>クロナ  |                     |            |  |
| 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<br>(%) | 額面金額           | 評 価<br>外貨建金額   | 額<br>邦貨換算金額<br>(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<br>クロナ  | キデンマーク<br>クロナ  |                     |            |  |
| 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          | 209,099             | 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        | 4,330          | 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<br>ドル | キオーストラリア<br>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<br>(%) | 額面金額            | 評 価             | 額              |            |
|             |          |            |                 | 外貨建金額           | 邦貨換算金額<br>(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)    |          |            | 千シンガポールドル       | 千シンガポールドル       |                |            |
| 国債証券        |          |            |                 |                 |                |            |
| SIGB 0.5%   | 11/01/25 | 0.5        | 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<br>リンギット | 千マレーシア<br>リンギット |                |            |
| 国債証券        |          |            |                 |                 |                |            |
| MGS 3.418%  | 08/15/22 | 3.418      | 1,500           | 1,528           | 40,469         | 2022/8/15  |
| MGS 3.478%  | 06/14/24 | 3.478      | 700             | 724             | 19,177         | 2024/6/14  |
| MGS 3.48%   | 03/15/23 | 3.48       | 2,330           | 2,392           | 63,353         | 2023/3/15  |
| MGS 3.502%  | 05/31/27 | 3.502      | 1,510           | 1,563           | 41,399         | 2027/5/31  |
| MGS 3.733%  | 06/15/28 | 3.733      | 3,430           | 3,594           | 95,198         | 2028/6/15  |
| MGS 3.757%  | 04/20/23 | 3.757      | 1,090           | 1,125           | 29,820         | 2023/4/20  |
| MGS 3.757%  | 05/22/40 | 3.757      | 550             | 524             | 13,882         | 2040/5/22  |
| MGS 3.795%  | 09/30/22 | 3.795      | 1,500           | 1,537           | 40,726         | 2022/9/30  |
| MGS 3.8%    | 08/17/23 | 3.8        | 930             | 964             | 25,551         | 2023/8/17  |
| MGS 3.844%  | 04/15/33 | 3.844      | 2,350           | 2,364           | 62,624         | 2033/4/15  |
| MGS 3.882%  | 03/14/25 | 3.882      | 1,030           | 1,082           | 28,658         | 2025/3/14  |
| MGS 3.885%  | 08/15/29 | 3.885      | 1,500           | 1,580           | 41,866         | 2029/8/15  |
| MGS 3.892%  | 03/15/27 | 3.892      | 1,130           | 1,193           | 31,619         | 2027/3/15  |
| MGS 3.899%  | 11/16/27 | 3.899      | 1,970           | 2,092           | 55,408         | 2027/11/16 |
| MGS 3.9%    | 11/30/26 | 3.9        | 1,440           | 1,533           | 40,619         | 2026/11/30 |
| MGS 3.906%  | 07/15/26 | 3.906      | 600             | 633             | 16,791         | 2026/7/15  |
| MGS 3.955%  | 09/15/25 | 3.955      | 2,380           | 2,513           | 66,570         | 2025/9/15  |
| MGS 4.059%  | 09/30/24 | 4.059      | 1,900           | 2,003           | 53,054         | 2024/9/30  |
| MGS 4.065%  | 06/15/50 | 4.065      | 760             | 721             | 19,097         | 2050/6/15  |
| MGS 4.181%  | 07/15/24 | 4.181      | 1,280           | 1,351           | 35,781         | 2024/7/15  |
| MGS 4.232%  | 06/30/31 | 4.232      | 2,000           | 2,145           | 56,812         | 2031/6/30  |
| MGS 4.254%  | 05/31/35 | 4.254      | 2,030           | 2,105           | 55,773         | 2035/5/31  |
| MGS 4.392%  | 04/15/26 | 4.392      | 2,910           | 3,141           | 83,211         | 2026/4/15  |
| MGS 4.498%  | 04/15/30 | 4.498      | 2,380           | 2,603           | 68,964         | 2030/4/15  |
| MGS 4.642%  | 11/07/33 | 4.642      | 2,830           | 3,065           | 81,188         | 2033/11/7  |
| MGS 4.736%  | 03/15/46 | 4.736      | 1,480           | 1,562           | 41,388         | 2046/3/15  |
| MGS 4.762%  | 04/07/37 | 4.762      | 2,280           | 2,458           | 65,120         | 2037/4/7   |
| MGS 4.893%  | 06/08/38 | 4.893      | 2,310           | 2,508           | 66,436         | 2038/6/8   |
| MGS 4.921%  | 07/06/48 | 4.921      | 1,400           | 1,507           | 39,919         | 2048/7/6   |
| MGS 4.935%  | 09/30/43 | 4.935      | 1,560           | 1,693           | 44,856         | 2043/9/30  |
| 小 計         |          |            |                 |                 | 1,425,343      |            |
| (イスラエル)     |          |            | 千イスラエル<br>シェケル  | 千イスラエル<br>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<br>(%) | 額面金額  | 評 価   | 額              |            |
|             |          |            |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額<br>(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<br>(百万円) | 売 建 額<br>(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<br>298,426,352 | %<br>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<br>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<br>自 2020年5月30日<br>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。