

JP4資産均等バランス

運用報告書（全体版）

第5期（決算日 2022年7月15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資産均等バランス」は、2022年7月15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	追加型投資ノ内外ノ資産複合			
信託期間	無期限（2017年10月18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せん。 <基本組入比率>			
	日本株式	日本債券	海外株式	海外債券
主な投資対象	JP4資産均等バランス	25%	25%	25%
	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-KOKUSA1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 国内債券インデックス・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。		
	野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSA1インデックスファンド（適格機関投資家専用）	日本債券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）	海外株式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。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 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75%以下とします。 デリバティブの直接利用は行いません。 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。			
	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。 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。 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。 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。		

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 資産均等バランス	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)	144

【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	基準価額			参考指数	投資信託 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配 金	期騰 落 率			
(設定日)	円	円	%		%	百万円
2017年10月18日	10,000	—	—	10,000	—	1
1期(2018年7月17日)	10,263	0	2.6	10,228	98.8	478
2期(2019年7月16日)	10,226	0	△0.4	10,149	99.0	2,156
3期(2020年7月15日)	10,617	0	3.8	10,403	99.4	4,521
4期(2021年7月15日)	12,420	0	17.0	12,296	99.4	8,850
5期(2022年7月15日)	12,644	0	1.8	12,514	99.3	14,519

(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	基準価額		参考指数	投資信託 組入比率
	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%	%	%
2021年7月15日	12,420	—	12,296	99.4
7月末	12,407	△0.1	12,297	99.0
8月末	12,517	0.8	12,427	99.1
9月末	12,575	1.2	12,430	98.8
10月末	12,804	3.1	12,726	99.2
11月末	12,682	2.1	12,605	98.8
12月末	12,917	4.0	12,884	98.9
2022年1月末	12,421	0.0	12,316	99.2
2月末	12,317	△0.8	12,229	99.1
3月末	12,921	4.0	12,879	99.4
4月末	12,609	1.5	12,520	99.0
5月末	12,693	2.2	12,595	99.4
6月末	12,612	1.5	12,501	99.1
(期末)				
2022年7月15日	12,644	1.8	12,514	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2021年7月16日～2022年7月15日)

期中の基準価額等の推移



期 首：12,420円

期 末：12,644円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 1.8% (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7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12,420円から期末12,644円となり、値上がり額は224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作成期間の値動きは、海外株式、海外債券は上昇した一方、日本株式、日本債券は下落しました。海外株式、海外債券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7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、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。11月から12月にかけては、感染力の強い新型コロナウイルスの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債券は買われました。2022年1月から2月中旬は、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融政策の引き締め観測が強まったことなどから米長期金利が上昇し、連れて債券は売られました。その後2月下旬から3月上旬にかけては、ウクライナを巡る地政学リスクの高まりを受けてリスク回避姿勢が強まり、相対的に安全資産とされる債券は買われました。3月中旬以降は、物価上昇圧力の強さを示す経済指標が相次いで発表され、FRBやECB（欧州中央銀行）が金融引き締めを加速するとの見方が強まったことなどから世界的に債券利回りが上昇し、連れて債券の売りが優勢となりましたが、日銀が強力な金融緩和策によって長期金利の上昇を抑制したことから、債券利回りの上昇幅は限定的となりました。</p>
日本株式市場	<p>期を通じて、日本株式市場は下落しました。2021年7月中旬から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月中旬から12月にかけては、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、感染力の強い新型コロナウイルスのオミクロン株の発生を受けて下落する場面もあり、一進一退の展開となりました。2022年1月から3月上旬にかけては、FRBの金融政策正常化観測の強まりや、ロシアのウクライナ侵攻を受けてリスク回避姿勢が強まり、大幅に下落しました。3月中旬から下旬にかけては、円安ドル高が加速し輸出企業の業績が改善するとの見方が強まったことなどから反発しました。4月以降は、中国での感染拡大を受けて世界景気の下押し懸念が強まったことや、物価指標の上振れを受けてFRBが相次いで大幅な利上げを実施し、米国の景気後退懸念が強まったことなどから下落する一方、円安ドル高の進行や、国内の経済再開期待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>
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7月中旬から12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る一方、感染力の強い新型コロナウイルスの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など、一進一退の展開となりました。2022年1月から3月上旬にかけては、ウクライナを巡る地政学リスクの高まりを受けてリスク回避姿勢が強まり買われる場面もありましたが、FRBの金融政策の引き締め観測が強まったことなどから債券の売りが優勢となりました。その後、3月中旬から6月前半にかけては、物価上昇圧力の強さを示す経済指標が相次いで発表され、FRBやECBが金融引き締めを加速す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。6月後半から7月中旬にかけては、欧米で景気の減速を示す経済指標の発表が相次ぎ、景気の先行きに対する懸念から債券は買われました。外国為替市場では、FRBが相次いで大幅な利上げを実施する一方、日銀が強力な金融緩和策を維持し、日米の金融政策の方向性の違いが意識されたことなどから、大幅な円安ドル高となりました。</p>
海外株式市場	<p>期を通じて、海外株式市場は下落しました。2021年7月中旬から10月上旬にかけては、堅調な経済指標の発表や好調な企業決算などを背景に上昇する一方、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するなど、一進一退の展開となりました。10月中旬から12月にかけては、感染力の強い新型コロナウイルスのオミクロン株の発生を受けて下落する場面もあったものの、好調な企業決算が相次いだことなどから上昇しました。2022年1月から3月上旬にかけては、FRBの金融政策正常化観測の強まりや、ロシアのウクライナ侵攻を受けてリスク回避姿勢が強まり、大幅に下落しました。その後3月下旬にかけては、ロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待などから一時反発しましたが、4月上旬以降は、中国での感染拡大を受けて世界景気の減速への懸念が高まったことや、物価指標の上振れを受けてFRBが相次いで大幅な利上げを実施し、米国の景気後退への懸念が強まったことなどから大幅に下落しました。外国為替市場では、FRBが相次いで大幅な利上げを実施する一方、日銀が強力な金融緩和策を維持し、日米の金融政策の方向性の違いが意識されたことなどから、大幅な円安ドル高となりました。</p>

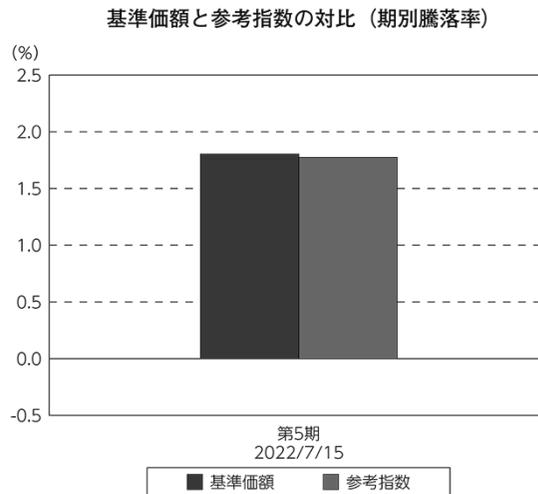
当ファンドのポートフォリオ

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7月16日～ 2022年7月15日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,643

(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7月16日～2022年7月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 14	% 0.107	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(5)	(0.043)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.043)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0.022)	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	15	0.111	
期中の平均基準価額は、12,622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。

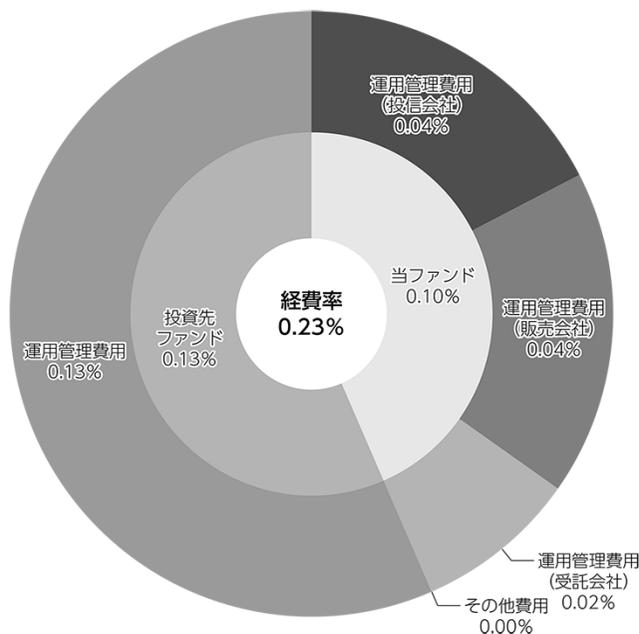
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。

(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0.23%です。



(単位:%)

経費率(①+②)	0.23
①当ファンドの費用の比率	0.10
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7月16日～2022年7月15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-KOKUSAI インデックスファンド(適格機関投資家専用)	639,072,561	1,311,000	23,741,587	51,100
	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)	1,564,287,608	1,536,700	37,177,476	36,500
	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)	1,099,829,755	1,513,500	16,931,953	24,300
	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)	1,374,600,915	1,363,200	12,207,071	12,000
合計		4,677,790,839	5,724,400	90,058,087	123,900

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月16日～2022年7月15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7月16日～2022年7月15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7月16日～2022年7月15日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年7月15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
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)		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)	1,101,178,482	1,716,509,456	3,573,772	24.6
	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)	2,209,383,013	3,736,493,145	3,596,748	24.8
	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)	1,572,886,434	2,655,784,236	3,607,617	24.8
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)	2,206,566,343	3,568,960,187	3,633,558	25.0	
合計		7,090,014,272	11,677,747,024	14,411,696	99.3

(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7月15日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	14,411,696	99.2
コール・ローン等、その他	121,301	0.8
投資信託財産総額	14,532,997	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7月15日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,532,997,715
コール・ローン等	121,301,055
投資信託受益証券(評価額)	14,411,696,660
(B) 負債	13,850,623
未払解約金	6,577,460
未払信託報酬	6,770,621
未払利息	332
その他未払費用	502,210
(C) 純資産総額(A-B)	14,519,147,092
元本	11,483,048,965
次期繰越損益金	3,036,098,127
(D) 受益権総口数	11,483,048,965口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,644円

(注) 当ファンドの期首元本額は7,126,115,753円、期中追加設定元本額は5,001,050,739円、期中一部解約元本額は644,117,527円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,2644円です。

○損益の状況 (2021年7月16日～2022年7月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	166,532,625
受取配当金	166,636,198
支払利息	△ 103,573
(B) 有価証券売買損益	10,769,616
売買益	230,240,404
売買損	△ 219,470,788
(C) 信託報酬等	△ 12,746,495
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	164,555,746
(E) 前期繰越損益金	1,031,562,643
(F) 追加信託差損益金	1,839,979,738
(配当等相当額)	(1,464,661,587)
(売買損益相当額)	(375,318,151)
(G) 計(D+E+F)	3,036,098,127
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	3,036,098,127
追加信託差損益金	1,839,979,738
(配当等相当額)	(1,464,661,587)
(売買損益相当額)	(375,318,151)
分配準備積立金	1,196,118,389

(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7月16日～2022年7月15日)は以下の通りです。

項 目	2021年7月16日～ 2022年7月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	154,559,842円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	9,995,904円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,839,979,738円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,031,562,643円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	3,036,098,127円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,643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7月16日から2022年7月15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)	25%
日 本 債 券	NOMURA-BPI総合	25%
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)	25%
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)	25%

- * 「TOPIX (東証株価指数、配当なし) とは、株式会社JPX総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、JPXにより提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。
- * 「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 インデックス・ファンドP (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 インデックス マザーファンド	わが国の取引所に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	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)	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	国内株式 インデックス マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。
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。 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。 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35期(決算日 2022年3月7日)
第36期(決算日 2022年5月9日)
第37期(決算日 2022年7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。
- ・ 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	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率				
第9	第23期(2020年 3月9日)	円 9,973	円 2	% △19.4	9,877	% △19.5	% 98.7	% 1.3	百万円 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
第13	第35期(2022年 3月7日)	12,880	3	△10.1	12,757	△10.1	99.2	0.6	76,350
	第36期(2022年 5月9日)	13,481	154	5.9	13,357	4.7	99.3	1.6	81,013
	第37期(2022年 7月7日)	13,507	26	0.4	13,385	0.2	99.5	0.5	83,439

(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 J P X 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当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		株式組 比率	株式先 物比率
		円	騰落率	円	騰落率		
第35期	(期首)2022年1月7日	14,327	—	14,191	—	99.3	0.6
	1月末	13,611	△5.0	13,482	△5.0	99.1	0.8
	2月末	13,550	△5.4	13,418	△5.4	99.3	0.6
	(期末)2022年3月7日	12,883	△10.1	12,757	△10.1	99.2	0.6
第36期	(期首)2022年3月7日	12,880	—	12,757	—	99.2	0.6
	3月末	14,127	9.7	13,841	8.5	98.3	1.6
	4月末	13,788	7.0	13,508	5.9	98.3	1.8
	(期末)2022年5月9日	13,635	5.9	13,357	4.7	99.3	1.6
第37期	(期首)2022年5月9日	13,481	—	13,357	—	99.3	1.6
	5月末	13,735	1.9	13,601	1.8	98.4	1.5
	6月末	13,450	△0.2	13,303	△0.4	98.5	1.4
	(期末)2022年7月7日	13,533	0.4	13,385	0.2	99.5	0.5

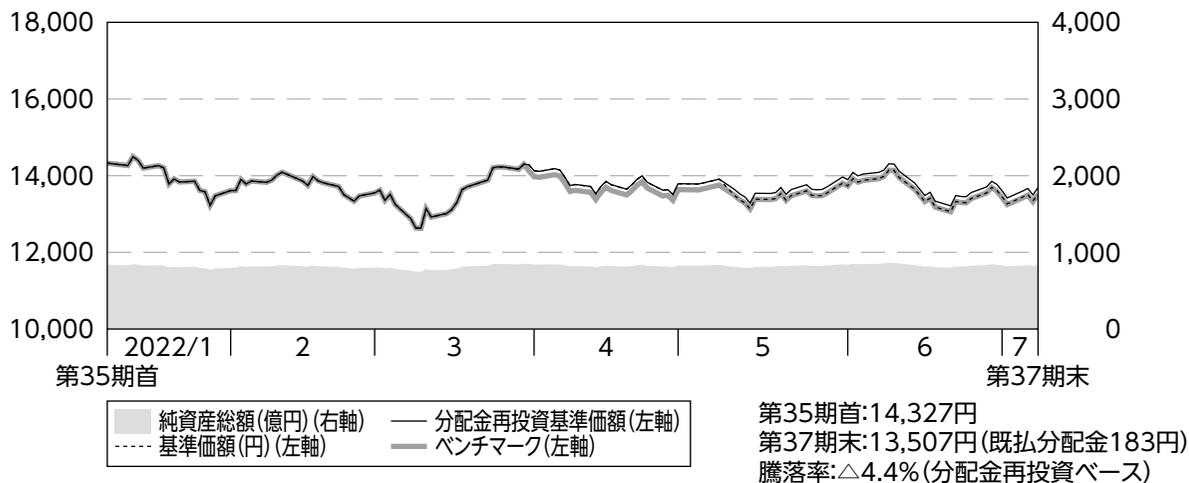
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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、2022年1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下落しました。

投資環境



当作成期の国内株式市場は下落しました。新型コロナウイルス変異株の感染拡大や米国の金融引き締め、ウクライナを巡る地政学リスクなどが懸念され、国内株式市場は2022年3月にかけて下落しました。当作成期末にかけては、引き続き米国の金融引き締めなどが重石となる一方で、ウクライナ情勢への過度な懸念が後退したこと、円安・米ドル高の進行による輸出関連企業の業績改善が期待されたこと、中国・上海のロックダウン（都市封鎖）が解除されたことなどから、国内株式市場はやや値を戻しました。

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) 先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持し、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) TOPIX構成銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、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。

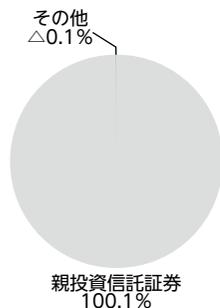
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

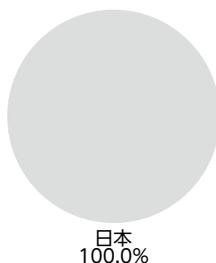
	当作成期末
	2022年7月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

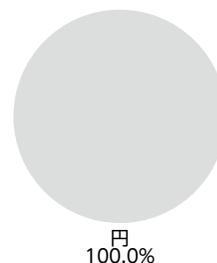
○資産別配分



○国別配分



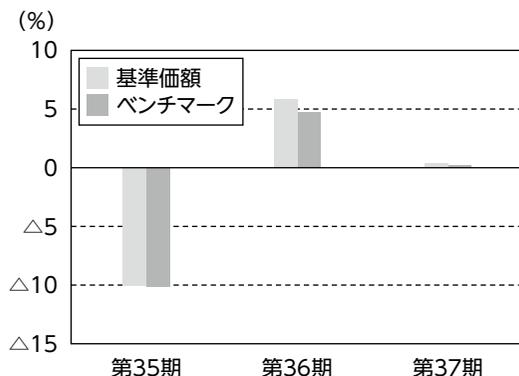
○通貨別配分



(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35期	第36期	第37期
	2022年1月8日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年5月9日	2022年5月10日～ 2022年7月7日
当期分配金 (円)	3	154	26
(対基準価額比率) (%)	(0.023)	(1.129)	(0.192)
当期の収益 (円)	3	154	26
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	6,796	6,798	6,800

(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、わが国の金融商品取引所等に上場している株式に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)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
	(2022年1月8日~2022年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	8円	0.060%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は13,710円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(6)	(0.044)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(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 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	8	0.061	

(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
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	2,658,825	4,898,123	686,463	1,282,377

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	66,261,073千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	477,842,415千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.13

(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			当 作 成 期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 6,178	百万円 468	% 7.6	百万円 6,179	百万円 460	% 7.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期			当 作 成 期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 385,459	百万円 29,355	% 7.6	百万円 385,816	百万円 29,031	% 7.5

<平均保有割合 17.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

■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	86百万円	116百万円	1,372百万円

(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	42,920,301	44,892,664	83,558,715

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、263,862,712千口です。

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 83,558,715	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	57,704	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	83,616,419	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 35 期 末 2022年3月7日現在	第 36 期 末 2022年5月9日現在	第 37 期 末 2022年7月7日現在
(A)資 産 総 額	76,384,041,123円	81,956,266,090円	83,616,419,753円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	55,459,854	57,993,610	57,703,966
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	76,328,581,269	81,897,041,152	83,558,715,787
未 収 入 金	—	1,231,328	—
(B)負 債 総 額	33,976,121	942,874,868	177,103,365
未 払 収 益 分 配 金	17,783,364	925,436,730	160,613,453
未 払 信 託 報 酬	15,880,556	17,104,077	16,176,369
未 払 利 息	17	41	18
そ の 他 未 払 費 用	312,184	334,020	313,525
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	76,350,065,002	81,013,391,222	83,439,316,388
元 本	59,277,881,406	60,093,294,190	61,774,405,033
次 期 繰 越 損 益 金	17,072,183,596	20,920,097,032	21,664,911,355
(D)受 益 権 総 口 数	59,277,881,406口	60,093,294,190口	61,774,405,033口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	12,880円	13,481円	13,507円

■損益の状況

項 目	第 35 期 自 2022年1月8日 至 2022年3月7日	第 36 期 自 2022年3月8日 至 2022年5月9日	第 37 期 自 2022年5月10日 至 2022年7月 7日
(A)配 当 等 収 益	△3,097円	△1,597円	△3,403円
受 取 利 息	55	3	99
支 払 利 息	△3,152	△1,600	△3,502
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△8,471,447,311	4,500,819,367	358,223,087
売 買 益	587,784	4,517,729,857	364,307,217
売 買 損	△8,472,035,095	△16,910,490	△6,084,130
(C)信 託 報 酬 等	△16,192,740	△17,438,097	△16,489,894
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	△8,487,643,148	4,483,379,673	341,729,790
(E)前 期 繰 越 損 益 金	15,028,228,507	6,517,468,212	10,063,540,954
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	10,549,381,601	10,844,685,877	11,420,254,064
(配 当 等 相 当 額)	(22,560,870,280)	(23,129,626,098)	(24,293,547,756)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,011,488,679)	(△12,284,940,221)	(△12,873,293,692)
(G)計 (D+E+F)	17,089,966,960	21,845,533,762	21,825,524,808
(H)収 益 分 配 金	△17,783,364	△925,436,730	△160,613,453
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	17,072,183,596	20,920,097,032	21,664,911,355
追 加 信 託 差 損 益 金	10,549,381,601	10,844,685,877	11,420,254,064
(配 当 等 相 当 額)	(22,560,923,597)	(23,129,691,838)	(24,294,207,862)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△12,011,541,996)	(△12,285,005,961)	(△12,873,953,798)
分 配 準 備 積 立 金	17,728,039,526	17,727,342,881	17,714,779,424
繰 越 損 益 金	△11,205,237,531	△7,651,931,726	△7,470,122,133

(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35期首元本額は58,276,852,873円、第35～37期中追加設定元本額は3,656,257,132円、第35～37期中一部解約元本額は158,704,972円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 35 期	第 36 期	第 37 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	21,624,107円	939,236,544円	168,935,210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	22,560,923,597円	23,129,691,838円	24,294,207,862円
(D) 分配準備積立金額	17,724,198,783円	17,713,543,067円	17,706,457,667円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	40,306,746,487円	41,782,471,449円	42,169,600,739円
(F) 期末残存口数	59,277,881,406口	60,093,294,190口	61,774,405,033口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	6,799円	6,952円	6,826円
(H) 分配金額(1万口当たり)	3円	154円	26円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	17,783,364円	925,436,730円	160,613,453円

分配金のお知らせ

	第35期	第36期	第37期
1万口当たり分配金	3円	154円	26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

株式会社東京証券取引所の市場区分再編に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年4月4日)

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は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している株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率		
第18期(2018年5月29日)	円	%		%	%	百万円
第19期(2019年5月29日)	15,832	14.6	1,761.85	12.2	98.1	205,946
第20期(2020年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	272,283
第21期(2021年5月31日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	313,448
第22期(2022年5月30日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	98.3	497,213

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 株式先物率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(当期首) 2021年 5月31日	円	%		%	%
6月末	18,550	－	1,922.98	－	1.5
7月末	18,770	1.2	1,943.57	1.1	0.9
8月末	18,361	△1.0	1,901.08	△1.1	0.8
9月末	18,942	2.1	1,960.70	2.0	0.7
10月末	18,942	2.1	1,960.70	2.0	0.7
11月末	19,766	6.6	2,030.16	5.6	1.4
12月末	19,486	5.0	2,001.18	4.1	1.4
2022年 1月末	18,779	1.2	1,928.35	0.3	1.3
2月末	19,433	4.8	1,992.33	3.6	1.1
3月末	18,495	△0.3	1,895.93	△1.4	0.8
4月末	18,414	△0.7	1,886.93	△1.9	0.6
(当期末) 2022年 5月30日	19,205	3.5	1,946.40	1.2	1.6
	18,745	1.1	1,899.62	△1.2	1.8
	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	1.9

(注1)騰落率は期首比です。

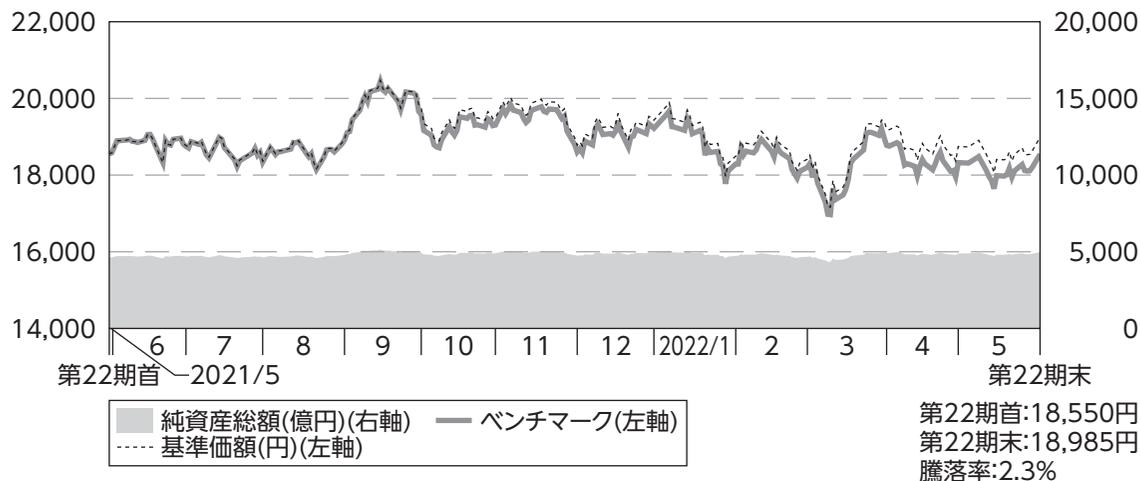
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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 J P X 総研が算出、公表する指数で、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出されます。同指数の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X 総研又は株式会社 J P X 総研の関連会社(以下「J P X」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P X が有します。J P X は、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。本商品は、J P X により提供、保証又は販売されるものではなく、本商品の設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P X は責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

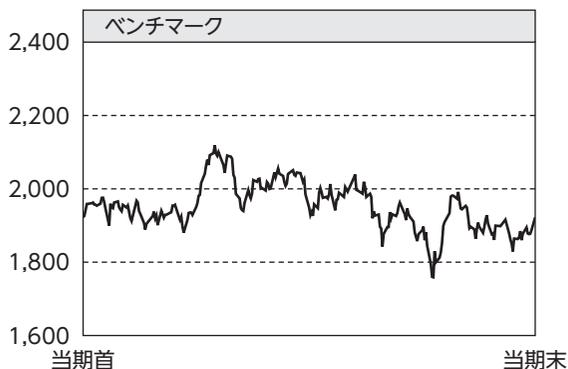


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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



国内株式市場は下落しました。

期初は、堅調な米国株式市場が下支えとなった一方で、国内での新型コロナウイルス新規感染拡大に歯止めがかからず、緊急事態宣言が発出されたことなどから上値の重い展開となりました。9月に入ると、新政権による国内経済対策への期待感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インフレ懸念の高まりなどから下落しました。期末にかけては、国内での新型コロナウイルス変異株の感染拡大や米国の金融引き締めへの警戒感、ウクライナを巡る地政学リスクが高まった一方で、円安・米ドル高の進行による輸出関連企業の業績改善が期待されたこと、米国のインフレ加速への警戒感が後退したことなどを受けて、国内株式市場はやや値を戻しました。

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) TOPIX構成銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、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

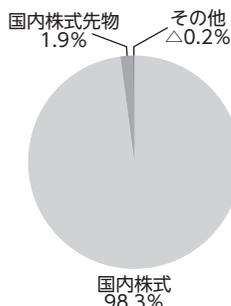
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.9%
2	ソニーグループ	日本	2.9%
3	東証株価指数先物 2206	日本	1.9%
4	キーエンス	日本	1.8%
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.7%
6	日本電信電話	日本	1.7%

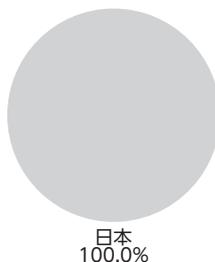
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	東京エレクトロン	日本	1.5%
8	リクルートホールディングス	日本	1.3%
9	任天堂	日本	1.3%
10	日立製作所	日本	1.3%
組入銘柄数			2,103

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

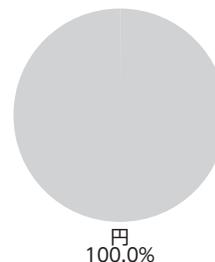
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

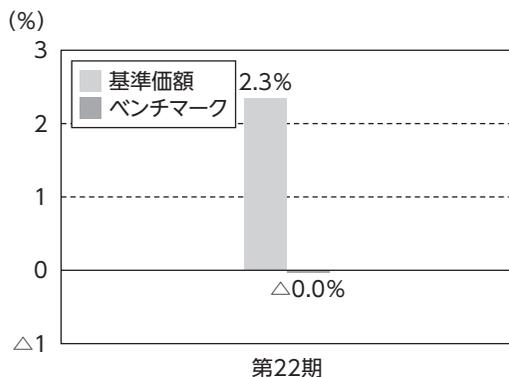


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.9%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、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

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(18,912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 29,302 (7,372)	千円 71,828,645 (-)	千株 16,256	千円 39,141,522

(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 — (5,300)	千円 — (-)	証券 — (5,300)	千円 — (-)

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 59,969	百万円 56,982	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合＞

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	110,970,168千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	475,292,667千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.23

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 809,836	百万円 20,042	% 2.5	百万円 811,443	百万円 19,690	% 2.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■ 利害関係人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	136百万円	106百万円	1,292百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	7.6	8.8	29,524
日本水産	217.9	250.3	131,407
マルハニチロ	36.7	36.9	83,430
雪国まいたけ	19.3	19.2	16,204
カネコ種苗	7.1	7.4	13,238
サカタのタネ	28	29.4	129,507
ホクト	19.7	20.7	39,764
ホクリヨウ	3.6	3.6	2,289
鉱業(0.4%)			
住石ホールディングス	41.1	46	9,660
日鉄鉱業	5.4	5.4	32,022
三井松島ホールディングス	9.8	11	33,275
I N P E X	862.8	944.2	1,492,780
石油資源開発	30.7	30.9	90,258
K&Oエナジーグループ	11.4	10.8	16,621
建設業(2.1%)			
ヒノキヤグループ	5.8	—	—
ショーボンドホールディングス	33.5	33	189,750
ミライト・ホールディングス	81.3	84.6	138,151
タマホーム	14.2	15.9	39,765
サンヨーホームズ	2.7	3	2,232
日本アクア	9.3	10.4	6,520
ファーストコーポレーション	7.2	6.4	4,736
ベステラ	4.5	5.3	6,487
Robot Home	44	43.8	8,497
キャンディル	4	4.1	2,189
スペースバリューホールディングス	28.6	—	—
ダイセキ環境ソリューション	4.5	5.1	4,962
第一カッター興業	5.8	6	7,926
安藤・間	150.4	123.3	97,776
東急建設	68.7	72.7	43,256
コムシスホールディングス	83.2	84.7	208,023
ピーアールホールディングス	31.4	33.9	10,915
高松コンストラクショングループ	14.6	16	32,848
東建コーポレーション	7.2	7.3	64,605
ソネック	2.4	2.7	2,721
ヤマウラ	10.2	11.8	11,021
オリエンタル白石	78.9	88.3	20,838
大成建設	168.6	164.9	653,004
大林組	541.8	578	531,760

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
清水建設	507.5	536.9	367,776
飛鳥建設	15.5	16.2	16,459
長谷工コーポレーション	177.5	168.7	260,978
松井建設	21.3	21.4	14,402
銭高組	2.4	2.4	8,556
鹿島建設	397	423.5	590,359
不動テトラ	13.3	12.9	20,549
大末建設	6.8	6.4	10,195
鉄建建設	10.9	12.6	22,541
西松建設	38.8	36.7	153,039
三井住友建設	130.9	136.8	60,328
大豊建設	11.9	8.9	39,471
前田建設工業	135.7	—	—
佐田建設	12.5	13.1	6,288
ナカノフドー建設	13	14.5	4,611
奥村組	29.8	31.7	90,535
東鉄工業	23.2	25.3	55,204
イチケン	3.9	4.4	8,179
富士ビー・エス	7	7.8	4,001
浅沼組	6.5	6.8	35,768
戸田建設	225	239.1	162,109
熊谷組	25.1	30	80,400
北野建設	3.3	3.7	8,269
植木組	4.8	5.1	7,481
矢作建設工業	23.9	25	19,850
ピーエス三菱	17.8	20	12,060
日本ハウスホールディングス	37	41	17,630
大東建託	59.1	62.1	693,657
新日本建設	23	25.8	19,117
N I P P O	44.8	—	—
東亜道路工業	3.4	3.1	16,554
前田道路	33.5	—	—
日本道路	5.2	5.3	34,609
東亜建設工業	14.5	14	33,194
日本国土開発	52.7	51.2	26,316
若築建設	9.7	9.6	19,017
東洋建設	60.7	68	58,412
五洋建設	230.1	229.1	145,478
世紀東急工業	26	29.1	23,774
福田組	6.3	6.5	30,127
住友林業	127.4	140.4	278,132

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
日本基礎技術	16.5	15.4	8,978	
バコーポレーション	24.1	23.7	10,072	
大和ハウス工業	500.3	507	1,621,893	
ライト工業	31	34.5	57,787	
積水ハウス	587.6	603.3	1,393,321	
日特建設	14.1	12.5	9,650	
北陸電気工事	9.4	11.4	8,675	
ユアテック	31	34.7	24,255	
日本リーテック	11.3	11.9	12,709	
四電工	2.9	6.1	10,321	
中電工	24.9	25.6	53,248	
関電工	88.1	98.7	80,243	
きんでん	110	127.4	190,080	
東京エネシス	18	18.7	17,578	
トーエネック	5.4	6.1	19,520	
住友電設	15.3	15	35,115	
日本電設工業	29.7	28.3	45,053	
エクシオグループ	82.1	86.6	180,820	
新日本空調	14.3	14.1	25,563	
九電工	38	41.2	110,251	
三機工業	38.4	39.4	56,381	
日揮ホールディングス	180.7	176.6	315,584	
中外炉工業	5.9	5.8	9,784	
ヤマト	17.3	15.6	11,466	
太平電業	12	11.8	31,600	
高砂熱学工業	49	49.2	77,637	
三晃金属工業	2.1	2.4	6,700	
朝日工業社	4	7.6	11,985	
明星工業	35	32.7	24,067	
大気社	26.3	26.7	81,969	
ダイダン	12	12.1	24,405	
日比谷総合設備	17.4	17.5	32,970	
フィル・カンパニー	3.1	3.2	3,891	
テスホールディングス	9.9	16.9	23,254	
インフロンア・ホールディングス	—	235.4	222,453	
東洋エンジニアリング	22.8	25.5	16,218	
レイズネクスト	29.1	27.1	31,246	
食料品(3.2%)				
ニッポン	50.7	50.5	81,002	
日清製粉グループ本社	195.9	195.1	297,137	
日東富士製粉	1.3	2.8	11,704	
昭和産業	14.6	16.3	39,869	
鳥越製粉	15.4	15.1	9,648	
中部飼料	21.2	20.7	21,072	
フィード・ワン	23.3	23.9	15,750	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
東洋精糖	2.9	3.3	3,144	
日本甜菜製糖	9	10.1	17,069	
DM三井製糖ホールディングス	13.7	16.3	30,578	
塩水港精糖	20.7	23.1	4,943	
日新製糖	8.2	9.2	16,385	
森永製菓	40.7	41.2	162,946	
中村屋	4.2	4.2	12,936	
江崎グリコ	47.7	48	182,880	
名糖産業	7.6	7.5	11,880	
井村屋グループ	9.8	10	23,320	
不二家	11.1	10.8	26,103	
山崎製パン	130	127.9	193,512	
第一屋製パン	3.3	3.7	1,916	
モロゾフ	2.8	5.9	19,411	
亀田製菓	9.9	10.4	44,512	
寿スピリッツ	16.7	17.5	127,750	
カルビー	79	88.5	213,639	
森永乳業	32.1	33.9	157,974	
六甲バター	11.5	13.3	19,298	
ヤクルト本社	119.3	130.2	910,098	
明治ホールディングス	114.7	112.9	728,205	
雪印メグミルク	41.7	43.9	76,693	
ブリマハム	24.4	24.3	51,831	
日本ハム	66.3	70.1	277,946	
林兼産業	5.7	5.9	2,967	
丸大食品	17.1	18	26,568	
S F o o d s	15.6	17.4	52,809	
柿安本店	6	6.7	16,260	
伊藤ハム米久ホールディングス	111.6	125	82,750	
サッポロホールディングス	59.2	60	168,060	
アサヒグループホールディングス	378.8	416.3	1,813,819	
キリンホールディングス	735.4	713.8	1,424,744	
宝ホールディングス	128.5	116	111,128	
オエノンホールディングス	49.3	52.5	15,592	
養命酒製造	5.3	5.5	9,537	
コカ・コーラ ボトラーズ	132.8	128.1	179,596	
ジャパンホールディングス	116	129.9	633,262	
サントリー食品インターナショナル	116	129.9	633,262	
ダイドーグループホールディングス	9.8	10	49,000	
伊藤園	52.6	59	323,320	
キーコーヒー	17	18.2	37,692	
ユニカフェ	5.2	5.8	5,469	
ジャパンフーズ	2.5	2.8	3,298	
日清オイリオグループ	22.2	23	69,460	
不二製油グループ本社	42.3	42.1	74,938	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
かどや製油	1.9	1.8	6,120
J-オイルミルズ	16.2	18.1	27,837
キッコーマン	124.8	124.3	856,427
味の素	412.4	397.9	1,254,180
ブルドックソース	7.9	7.3	13,183
キュービー	96.5	90.7	195,549
ハウス食品グループ本社	64.8	64.6	175,776
カゴメ	70.9	73.7	245,789
焼津水産化学工業	8.4	8.4	7,921
アリアケジャパン	15.8	17.7	86,287
ビエトロ	2.3	2.5	4,500
エバラ食品工業	3.8	4.2	12,747
やまみ	1.9	1.7	2,701
ニチレイ	82.6	77.8	177,150
東洋水産	89.2	88.8	426,240
イトアンドホールディングス	6	7.3	16,979
大冷	1.9	2.2	4,180
ヨシムラ・フード・ホールディングス	9.7	10	5,470
日清食品ホールディングス	68	66.8	565,796
永谷園ホールディングス	8.5	8.6	17,621
一正蒲鉾	6.7	7.8	6,427
フジッコ	18.8	18.1	34,752
ロック・フィールド	18.7	19.8	27,937
日本たばこ産業	929.7	1,041.3	2,457,468
ケンコーマヨネーズ	10.6	10.2	13,800
わらべや日洋ホールディングス	11.3	12	19,836
なとり	9.7	10.8	22,140
イフジ産業	2.7	3.4	3,423
ビックスコーポレーション	4.1	9.3	12,657
ファーマフーズ	16.4	24.5	39,322
北の達人コーポレーション	60.5	—	—
ユウグレナ	88.3	99.8	86,526
紀文食品	10.1	15.1	14,994
ミヨシ油脂	6.1	7	7,252
理研ビタミン	16.4	17.7	29,151
繊維製品(0.4%)			
片倉工業	23	18.6	39,134
グンゼ	12.5	11.5	42,147
東洋紡	67.2	75.4	78,114
ユニチカ	50.9	54.1	13,038
富士紡ホールディングス	8.3	8.1	27,499
倉敷紡績	15.9	14.8	28,401
シキボウ	9.5	9.9	8,959
日本毛織	56.2	50.8	47,498
トーア紡コーポレーション	6.7	7	2,681

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
帝国繊維	19.3	20.6	30,405
帝人	159.5	170.8	230,409
東レ	1,225.8	1,242.3	833,831
サカイオーベックス	4.6	—	—
住江織物	3.7	3.4	5,895
日本フェルト	10.7	11.9	5,140
イチカワ	2.6	2.7	3,720
日東製網	1.8	2	2,754
アツギ	13.3	14.3	7,607
ダイニック	6.4	6.5	4,537
セーレン	41.8	36.5	74,715
ソトー	7	7.2	6,307
東海染工	2.3	2.4	2,822
小松マテーレ	28	29.5	40,120
ワコールホールディングス	42.3	42.1	85,673
ホギメディカル	22.9	24.3	75,330
T S I ホールディングス	52.1	60.1	19,833
マツオカコーポレーション	5.5	5.9	5,941
ワールド	22.3	24.9	35,905
三陽商会	8.8	8.6	7,748
ナイガイ	6.8	7.1	2,172
オンワードホールディングス	102.4	108.4	28,292
ルックホールディングス	5.9	6.2	10,223
ゴールドウイン	28	32.3	254,201
デサント	29	34	83,164
キング	9.4	9.3	5,022
ヤマトインターナショナル	15.5	15.7	4,474
パルプ・紙(0.2%)			
特種東海製紙	10.4	10.4	33,176
王子ホールディングス	761.7	751.6	426,908
日本製紙	74.8	81.5	77,914
三菱製紙	24	25.1	7,555
北越コーポレーション	121	116.7	70,953
中越パルプ工業	6.4	7.2	6,595
巴川製紙所	5.6	5.6	3,550
大王製紙	81.6	84.6	119,962
阿波製紙	4.4	4.5	1,426
レンゴー	174.5	157.4	110,967
トーモク	10.4	10.1	14,756
ザ・バック	12.8	12.8	28,633
化学(6.4%)			
北の達人コーポレーション	—	67.8	12,543
クラレ	266.5	262.9	287,875
旭化成	1,121.5	1,200.3	1,263,915
共和レザー	9.2	10.8	6,177

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
昭和電工	128.5	165.9	415,745	
住友化学	1,331.9	1,326.1	701,506	
住友精化	8.2	7.8	22,573	
日産化学	93.3	91.6	676,008	
ラサ工業	5.5	6.7	12,864	
クレハ	14.5	14.2	144,982	
多木化学	6.6	6.6	29,304	
テイカ	12.4	11.8	14,136	
石原産業	30.3	33.2	34,561	
片倉コープアグリ	4.4	4.3	5,878	
日本曹達	23.6	21.9	87,928	
東ソー	261.5	247.4	466,349	
トクヤマ	50.3	57.7	98,436	
セントラル硝子	32.3	29.3	82,245	
東亜合成	103.2	95.3	98,444	
大阪ソーダ	17.2	15.5	47,507	
関東電化工業	40.1	36.9	34,501	
デンカ	61.7	65.6	213,528	
信越化学工業	312.9	308.7	5,633,775	
日本カーバイド工業	6.2	6.8	9,805	
堺化学工業	11.9	12.6	23,990	
第一稀元素化学工業	17	16.6	17,546	
エア・ウォーター	172.5	161	280,623	
日本酸素ホールディングス	139.4	164.8	408,704	
日本化学工業	4.8	5.5	11,451	
東邦アセチレン	2.5	3.9	4,430	
日本パーカライジング	85.4	85	78,200	
高圧ガス工業	26.8	27.8	17,958	
チタン工業	2.1	2.2	3,960	
四国化成工業	22.5	22.7	28,375	
戸田工業	3.6	4	10,544	
ステラ ケミファ	9.2	9.5	24,576	
保土谷化学工業	5	5.4	19,440	
日本触媒	30.6	28.6	149,578	
大日精化工業	14	14.2	26,255	
カネカ	43.8	43.6	145,842	
三菱瓦斯化学	169.5	158.2	329,214	
三井化学	146.1	155.7	489,676	
J S R	169.8	176.6	712,581	
東京応化工業	29	29	216,630	
大阪有機化学工業	15.6	14.4	40,046	
三菱ケミカルホールディングス	1,131.1	1,206.6	934,391	
KHネオケム	27.9	29.8	74,827	
ダイセル	227.5	260.9	214,981	
住友ベークライト	26.6	27.8	122,181	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
積水化学工業	357.8	377.7	693,079	
日本ゼオン	152.6	151.9	207,039	
アイカ工業	47.1	47.4	135,801	
UBE	85.4	89.3	178,957	
積水樹脂	27.9	26.9	44,546	
タキロンシーアイ	36.6	41	21,853	
旭有機材	9.6	10.7	21,838	
ニチバン	8.9	10.4	16,764	
リケンテクノス	41.3	41.1	17,590	
大倉工業	8	8.7	14,607	
積水化成工業	22.7	23.5	9,470	
群栄化学工業	3.9	4	10,480	
タイガースポリマー	8.9	9.4	3,985	
ミライアル	5.4	6.1	10,949	
ダイキアクシス	6.5	7.4	5,698	
ダイキョーニシカワ	35.7	40	19,480	
竹本容器	6	6.8	5,548	
森六ホールディングス	9.1	9.5	17,746	
恵和	3.3	5.2	24,622	
日本化薬	104.7	136.6	149,713	
カーリットホールディングス	16.8	16.9	10,883	
日本精化	12.2	13.2	27,218	
扶桑化学工業	13.3	15.6	61,074	
トリケミカル研究所	15.7	19.5	50,329	
ADEKA	77.9	79	198,922	
日油	63.7	58.1	280,623	
新日本理化	28	28.4	7,213	
ハリマ化成グループ	12.6	13.1	9,890	
花王	413.7	409	2,149,704	
第一工業製薬	5.7	6.6	14,902	
石原ケミカル	4.3	9.1	11,547	
日華化学	5.7	6.4	5,222	
ニイタカ	3.5	3.7	8,010	
三洋化成工業	10.1	11.3	52,149	
有機合成薬品工業	13	13.2	3,735	
大日本塗料	19.1	22	16,500	
日本ペイントホールディングス	698	712	694,912	
関西ペイント	190.1	174.7	280,393	
神東塗料	13.3	14.9	2,324	
中国塗料	40.8	42.2	36,629	
日本特殊塗料	12.7	12.3	11,168	
藤倉化成	22.8	23.6	11,328	
太陽ホールディングス	12.4	27.9	91,233	
D I C	71.5	72.4	181,072	
サカタインクス	36.9	37.6	35,607	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
東洋インキSCホールディングス	35.8	37.6	73,207
T&K TOKA	11.8	15.3	13,050
富士フイルムホールディングス	303.6	340.1	2,370,156
資生堂	343.3	360.4	1,979,677
ライオン	224.6	205.1	288,370
高砂香料工業	10.8	11.7	27,261
マンダム	36.2	38.7	55,263
ミルボン	23.1	23.9	124,041
ファンケル	62.9	78.3	169,362
コーセー	32.5	36.4	435,344
コタ	10.9	13.5	19,615
シーボン	2.2	2.5	4,422
ポーラ・オルビスホールディングス	73.7	82.6	131,416
ノエビアホールディングス	14.7	15	83,700
アジュバンホールディングス	3.9	4.3	4,420
新日本製薬	4.7	7.9	10,404
エステー	11.1	12.4	18,141
アグロ カネショウ	6.5	6.4	8,236
コニシ	28.4	30.2	47,776
長谷川香料	29.8	33.4	83,032
星光PMC	9.9	10.9	6,223
小林製薬	48.4	54.2	476,960
荒川化学工業	14.4	14.5	14,166
メック	11.8	13.7	39,976
日本高純度化学	4.7	4.8	11,049
タカラバイオ	45.2	50.6	92,092
JCU	19.4	20.4	75,174
新田ゼラチン	10.8	11.4	7,102
OATアグリオ	3.3	8	13,096
デクセリアルズ	48.3	50.4	209,916
アース製薬	13	15.9	82,362
北興化学工業	16.1	16.8	17,068
大成ラミック	5.3	5.4	14,250
クミアイ化学工業	71.4	72	72,648
日本農薬	30.8	34.5	24,736
アキレス	11.9	12.4	17,000
有沢製作所	24	26.9	29,321
日東電工	104.4	117	1,086,930
レック	20.5	23.7	16,945
三光合成	18.1	22.1	7,646
きもと	26.4	29.6	6,926
藤森工業	15.5	15.8	55,695
前澤化成工業	11	11.7	14,917
未来工業	6.2	6.9	10,908
ウェーブロックホールディングス	6	7.3	5,037

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
JSP	10.1	11.3	15,921
エフビコ	31.8	35.6	97,650
天馬	12.9	15.2	34,032
信越ポリマー	26.6	34.7	38,100
東リ	43	45.5	9,373
ニフコ	63.4	64.6	196,707
バルカー	14	15.7	43,175
ユニ・チャーム	366.3	373	1,678,127
ショーエイコーボレーション	3.8	5.2	3,120
医薬品(5.2%)			
協和キリン	173.8	205.5	574,783
武田薬品工業	1,437.4	1,520.9	5,694,249
アステラス製薬	1,497.9	1,654.3	3,377,253
住友ファーマ	128.1	119.5	130,374
塩野義製薬	217.3	230.9	1,573,814
わかもと製薬	20.6	20.2	5,393
日本新薬	49	45	362,700
ビオフェルミン製薬	2.9	—	—
中外製薬	540.4	605.2	2,126,672
科研製薬	29.6	28.5	103,740
エーザイ	190.9	219.7	1,185,720
ロート製薬	82.3	94.6	324,005
小野薬品工業	396.7	393.8	1,362,941
久光製薬	50.2	44.3	152,613
持田製薬	24	22.5	70,087
参天製薬	300.6	345.1	362,009
扶桑薬品工業	5.6	6.4	14,444
日本ケミファ	2.1	2.1	4,032
ツムラ	57.6	56.9	168,367
日医工	48.9	57.2	20,763
キッセイ薬品工業	30.6	30.1	77,838
生化学工業	30.5	34.1	25,984
栄研化学	30.4	30.5	51,972
日水製薬	6.3	7.1	7,029
鳥居薬品	10.8	10.4	31,408
JCRファーマ	48.7	54.5	131,835
東和薬品	24.9	27.9	69,108
富士製薬工業	10.6	10.9	10,060
ゼリア新薬工業	31.3	30.9	62,912
第一三共	1,357.7	1,442.7	4,997,512
キョーリン製薬ホールディングス	38.1	36.2	61,431
大幸薬品	21.2	29.2	18,279
ダイト	11	12.2	32,195
大塚ホールディングス	359.1	379.8	1,662,384
大正製薬ホールディングス	41.1	39.2	193,452

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ペプチドリーム	89.1	101.5	166,764
あすか製菓ホールディングス	19.7	19.6	19,560
サワイグループホールディングス	37.8	38.9	150,932
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	146	163.5	20,764
ニチレキ	20.4	22.2	28,926
ユシロ化学工業	9.7	9.5	9,367
ビービー・カストロール	6.2	6.9	8,500
富士石油	41.9	45.4	14,119
MORESCO	6.2	6.4	7,808
出光興産	191.7	202.8	707,772
ENEOSホールディングス	2,599	2,910.9	1,506,099
コスモエネルギーホールディングス	54.6	69.6	241,860
ゴム製品(0.7%)			
横浜ゴム	100	98.5	163,805
TOYO TIRE	90.9	95.7	165,178
ブリヂストン	459.4	528.8	2,679,958
住友ゴム工業	155.2	163.3	191,387
藤倉コンポジット	15.1	15.5	13,671
オカモト	10.5	9.9	38,362
フコク	7.6	8.5	8,440
ニッタ	17.9	18.8	52,489
住友理工	33.5	37.5	21,112
三ツ星ベルト	21	23.5	66,716
バンドー化学	30.4	31.2	28,735
ガラス・土石製品(0.7%)			
日東紡績	25.7	25.6	67,302
AGC	158.6	168.6	832,041
日本板硝子	87.7	89.3	34,469
石塚硝子	2.9	3.1	5,359
日本山村硝子	7.3	7.1	5,474
日本電気硝子	64.1	73.8	202,581
オハラ	6.9	7.8	9,539
住友大阪セメント	31.1	32.9	109,557
太平洋セメント	102.3	110	214,500
日本ヒューム	15.9	17.2	11,902
日本コンクリート工業	37.6	36.3	10,055
三谷セキサン	8.1	8.3	42,911
アジアパイルホールディングス	26.8	28.5	13,110
東海カーボン	169	153.3	164,337
日本カーボン	9.6	10	42,500
東洋炭素	10.2	11.8	33,972
ノリタケカンパニーリミテド	9.6	10.1	42,319
TOTO	123.4	124.1	541,076
日本碍子	190.2	197	372,330
日本特殊陶業	131.5	139.1	340,099

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
MARUWA	6	6.7	105,458
品川リフラクトリーズ	4.1	4.6	16,767
黒崎播磨	3	3.3	14,107
ヨータイ	12.5	12.4	19,753
イソライト工業	7.8	—	—
東京窯業	22.4	21.4	5,970
ニッカトー	8	8.5	4,080
フジミインコーポレーテッド	13.9	15.5	88,815
クニミネ工業	5.5	6.2	6,144
エーアンドエーマテリアル	3.3	3.3	2,894
ニチアス	43.7	42.2	94,950
ニチハ	24.1	25.5	60,537
鉄鋼(0.8%)			
日本製鉄	815.6	818.4	1,815,211
神戸製鋼所	312.8	341.4	231,469
中山製鋼所	23.9	28	12,096
合同製鐵	9.3	9.7	12,367
ジェイエフイーホールディングス	494.4	467.6	743,016
東京製鐵	66.6	59.1	91,605
共英製鋼	19.3	19.8	25,898
大和工業	36.3	32.6	141,321
東京鐵鋼	6.6	8.1	9,825
大阪製鐵	9.1	10.2	14,371
淀川製鋼所	22.5	22.4	51,318
丸一鋼管	55.5	57.2	169,197
モリ工業	5.1	5	12,010
大同特殊鋼	28	27.9	102,672
日本高周波鋼業	6.5	7.3	2,489
日本冶金工業	13.3	13.4	30,016
山陽特殊製鋼	20.5	17.5	36,680
愛知製鋼	9.6	10.8	21,729
日立金属	161.1	206.2	425,390
日本金属	4.3	4.8	5,654
大平洋金属	11.6	11.8	34,314
新日本電工	110.5	112	40,096
栗本鐵工所	7.8	8.2	13,185
虹技	2.4	2.6	2,545
三菱製鋼	12.7	12.3	11,758
日亜鋼業	25.3	23.1	5,913
日本精線	2.5	3	12,495
エンビプロ・ホールディングス	7.4	12.7	11,887
シンニッタン	21	23.4	5,194
新家工業	4.3	4.3	6,282
非鉄金属(0.8%)			
大紀アルミニウム工業所	25.9	25.4	34,544
日本軽金属ホールディングス	46.6	48.5	76,533

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
三井金属鉱業	46.1	51.7	176,555	
東邦亜鉛	9.5	10.1	24,108	
三菱マテリアル	112.9	115.9	230,525	
住友金属鉱山	218.4	221.3	1,196,569	
DOWAホールディングス	43.3	47.2	222,548	
古河機械金属	28.3	30.1	37,173	
大阪チタニウムテクノロジーズ	17.9	22.2	41,913	
東邦チタニウム	30.7	34.3	72,270	
UACJ	26	27.2	59,051	
CKサンエツ	3.6	3.8	15,656	
古河電気工業	53.1	56.7	123,039	
住友電気工業	596.3	683.7	997,176	
フジクラ	206.3	213.4	162,824	
昭和電線ホールディングス	16.6	16.7	29,475	
東京特殊電線	2.2	2.6	6,032	
タツタ電線	30.4	34	16,218	
カナレ電気	2.9	2.9	4,903	
平河ヒューテック	9.6	10.7	11,834	
リョービ	21.1	21	22,869	
アーレスティ	21.3	20.7	7,659	
アサヒホールディングス	64.2	76.7	160,379	
金属製品(0.6%)				
稲葉製作所	9.6	10	13,000	
宮地エンジニアリンググループ	5.6	5.5	18,590	
トーカロ	44.1	49.4	67,134	
アルファC o	6	6.9	6,713	
SUMCO	217.9	308.5	636,127	
川田テクノロジーズ	3.5	3.7	12,617	
RS Technologies	5.5	6.2	37,634	
ジェイテックコーポレーション	1.9	2.5	5,692	
信和	9.1	11.9	9,436	
東洋製罐グループホールディングス	108.8	105.6	144,144	
ホッカンホールディングス	8.7	9.4	11,486	
コロナ	9.4	9.7	7,954	
横河ブリッジホールディングス	29.3	29.2	56,472	
駒井ハルテック	3.5	3.2	5,465	
高田機工	1.6	1.7	4,318	
三和ホールディングス	161.1	180.4	227,664	
文化シャッター	50.3	57.8	55,488	
三協立山	22	23.4	13,618	
アルインコ	11.3	13.1	11,095	
東洋シャッター	3.8	4.2	2,700	
LIXIL	235.3	301.2	768,060	
日本ファイルコン	11.9	12.4	6,212	
ノーリツ	35.4	32.6	49,943	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
長府製作所	17.4	19.5	35,100	
リンナイ	33.2	34.1	298,034	
ダイニチ工業	8.2	9.2	5,934	
日東精工	21.4	22.4	11,222	
三洋工業	2.1	2.3	4,146	
岡部	34.6	31.6	20,066	
ジーテクト	21.2	22	28,028	
東プレ	31.9	31.4	31,902	
高周波熱錬	32.9	30.3	19,604	
東京製綱	12.2	11.7	10,904	
サンコール	14.6	16.4	10,496	
モリテック スチール	13.3	14.9	4,619	
パイオラックス	25.3	25.9	43,512	
エイチワン	16.8	17.6	10,331	
日本発條	170.2	166.2	155,729	
中央発條	8.2	9.2	6,504	
アドバネクス	2.5	2.5	4,090	
立川ブラインド工業	7.5	7.8	8,494	
三益半導体工業	13.3	14.9	36,311	
機械(5.4%)				
日本ドライケミカル	4.3	4.5	6,889	
日本製鋼所	51.9	52.2	169,911	
三浦工業	74	77.9	227,779	
タクマ	58	58.4	84,154	
ツガミ	35.5	40.3	49,286	
オークマ	20	19.7	105,592	
芝浦機械	17.8	21.7	68,355	
アマダ	250.6	302.3	315,903	
アイダエンジニアリング	45	44.8	41,619	
滝澤鉄工所	5	5.6	7,442	
F U J I	68.3	80.4	180,980	
牧野フライス製作所	20.1	20	85,800	
オーエスジー	84.4	85.6	146,033	
ダイジェット工業	2.1	2.4	2,172	
旭ダイヤモンド工業	45.3	48.4	29,136	
DMG森精機	108.2	108.6	214,919	
ソディック	41.1	41.8	31,893	
ディスコ	23.2	28.2	992,640	
日東工器	8.2	9.7	14,433	
日進工具	13.5	15.1	20,490	
パンチ工業	14.4	16.4	7,691	
富士ダイス	8.7	9.8	6,566	
豊和工業	9.7	10.2	8,302	
OKK	6.6	7.1	7,753	
東洋機械金属	12.4	12.6	7,686	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
津田駒工業	3.3	3.4	1,876	
エンシュウ	4.4	4.6	3,496	
島精機製作所	25.1	28.1	56,762	
オプトラン	21.5	24	48,528	
NCホールディングス	5.3	4.9	8,962	
イワキポンプ	11	12.3	12,140	
フリュー	16.8	17.1	17,801	
ヤマシンフィルタ	34.6	33.2	10,159	
日阪製作所	21.2	21.1	17,470	
やまびこ	33.2	33.7	40,507	
野村マイクロ・サイエンス	—	6.3	26,964	
平田機工	8.1	8.6	36,163	
ペガサスミシン製造	17.5	19.6	11,191	
マルマエ	7.1	7.9	16,724	
タツモ	7.3	9	10,800	
ナブテスコ	100.7	104.3	329,588	
三井海洋開発	18.2	20.4	25,663	
レオン自動車	16.8	20.5	27,654	
SMC	50.6	56.7	3,766,014	
ホソカワミクロン	6	12.8	32,460	
ユニオンツール	6.4	7.2	26,460	
オイレス工業	24	25.5	39,856	
日精エー・エス・ビー機械	5.8	7.1	22,400	
サトーホールディングス	22.5	25.2	48,031	
技研製作所	15.1	17	61,880	
日本エアテック	5.7	8.9	9,763	
カワタ	4.8	5.9	6,035	
日精樹脂工業	13.3	12.8	11,622	
オカダアイヨン	5.5	6.1	9,351	
ワイエイシイホールディングス	6.8	7.6	13,976	
小松製作所	782.8	877	2,816,924	
住友重機械工業	99	105.9	326,172	
日立建機	80.8	77.6	234,352	
日工	26.1	25.3	15,508	
巴工業	6.8	7.2	17,496	
井関農機	17.4	16.3	20,179	
TOWA	16.2	16.6	30,643	
丸山製作所	3.6	3.5	5,439	
北川鉄工所	7.9	8.1	11,542	
ローツェ	7.6	9.5	104,690	
タカキタ	6.2	6.3	3,641	
クボタ	907.6	937.5	2,253,281	
荏原実業	4.4	9	21,816	
三菱化工機	5.6	6	12,510	
月島機械	32	32.3	28,811	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
帝国電機製作所	12.1	12.8	20,531	
新東工業	41.3	38.7	26,470	
澁谷工業	15.2	15.9	36,824	
アイチ コーポレーション	29.6	27.9	25,249	
小森コーポレーション	44.1	47.1	35,984	
鶴見製作所	13.4	14.2	25,616	
住友精密工業	2.6	2.9	7,943	
日本ギア工業	7.2	7.2	1,951	
酒井重工業	3.1	3.3	9,781	
荏原製作所	71.7	77.5	427,800	
石井鐵工所	2.5	2.5	7,162	
西島製作所	17.7	16.5	21,466	
北越工業	17.9	17	13,906	
ダイキン工業	220.1	223.1	4,604,784	
オルガノ	5.6	5.6	55,664	
トーヨーカネツ	6.6	7	19,586	
栗田工業	93.5	100.1	496,496	
椿本チエイン	24.7	25.4	79,121	
大同工業	8.4	8.4	7,005	
木村化工機	14.6	15.7	10,424	
アネスト岩田	29.2	30.2	26,032	
ダイフク	95.1	96.4	795,300	
サムコ	4.3	5.2	13,972	
加藤製作所	9.7	9.5	7,647	
油研工業	3	3.2	5,664	
タダノ	83.6	96.3	92,448	
フジテック	59.5	62.7	164,838	
CKD	40.1	51.7	98,281	
キトー	14.6	15.6	41,277	
平和	48.2	54	104,544	
理想科学工業	12.7	15.7	33,990	
SANKYO	41.1	41.8	178,277	
日本金銭機械	19.3	19.8	13,642	
マースグループホールディングス	11	12.3	21,008	
フクシマガリレイ	11.9	12.4	42,222	
オーイズミ	7.5	7	3,010	
ダイコク電機	8	9	10,548	
竹内製作所	28.9	29.5	68,646	
アマノ	45.3	50.7	125,533	
JUKI	24	26.9	18,776	
ジャノメ	15.8	16.6	11,586	
マックス	23.2	23.9	37,546	
グローリー	44.4	47.2	94,872	
新晃工業	16.1	18.1	27,475	
大和冷機工業	27.8	28.1	29,027	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
セガサミーホールディングス	157.2	192	459,456
日本ビストンリング	6.4	7.1	9,222
リケン	8	7.5	17,437
T P R	23.3	23.2	28,628
ツバキ・ナカシマ	33.3	42.6	41,322
ホシザキ	54.4	56.6	438,084
大豊工業	14.2	15.9	11,257
日本精工	354.9	342.4	256,800
NTN	399.8	373.2	97,778
ジェイテクト	165.8	172	169,076
不二越	16.1	14.5	53,940
日本トムソン	47.5	47.3	26,629
THK	107.7	109.3	302,542
ユースン精機	11.6	15.1	10,464
前澤給装工業	12.1	13.3	10,932
イーグル工業	21.4	22	21,450
前澤工業	10.5	12.2	7,259
日本ビラー工業	17.5	17.6	50,723
キッツ	53.5	58.1	39,682
マキタ	225.3	224.3	798,059
三井E&Sホールディングス	—	70.2	25,342
日立造船	137.3	157.2	125,288
三菱重工業	271.5	290.6	1,446,316
I H I	116.2	120.9	447,330
スター精密	26.7	27	45,468
電気機器 (18.3%)			
日清紡ホールディングス	105.7	111.7	115,386
イビデン	83.3	96.2	459,355
コニカミノルタ	352.2	405.5	175,987
ブラザー工業	211.4	226.3	540,178
ミネベアミツミ	298.2	317	745,584
日立製作所	830.7	930.7	6,310,146
東芝	341.9	338.2	1,971,029
三菱電機	1,727.6	1,849	2,622,806
富士電機	104.1	110.6	668,024
東洋電機製造	7	6.6	5,979
安川電機	186	197.6	883,272
シンフォニアテクノロジー	22.5	20.9	28,424
明電舎	29.4	29.2	60,502
オリジン	4.9	4.6	5,915
山洋電気	8.5	7.8	42,978
デンヨー	14.8	14.7	23,475
P H Cホールディングス	—	30.7	44,607
東芝テック	18.6	20.8	84,136
芝浦メカトロニクス	3.2	3.5	37,520

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
マブチモーター	48.1	44.7	159,355
日本電産	415.9	453.9	3,922,603
トレックス・セミコンダクター	9.8	9.2	27,176
東光高岳	9.5	11.4	20,303
ダイヘン	18.9	19	78,375
ヤーマン	28.9	32.6	39,315
J V Cケンウッド	154.1	164	31,160
ミマキエンジニアリング	17	19.5	11,173
I - P E X	8.5	9.9	13,761
日新電機	40.6	45.3	67,995
大崎電気工業	34.6	33.5	16,616
オムロン	143.8	161.1	1,196,167
日東工業	25.4	24.3	53,217
I D E C	23.2	24	63,408
正興電機製作所	6.1	6.7	7,316
不二電機工業	3.7	4.6	5,451
ジーエス・ユアサ コーポレーション	62.4	60.3	125,544
サクサホールディングス	4.2	4.5	6,817
メルコホールディングス	6.2	5.4	19,764
テクノメディカ	4.5	5.1	8,246
日本電気	219.5	235	1,236,100
富士通	155.5	174.1	3,394,950
沖電気工業	70.3	75.1	56,700
岩崎通信機	7.6	7.9	6,912
電気興業	8.4	9.6	24,480
サンケン電気	20.2	17.1	93,879
ナカヨ	3.5	3.3	3,709
アイホン	9.9	9.5	16,150
ルネサスエレクトロニクス	744.7	1,052.4	1,610,172
セイコーエプソン	214.4	224.1	482,935
ワコム	126.6	151.3	146,761
アルバック	31.8	38.5	213,290
アクセル	8.3	9.1	7,689
E I Z O	14.7	14.1	49,279
日本信号	40.4	43.8	39,901
京三製作所	37.5	39	16,965
能美防災	23.4	23.9	40,653
ホーチキ	13.4	13.7	16,714
星和電機	10.4	10.8	5,000
エレコム	40.1	45.1	70,401
パナソニック ホールディングス	1,842.6	2,063.8	2,473,464
シャープ	229.8	196.1	209,238
アンリツ	103.9	124.6	179,922
富士通ゼネラル	52.8	52.5	132,877
ソニーグループ	1,082.3	1,212.1	14,539,139

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
TDK	83.5	280.5	1,238,407
帝国通信工業	8.6	9.4	13,667
タムラ製作所	62.4	71.3	39,286
アルプスアルパイン	142	163.3	227,803
池上通信機	5.5	5.7	3,448
日本電波工業	—	20.4	23,276
鈴木	8.8	11	9,394
メイコー	—	21.2	96,248
日本トリム	4	4.2	10,134
ローランド ディー・ジー	10.7	11.8	37,347
フォスター電機	17.6	18.5	13,042
SMK	4.5	4.5	9,792
ヨコオ	13.9	13.9	33,554
ホシデン	48.2	45	56,115
ヒロセ電機	26.6	28.3	502,608
日本航空電子工業	39.7	40.7	80,626
TOA	20.6	20.7	16,767
マクセル	35.2	37.3	46,028
古野電気	23.2	24.2	24,514
ユニデンホールディングス	4.5	4.2	14,196
スミダコーポレーション	15.7	19.6	16,444
アイコム	7.2	6.5	15,710
リオン	7.7	7.4	19,173
本多通信工業	15.6	17.5	9,030
横河電機	173	182.9	421,767
新電元工業	6.7	7	22,750
アズビル	116.9	113.4	425,250
東亜ディーケーケー	9.8	10.8	10,497
日本光電工業	71.7	76.8	233,472
チノー	5.6	6.1	10,351
共和電業	18.7	18.5	6,382
日本電子材料	7.2	9.3	17,577
堀場製作所	34.2	34.1	226,083
アドバンテスト	128.5	143.8	1,264,002
小野測器	9.2	10.3	4,532
エスベック	15.8	15.4	27,612
キーエンス	169.6	175.3	9,052,492
日置電機	8.5	9.4	67,586
シスメックス	134.9	147.1	1,237,699
日本マイクロニクス	30.7	31.3	46,167
メガチップス	17.6	17.5	63,175
OBARA GROUP	8.1	8.4	24,628
澤藤電機	2.3	3.2	4,883
原田工業	8.2	10.5	10,174
コーセル	22	23	17,986

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
イリソ電子工業	14.7	16.6	55,444
オブテックグループ	28.9	32.4	64,249
千代田インテグレ	7.8	8.2	16,072
アイ・オー・データ機器	7.3	—	—
レーザーテック	75.9	81.3	1,514,212
スタンレー電気	121.2	128.7	300,643
岩崎電気	7	6.9	17,201
ウシオ電機	89.2	94.8	166,089
岡谷電機産業	15.3	18.2	5,296
ヘリオス テクノ ホールディング	18.9	20.6	6,056
エノモト	5.4	6.1	10,138
日本セラミック	17.9	18.6	39,357
遠藤照明	10.1	10.4	8,392
古河電池	13	14.8	17,819
双信電機	10.5	11.3	6,723
山一電機	11.9	13.7	25,687
図研	11.6	13	37,011
日本電子	31.6	38.4	240,768
カシオ計算機	139	124.7	147,146
ファナック	151.6	169.8	3,619,287
日本シイエムケイ	39.4	38.1	17,792
エンブラス	8.1	5.1	17,161
大真空	6.2	25.8	26,445
ローム	71.9	82.6	883,820
浜松ホトニクス	124.1	132.4	801,020
三井ハイテック	17.2	17.5	191,800
新光電気工業	58.3	57.1	277,220
京セラ	263.5	272.4	2,001,867
太陽誘電	77	88.9	464,947
村田製作所	507.6	541.5	4,465,750
双葉電子工業	30.8	34.9	24,011
北陸電気工業	7.6	8.2	9,987
ニチコン	55.3	55.6	73,670
日本ケミコン	17.4	19	34,637
KOA	24.6	28.3	48,251
市光工業	27.3	26.6	9,496
小糸製作所	103.6	100.1	472,972
ミツバ	31.8	32	12,832
SCREENホールディングス	30	31.5	374,850
キヤノン電子	16.5	18.5	28,656
キヤノン	858.5	961.5	3,141,220
リコー	439.6	486	517,590
象印マホービン	47.4	50.3	69,665
MUTOHホールディングス	2.9	3	6,492
東京エレクトロン	101.2	122.8	7,337,300

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
輸送用機器 (7.9%)			
トヨタ紡織	50.4	71.4	149,368
芦森工業	3.3	3.6	3,880
ユニプレス	28.4	30.8	26,549
豊田自動織機	139.8	143.6	1,191,880
モリタホールディングス	27.7	31	40,858
三櫻工業	24	26.8	17,312
デンソー	380.4	394.5	3,105,109
東海理化電機製作所	45.5	50.9	71,412
三井E&Sホールディングス	66.9	—	—
川崎重工業	134.4	134.5	338,536
名村造船所	51.9	52.6	21,355
日本車輛製造	6.3	6.5	13,273
三菱ロジスネクスト	22.9	25.6	22,220
近畿車輛	3	2.9	3,543
日産自動車	2,037.5	2,282	1,146,248
いすゞ自動車	458.7	576.1	863,573
トヨタ自動車	1,750.2	9,148.4	19,454,072
日野自動車	215.7	241.6	171,536
三菱自動車工業	639.5	716.2	275,020
エフテック	12.2	12.7	7,226
レシップホールディングス	6.8	7.7	4,481
GMB	3.2	3.5	2,495
ファルテック	3.1	3.4	2,097
武蔵精密工業	38.5	43.1	59,995
日産車体	25.3	28.3	16,753
新明和工業	48.8	51.9	50,550
極東開発工業	29.8	32.5	45,175
トビー工業	14.3	14.9	19,295
ティラド	5.4	5	14,185
曙ブレーキ工業	94.8	106.2	15,611
タチエス	26.5	32.5	36,985
NOK	83.6	79.8	93,605
フタバ産業	43.4	44.8	17,113
KYB	19.3	18	53,154
大同メタル工業	35.8	37.1	19,477
プレス工業	85.9	88.9	36,715
ミクニ	22.2	23.2	8,328
太平洋工業	36.3	38.1	39,928
河西工業	23.5	23.7	6,825
アイシン	126.5	141.6	584,100
マツダ	542.2	582	636,708
今仙電機製作所	15.2	12.7	7,442
本田技研工業	1,360.3	1,451	4,619,984
スズキ	342.4	403.3	1,544,639

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
S U B A R U	495.1	523.7	1,116,790
安永	8.4	8.3	5,810
ヤマハ発動機	244.1	252.5	659,782
T B K	20.7	20	6,820
エクセディ	23.5	29.2	48,851
豊田合成	55.8	57.3	117,006
愛三工業	27.2	30.3	22,361
盟和産業	2.7	2.7	2,835
日本プラス	14.7	14.4	6,465
ヨロズ	14.9	16.1	13,057
エフ・シー・シー	28.3	31.6	42,028
シマノ	64.7	73.7	1,692,520
テイ・エス テック	80.3	81.7	107,108
ジャムコ	10.1	11.3	10,633
精密機器 (2.8%)			
テルモ	529.6	547.5	2,310,997
クリエートメディック	5.7	5.8	5,846
日機装	55.8	52.1	42,878
日本エム・ディ・エム	10	11.2	17,281
島津製作所	222.3	237.2	1,114,840
JMS	14.6	15.4	8,824
長野計器	12.5	13.3	15,348
プイ・テクノロジー	8.1	8.5	24,777
東京計器	11	12.3	16,568
愛知時計電機	2.3	7.4	11,181
インターアクション	8.7	9.7	20,680
オーバル	15.6	17.4	5,689
東京精密	29.1	31	153,450
マニー	68.8	72.8	106,724
ニコン	263.9	280.4	448,920
トプコン	87	91	168,350
オリンパス	955.9	962.7	2,619,506
理研計器	15.2	13.8	59,823
タムロン	13.9	14	34,384
HOYA	340	373.6	5,239,740
シード	6.8	9.1	4,550
ノーリツ鋼機	15.5	17.4	40,890
A&Dホロンホールディングス	14.6	21.8	22,192
朝日インテック	181.9	212.2	414,638
シチズン時計	219.3	201.5	111,832
リズム	5.5	6.1	10,967
大研医器	13.7	15.4	8,115
メニコン	26.6	61.2	168,116
シンシア	1.9	2.1	963
松風	7.9	7	10,514

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
セイコーホールディングス	24.5	27.4	72,116	
ニプロ	128.8	137.4	142,346	
その他製品(2.4%)				
中本パックス	4.4	5.4	8,758	
スノーピーク	10.2	25.2	67,611	
パラマウントベッドホールディングス	33.1	37.1	75,498	
トランザクション	9.5	11.8	12,567	
粧美堂	5	5.1	2,121	
ニホンフラッシュ	14.8	15.6	13,930	
前田工織	19	18.7	49,742	
永大産業	22.6	22.5	6,052	
アートネイチャー	16.6	16.5	12,540	
バンダイナムコホールディングス	142.9	164.5	1,600,091	
アイフィスジャパン	4.4	4.9	3,449	
共立印刷	28.9	28.5	4,360	
SHOE I	16.2	17.3	83,991	
フランスベッドホールディングス	22.2	24.9	22,559	
パイロットコーポレーション	29.2	29.3	147,086	
萩原工業	9.6	11.9	13,566	
トッパン・フォームズ	30.8	—	—	
フジシールインターナショナル	35.5	42.2	66,211	
タカラトミー	77.5	79.9	103,230	
広済堂ホールディングス	12	12	12,168	
エステールホールディングス	4.6	4.3	2,734	
タカノ	5.9	6.6	5,643	
プロネクサス	13.9	15	16,785	
ホクシン	10.7	13.6	1,985	
ウッドワン	5.8	5.9	7,203	
大建工業	11.6	10.3	19,147	
凸版印刷	262.6	266.1	648,485	
大日本印刷	208.7	216	641,952	
共同印刷	5.3	5.2	13,520	
N I S S H A	35.5	35.6	53,649	
光村印刷	1.5	1.6	2,040	
TAKARA & COMPANY	8.5	11.3	20,419	
アシックス	152.8	155.9	356,075	
ツツミ	4.3	4.8	9,408	
ローランド	13.4	13.5	63,112	
小松ウオール工業	5.3	5.9	11,381	
ヤマハ	102.7	112.5	606,375	
河合楽器製作所	4.8	5.1	14,703	
クリナップ	16.1	18	9,990	
ピジョン	110.9	116.9	219,772	
オリバー	3.7	—	—	
兼松サステック	1.1	1.2	1,930	

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
キングジム	14.3	15.1	13,816	
リントック	37	38.4	91,660	
イトーキ	34.3	35.7	14,601	
任天堂	98.9	109.2	6,369,636	
三菱鉛筆	28.4	28	37,744	
タカラスタンダード	35.7	34.1	42,284	
コクヨ	82.9	87.7	147,248	
ナカバヤシ	17	16.1	7,937	
グローブライド	8.4	15.4	34,865	
オカムラ	59.4	58.4	65,875	
美津濃	17.1	17	37,961	
電気・ガス業(1.3%)				
東京電力ホールディングス	1,465.4	1,448.1	703,776	
中部電力	528.5	561.6	736,819	
関西電力	654.6	695.6	882,716	
中国電力	249.2	286.9	249,889	
北陸電力	157.9	168.5	88,462	
東北電力	404.6	433	312,193	
四国電力	143.6	165.3	127,611	
九州電力	381.5	379.8	321,690	
北海道電力	161.7	168.1	83,881	
沖縄電力	33.6	41	49,405	
電源開発	137.5	150.3	309,016	
エフオン	10.4	11.7	6,388	
イーレックス	25.4	26.1	54,575	
レノバ	29.3	37.9	73,563	
東京瓦斯	332.2	353.3	907,627	
大阪瓦斯	312.9	333.8	813,136	
東邦瓦斯	85	80.1	227,083	
北海道瓦斯	9.3	9.6	15,993	
広島ガス	35.6	34.8	11,170	
西部ガスホールディングス	19.4	19.5	38,317	
静岡ガス	49	47.3	39,306	
メタウォーター	19.4	20.1	42,109	
陸運業(3.0%)				
SBSホールディングス	12.8	14.3	42,256	
東武鉄道	180.1	180.7	524,572	
相鉄ホールディングス	59.2	59	132,750	
東急	435.7	463	691,259	
京浜急行電鉄	221.9	226.4	306,772	
小田急電鉄	276.7	258.3	443,501	
京王電鉄	96.5	90.1	387,880	
京成電鉄	129.5	120.9	418,918	
富士急行	23.6	20.9	86,108	
新京成電鉄	4.4	4.5	12,915	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
東日本旅客鉄道	304.1	310.3	2,076,527
西日本旅客鉄道	153.9	215	1,033,075
東海旅客鉄道	143.6	144.4	2,358,052
西武ホールディングス	208.2	239.7	325,992
鴻池運輸	27.5	28.5	32,205
西日本鉄道	47.9	48.9	135,697
ハマキョウレックス	13.3	12.9	37,126
サカイ引越センター	7.9	8.9	39,471
近鉄グループホールディングス	163.6	175.6	663,768
阪急阪神ホールディングス	218.2	219	754,455
南海電気鉄道	77.6	78.3	192,226
京阪ホールディングス	72.9	74.8	225,522
神戸電鉄	3.9	4.4	15,004
名古屋鉄道	134.5	185.1	402,037
山陽電気鉄道	11.7	13.4	28,649
アルプス物流	11.4	12.8	15,065
日本通運	56.6	—	—
ヤマトホールディングス	229.3	256.8	574,975
山九	42	45.8	177,933
丸運	9.3	9.3	2,185
丸全昭和運輸	13.3	13.2	40,590
センコーグループホールディングス	90.2	88.1	75,237
トナミホールディングス	3.9	3.8	12,996
ニッコンホールディングス	54.9	58.8	119,540
日本石油輸送	1.8	2	5,158
福山通運	20.9	25.7	84,553
セイノーホールディングス	122.5	108.1	110,586
エスライン	4.5	5.2	4,456
神奈川中央交通	4.1	4.5	15,952
日立物流	36	35.4	300,192
丸和運輸機関	34.5	33.5	52,762
C&Fロジホールディングス	16.5	16.5	17,539
九州旅客鉄道	126.6	129.2	336,824
S Gホールディングス	309.1	320.6	722,311
NIPPON EXPRESSホールディングス	—	57.4	428,204
海運業(0.7%)			
日本郵船	137.2	153.6	1,678,848
商船三井	97.4	291	1,037,415
川崎汽船	50.4	56.4	598,404
N Sユナイテッド海運	8.4	10	43,150
飯野海運	79.4	82.2	55,074
共栄タンカー	4.7	6.8	7,568
乾汽船	11.2	11.5	21,033
空運業(0.4%)			
日本航空	398.6	402.7	961,647

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ANAホールディングス	441.6	446.1	1,160,529
パスコ	3.2	3.5	4,655
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	5	5.1	32,895
日新	13	13.8	23,253
三菱倉庫	56.6	51.1	156,877
三井倉庫ホールディングス	17.4	18.4	54,519
住友倉庫	57.8	57.1	125,848
澁澤倉庫	9	9.8	23,030
東陽倉庫	27.4	27.6	8,390
日本トランスシティ	36	35	18,585
ケイヒン	3.2	3.1	4,268
中央倉庫	10	10	9,960
川西倉庫	3	3.3	3,795
安田倉庫	13.4	13.2	12,658
ファイブホールディングス	2.9	3.9	2,956
東洋埠頭	5	5.3	7,117
宇徳	11.7	—	—
上組	90	94.5	244,944
サンリツ	4.2	4.8	3,580
キムラユニティー	4.4	4.8	7,320
キューソー流通システム	4.1	9.1	9,873
近鉄エクスプレス	30.9	34.6	144,455
東海運	9.3	10.4	3,120
エーアイティー	10.3	11.5	18,929
内外トランスライン	5.7	7.1	14,427
日本コンセプト	5.2	5.8	8,717
情報・通信業(9.0%)			
NECネットエスアイ	56.3	62.9	117,685
クロスキャット	4.8	10.1	8,776
システナ	60.7	271.4	119,687
デジタルアーツ	9.9	10.2	73,440
日鉄ソリューションズ	24.7	31.2	118,404
キューブシステム	9.4	9.8	9,339
WOW WORLD	2.8	2.8	3,211
コア	7.4	8.2	12,234
手間いらず	—	2.8	16,072
ラクーンホールディングス	12.1	16.3	23,895
ソリトンシステムズ	8.7	9.7	12,590
ソフトクリエイティブホールディングス	6.8	8.3	35,233
T I S	169.7	171.1	593,717
J N Sホールディングス	8.3	8.8	3,546
電算システム	6.5	—	—
グリー	104.6	86.6	77,766
GMOペパボ	1.5	2.1	4,630

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
コーエーテクモホールディングス	45.1	60.6	276,336	
三菱総合研究所	7.4	8.9	36,846	
電算	2	2.2	5,011	
AGS	9.1	8.5	6,324	
ファインデックス	14.6	16.3	10,106	
ブレインパッド	4.5	16.3	18,174	
KL a b	31.1	33.3	16,283	
ポルトゥウィンホールディングス	22.9	27.7	28,918	
イーブックイニシアティブジャパン	2.9	—	—	
ネクソン	429.1	431.4	1,393,422	
アイスタイル	52.4	50	10,750	
エムアップホールディングス	4.5	22.1	26,011	
エイチーム	11.9	12.6	9,235	
エニグモ	16.3	20.9	11,662	
テクノスジャパン	13.8	15.1	7,852	
コロブラ	56.2	62.8	40,254	
ブロードリーフ	84.7	94.7	36,648	
クロス・マーケティンググループ	8.2	7.5	6,022	
デジタルハーツホールディングス	8	8.7	16,547	
システム情報	13.1	14.4	14,832	
メディアドゥ	6.7	6.8	12,763	
じげん	42.9	54.3	19,548	
ブイキューブ	9.4	19.5	18,057	
エンカレッジ・テクノロジー	3.6	4.6	2,350	
サイバーリンクス	5.8	6.5	6,903	
フィックスターズ	18.5	19.1	15,509	
CARTA HOLDINGS	7.1	7.8	15,334	
オブティム	12	13.5	11,326	
セレス	5.7	7.3	10,125	
SHIFT	8.5	11.1	227,550	
ティーガイア	18.2	17	28,203	
セック	2.6	2.9	7,174	
日本アジアグループ	16.4	—	—	
テクマトリックス	26.5	32.2	53,967	
プロシップ	5.2	6.4	9,139	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41	49.4	122,314	
GMOペイメントゲートウェイ	32.5	36.8	396,704	
ザッパラス	7.3	7.4	2,871	
システムリサーチ	5.1	5.6	11,698	
インターネットイニシアティブ	45.3	50.6	238,832	
さくらインターネット	18.8	20.7	11,840	
ヴィンクス	5.2	5.5	5,978	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	3.8	4.3	24,768	
SRAホールディングス	9.1	9.2	26,137	
システムインテグレータ	5.4	6.4	3,129	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
朝日ネット	14.3	17.7	10,974	
eBASE	20.7	23.1	11,203	
アバント	18.4	20.5	27,162	
アドソル日進	6.2	6.9	11,136	
ODKソリューションズ	4	4.3	2,506	
フリービット	10.5	10.1	9,100	
コムチュア	15.7	21.4	61,268	
サイバーコム	3.3	3.1	3,565	
アステリア	12.7	13.9	14,219	
アイル	9.6	9.7	13,977	
マークラインズ	7.2	9.6	23,510	
メディカル・データ・ビジョン	19.5	24.3	23,133	
gumi	23.8	26.7	14,017	
ショーケース	4.2	4.6	2,116	
モバイルファクトリー	4.1	4.5	4,653	
テラスカイ	5.6	7.1	10,110	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7.7	8.5	12,393	
PCIホールディングス	6.7	8	8,480	
パイプドHD	3.7	3.5	9,593	
アイビーシー	3.1	3.3	1,689	
ネオジャパン	3.4	5.5	7,056	
PR TIMES	3.7	4.1	8,810	
ラクス	51.2	87.2	141,961	
ランドコンピュータ	2.9	4.5	4,167	
ダブルスタンダード	2.3	5.8	11,965	
オープンドア	10.2	11.4	22,412	
マイネット	5.5	6.8	3,495	
アカツキ	6.9	8.5	25,041	
ベネフィットジャパン	1.5	1.5	3,049	
Ubicomホールディングス	4.6	5.1	13,790	
カナミックネットワーク	18.7	22.6	11,413	
ノムラシステムコーポレーション	8.7	10.7	2,450	
チェンジ	31.3	38.1	66,675	
シンクロ・フード	11.1	10.4	3,276	
オークネット	9.2	10.2	18,207	
キャピタル・アセット・プランニング	3.7	3.8	2,667	
セグエグループ	4.7	5.3	2,909	
エイトレッド	3.4	2.8	5,740	
AOI TYO Holdings	17.6	—	—	
マクロミル	35.1	38.3	38,874	
ビーグリー	3.6	4.6	6,835	
オロ	5.5	5.9	10,968	
ユーザローカル	2.6	5.9	10,590	
テモナ	4	4.2	1,625	
ニーズウェル	4.1	5.4	3,736	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
マナーフォワード	—	38.7	140,868			
サインポスト	4.1	6.1	5,490			
電算システムホールディングス	—	7.9	19,291			
ソルクシーズ	6.9	16.7	6,412			
フェイス	5.6	5.3	3,604			
プロトコーポレーション	20.6	20.4	20,134			
ハイマックス	5.2	5.2	6,760			
野村総合研究所	294.6	342.5	1,233,000			
サイバネットシステム	12.5	13.8	10,350			
CEホールディングス	9.7	9.9	4,752			
日本システム技術	3.3	3.6	8,542			
インタージホールディングス	21.4	22	31,680			
東邦システムサイエンス	4.9	5.2	4,747			
ソースネクスト	81.7	82.8	19,044			
インフォコム	15.6	20.9	45,541			
シンプレクス・ホールディングス	—	30.1	58,454			
HEROZ	5	5.7	5,244			
ラクスル	18.5	22.1	47,271			
I P S	4.1	5.3	11,925			
F I G	19.7	21.3	6,624			
システムサポート	5.3	7	8,253			
イーソル	9.5	12	7,104			
アルテリア・ネットワークス	19	20.2	25,209			
E d u L a b	1.7	—	—			
東海ソフト	2.9	3.2	3,404			
ウイングアーク1 s t	9	14.6	20,600			
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4	4.4	7,312			
サーバーワークス	1.7	3.3	7,144			
東名	1.9	1.7	1,601			
ヴィッツ	1.8	1.9	2,257			
トビラシステムズ	2.5	4.1	3,325			
S a n s a n	15.1	62.8	66,819			
L i n k - U	3.4	3.7	2,442			
ギフティ	10.3	16.4	18,515			
ベース	2	3.3	20,592			
J M D C	—	23.8	127,568			
フォーカスシステムズ	11.8	12.3	11,414			
クレスコ	11.3	13.9	30,441			
フジ・メディア・ホールディングス	176.2	173.7	191,591			
オービック	53.4	59.8	1,153,542			
ジャストシステム	24.2	27.1	130,757			
T D C ソフト	15.2	15.8	16,621			
Zホールディングス	2,329.7	2,738.5	1,156,468			
トレンドマイクロ	90.6	95.9	729,799			
I Dホールディングス	6.7	12.2	10,638			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
日本オラクル	34.4	30.8	244,552			
アルファシステムズ	4.6	5.1	21,777			
フューチャー	20.6	40.2	68,058			
C A C H o l d i n g s	11.3	10.4	14,705			
S B テクノロジー	6.2	8.3	19,256			
トーセ	5.1	5.1	3,728			
オービックビジネスコンサルタント	17.3	18.2	81,718			
伊藤忠テクノソリューションズ	77.3	86.6	278,419			
アイティフォー	22.6	23.3	18,360			
東計電算	2.6	2.3	13,777			
エックスネット	3	3.2	3,225			
大塚商会	91.8	102.8	426,620			
サイボウズ	20	25.6	27,059			
電通国際情報サービス	21.1	24.9	103,086			
A C C E S S	21.6	21.8	12,927			
デジタルガレージ	28.1	31.5	126,630			
EMシステムズ	28.4	31.6	30,146			
ウェザーニューズ	5.2	6	40,620			
C I J	12	15	12,210			
ビジネスエンジニアリング	1.8	4.4	9,086			
日本エンタープライズ	19	20.6	3,399			
WOWOW	8.3	8.4	12,549			
スカラ	15.6	16.2	12,781			
インテリジェント ウェイブ	10.5	9.8	6,399			
I M A G I C A G R O U P	15.2	14.6	10,468			
ネットワンシステムズ	69.3	70.1	195,929			
システムソフト	37.5	53	5,883			
アルゴグラフィックス	13.3	14.8	46,768			
マーベラス	27.2	30.2	21,713			
エイベックス	29.4	32.9	38,065			
B I P R O G Y	58.9	59.4	171,369			
兼松エレクトロニクス	9.3	10.4	40,872			
都築電気	7.8	9	12,276			
T B S ホールディングス	112.7	99.8	171,955			
日本テレビホールディングス	141.8	158.7	194,248			
朝日放送グループホールディングス	17.4	16.6	11,055			
テレビ朝日ホールディングス	52.6	45.8	67,142			
スカパーJ SATホールディングス	112.5	161.2	75,119			
テレビ東京ホールディングス	12.3	12.3	25,116			
日本BS放送	6.1	6.6	7,002			
ビジョン	21.4	31.4	42,390			
スマートバリュー	4.9	4.7	2,594			
USEN-NEXT HOLDINGS	—	15.7	32,043			
ワイヤレスゲート	7.8	8.5	2,643			
コネクシオ	9.9	13.6	18,346			

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
クロップス	3.5	3.7	3,866
日本電信電話	1,983	2,080.9	8,300,710
KDDI	1,359.6	1,384.3	6,298,565
ソフトバンク	1,540.9	2,876	4,289,554
光通信	20	21.9	319,521
エムティーアイ	17	16.4	7,429
GMOインターネット	60.1	66.6	172,494
ファイバーゲート	5.8	8.9	9,638
アイドママーケティングコミュニケーション	5.3	4.8	1,372
KADOKAWA	44	102.8	322,278
学研ホールディングス	24.2	27.1	22,926
ゼンリン	31.1	31.2	29,047
昭文社ホールディングス	7.6	8.2	3,476
インプレスホールディングス	14	15.7	3,485
アイネット	9	9.3	11,522
松竹	11.2	11.5	159,505
東宝	100.1	112.1	563,863
東映	5.6	5.6	100,912
エヌ・ティ・ティ・データ	451.6	505.6	1,029,907
ビー・シー・エー	2.6	11.3	14,147
ビジネスブレイン太田昭和	6	6.1	9,308
DTS	35.3	35.4	110,625
スクウェア・エニックス・ホールディングス	72.4	88.4	562,224
シーイーシー	18.4	20.5	25,358
カブコン	145.4	179.1	651,924
アイ・エス・ビー	8.1	9.1	9,700
ジャステック	11.1	11.2	13,036
S C S K	39.2	131.5	285,486
日本システムウエア	5.8	7.2	17,913
アイネス	17	16	24,448
TKC	28.8	30	104,700
富士ソフト	18.1	18.9	138,537
NSD	54.7	59.6	138,689
コナミホールディングス	61.6	69	613,410
福井コンピュータホールディングス	7.9	8.8	30,052
J B C Cホールディングス	11.7	12.9	21,052
ミロク情報サービス	17	16.9	20,381
ソフトバンクグループ	1,345.2	1,138.6	6,100,618
卸売業(5.7%)			
ハウスイ	1.4	—	—
高千穂交易	6.6	6.9	12,468
オルパヘルスケアホールディングス	2.8	3.1	5,648
伊藤忠食品	4.1	4.1	19,844
エレマテック	13.6	15.3	19,706
J A L U X	4.8	—	—

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
あらた	13.5	14.5	58,580
トーマンデバイス	2.2	2.9	17,777
東京エレクトロン デバイス	5.6	5.7	32,148
フィールズ	14.9	16.7	17,685
双日	939.8	200.5	417,842
アルフレッサ ホールディングス	176.5	202.4	343,270
横浜冷凍	47.7	48.7	41,492
ラサ商事	9	8.9	8,615
アルコニックス	18.1	24.1	31,619
神戸物産	117.4	137	432,235
ハイパー	3.5	4.8	2,265
あい ホールディングス	24.3	27.2	44,961
ディーブイエックス	5.2	6.5	7,111
ダイワボウホールディングス	77.5	84.9	146,282
マクニカ・富士エールホールディングス	40.6	45.5	129,038
ラクト・ジャパン	7.4	6.6	12,969
グリムス	5.1	8.5	13,013
バイタルケエスケー・ホールディングス	29.6	31.3	21,628
八洲電機	13.2	13.8	13,758
メディアスホールディングス	9.7	10.9	11,957
レスターホールディングス	17.7	18.1	37,304
ジューテックホールディングス	3.9	4	3,992
大光	6.6	8.1	5,832
OCHIホールディングス	5	4.7	5,640
TOKAIホールディングス	82.5	92.4	80,665
黒谷	4.7	5.2	3,031
C o m i n i x	3	3.4	2,485
三洋貿易	17.2	18.1	17,267
ビューティガレージ	2.7	3.1	7,998
ウイン・パートナーズ	12.3	13.8	14,545
ミタチ産業	4.7	4.8	4,468
ジップヘルスケアホールディングス	60	57	132,297
明治電機工業	5.9	5.9	6,495
デリカフーズホールディングス	6.7	7.5	4,065
スターティアホールディングス	3.3	4.4	3,432
コマダホールディングス	37.1	41.6	92,643
ビーバンドットコム	2.4	2.7	1,474
アセンテック	4.4	6.6	5,035
富士興産	5.2	4.8	5,304
協栄産業	1.9	2	2,750
フルサト・マルカホールディングス	—	17.4	66,642
ヤマエグループホールディングス	—	11.4	13,053
小野建	15.3	17.5	24,395
南陽	3.5	3.7	6,793
佐鳥電機	10.6	11.9	13,649

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
エコートレーディング	3.6	4.1	2,337	
伯東	10.4	11.6	33,118	
コンドーテック	13.2	14.3	15,544	
中山福	9.9	10.1	3,353	
ナガイレーベン	22.6	23.8	45,672	
三菱食品	18.7	18.3	56,730	
松田産業	12.4	13.9	28,578	
第一興商	33.8	36.2	145,886	
メディパルホールディングス	170.5	186.1	335,166	
S P K	7.3	7.6	10,602	
萩原電気ホールディングス	6.3	6.7	13,601	
アズワン	12.2	27.3	178,815	
スズデン	5.9	6.2	12,592	
尾家産業	5	4.7	4,178	
シモジマ	10.4	11.7	11,395	
ドウシシャ	16.1	18	27,918	
小津産業	3.8	4.2	8,316	
高速	9	10.5	16,516	
たけびし	6	6.7	9,815	
リックス	3.9	4	7,520	
丸文	15.1	15.8	12,640	
ハビネット	14.2	15	23,685	
橋本総業ホールディングス	3.4	3.5	6,667	
日本ライフライン	55	56.5	52,658	
タカショー	11.1	14.7	11,142	
マルカ	5.5	—	—	
I D O M	57.4	57.9	39,082	
進和	10.1	11.3	24,939	
エスケイジャパン	4.2	4.7	2,124	
ダイترون	7.2	7.6	15,800	
シークス	21.7	25.3	27,172	
田中商事	5.3	5.9	3,687	
オーハシテクニカ	8.7	9.7	12,348	
白銅	6.1	6.2	15,493	
ダイコー通産	2	2.3	2,785	
伊藤忠商事	1,190.1	1,206.1	4,487,898	
丸紅	1,678	1,740.8	2,384,025	
高島	2.7	2.7	6,725	
長瀬産業	93.4	92	167,992	
蝶理	10.9	10.7	21,250	
豊田通商	170.9	177.3	888,273	
三共生興	25.8	24.5	13,646	
兼松	68	67.7	89,702	
ツカモトコーポレーション	2.8	3.2	4,147	
三井物産	1,357.4	1,414.2	4,508,469	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	評 価 額 (千円)
日本紙パルプ商事	8.9	9.3	33,573	
カメイ	22.2	21.1	21,986	
東都水産	2	1	4,460	
O U Gホールディングス	2.7	2.8	7,736	
スターゼン	12.6	13.3	26,028	
山善	66.5	72.6	68,897	
椿本興業	3.1	3.4	12,002	
住友商事	1,073.8	1,152.8	2,164,958	
内田洋行	7.3	7.7	34,881	
三菱商事	1,036	1,309.2	5,890,090	
第一実業	7.7	7.8	24,726	
キャノンマーケティングジャパン	42.2	47.3	143,792	
西華産業	9	8.7	14,233	
佐藤商事	14.1	14	16,086	
菱洋エレクトロ	13	11.3	24,148	
東京産業	15.5	16.1	11,334	
ユアサ商事	17.4	16.2	52,326	
神鋼商事	3.8	4.3	16,641	
トルク	10.3	10.3	2,173	
阪和興業	34.1	34.8	106,662	
正栄食品工業	11	12.3	49,630	
カナデン	13.8	15.5	15,872	
菱電商事	12.3	15.1	25,232	
フルサト工業	8.6	—	—	
岩谷産業	40.8	43.4	234,794	
ナイス	6.7	6.1	10,126	
ニチモウ	2.7	2.4	5,964	
極東貿易	4.9	5.5	14,245	
アステナホールディングス	24.5	25.4	10,490	
三愛オプリー	41.9	44.1	42,115	
稲畑産業	40.9	38.2	85,568	
G S Iクレオス	8.4	9.1	11,711	
明和産業	15.8	17.6	12,584	
クワザワホールディングス	6.1	7.1	3,308	
ヤマエ久野	12.4	—	—	
ワキタ	33.5	36.5	40,953	
東邦ホールディングス	54.6	54.9	110,184	
サンゲツ	45.9	47.4	72,996	
ミツウロコグループホールディングス	25.1	23.7	22,135	
シナネンホールディングス	6.3	6.5	21,775	
伊藤忠エネクス	37.7	42.2	43,845	
サンリオ	47.8	55.3	146,379	
サンワテクノス	11.2	10.3	14,358	
リョーサン	18.8	20	49,260	
新光商事	23	26.3	24,038	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
トーヨー	7.7	7.8	9,024	
三信電気	9.1	8.2	12,841	
東陽テクニカ	16.8	18.8	20,304	
モスフードサービス	24.1	25	77,250	
加賀電子	15.4	16.1	49,668	
ソーダニッカ	16.3	16.9	10,224	
立花エレテック	12.6	13.2	20,750	
フォーバル	6	7.3	6,599	
PALTAC	27.3	26.7	118,948	
三谷産業	22.5	29.8	9,387	
西本Wismettacホールディングス	3.9	4.3	15,243	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.5	1.7	3,298	
コア商事ホールディングス	12.8	12	10,164	
国際紙バルブ商事	36.4	36.8	14,131	
ヤマタネ	7.3	8.4	13,918	
丸紅建材リース	1.7	1.7	3,155	
日鉄物産	12.1	12.3	66,297	
泉州電業	4.8	4.9	25,921	
トラスコ中山	39	39.7	73,286	
オートバックスセブン	63.1	60.8	83,782	
モリト	12.5	13.9	10,160	
加藤産業	24.6	22.9	73,394	
北恵	4.3	4.9	4,410	
イノテック	9.6	11.6	15,694	
イエローハット	32.2	31	51,522	
JKホールディングス	15.4	14.1	12,986	
日伝	14.1	13.9	27,160	
北沢産業	11.7	11.2	2,363	
杉本商事	8.6	8.9	20,915	
因幡電機産業	45.4	48.6	127,526	
東テク	5.6	5.9	18,172	
ミスミグループ本社	213.5	239.3	689,662	
アルテック	12.6	12.2	2,903	
タキヒヨー	5.7	5.4	5,513	
蔵王産業	3.3	3.7	7,466	
スズケン	72.1	70.4	248,864	
ジェコス	11.8	13.2	11,008	
グローセル	18.5	21.3	8,775	
小売業(4.1%)				
ローソン	43.1	42.2	193,276	
サンエー	13	13.5	53,797	
カワチ薬品	12	14.9	30,694	
エービーシー・マート	26.6	29.8	163,304	
ハードオフコーポレーション	8	8.8	7,735	
アスクル	27.7	43.4	64,188	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ゲオホールディングス	23.1	24.1	28,703	
アダストリア	23.8	20.7	43,801	
くら寿司	20.1	20	60,000	
キャンドウ	8.3	7.2	17,964	
アイケイ	5.4	6.7	3,604	
バルグループホールディングス	15.1	16.9	26,533	
エディオン	72.5	87.8	106,852	
サーラコーポレーション	35.2	39.2	24,852	
ワッツ	8.7	9.7	7,323	
ハローズ	7	8.8	28,996	
フジオフードグループ本社	14.3	14.8	20,276	
あみやき亭	3.8	4.6	13,703	
大黒天物産	5.5	6.2	28,334	
ハニーズホールディングス	13.9	16	16,592	
ファーマライズホールディングス	4.6	4.8	3,384	
アルペン	13.2	14.3	27,556	
ハブ	6	6.9	3,567	
クオールホールディングス	23.2	23.7	29,056	
ジンズホールディングス	11.6	11.1	46,287	
ビックカメラ	101.3	113.3	129,048	
DCMホールディングス	105.4	113.5	121,899	
MonotaRO	242.1	241.1	461,947	
東京一番フーズ	5	5.1	3,024	
きちりホールディングス	4.5	5.1	2,075	
アークランドサービスホールディングス	14.4	14.1	29,370	
J・フロント リテイリング	203.5	217.1	226,652	
ドール・日レスホールディングス	27.2	31.3	47,294	
マツキヨココカラ&カンパニー	70.4	113.6	571,408	
ブロンコピラー	9.1	10.4	25,282	
ZOZO	100.4	131.2	366,441	
トレジャー・ファクトリー	5.4	5.9	6,271	
物語コーポレーション	9.1	9.5	50,730	
ココカラファイン	15.2	—	—	
三越伊勢丹ホールディングス	298.2	302.2	327,584	
Hamee	4.6	7.1	8,754	
マーケットエンタープライズ	1.4	2.3	2,438	
ウエルシアホールディングス	90.1	100.9	261,633	
クリエイトSDホールディングス	25.2	28.2	82,597	
丸善CHIホールディングス	19.9	22.2	8,702	
ミサワ	4	4.4	2,772	
ティーライフ	2.6	2.8	4,113	
チムニー	5.2	5.8	7,128	
シュッピン	12	16.1	23,296	
オイシックス・ラ・大地	22.5	27.6	52,798	
ネクステージ	30.2	38.9	80,484	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ジョイフル本田	50.1	57.5	90,735	
鳥貴族ホールディングス	6.5	6.7	12,709	
ホットランド	13	14.5	19,792	
すかいらくホールディングス	190.9	237.1	371,298	
SFPホールディングス	8.3	9.3	14,284	
綿半ホールディングス	13.1	13.8	18,547	
ヨシックスホールディングス	3.5	3.9	8,287	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	49.8	55.7	59,209	
ゴルフダイジェスト・オンライン	9.1	10.2	12,291	
BEENOS	8.7	9.8	17,718	
あさひ	12.9	16	20,640	
日本調剤	10.6	11.9	14,434	
コスモス薬品	17.2	19.3	233,916	
トーエル	8.8	9	7,848	
オンリー	3.8	—	—	
セブン&アイ・ホールディングス	665.7	674.6	3,650,260	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	91.5	119.1	106,118	
ツルハホールディングス	37.1	41.6	289,536	
サンマルクホールディングス	13.7	15.3	23,577	
フェリシモ	4.1	4.5	5,400	
トリドールホールディングス	42.3	47.6	110,146	
TOKYO BASE	15.9	18.5	6,142	
ウイルプラスホールディングス	3	4	3,704	
JMホールディングス	11.6	14.1	21,248	
サツドラホールディングス	2.7	9.1	5,996	
アレンザホールディングス	13.3	13.6	13,749	
串カツ田中ホールディングス	4.7	5.3	9,757	
パロックジャパンリミテッド	12.3	13.7	11,151	
クスリのアオキホールディングス	17	17.7	97,350	
力の源ホールディングス	7.7	9.7	6,576	
FOOD & LIFE COMPANIES	99.7	102.4	291,532	
メディカルシステムネットワーク	15.3	18	7,884	
はるやまホールディングス	8.5	9.7	4,791	
ノジマ	30.4	30.9	90,907	
カッパ・クリエイト	23.9	26.7	38,047	
ライトオン	12.7	14.2	10,550	
良品計画	196	219.5	296,983	
バリミキホールディングス	22.5	24.9	6,897	
アドヴァングループ	17.7	17.7	13,558	
アルビス	5.6	5.9	12,985	
コナカ	20	21.2	7,123	
ハウス オブ ローゼ	2.3	2.5	4,175	
G-7ホールディングス	8.4	21.4	30,794	
イオン北海道	22.6	28.1	29,982	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
コジマ	29.7	33.3	21,445	
ヒマラヤ	6.3	6.5	6,142	
コーナン商事	24.3	27.2	100,640	
エコス	6.5	6.7	13,554	
ワタミ	22.4	23.1	22,014	
マルシェ	4.5	6.2	2,982	
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	340.3	381.2	750,964	
西松屋チェーン	37.6	39.3	57,810	
ゼンショーホールディングス	91.5	93.1	281,162	
幸楽苑ホールディングス	10.8	11.4	14,523	
ハークスレイ	4	8.6	4,678	
サイゼリヤ	25.4	28.4	68,756	
VTホールディングス	64.9	72.5	33,712	
魚力	5.5	5.4	12,717	
フジ・コーポレーション	9.3	10.4	12,240	
ユナイテッドアローズ	19.7	20.1	40,702	
ハイデイ日高	24.8	27.7	55,039	
YU-WA Creation Holdings	12.3	12.8	3,059	
コロワイド	56.5	78.3	138,982	
ピーシーデポコーポレーション	20.6	23.2	7,748	
壺番屋	12.1	13.5	66,757	
PLANT	4.9	5.1	3,294	
スギホールディングス	34	38.1	203,835	
葉王堂ホールディングス	7.6	9.7	19,215	
スクロール	24.7	29.8	25,091	
ヨンドシーホールディングス	15.9	16.8	29,064	
木曽路	22.4	25.7	53,764	
SRSホールディングス	22.4	27.5	23,870	
千趣会	—	35.3	14,155	
リテールパートナーズ	21	27.4	30,468	
ケーヨー	31.7	35.4	34,479	
上新電機	19.7	19.8	37,362	
日本瓦斯	84.3	92.8	181,980	
ロイヤルホールディングス	29.7	31.4	71,717	
いなげや	19.1	20.6	25,296	
チヨダ	18.2	17.5	12,512	
ライフコーポレーション	17.1	15.9	42,453	
リンガーハット	21	22.4	51,116	
MrMaxHD	24	24.4	15,250	
AOKIホールディングス	34.6	37.4	24,871	
オークワ	26.9	28.3	24,507	
コメリ	26.4	29.5	81,685	
青山商事	38.3	37.7	32,459	
しまむら	19.8	22.2	247,086	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
はせがわ	10.3	11.4	3,135	
高島屋	124.1	131.9	170,282	
松屋	37.4	34.4	27,726	
エイチ・ツー・オー リテイリング	80.8	85.5	80,626	
近鉄百貨店	6.6	6.2	15,543	
丸井グループ	144	142.2	350,238	
アクシアル リテイリング	14.2	13.5	41,580	
イオン	654.8	663.6	1,582,686	
イズミ	34.6	31.6	88,416	
平和堂	31.5	29.6	56,713	
フジ	20.6	45.3	103,646	
ヤオコー	19.3	21.7	142,352	
ゼビオホールディングス	21	26.3	22,591	
ケーズホールディングス	145.1	167	218,937	
O l y m p i c グループ	9.3	9.4	5,959	
日産東京販売ホールディングス	26.6	29.5	7,021	
シルバーライフ	3.6	4.1	6,264	
Genky DrugStores	7.6	8.5	28,687	
ナルミヤ・インターナショナル	3.6	4.6	4,121	
ブックオフグループホールディングス	9.9	11.1	10,989	
ギフトホールディングス	2.3	3.2	6,966	
アインホールディングス	24.8	24.2	139,634	
元気寿司	4.9	5.5	14,025	
ヤマダホールディングス	571	694.4	317,340	
アークランドサカモト	26.9	30.1	45,089	
ニトリホールディングス	67.5	75.7	971,609	
グルメ杵屋	12.5	15.5	16,569	
愛眼	13.6	13.9	2,641	
ケーユーホールディングス	9.3	10.3	11,803	
吉野家ホールディングス	56.1	66.7	161,480	
松屋フーズホールディングス	8.3	9.3	35,898	
サガミホールディングス	24.4	28.2	33,473	
関西フードマーケット	13.2	16.9	21,378	
王将フードサービス	11.3	12.6	80,388	
プレナス	19.3	21.5	42,118	
ミニストップ	12.7	14.3	20,234	
アークス	32.6	34.8	68,625	
パローホールディングス	34.9	40.2	76,259	
ベルク	8.5	8.5	44,625	
大庄	9.5	10.5	11,991	
ファーストリテイリング	22.8	25.5	1,570,800	
サンドラッグ	64.1	71.8	202,260	
サックスパー ホールディングス	15.1	18.5	10,952	
ヤマザワ	4.2	4.3	6,462	
やまや	3.5	3.9	9,792	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ベルーナ		36.9	41.4	27,613
銀行業 (5.2%)				
島根銀行		5.9	6.1	3,251
じもとホールディングス		11.5	12.9	7,443
めぶきフィナンシャルグループ		885.4	828.8	205,542
東京きらぼしフィナンシャルグループ		21.4	22.7	43,720
九州フィナンシャルグループ		348	352.6	133,988
ゆうちょ銀行		482.7	450.5	447,346
富山第一銀行		40.6	43.5	17,226
コンコルディア・フィナンシャルグループ		1,038.1	993.2	436,014
西日本フィナンシャルホールディングス		111.3	106.3	80,256
三十三フィナンシャルグループ		14.7	16.1	22,137
第四北越フィナンシャルグループ		27.7	28.3	71,599
ひろぎんホールディングス		251.3	256.5	156,465
おきなわフィナンシャルグループ		—	16.5	34,963
十六フィナンシャルグループ		—	23.4	53,281
北國フィナンシャルホールディングス		—	16.8	70,476
プロクレアホールディングス		—	19.7	36,819
新生銀行		138.9	124.5	243,148
あおぞら銀行		101.5	106.6	286,114
三菱UFJフィナンシャル・グループ		11,656.2	11,437.2	8,444,084
りそなホールディングス		1,966.4	2,067.5	991,366
三井住友トラスト・ホールディングス		322.1	330.7	1,292,375
三井住友フィナンシャルグループ		1,179.2	1,266	5,039,946
千葉銀行		568.7	571.6	382,972
群馬銀行		350.7	324.1	114,731
武蔵野銀行		25.4	25.7	45,180
千葉興業銀行		43.4	42.4	11,066
筑波銀行		70.8	74.4	13,615
七十七銀行		53.5	53.7	91,128
青森銀行		13.2	—	—
秋田銀行		10.2	11.7	17,924
山形銀行		19.1	18.5	15,244
岩手銀行		11.2	11.9	23,800
東邦銀行		152.4	144.1	28,675
東北銀行		8.2	8.8	8,641
みちのく銀行		10.9	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ		153.8	145.5	325,920
静岡銀行		415	417.2	315,820
十六銀行		21.4	—	—
スルガ銀行		149.4	167.3	60,060
八十二銀行		383.8	389	176,217
山梨中央銀行		19.8	19.7	22,123
大垣共立銀行		33.7	34.3	59,819
福井銀行		14.6	15.6	20,576

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
北國銀行	15.8	—	—
清水銀行	7	7.2	10,677
富山銀行	3.3	3.1	5,890
滋賀銀行	34.2	32.7	86,949
南都銀行	24.8	27.1	53,739
百五銀行	153.3	167.9	54,567
京都銀行	61	62.3	350,126
紀陽銀行	60.3	59.3	83,553
ほくほくフィナンシャルグループ	113.4	110.9	88,387
山陰合同銀行	107.4	108.5	71,176
中国銀行	146.6	144.7	135,149
鳥取銀行	5.4	6.1	7,448
伊予銀行	225.8	227	143,237
百十四銀行	18.1	18.5	32,134
四国銀行	24.2	26.4	21,463
阿波銀行	26.1	26.6	54,210
大分銀行	9.8	10.5	18,322
宮崎銀行	10.6	10.9	22,039
佐賀銀行	9.7	10.3	14,595
沖縄銀行	15.6	—	—
琉球銀行	37	41.4	32,333
セブン銀行	569.3	566.8	138,299
みずほフィナンシャルグループ	2,315.4	2,339.1	3,581,162
高知銀行	6.2	6.3	4,693
山口フィナンシャルグループ	212.7	201.2	145,870
長野銀行	5.6	6	7,530
名古屋銀行	13.7	12.4	38,068
北洋銀行	256.9	255.7	56,765
愛知銀行	5.7	6.2	31,310
中京銀行	6.1	6.2	10,087
大光銀行	5.8	6	7,578
愛媛銀行	23.8	25.5	20,935
トマト銀行	6.6	6.1	6,106
京葉銀行	72.7	79.6	36,616
栃木銀行	82.3	87.8	23,267
北日本銀行	5.3	5.7	8,914
東和銀行	29.9	32	16,416
福島銀行	19.5	20.7	4,595
大東銀行	8.2	8.6	5,598
トモニホールディングス	131.7	141	43,569
フィデアホールディングス	165.4	17.4	22,080
池田泉州ホールディングス	195.9	208.2	38,517
証券・商品先物取引業(0.7%)			
F P G	57.6	64.5	62,758
ジャパンインベストメントアドバイザー	11.6	15	19,305

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
マーキュリアインベストメント	6.9	—	—
マーキュリアホールディングス	—	9.8	6,174
S B I ホールディングス	210	235.7	618,712
ジャフコ グループ	26.2	73.1	116,082
大和証券グループ本社	1,276.5	1,361.6	860,803
野村ホールディングス	2,602	2,914.3	1,477,550
岡三証券グループ	145.7	142.5	49,875
丸三証券	50.9	57.2	28,256
東洋証券	57.6	60.7	11,593
兼海東京フィナンシャル・ホールディングス	182.2	199	75,023
光世証券	4.4	4.5	2,052
水戸証券	46.2	49	13,132
いちよし証券	34.5	34.4	21,775
松井証券	83.7	93.7	77,958
マネックスグループ	153.1	159.5	80,069
極東証券	23.1	23.3	15,471
岩井コスモホールディングス	17.6	18.2	22,313
アイザワ証券グループ	30.8	28	19,572
マネーパートナーズグループ	19.1	21.4	5,029
スパークス・グループ	79.5	89.1	23,700
保険業(2.2%)			
かんぽ生命保険	211.2	192.1	413,591
S O M P O ホールディングス	300.4	285.5	1,632,203
アニコム ホールディングス	47.9	58.6	40,023
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	413.8	404.2	1,622,054
第一生命ホールディングス	900.2	908.7	2,355,350
東京海上ホールディングス	561.2	558.3	4,112,437
T & D ホールディングス	509.3	448.2	660,198
アドバンスクリエイト	8.1	9.1	8,845
その他金融業(1.2%)			
全国保証	44.4	45.6	197,220
あんしん保証	—	9.2	2,511
イントラスト	5.2	8.9	4,975
日本モーゲージサービス	9	11.1	11,122
C a s a	5	7.3	6,241
アルヒ	25.3	28.7	27,810
プレミアグループ	8	9.8	40,180
ネットプロテクションズホールディングス	—	58.7	35,924
クレディセゾン	99.7	115.4	177,600
芙蓉総合リース	17.9	17.7	133,104
みずほリース	26.4	25.7	79,541
東京センチュリー	39.6	32.1	139,956
日本証券金融	72.4	75.5	66,440
アイフル	286.7	321.6	113,203

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
リコーリース	13.5	17	59,075
イオンフィナンシャルサービス	104.5	104.2	126,603
アコム	343	377.9	124,329
ジャックス	18.9	19.8	67,518
オリエントコーポレーション	462.7	519.9	66,547
オリックス	1,034.6	1,134	2,791,908
三菱HCキャピタル	589.8	647	405,669
九州リースサービス	8.8	9.4	5,358
日本取引所グループ	460.4	455.4	941,539
イー・ギャランティ	19.7	28.4	62,366
アサックス	9.2	10.7	6,708
NECキャピタルソリューション	7.1	8	15,808
不動産業(2.0%)			
いちご	194.1	218.4	68,577
日本駐車場開発	196.8	206.5	33,453
スター・マイカ・ホールディングス	10.2	11.6	17,690
SREホールディングス	2.8	5.9	11,180
ADワークスグループ	34.2	35.9	5,385
ヒューリック	362.7	430.5	465,801
三栄建築設計	7.6	8.8	14,660
野村不動産ホールディングス	104.1	99.3	325,704
三重交通グループホールディングス	37.6	42.4	20,691
サムティ	25	29.8	60,017
ディア・ライフ	25.2	27.2	14,552
地主	11.6	12.9	27,373
プレサンスコーポレーション	28.9	23.4	36,387
ハウスコム	4.2	4.8	5,212
日本管理センター	10.4	10.9	11,216
サンセイランディック	6.8	7.7	6,853
フージャースホールディングス	27.8	24.4	19,593
オープンハウスグループ	54.4	61	335,500
東急不動産ホールディングス	465.6	536	365,552
飯田グループホールディングス	142.6	160.1	326,604
イーグラント	4.3	4.1	5,965
ムゲンエステート	13.5	15.4	7,777
And Doホールディングス	8.4	9.4	8,497
シーアールイー	5.5	7.7	12,381
ケイアイスター不動産	—	8.9	44,678
グッドコムアセット	9.2	9.8	11,730
ジェイ・エス・ビー	3.6	4.4	15,576
ロードスターキャピタル	—	6.1	8,802
テンポイノベーション	6.6	7.4	6,586
フェイスネットワーク	2.5	3.8	5,065
パーク24	92.1	113.9	236,342
パラカ	5.3	6.4	11,808

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
三井不動産	777.2	788.5	2,254,715
三菱地所	1,120.2	1,143.5	2,253,838
平和不動産	29.5	31.6	121,344
東京建物	169.2	172.8	309,312
ダイビル	44.4	—	—
京阪神ビルディング	30.5	27.9	35,126
住友不動産	383.4	362.8	1,309,345
テーオーシー	35.5	33.5	20,904
東京楽天地	3.2	3.3	13,084
スターツコーポレーション	20.8	26.7	64,533
フジ住宅	22.2	24.9	16,434
空港施設	19.5	22.5	12,262
明和地所	10.5	12	7,320
ゴールドクレスト	16.2	16.1	27,337
エスリード	7.6	8.5	14,892
日神グループホールディングス	28.4	35	16,100
日本エスコン	30.9	35.5	27,477
タカラレーベン	71.4	80	26,800
AVANTIA	10.5	11.4	9,667
イオンモール	86.3	96.8	154,686
毎日コムネット	8	9.1	6,388
ファースト住建	8.5	8.7	9,778
カチタス	42.7	47.9	144,179
トーセイ	24.9	27.9	32,224
穴吹興産	4.4	5	11,750
サンフロンティア不動産	22.6	28.1	30,376
FJネクストホールディングス	18.2	20.4	21,930
インテリックス	3.8	4.3	2,653
ランドビジネス	7.2	7	1,659
サンネクスタグループ	6.9	7.6	8,892
グランディハウス	15.1	16.4	8,741
日本空港ビルディング	59.5	65.6	351,616
サービス業(5.4%)			
明豊ファシリティワークス	7.9	9	5,841
日本工営	10.4	11.9	37,068
LIFULL	51.2	58.5	10,354
ミクシィ	42.1	42.5	91,120
ジェイエイシーリクルートメント	11.5	15.1	27,844
日本M&Aセンターホールディングス	270.9	303.5	461,927
メンバーズ	5	5.2	15,990
中広	3	3.9	1,540
UTグループ	23.9	26.8	65,606
アイティメディア	5.7	9	16,407
タケエイ	18.6	—	—
E・Jホールディングス	8.9	10.9	12,589

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
夢真ビーネックスグループ	44.1	60.5	89,177	
コシダカホールディングス	44.6	49.9	38,672	
アルトナー	4.3	4.9	4,160	
パソナグループ	18	20.2	42,420	
CDS	4.3	4.8	10,464	
リンクアンドモチベーション	30.3	40.8	18,645	
GCA	21.9	—	—	
エス・エム・エス	56.2	63	186,102	
サニーサイドアップグループ	6.1	7	4,403	
パーソルホールディングス	165.2	185	467,495	
リニカル	9.7	10.8	9,450	
クックパッド	52.9	59.7	13,432	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	8.4	9.6	5,827	
学情	6	7.9	7,552	
スタジオアリス	8.4	8.4	19,093	
シミックホールディングス	9.3	9.7	14,132	
エプコ	4.3	4.4	3,207	
NJS	4.2	4.3	9,030	
総合警備保障	65.7	69.6	248,820	
カカココム	122	135.8	346,018	
アイロムグループ	5.9	6.7	13,078	
セントケア・ホールディング	12.3	12.5	10,287	
サイネックス	3.2	3.7	2,186	
ルネサンス	10.6	13.2	12,434	
ディップ	25.9	32.6	123,717	
デジタルホールディングス	11.6	13.2	17,595	
新日本科学	20.5	22.7	38,272	
キャリアデザインセンター	4.4	4.4	4,879	
ベネフィット・ワン	60.2	67.5	136,755	
エムスリー	291.3	326.4	1,219,756	
ツカダ・グローバルホールディング	13.1	11.8	4,023	
アウトソーシング	94.7	106.3	123,095	
ウェルネット	17.2	17.8	8,882	
ワールドホールディングス	5.8	7.6	17,882	
ディー・エヌ・エー	70	70.6	131,527	
博報堂DYホールディングス	229.9	242.1	316,666	
ぐるなび	29.2	28.9	12,455	
タカミヤ	20.5	23.4	8,845	
ジャパンベストレスキューシステム	11.2	11.1	9,024	
ファンコミュニケーションズ	46.1	44	18,040	
ライク	4.5	6.3	13,488	
ビジネス・ブレイクスルー	7.5	7.7	3,334	
エスプール	42.7	52.5	64,627	
WDBホールディングス	7.6	8.6	20,201	
手間いらず	2.1	—	—	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
ティア	10.2	11.6	5,370	
CDG	1.7	2.3	2,957	
アドウェイズ	27.1	28.2	20,134	
バリュエコマース	11.2	14.6	46,939	
インフォマート	167.3	203.4	103,327	
J Pホールディングス	48.1	49.2	11,168	
エコナックホールディングス	32.9	36.3	3,303	
E P Sホールディングス	25	—	—	
CLホールディングス	4.2	4.3	4,360	
プレステージ・インターナショナル	62.3	69.9	44,945	
アミューズ	9.1	10.2	22,236	
ドリームインキュベータ	5.3	5.6	13,423	
クイック	10.5	12.1	17,230	
TAC	10.1	11.6	2,726	
電通グループ	185.7	179.1	774,607	
イオンファンタジー	6.5	7.3	18,140	
シーティーエス	18.9	21.3	18,467	
ネクシィーズグループ	6.1	6.6	3,451	
H. U. グループホールディングス	46.3	48.5	127,943	
アルプス技研	14.7	15.4	28,844	
ダイオーズ	3.5	4	4,312	
日本空調サービス	17.7	19.8	15,998	
オリエンタルランド	175.6	204	4,019,820	
ダスキン	38.4	41	111,684	
明光ネットワークジャパン	19.9	22.3	13,469	
ファルコホールディングス	8	8.5	18,691	
ラウンドワン	56.5	51.8	80,134	
リゾートトラスト	75.8	80.6	172,242	
ビー・エム・エル	21.3	23.6	82,010	
りらいあコミュニケーションズ	25.3	27.6	31,105	
リソー教育	84.7	85.5	29,412	
早稲田アカデミー	7.3	10.6	12,667	
ユー・エス・エス	185	207.2	504,532	
東京個別指導学院	15	16.9	10,376	
サイバーエージェント	407	415.5	582,531	
楽天グループ	770.7	889.2	662,454	
クリーク・アンド・リバー社	8.8	9.9	21,027	
モーニングスター	24.7	33	17,919	
テー・オー・ダブリュー	29.7	36.4	12,558	
山田コンサルティンググループ	9.8	9.9	11,612	
セントラルスポーツ	6.3	7	17,500	
フルキャストホールディングス	14.2	15.9	36,554	
エン・ジャパン	29.4	32.1	63,172	
リソルホールディングス	1.9	2.1	9,702	
テクノプロ・ホールディングス	33	110.9	335,472	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アトラグループ	3.8	4.1	832
インターワークス	5.4	6.3	2,444
アイ・アールジャパンホールディングス	6.7	8.7	39,367
KeepEr 技研	10.7	12	38,760
ファーストロジック	3.6	3.6	2,718
三機サービス	3.4	3.5	3,885
Gunosy	10.6	10.6	9,253
デザインワン・ジャパン	5.3	7.2	1,332
イー・ガーディアン	6.8	6.8	20,230
リブセンス	10.3	12.4	2,021
ジャパンマテリアル	51	57.1	103,864
バクトル	20.9	26.2	29,868
ウチヤマホールディングス	8.9	10.3	3,213
チャーム・ケア・コーポレーション	12.5	14.1	15,947
キャリアリンク	5.5	7	14,742
I B J	13.8	15.7	11,853
アサンテ	6.1	8.4	12,768
バリュHR	6.7	15.9	20,320
M&Aキャピタルパートナーズ	13.6	15.4	53,438
ライドオンエクスプレスホールディングス	6.6	7.5	9,097
ERIホールディングス	5.1	5.4	7,263
アビスト	2.7	3	8,781
シグマクス・ホールディングス	9.2	22.6	27,097
ウィルグループ	12.4	14	16,758
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	25.6	23.2	3,781
メドピア	12.8	13.6	29,158
レアジョブ	3.2	4.2	2,343
リクルートホールディングス	1,182.6	1,358.6	6,377,268
エラン	23	25.8	28,018
土木管理総合試験所	8.8	9.7	3,220
ネットマーケティング	8.7	9.5	6,612
日本郵政	1,249.3	2,213.8	2,115,507
ベルシステム24ホールディングス	27.8	26.8	39,235
鎌倉新書	16.9	21.7	12,260
SMN	3.9	4.6	2,819
グローバルキッズCOMPANY	3.3	3.6	2,419
エアトリ	10.3	11.2	32,995
アトラエ	11.6	13.1	23,973
ストライク	6.3	7.9	30,059
ソラスト	40.7	46	33,028
セラク	5.3	6.2	7,154
インソース	16.1	19.8	45,124
ペイカレント・コンサルティング	10.8	13.1	550,855
Orchestra Holdings	3.8	3.7	9,982
アイモバイル	4.9	8.1	11,826

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
キャリアインデックス	7.2	7	3,689
MS-Japan	7	8	6,880
船場	3.6	4.2	2,889
グレイステクノロジー	16.9	—	—
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	47.7	58.9	92,296
フルテック	2.5	2.9	3,926
グリーンズ	6.2	—	—
GameWith	5.4	6.3	2,942
ソウルドアウト	4.1	—	—
MS&Consulting	3.1	3.2	2,393
ウエルビー	6.3	12.5	10,862
エル・ティー・エス	1.7	2.5	9,575
ミダックホールディングス	3.6	8.5	24,412
日総工産	13.3	15	9,300
キュービーネットホールディングス	7.7	8.8	11,906
RPAホールディングス	19.6	27.1	10,704
スプリックス	4.9	6.3	6,520
マネジメントソリューションズ	8.2	9.2	45,862
プロレド・パートナーズ	3.1	4.7	2,641
テノ・ホールディングス	2	2.8	1,974
フロンティア・マネジメント	3.9	5.1	7,175
ピアラ	1.4	3.4	2,944
コプロ・ホールディングス	2.4	4	3,672
ギークス	3	3.6	3,128
カープスホールディングス	45.6	51.3	36,525
フォーラムエンジニアリング	11.7	12.2	11,797
Fast Fitness Japan	—	3.6	6,624
ダイレクトマーケティングミックス	8.9	19.9	36,038
ポピンズ	4.4	4.5	9,540
LITALICO	6.7	15.1	38,278
アドバンテッジリスクマネジメント	8.7	10.1	5,181
リログループ	90.4	101.3	215,667
東祥	10.4	14.1	18,950
ビーウィズ	—	5.2	7,337
TREホールディングス	—	31.8	72,631
人・夢・技術グループ	—	7.5	18,525
エイチ・アイ・エス	25.8	39.4	93,062
ラックランド	4.8	5.7	17,356
共立メンテナンス	27.4	33.1	166,493
イチネンホールディングス	17.4	19.2	24,019
建設技術研究所	10.7	10.1	24,421
スペース	11	12.8	11,878
長大	6.7	—	—
燦ホールディングス	7.4	8.2	15,899

銘柄	当 期 首 (前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
スバル興業	1	1.1	9,493	
東京テアトル	6.4	6.9	8,576	
タナベ経営	3.4	7.6	5,327	
ナガワ	5.3	5.4	48,654	
東京都競馬	10.9	13.9	52,264	
カナモト	29.2	31.2	59,779	
西尾レントオール	15.3	16.1	44,516	
トランス・コスモス	15.8	23.6	82,128	
乃村工藝社	71.1	79.6	74,187	
藤田観光	6.5	8.1	20,565	
KN T-C Tホールディングス	8.8	11.5	20,665	
日本管財	17.8	19.9	52,635	
トーカイ	16.1	15.4	25,979	
セコム	162.7	182.2	1,538,861	
セントラル警備保障	8	9.1	20,839	
丹青社	31.5	36.3	30,274	
メイテック	20	22	154,660	
応用地質	18.8	18.9	33,358	
船井総研ホールディングス	33.9	35.9	76,143	
進学会ホールディングス	7.1	7	2,597	
オオバ	11.9	12.4	9,262	
いであ	4.2	4.9	8,820	
学究社	5	6.2	10,168	
ベネッセホールディングス	60.6	61.8	129,223	
イオンディライト	20.4	21.4	60,797	
ナック	8.1	9.1	8,836	
ダイセキ	27.7	33.8	154,635	
ステップ	6.2	7	12,754	
合 計	株 数・金 額	181,054	201,473	488,516,185
	銘柄数<比率>	2,114	2,102	<98.3%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 T O P I X	9,617	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	488,516,185	97.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,712,064	2.7
投 資 信 託 財 産 総 額	502,228,249	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 2022年5月30日現在
(A)資 産	502,188,455,124円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,696,630,134
株 式(評価額)	488,516,185,770
未 収 入 金	4,153,568,703
未 収 配 当 金	5,495,605,067
差 入 委 託 証 拠 金	326,465,450
(B)負 債	4,974,551,491
未 払 金	4,956,801,164
未 払 解 約 金	17,747,094
未 払 利 息	3,233
(C)純 資 産 総 額(A-B)	497,213,903,633
元 本	261,899,870,077
次 期 繰 越 損 益 金	235,314,033,556
(D)受 益 権 総 口 数	261,899,870,077口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,985円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	11,577,303,389円
受 取 配 当 金	11,575,474,978
受 取 利 息	21,631
そ の 他 収 益 金	3,243,816
支 払 利 息	△1,437,036
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△135,113,539
売 買 益	41,187,525,426
売 買 損	△41,322,638,965
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△118,602,600
取 引 益	811,597,550
取 引 損	△930,200,150
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	11,323,587,250
(E)前 期 繰 越 損 益 金	213,332,602,374
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	31,763,096,628
(G)解 約 差 損 益 金	△21,105,252,696
(H)計 (D+E+F+G)	235,314,033,556
次 期 繰 越 損 益 金(H)	235,314,033,556

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は249,503,103,457円、期中追加設定元本額は35,776,873,459円、期中一部解約元本額は23,380,106,839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)	46,649,424,599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)	44,408,751,306円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	29,949,549,876円
DCマイセレクション50	18,942,593,551円
DCマイセレクション75	18,879,688,062円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,780,801,499円
DCマイセレクションS50	9,073,586,435円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,361,740,808円
DCマイセレクションS75	6,906,288,752円
DCマイセレクション25	6,244,084,567円
DC日本株式インデックス・オープン	6,208,866,136円
分散投資コア戦略ファンドS	6,097,040,794円
コア投資戦略ファンド(成長型)	4,319,372,568円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,987,438,501円
世界経済インデックスファンド	3,846,566,064円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,598,505,045円
DC世界経済インデックスファンド	3,590,618,326円
日本株式インデックス・オープン	3,329,539,157円
DCマイセレクションS25	3,101,188,895円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,827,592,622円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,062,924,464円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,899,560,290円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,794,542,708円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,762,760,621円
分散投資コア戦略ファンドA	1,418,670,019円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,141,170,962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)	939,963,074円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	914,590,374円
DCターゲット・イヤール ファンド2035	703,995,649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)	586,687,036円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	558,843,487円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	515,581,834円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	485,200,127円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	477,819,397円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	436,434,928円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	419,000,801円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	402,198,610円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	351,054,666円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,996,082円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	278,407,466円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	263,400,284円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	220,603,259円
グローバル経済コア	218,176,100円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	197,036,199円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	192,767,573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)	186,418,998円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	175,219,707円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	113,885,822円
i-SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	104,463,510円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	74,211,525円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	58,692,527円
SMT インデックスバランス・オープン	57,855,547円

世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	55,807,407円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	51,288,288円
SMT 世界経済インデックス・オープン	46,605,223円
国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	35,139,857円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	31,659,093円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	31,325,672円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	27,485,982円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	26,007,286円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	25,967,549円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	25,626,792円
マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	21,158,127円
マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	19,058,334円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,307,969円
私募世界経済バッシブファンド(適格機関投資家専用)	13,443,001円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,178,371円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	11,191,188円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	10,489,027円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	8,690,813円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	5,155,303円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	4,206,394円
国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	3,350,367円
国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	2,356,825円

お知らせ

株式会社東京証券取引所の市場区分再編に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2022年4月4日)

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 インデックス・ファンドP (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。
	国内債券 インデックス マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	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)	外貨建資産への投資は行いません。
	国内債券 インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	

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35期(決算日 2022年3月7日)
 第36期(決算日 2022年5月9日)
 第37期(決算日 2022年7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。
- ・ 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	債券先物率比	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率			
第9	第23期(2020年 3月9日)	円 10,256	円 11	% 1.5		% 1.5	% 99.2	% —	百万円 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25期(2020年 7月7日)	9,994	9	△0.7	10,306	△0.7	99.7	0.0	101,147
第10	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28期(2021年 1月7日)	9,986	7	△0.1	10,329	△0.1	99.8	—	106,985
第11	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31期(2021年 7月7日)	9,978	8	0.3	10,352	0.3	99.8	—	110,092
第12	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
第13	第35期(2022年 3月7日)	9,831	8	△0.5	10,239	△0.5	99.6	—	112,553
	第36期(2022年 5月9日)	9,697	7	△1.3	10,108	△1.3	99.7	—	111,342
	第37期(2022年 7月7日)	9,627	8	△0.6	10,047	△0.6	99.8	—	112,009

(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、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。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 組入比率	債 券 先 物 比 率
		円	騰 落 率	円	騰 落 率		
第35期	(期 首)2022年1月7日	9,890	—	10,293	—	99.8	—
	1月末	9,852	△0.4	10,251	△0.4	99.7	—
	2月末	9,802	△0.9	10,200	△0.9	99.7	—
	(期 末)2022年3月7日	9,839	△0.5	10,239	△0.5	99.6	—
第36期	(期 首)2022年3月7日	9,831	—	10,239	—	99.6	—
	3月末	9,765	△0.7	10,171	△0.7	99.8	—
	4月末	9,740	△0.9	10,146	△0.9	99.9	—
	(期 末)2022年5月9日	9,704	△1.3	10,108	△1.3	99.7	—
第37期	(期 首)2022年5月9日	9,697	—	10,108	—	99.7	—
	5月末	9,718	0.2	10,131	0.2	99.7	—
	6月末	9,628	△0.7	10,038	△0.7	99.8	—
	(期 末)2022年7月7日	9,635	△0.6	10,047	△0.6	99.8	—

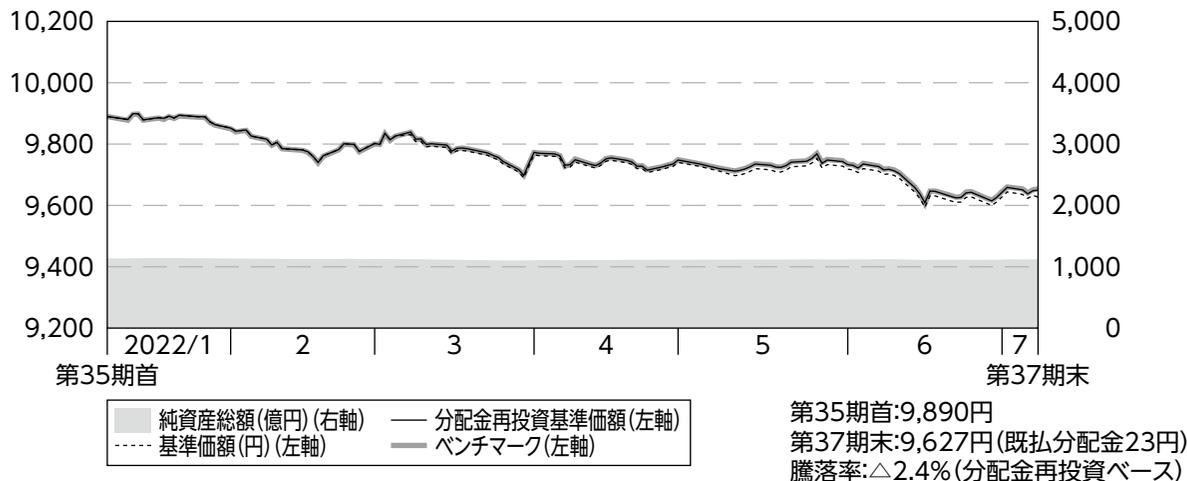
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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

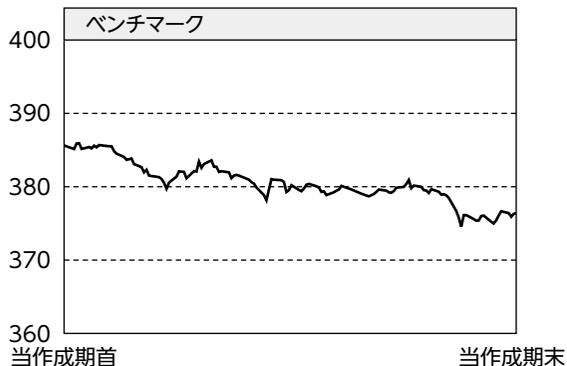


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年1月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2022年2月中旬にかけて、米長期金利が上昇した影響から国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額(分配金再投資ベース)は下落しました。2月下旬から3月上旬にかけて、ウクライナ情勢の深刻化により国内金利が低下(債券価格は上昇)したことから基準価額は上昇しましたが、3月下旬にかけては、欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて国内金利が上昇し、再び下落しました。4月から6月上旬にかけては、世界的に長期金利の上昇が続く中、日銀は10年国債に対して指し値オペを実施し、金利上昇をけん制したことから、基準価額はレンジ内推移となりました。6月中旬に、欧米の長期金利が急上昇した影響を受けて、日銀の指し値オペの影響が及びにくい期間の国内金利が上昇し、基準価額は下落しました。その後当作成期末にかけては、日銀が債券先物と連動性が高い残存期間7年余りの国債を無制限で買い入れる指し値オペを実施し、現行政策を維持する強い姿勢を示したことから、国内金利の上昇が止まり、基準価額はレンジ内推移となりました。

投資環境



国内金利は、2022年2月中旬にかけて、米長期金利が上昇した影響から、上昇しました。2月下旬から3月上旬にかけてウクライナ情勢の深刻化により国内金利は低下しましたが、3月下旬にかけては、欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて、再び上昇しました。4月から6月上旬にかけては、日銀が指し値オペの実施で金利上昇をけん制したことから国内金利はもみ合い推移となりましたが、6月中旬には、欧米の長期金利が急上昇した影響を受けて、日銀の指し値オペの影響が及びにくい期間の金利が上昇しました。その後は、日銀が現行政策を維持する強い姿勢を示したことから、国内金利の上昇は止まりました。

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。

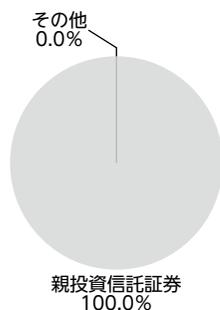
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

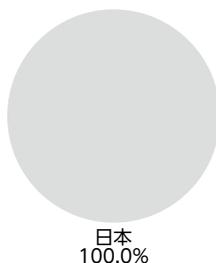
	当作成期末
	2022年7月7日
国内債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

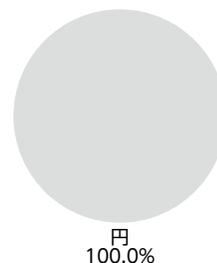
○資産別配分



○国別配分



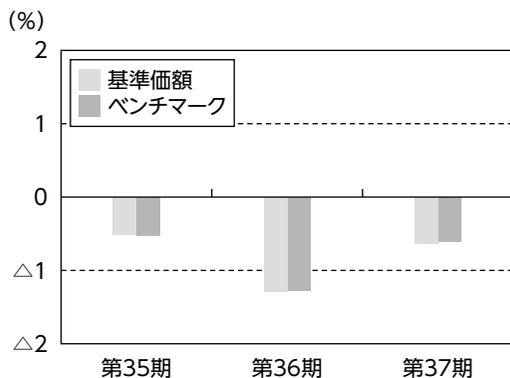
○通貨別配分



(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35期	第36期	第37期
	2022年1月8日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年5月9日	2022年5月10日～ 2022年7月7日
当期分配金 (円)	8	7	8
(対基準価額比率) (%)	(0.081)	(0.072)	(0.083)
当期の収益 (円)	8	7	8
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	600	604	605

(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
	(2022年1月8日~2022年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5円	0.055%	(a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,750円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(4)	(0.038)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(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＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(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＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	5	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 マザーファンド	千口	千円	千口	千円
	2,371,755	3,279,669	1,682,510	2,340,282

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			成 期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 8,425	百万円 649	% 7.7	百万円 8,407	百万円 632	% 7.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当 作 成 期			成 期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 132,628	百万円 9,717	% 7.3	百万円 133,024	百万円 9,684	% 7.3

<平均保有割合 18.0%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

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 80,975,129	千口 81,664,374	千円 111,953,690

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、454,631,886千口です。

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 111,953,690	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	169,292	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	112,122,982	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 35 期 末 2022年3月7日現在	第 36 期 末 2022年5月9日現在	第 37 期 末 2022年7月7日現在
(A)資 産 等	112,769,476,390円	111,444,161,364円	112,122,982,648円
コ ー ル ・ ロ ー ン	102,879,597	74,528,908	134,262,914
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	112,497,215,872	111,286,333,515	111,953,690,575
未 収 入	169,380,921	83,298,941	35,029,159
(B)負 債	216,060,320	102,108,489	113,299,522
未 払 収 益 分 配 金	91,587,068	80,377,701	93,077,836
未 払 解 約 金	103,999,998	249,999	—
未 払 信 託 報 酬	20,132,557	21,118,870	19,882,241
未 払 利 息	32	52	43
そ の 他 未 払 費 用	340,665	361,867	339,402
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	112,553,416,070	111,342,052,875	112,009,683,126
元 本	114,483,836,082	114,825,288,449	116,347,295,396
次 期 繰 越 損 益 金	△1,930,420,012	△3,483,235,574	△4,337,612,270
(D)受 益 権 総 口 数	114,483,836,082口	114,825,288,449口	116,347,295,396口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,831円	9,697円	9,627円

■損益の状況

項 目	第 35 期 自 2022年1月8日 至 2022年3月7日	第 36 期 自 2022年3月8日 至 2022年5月9日	第 37 期 自 2022年5月10日 至 2022年7月7日
(A)配 当 等 収 益	△4,452円	△2,109円	△4,395円
受 取 利 息	73	4	132
支 払 利 息	△4,525	△2,113	△4,527
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△562,636,566	△1,431,325,829	△691,014,248
売 買 益 損	8,636,168	4,641,574	464,997
信 託 報 酬 等	△571,272,734	△1,435,967,403	△691,479,245
(C)信 託 報 酬 等	△20,473,222	△21,480,737	△20,221,643
(D)当 期 繰 越 損 益 金 (A+B+C)	△583,114,240	△1,452,808,675	△711,240,286
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△1,566,950,791	△2,221,007,139	△3,751,289,063
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	311,232,087	270,957,941	217,994,915
(配 当 等 相 当 額)	(3,726,918,862)	(3,776,598,768)	(3,871,408,268)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,415,686,775)	(△3,505,640,827)	(△3,653,413,353)
(G)計 (D+E+F)	△1,838,832,944	△3,402,857,873	△4,244,534,434
(H)収 益 分 配 金	△91,587,068	△80,377,701	△93,077,836
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,930,420,012	△3,483,235,574	△4,337,612,270
追 加 信 託 差 損 益 金	311,232,087	270,957,941	217,994,915
(配 当 等 相 当 額)	(3,727,059,343)	(3,777,029,161)	(3,871,775,337)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,415,827,256)	(△3,506,071,220)	(△3,653,780,422)
分 配 準 備 積 立 金	3,151,571,883	3,158,937,029	3,171,888,103
繰 越 損 益 金	△5,393,223,982	△6,913,130,544	△7,727,495,288

(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35期首元本額は115,030,577,949円、第35～37期中追加設定元本額は3,572,579,128円、第35～37期中一部解約元本額は2,255,861,681円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 35 期	第 36 期	第 37 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	108,298,105円	116,767,903円	108,472,839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	3,727,059,343円	3,777,029,161円	3,871,775,337円
(D) 分配準備積立金額	3,134,860,846円	3,122,546,827円	3,156,493,100円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	6,970,218,294円	7,016,343,891円	7,136,741,276円
(F) 期末残存口数	114,483,836,082口	114,825,288,449口	116,347,295,396口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	608円	611円	613円
(H) 分配金額(1万口当たり)	8円	7円	8円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	91,587,068円	80,377,701円	93,077,836円

分配金のお知らせ

	第35期	第36期	第37期
1万口当たり分配金	8円	7円	8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22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第18期(2018年5月29日)	円 13,934	% 0.8	382.463	% 0.8	% 99.9	百万円 379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390.052	2.0	99.7	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
第22期(2022年5月30日)	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8	624,929

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 債組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(当期首) 2021年 5月31日	円 14,082	% —	386.621	% —	% 99.8
6月末	14,091	0.1	386.903	0.1	100.0
7月末	14,160	0.6	388.809	0.6	99.8
8月末	14,149	0.5	388.461	0.5	99.7
9月末	14,101	0.1	387.116	0.1	99.9
10月末	14,086	0.0	386.721	0.0	99.8
11月末	14,120	0.3	387.655	0.3	99.9
12月末	14,088	0.0	386.841	0.1	99.8
2022年 1月末	13,989	△0.7	384.056	△0.7	99.8
2月末	13,919	△1.2	382.128	△1.2	99.7
3月末	13,880	△1.4	381.037	△1.4	99.9
4月末	13,845	△1.7	380.119	△1.7	99.9
(当期末) 2022年 5月30日	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8

(注1)騰落率は期首比です。

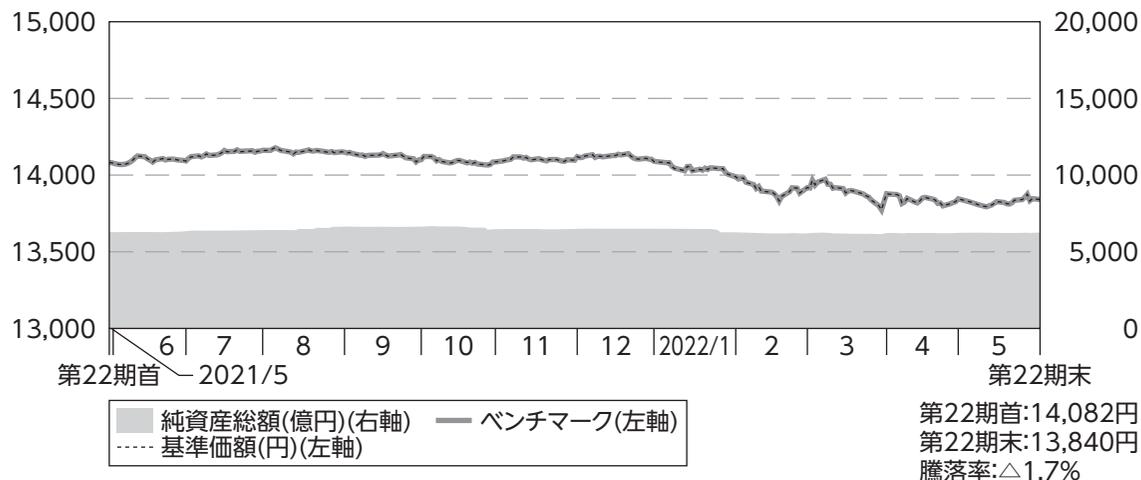
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2021年5月31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、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に緊急事態宣言が発出されたことなどから国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬以降10月下旬にかけては、岸田新政権の経済対策による先行きの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月以降12月中旬にかけては、主要国の中央銀行が利上げに慎重な姿勢を示した影響から国内金利が低下しましたが、米国で早期の利上げ観測が強まった影響から再び上昇し、基準価額はレンジ内推移となりました。12月下旬以降2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から国内金利が上昇し、基準価額は下落しました。2月下旬から3月上旬にかけて、ウクライナ情勢の深刻化によるリスク回避の動きから国内金利が低下し、基準価額は上昇しましたが、3月中旬以降は、インフレ指標の上昇を背景に欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて国内金利が上昇推移となったことから、再び下落しました。

投資環境



国内金利は、2021年8月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に低下しました。8月中旬以降10月下旬にかけては、先行き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月以降12月中旬にかけては、主要国の中央銀行が利上げに慎重な姿勢を示した影響から低下しましたが、米国で早期の利上げ観測が強まった影響から再び上昇しました。12月下旬以降2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から、上昇しました。2月下旬から3月上旬にかけてはリスク回避の動きから低下しましたが、3月中旬以降は、欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて上昇推移となりました。

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

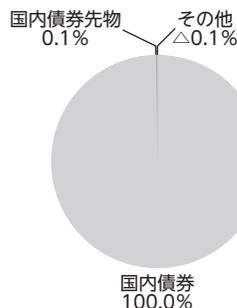
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第141回利付国債(5年)	日本	1.2%
2	第148回利付国債(5年)	日本	1.1%
3	第138回利付国債(5年)	日本	1.1%
4	第137回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第365回利付国債(10年)	日本	1.1%
6	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%

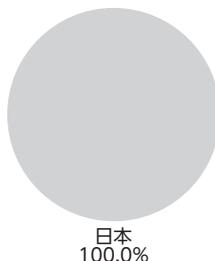
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%
9	第150回利付国債(5年)	日本	0.9%
10	第145回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数		992	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

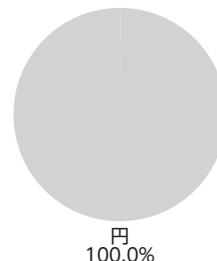
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

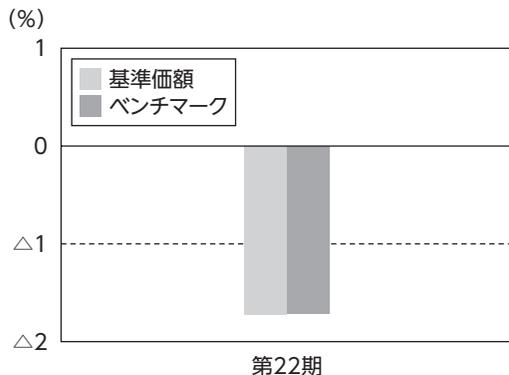


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.1%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。

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 (2021年6月1日~2022年5月30日)		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	0円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(14,042円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	国 債 証 券	135,414,533	123,527,580
	地 方 債 証 券	5,665,813	5,654,159
	特 殊 債 券	9,608,254	10,670,914 (800,945)
	社債券(投資法人債券を含む)	5,921,474	3,618,993

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
国内	債券先物取引	百万円 21,148	百万円 20,546	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 296,828	百万円 6,676	% 2.2	百万円 296,847	百万円 6,445	% 2.2

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	503,715,000 (-)	523,319,672 (-)	83.7 (-)	- (-)	54.5 (-)	20.2 (-)	9.0 (-)
地 方 債 証 券	32,361,680 (32,361,680)	33,511,126 (33,511,126)	5.4 (5.4)	- (-)	3.3 (3.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	33,652,796 (33,652,796)	34,709,232 (34,709,232)	5.6 (5.6)	- (-)	3.3 (3.3)	1.2 (1.2)	1.1 (1.1)
金 融 債 証 券	2,200,000 (2,200,000)	2,200,178 (2,200,178)	0.4 (0.4)	- (-)	- (-)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	30,126,000 (30,126,000)	30,041,507 (30,041,507)	4.8 (4.8)	- (-)	2.2 (2.2)	1.8 (1.8)	0.8 (0.8)
合 計	602,055,476 (98,340,476)	623,781,716 (100,462,043)	99.8 (16.1)	- (-)	63.3 (8.8)	24.8 (4.6)	11.7 (2.7)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
国債証券				
第425回利付国債(2年)	0.005	2,750,000	2,752,750	2023/6/1
第426回利付国債(2年)	0.005	620,000	620,638	2023/7/1
第427回利付国債(2年)	0.005	3,260,000	3,263,618	2023/8/1
第428回利付国債(2年)	0.005	230,000	230,273	2023/9/1
第429回利付国債(2年)	0.005	950,000	951,140	2023/10/1
第430回利付国債(2年)	0.005	2,010,000	2,012,572	2023/11/1
第434回利付国債(2年)	0.005	1,915,000	1,917,681	2024/3/1
第435回利付国債(2年)	0.005	780,000	781,146	2024/4/1
第436回利付国債(2年)	0.005	720,000	721,036	2024/5/1
第136回利付国債(5年)	0.1	4,330,000	4,338,660	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	6,760,000	6,776,359	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	6,890,000	6,909,292	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	5,590,000	5,607,105	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	4,660,000	4,675,797	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	7,750,000	7,778,597	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	4,370,000	4,387,873	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	4,910,000	4,931,358	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	6,310,000	6,338,899	2025/6/20

銘 柄 名	当 期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第145回利付国債(5年)	0.1	5,750,000	5,777,600	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	3,150,000	3,165,687	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	4,170,000	4,175,546	2026/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	6,950,000	6,958,409	2026/6/20
第149回利付国債(5年)	0.005	5,130,000	5,135,489	2026/9/20
第150回利付国債(5年)	0.005	5,880,000	5,883,998	2026/12/20
第151回利付国債(5年)	0.005	1,620,000	1,620,388	2027/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	535,164	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,459,813	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	715,363	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	950,000	1,239,569	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,070,000	1,345,500	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,558,229	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,240,000	1,472,524	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,230,000	1,361,610	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	2,050,000	1,688,072	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,100,000	2,024,862	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,635,000	1,524,670	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,290,000	1,081,561	2059/3/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第13回利付国債(40年)	0.5	2,140,000	1,785,252	2060/3/20
第14回利付国債(40年)	0.7	2,130,000	1,898,277	2061/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	4,410,000	4,451,409	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	3,910,000	3,955,238	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	908,064	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	4,800,000	4,850,832	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	3,030,000	3,066,632	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	4,260,000	4,318,276	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,310,000	2,339,868	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	1,110,000	1,125,906	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,800,000	2,825,788	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	4,560,000	4,618,231	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	4,750,000	4,815,360	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	4,830,000	4,901,145	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	5,340,000	5,404,614	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	4,760,000	4,783,514	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,683,536	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	5,900,000	5,930,503	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	3,780,000	3,798,937	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	5,750,000	5,777,600	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,850,000	3,867,479	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	4,340,000	4,359,530	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	5,000,000	5,020,800	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	6,630,000	6,653,006	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	4,940,000	4,953,387	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	4,510,000	4,518,478	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	4,915,000	4,921,389	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	4,790,000	4,793,209	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	3,710,000	3,708,664	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	4,080,000	4,074,084	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,770,000	2,763,767	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	3,560,000	3,548,999	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	3,420,000	3,406,388	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	4,890,000	4,863,936	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	3,940,000	3,915,059	2030/12/20
第362回利付国債(10年)	0.1	3,790,000	3,762,067	2031/3/20
第363回利付国債(10年)	0.1	5,460,000	5,411,406	2031/6/20
第364回利付国債(10年)	0.1	5,110,000	5,058,644	2031/9/20
第365回利付国債(10年)	0.1	6,770,000	6,693,905	2031/12/20
第366回利付国債(10年)	0.2	810,000	807,667	2032/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	131,447	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	187,852	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	140,485	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	135,254	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	58,915	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	350,000	421,592	2031/11/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	216,419	2032/5/20
第8回利付国債(30年)	1.8	350,000	404,985	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	267,832	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	173,665	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	260,000	299,267	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	227,525	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	400,000	475,416	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	800,000	989,248	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	425,537	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	200,000	250,882	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	1,150,000	1,432,681	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	345,000	426,651	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	530,000	656,972	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	608,505	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	622,155	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	540,000	687,879	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	548,697	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	780,000	998,283	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	439,054	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	1,140,000	1,448,506	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	1,920,000	2,476,550	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	2,090,000	2,704,146	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	2,141,942	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	1,770,000	2,248,147	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,382,447	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	1,360,000	1,733,265	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,820,000	2,231,083	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,795,000	2,264,948	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	2,300,000	2,825,343	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	2,130,000	2,620,688	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	2,225,000	2,699,703	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	1,410,000	1,685,514	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	1,480,000	1,799,295	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	1,380,000	1,650,742	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	1,150,000	1,353,975	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	1,120,000	1,319,371	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	1,340,000	1,579,404	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	1,210,000	1,426,928	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	1,410,000	1,638,864	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,650,000	1,878,162	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,560,000	1,808,196	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,710,000	1,909,659	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,700,000	1,898,407	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	1,590,000	1,569,584	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,710,000	1,499,704	2046/6/20
第52回利付国債(30年)	0.5	1,680,000	1,541,349	2046/9/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第53回利付国債(30年)	0.6	1,320,000	1,237,856	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	1,680,000	1,645,929	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,440,000	1,409,112	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,480,000	1,445,012	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,410,000	1,373,565	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	2,350,000	2,284,035	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	1,410,000	1,334,973	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	1,530,000	1,515,480	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,460,000	1,373,845	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	480,000	427,910	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,260,000	1,089,736	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	1,830,000	1,579,235	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	1,555,000	1,343,271	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	1,030,000	888,787	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,865,000	1,692,282	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,490,000	1,351,057	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	1,340,000	1,247,928	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	1,740,000	1,617,834	2051/3/20
第71回利付国債(30年)	0.7	1,430,000	1,327,426	2051/6/20
第72回利付国債(30年)	0.7	1,070,000	991,622	2051/9/20
第73回利付国債(30年)	0.7	1,870,000	1,732,124	2051/12/20
第74回利付国債(30年)	1.0	720,000	720,000	2052/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	323,004	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	203,990	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	328,307	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	226,787	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	339,665	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	134,621	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	197,784	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	405,272	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	420,284	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	209,320	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	661,430	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	378,936	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	211,032	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	137,863	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	284,814	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	306,727	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	180,140	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	286,931	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	234,469	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	416,410	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	642,618	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	312,100	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	504,140	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	313,516	2026/3/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第86回利付国債(20年)	2.3	510,000	555,237	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,830,000	1,985,348	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	459,631	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	381,608	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	690,284	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	495,000	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	964,629	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	449,380	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	671,518	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	680,570	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,757,578	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	446,344	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	488,642	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,290,000	1,438,517	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	540,019	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	812,683	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,438,731	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	454,328	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	179,798	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,330,827	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	430,958	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	294,348	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	738,579	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	583,830	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,249,908	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,112,696	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	900,679	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	2,020,000	2,311,364	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,675,445	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	809,025	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,728,236	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,244,343	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	757,772	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	600,071	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,752,559	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,714,665	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,066,815	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,870,000	2,175,277	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	704,434	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,770,000	2,081,626	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	845,858	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,173,040	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,118,148	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	740,000	846,426	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,285,000	1,473,522	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,137,570	2031/9/20

銘柄名	期 末			
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第132回利付国債(20年)	1.7	1,160,000	1,321,912	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,230,000	1,413,208	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	830,000	955,836	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	1,030,000	1,176,270	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,450,000	1,642,009	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,060,000	1,212,534	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	620,000	697,035	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	830,000	941,278	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	2,420,000	2,772,569	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	1,600,000	1,835,760	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	980,000	1,134,467	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,920,000	2,185,728	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,150,000	1,297,108	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	2,675,000	3,079,005	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,700,000	3,113,370	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,380,000	2,721,006	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,000,000	2,265,820	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	2,600,000	2,947,542	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	2,730,000	3,064,588	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	2,255,000	2,478,087	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	2,860,000	3,144,398	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,440,000	2,714,134	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,790,000	3,068,107	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,800,000	3,006,360	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,620,000	2,601,267	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,950,000	2,843,092	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,530,000	2,538,450	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,400,000	2,437,512	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	1,890,000	1,943,430	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,990,000	2,015,034	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	630,000	636,690	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	1,980,000	1,997,047	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,320,000	1,309,440	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	2,150,000	2,127,855	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	1,620,000	1,650,180	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,150,000	2,119,212	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	1,410,000	1,363,822	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	1,990,000	1,887,395	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,390,000	2,259,864	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,670,000	1,574,158	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	2,470,000	2,362,036	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	2,350,000	2,240,584	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	2,480,000	2,359,248	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	1,960,000	1,892,497	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	2,850,000	2,743,866	2041/3/20
第177回利付国債(20年)	0.4	2,390,000	2,254,271	2041/6/20

銘柄名	期 末			
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第178回利付国債(20年)	0.5	1,690,000	1,620,101	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	3,015,000	2,886,440	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	800,000	808,288	2042/3/20
小計		503,715,000	523,319,672	
地方債証券				
第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	0.1	100,000	100,182	2026/12/18
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	104,057	2024/3/19
第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	0.74	100,000	91,912	2051/9/20
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	105,531	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	126,922	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	124,591	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	120,579	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	118,811	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	200,000	223,872	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	112,455	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	113,512	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	92,016	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	228,092	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	227,310	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	199,786	2025/12/19
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	100,908	2023/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	200,000	202,240	2023/12/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	100,995	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,171	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,674	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,452	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	300,270	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	197,918	2029/12/20
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,635	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,136	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	100,806	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	200,194	2028/12/28
第29回1号宮城県公募公債(10年)	0.68	100,000	100,941	2023/10/25
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	260,052	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	113,275	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	227,894	2030/11/12
第17回神奈川県公募公債(20年)	1.975	100,000	115,116	2031/7/11
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	113,715	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	111,318	2034/9/20
第78回神奈川県公募公債(5年)	0.005	200,000	199,958	2024/6/20
第201回神奈川県公募公債	0.704	200,250	202,068	2023/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	202,204	2024/12/20
第215回神奈川県公募公債	0.494	100,000	101,420	2025/6/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,550	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,603	2027/3/19

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第227回神奈川県公債	0.18	100,000	100,452	2027/6/18
第243回神奈川県公債	0.075	200,000	197,842	2029/12/20
第6回大阪府公債(20年)	1.98	200,000	228,020	2030/9/13
第7回大阪府公債(20年)	1.84	200,000	228,038	2031/9/26
第10回大阪府公債(20年)	1.72	100,000	113,808	2032/9/24
第375回大阪府公債(10年)	0.835	100,000	101,030	2023/8/29
第377回大阪府公債(10年)	0.729	100,000	101,019	2023/10/30
第389回大阪府公債(10年)	0.53	100,000	101,233	2024/10/30
第395回大阪府公債(10年)	0.435	151,000	152,780	2025/4/28
第399回大阪府公債(10年)	0.529	100,000	101,605	2025/8/28
第402回大阪府公債(10年)	0.493	100,000	101,582	2025/11/27
第407回大阪府公債(10年)	0.09	156,000	156,243	2026/4/27
第410回大阪府公債(10年)	0.001	200,000	199,550	2026/7/28
第439回大阪府公債(10年)	0.193	200,000	200,168	2028/12/27
第440回大阪府公債(10年)	0.2	100,000	100,098	2029/1/30
第465回大阪府公債(10年)	0.12	160,000	157,729	2031/2/25
第468回大阪府公債(10年)	0.129	182,000	179,351	2031/5/28
第469回大阪府公債(10年)	0.128	200,000	196,960	2031/6/27
平成21年度第3回京都府公債(20年)	2.19	100,000	114,297	2029/9/20
平成23年度第5回京都府公債(20年)	1.79	100,000	113,739	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公債	0.8	100,000	101,032	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公債	0.553	100,000	101,599	2025/6/19
平成28年度第5回京都府公債(20年)	0.327	100,000	97,121	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公債(20年)	0.63	100,000	100,696	2037/8/14
令和2年度第12回京都府公債	0.12	140,500	138,795	2030/12/16
第2回兵庫県公債(20年)	2.37	100,000	111,940	2027/9/17
第3回兵庫県公債(12年)	0.56	100,000	101,525	2025/4/16
第6回兵庫県公債(15年)	1.35	100,000	107,272	2028/7/14
第7回兵庫県公債(15年)	1.12	100,000	106,141	2028/12/25
第8回兵庫県公債(15年)	1.09	100,000	106,112	2029/4/16
第9回兵庫県公債(20年)	2.25	400,000	459,988	2029/11/19
平成25年度第7回兵庫県公債	0.7	100,000	100,978	2023/10/30
平成26年度第17回兵庫県公債	0.46	100,000	101,193	2025/2/26
第35回兵庫県公債(20年)	0.578	100,000	99,316	2038/5/28
令和元年度第17回兵庫県公債	0.15	300,000	298,416	2030/1/28
第9回静岡県公債(30年)	1.539	100,000	112,734	2045/6/20
第12回静岡県公債(30年)	0.822	100,000	95,853	2048/3/19
第15回静岡県公債(20年)	1.701	100,000	113,750	2032/10/15
第18回静岡県公債(20年)	1.473	100,000	112,138	2034/7/10
平成26年度第3回静岡県公債	0.679	100,000	101,322	2024/5/27
平成29年度第5回静岡県公債	0.19	100,000	100,503	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公債	0.21	100,000	100,603	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公債	0.215	100,000	100,605	2027/9/17
令和2年度第11回静岡県公債	0.204	310,000	308,412	2030/12/20
平成21年度第5回愛知県公債(20年)	2.28	100,000	114,557	2029/6/20
平成26年度第3回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	101,246	2024/4/30

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
平成26年度第5回愛知県公債(10年)	0.66	200,000	202,572	2024/5/28
平成27年度第17回愛知県公債(10年)	0.38	100,000	101,225	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公債(10年)	0.07	100,000	100,061	2026/6/29
平成29年度第6回愛知県公債(10年)	0.22	200,000	201,252	2027/7/28
平成29年度第12回愛知県公債(20年)	0.606	300,000	300,456	2037/11/20
平成30年度第1回愛知県公債(10年)	0.185	100,000	100,322	2028/4/27
平成30年度第6回愛知県公債(30年)	0.777	100,000	94,602	2048/6/19
令和元年度第16回愛知県公債(10年)	0.09	200,000	197,952	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公債(10年)	0.145	100,000	99,181	2030/7/31
令和3年度第6回愛知県公債(30年)	0.718	200,000	183,164	2051/6/20
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	113,625	2028/9/21
平成21年度第1回広島県公債(20年)	2.21	200,000	227,890	2029/5/28
平成25年度第4回広島県公債	0.67	100,000	100,986	2023/11/27
平成27年度第4回広島県公債	0.476	125,230	127,133	2025/11/25
平成29年度第1回広島県公債	0.175	100,000	100,423	2027/5/25
令和2年度第7回広島県公債	0.214	390,000	388,116	2031/3/19
第3回埼玉県公債(20年)	2.42	100,000	111,719	2027/6/18
第6回埼玉県公債(20年)	2.26	100,000	113,125	2028/9/21
第6回埼玉県公債(30年)	0.957	100,000	99,942	2046/12/20
第7回埼玉県公債(20年)	2.29	200,000	229,276	2029/6/22
第8回埼玉県公債(15年)	0.367	200,000	195,778	2036/4/18
第10回埼玉県公債(20年)	1.94	200,000	227,894	2030/11/12
第18回埼玉県公債(20年)	0.323	200,000	194,480	2036/5/20
平成25年度第11回埼玉県公債	0.655	100,000	101,165	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公債	0.469	100,000	101,512	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公債	0.085	100,000	100,127	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公債	0.249	100,000	100,849	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公債	0.19	100,000	100,479	2027/6/22
令和2年度第7回埼玉県公債	0.125	100,000	98,932	2030/10/16
令和2年度第8回埼玉県公債	0.12	100,000	98,786	2030/12/17
令和3年度第8回埼玉県公債	0.125	150,000	147,568	2031/10/27
平成19年度第1回福岡県公債(20年)	2.38	100,000	111,841	2027/8/20
平成20年度第2回福岡県公債(20年)	2.05	100,000	112,196	2028/12/20
平成22年度第1回福岡県公債(15年)	1.67	100,000	105,664	2025/11/21
平成23年度第1回福岡県公債(20年)	2.008	100,000	115,188	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債(15年)	1.491	100,000	106,422	2026/11/27
平成24年度第1回福岡県公債(30年)	2.12	100,000	124,151	2042/9/19
平成26年度第4回福岡県公債(20年)	1.249	100,000	109,626	2035/2/23
平成27年度第7回福岡県公債	0.464	100,000	101,494	2025/12/25
平成30年度第1回福岡県公債(30年)	0.777	100,000	94,602	2048/6/19
平成30年度第1回福岡県公債(20年)	0.639	100,000	100,055	2038/8/20
令和2年度第1回福岡県公債	0.155	300,000	297,975	2030/6/24
令和3年度第2回福岡県公債	0.155	100,000	98,859	2031/5/30
令和3年度第1回福岡県公債(15年)	0.299	100,000	96,770	2036/7/14
第5回千葉県公債(20年)	2.26	200,000	226,250	2028/9/21

銘 柄 名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第6回千葉県公募公債 (20年)	2.26	100,000	114,119	2029/4/20
第13回千葉県公募公債 (20年)	1.701	100,000	113,750	2032/10/15
平成25年度第5回千葉県公募公債	0.84	100,000	101,026	2023/8/25
平成25年度第8回千葉県公募公債	0.67	300,000	302,940	2023/11/24
平成25年度第9回千葉県公募公債	0.7	100,000	101,083	2023/12/25
平成26年度第7回千葉県公募公債	0.429	100,000	101,107	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公募公債	0.549	100,000	101,547	2025/5/23
平成28年度第4回千葉県公募公債	0.085	100,000	100,128	2026/9/25
平成28年度第6回千葉県公募公債	0.18	120,000	120,642	2027/1/25
令和元年度第7回千葉県公募公債	0.08	300,000	296,688	2030/2/25
令和2年度第7回千葉県公募公債	0.15	100,000	99,143	2030/9/25
令和3年度第1回長野県公募公債 (10年)	0.19	300,000	297,789	2031/4/16
平成30年度第3回茨城県公募公債	0.03	350,000	350,080	2023/8/25
第1回群馬県公募公債 (20年)	1.841	200,000	226,140	2030/10/18
平成29年度第1回岐阜県公募公債 (10年)	0.205	100,000	100,538	2027/10/29
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	202,004	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	100,941	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	100,965	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	202,482	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,128	2024/2/23
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	303,546	2024/3/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	112,000	113,462	2024/5/24
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,333	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	101,272	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,218	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	202,388	2024/11/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	202,184	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	203,118	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	127,449	2025/7/25
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	101,590	2025/11/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,190	2026/3/25
第157回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,116	2026/4/24
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	200,120	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	199,958	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	400,084	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	99,961	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,535	2027/1/25
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	100,830	2027/2/25
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	200,910	2027/6/25
第174回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	194,709	2027/9/24
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	100,591	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	300,876	2028/4/25
第219回共同発行市場公募地方債	0.145	100,000	98,718	2031/6/25
平成29年度第1回静岡市公募公債	0.22	100,000	100,600	2027/11/24
第13回回大阪市公募公債 (20年)	2.08	200,000	229,210	2030/6/14
第15回回大阪市公募公債 (30年)	0.704	100,000	91,172	2051/6/20

銘 柄 名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
第22回回大阪市公募公債 (20年)	0.347	300,000	292,452	2036/5/30
第24回回大阪市公募公債 (20年)	0.655	100,000	101,234	2037/4/21
平成25年度第8回回大阪市公募公債	0.767	100,000	101,266	2024/1/31
令和3年度第2回回大阪市公募公債	0.16	200,000	197,810	2031/5/21
第1回名古屋市長官公債 (30年)	2.53	100,000	125,341	2035/3/20
第5回名古屋市長官公債 (30年)	2.49	100,000	128,851	2039/3/18
第9回名古屋市長官公債 (20年)	2.07	100,000	112,326	2028/12/20
第11回名古屋市長官公債 (30年)	1.774	100,000	117,637	2044/9/20
第49回名古屋市長官公債 (10年)	0.225	100,000	100,725	2027/3/26
第512回名古屋市長官公債 (10年)	0.15	300,000	297,864	2030/6/20
平成28年度第6回京都市公募公債	0.18	200,000	201,072	2027/1/27
平成18年度第3回神戸市公募公債 (20年)	2.54	120,000	132,091	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公募公債 (20年)	2.38	200,000	226,606	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公募公債 (20年)	2.233	100,000	115,180	2030/1/29
平成24年度第12回神戸市公募公債 (20年)	1.711	100,000	113,960	2032/12/17
令和2年度第9回神戸市公募公債 (30年)	0.674	100,000	90,854	2050/6/20
令和3年度第6回神戸市公募公債 (30年)	0.713	100,000	91,370	2051/6/20
第5回回横浜市公募公債 (20年)	2.17	100,000	106,540	2025/6/20
第20回回横浜市公募公債 (20年)	2.1	300,000	341,298	2029/10/19
平成28年度第4回横浜市公募公債	0.175	100,000	100,511	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公募公債	0.24	100,000	100,747	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公募公債	0.195	100,000	100,379	2028/4/17
平成30年度第4回横浜市公募公債	0.289	100,000	100,815	2028/10/17
第30回回横浜市公募公債 (20年)	1.376	200,000	222,130	2034/10/20
令和2年度第1回横浜市公募公債	0.15	300,000	297,987	2030/6/12
令和3年度第2回横浜市公募公債	0.16	100,000	98,905	2031/5/23
平成23年度第9回札幌市公募公債 (15年)	1.493	100,000	106,679	2027/2/12
平成26年度第9回札幌市公募公債 (10年)	0.43	100,000	101,048	2024/12/20
第11回回川崎市公募公債 (20年)	1.84	100,000	113,062	2030/10/18
第89回回川崎市公募公債	0.16	100,000	100,454	2026/12/18
第93回回川崎市公募公債	0.105	100,000	98,778	2030/9/20
平成26年度第2回北九州市公募公債	0.451	100,000	101,107	2024/12/24
平成27年度第2回北九州市公募公債	0.484	100,000	101,575	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公募公債	0.08	100,000	100,115	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市公募公債 (20年)	2.14	100,000	113,927	2029/9/18
平成25年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.511	100,000	112,377	2034/2/17
平成26年度第5回福岡市公募公債	0.539	200,000	202,504	2024/10/28
平成30年度第5回福岡市公募公債 (5年)	0.03	200,000	200,046	2023/8/17
平成30年度第10回福岡市公募公債 (5年)	0.02	100,000	100,014	2023/12/26
平成25年度第3回広島市公募公債	0.67	150,000	151,719	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公募公債	0.456	100,000	101,121	2024/12/25
平成28年度第4回広島市公募公債	0.165	105,000	105,478	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公募公債	0.23	170,000	171,016	2028/2/25
令和元年度第6回広島市公募公債	0.115	550,000	545,391	2030/2/25
令和2年度第3回広島市公募公債 (5年)	0.02	200,000	199,868	2025/10/24

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
令和元年度第5回千葉市公募公債	0.08	200,000	197,792	2030/2/25
平成25年度第4回福岡県公募公債	0.7	100,000	101,303	2024/4/25
平成26年度第1回岡山県公債(10年)	0.33	200,000	201,628	2025/1/30
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	111,567	2027/12/20
小計		32,361,680	33,511,126	
特殊債券(除く金融債)				
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	126,000	126,000	2026/3/13
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	100,443	2027/7/20
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	210,109	2027/9/24
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	187,983	2028/9/15
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	0.001	220,000	220,083	2024/10/24
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	202,000	203,959	2023/6/27
第2回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	300,000	307,020	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	100,205	2026/12/14
第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	100,029	2025/1/24
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	132,298	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	227,796	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	200,000	229,808	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	124,889	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	115,736	2030/12/27
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	113,652	2032/12/28
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	201,954	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	149,619	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	101,021	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	268,548	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	202,250	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	533,000	539,838	2024/1/31
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	101,217	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	224,426	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	103,347	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	101,370	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	101,336	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	223,024	2034/9/29

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
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	101,329	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	101,227	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	302,646	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	108,693	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	218,720	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	202,238	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	100,468	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	88,275	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	106,836	2026/11/30
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	205,672	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	100,438	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	200,838	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	100,413	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	120,651	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	200,416	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	299,550	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	215,211	2028/10/31
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	100,000	98,844	2029/6/29
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.001	100,000	98,632	2029/10/31
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.311	100,000	100,383	2023/7/28
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	0.001	600,000	600,210	2024/8/28
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	101,032	2023/8/14
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	105,000	106,060	2023/11/17
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	202,334	2024/2/16
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	101,191	2024/3/15
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	101,305	2025/12/12
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	100,000	2026/3/13
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,205	2026/12/14
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,046	2027/4/16
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,441	2027/7/16
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,404	2027/8/13
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	110,624	2028/2/15

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第111回	政府保証	地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	156,825	2028/8/15
第113回	政府保証	地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	100,563	2028/10/16
第120回	政府保証	地方公共団体金融機構債券	0.001	100,000	98,810	2029/7/13
第16回	政府保証	民間都市開発債券	0.699	180,000	181,798	2023/10/20
第129回	株式会	社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	83,736	2070/7/16
第21回	回道路	債券	2.75	100,000	125,088	2033/6/20
第27回	回道路	債券	2.42	400,000	417,252	2024/3/20
第28回	回道路	債券	2.83	200,000	253,424	2033/12/20
第33回	回道路	債券	2.91	200,000	256,576	2034/6/20
第34回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	112,841	2028/3/17
第36回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	139,939	2048/3/20
第37回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	113,490	2028/6/20
第42回	回道路	債券	2.22	100,000	106,115	2025/3/21
第47回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	114,905	2029/4/20
第95回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	114,027	2032/9/17
第112回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	0.85	300,000	302,661	2023/6/20
第115回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	100,945	2023/9/20
第118回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,167	2023/12/20
第131回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	111,190	2034/6/20
第134回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	101,026	2024/6/20
第144回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,114	2024/12/20
第153回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	121,966	2055/3/19
第158回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	218,082	2035/6/20
第188回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	599,058	2037/9/18
第208回	日本高速	道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	100,172	2058/3/19
第2回	回営企	業債券(30年)	2.39	300,000	365,766	2033/12/20
第3回	回地方公	共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	106,415	2029/1/26
第5回	回営企	業債券(30年)	2.72	300,000	380,145	2034/9/22
第7回	回営企	業債券(20年)	2.2	100,000	103,937	2024/3/22
第7回	回営企	業債券(30年)	2.67	200,000	254,298	2035/6/20
第8回	回営企	業債券(20年)	2.25	40,000	41,611	2024/3/22
第8回	回営企	業債券(30年)	2.5	100,000	125,281	2035/9/21
第8回	回地方公	共団体金融機構債券(20年)	2.043	200,000	228,210	2030/6/28
第10回	回地方公	共団体金融機構債券(20年)	1.752	200,000	223,934	2030/8/28
第11回	回地方公	共団体金融機構債券(30年)	0.633	200,000	178,532	2050/8/26
第18回	回営企	業債券(20年)	2.58	100,000	110,171	2026/6/19
第19回	回地方公	共団体金融機構債券(20年)	1.84	200,000	228,566	2031/12/26
第24回	回地方公	共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	113,472	2032/9/28
第34回	回地方公	共団体金融機構債券(20年)	1.624	500,000	566,625	2034/1/27

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第58回	回地方公	共団体金融機構債券	0.739	100,000	101,295	2024/3/28
第65回	回地方公	共団体金融機構債券	0.535	300,000	303,651	2024/10/28
第67回	回地方公	共団体金融機構債券	0.501	100,000	101,213	2024/12/27
第69回	回地方公	共団体金融機構債券	0.478	100,000	101,217	2025/2/28
第76回	回地方公	共団体金融機構債券	0.505	200,000	202,994	2025/9/26
F77回	回地方公	共団体金融機構債券	1.519	100,000	106,336	2026/10/20
第83回	回地方公	共団体金融機構債券	0.09	200,000	200,194	2026/4/28
第88回	回地方公	共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,998	2026/9/28
F95回	回地方公	共団体金融機構債券	1.336	100,000	103,497	2025/2/6
F107回	回地方公	共団体金融機構債券	1.388	100,000	103,788	2025/3/19
第116回	回地方公	共団体金融機構債券	0.155	100,000	99,703	2029/1/26
F132回	回地方公	共団体金融機構債券	1.09	100,000	103,291	2025/7/30
F146回	回地方公	共団体金融機構債券	1.134	200,000	207,356	2025/10/28
F202回	回地方公	共団体金融機構債券	0.929	200,000	207,020	2026/6/26
F208回	回地方公	共団体金融機構債券	0.857	100,000	102,930	2026/2/4
F214回	回地方公	共団体金融機構債券	0.94	100,000	104,084	2027/4/28
第29回	首都高	速道路株式会社債	0.125	100,000	100,045	2026/12/18
第7回	回阪神	高道路債券	2.18	100,000	105,928	2025/3/21
第19回	回水資源	債券(サステナビリティボンド)	0.001	200,000	199,824	2024/12/20
第4回	株式会	社日本政策金融公社債	2.2	100,000	114,081	2029/9/20
第18回	株式会	社日本政策金融公社債	2.157	100,000	116,222	2031/5/9
第87回	株式会	社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,914	2024/3/11
第88回	株式会	社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,956	2023/11/10
第89回	株式会	社日本政策金融公社債	0.03	100,000	99,972	2025/3/12
第117回	回都市	再生債券	0.804	200,000	208,504	2030/11/20
第159回	回都市	再生債券	0.43	200,000	154,990	2059/3/19
第161回	回都市	再生債券	0.687	100,000	85,103	2059/3/19
第171回	回都市	再生債券	0.886	200,000	181,582	2061/3/18
第5回	回本州	四国連絡橋債券	2.23	100,000	105,544	2024/12/20
第346回	回東京	交通債券	1.13	20,000	20,229	2023/6/20
第62回	回独立	行政法人福祉医療機構債券	0.18	100,000	99,211	2030/6/20
第1回	回貸付	債権担保宅金融支援機構債券	2.13	10,245	10,310	2042/5/10
第1回	回貸付	債権担保S種宅金融支援機構債券	2.08	10,648	10,770	2037/11/10
第2回	回貸付	債権担保S種宅金融支援機構債券	2.27	10,742	10,893	2037/11/10
第2回	回貸付	債権担保T種宅金融支援機構債券	0.18	134,739	134,270	2032/5/10
第3回	回貸付	債権担保T種宅金融支援機構債券	0.16	95,042	94,770	2033/1/10
第4回	回貸付	債権担保宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,839	2042/8/10
第4回	回貸付	債権担保S種宅金融支援機構債券	2.03	11,619	11,841	2038/5/10
第4回	回貸付	債権担保T種宅金融支援機構債券	0.08	169,236	168,381	2033/4/10
第6回	回貸付	債権担保S種宅金融支援機構債券	1.94	11,501	11,714	2038/11/10
第6回	回貸付	債権担保T種宅金融支援機構債券	0.06	192,255	191,018	2034/2/10
第7回	回貸付	債権担保T種宅金融支援機構債券	0.14	68,772	68,503	2034/2/10
第8回	回貸付	債権担保S種宅金融公社債券	2.15	9,987	10,047	2037/5/10
第8回	回貸付	債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	11,929	12,252	2039/5/10
第8回	回貸付	債権担保T種宅金融支援機構債券	0.13	230,094	228,943	2034/6/10
第9回	回貸付	債権担保S種宅金融公社債券	2.19	10,194	10,256	2037/5/10

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	158,322	157,661	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	12,070	12,380	2039/11/10
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	111,982	2027/12/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	15,938	16,727	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	16,069	16,910	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	17,978	19,049	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	19,816	20,900	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	21,714	23,035	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	22,275	23,608	2044/12/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	46,492	49,148	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	10,407	10,468	2040/11/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	20,992	22,078	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	10,670	10,786	2041/2/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	10,307	10,378	2041/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	21,375	22,465	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	21,015	22,119	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	19,831	20,814	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	11,492	11,757	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	42,464	44,341	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	22,311	23,325	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	11,196	11,406	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	29,588	30,941	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	28,330	29,606	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	28,630	29,936	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	64,376	67,144	2047/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	76,318	79,171	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	39,271	40,694	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	39,842	41,622	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	40,092	41,932	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	35,047	36,538	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	34,329	35,533	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	39,865	41,737	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	173,310	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	104,565	108,240	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	142,232	147,197	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	40,575	41,903	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	41,885	43,280	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	42,880	44,183	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	114,204	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	134,922	138,949	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	46,395	47,591	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	97,682	99,514	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	54,295	55,483	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	58,033	59,122	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	57,478	58,841	2050/6/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	178,620	183,530	2050/7/10

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	120,492	123,648	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	58,204	59,614	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	63,181	64,725	2051/1/10
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	69,494	69,011	2051/5/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	75,109	74,755	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	74,747	74,223	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	75,046	74,841	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	75,502	75,619	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	76,026	76,016	2052/2/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	77,872	77,801	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	78,273	78,282	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,125	77,917	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,131	77,919	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	78,840	78,655	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	159,830	159,096	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	79,103	78,864	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	161,548	161,405	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	80,142	79,893	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	160,908	160,116	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	81,458	81,186	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	163,600	162,762	2053/7/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	164,636	163,763	2053/8/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	122,408	2043/3/20
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	83,408	83,375	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	82,925	83,070	2053/11/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	83,194	82,653	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	171,234	169,358	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	85,907	84,871	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	85,264	84,357	2054/5/10
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	172,908	170,793	2054/6/10
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	87,589	85,895	2054/7/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	264,483	258,011	2054/9/10
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	177,290	172,912	2054/10/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	90,165	89,166	2055/2/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	90,795	89,540	2055/3/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	186,272	184,498	2055/9/10
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	94,267	93,245	2055/11/10
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	188,800	186,696	2055/12/10
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	190,028	187,550	2056/1/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,657	93,664	2056/2/10
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	190,498	189,250	2056/3/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,824	190,625	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	96,517	95,813	2056/6/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,503	96,258	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	292,386	288,614	2056/9/10
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	97,777	96,638	2056/10/10

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	99,349	99,609	2057/3/10
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	100,000	100,247	2057/6/10
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	94,708	2036/7/18
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	0.753	100,000	91,495	2051/3/20
第64回日本学生支援債券	0.001	300,000	299,940	2023/9/20
第65回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,940	2023/11/20
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	106,094	2025/6/20
第24回沖縄振興開発金融公庫債券	0.09	600,000	600,738	2024/6/20
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	114,251	2033/9/20
第53回東日本高速道路株式会社債	0.07	200,000	200,120	2023/12/20
第64回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	99,108	2029/11/29
第67回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	199,322	2030/1/31
第73回東日本高速道路株式会社債	0.21	500,000	496,960	2030/7/17
第86回東日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	99,638	2026/12/18
第60回西日本高速道路株式会社債	0.001	300,000	299,925	2023/9/4
第63回西日本高速道路株式会社債	0.001	200,000	199,922	2023/12/11
第66回西日本高速道路株式会社債	0.08	800,000	800,312	2024/5/20
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	100,876	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	99,936	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	195,618	2034/5/30
小 計		33,652,796	34,709,232	
金融債券				
い第823号商工債	0.17	200,000	200,342	2023/12/27
い第829号商工債	0.13	200,000	200,206	2024/6/27
い第832号商工債	0.06	200,000	199,906	2024/9/27
い第833号商工債	0.05	100,000	99,903	2024/10/25
い第843号商工債	0.12	200,000	200,038	2025/8/27
い第847号商工債	0.1	100,000	99,910	2025/12/26
い第850号商工債	0.1	200,000	199,656	2026/3/27
第350回信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,057	2024/1/26
第360回信金中金債(5年)	0.01	200,000	199,750	2024/11/27
第376回信金中金債(5年)	0.05	100,000	99,790	2026/3/27
第379回信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,716	2026/6/26
第385回信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,613	2026/12/25
第254号商工債(3年)	0.05	300,000	299,862	2024/3/27
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	101,429	2025/9/26
小 計		2,200,000	2,200,178	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第507回中部電力株式会社債	0.605	100,000	101,229	2026/1/23
第511回中部電力株式会社債	0.21	100,000	99,590	2026/7/24
第519回中部電力株式会社債	0.84	100,000	100,192	2037/1/23
第540回中部電力株式会社債	0.53	100,000	93,202	2040/2/24
第508回関西電力株式会社債	0.455	100,000	100,194	2027/4/23
第510回関西電力株式会社債	0.49	200,000	200,570	2027/7/23
第511回関西電力株式会社債	0.41	100,000	99,843	2027/9/17
第524回関西電力株式会社債	0.514	100,000	100,148	2028/10/25

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第536回関西電力株式会社債	0.44	100,000	98,696	2030/12/20
第538回関西電力株式会社債	0.39	100,000	98,206	2031/1/24
第550回関西電力株式会社債	0.39	100,000	99,854	2027/5/25
第385回中国電力株式会社債	0.728	100,000	101,594	2025/7/25
第398回中国電力株式会社債	0.425	100,000	100,210	2027/7/23
第400回中国電力株式会社債	0.34	100,000	99,739	2027/9/24
第416回中国電力株式会社債	0.355	200,000	198,374	2029/5/25
第425回中国電力株式会社債	0.37	100,000	98,797	2030/6/25
第307回北陸電力株式会社債	1.055	100,000	103,036	2026/6/25
第322回北陸電力株式会社債	0.38	100,000	99,976	2027/6/25
第330回北陸電力株式会社債	0.34	200,000	198,172	2029/5/25
第471回東北電力株式会社債	1.168	126,000	127,969	2023/12/25
第481回東北電力株式会社債	0.803	100,000	101,749	2025/7/25
第496回東北電力株式会社債	0.355	100,000	99,661	2027/9/24
第508回東北電力株式会社債	0.465	100,000	99,765	2029/4/25
第521回東北電力株式会社債	0.45	200,000	198,470	2030/5/24
第527回東北電力株式会社債	0.32	100,000	97,744	2023/2/25
第535回東北電力株式会社債	0.2	100,000	98,432	2028/7/25
第309回四国電力株式会社債	0.4	100,000	99,080	2030/5/24
第314回四国電力株式会社債	0.29	100,000	97,566	2031/5/23
第449回九州電力株式会社債	0.43	200,000	200,244	2027/4/23
第465回九州電力株式会社債	0.38	100,000	99,450	2028/7/25
第468回九州電力株式会社債	0.435	100,000	99,765	2028/8/25
第484回九州電力株式会社債	0.375	200,000	197,604	2029/11/22
第489回九州電力株式会社債	0.44	100,000	99,082	2030/5/24
第494回九州電力株式会社債	0.31	100,000	97,404	2031/5/23
第326回北海道電力株式会社債	0.789	100,000	101,764	2025/12/25
第340回北海道電力株式会社債	0.48	100,000	100,363	2027/4/23
第350回北海道電力株式会社債	0.754	100,000	97,514	2038/3/25
第39回大成建設株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,154	2030/6/14
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,929	2027/11/30
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	199,610	2023/11/27
第11回西松建設株式会社無担保社債	0.42	100,000	100,147	2027/3/1
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	300,000	298,950	2026/6/3
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,738	2031/6/3
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	100,203	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	199,718	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	100,222	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	199,768	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	101,209	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	198,864	2026/6/3
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,090	2025/8/29

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	99,974	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	99,433	2028/5/26
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	99,942	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	100,309	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	199,948	2025/12/19
第13回旭化成株式会社無担保社債	0.12	100,000	99,820	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	100,296	2028/11/29
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,148	2027/3/1
第4回ア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	99,890	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	100,265	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	199,546	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	200,170	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	99,610	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	95,248	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	100,068	2028/3/23
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.01	200,000	199,730	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	100,009	2025/7/8
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	200,000	200,010	2030/7/8
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	300,000	294,528	2031/10/14
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	100,102	2026/3/6
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	97,603	2029/7/31
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	0.5	100,000	99,614	2024/12/2
第19回楽天グループ株式会社無担保社債	1.3	100,000	95,441	2033/12/2
第7回東豊ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	101,753	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	101,293	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	100,007	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	100,009	2026/4/17
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	99,910	2029/4/19
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,968	2026/6/19
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	300,120	2025/7/14
第8回株式会社タダノ無担保社債	0.28	100,000	99,731	2025/7/17
第17回株式会社日立製作所無担保社債	1.371	100,000	106,562	2028/12/13
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	99,207	2030/3/12
第1回株式会社安川電機無担保社債	0.13	100,000	99,752	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	100,009	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	99,304	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	100,214	2023/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	200,000	201,848	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	99,898	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	99,903	2025/12/24
第23回パナソニック株式会社無担保社債	0.39	100,000	98,610	2030/12/24
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	99,914	2028/3/17
第19回株式会社デンソー無担保社債	0.001	300,000	299,556	2023/11/20
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,086	2024/9/3
第35回三菱重工株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,915	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	100,050	2023/9/7
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,771	2026/2/4
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.219	200,000	198,268	2031/3/18
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	99,992	2023/9/25
第8回楽天カード株式会社無担保社債	1.07	100,000	96,968	2031/12/17
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,840	2026/3/11
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	93,606	2040/3/9
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	101,285	2024/5/30
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	100,184	2027/7/12
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	114,476	2033/3/4
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	198,544	2029/7/11
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,008	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	100,288	2028/9/14
第60回住友商事株式会社無担保社債	0.574	100,000	100,032	2032/5/24
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	99,613	2029/12/12
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	100,000	116,216	2029/10/16
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	110,341	2027/4/20
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	101,062	2024/9/12
第11回株式会社セブ銀行無担保社債	0.536	100,000	101,032	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	303,126	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	99,901	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	99,826	2025/10/7
第9回みずほリース株式会社無担保社債	0.23	100,000	98,254	2028/9/1
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	200,054	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	199,846	2030/9/20
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.22	100,000	98,372	2028/7/21
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	99,888	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	199,726	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	99,976	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	99,885	2025/12/19

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
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	99,968	2025/10/21
第41回リコーリース株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,318	2026/4/17
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,570	2025/6/24
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.34	100,000	99,395	2026/7/31
第30回株式会社ジャックス無担保社債	0.28	100,000	99,683	2026/1/27
第32回株式会社ジャックス無担保社債	0.23	100,000	99,315	2026/6/8
第35回株式会社ジャックス無担保社債	0.25	100,000	99,164	2026/12/9
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	102,717	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	100,123	2023/12/20
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,091	2029/10/19
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,736	2024/1/19
第21回三井住友フィナンサーズ株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,132	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	100,034	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	199,866	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	100,148	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	100,005	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	99,855	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	800,000	800,240	2023/9/4
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.28	100,000	99,505	2026/9/4
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	200,000	199,618	2026/11/13
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	200,656	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,916	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	95,337	2039/8/5
第135回三菱地所株式会社無担保社債	0.26	100,000	98,514	2031/6/20
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	101,365	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	101,403	2024/9/9
第109回住友不動産株式会社無担保社債	0.31	100,000	98,497	2031/5/9
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	101,025	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	103,154	2026/6/17
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,762	2023/11/27
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	0.624	100,000	100,183	2032/6/2
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	93,363	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	96,334	2040/6/11
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,672	2023/11/27
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	102,485	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	95,704	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	89,112	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	96,862	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,165	2028/9/7

銘柄名	期 末			償還年月日
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	
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	109,784	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	227,058	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	99,524	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	100,949	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	98,024	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	99,346	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	92,052	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	94,640	2041/4/15
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.002	100,000	88,422	2061/7/15
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	112,569	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	92,058	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	98,852	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	499,935	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	94,409	2041/4/22
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	124,817	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	117,746	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	109,113	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	96,811	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	83,483	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	78,464	2070/1/31
第54回東京地下鉄株式会社社債	1.055	100,000	90,609	2061/10/14
第56回東京地下鉄株式会社社債	1.066	100,000	97,903	2052/2/28
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	179,040	2049/11/19
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,494	2025/9/4
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,093	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,328	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	397,356	2026/6/3
第31回株式会社光通信無担保社債	1.38	200,000	196,328	2036/2/1
第33回株式会社光通信無担保社債	0.85	100,000	97,857	2031/6/16
第36回株式会社光通信無担保社債	0.8	100,000	97,098	2031/11/4
第13回回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	105,474	2025/6/20
第44回回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	97,893	2036/10/20
第50回回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,008	2027/7/20
第57回回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,385	2028/7/20
第77回回電源開発株式会社無担保社債	0.4	100,000	100,007	2027/5/20
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	200,000	201,958	2029/10/9
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	300,000	300,675	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	101,445	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	300,660	2026/10/8

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	101,069	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	99,436	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	98,847	2031/4/22
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	300,000	287,877	2036/8/29
第9回株式会社JERA無担保社債	0.664	100,000	100,032	2032/5/25
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.805	100,000	91,377	2050/9/9
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.225	200,000	197,676	2030/9/10
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	200,000	197,040	2031/6/3
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	94,199	2041/6/3
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	100,865	2023/6/20
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	200,910	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 円貨社債	0.384	100,000	99,918	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 円貨社債	0.25	300,000	298,806	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	99,766	2024/6/28
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	400,000	400,916	2023/7/12
第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.499	100,000	99,752	2024/12/12

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,223	2026/6/17
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,948	2024/1/26
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	99,626	2024/6/7
第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	0.463	400,000	399,172	2024/12/5
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	400,204	2023/7/6
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,636	2023/6/2
小 計		30,126,000	30,041,507	
合 計		602,055,476	623,781,716	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 10年国債標準物	599	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 623,781,716	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,677,629	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	627,459,345	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 2022年5月30日現在
(A)資 産	627,559,392,248円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,426,453,894
公 社 債(評価額)	623,781,716,178
未 収 利 息	1,232,469,294
前 払 費 用	18,705,882
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B)負 債	2,629,926,841
未 払 金	2,500,958,920
未 払 解 約 金	28,918,799
未 払 利 息	2,122
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純 資 産 総 額(A-B)	624,929,465,407
元 本	451,551,932,225
次 期 繰 越 損 益 金	173,377,533,182
(D)受 益 権 総 口 数	451,551,932,225口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,840円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	4,488,808,714円
受 取 利 息	4,489,369,711
支 払 利 息	△560,997
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△15,524,030,963
売 買 益	70,367,063
売 買 損	△15,594,398,026
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,391,080
取 引 益	4,305,780
取 引 損	△6,696,860
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△11,037,613,329
(E)前 期 繰 越 損 益 金	182,160,310,920
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	24,805,234,643
(G)解 約 差 損 益 金	△22,550,399,052
(H) 計 (D+E+F+G)	173,377,533,182
次 期 繰 越 損 益 金(H)	173,377,533,182

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は446,205,859,601円、期中追加設定元本額は61,228,635,499円、期中一部解約元本額は55,882,562,875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 100,347,000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	92,541,310,930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)	80,859,739,502円
DC日本債券インデックス・オープンP	66,912,531,360円
DCマイセクション50	29,416,463,980円
DCマイセクション25	25,809,895,198円
分散投資コア戦略ファンドS	25,440,115,400円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,733,806,056円
分散投資コア戦略ファンドA	19,869,312,536円
日本債券ファンド・シリーズ1	15,920,823,109円
DCマイセクションS50	14,198,988,240円
DCマイセクションS25	12,760,944,723円
DCマイセクション75	8,599,031,500円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,042,755,457円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,042,619,488円

世界経済インデックスファンド	3,710,871,247円
DC世界経済インデックスファンド	3,341,731,761円
DCマイセクションS75	3,211,693,140円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,196,257,589円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,939,383,962円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	2,202,205,181円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,435,781,360円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,356,312,332円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,149,756,134円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,003,105,420円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	821,333,270円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	795,519,625円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	763,422,315円
DC日本債券インデックス・オープン ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	440,199,184円 418,803,647円
グローバル経済コア	229,985,351円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	160,194,027円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	139,022,548円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	128,536,453円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	114,549,770円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	92,634,852円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	88,838,138円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	85,353,934円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	76,010,188円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	71,893,746円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	66,236,571円
SMT インデックスバランス・オープン	61,223,294円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,666,819円
SMT 世界経済インデックス・オープン	36,559,382円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	33,130,779円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	30,283,266円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	28,573,508円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	27,610,659円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	19,753,874円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	19,614,917円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,462,539円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	12,384,315円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	11,059,138円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,712,858円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,959,214円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	2,855,640円
エマージング株式オープン	2,227,240円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	2,115,332円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	1,435,383円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	972,063円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	362,781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35期～第37期(2022年1月8日～2022年7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いません。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いません。	

○最近15期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配 金	期中 騰落 率	期中 騰落 率	期中 騰落 率				
23期(2020年3月9日)	円	60	△14.1	141.65	△14.1	95.3	1.8	2.9	百万円 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
35期(2022年3月7日)	19,744	40	△9.7	226.18	△9.7	95.6	1.9	2.4	48,721
36期(2022年5月9日)	21,446	70	9.0	247.03	9.2	96.3	1.1	2.5	51,673
37期(2022年7月7日)	20,681	85	△3.2	239.03	△3.2	95.7	1.7	2.5	51,054

* 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。

* 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、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
		円	騰 落 率	円	騰 落 率			
第35期	(期 首) 2022年 1 月 7 日	21,909	—	250.34	—	95.9	1.7	2.3
	1 月 末	20,593	△ 6.0	235.34	△ 6.0	96.5	1.1	2.3
	2 月 末	20,451	△ 6.7	233.96	△ 6.5	95.8	1.8	2.3
	(期 末) 2022年 3 月 7 日	19,784	△ 9.7	226.18	△ 9.7	95.6	1.9	2.4
第36期	(期 首) 2022年 3 月 7 日	19,744	—	226.18	—	95.6	1.9	2.4
	3 月 末	22,579	14.4	258.77	14.4	95.8	1.4	2.4
	4 月 末	21,611	9.5	247.57	9.5	95.5	1.8	2.6
	(期 末) 2022年 5 月 9 日	21,516	9.0	247.03	9.2	96.3	1.1	2.5
第37期	(期 首) 2022年 5 月 9 日	21,446	—	247.03	—	96.3	1.1	2.5
	5 月 末	21,474	0.1	247.28	0.1	96.3	1.2	2.4
	6 月 末	20,968	△ 2.2	241.49	△ 2.2	96.1	1.3	2.5
	(期 末) 2022年 7 月 7 日	20,766	△ 3.2	239.03	△ 3.2	95.7	1.7	2.5

* 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－4.7%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの－4.5%を0.2ポイント下回りました。ロシアによるウクライナへの軍事侵攻により世界経済の先行き不透明感が強まったことや、インフレ抑制のために主要投資国が金融引き締め姿勢を強めたことを受けて、基準価額は下落しました。

【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、また資金流入入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いません。

【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いません。

※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）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

(2022年 1 月 8 日～2022年 7 月 7 日)

項 目	第35期～第37期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	19	0.087	(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)	(0.071)	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)	(0.005)	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 ※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	1	0.003	(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 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	(1)	(0.003)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	△ 0	△0.001	(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 ）	(△ 1)	(△0.006)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	20	0.090	
作成期間の平均基準価額は、21,279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

(2022年1月8日～2022年7月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第35期～第37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 777,219	千円 3,367,800	千口 665,921	千円 3,040,788

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2022年1月8日～2022年7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35期～第37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	138,823,787千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	1,196,610,647千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	

*(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

(2022年1月8日～2022年7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

(2022年1月8日～2022年7月7日)

第35期首残高 (元本)	設定元本	解約元本	第37期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2022年7月7日現在)

親投資信託残高

銘柄	第34期末		第37期末	
	口数	評価額	口数	評価額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 11,527,942	千円 51,049,707	千口 11,639,240	千円 51,049,707

*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7月7日現在)

項 目	第37期末	
	評 価 額	比 率
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千円 51,049,707	% 99.6
コール・ローン等、その他	229,716	0.4
投資信託財産総額	51,279,423	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37期末における外貨建純資産(1,275,792,992千円)の投資信託財産総額(1,277,715,538千円)に対する比率は99.8%です。

*外貨建資産は、第37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=135.88円、1カナダドル=104.21円、1英ポンド=162.00円、1スイスフラン=140.00円、1スウェーデンクローナ=12.88円、1ノルウェークローネ=13.40円、1デンマーククローネ=18.59円、1ユーロ=138.35円、1香港ドル=17.32円、1シンガポールドル=96.77円、1豪ドル=92.19円、1ニュージーランドドル=83.66円、1新シエケル=38.932円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第35期末	第36期末	第37期末
	2022年3月7日現在	2022年5月9日現在	2022年7月7日現在
	円	円	円
(A) 資産	48,834,546,344	51,867,181,740	51,279,423,650
コール・ローン等	19,731,439	30,549,992	19,574,050
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	48,716,110,191	51,667,966,026	51,049,707,775
未収入金	98,704,714	168,665,722	210,141,825
(B) 負債	113,474,181	194,002,706	224,617,185
未払収益分配金	98,704,714	168,665,721	209,836,037
未払解約金	—	8,999,998	—
未払信託報酬	14,497,651	16,036,315	14,509,120
未払利息	2	12	5
その他未払費用	271,814	300,660	272,023
(C) 純資産総額(A-B)	48,721,072,163	51,673,179,034	51,054,806,465
元本	24,676,178,585	24,095,103,132	24,686,592,702
次期繰越損益金	24,044,893,578	27,578,075,902	26,368,213,763
(D) 受益権総口数	24,676,178,585口	24,095,103,132口	24,686,592,702口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,744円	21,446円	20,681円

(注) 第35期首元本額は24,201,921,272円、第35～37期中追加設定元本額は1,681,557,186円、第35～37期中一部解約元本額は1,196,885,756円、1口当たり純資産額は、第35期1.9744円、第36期2.1446円、第37期2.0681円です。

○損益の状況

項 目	第35期	第36期	第37期
	2022年1月8日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年5月9日	2022年5月10日～ 2022年7月7日
	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 407	△ 184	△ 363
支払利息	△ 407	△ 184	△ 363
(B) 有価証券売買損益	△ 5,145,181,932	4,273,001,523	△ 1,571,310,945
売買益	18,458,209	4,437,499,354	11,250,149
売買損	△ 5,163,640,141	△ 164,497,831	△ 1,582,561,094
(C) 信託報酬等	△ 14,769,465	△ 16,336,975	△ 14,781,143
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 5,159,951,804	4,256,664,364	△ 1,586,092,451
(E) 前期繰越損益金	20,832,861,535	15,166,098,401	18,966,232,682
(F) 追加信託差損益金	8,470,688,561	8,323,978,858	9,197,909,569
(配当等相当額)	(10,302,813,537)	(10,116,581,816)	(11,166,993,770)
(売買損益相当額)	(△ 1,832,124,976)	(△ 1,792,602,958)	(△ 1,969,084,201)
(G) 計(D+E+F)	24,143,598,292	27,746,741,623	26,578,049,800
(H) 収益分配金	△ 98,704,714	△ 168,665,721	△ 209,836,037
次期繰越損益金(G+H)	24,044,893,578	27,578,075,902	26,368,213,763
追加信託差損益金	8,470,688,561	8,323,978,858	9,197,909,569
(配当等相当額)	(10,303,877,407)	(10,117,078,018)	(11,172,163,909)
(売買損益相当額)	(△ 1,833,188,846)	(△ 1,793,099,160)	(△ 1,974,254,340)
分配準備積立金	20,835,709,125	20,293,251,974	19,987,842,232
繰越損益金	△ 5,261,504,108	△ 1,039,154,930	△ 2,817,538,038

* 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20期（決算日2022年3月31日）

作成対象期間（2021年4月1日～2022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せん。
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。 外貨建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	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	期騰落率	騰落率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	期騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
20期(2022年3月31日)	47,511	25.8	514.47	26.0	95.8	1.4	2.4	1,315,344

*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

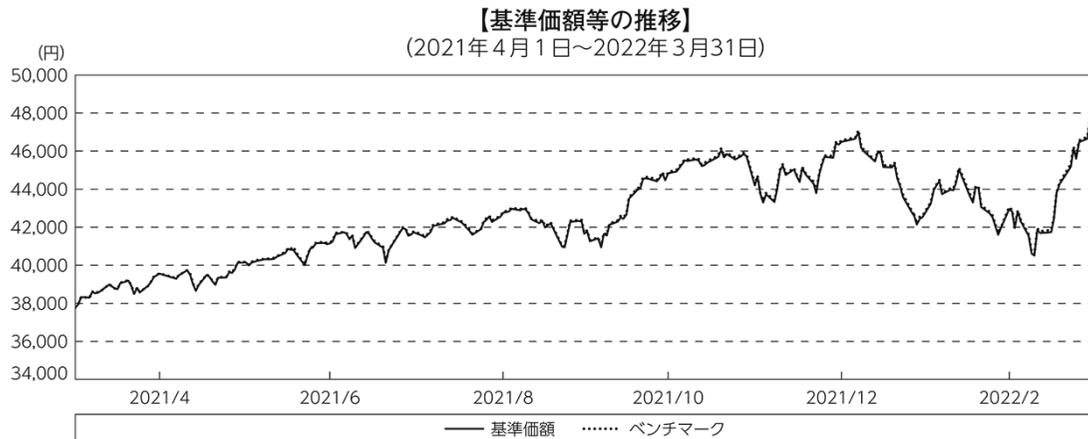
年月日	基準価額		ベンチマーク		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率
	騰落率	騰落率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	騰落率			
(期首) 2021年3月31日	円	%		%	%	%	%
4月末	37,781	—	408.16	—	95.9	1.9	2.2
5月末	39,556	4.7	427.49	4.7	95.8	2.0	2.2
6月末	40,142	6.2	434.03	6.3	95.9	1.8	2.2
7月末	41,737	10.5	451.47	10.6	96.3	1.4	2.3
8月末	42,767	13.2	462.63	13.3	96.0	1.7	2.3
9月末	41,777	10.6	451.95	10.7	95.8	1.9	2.2
10月末	44,835	18.7	485.08	18.8	96.0	1.4	2.3
11月末	44,662	18.2	483.01	18.3	95.6	2.0	2.3
12月末	46,484	23.0	503.00	23.2	95.7	1.9	2.3
2022年1月末	43,234	14.4	467.89	14.6	96.5	1.1	2.3
2月末	42,941	13.7	465.14	14.0	95.8	1.8	2.3
(期末) 2022年3月31日	47,511	25.8	514.47	26.0	95.8	1.4	2.4

*騰落率は期首比です。

*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。

○基準価額の変動要因

新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったこと、堅調な欧米企業の決算や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、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、期首から新型コロナウイルスのワクチン接種加速による経済正常化への期待が高まったこと、堅調な欧米企業の決算や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。2021年9月には、米国での新型コロナウイルスの感染再拡大や中国の大手不動産会社の債務問題を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まり下落に転じましたが、10月以降は、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米債務上限問題が先送りされたこと、堅調な欧米企業の決算発表が続いたことなどから再び上昇しました。2022年1月以降は、FRB（米連邦準備制度理事会）が金融政策の正常化を前倒しで進めるとの見方が強まったこと、ロシアがウクライナへ軍事侵攻したことや欧米を中心にロシアに対する経済制裁を強化する動きが広がったことで世界経済の先行き不透明感が強まったことなどを受けて下落しました。3月中旬から下旬にかけては、ロシアとウクライナの停戦交渉進展への期待などから上昇しました。

為替市場は、期首から主要通貨である米ドルは米金融緩和の早期縮小観測や米長期金利の行方を巡り一進一退となりました。2021年9月下旬から10月中旬にかけては、米金融政策の正常化が意識され米長期金利が上昇基調になったことなどから上昇（円安）しました。11月以降は、新型コロナウイルスのオミクロン株の感染拡大への懸念や、FRB（米連邦準備制度理事会）の金融政策正常化に対する姿勢などを巡り、再び一進一退となりました。2022年3月以降は、エネルギー価格の高騰などによる物価上昇に対応するべくFRBが金融引き締め姿勢を強めていることなどを背景に日米の金利差が拡大したことなどを受けて上昇（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ない、また資金流出入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）は行ないませんでした。

○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+25.8%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+26.0%を0.2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）

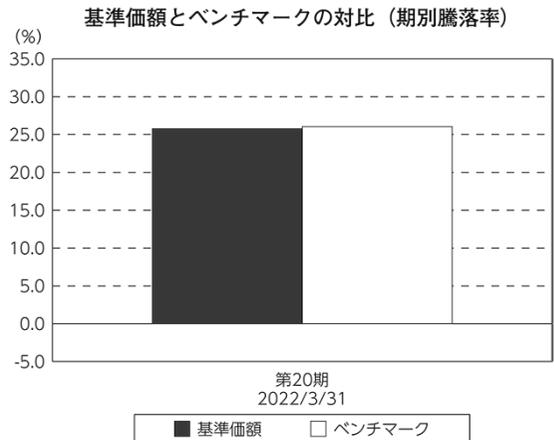
（その他、差異を生じた要因）

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）

◎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ないます。

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。



(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。

(2021年4月1日～2022年3月31日)

○ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 1 (0) (0) (0)	% 0.002 (0.001) (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.005 (0.005) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	4 (2) (2)	0.010 (0.004) (0.006)	(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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	7	0.017	
期中の平均基準価額は、42,255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

(2021年4月1日～2022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 93,525 (△ 1,762)	千米ドル 1,059,353 (7,253)	百株 11,100 (3,268)	千米ドル 99,086 (24,554)
	カナダ	11,780 (1,741)	千カナダドル 69,488 (7,287)	5,352 (458)	千カナダドル 8,209 (3,746)
	イギリス	68,195 (11,455)	千英ポンド 41,463 (4,740)	6,519 (18,083)	千英ポンド 3,316 (12,729)
	スイス	4,400 (91)	千スイスフラン 39,169 (779)	778 (91)	千スイスフラン 4,070 (1,176)
	スウェーデン	10,692 (16,002)	千スウェーデンクローナ 222,770 (64,913)	3,741 (2,670)	千スウェーデンクローナ 25,672 (64,913)
	ノルウェー	1,553	千ノルウェークローネ 28,813	—	千ノルウェークローネ —
	デンマーク	1,304 (1,328)	千デンマーククローネ 66,286 (—)	224	千デンマーククローネ 11,495
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	6,029 (4,685)	31,347 (6,350)	1,250 (2,900)	5,824 (5,232)
	イタリア	19,609 (11)	8,596 (5)	12,030 (—)	686 (106)
	フランス	6,953 (2,938)	39,382 (724)	3,852 (996)	6,150 (318)
	オランダ	5,185 (1,630)	25,395 (△ 23)	1,594	3,496
	スペイン	12,397 (42,855)	8,724 (1,640)	1,950 (41,377)	1,577 (1,012)
	ベルギー	589	3,866	70	419
オーストリア	297	1,159	—	—	
ルクセンブルグ	379	858	—	—	
フィンランド	2,104	3,344	340	172	
アイルランド	291	2,144	— (1,398)	— (—)	
ポルトガル	1,230	1,774	—	—	
香港	22,822 (930)	千香港ドル 97,155 (△ 147)	16,902	千香港ドル 21,717	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	シンガポール	百株 5,270 (9,816)	千シンガポールドル 4,734 (1,277)	百株 5,016 (4,800)	千シンガポールドル 0.50032 (1,822)
	オーストラリア	17,624 (5,171)	千豪ドル 43,365 (15,255)	8,282 (6,744)	千豪ドル 5,076 (7,086)
国	ニュージーランド	1,750	千ニュージーランドドル 1,360	1,170	千ニュージーランドドル 714
	イスラエル	1,331	千新シエケル 5,289	—	千新シエケル —

*金額は受け渡し代金。

*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。

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

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,700	1,135	—	—
AMERICAN TOWER CORP	12,300	3,223	—	—
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	29,000	234	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,900	860	—	—
BOSTON PROPERTIES	3,600	419	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,800	432	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	9,000	1,650	—	—
DIGITAL REALTY TRUST INC	8,800	1,294	—	—
DUKE REALTY CORP	7,900	431	—	—
EQUINIX INC	2,100	1,605	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,700	219	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	10,300	853	3,200	245
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,300	426	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,200	713	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	12,000	415	—	—
HOST HOTELS & RESORTS INC	26,000	455	—	—
INVITATION HOMES INC	21,000	815	—	—
IRON MOUNTAIN INC	5,000	245	—	—
KIMCO REALTY CORP	115,000	2,784	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	9,000	181	—	—
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,100	420	—	—
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,500	237	43,000	1,201
ORION OFFICE REIT INC	—	—	9,551	184
	(9,551)	(—)		
PROLOGIS INC	18,100	2,468	1,700	228
PUBLIC STORAGE	3,200	1,047	—	—
REALTY INCOME CORP	22,084	1,512	—	—
	(29,116)	(1,643)		
REGENCY CENTERS CORP	6,400	450	3,800	244
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,400	767	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,500	884	—	—
SUN COMMUNITIES INC	3,500	650	—	—
UDR INC	13,000	689	—	—
VENTAS INC	9,700	526	—	—
VEREIT INC	4,300	210	—	—
	(△ 41,300)	(△ 1,643)		
VICI PROPERTIES INC	33,000	976	—	—
VORNADO REALTY TRUST	5,000	205	—	—
WP CAREY INC	6,600	501	—	—
WELLTOWER INC	14,200	1,150	—	—
WEYERHAEUSER CO	22,000	845	—	—
小計	470,184	31,947	61,251	2,104
	(△ 2,633)	(—)		
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,000	130	—	—
小計	6,000	130	—	—
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
BRITISH LAND	31,000	168	—	—
SEGRO PLC	38,000	453	—	—

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
LAND SECURITIES GROUP PLC	21,000	146	—	—
小計	90,000	768	—	—
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
KLEPIERRE	7,700 (—)	150 (△ 32)	—	—
GECINA SA	1,000	136	—	—
COVIVIO	2,400	151	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,700	176	3,000	209
小計	13,800 (—)	614 (△ 32)	3,000	209
ユーロ計	13,800 (—)	614 (△ 32)	3,000	209
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	39,000	2,793	—	—
小計	39,000	2,793	—	—
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	123,200 (74,242)	258 (133)	—	—
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	80,800 (—)	247 (△ 23)	—	—
SUNTEC REIT	—	—	300,000	429
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	122,000 (20,349)	240 (29)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST-RTS	—	—	—	—
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	(20,349)	(37)	(20,349)	(1)
小計	326,000 (114,940)	745 (175)	300,000 (20,349)	429 (1)
オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
MIRVAC GROUP	90,000	265	—	—
GPT GROUP	50,000	238	—	—
LENDLEASE GROUP	24,000	257	—	—
STOCKLAND TRUST GROUP	60,000	254	—	—
DEXUS/AU	25,000 (△196,000)	259 (△ 1,892)	—	—
GOODMAN GROUP	36,000	823	—	—
SCENTRE GROUP	190,000	546	—	—
DEXUS/AU	—	—	—	—
小計	(196,000)	(1,892)	—	—
小計	475,000	2,645	—	—

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

* () 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 223,381	百万円 225,472	百万円 -	百万円 -

*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

(2021年4月1日～2022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	181,377,433千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,080,869,998千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (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4月1日～2022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

(2022年3月31日現在)

外国株式

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	
AFLAC INC	1,089	1,169	7,656	937,134	保険
AES CORP	1,100	1,270	3,232	395,582	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	—	910	2,336	286,010	娯楽
AT & T INC	11,810	13,440	32,444	3,970,840	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	2,937	3,328	40,062	4,903,244	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	2,926	3,327	54,479	6,667,761	バイオテクノロジー
ABIOMED INC	72	87	2,858	349,795	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,290	1,475	11,853	1,450,700	娯楽
ADOBE INC	794	895	41,198	5,042,268	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	109	120	2,541	311,095	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES	1,993	3,076	36,677	4,488,995	半導体・半導体製造装置
AFFIRM HOLDINGS INC	—	330	1,542	188,817	情報技術サービス
AGILENT TECHNOLOGIES INC	519	566	7,667	938,368	ライフサイエンス・ツール/サービス
ATRBNB INC-CLASS A	87	555	9,636	1,179,406	ホテル・レストラン・レジャー
AIR PRODUCTS	363	420	10,632	1,301,338	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	274	313	3,790	463,949	情報技術サービス
ALBEMARLE CORP	197	218	4,864	595,386	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	369	—	—	—	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC	125	143	6,323	773,875	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP	23	25	2,187	267,713	保険
ALLIANT ENERGY CORP	409	484	3,043	372,480	電力
ALLSTATE CORP	496	535	7,510	919,254	保険
ALLY FINANCIAL INC	630	670	2,985	365,397	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	187	230	3,800	465,145	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C	492	538	153,514	18,788,579	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL A	498	566	160,702	19,668,411	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALTICE USA INC-A	360	—	—	—	メディア
ALTRIA GROUP INC	3,105	3,444	17,926	2,193,965	タバコ
AMAZON.COM INC	706	858	285,671	34,963,378	インターネット販売・通信販売
AMERCO	17	17	1,039	127,272	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	415	494	4,634	567,241	総合公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	834	949	9,434	1,154,744	電力
AMERICAN EXPRESS CO	1,136	1,239	23,511	2,877,543	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	125	139	2,053	251,304	保険
AMERICAN INTL GROUP	1,450	1,549	9,834	1,203,656	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	306	347	5,754	704,353	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	257	289	4,483	548,741	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	192	213	6,615	809,705	資本市場
AMETEK INC	373	438	5,931	725,997	電気設備
AMGEN INC	961	1,060	25,712	3,146,943	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	1,004	1,126	8,637	1,057,149	電子装置・機器・部品
ANALOG DEVICES INC	618	1,014	16,881	2,066,074	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	145	164	5,253	642,924	ソフトウェア
ANTHEM INC	409	457	22,963	2,810,482	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	275	—	—	—	資本市場
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	—	665	4,192	513,078	各種金融サービス
APPLE INC	28,174	30,874	548,847	67,173,396	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,507	1,699	23,072	2,823,833	半導体・半導体製造装置

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	
ARAMARK	390	440	1,666	203,936	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	938	1,045	9,331	1,142,125	食品
ARISTA NETWORKS INC	96	440	6,080	744,175	通信機器
ARROW ELECTRS INC	121	137	1,651	202,114	電子装置・機器・部品
ASANA INC - CL A	-	119	496	60,719	ソフトウェア
ASSURANT INC	102	102	1,858	227,417	保険
ATMOS ENERGY CORP	202	244	2,937	359,462	ガス
AUTODESK INC.	367	410	9,061	1,108,975	ソフトウェア
AUTOLIV INC	140	-	-	-	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	706	790	17,993	2,202,168	情報技術サービス
AUTOZONE	37	39	8,153	997,859	専門小売り
AVALARA INC	131	172	1,726	211,247	ソフトウェア
AVANTOR INC	840	1,050	3,608	441,687	ライフサイエンス・ツール/サービス
AVERY DENNISON CORP	134	156	2,758	337,618	容器・包装
BAKER HUGHES CO	1,110	1,580	5,901	722,260	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	551	618	5,654	692,003	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	12,900	13,860	59,598	7,294,199	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,343	1,464	7,589	928,863	資本市場
BATH & BODY WORKS INC	-	504	2,514	307,805	専門小売り
BAXTER INTERNATIONAL INC.	855	933	7,406	906,439	ヘルスケア機器・用品
BECTON, DICKINSON	484	534	14,396	1,761,939	ヘルスケア機器・用品
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	-	330	1,467	179,568	ソフトウェア
WR BERKLEY CORP	239	399	2,676	327,575	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	2,272	2,453	87,721	10,736,262	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	393	424	4,088	500,407	専門小売り
BILL.COM HOLDINGS INC	-	142	3,296	403,462	ソフトウェア
BIO-RAD LABORATORIES-A	36	43	2,494	305,361	ライフサイエンス・ツール/サービス
BTOMARIN PHARMACEUTICAL INC	306	334	2,601	318,400	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	252	277	5,845	715,434	バイオテクノロジー
BIO TECHNE CORP	-	75	3,317	406,071	ライフサイエンス・ツール/サービス
BLACK KNIGHT INC	270	298	1,736	212,523	ソフトウェア
BLACKROCK INC	254	285	22,224	2,720,083	資本市場
BLACKSTONE INC	1,126	1,299	16,527	2,022,761	資本市場
BOEING CO	885	1,055	20,563	2,516,706	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC	67	77	17,925	2,193,904	ホテル・レストラン・レジャー
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	226	248	2,217	271,383	専門サービス
BORGWARNER INC	404	450	1,782	218,209	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,350	2,680	11,979	1,466,183	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,742	4,177	30,792	3,768,736	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	194	218	3,397	415,797	情報技術サービス
BROADCOM INC	668	774	48,884	5,982,941	半導体・半導体製造装置
BROWN & BROWN INC	388	460	3,344	409,352	保険
BROWN-FORMAN CORP-CL B	527	585	3,937	481,927	飲料
BURLINGTON STORES INC	114	121	2,303	281,952	専門小売り
CBOE GLOBAL MARKETS INC	179	195	2,236	273,719	資本市場
CBRE GROUP INC	548	623	5,779	707,361	不動産管理・開発
CDW CORPORATION	239	250	4,470	547,144	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	353	412	4,161	509,339	化学
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	220	243	2,667	326,434	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	595	622	15,290	1,871,419	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CME GROUP INC	600	674	16,297	1,994,628	資本市場
CMS ENERGY CORP	482	543	3,800	465,137	総合公益事業
CSX CORP	1,279	4,190	15,838	1,938,437	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	2,184	2,484	25,721	3,148,093	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CABLE ONE INC	8	9	1,514	185,388	メディア
COTERRA ENERGY INC	640	1,450	3,929	480,931	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	469	517	8,443	1,033,354	ソフトウェア
CAESARS ENTERTAINMENT INC	—	397	3,077	376,709	ホテル・レストラン・レジャー
CAMPBELL SOUP CO	309	360	1,587	194,306	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	766	799	10,744	1,314,976	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	472	553	3,186	390,049	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	279	313	3,177	388,941	専門小売り
CARLYLE GROUP INC/THE	220	290	1,354	165,717	資本市場
CARNIVAL CORP	1,290	1,590	3,116	381,416	ホテル・レストラン・レジャー
CARRIER GLOBAL CORP	1,390	1,530	7,278	890,780	建設関連製品
CARVANA CO	102	138	1,738	212,777	専門小売り
CATALENT INC	280	323	3,579	438,132	医薬品
CATERPILLAR INC DEL	899	1,016	22,664	2,773,960	機械
CELANESE CORP-SERIES A	195	209	3,022	369,982	化学
CENTENE CORP	975	1,107	9,560	1,170,054	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	940	1,200	3,693	452,059	総合公益事業
CERIDIAN HCM HOLDING INC	216	268	1,855	227,045	ソフトウェア
CERNER CORP	520	545	5,103	624,669	ヘルスケア・テクノロジー
CHARLES RIVER LABORATORIES	—	96	2,782	340,569	ライフサイエンス・ツール/サービス
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	230	235	13,426	1,643,248	メディア
CHENIERE ENERGY INC	364	459	6,484	793,668	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	3,190	3,628	60,036	7,347,823	石油・ガス・消耗燃料
CHEWY INC - CLASS A	123	151	646	79,079	インターネット販売・通信販売
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	44	53	8,421	1,030,692	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	398	450	4,465	546,514	家庭用品
CINCINNATI FINANCIAL CORP	246	285	3,937	481,883	保険
CISCO SYSTEMS	7,002	7,937	44,486	5,444,749	通信機器
CINTAS CORP	143	177	7,646	935,864	商業サービス・用品
CITIGROUP	3,457	3,734	20,525	2,512,152	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	700	788	3,687	451,354	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	198	238	2,415	295,628	ソフトウェア
COLOROX CO	213	225	3,138	384,151	家庭用品
CLOUDFLARE INC - CLASS A	329	493	6,132	750,608	情報技術サービス
COCA COLA CO	6,765	7,722	48,038	5,879,439	飲料
COGNEX CORP	278	336	2,623	321,088	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	875	997	9,111	1,115,166	情報技術サービス
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	—	78	1,534	187,778	資本市場
COLGATE PALMOLIVE CO.	1,363	1,504	11,484	1,405,593	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	7,566	8,581	40,922	5,008,540	メディア
CONAGRA BRANDS INC	821	930	3,106	380,167	食品
CONOCOPHILLIPS	2,231	2,475	25,022	3,062,473	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	570	663	6,280	768,682	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	283	312	7,272	890,031	飲料
CONSTELLATION ENERGY	—	629	3,616	442,654	電力
THE COOPER COMPANIES, INC.	91	93	3,919	479,648	ヘルスケア機器・用品
COPART INC	358	408	5,199	636,323	商業サービス・用品
CORNING INC	1,290	1,550	5,824	712,909	電子装置・機器・部品
CORTEVA INC	1,217	1,387	8,095	990,859	化学
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	733	831	47,927	5,865,873	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	66	757	5,146	629,922	専門サービス
COUPA SOFTWARE INC	114	142	1,476	180,658	ソフトウェア
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	290	369	8,301	1,015,962	ソフトウェア
CROWN HOLDINGS INC	228	247	3,148	385,346	容器・包装

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	
CUMMINS INC	249	267	5,595	684,835	機械
DR HORTON INC	561	633	4,993	611,183	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	328	362	4,798	587,309	総合公益事業
DANAHER CORP	1,060	1,210	35,980	4,403,660	ライフサイエンス・ツール/サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	220	250	3,291	402,846	ホテル・レストラン・レジャー
DATADOG INC - CLASS A	293	413	6,180	756,487	ソフトウェア
DAVITA INC	125	125	1,432	175,369	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	494	552	22,938	2,807,425	機械
DELL TECHNOLOGIES-C	407	558	3,031	370,970	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC	252	300	1,179	144,407	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	352	422	2,091	255,918	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	1,000	1,204	7,291	892,397	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	161	181	9,394	1,149,763	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	-	321	4,466	546,681	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO	3,000	3,421	48,222	5,901,941	娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	500	556	6,298	770,925	消費者金融
DISCOVERY INC - A	245	310	796	97,508	メディア
DISCOVERY INC - C	491	580	1,492	182,647	メディア
DISH NETWORK CORP-A	384	434	1,383	169,337	メディア
DOCUSIGN INC	293	364	3,929	480,916	ソフトウェア
DOLLAR GENERAL CORP	418	443	10,076	1,233,314	複合小売り
DOLLAR TREE INC	382	422	6,765	828,030	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	1,340	1,534	13,104	1,603,916	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	63	69	2,803	343,091	ホテル・レストラン・レジャー
DOORDASH INC-A	-	196	2,317	283,615	インターネット販売・通信販売
DOVER CORP	243	268	4,303	526,710	機械
DOW INC	1,245	1,405	9,028	1,105,001	化学
DRAFTKINGS INC - CL A	277	584	1,191	145,882	ホテル・レストラン・レジャー
DROPBOX INC-CLASS A	510	570	1,350	165,266	ソフトウェア
DUKE ENERGY CORP	1,230	1,444	16,097	1,970,198	電力
DUPONT DE NEMOURS INC	877	969	7,416	907,733	化学
DYNATRACE INC	290	330	1,577	193,098	ソフトウェア
EOG RESOURCES INC	981	1,099	13,307	1,628,740	石油・ガス・消耗燃料
EASTMAN CHEMICAL CO.	230	250	2,857	349,729	化学
EBAY INC	1,128	1,168	6,933	848,560	インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC	430	486	8,767	1,073,046	化学
EDISON INTERNATIONAL	612	727	5,049	618,037	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,042	1,172	13,722	1,679,551	ヘルスケア機器・用品
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	740	810	2,199	269,253	医薬品
ELECTRONIC ARTS	485	532	6,792	831,343	娯楽
EMERSON ELEC	982	1,113	11,016	1,348,306	電気設備
ENPHASE ENERGY INC	195	246	4,837	592,072	半導体・半導体製造装置
ENTEGRIS INC	-	257	3,480	426,016	半導体・半導体製造装置
ENTERGY CORP	336	376	4,400	538,602	電力
EPAM SYSTEMS INC	95	103	3,020	369,719	情報技術サービス
EQUIFAX INC	197	233	5,581	683,064	専門サービス
EQUITABLE HOLDINGS INC	690	690	2,187	267,703	各種金融サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	44	44	790	96,771	保険
ESSENTIAL UTILITIES INC	396	440	2,287	279,974	水道
ETSY INC	209	244	3,283	401,838	インターネット販売・通信販売
EVERGY INC	359	429	2,928	358,401	電力
EVERSOURCE ENERGY	564	644	5,708	698,653	電力
EXACT SCIENCES CORP	258	323	2,303	281,942	バイオテクノロジー
EXELON CORPORATION	1,637	1,830	8,643	1,057,827	電力

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	
EXPEDIA GROUP INC	223	279	5,361	656,199	ホテル・レストラン・レジャー
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	271	327	3,437	420,746	航空貨物・物流サービス
EXXON MOBIL CORP	7,007	7,967	66,747	8,169,229	石油・ガス・消耗燃料
FMC CORP	212	232	3,080	376,993	化学
META PLATFORMS INC	3,984	4,453	101,461	12,417,885	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	64	69	3,035	371,491	資本市場
FAIR ISAAC CORP	46	51	2,442	298,880	ソフトウェア
FASTENAL CO	969	1,089	6,502	795,831	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	417	479	11,268	1,379,148	航空貨物・物流サービス
F5 INC	104	113	2,404	294,276	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	1,035	1,139	11,506	1,408,241	情報技術サービス
FNF GROUP	454	500	2,489	304,689	保険
FIFTH THIRD BANCORP	1,200	1,270	5,623	688,267	銀行
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	-	22	1,524	186,576	銀行
FIRST REPUBLIC BANK/CA	290	337	5,594	684,756	銀行
FISERV INC	952	1,126	11,500	1,407,602	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	866	1,040	4,763	582,968	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	135	142	3,553	434,866	情報技術サービス
FORD MOTOR COMPANY	6,560	7,430	12,831	1,570,460	自動車
FORTINET INC	224	259	8,855	1,083,884	ソフトウェア
FORTIVE CORP	518	648	4,026	492,745	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	234	256	1,989	243,479	建設関連製品
FOX CORP-CLASS A	580	620	2,488	304,589	メディア
FOX CORP-CLASS B	254	300	1,104	135,228	メディア
FRANKLIN RESOURCES INC	510	570	1,618	198,055	資本市場
FREEMPORT-MCMORAN INC	2,390	2,760	14,015	1,715,330	金属・鉱業
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	-	82	306	37,534	資本市場
ARTHUR J GALLAGHER & CO	319	395	6,865	840,219	保険
GARTNER INC	141	153	4,613	564,672	情報技術サービス
GENERAC HOLDINGS INC	102	116	3,608	441,619	電気設備
GENERAL DYNAMICS	410	446	10,896	1,333,643	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	14,530	-	-	-	コングロマリット
GENERAL ELECTRIC CO	-	2,058	19,464	2,382,267	コングロマリット
GENERAL MILLS	1,028	1,133	7,697	942,109	食品
GENERAL MOTORS CO	2,153	2,460	11,124	1,361,481	自動車
GENUINE PARTS CO	232	266	3,426	419,415	販売
GILEAD SCIENCES INC	2,082	2,354	14,043	1,718,840	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	492	549	7,549	924,025	情報技術サービス
GLOBE LIFE INC	157	177	1,807	221,179	保険
GODADDY INC - CLASS A	269	323	2,738	335,191	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	543	635	21,309	2,608,126	資本市場
GRAINGER(W.W.) INC	74	83	4,321	528,885	商社・流通業
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	136	158	1,507	184,519	ソフトウェア
HCA HEALTHCARE INC	454	467	11,906	1,457,252	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HP INC	2,250	2,170	8,428	1,031,537	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	1,500	1,670	6,432	787,315	エネルギー設備・サービス
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	589	653	4,800	587,576	保険
HASBRO INC	214	255	2,154	263,719	レジャー用品
HEICO CORP	63	79	1,224	149,827	航空宇宙・防衛
HEICO CORP-CLASS A	123	139	1,766	216,225	航空宇宙・防衛
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	127	139	2,741	335,582	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	251	275	5,957	729,184	食品
HESS CORP	473	524	5,688	696,220	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	2,200	2,460	4,250	520,265	コンピュータ・周辺機器

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	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			
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	468	530	8,116	993,433	ホテル・レストラン・レジャー		
HOLOGIC INC	434	461	3,534	432,585	ヘルスケア機器・用品		
HOME DEPOT	1,784	1,965	60,612	7,418,350	専門小売り		
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,165	1,295	25,451	3,115,061	コングロマリット		
HORMEL FOODS CORP	500	550	2,832	346,669	食品		
HOWMET AEROSPACE INC	660	720	2,623	321,112	航空宇宙・防衛		
HUBSPOT INC	70	84	4,246	519,712	ソフトウェア		
HUMANA INC	217	244	10,721	1,312,157	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	157	3,238	396,333	陸運・鉄道		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,720	2,710	4,035	493,866	銀行		
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	65	75	1,524	186,632	航空宇宙・防衛		
IAC/INTERACTIVE CORP	136	—	—	—	インタラクティブ/メディアおよびサービス		
IAC/INTERACTIVECORP	—	150	1,535	187,917	インタラクティブ/メディアおよびサービス		
IPG PHOTONICS CORP	59	69	782	95,714	電子装置・機器・部品		
IDEX CORP	123	142	2,774	339,540	機械		
IDEXX LABORATORIES INC	142	158	8,713	1,066,388	ヘルスケア機器・用品		
ILLINOIS TOOL WORKS INC	529	594	12,750	1,560,570	機械		
ILLUMINA INC	244	280	9,857	1,206,412	ライフサイエンス・ツール/サービス		
INCYTE CORP	312	365	2,907	355,904	バイオテクノロジー		
INGERSOLL-RAND INC	580	764	3,881	475,010	機械		
INSULET CORP	106	133	3,506	429,166	ヘルスケア機器・用品		
INTEL CORP	6,791	7,655	39,369	4,818,453	半導体・半導体製造装置		
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	930	1,066	14,321	1,752,834	資本市場		
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	1,485	1,688	22,303	2,729,730	情報技術サービス		
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	371	481	6,311	772,427	化学		
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	601	675	3,131	383,242	容器・包装		
INTERPUBLIC GROUP	670	730	2,664	326,108	メディア		
INTUIT INC	433	506	23,885	2,923,332	ソフトウェア		
INTUITIVE SURGICAL INC	194	672	20,458	2,503,899	ヘルスケア機器・用品		
IONIS PHARMACEUTICALS INC	214	—	—	—	バイオテクノロジー		
IQVIA HOLDINGS INC	322	357	8,258	1,010,711	ライフサイエンス・ツール/サービス		
JPMORGAN CHASE & CO	5,051	5,561	78,154	9,565,304	銀行		
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	213	245	3,418	418,418	専門サービス		
JOHNSON & JOHNSON	4,362	4,954	88,968	10,888,901	医薬品		
JUNIPER NETWORKS INC	530	600	2,254	275,964	通信機器		
KLA CORP	255	284	10,616	1,299,351	半導体・半導体製造装置		
KKR & CO INC-A	855	974	5,776	707,021	資本市場		
KANSAS CITY SOUTHERN	151	—	—	—	陸運・鉄道		
KELLOGG CO	433	494	3,165	387,371	食品		
KEURIG DR PEPPER INC	920	1,310	4,997	611,662	飲料		
KEYCORP	1,580	1,780	4,095	501,282	銀行		
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	304	349	5,612	686,885	電子装置・機器・部品		
KIMBERLY-CLARK CORP	572	640	7,926	970,112	家庭用品		
KINDER MORGAN INC	3,440	3,850	7,349	899,523	石油・ガス・消耗燃料		
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	208	301	1,577	193,038	陸運・鉄道		
KRAFT HEINZ CO/THE	1,090	1,250	4,925	602,770	食品		
KROGER CO	1,260	1,330	7,497	917,583	食品・生活必需品小売り		
LKQ CORP	490	526	2,460	301,091	販売		
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	344	366	9,216	1,127,976	航空宇宙・防衛		
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	158	183	4,922	602,489	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス		
LAM RESEARCH	237	263	14,471	1,771,107	半導体・半導体製造装置		
LAMB WESTON HOLDINGS INC	239	—	—	—	食品		
LAS VEGAS SANDS CORP	586	640	2,537	310,576	ホテル・レストラン・レジャー		
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	378	433	12,087	1,479,404	パーソナル用品		

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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LEAR CORP	97	109	1,587	194,277	自動車部品
LEIDOS HOLDINGS INC	215	258	2,797	342,353	専門サービス
LENNAR CORP-A	465	506	4,257	521,135	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	57	64	1,708	209,108	建設関連製品
LIBERTY BROADBAND CORP-A	40	40	545	66,810	メディア
LIBERTY BROADBAND CORP-C	259	264	3,723	455,778	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	129	170	786	96,229	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	299	299	1,383	169,323	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	340	371	2,587	316,711	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,427	1,530	44,353	5,428,384	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	299	332	2,223	272,163	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	266	309	3,638	445,350	娯楽
LOCKHEED MARTIN	420	469	20,915	2,559,793	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	431	418	2,739	335,245	保険
LOWES COS INC	1,214	1,268	26,563	3,251,086	専門小売り
LUCID GROUP INC	-	800	2,120	259,466	自動車
LULULEMON ATHLETICA INC	208	220	8,292	1,014,887	繊維・アパレル・贅沢品
LUMEN TECHNOLOGIES INC	1,470	1,620	1,843	225,633	各種電気通信サービス
LYFT INC-A	-	520	2,009	245,979	陸運・鉄道
M & T BANK CORP	217	245	4,220	516,531	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	800	710	3,064	375,047	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	137	153	7,853	961,154	資本市場
MARATHON PETROLEUM CORP	1,060	1,149	9,806	1,200,243	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	23	25	3,732	456,787	保険
MARKETAXESS HOLDINGS INC	61	72	2,497	305,699	資本市場
MARSH & MCLENNAN COS	848	947	16,273	1,991,682	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	464	526	9,281	1,135,934	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	105	116	4,527	554,061	建設資材
MARVELL TECHNOLOGY INC	-	1,562	11,404	1,395,755	半導体・半導体製造装置
MASCO CORP	425	458	2,443	299,051	建設関連製品
MASIMO CORP	82	93	1,445	176,880	ヘルスケア機器・用品
MASTERCARD INC	1,474	1,651	59,805	7,319,634	情報技術サービス
MATCH GROUP INC	416	509	5,635	689,746	インタラクティブ・メディアおよびサービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	452	-	-	-	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	402	477	4,639	567,804	食品
MCDONALD'S CORP	1,236	1,406	35,013	4,285,316	ホテル・レストラン・レジャー
MCESSON CORP	262	287	8,811	1,078,436	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	275	33,664	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	74	85	10,344	1,266,028	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	4,193	4,753	39,164	4,793,370	医薬品
METLIFE INC	1,254	1,334	9,555	1,169,490	保険
METTLER-TOLEDO INTL	38	43	6,157	753,572	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	11,902	13,422	421,262	51,558,365	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	427	1,056	8,066	987,293	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,845	2,115	16,742	2,049,094	半導体・半導体製造装置
MODERNA INC	463	648	11,334	1,387,268	バイオテクノロジー
MOHAWK INDUSTRIES	102	102	1,335	163,450	家庭用耐久財
MOLINA HEALTHCARE INC	97	111	3,789	463,774	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	314	350	1,900	232,602	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	2,386	2,637	16,547	2,025,208	食品
MONGODB INC	88	113	4,861	594,997	情報技術サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	69	84	4,102	502,112	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	666	750	6,004	734,890	飲料
MOODYS CORP	283	317	10,724	1,312,601	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	千円ドル	千円	
MORGAN STANLEY	2,331	2,533	22,865	2,798,495	資本市場
MOSAIC CO/THE	560	690	4,520	553,310	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	276	316	7,608	931,222	通信機器
NRG ENERGY INC	405	450	1,710	209,397	電力
NVR INC	5	6	2,835	347,090	家庭用耐久財
NASDAQ INC	184	225	4,092	500,856	資本市場
NETAPP INC	352	431	3,731	456,657	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	732	833	31,784	3,890,053	娯楽
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	142	170	1,571	192,354	バイオテクノロジー
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,840	2,200	1,108	135,706	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	354	414	2,358	288,714	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	403	—	—	—	コングロマリット
NEWELL BRANDS INC	660	750	1,667	204,054	家庭用耐久財
NEWMONT CORP	1,317	1,511	12,081	1,478,710	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	670	750	1,707	209,011	メディア
NEXTERA ENERGY INC	3,252	3,692	31,566	3,863,436	電力
NIKE INC-B	2,083	2,405	33,318	4,077,896	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	650	730	2,307	282,418	総合公益事業
NORDSON CORP	87	96	2,207	270,131	機械
NORFOLK SOUTHERN CORP	418	459	13,271	1,624,358	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	321	363	4,383	536,462	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	260	283	12,829	1,570,170	航空宇宙・防衛
NORTONLIFELOCK INC	910	1,100	2,990	366,056	ソフトウェア
NOVAVAX INC	—	130	971	118,932	バイオテクノロジー
NUCOR CORP	509	539	8,056	986,026	金属・鉱業
NVIDIA CORP	1,025	4,704	130,264	15,943,113	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	325	—	—	—	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	118	127	8,887	1,087,768	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	1,580	1,772	10,185	1,246,597	石油・ガス・消耗燃料
OKTA INC	203	280	4,272	522,947	情報技術サービス
OLD DOMINION FREIGHT LINE	153	181	5,634	689,654	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	345	400	3,453	422,686	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	680	817	5,263	644,252	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC	740	851	6,102	746,887	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,230	3,087	25,733	3,149,490	ソフトウェア
OTIS WORLDWIDE CORP	696	753	5,854	716,541	機械
OWENS CORNING INC	168	189	1,785	218,571	建設関連製品
PG&E CORP	2,370	2,770	3,348	409,875	電力
PNC FINANCIAL	698	800	15,258	1,867,475	銀行
PPG INDUSTRIES	398	440	5,849	715,903	化学
PPL CORPORATION	1,290	1,420	4,075	498,788	電力
PPD INC	200	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
PTC INC	187	203	2,216	271,284	ソフトウェア
PACCAR	583	657	5,873	718,867	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	161	177	2,776	339,827	容器・包装
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	—	3,090	4,288	524,920	ソフトウェア
PALO ALTO NETWORKS INC	156	185	11,422	1,397,958	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP	216	239	6,970	853,111	機械
PAYCHEX INC	548	605	8,281	1,013,615	情報技術サービス
PAYCOM SOFTWARE INC	81	96	3,333	408,011	ソフトウェア
PAYPAL HOLDINGS INC	1,845	2,100	24,882	3,045,418	情報技術サービス
PELOTON INTERACTIVE INC-A	402	520	1,478	181,000	レジャー用品
PEPSICO INC	2,290	2,602	43,703	5,348,833	飲料
PERKINELMER INC	188	212	3,783	463,122	ライフサイエンス・ツール/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	
(アメリカ)	百株	百株	千円ドル	千円	
PFIZER INC	9,210	10,563	55,392	6,779,472	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,586	2,930	27,524	3,368,713	タバコ
PHILLIPS 66	711	907	7,930	970,651	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	191	—	—	—	電力
PINTEREST INC- CLASS A	847	1,030	2,646	323,852	インタラクティブ・メディアおよびサービス
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	335	436	11,245	1,376,367	石油・ガス・消耗燃料
PLUG POWER INC	776	940	2,668	326,617	電気設備
POOL CORP	65	73	3,307	404,851	販売
T ROWE PRICE GROUP INC	382	421	6,445	788,865	資本市場
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	444	507	3,780	462,657	保険
PROCTER & GAMBLE CO	4,109	4,554	70,309	8,605,143	家庭用品
PROGRESSIVE CO	961	1,099	12,876	1,576,013	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	666	706	8,493	1,039,480	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	858	956	6,686	818,331	総合公益事業
PULTEGROUP INC	430	470	2,083	255,058	家庭用耐久財
QORVO INC	194	207	2,637	322,840	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,868	2,108	32,195	3,940,405	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	219	237	3,293	403,073	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
RPM INTERNATIONAL INC	211	235	1,938	237,254	化学
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	196	342	3,830	468,760	資本市場
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	2,506	2,817	28,403	3,476,342	航空宇宙・防衛
REGENERON PHARMACEUTICALS	175	200	13,861	1,696,502	バイオテックノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,620	1,800	4,077	498,984	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	105	—	—	—	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	361	418	5,630	689,060	商業サービス・用品
RESMED INC	245	275	6,847	838,099	ヘルスケア機器・用品
RINGCENTRAL INC-CLASS A	125	145	1,764	215,922	ソフトウェア
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	—	346	1,799	220,246	自動車
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	203	203	2,404	294,266	専門サービス
ROBINHOOD MARKETS INC -A	—	320	465	57,023	資本市場
ROCKWELL AUTOMATION INC	196	219	6,147	752,425	電気設備
ROKU INC	175	220	2,858	349,900	娯楽
ROLLINS INC	358	410	1,453	177,837	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	175	200	9,566	1,170,831	コングロマリット
ROSS STORES INC	598	663	6,140	751,479	専門小売り
S&P GLOBAL INC	396	666	27,941	3,419,805	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	191	225	1,379	168,778	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	370	427	3,243	397,023	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	87	108	6,175	755,766	銀行
SALESFORCE.COM INC	1,508	1,842	39,600	4,846,710	ソフトウェア
SAREPTA THERAPEUTICS INC	126	—	—	—	バイオテックノロジー
HENRY SCHEIN INC	231	257	2,257	276,325	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	2,340	2,640	11,143	1,363,845	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,539	2,727	24,204	2,962,431	資本市場
SEA LTD-ADR	—	603	7,443	911,001	娯楽
SEAGEN INC	207	258	3,652	446,998	バイオテックノロジー
SEALED AIR CORP	265	265	1,809	221,454	容器・包装
SEMPRA ENERGY	473	606	10,157	1,243,209	総合公益事業
SERVICENOW INC	323	374	21,495	2,630,886	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	134	472	11,942	1,461,590	化学
SIGNATURE BANK	—	115	3,524	431,351	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,750	1,750	1,162	142,217	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	271	317	4,323	529,199	半導体・半導体製造装置
SLACK TECHNOLOGIES INC-CL A	761	—	—	—	ソフトウェア

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	
SMITH (A. O.) CORP	218	247	1,636	200,275	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	186	201	2,711	331,810	食品
SNAP-ON INC	84	97	2,027	248,121	機械
SNAP INC-A	1,522	2,040	7,515	919,804	インタラクティブ・メディアおよびサービス
SNOWFLAKE INC-CLASS A	39	392	9,079	1,111,288	情報技術サービス
SOFI TECHNOLOGIES INC	-	920	898	110,009	消費者金融
SOLAREGE TECHNOLOGIES INC	82	100	3,142	384,586	半導体・半導体製造装置
SOUTHERN CO.	1,767	2,006	14,543	1,779,978	電力
SOUTHWEST AIRLINES	249	290	1,321	161,742	旅客航空輸送業
SPLUNK INC	270	304	4,319	528,668	ソフトウェア
BLOCK INC	636	955	13,379	1,637,523	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	259	309	4,421	541,107	機械
STARBUCKS CORP	1,949	2,217	20,181	2,469,995	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	596	698	6,429	786,879	資本市場
STEEL DYNAMICS	334	371	3,103	379,781	金属・鉱業
STRYKER CORP	565	637	17,144	2,098,280	ヘルスケア機器・用品
SUNRUN INC	185	360	1,114	136,410	電気設備
SYNOPSIS INC	255	285	9,478	1,160,112	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	860	1,038	3,708	453,916	消費者金融
SYSCO CORP	813	956	7,933	971,023	食品・生活必需品小売り
TJX COS INC	2,003	2,276	14,111	1,727,069	専門小売り
T-MOBILE US INC	931	1,172	15,073	1,844,795	無線通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	194	219	3,417	418,294	娯楽
TARGET CORP	836	898	19,932	2,439,478	複合小売り
TELADOC HEALTH INC	193	276	2,016	246,827	ヘルスケア・テクノロジー
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	58	86	4,068	497,984	電子装置・機器・部品
TELEFLEX INC	75	87	3,030	370,878	ヘルスケア機器・用品
10X GENOMICS INC-CLASS A	100	144	1,076	131,722	ライフサイエンス・ツール/サービス
TERADYNE INC	272	302	3,655	447,348	半導体・半導体製造装置
TESLA INC	1,256	1,606	175,738	21,508,641	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	1,730	2,150	2,016	246,823	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,521	1,738	32,578	3,987,320	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	379	407	3,060	374,591	航空宇宙・防衛
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	68	823	5,895	721,507	ソフトウェア
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	655	741	44,130	5,401,116	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	956	1,081	16,369	2,003,473	コングロマリット
TRACTOR SUPPLY COMPANY	195	215	5,006	612,717	専門小売り
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	164	187	1,645	201,336	資本市場
TRANSIGM GROUP INC	86	100	6,723	822,840	航空宇宙・防衛
TRUNSONION	311	352	3,654	447,226	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	426	466	8,646	1,058,261	保険
TRIMBLE INC	422	473	3,448	422,079	電子装置・機器・部品
TRUIST FINANCIAL CORP	2,253	2,504	14,708	1,800,172	銀行
TWILIO INC - A	233	322	5,429	664,563	情報技術サービス
TWITTER INC	1,328	1,490	5,811	711,208	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TYLER TECHNOLOGIES INC	65	75	3,334	408,102	ソフトウェア
TYSON FOODS INC-CL A	501	549	4,870	596,061	食品
UGI CORP	360	400	1,460	178,738	ガス
US BANCORP	2,231	2,643	14,584	1,784,944	銀行
UBER TECHNOLOGIES INC	1,615	2,740	10,022	1,226,705	陸運・鉄道
ULTA BEAUTY INC	86	99	3,977	486,784	専門小売り
UNION PAC CORP	1,113	1,213	33,562	4,107,714	陸運・鉄道
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,174	1,372	30,211	3,697,578	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	122	135	4,849	593,477	商社・流通業

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	
(アメリカ)	百株	百株	千円ドル	千円	
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,572	1,772	92,310	11,297,837	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITY SOFTWARE INC	—	112	1,133	138,735	ソフトウェア
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	130	144	2,096	256,554	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UPSTART HOLDINGS INC	—	82	935	114,550	消費者金融
V F CORP	563	617	3,603	441,080	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	67	74	1,956	239,427	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	665	759	7,627	933,584	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	153	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	227	265	5,671	694,106	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	176	185	4,109	502,927	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	6,857	7,791	40,209	4,921,222	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	260	285	6,183	756,816	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	436	482	12,364	1,513,262	バイオテクノロジー
PARAMOUNT GLOBAL	951	1,140	4,343	531,588	メディア
VIA TRIS INC	2,007	2,290	2,516	308,020	医薬品
VISA INC-CLASS A SHARES	2,804	3,142	70,365	8,611,983	情報技術サービス
VISTRA CORP	700	800	1,848	226,176	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A	142	398	4,624	565,975	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	217	—	—	—	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	223	247	4,621	565,669	建設資材
WEC ENERGY GROUP INC	536	602	6,037	738,924	総合公益事業
WABTEC CORP	288	341	3,379	413,593	機械
WALMART INC	2,348	2,886	43,252	5,293,671	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,203	1,390	6,596	807,399	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	445	496	6,928	847,994	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	693	792	12,628	1,545,594	商業サービス・用品
WATERS CORP	105	112	3,602	440,921	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A	115	146	1,773	217,054	インターネット販売・通信販売
WEBSTER FINANCIAL CORP	—	330	1,903	233,002	銀行
WELLS FARGO CO	6,500	7,503	37,597	4,601,562	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	124	140	5,852	716,243	ライフサイエンス・ツール/サービス
WESTERN DIGITAL CORP	516	586	2,966	363,049	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	660	750	1,443	176,608	情報技術サービス
WESTROCK CO	432	520	2,461	301,285	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	103	113	2,037	249,383	家庭用耐久財
WILLIAMS COS	1,980	2,310	7,773	951,355	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	291	364	8,792	1,076,148	ソフトウェア
WYNN RESORTS LTD	171	193	1,566	191,733	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC	143	—	—	—	陸運・鉄道
XCEL ENERGY INC	885	1,025	7,412	907,252	電力
XILINX INC	412	—	—	—	半導体・半導体製造装置
XYLEM INC	303	338	2,977	364,450	機械
YUM BRANDS INC	508	558	6,742	825,260	ホテル・レストラン・レジャー
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	89	103	4,424	541,573	電子装置・機器・部品
ZENDESK INC	188	226	2,704	331,064	ソフトウェア
ZILLOW GROUP INC - A	98	98	501	61,386	不動産管理・開発
ZILLOW GROUP INC - C	246	332	1,743	213,407	不動産管理・開発
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	349	400	5,147	630,014	ヘルスケア機器・用品
ZOETIS INC	794	894	17,104	2,093,359	医薬品
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC-A	—	541	3,142	384,631	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZSCALER INC	119	154	3,694	452,164	ソフトウェア
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	323	406	4,969	608,160	ソフトウェア
ALLEGION PLC	148	163	1,847	226,128	建設関連製品
AMCOR PLC	2,680	2,860	3,297	403,590	容器・包装

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		
AON PLC	375	414	13,512	1,653,800	保険	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	650	750	3,633	444,642	保険	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	212	—	—	—	保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	360	—	—	—	化学	
ACCENTURE PLC-CL A	1,050	1,189	40,242	4,925,327	情報技術サービス	
BUNGE LIMITED	220	268	2,940	359,854	食品	
CLARIVATE PLC	—	650	1,088	133,172	専門サービス	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	326	393	1,920	235,013	飲料	
EATON CORP PLC	654	749	11,643	1,425,103	電気設備	
EVEREST RE GROUP LTD	62	71	2,163	264,792	保険	
GRAB HOLDINGS LTD-CL A	—	2,030	720	88,200	インターネット販売・通信販売	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	359	411	4,348	532,248	バイオテクノロジー	
IHS MARKIT LTD	638	—	—	—	専門サービス	
INVESCO LTD	680	650	1,522	186,314	資本市場	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	90	120	1,889	231,214	医薬品	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	1,185	1,316	8,817	1,079,137	建設関連製品	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	310	803	98,304	各種電気通信サービス	
LIBERTY GLOBAL PLC-C	640	640	1,685	206,320	各種電気通信サービス	
LNDE PLC	872	965	31,422	3,845,778	化学	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	1,128	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	2,230	2,531	28,235	3,455,783	ヘルスケア機器・用品	
APTIV PLC	454	502	6,132	750,548	自動車部品	
NOVOCURE LTD	140	164	1,378	168,744	ヘルスケア機器・用品	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	78	—	—	—	保険	
ROYALTY PHARMA PLC-CL A	289	630	2,457	300,712	医薬品	
SEAGATE TECHNOLOGY	373	—	—	—	コンピュータ・周辺機器	
SEAGATE TECHNOLOGY	—	384	3,508	429,418	コンピュータ・周辺機器	
PENTAIR PLC	275	300	1,692	207,157	機械	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	245	283	1,471	180,143	電気設備	
STERIS PLC	138	191	4,696	574,804	ヘルスケア機器・用品	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	403	452	7,168	877,324	建設関連製品	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	218	238	5,712	699,120	保険	
CHUBB LTD	743	808	17,574	2,150,881	保険	
GARMIN LTD	242	288	3,464	424,002	家庭用耐久財	
TE CONNECTIVITY LTD	554	614	8,202	1,003,894	電子装置・機器・部品	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	187	201	2,779	340,124	ソフトウェア	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	71	71	1,199	146,803	ソフトウェア	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	—	52	407	49,851	インターネット販売・通信販売	
INMODE LTD	—	88	338	41,411	ヘルスケア機器・用品	
KORNIT DIGITAL LTD	—	82	694	84,944	機械	
WIX.COM LTD	94	102	1,062	129,993	情報技術サービス	
AERCAP HOLDINGS NV	—	251	1,291	158,023	商社・流通業	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	452	494	5,187	634,957	化学	
NXP SEMICONDUCTORS NV	468	500	9,366	1,146,365	半導体・半導体製造装置	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	386	437	3,560	435,791	ホテル・レストラン・レジャー	
小 計	株 数	金 額	519,005	596,398	7,570,222	926,519,476
	銘柄 数 < 比 率 >		593	606	—	< 70.4% >
(カナダ)					千カナダドル	
AGNICO EAGLE MINES LTD	410	868	6,685	654,494	金属・鉱業	
AIR CANADA	320	320	778	76,221	旅客航空輸送業	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	970	1,260	2,436	238,566	総合公益事業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	1,450	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	—	1,610	8,903	871,633	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD	420	520	1,464	143,356	ガス	

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	
	百株	百株	千カナダドル	千円	
(カナダ)					
ATCO LTD CL1	130	—	—	—	総合公益事業
BCE INC	256	144	985	96,512	各種電気通信サービス
BALLARD POWER SYSTEMS INC	370	370	547	53,610	電気設備
BANK OF MONTREAL	1,056	1,214	17,979	1,760,177	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,994	2,297	20,996	2,055,594	銀行
BARRICK GOLD	2,990	3,360	10,419	1,020,055	金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC	510	580	1,677	164,213	医薬品
BLACKBERRY LTD	940	940	892	87,332	ソフトウェア
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,108	2,671	19,199	1,879,596	資本市場
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	187	240	1,298	127,113	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
B2GOLD CORP	1,750	—	—	—	金属・鉱業
CAE INC	500	600	1,957	191,609	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	247	282	1,615	158,192	容器・包装
CGI INC	372	421	4,255	416,651	情報技術サービス
CAMECO CORP	720	720	2,521	246,848	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	750	846	13,124	1,284,922	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,186	1,326	22,608	2,213,352	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,990	2,205	17,240	1,687,883	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	221	1,759	18,330	1,794,559	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	102	102	1,977	193,594	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	203	270	1,031	101,000	総合公益事業
CANOPY GROWTH CORP	350	350	347	34,025	医薬品
CENOVUS ENERGY INC	2,160	2,520	5,244	513,399	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	34	38	8,141	797,098	ソフトウェア
DOLLARAMA INC	466	556	3,958	387,504	複合小売り
EMERA INC	425	470	2,885	282,473	電力
EMPIRE CO LTD A	260	320	1,408	137,843	食品・生活必需品小売り
ENBRIDGE INC	3,330	3,800	21,960	2,149,903	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	41	46	3,120	305,487	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	930	1,110	4,830	472,927	金属・鉱業
FIRSTSERVICE CORP	60	72	1,303	127,618	不動産管理・開発
FORTIS INC	753	890	5,479	536,465	電力
FRANCO-NEVADA CORP	323	365	7,359	720,458	金属・鉱業
GFL ENVIRONMENTAL INC - SUB VT	300	300	1,191	116,628	商業サービス・用品
GILDAN ACTIVEWEAR INC	318	370	1,794	175,645	繊維・アパレル・贅沢品
GREAT-WEST LIFE CO INC	420	500	1,841	180,282	保険
HYDRO ONE LTD	550	630	2,109	206,494	電力
IGM FINANCIAL INC	150	150	675	66,082	資本市場
IA FINANCIAL CORP INC	183	211	1,617	158,355	保険
IMPERIAL OIL	375	460	2,763	270,519	石油・ガス・消耗燃料
INTACT FINANCIAL CORP	245	329	6,093	596,544	保険
INTER PIPELINE LTD	750	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
IVANHOE MINES LTD-CL A	—	1,220	1,444	141,414	金属・鉱業
KEYERA CORP	340	410	1,309	128,203	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	2,170	2,500	1,850	181,115	金属・鉱業
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	427	—	—	—	金属・鉱業
LIGHTSPEED COMMERCE INC	—	194	754	73,843	ソフトウェア
LOBLAW COMPANIES	285	314	3,490	341,712	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	1,180	1,180	1,504	147,290	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC	482	528	4,275	418,543	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	3,260	3,700	9,956	974,760	保険
METRO INC	435	467	3,343	327,350	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	550	634	6,161	603,182	銀行
NORTHLAND POWER INC	300	400	1,654	161,926	独立系発電事業者・エネルギー販売業者

銘柄	株数	当期		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		
NUTRIEN LTD	961	1,082	13,785	1,349,626	化学	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	-	140	1,327	129,973	情報技術サービス	
ONEX CORPORATION	132	132	1,116	109,313	資本市場	
OPEN TEXT CORP	470	510	2,729	267,220	ソフトウェア	
PAN AMERICAN SILVER CORP	353	430	1,476	144,561	金属・鉱業	
PARKLAND CORP	217	280	1,025	100,355	石油・ガス・消耗燃料	
PEMBINA PIPELINE CORP	880	1,020	4,817	471,629	石油・ガス・消耗燃料	
POWER CORPORATION OF CANADA	970	1,030	4,020	393,566	保険	
QUEBECOR INC-CL B	270	340	1,017	99,658	メディア	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	494	524	3,808	372,896	ホテル・レストラン・レジャー	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	183	211	1,563	153,108	商業サービス・用品	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	582	670	4,694	459,610	無線通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	2,348	2,682	37,515	3,672,798	銀行	
SSR MINING INC	340	-	-	-	金属・鉱業	
SAPUTO INC	410	500	1,487	145,577	食品	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	770	840	3,267	319,898	メディア	
SHOPIFY INC - CLASS A	182	213	18,753	1,835,946	情報技術サービス	
SUN LIFE FINANCIAL INC	988	1,108	7,796	763,325	保険	
SUNCOR ENERGY INC	2,490	2,720	11,225	1,098,970	石油・ガス・消耗燃料	
TFI INTERNATIONAL INC	-	149	2,003	196,123	陸運・鉄道	
TMX GROUP LTD	95	113	1,459	142,874	資本市場	
TC ENERGY CORP	1,580	1,860	13,272	1,299,422	石油・ガス・消耗燃料	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	790	870	4,437	434,467	金属・鉱業	
TELUS CORP	586	786	2,535	248,238	各種電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	278	326	4,435	434,240	専門サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	128	150	1,792	175,441	商社・流通業	
TORONTO DOMINION BANK	3,007	3,430	34,787	3,405,653	銀行	
TOURMALINE OIL CORP	-	610	3,438	336,636	石油・ガス・消耗燃料	
WSP GLOBAL INC	198	228	3,786	370,732	建設・土木	
WEST FRASER TIMBER	140	178	1,924	188,429	紙製品・林産品	
WESTON(GEORGE)LTD	123	141	2,168	212,276	食品・生活必需品小売り	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	761	850	5,124	501,703	金属・鉱業	
YAMANA GOLD INC	1,640	-	-	-	金属・鉱業	
小計	株数・金額	66,371	74,082	501,394	49,086,475	
	銘柄数<比率>	87	86	-	<3.7%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	620	700	1,194	192,191	金属・鉱業	
ASHTED GROUP PLC	735	832	4,031	648,554	商社・流通業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,590	1,810	946	152,303	家庭用耐久財	
AVIVA PLC	6,700	7,120	3,233	520,188	保険	
DIAGEO PLC	3,901	4,390	17,121	2,754,597	飲料	
SCHRODERS PLC	197	240	782	125,957	資本市場	
DCC PLC	160	184	1,093	175,964	コングロマリット	
BAE SYSTEMS PLC	5,470	5,990	4,376	704,101	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	3,830	4,120	13,357	2,149,014	タバコ	
HALMA PLC	650	700	1,742	280,318	電子装置・機器・部品	
STANDARD CHARTERED PLC	4,430	4,790	2,442	393,038	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	1,610	1,800	2,943	473,644	タバコ	
HSBC HOLDINGS PLC	33,620	38,290	20,163	3,244,107	銀行	
LEGAL & GENERAL	10,100	11,400	3,113	500,905	保険	
MORRISON SUPERMARKETS	3,700	-	-	-	食品・生活必需品小売り	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	620	680	1,176	189,325	食品	
PEARSON	1,260	1,480	1,094	176,016	メディア	
PERSIMMON PLC	526	580	1,245	200,349	家庭用耐久財	

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	
PRUDENTIAL PLC	4,280	5,180	5,819	936,336	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,850	2,107	12,802	2,059,735	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	950	1,040	1,515	243,793	資本市場
SSE PLC	1,770	2,040	3,571	574,541	電力
BP PLC	33,390	37,300	14,276	2,296,958	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	115,900	133,700	6,433	1,035,108	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC	6,200	7,100	957	154,098	家庭用耐久財
SMITH & NEPHEW PLC	1,500	1,700	2,105	338,745	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	8,270	9,430	15,661	2,519,753	医薬品
ASTRAZENECA PLC	2,179	2,914	29,614	4,764,655	医薬品
BT GROUP PLC	15,300	17,000	3,184	512,289	各種電気通信サービス
BARCLAYS PLC	29,200	31,900	4,830	777,249	銀行
INTERTEK GROUP PLC	256	310	1,635	263,145	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	660	730	1,250	201,250	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	219	260	1,631	262,450	複合小売り
KINGFISHER PLC	3,490	3,900	1,033	166,279	専門小売り
SAINSBURY	2,990	3,400	888	142,937	食品・生活必需品小売り
ADMIRAL GROUP PLC	308	350	900	144,889	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	195	—	—	—	家庭用耐久財
SHELL PLC	6,760	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SHELL PLC	6,100	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	550	660	1,951	313,996	商社・流通業
RENTOKIL INTIAL PLC	3,180	3,450	1,807	290,856	商業サービス・用品
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	296	296	612	98,485	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	532	627	4,960	798,146	資本市場
UNILEVER PLC	4,342	4,836	17,158	2,760,571	パーソナル用品
EXPERIAN PLC	1,529	1,720	5,122	824,104	専門サービス
MONDI PLC	840	910	1,395	224,446	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	370	480	1,459	234,770	水道
WHITBREAD PLC	316	363	1,045	168,142	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	520	650	672	108,134	資本市場
SMITHS GROUP PLC	610	710	1,050	169,063	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	2,060	2,423	9,633	1,549,989	金属・鉱業
3I GROUP PLC	1,670	1,780	2,458	395,496	資本市場
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,190	1,355	7,860	1,264,652	家庭用品
RELX PLC	3,240	3,640	8,645	1,390,894	専門サービス
FRESNILLO PLC	300	—	—	—	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	1,060	1,220	1,360	218,956	水道
OCADO GROUP PLC	830	920	1,072	172,515	食品・生活必需品小売り
GLENCORE PLC	16,800	18,610	9,318	1,499,177	金属・鉱業
ENTAIN PLC	1,020	1,100	1,832	294,847	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	13,800	15,200	1,566	252,036	航空宇宙・防衛
EVRAZ PLC	760	—	—	—	金属・鉱業
NMC HEALTH PLC	133	133	0.0532	8	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
NATWEST GROUP PLC	7,700	10,700	2,346	377,529	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,750	1,970	1,378	221,740	ソフトウェア
WPP PLC	2,000	2,180	2,295	369,329	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI	340	390	637	102,591	飲料
AVEVA GROUP PLC	199	199	498	80,151	ソフトウェア
COMPASS GROUP PLC	2,920	3,330	5,571	896,332	ホテル・レストラン・レジャー
NATIONAL GRID PLC	5,910	6,800	7,938	1,277,196	総合公益事業
ABRDN PLC	3,660	4,200	900	144,878	資本市場
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	890	1,220	773	124,484	保険
BHP GROUP PLC	3,470	—	—	—	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		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
VODAFONE GROUP PLC	45,000	51,200	6,626	1,066,106	無線通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	288	354	1,857	298,900	ホテル・レストラン・レジャー	
CRODA INTERNATIONAL PLC	223	263	2,079	334,535	化学	
FERGUSON PLC	366	418	4,345	699,084	商社・流通業	
M&G PLC	4,400	5,000	1,108	178,266	各種金融サービス	
RSA INSURANCE GROUP PLC	1,620	—	—	—	保険	
TESCO PLC	13,026	14,700	4,157	668,963	食品・生活必需品小売り	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	—	208	803	129,213	家庭用耐久財	
JD SPORTS FASHION PLC	—	4,650	710	114,390	専門小売り	
INFORMA PLC	2,480	2,750	1,665	267,946	メディア	
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	8,700	1,118	179,936	コングロマリット	
SHELL PLC-NEW	—	14,490	30,595	4,922,531	石油・ガス・消耗燃料	
AUTO TRADER GROUP PLC	1,710	1,710	1,097	176,573	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	116	141	1,758	283,001	機械	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	2,190	—	—	—	保険	
JD SPORTS FASHION PLC	930	—	—	—	専門小売り	
MELROSE INDUSTRIES PLC	8,500	—	—	—	コングロマリット	
JOHNSON MATTHEY PLC	302	348	651	104,840	化学	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	487,424	542,472	350,069	56,322,614	< 4.3% >
(スイス)			千スイスフラン			
SGS SA-REG	9	11	3,082	408,562	専門サービス	
BARRY CALLEBAUT AG	4	7	1,553	205,898	食品	
SWISSCOM AG-REG	44	48	2,742	363,449	各種電気通信サービス	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	1	2,195	291,018	食品	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.16	0.2	2,294	304,046	食品	
GIVAUDAN-REG	15	17	6,658	882,581	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	251	285	13,024	1,726,267	保険	
NOVARTIS AG-REG	3,670	4,123	33,664	4,461,865	医薬品	
ABB LTD	3,030	3,090	9,350	1,239,294	電気設備	
ROCHE HOLDINGS AG-BEARER	53	58	2,384	316,102	医薬品	
ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)	1,164	1,322	49,019	6,497,078	医薬品	
ADECCO GROUP AG-REG	249	281	1,211	160,520	専門サービス	
HOLCIM LTD	884	965	4,402	583,484	建設資材	
CLARIANT AG-REG	320	410	680	90,152	化学	
NESTLE SA-REG	4,774	5,297	63,871	8,465,492	食品	
BALOISE HOLDING AG	74	86	1,418	187,960	保険	
TEMENOS AG-REG	104	120	1,140	151,222	ソフトウェア	
BACHEM HOLDING AG-REG B	—	11	592	78,582	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SONOVA HOLDING AG-REG	88	103	3,943	522,720	ヘルスケア機器・用品	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	17	19	2,836	375,976	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	4,120	5,040	3,792	502,604	資本市場	
THE SWATCH GROUP AG-B	47	55	1,484	196,749	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	74	105	542	71,879	繊維・アパレル・贅沢品	
LONZA AG-REG	121	138	9,306	1,233,457	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SWISS LIFE HOLDING AG	52	60	3,589	475,708	保険	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	14	13	1,235	163,784	化学	
SWISS PRIME SITE-REG	135	135	1,248	165,419	不動産管理・開発	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	31	42	4,899	649,337	資本市場	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	67	74	1,493	197,924	機械	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	30	37	742	98,373	機械	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	84	101	2,728	361,570	海運業	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	270	316	2,246	297,785	コンピュータ・周辺機器	
GEBERIT AG-REG	62	68	3,978	527,246	建設関連製品	

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	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
JULIUS BAER GROUP LTD	358	422	2,299	304,828	資本市場
SWISS RE LTD	483	571	5,072	672,344	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	857	989	11,976	1,587,403	繊維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG	238	270	8,253	1,093,971	化学
ALCON INC	827	951	7,147	947,358	ヘルスケア機器・用品
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	54	—	—	—	銀行
VIFOR PHARMA AG/NEW	—	91	1,495	198,224	医薬品
UBS GROUP AG	6,020	6,610	11,914	1,579,151	資本市場
VAT GROUP AG	—	53	1,904	252,464	機械
VIFOR PHARMA AG	76	—	—	—	医薬品
株 数 ・ 金 額	28,779	32,400	293,419	38,889,867	
小 計	銘柄 数 < 比 率 >	40	41	< 3.0% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	126	155	7,562	100,051	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	2,670	3,140	32,875	434,946	銀行
SWEDBANK AB	1,480	1,700	27,159	359,316	銀行
SWEDISH MATCH AB	260	—	—	—	タバコ
SECURITAS AB-B SHS	540	540	5,988	79,229	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	767	—	—	—	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	1,300	1,330	19,269	254,929	専門小売り
ERICSSON LM-B	4,910	5,470	47,884	633,510	通信機器
TELIA CO AB	4,280	4,800	18,086	239,283	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	600	660	14,097	186,511	建設・土木
LUNDIN ENERGY AB	288	370	14,788	195,657	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	510	570	18,108	239,580	機械
GETINGE AB-B SHS	—	450	17,253	228,257	ヘルスケア機器・用品
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	151	187	11,496	152,102	不動産管理・開発
ICA GRUPPEN AB	171	—	—	—	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	730	730	7,380	97,641	機械
ELECTROLUX AB-B	340	—	—	—	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	600	680	10,506	138,994	機械
VOLVO AB-A SHS	—	400	7,388	97,743	機械
VOLVO AB-B SHS	2,330	2,690	48,333	639,457	機械
SANDVIK AB	1,840	2,100	42,840	566,773	機械
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	150	240	6,610	87,461	各種金融サービス
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	250	320	8,608	113,883	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B	1,000	1,120	20,328	268,939	紙製品・林産品
HEXAGON AB-B SHS	456	—	—	—	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	780	920	12,857	170,098	無線通信サービス
SAGAX AB-B	—	290	8,160	107,964	不動産管理・開発
ATLAS COPCO AB-A	1,129	1,269	61,800	817,617	機械
ATLAS COPCO AB-B	627	731	31,257	413,537	機械
EPIROC AB - A	1,130	—	—	—	機械
EPIROC AB - B	690	—	—	—	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,030	1,160	25,879	342,387	家庭用品
EQT AB	420	590	21,564	285,298	資本市場
BOLIDEN AB	440	—	—	—	金属・鉱業
EVOLUTION AB	273	329	33,110	438,052	ホテル・レストラン・レジャー
SINCH AB	—	920	6,800	89,972	ソフトウェア
LIFCO AB-B SHS	—	420	10,143	134,191	コングロマリット
EPIROC AB - A	—	1,210	24,127	319,205	機械
EPIROC AB - B	—	690	11,581	153,225	機械
EMBRACER GROUP AB	—	1,100	8,826	116,773	娯楽
INVESTOR AB-A SHS	—	960	21,456	283,862	各種金融サービス

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	期末			
			評価額		外貨建金額	邦貨換算金額
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円		
INVESTOR AB-B SHS	—	3,440	71,724	948,908	各種金融サービス	
BOLIDEN AB	—	530	25,090	331,943	金属・鉱業	
KINNEVIK AB - B	390	—	—	—	各種金融サービス	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	—	2,730	27,873	368,763	建設関連製品	
KINNEVIK AB - B	—	440	11,039	146,053	各種金融サービス	
HEXAGON AB-B SHS	—	3,630	48,097	636,329	電子装置・機器・部品	
SWEDISH MATCH AB	—	3,080	22,366	295,914	タバコ	
ELECTROLUX AB-B	—	410	6,340	83,886	家庭用耐久財	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	2,670	2,830	25,045	331,351	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	1,700	1,900	48,735	644,764	建設関連製品	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	510	—	—	—	建設関連製品	
NORDEA BANK ABP	5,480	6,070	60,329	798,162	銀行	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	260	260	7,909	104,638	コンピュータソフト	
小計	株数・金額	43,278	63,561	1,018,682	13,477,175	
	銘柄数<比率>	38	44	—	<1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	1,550	—	—	—	銀行	
TELENOR ASA	1,160	1,290	16,679	238,019	各種電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	106	144	3,162	45,125	メディア	
EQUINOR ASA	1,600	1,850	60,430	862,339	石油・ガス・消耗燃料	
YARA INTERNATIONAL ASA	296	331	216,849	15,196	化学	
MOWI ASA	700	840	20,412	291,279	食品	
NORSK HYDRO	2,180	2,460	21,795	311,023	金属・鉱業	
AKER BP ASA	—	220	7,156	102,124	石油・ガス・消耗燃料	
ORKLA ASA	1,330	1,330	10,472	149,441	食品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	310	400	8,920	127,288	保険	
ADEVINTA ASA	450	630	5,276	75,301	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
DNB BANK ASA	—	1,740	35,461	506,031	銀行	
SCHIBSTED ASA-B SHS	181	181	3,411	48,687	メディア	
小計	株数・金額	9,863	11,416	208,374	2,973,510	
	銘柄数<比率>	11	12	—	<0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG B	168	193	16,393	301,311	飲料	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	10	10	22,323	410,300	海運業	
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	5	5	11,116	204,312	海運業	
GN STORE NORD A/S	212	241	8,018	147,372	ヘルスケア機器・用品	
DANSKE BANK AS	1,090	1,320	15,503	284,952	銀行	
GENMAB A/S	110	126	31,248	574,338	バイオテクノロジー	
ROCKWOOL INTERNATIONAL A/S-B SHS	11	17	3,932	72,271	建設関連製品	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	332	—	—	—	電気設備	
H LUNDBECK A/S	105	—	—	—	医薬品	
DSV A/S	338	388	51,410	944,915	航空貨物・物流サービス	
PANDORA A/S	160	177	11,618	213,543	繊維・アパレル・贅沢品	
CHR HANSEN HOLDING A/S	182	204	10,018	184,138	化学	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	337	376	17,220	316,518	化学	
COLOPLAST-B	194	221	22,265	409,244	ヘルスケア機器・用品	
AMBU A/S-B	290	290	2,946	54,154	ヘルスケア機器・用品	
NOVO NORDISK A/S-B	2,842	3,169	239,481	4,401,666	医薬品	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	1,910	38,371	705,275	電気設備	
TRYG A/S-NEW	326	—	—	—	保険	
TRYG A/S	280	680	11,118	204,348	保険	
ORSTED A/S	318	351	28,852	530,303	電力	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
DEMANT A/S	160	201	6,088	111,902	ヘルスケア機器・用品
小 計	7,472	9,880	547,925	10,070,872	
(ユーロ…ドイツ)	銘柄数 < 比率 >	20	18	—	< 0.8% >
			千ユーロ		
ADIDAS AG	313	362	7,833	1,070,864	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA	673	780	2,550	348,667	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	537	73,489	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD	105	—	—	—	化学
HANNOVER RUECK SE	96	109	1,675	229,017	保険
GEA GROUP AG	242	290	1,093	149,454	機械
CONTINENTAL AG	189	206	1,388	189,856	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	1,659	1,846	8,175	1,117,650	航空貨物・物流サービス
MERCK KGAA	211	243	4,675	639,116	医薬品
RWE AG	1,085	1,190	4,599	628,731	総合公益事業
SAP SE	1,724	1,973	20,136	2,752,651	ソフトウェア
E.ON SE	3,800	4,250	4,539	620,481	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	180	203	1,226	167,610	家庭用品
PUMA SE	163	189	1,481	202,556	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG	1,616	1,863	11,526	1,575,656	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	289	332	2,037	278,478	家庭用品
BASF SE	1,512	1,726	9,197	1,257,346	化学
BEIERSDORF AG	160	198	1,900	259,839	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	38	—	—	—	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	249	274	1,464	200,163	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	366	399	2,394	327,259	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	680	772	16,698	2,282,665	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	560	1,120	831	113,710	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	229	267	6,520	891,303	保険
VOLKSWAGEN AG	51	58	1,357	185,529	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	312	344	5,471	747,976	自動車
MERCEDES-BENZ GROUP AG	1,431	1,607	10,501	1,435,588	自動車
NEMETSCHKE SE	92	110	977	133,558	ソフトウェア
SIEMENS AG	1,263	1,433	18,631	2,546,976	コングロマリット
DEUTSCHE BANK AG-REG	3,340	3,870	4,502	615,472	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	559	620	4,976	680,235	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	102	102	740	101,159	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	5,580	6,150	10,584	1,446,853	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG	57	51	2,086	285,281	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,188	2,440	7,706	1,053,511	半導体・半導体製造装置
RATIONAL AG	8	10	670	91,690	機械
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	72	72	1,077	147,340	ヘルスケア機器・用品
BECHTLE AG	44	157	818	111,859	情報技術サービス
DEUTSCHE BOERSE AG	320	359	5,928	810,478	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	254	294	2,600	355,518	自動車
LANXESS	127	155	653	89,267	化学
MTU AERO ENGINES AG	92	101	2,112	288,836	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE	555	—	—	—	不動産管理・開発
SYMRISE AG	209	255	2,775	379,434	化学
BRENTAG SE	268	290	2,144	293,199	商社・流通業
EVONIK INDUSTRIES AG	330	390	1,005	137,440	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	1,500	2,100	522	71,451	各種電気通信サービス
COMMERZBANK AG	1,580	1,880	1,377	188,352	銀行
LEG IMMOBILIEN SE	125	140	1,479	202,288	不動産管理・開発
KION GROUP AG	110	131	813	111,242	機械

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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VONOVIA SE	878	1,392	6,025	823,749	不動産管理・開発	
KNORR-BREMSE AG	127	127	910	124,408	機械	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	460	539	3,056	417,772	ヘルスケア機器・用品	
TEAMVIEWER AG	252	—	—	—	ソフトウェア	
SIEMENS ENERGY AG	660	730	1,502	205,369	電気設備	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	—	150	505	69,101	化学	
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	—	759	1,998	273,135	機械	
ZALANDO SE	249	402	1,979	270,645	インターネット販売・通信販売	
SCOUT24 SE	171	152	801	109,502	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
COVESTRO AG	305	380	1,783	243,782	化学	
HELLOFRESH SE	240	318	1,419	194,096	食品・生活必需品小売り	
QIAGEN N.V.	394	440	1,976	270,124	ライフサイエンス・ツール/サービス	
UNIPER SE	311	151	373	51,046	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
DELIVERY HERO SE	221	290	1,237	169,156	インターネット販売・通信販売	
小 計	株 数 ・ 金 額	41,145	47,709	227,571	31,109,007	
	銘柄 数 < 比 率 >	62	60	—	<2.4%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	1,880	2,080	4,184	572,084	保険	
INTESA SANPAOLO	27,800	30,800	6,572	898,490	銀行	
MEDIOBANCA S. P. A.	1,070	1,240	1,132	154,862	銀行	
ENEL SPA	13,580	15,290	9,322	1,274,360	電力	
ENI SPA	4,110	4,720	6,316	863,438	石油・ガス・消耗燃料	
SNAM SPA	3,500	3,840	1,979	270,547	ガス	
TENARIS SA	710	880	1,212	165,707	エネルギー設備・サービス	
TELECOM ITALIA SPA	11,700	19,300	692	94,662	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	8,800	—	—	—	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	790	890	1,684	230,308	運送インフラ	
TERNA SPA	2,220	2,750	2,071	283,221	電力	
RECORDATI SPA	168	199	932	127,529	医薬品	
AMPLIFON SPA	203	240	974	133,233	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PRYSMIAN SPA	430	480	1,501	205,312	電気設備	
DIASORIN SPA	40	48	680	93,043	ヘルスケア機器・用品	
FERRARI NV	213	241	4,841	661,859	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV	1,700	1,930	2,802	383,082	機械	
MONCLER SPA	321	376	1,958	267,789	繊維・アパレル・贅沢品	
NEXI SPA	740	1,040	1,140	155,958	情報技術サービス	
STELLANTIS NV	3,340	3,840	5,823	796,105	自動車	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	1,010	1,110	1,581	216,225	銀行	
UNICREDIT SPA	3,610	4,060	4,116	562,772	銀行	
EXOR NV	172	195	1,388	189,794	各種金融サービス	
POSTE ITALIANE SPA	880	1,030	1,089	148,897	保険	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	550	550	558	76,387	各種電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	89,537	97,129	64,562	8,825,674	
	銘柄 数 < 比 率 >	25	24	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	400	460	1,471	201,096	建設・土木	
AIRBUS SE	968	1,106	12,316	1,683,654	航空宇宙・防衛	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	870	1,250	3,638	497,417	総合公益事業	
LOREAL-ORD	420	470	17,232	2,355,689	パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	460	522	34,504	4,716,767	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT AVIATION SA	3	—	—	—	航空宇宙・防衛	
THALES SA	186	206	2,353	321,730	航空宇宙・防衛	
CAPGEMINI SA	273	300	6,009	821,430	情報技術サービス	
PUBLICIS GROUPE	380	433	2,478	338,809	メディア	

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	
FAURECIA	150	206	503	68,806	自動車部品
BOLLORE SE	1,380	1,680	796	108,902	娯楽
MICHELIN (CGDE)	287	312	3,845	525,666	自動車部品
PERNOD RICARD SA	343	391	7,702	1,052,959	飲料
RENAULT SA	337	337	833	113,971	自動車
REMY COINTREAU	39	39	726	99,268	飲料
SEB SA	41	54	689	94,265	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	887	1,023	15,619	2,135,139	電気設備
VIVENDI SE	1,400	1,450	1,724	235,776	メディア
ORANGE SA	3,250	3,820	4,110	561,880	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	53	59	7,778	1,063,376	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT SYSTEMES SA	223	—	—	—	ソフトウェア
KERING SA	127	141	8,274	1,131,070	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	280	360	786	107,479	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	950	1,190	2,324	317,781	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	153	—	—	—	情報技術サービス
SANOFI	1,869	2,148	20,100	2,747,804	医薬品
ACCOR SA	320	320	948	129,657	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	1,078	1,280	5,216	713,027	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	1,290	1,510	3,830	523,576	銀行
TELEPERFORMANCE	96	113	3,908	534,315	専門サービス
EURAZEO SE	59	78	599	81,995	各種金融サービス
SODEXO	138	159	1,183	161,841	ホテル・レストラン・レジャー
AXA SA	3,170	3,660	9,709	1,327,354	保険
ESSILORLUXOTTICA	478	541	9,244	1,263,737	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	1,840	2,260	2,516	344,037	銀行
BNP PARIBAS	1,850	2,112	11,210	1,532,474	銀行
ORPEA	93	93	363	49,733	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)	828	939	5,206	711,763	建設関連製品
WENDEL	43	43	401	54,872	各種金融サービス
ILIAD SA	24	—	—	—	各種電気通信サービス
SES FDR	560	—	—	—	メディア
SAFRAN SA	538	644	6,957	951,127	航空宇宙・防衛
ENGIE	3,080	3,370	4,067	556,039	総合公益事業
ALSTOM	433	610	1,331	181,950	機械
ELECTRICITE DE FRANCE	1,090	790	691	94,472	電力
ELECTRICITE DE FRANCE SA-RTS	—	790	31	4,319	電力
IPSEN	55	73	827	113,162	医薬品
ARKEMA	116	116	1,306	178,552	化学
LEGRAND SA	452	512	4,441	607,096	電気設備
EIFFAGE SA	141	159	1,482	202,703	建設・土木
TOTALENERGIES SE	4,159	4,736	22,242	3,040,566	石油・ガス・消耗燃料
ADP	47	61	837	114,532	運送インフラ
NATIXIS	1,580	—	—	—	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT	144	173	703	96,109	娯楽
SCOR SE	232	—	—	—	保険
VINCI	873	1,012	9,485	1,296,664	建設・土木
DANONE	1,038	1,244	6,320	864,048	食品
AIR LIQUIDE SA	791	897	14,298	1,954,561	化学
BUREAU VERITAS SA	470	540	1,443	197,389	専門サービス
GETLINK	720	830	1,345	183,920	運送インフラ
SUEZ	520	—	—	—	総合公益事業
EDENRED	424	470	2,119	289,762	情報技術サービス
VALEO SA	373	440	738	100,958	自動車部品

銘柄	株数	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…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
BIOMERIEUX	69	69	685	93,757	ヘルスケア機器・用品	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	154	200	731	99,927	ホテル・レストラン・レジャー	
FAURECIA	56	—	—	—	自動車部品	
DASSAULT SYSTEMES SE	—	1,250	5,704	779,788	ソフトウェア	
DASSAULT AVIATION SA	—	50	714	97,603	航空宇宙・防衛	
WORLDLINE SA	386	448	1,895	259,051	情報技術サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	45	49	1,884	257,606	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AMUNDI SA	100	128	814	111,372	資本市場	
小 計	株 数 ・ 金 額	45,686	50,728	303,263	41,456,179	
	銘柄 数 < 比 率 >	68	62	—	< 3.2% >	
(ユーロ…オランダ)						
ASM INTERNATIONAL NV	78	90	3,025	413,626	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	184	214	1,254	171,485	専門サービス	
WOLTERS KLUWER	444	503	4,842	662,022	専門サービス	
VOPAK	114	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
AEGON NV	2,930	3,290	1,593	217,765	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	5,600	6,100	1,913	261,585	各種電気通信サービス	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	1,527	1,740	4,895	669,213	ヘルスケア機器・用品	
HEINEKEN NV	438	496	4,338	593,006	飲料	
HEINEKEN HOLDING NV	200	220	1,582	216,382	飲料	
KONINKLIJKE DSM NV	291	333	5,421	741,083	化学	
ASML HOLDING NV	703	777	48,394	6,615,557	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,860	1,990	5,800	792,976	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	312	345	2,724	372,481	化学	
PROSUS NV	816	1,754	8,770	1,198,859	インターネット販売・通信販売	
JDE PEET'S BV	110	210	552	75,556	食品	
DAVIDE CAMPARI-MIRANO NV	910	910	963	131,674	飲料	
EURONEXT NV	—	153	1,272	173,909	資本市場	
IMCD NV	—	102	1,579	215,913	商社・流通業	
NN GROUP NV	470	494	2,286	312,595	保険	
ARGENX SE	76	83	2,343	320,413	バイオテクノロジー	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	1,350	3,225	440,878	娯楽	
ARCELORMITTAL	1,190	1,190	5,536	483,382	金属・鉱業	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	206	329	1,054	144,142	インターネット販売・通信販売	
ABN AMRO BANK NV-CVA	700	820	973	133,122	銀行	
ADYEN NV	30	37	7,001	957,156	情報技術サービス	
ING GROEP NV	6,390	7,270	7,107	971,547	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	25,580	30,800	126,454	17,286,339	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	25	—	< 1.3% >	
(ユーロ…スペイン)						
ENDESA S. A.	500	570	1,101	150,539	電力	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.	10,900	12,450	6,710	917,332	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	500	340	926	126,606	ガス	
REPSOL SA	2,448	2,740	3,294	450,293	石油・ガス・消耗燃料	
BANCO SANTANDER SA	28,500	32,600	10,244	1,400,429	銀行	
TELEFONICA SA	8,200	9,900	4,367	597,089	各種電気通信サービス	
ENAGAS SA	390	480	957	130,838	ガス	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	380	450	725	99,192	電気設備	
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	370	461	1,139	155,822	建設・土木	
FERROVIAL SA	797	950	2,287	312,714	建設・土木	
CAIXABANK	6,000	8,300	2,609	356,721	銀行	
IBERDROLA SA	10,220	10,940	10,872	1,486,225	電力	
AMADEUS IT GROUP SA	760	861	5,112	698,894	情報技術サービス	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	700	790	1,449	198,167	電力	

銘柄	株数	当期		業種等		
		株数	期末			
		評価額				
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
INDITEX SA	1,840	2,090	4,351	594,833	専門小売り	
AENA SME SA	117	144	2,186	298,913	運送インフラ	
CELLNEX TELECOM SA	539	950	4,212	575,821	各種電気通信サービス	
GRIFOLS SA	468	540	891	121,836	バイオテクノロジー	
小計	株数・金額	73,631	85,556	63,440	8,672,274	
	銘柄数<比率>	18	18	-	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	409	460	3,058	418,039	銀行	
SOFINA SA	23	29	974	133,200	各種金融サービス	
SOLVAY SA	116	142	1,321	180,603	化学	
UCB SA	206	245	2,632	359,866	医薬品	
COLRUYT SA	87	87	330	45,157	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAM	195	214	2,043	279,315	各種金融サービス	
PROXIMUS	260	260	442	60,421	各種電気通信サービス	
GALAPAGOS NV	70	-	-	-	バイオテクノロジー	
ELIA GROUP SA/NV	48	62	845	115,604	電力	
AGEAS	289	320	1,490	203,803	保険	
UMICORE	343	390	1,546	211,439	化学	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,277	1,633	9,014	1,232,235	飲料	
小計	株数・金額	3,323	3,842	23,699	3,239,686	
	銘柄数<比率>	12	11	-	<0.2%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	250	281	1,224	167,440	石油・ガス・消耗燃料	
VERBUND AG	110	127	1,185	162,064	電力	
VOESTALPINE AG	200	200	554	75,841	金属・鉱業	
ERSTE GROUP BANK AG	490	650	2,226	304,417	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	201	290	389	53,280	銀行	
小計	株数・金額	1,251	1,548	5,581	763,043	
	銘柄数<比率>	5	5	-	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
AROUNDTOWN SA	1,730	1,730	919	125,671	不動産管理・開発	
INPOST SA	-	340	225	30,856	航空貨物・物流サービス	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	216	255	2,342	320,245	ライフサイエンス・ツール/サービス	
小計	株数・金額	1,946	2,325	3,487	476,773	
	銘柄数<比率>	2	3	-	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS	440	500	1,313	179,487	食品・生活必需品小売り	
WARTSILA OYJ	660	820	715	97,858	機械	
UPM-KYMMENE OYJ	910	1,020	3,083	421,508	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R	960	1,080	1,958	267,664	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A SHS	804	950	4,222	577,249	保険	
FORTUM OYJ	720	890	1,501	205,306	電力	
ELISA OYJ	221	257	1,407	192,382	各種電気通信サービス	
NOKIA OYJ	9,230	10,020	5,045	689,661	通信機器	
NESTE OYJ	714	780	3,130	427,996	石油・ガス・消耗燃料	
KONE OYJ	574	635	3,047	416,574	機械	
ORION OYJ	165	210	874	119,593	医薬品	
小計	株数・金額	15,398	17,162	26,300	3,595,282	
	銘柄数<比率>	11	11	-	<0.3%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC	1,322	1,460	5,378	735,260	建設資材	
KINGSPAN GROUP PLC	264	299	2,644	361,565	建設関連製品	
KERRY GROUP PLC-A	259	293	2,978	407,139	食品	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	-	-	-	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		
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株	千ユーロ	千円		
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	423	462	1,870	255,653	容器・包装	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	266	311	3,254	444,905	ホテル・レストラン・レジャー	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,932	2,825	16,126	2,204,523	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	5	—	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL	4,760	5,090	2,244	306,849	電力	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	810	960	1,104	150,916	石油・ガス・消耗燃料	
JERONIMO MARTINS	380	550	1,194	163,301	食品・生活必需品小売り	
EDP RENOVAVEIS SA	—	580	1,336	182,674	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,950	7,180	5,879	803,742	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	307,381	346,806	866,368	118,432,528	
	銘柄 数 < 比 率 >	235	228	—	< 9.0% >	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	480	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	3,600	3,600	5,724	89,523	不動産管理・開発	
BANK OF EAST ASIA	2,200	—	—	—	銀行	
CLP HLDGS	2,810	3,170	24,218	378,782	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	1,983	2,280	85,773	1,341,499	資本市場	
MTR CORP	2,720	3,070	13,032	203,822	陸運・鉄道	
HANG SENG BANK	1,310	1,400	21,392	334,570	銀行	
HENDERSON LAND	2,294	2,674	8,892	139,078	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	2,250	2,540	13,081	204,586	電力	
HONG KONG & CHINA GAS	17,403	20,703	19,792	309,560	ガス	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	3,560	4,090	19,427	303,846	ホテル・レストラン・レジャー	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	6,100	6,700	20,033	313,316	銀行	
PCCW LTD	7,500	—	—	—	各種電気通信サービス	
SINO LAND CO. LTD	4,800	6,200	6,472	101,234	不動産管理・開発	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	2,220	2,500	23,812	372,427	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC-A	750	1,040	4,997	78,156	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	2,330	2,620	33,929	530,649	機械	
XINYI GLASS HOLDINGS CO LTD	2,800	3,300	6,481	101,365	建設関連製品	
SJM HOLDINGS LIMITED	2,700	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
WYNN MACAU LTD	2,280	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROUP LTD	—	4,100	5,986	93,621	専門小売り	
AIA GROUP LTD	19,980	22,840	188,430	2,947,045	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD	5,996	7,196	7,800	121,999	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	3,840	4,320	8,346	130,535	ホテル・レストラン・レジャー	
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	—	2,300	6,555	102,520	海運業	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,730	2,300	4,586	71,728	不動産管理・開発	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	2,790	3,110	12,502	195,534	不動産管理・開発	
ESR CAYMAN LTD	2,600	3,800	9,272	145,014	不動産管理・開発	
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	2,900	3,500	7,350	114,954	飲料	
WH GROUP LIMITED	16,100	15,383	7,676	120,054	食品	
NEW WORLD DEVELOPMENT	2,689	2,689	8,806	137,741	不動産管理・開発	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	4,600	5,090	29,906	467,731	コングロマリット	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	1,070	1,340	7,142	111,704	電力	
CK ASSET HOLDINGS LTD	4,450	3,830	20,875	326,495	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	140,837	147,687	632,295	9,889,098	
	銘柄 数 < 比 率 >	32	29	—	< 0.8% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	2,490	3,100	1,283	116,134	航空宇宙・防衛	
DBS GROUP HLDGS	3,020	3,380	12,211	1,105,058	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	700	700	559	50,611	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		
SINGAPORE EXCHANGE LTD	1,290	1,480	1,463	132,452	資本市場	
CAPITALAND LIMITED	4,300	—	—	—	不動産管理・開発	
SINGAPORE AIRLINES LTD	2,400	2,400	1,320	119,446	旅客航空輸送業	
UNITED OVERSEAS BANK	1,900	2,200	7,108	643,221	銀行	
UOL GROUP LIMITED	870	870	620	56,131	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	450	580	1,032	93,474	電子装置・機器・部品	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	—	15,400	4,096	370,683	各種電気通信サービス	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	14,000	—	—	—	各種電気通信サービス	
OCBC-ORD	5,590	6,490	8,080	731,163	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	3,400	3,800	1,839	166,429	食品	
KEPPEL CORP.	2,320	2,800	1,817	164,438	コングロマリット	
GENTING SINGAPORE LTD	11,300	11,300	932	84,359	ホテル・レストラン・レジャー	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	—	4,800	1,958	177,215	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	54,030	59,300	44,323	4,010,819	
	銘柄 数 < 比 率 >	14	14	—	< 0.3% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	295	330	2,136	196,550	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	4,750	5,300	14,776	1,359,428	銀行	
WESTPAC BANKING CORP	5,940	6,950	17,034	1,567,169	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	2,760	3,130	6,197	570,160	金属・鉱業	
TELSTRA CORP LTD	7,300	7,900	3,081	283,452	各種電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LTD	770	—	—	—	飲料	
ASX LTD	307	378	3,082	283,598	資本市場	
BHP GROUP LIMITED	4,860	9,530	48,202	4,434,652	金属・鉱業	
COMPUTERSHARE LTD	760	1,010	2,513	231,277	情報技術サービス	
COMPUTERSHARE LTD-RIGHTS	86	—	—	—	情報技術サービス	
CSL LIMITED	758	905	24,439	2,248,436	バイオテクノロジー	
REA GROUP LTD	88	104	1,420	130,660	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
TRANSURBAN GROUP	4,620	5,860	7,799	717,568	運送インフラ	
COCHLEAR LTD	103	128	2,851	262,310	ヘルスケア機器・用品	
ORIGIN ENERGY LTD	2,650	3,300	2,088	192,178	電力	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	2,951	3,211	34,380	3,162,976	銀行	
RIO TINTO LTD	607	702	8,207	755,051	金属・鉱業	
APA GROUP	2,050	2,290	2,457	226,059	ガス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	990	1,100	4,121	379,196	ホテル・レストラン・レジャー	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	4,300	4,800	2,116	194,745	保険	
ORICA LTD	590	790	1,271	117,014	化学	
BLUESCOPE STEEL LTD	900	900	1,941	178,599	金属・鉱業	
SUNCORP GROUP LTD	2,220	2,450	2,746	252,673	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	5,410	6,190	20,037	1,843,406	銀行	
NEWCREST MINING	1,320	1,640	4,408	405,565	金属・鉱業	
OIL SEARCH LTD	3,500	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
AMP LIMITED	5,300	—	—	—	各種金融サービス	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	1,700	1,700	894	82,266	旅客航空輸送業	
QBE INSURANCE	2,440	2,660	3,101	285,343	保険	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,940	1,940	2,083	191,687	金属・鉱業	
REECE LTD	—	490	980	90,205	商社・流通業	
SANTOS LTD.	3,100	6,100	4,800	441,664	石油・ガス・消耗燃料	
SONIC HEALTHCARE LTD	780	840	3,006	276,585	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	380	1,084	99,775	石油・ガス・消耗燃料	
TABCORP HOLDINGS	3,709	4,200	2,188	201,314	ホテル・レストラン・レジャー	
WESFARMERS LIMITED	1,902	2,120	10,848	998,019	複合小売り	
WOODSIDE PETROLEUM	1,630	1,850	6,019	553,830	石油・ガス・消耗燃料	
WOOLWORTHS GROUP LTD	2,120	2,330	8,641	795,061	食品・生活必需品小売り	

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		
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	192	—	—	—	資本市場	
SEEK LTD	600	600	1,807	166,262	インタラクティブ・メディアおよびサービス	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	—	103	903	83,095	ホテル・レストラン・レジャー	
MINERAL RESOURCES LTD	—	340	1,717	157,995	金属・鉱業	
BRAMBLES LTD	2,470	2,700	2,689	247,406	商業サービス・用品	
MACQUARIE GROUP LIMITED	568	632	13,088	1,204,104	資本市場	
CROWN RESORTS LTD	550	770	980	90,250	ホテル・レストラン・レジャー	
EVOLUTION MINING LTD	2,720	3,400	1,489	137,006	金属・鉱業	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	730	850	3,578	329,222	建設資材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,110	1,350	1,597	146,928	飲料	
SYDNEY AIRPORT	2,006	—	—	—	運送インフラ	
AURIZON HOLDINGS LTD	3,050	3,800	1,390	127,953	陸運・鉄道	
XERO LIMITED	198	255	2,745	252,570	ソフトウェア	
IDP EDUCATION LTD	—	370	1,168	107,532	各種消費者サービス	
AFTERPAY LTD	348	—	—	—	情報技術サービス	
AMPOL LTD	400	400	1,229	113,086	石油・ガス・消耗燃料	
TPG TELECOM LTD	520	—	—	—	各種電気通信サービス	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALIA	—	2,530	1,857	170,845	食品・生活必需品小売り	
AUSNET SERVICES	3,300	—	—	—	電力	
MEDIBANK PRIVATE LTD	4,500	5,200	1,617	148,782	保険	
AGL ENERGY LTD	1,050	—	—	—	総合公益事業	
SOUTH32 LTD	7,800	8,700	4,332	398,599	金属・鉱業	
CIMIC GROUP LTD	180	—	—	—	建設・土木	
COLES GROUP LTD	2,270	2,430	4,364	401,513	食品・生活必需品小売り	
WISETECH GLOBAL LTD	210	280	1,449	133,308	ソフトウェア	
小 計	株 数 ・ 金 額	120,448	128,218	308,966	28,424,950	
	銘柄 数 < 比 率 >	58	52	—	< 2.2% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
RYMAN HEALTHCARE LTD	740	740	685	58,471	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	—	—	—	食品	
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	930	1,090	2,706	230,943	ヘルスケア機器・用品	
SPARK NEW ZEALAND LTD	3,070	3,800	1,751	149,481	各種電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	1,000	1,370	817	69,790	電力	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	2,230	2,230	1,717	146,520	運送インフラ	
MERIDIAN ENERGY LTD	2,010	2,500	1,237	105,595	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小 計	株 数 ・ 金 額	11,150	11,730	8,916	760,802	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	6	—	< 0.1% >	
(イスラエル)			千新シケル			
BANK HAPOLIM BM	1,830	2,240	7,221	278,130	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	2,380	2,670	9,414	362,576	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	50	50	3,586	138,107	航空宇宙・防衛	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	1,720	2,130	4,247	163,572	銀行	
ICL GROUP LTD	1,250	1,390	5,309	204,495	化学	
NICE LTD	106	116	8,267	318,398	ソフトウェア	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	230	280	3,575	137,706	銀行	
AZRIELI GROUP	65	86	2,463	94,891	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	7,631	8,962	44,086	1,697,880	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 0.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,803,673	2,032,917	—	1,260,556,072	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,229	1,223	—	< 95.8% >	

* 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		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			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	93,000	93,000	1,231	150,701	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,400	28,100	5,678	694,985	0.1
AMERICAN TOWER CORP	73,700	86,000	21,574	2,640,542	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	238,000	267,000	1,893	231,687	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,700	26,600	6,701	820,241	0.1
BOSTON PROPERTIES	25,000	28,600	3,742	458,056	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	18,800	3,188	390,261	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	72,100	81,100	14,967	1,831,911	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	45,200	54,000	7,784	952,762	0.1
DUKE REALTY CORP	62,200	70,100	4,143	507,136	0.0
EQUINIX INC	14,810	16,910	12,746	1,560,096	0.1
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,400	32,100	2,484	304,082	0.0
EQUITY RESIDENTIAL	60,300	67,400	6,167	754,791	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	12,000	4,184	512,158	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	24,900	5,202	636,777	0.0
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	88,000	100,000	3,483	426,284	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	135,000	2,690	329,296	0.0
INVITATION HOMES INC	92,000	113,000	4,622	565,788	0.0
IRON MOUNTAIN INC	49,000	54,000	2,994	366,538	0.0
KIMCO REALTY CORP	—	115,000	2,875	351,871	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	99,000	108,000	2,307	282,471	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,300	21,400	4,558	557,904	0.0
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	—	—	—	—
PROLOGIS INC	122,700	139,100	22,831	2,794,393	0.2
PUBLIC STORAGE	26,500	29,700	11,765	1,440,034	0.1
REALTY INCOME CORP	55,600	106,800	7,505	918,647	0.1
REGENCY CENTERS CORP	26,200	28,800	2,084	255,162	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	18,100	20,500	7,031	860,535	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	54,800	61,300	8,262	1,011,262	0.1
SUN COMMUNITIES INC	17,800	21,300	3,793	464,316	0.0
UDR INC	46,100	59,100	3,428	419,673	0.0
VENTAS INC	63,900	73,600	4,624	565,966	0.0
VEREIT INC	37,000	—	—	—	—
VICI PROPERTIES INC	87,000	120,000	3,472	425,035	0.0
VORNADO REALTY TRUST	27,000	32,000	1,478	180,941	0.0
WP CAREY INC	27,400	34,000	2,796	342,222	0.0
WELLTOWER INC	68,000	82,200	8,044	984,516	0.1
WEYERHAEUSER CO	121,000	143,000	5,511	674,518	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	2,098,110 37	2,504,410 36	217,857 —	26,663,571 < 2.0% >
(カナダ)			千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	14,900	812	79,587	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	28,000	715	70,065	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	36,900 2	42,900 2	1,528 —	149,652 < 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		
(イギリス)	口	口	千英ポンド	千円	%	
BRITISH LAND	128,000	159,000	857	137,986	0.0	
SEGRO PLC	193,000	231,000	3,142	505,637	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	132,000	1,064	171,259	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	432,000	522,000	5,064	814,883	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	32,300	40,000	995	136,098	0.0	
GECINA SA	7,100	8,100	934	127,778	0.0	
COVIVIO	8,500	10,900	796	108,891	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	24,200	23,900	1,636	223,765	0.0	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	72,100	82,900	4,363	596,534	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	353,000	392,000	26,518	414,754	0.0	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	470,000	3,628	56,748	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	823,000	862,000	30,147	471,502	
	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	706,779	904,221	2,061	186,556	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	539,240	620,040	1,829	165,516	0.0	
SUNTEC REIT	300,000	—	—	—	—	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	427,980	570,329	1,066	96,508	0.0	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	370,000	710	64,284	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,343,999	2,464,590	5,667	512,866	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.0%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	660,000	750,000	1,897	174,570	0.0	
GPT GROUP	330,000	380,000	1,960	180,393	0.0	
LENDLEASE GROUP	111,000	135,000	1,494	137,489	0.0	
STOCKLAND TRUST GROUP	400,000	460,000	1,978	181,976	0.0	
DEXUS/AU	171,000	196,000	2,156	198,352	0.0	
GOODMAN GROUP	283,000	319,000	7,356	676,764	0.1	
SCENTRE GROUP	820,000	1,010,000	3,141	288,981	0.0	
VICINITY CENTRES	670,000	670,000	1,246	114,650	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	3,445,000	3,920,000	21,230	1,953,177	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	9,251,109	10,398,800	—	31,162,188	
	銘柄 数 < 比 率 >	61	59	—	<2.4%>	

* 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	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	CAN60	百万円 754	百万円 —
		EURO50	1,795	—
		FT100	858	—
		SPI200	481	—
		SPEMINI	14,400	—
		SWISSMKT	592	—

*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

(2022年3月31日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	1,260,556,072	95.8
投資証券	31,162,188	2.4
コール・ローン等、その他	24,602,516	1.8
投資信託財産総額	1,316,320,776	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建純資産（1,312,101,756千円）の投資信託財産総額（1,316,320,776千円）に対する比率は99.7%です。

*外貨建資産は、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=122.39円、1カナダドル=97.90円、1英ポンド=160.89円、1スイスフラン=132.54円、1スウェーデンクローナ=13.23円、1ノルウェークローネ=14.27円、1デンマーククローネ=18.38円、1ユーロ=136.70円、1香港ドル=15.64円、1シンガポールドル=90.49円、1豪ドル=92.00円、1ニュージーランドドル=85.33円、1新シェケル=38.5129円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月31日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	1,319,612,893,057
コール・ローン等	16,164,492,581
株式(評価額)	1,260,556,072,948
投資証券(評価額)	31,162,188,398
未収入金	4,271,783,153
未収配当金	1,549,663,654
差入委託証拠金	5,908,692,323
(B) 負債	4,268,796,686
未払金	3,316,782,017
未払解約金	948,473,555
未払利息	1,914
その他未払費用	3,539,200
(C) 純資産総額(A-B)	1,315,344,096,371
元本	276,853,019,010
次期繰越損益金	1,038,491,077,361
(D) 受益権総口数	276,853,019,010口
1万口当たり基準価額(C/D)	47,511円

(注) 期首元本額は245,531,591,330円、期中追加設定元本額は57,234,513,893円、期中一部解約元本額は25,913,086,213円、1口当たり純資産額は4.7511円です。

○損益の状況 (2021年4月1日～2022年3月31日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	18,637,884,256
受取配当金	18,622,438,805
受取利息	1,500
その他収益金	25,263,686
支払利息	△ 9,819,735
(B) 有価証券売買損益	234,492,254,411
売買益	294,028,438,419
売買損	△ 59,536,184,008
(C) 先物取引等取引損益	1,828,564,586
取引益	4,615,035,393
取引損	△ 2,786,470,807
(D) 保管費用等	△ 106,500,360
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	254,852,202,893
(F) 前期繰越損益金	682,116,659,771
(G) 追加信託差損益金	185,312,463,668
(H) 解約差損益金	△ 83,790,248,971
(I) 計(E+F+G+H)	1,038,491,077,361
次期繰越損益金(I)	1,038,491,077,361

* 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
	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)	85,751,817,026
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)	45,866,760,786
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	33,303,826,987
野村PoF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)	11,606,960,868
野村つみたて外国株投信	10,498,104,134
のむらっぴ・ファンド(普通型)	9,420,417,936
のむらっぴ・ファンド(積極型)	8,947,634,713
マイバランス50(確定拠出年金向け)	7,849,911,454
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,547,397,299
野村インデックスファンド・外国株式	7,261,094,161
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	6,279,185,236
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	4,975,961,363
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)	4,785,556,933
野村世界6資産分散投信(分配コース)	4,050,440,777
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,779,433,195
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,160,425,882
野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)	2,253,930,795
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)	2,232,642,047

ファンド名	当期末
	元本額
	円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,100,979,048
マイバランスDC50	1,797,228,535
マイバランスDC70	1,581,622,653
野村6資産均等バランス	1,293,340,986
マイ・ロード	903,921,663
マイバランスDC30	791,203,682
ノムラPoF用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	777,328,705
のむらっぴ・ファンド(保守型)	757,972,373
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	748,143,465
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)	741,032,370
野村スリー・ゼロ先進国株式投信	700,597,962
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)	599,612,608
野村外国株式インデックスファンド	487,011,909
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)	402,420,685
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	397,018,872
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	372,867,953
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	339,282,748
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	328,915,465

ファンド名	当期末
	元本額
	円
のむらっぴ・ファンド (やや保守型)	210,761,252
マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)	180,184,729
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	148,946,058
野村DC運用戦略ファンド	139,777,548
マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)	138,949,046
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)	131,647,823
バランスセレクト70	116,425,567
マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)	113,029,588
多資産分散投資ファンド(バランス10) (確定拠出年金向け)	99,795,865
バランスセレクト50	95,935,920
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)	87,764,083
マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)	81,193,323
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)	65,295,175
野村資産設計ファンド2040	43,237,015
野村世界6資産分散投資信 (DC) 成長コース	42,469,309
世界6資産分散投資信	38,134,431
インデックス・ブレンド (タイプV)	33,019,086
バランスセレクト30	32,014,849
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)	28,287,428
インデックス・ブレンド (タイプIII)	27,292,797
マイターゲット2065 (確定拠出年金向け)	27,158,462
野村資産設計ファンド2030	26,855,303
野村資産設計ファンド2035	22,668,859
野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)	21,492,638
野村資産設計ファンド2025	18,132,350
野村世界6資産分散投資信 (DC) 安定コース	17,320,011
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)	16,847,179
野村資産設計ファンド2050	10,655,035
野村資産設計ファンド2020	10,126,000

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村DC運用戦略ファンド (マイルド)	10,066,762
野村資産設計ファンド2015	9,939,235
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	8,648,454
バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	8,396,231
野村資産設計ファンド2045	8,346,649
先物・国債・人権型プラス外国株式戦略オープン (部分為替ヘッジあり) (適格機関投資家専用)	8,274,561
野村資産設計ファンド2060	7,831,515
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2030	7,699,711
野村世界6資産分散投資信 (DC) インカムコース	7,696,230
インデックス・ブレンド (タイプIV)	7,308,377
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040	6,905,610
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050	5,549,486
野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	4,650,251
ネクストコア	4,396,469
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)	4,287,944
野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060	3,557,016
みらいバランス・株式10 (富士通企業年金基金DC向け)	3,323,878
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	3,308,598
インデックス・ブレンド (タイプI)	2,595,644
インデックス・ブレンド (タイプII)	2,398,873
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,837,951
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)	1,655,193
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,430,643
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	1,363,876
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,214,397
野村PPIs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)	1,175,495
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)	1,040,026
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)	699,932

○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 インデックス・ファンドP (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 インデックス マザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	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)	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 インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	

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35期(決算日 2022年3月7日)
 第36期(決算日 2022年5月9日)
 第37期(決算日 2022年7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。
- ・ 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	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率						
第9	第23期(2020年 3月9日)	円 9,286	円 30	% △0.7	10,329	% 2.8	% 98.4	% 0.8	百万円 30,384		
	第24期(2020年 5月7日)	9,265	26	0.1	9,989	△3.3	97.9	1.2	29,172		
	第25期(2020年 7月7日)	9,651	28	4.5	10,477	4.9	98.0	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	0.8	30,965		
	第27期(2020年11月9日)	9,577	24	△2.1	10,433	△1.9	98.3	0.9	30,480		
	第28期(2021年 1月7日)	9,686	24	1.4	10,609	1.7	97.9	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	1.0	31,452		
	第30期(2021年 5月7日)	9,822	21	1.1	10,793	1.4	98.1	1.2	31,903		
	第31期(2021年 7月7日)	9,919	25	1.2	10,947	1.4	98.2	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	1.2	32,712		
	第33期(2021年11月8日)	10,060	23	1.7	11,128	1.5	98.0	1.3	33,434		
	第34期(2022年 1月7日)	9,946	20	△0.9	11,021	△1.0	97.7	1.6	33,674		
第13	第35期(2022年 3月7日)	9,600	20	△3.3	10,685	△3.0	98.2	1.1	33,097		
	第36期(2022年 5月9日)	9,833	23	2.7	10,961	2.6	94.2	4.5	34,002		
	第37期(2022年 7月7日)	10,030	26	2.3	11,214	2.3	98.5	0.7	34,892		

(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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		円	騰落率	円	騰落率		
第35期	(期 首)2022年1月7日	9,946	—	11,021	—	97.7	1.6
	1月末	9,800	△1.5	10,866	△1.4	97.1	2.0
	2月末	9,627	△3.2	10,714	△2.8	97.7	1.4
	(期 末)2022年3月7日	9,620	△3.3	10,685	△3.0	98.2	1.1
第36期	(期 首)2022年3月7日	9,600	—	10,685	—	98.2	1.1
	3月末	9,925	3.4	11,007	3.0	97.5	1.6
	4月末	9,943	3.6	11,010	3.0	97.8	0.8
	(期 末)2022年5月9日	9,856	2.7	10,961	2.6	94.2	4.5
第37期	(期 首)2022年5月9日	9,833	—	10,961	—	94.2	4.5
	5月末	9,859	0.3	10,964	0.0	97.0	1.9
	6月末	10,094	2.7	11,292	3.0	97.7	1.4
	(期 末)2022年7月7日	10,056	2.3	11,214	2.3	98.5	0.7

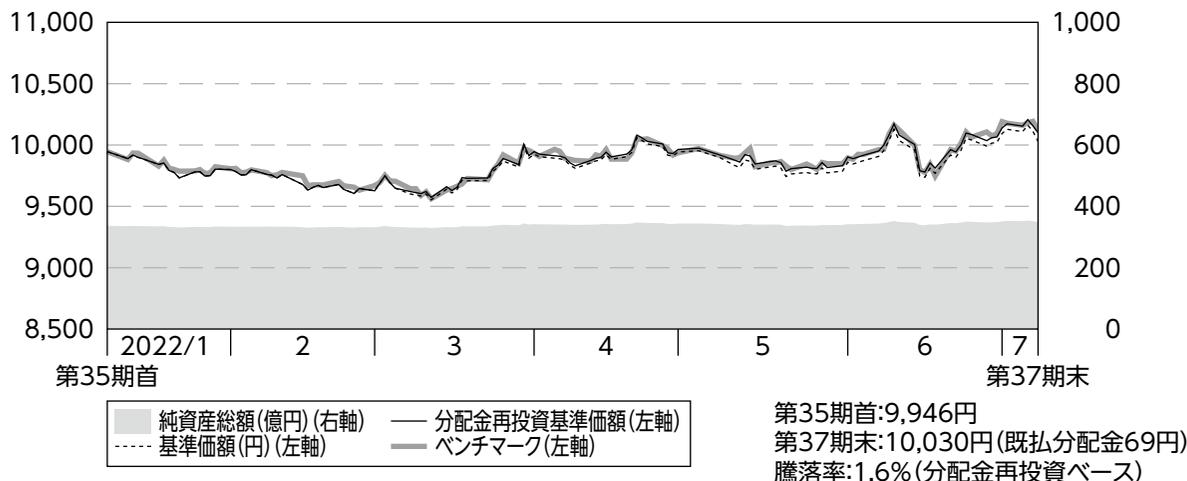
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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

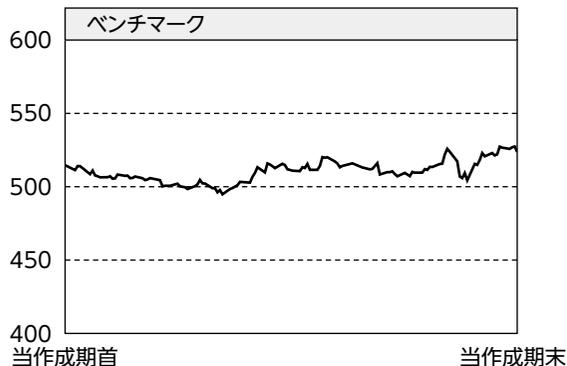


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年1月7日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2022年3月中旬にかけて、米国で大幅利上げへの警戒感が高まったこと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(分配金再投資ベース)は下落しました。3月下旬には、商品価格の高騰で世界的にインフレ加速が警戒されて主要国の長期金利が上昇したものの、日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことや原油高による日本の貿易収支の悪化観測から外国為替市場で円売りが加速し、基準価額は上昇しました。4月から6月上旬にかけては、主要国の長期金利上昇と円安推移が続いたことから、基準価額は上下動しながらレンジ内推移となりました。6月中旬には、世界的に株式が下落したことによるリスク回避姿勢の高まりから対ユーロや英ポンドで円高となり、基準価額は一旦下落しましたが、6月下旬以降は、主要国の長期金利上昇が一服して低下(債券価格は上昇)に転じたことや主要国の中央銀行が利上げペースを加速させた一方で日銀が金融緩和策を維持したことによる金融政策の方向性の違いが意識されて円安が継続したことから、基準価額は上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、商品価格の高騰で世界的にインフレ加速が警戒される中、主要国の中央銀行が利上げペースを加速したことから、上昇しました。

外国為替市場では、原油高による日本の貿易収支の悪化観測が高まったことや主要国の中央銀行が利上げペースを加速させた一方で日銀が金融緩和策を維持したことによる金融政策の方向性の違いが意識されて、対主要通貨で円安が加速しました。

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。

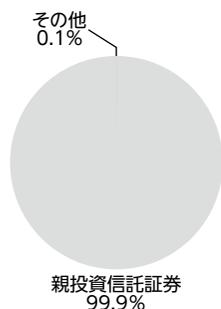
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

	当作成期末
	2022年7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。

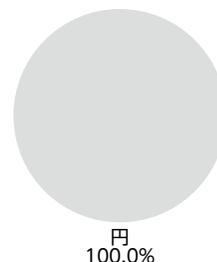
○資産別配分



○国別配分



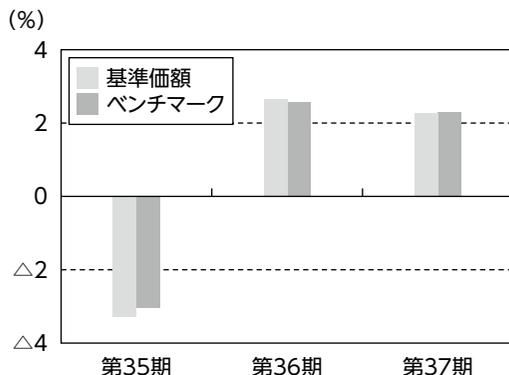
○通貨別配分



(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35期	第36期	第37期
	2022年1月8日～ 2022年3月7日	2022年3月8日～ 2022年5月9日	2022年5月10日～ 2022年7月7日
当期分配金 (円)	20	23	26
(対基準価額比率) (%)	(0.208)	(0.233)	(0.259)
当期の収益 (円)	20	23	26
当期の収益以外 (円)	—	—	—
翌期繰越分配対象額 (円)	1,195	1,201	1,205

(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
	(2022年1月8日~2022年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	6円	0.065%	(a) 信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,874円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(5)	(0.049)	
(販売会社)	(1)	(0.005)	
(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= $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(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= $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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	0.015	(d) その他費用= $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(1)	(0.012)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.080	

(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 421,667	千円 1,297,251	千口 209,128	千円 650,547

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 A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 2,612	百万円 203	% 7.8	百万円 2,619	百万円 200	% 7.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<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 A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
為 替 直 物 取 引	百万円 25,500	百万円 73	% 0.3	百万円 15,933	百万円 156	% 1.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	582,020	41,077	7.1	584,594	40,808	7.0

<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
外国債券インデックス マザーファンド	千口 10,829,378	千口 11,041,918	千円 34,874,794

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、101,616,621千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス マザーファンド	千円 34,874,794	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	115,593	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	34,990,387	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(318,951,697千円)の投資信託財産総額(321,151,358千円)に対する比率は99.3%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=135.88円

1ユーロ=138.35円

1ノルウェークローネ=13.40円

1オーストラリアドル=92.19円

1オフショア人民元=20.2322円

1カナダドル=104.21円

1イギリスポンド=162.00円

1デンマーククローネ=18.59円

1シンガポールドル=96.77円

1イスラエルシェケル=38.932円

1メキシコペソ=6.5803円

1スウェーデンクローナ=12.88円

1ポーランドズロチ=29.004円

1マレーシアリングギット=30.7069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 35 期 末 2022年3月7日現在	第 36 期 末 2022年5月9日現在	第 37 期 末 2022年7月7日現在
(A)資 産 等	33,174,331,630円	34,100,731,307円	34,990,387,455円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	48,680,608	24,322,097	24,924,372
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	33,081,362,809	33,985,090,746	34,874,794,569
未 収 入 金	44,288,213	91,318,464	90,668,514
(B)負 債	76,370,951	98,563,063	98,050,129
未 払 収 益 分 配 金	68,954,526	79,535,727	90,444,962
未 払 解 約 金	29,999	10,999,999	—
未 払 信 託 報 酬	7,116,756	7,738,800	7,334,606
未 払 利 息	15	17	8
そ の 他 未 払 費 用	269,655	288,520	270,553
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	33,097,960,679	34,002,168,244	34,892,337,326
元 本	34,477,263,188	34,580,750,917	34,786,523,995
次 期 繰 越 損 益 金	△1,379,302,509	△578,582,673	105,813,331
(D)受 益 権 総 口 数	34,477,263,188口	34,580,750,917口	34,786,523,995口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	9,600円	9,833円	10,030円

■損益の状況

項 目	第 35 期 自 2022年1月8日 至 2022年3月7日	第 36 期 自 2022年3月8日 至 2022年5月9日	第 37 期 自 2022年5月10日 至 2022年7月7日
(A)配 当 等 収 益	△1,256円	△715円	△1,372円
受 取 利 息	22	1	43
支 払 利 息	△1,278	△716	△1,415
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,105,496,760	886,537,032	784,751,754
売 買 益	4,275	891,369,954	791,859,693
売 買 損	△1,105,501,035	△4,832,922	△7,107,939
(C)信 託 報 酬 等	△7,386,411	△8,027,320	△7,605,159
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	△1,112,884,427	878,508,997	777,145,223
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,124,325,367	939,729,785	1,720,362,522
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△2,321,788,923	△2,317,285,728	△2,301,249,452
(配 当 等 相 当 額)	(1,585,971,923)	(1,605,943,912)	(1,657,653,470)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,907,760,846)	(△3,923,229,640)	(△3,958,902,922)
(G) 計 (D+E+F)	△1,310,347,983	△499,046,946	196,258,293
(H)収 益 分 配 金	△68,954,526	△79,535,727	△90,444,962
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△1,379,302,509	△578,582,673	105,813,331
追 加 信 託 差 損 益 金	△2,321,788,923	△2,317,285,728	△2,301,249,452
(配 当 等 相 当 額)	(1,586,165,333)	(1,606,013,826)	(1,657,804,836)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△3,907,954,256)	(△3,923,299,554)	(△3,959,054,288)
分 配 準 備 積 立 金	2,534,024,275	2,550,587,859	2,536,357,776
繰 越 損 益 金	△1,591,537,861	△811,884,804	△129,294,993

(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35期首元本額は33,857,677,648円、第35～37期中追加設定元本額は1,397,694,160円、第35～37期中一部解約元本額は468,847,813円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 35 期	第 36 期	第 37 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	82,903,231円	103,510,942円	103,119,496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	1,586,165,333円	1,606,013,826円	1,657,804,836円
(D) 分配準備積立金額	2,520,075,570円	2,526,612,644円	2,523,683,242円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	4,189,144,134円	4,236,137,412円	4,284,607,574円
(F) 期末残存口数	34,477,263,188口	34,580,750,917口	34,786,523,995口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	1,215円	1,224円	1,231円
(H) 分配金額(1万口当たり)	20円	23円	26円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	68,954,526円	79,535,727円	90,444,962円

分配金のお知らせ

	第35期	第36期	第37期
1万口当たり分配金	20円	23円	26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22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
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
第22期(2022年5月30日)	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	1.9	306,130

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2021年 5月31日	30,717	－	510,445	－	98.1	1.1
6月末	30,662	△0.2	508,662	△0.3	96.8	2.3
7月末	30,869	0.5	513,081	0.5	98.8	0.5
8月末	30,875	0.5	512,289	0.4	97.2	1.9
9月末	30,660	△0.2	508,953	△0.3	97.7	1.6
10月末	31,292	1.9	518,317	1.5	98.3	1.0
11月末	30,970	0.8	512,768	0.5	96.9	2.3
12月末	31,153	1.4	516,730	1.2	97.5	2.1
2022年 1月末	30,627	△0.3	507,460	△0.6	97.1	2.0
2月末	30,088	△2.0	500,360	△2.0	97.7	1.4
3月末	31,088	1.2	514,015	0.7	97.5	1.6
4月末	31,147	1.4	514,167	0.7	97.9	0.8
(当期末) 2022年 5月30日	30,737	0.1	509,621	△0.2	97.2	1.9

(注1)騰落率は期首比です。

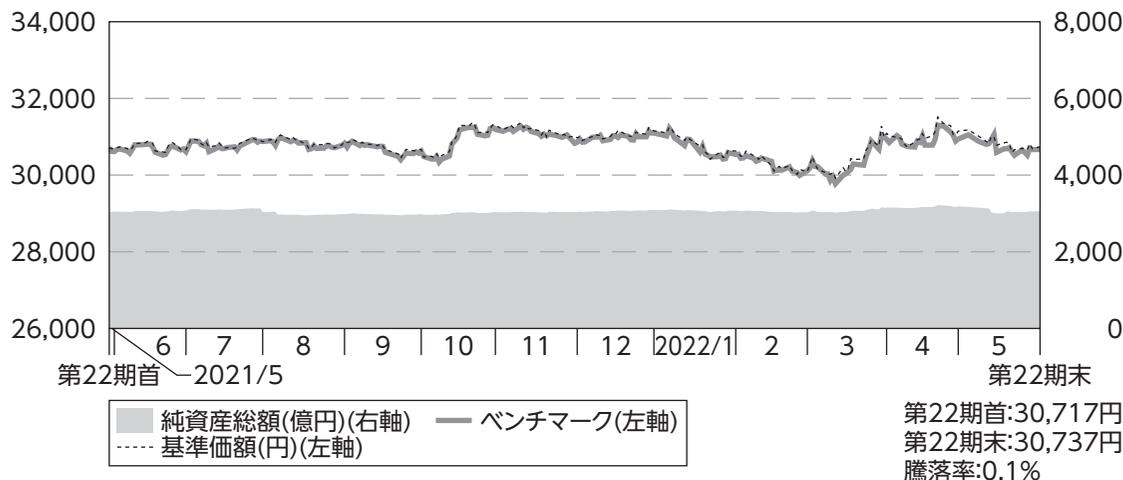
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏又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、2021年5月31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、主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬から10月上旬にかけては、FOMC(米連邦公開市場委員会)で量的金融緩和の縮小開始が示唆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、基準価額は下落しました。10月中旬には、日本の貿易収支悪化懸念から円安の動きが加速し、基準価額は上昇しました。10月下旬から12月上旬は、主要国の長期金利が低下したものの円高となり、12月中旬から2022年1月上旬は、主要国の長期金利が上昇したものの円安となったことから、基準価額はレンジ内推移となりました。1月中旬から3月中旬にかけては米国で大幅利上げへの警戒感が高まったことから主要国の長期金利が上昇して基準価額は下落しましたが、3月下旬には日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことから円売りが加速し、上昇しました。4月から5月上旬にかけて基準価額はレンジ内推移となり、以降は長期金利上昇と円安が一服したことから、緩やかに下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2021年12月上旬まで上下動しながらレンジ内での動きが続いていましたが、12月中旬以降は、米国で金融引き締めペースの加速見通しが強まったことや世界的にインフレ加速に対する警戒が続いたことから、概ね上昇推移となりました。

外国為替市場では、2022年3月上旬までは、円は主要通貨に対して円安傾向ながらレンジ内での展開が続いていましたが、3月中旬以降は、他の主要国の長期金利が大幅に上昇する中で日銀総裁が利上げの必要性を強く否定したことや資源価格高騰による日本の貿易収支悪化懸念から、主要通貨に対する円安が大幅に加速しました。

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

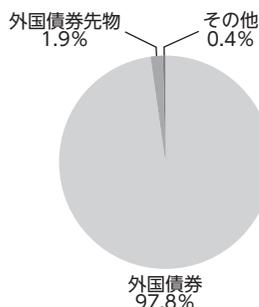
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	T 1.375% 11/15/31	アメリカ	0.7%
2	T 1.25% 08/15/31	アメリカ	0.6%
3	T 2.625% 02/15/29	アメリカ	0.6%
4	T 1.25% 09/30/28	アメリカ	0.5%
5	T 1.125% 02/15/31	アメリカ	0.5%
6	EURO-BUND 2206	ドイツ	0.5%

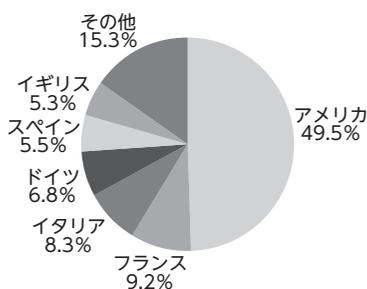
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	T 0.25% 03/15/24	アメリカ	0.5%
8	T 2% 08/15/51	アメリカ	0.5%
9	T 0.625% 05/15/30	アメリカ	0.5%
10	T 0.25% 09/30/23	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		826	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

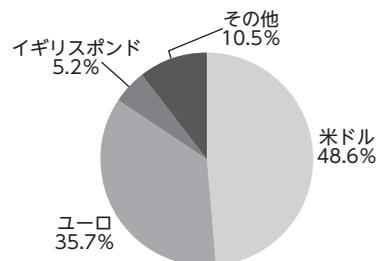
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

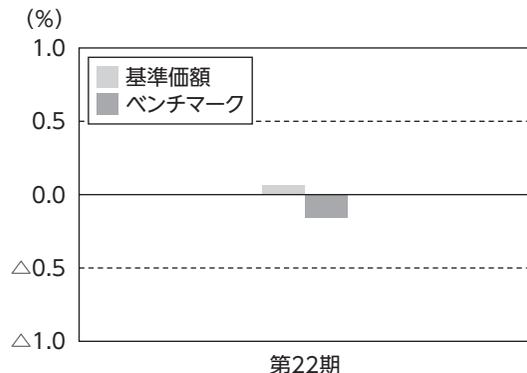


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して1.9%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、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※(プラス要因)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
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	7	0.024	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(7)	(0.023)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.001)	
合計	7	0.025	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(30,845円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 401,216	千米ドル 335,254
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 25,360	千カナダドル 26,202
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 60,029	千メキシコペソ 100,386
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 38,129	千ユーロ 42,369
	イ タ リ ア	国 債 証 券	34,105	39,020
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	33,494	38,246
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	8,355	8,221
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	22,711	24,064
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	5,598	7,602
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	6,311	7,046
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,437	2,880
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,390	3,773
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 13,005	千イギリスポンド 27,780
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 6,776	千スウェーデンクローナ 21,158
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 9,121	千ノルウェークローネ 6,550
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 8,764	千デンマーククローネ 20,425
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 10,602	千ポーランドズロチ 20,693
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 4,003	千オーストラリアドル 23,876
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 4,224	千シンガポールドル 4,350
	マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,698	千マレーシアリンギット 11,065
中 国 オ フ シ ョ ア	国 債 証 券	千オフショア人民元 268,308	千オフショア人民元 -	
イ ス ラ エ ル	国 債 証 券	千イスラエルシェケル 16,105	千イスラエルシェケル 21,192	

(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 63,854	百万円 61,561	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 35,250	百万円 131	% 0.4	百万円 35,483	百万円 351	% 1.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,117,914	30,860	2.8	1,116,764	30,326	2.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国(外貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期			末				
	額 面 金 額	評 価 額		組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
ア メ リ カ	千米ドル 1,234,970	千米ドル 1,161,808	千円 147,572,910	% 48.2	% —	% 21.4	% 17.1	% 9.7
カ ナ ダ	千カナダドル 64,950	千カナダドル 61,671	6,159,165	2.0	—	1.0	0.5	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 369,820	千メキシコペソ 355,118	2,306,634	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 142,510	千ユーロ 149,133	20,325,345	6.6	—	3.9	1.6	1.1
イ タ リ ア	180,290	181,990	24,803,426	8.1	—	4.7	2.2	1.2
フ ラ ン ス	195,640	201,735	27,494,486	9.0	—	5.4	2.5	1.1
オ ラ ン ダ	37,260	38,688	5,272,830	1.7	—	1.1	0.4	0.2
ス ペ イ ン	116,860	119,841	16,333,215	5.3	—	3.2	1.5	0.6
ベルギー	43,490	45,243	6,166,301	2.0	—	1.5	0.5	0.1
オーストリア	28,260	28,531	3,888,520	1.3	—	0.8	0.4	0.1
フィンランド	12,390	11,847	1,614,662	0.5	—	0.3	0.1	0.1
アイルランド	15,570	15,302	2,085,579	0.7	—	0.5	0.2	0.0
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 93,140	千イギリスポンド 98,476	15,794,705	5.2	—	4.0	0.7	0.5
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 62,360	千スウェーデンクローナ 62,898	813,906	0.3	—	0.1	0.1	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 58,140	千ノルウェークローネ 56,123	752,049	0.2	—	0.1	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 62,040	千デンマーククローネ 65,222	1,194,873	0.4	—	0.3	0.0	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 51,380	千ポーランドズロチ 42,924	1,281,487	0.4	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 54,440	千オーストラリアドル 50,793	4,623,245	1.5	—	1.0	0.4	0.0
シンガポール	千シンガポールドル 14,290	千シンガポールドル 14,083	1,307,226	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 50,920	千マレーシアリンギット 50,710	1,471,893	0.5	—	0.3	0.1	0.0
中国オフショア	千オフショア人民元 266,140	千オフショア人民元 270,299	5,112,008	1.7	—	0.7	0.6	0.3
イスラエル	千イスラエルシェケル 31,160	千イスラエルシェケル 31,896	1,209,741	0.4	—	0.2	0.1	0.1
合 計	—	—	297,584,217	97.2	—	51.4	29.9	15.9

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘柄	利率 (%)	期		償還年月日	
		額面金額	評価額		
			外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.125% 01/15/24	0.125	10,000	9,651	1,225,966 2024/1/15	
T 0.125% 02/15/24	0.125	4,710	4,536	576,203 2024/2/15	
T 0.125% 05/15/23	0.125	7,500	7,366	935,755 2023/5/15	
T 0.125% 05/31/23	0.125	6,800	6,670	847,254 2023/5/31	
T 0.125% 07/31/23	0.125	5,000	4,885	620,611 2023/7/31	
T 0.125% 09/15/23	0.125	8,060	7,851	997,286 2023/9/15	
T 0.125% 10/15/23	0.125	8,000	7,774	987,501 2023/10/15	
T 0.125% 12/15/23	0.125	3,250	3,144	399,406 2023/12/15	
T 0.25% 03/15/24	0.25	13,000	12,517	1,589,982 2024/3/15	
T 0.25% 05/15/24	0.25	10,000	9,583	1,217,233 2024/5/15	
T 0.25% 06/15/23	0.25	8,000	7,850	997,146 2023/6/15	
T 0.25% 06/15/24	0.25	9,000	8,603	1,092,808 2024/6/15	
T 0.25% 06/30/25	0.25	1,000	928	117,969 2025/6/30	
T 0.25% 07/31/25	0.25	5,200	4,818	612,024 2025/7/31	
T 0.25% 09/30/23	0.25	12,000	11,697	1,485,836 2023/9/30	
T 0.25% 09/30/25	0.25	7,500	6,919	878,894 2025/9/30	
T 0.25% 10/31/25	0.25	3,600	3,314	421,065 2025/10/31	
T 0.25% 11/15/23	0.25	11,000	10,687	1,357,541 2023/11/15	
T 0.375% 01/31/26	0.375	8,000	7,349	933,557 2026/1/31	
T 0.375% 04/15/24	0.375	7,000	6,736	855,693 2024/4/15	
T 0.375% 04/30/25	0.375	8,000	7,491	951,578 2025/4/30	
T 0.375% 07/15/24	0.375	9,010	8,618	1,094,693 2024/7/15	
T 0.375% 07/31/27	0.375	5,500	4,878	619,607 2027/7/31	
T 0.375% 08/15/24	0.375	5,000	4,771	606,073 2024/8/15	
T 0.375% 09/15/24	0.375	6,600	6,283	798,085 2024/9/15	
T 0.375% 09/30/27	0.375	8,000	7,059	896,721 2027/9/30	
T 0.375% 11/30/25	0.375	3,000	2,767	351,557 2025/11/30	
T 0.375% 12/31/25	0.375	4,000	3,683	467,830 2025/12/31	
T 0.5% 02/28/26	0.5	11,500	10,593	1,345,640 2026/2/28	
T 0.5% 03/31/25	0.5	7,220	6,800	863,743 2025/3/31	
T 0.5% 04/30/27	0.5	2,940	2,639	335,278 2027/4/30	
T 0.5% 05/31/27	0.5	3,500	3,135	398,254 2027/5/31	
T 0.5% 06/30/27	0.5	3,100	2,771	352,001 2027/6/30	
T 0.5% 08/31/27	0.5	4,660	4,148	526,987 2027/8/31	
T 0.5% 10/31/27	0.5	7,500	6,646	844,286 2027/10/31	
T 0.625% 03/31/27	0.625	4,500	4,072	517,288 2027/3/31	
T 0.625% 05/15/30	0.625	14,100	11,988	1,522,754 2030/5/15	
T 0.625% 07/31/26	0.625	8,000	7,338	932,168 2026/7/31	
T 0.625% 08/15/30	0.625	11,950	10,105	1,283,564 2030/8/15	
T 0.625% 11/30/27	0.625	2,500	2,227	282,991 2027/11/30	
T 0.625% 12/31/27	0.625	10,000	8,891	1,129,386 2027/12/31	
T 0.75% 01/31/28	0.75	8,500	7,599	965,292 2028/1/31	
T 0.75% 03/31/26	0.75	11,000	10,214	1,297,395 2026/3/31	
T 0.75% 04/30/26	0.75	3,000	2,781	353,343 2026/4/30	
T 0.75% 05/31/26	0.75	4,000	3,700	470,093 2026/5/31	
T 0.75% 08/31/26	0.75	11,830	10,891	1,383,432 2026/8/31	
T 0.75% 11/15/24	0.75	10,860	10,388	1,319,517 2024/11/15	
T 0.75% 12/31/23	0.75	3,370	3,288	417,732 2023/12/31	
T 0.875% 06/30/26	0.875	8,000	7,429	943,639 2026/6/30	
T 0.875% 09/30/26	0.875	6,000	5,545	704,425 2026/9/30	
T 0.875% 11/15/30	0.875	11,150	9,600	1,219,433 2030/11/15	
T 1% 07/31/28	1.0	7,000	6,293	799,427 2028/7/31	
T 1% 12/15/24	1.0	8,000	7,689	976,664 2024/12/15	
T 1.125% 01/15/25	1.125	6,800	6,546	831,480 2025/1/15	
T 1.125% 02/15/31	1.125	15,050	13,192	1,675,681 2031/2/15	

銘柄	利率 (%)	期		償還年月日	
		額面金額	評価額		
			外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)
T 1.125% 02/28/25	1.125	8,500	8,165	1,037,157 2025/2/28	
T 1.125% 02/29/28	1.125	8,000	7,302	927,563 2028/2/29	
T 1.125% 05/15/40	1.125	1,710	1,236	157,099 2040/5/15	
T 1.125% 08/15/40	1.125	7,300	5,245	666,313 2040/8/15	
T 1.125% 08/31/28	1.125	10,210	9,242	1,173,924 2028/8/31	
T 1.25% 03/31/28	1.25	5,150	4,726	600,338 2028/3/31	
T 1.25% 04/30/28	1.25	8,000	7,333	931,532 2028/4/30	
T 1.25% 05/15/50	1.25	8,650	5,721	726,702 2050/5/15	
T 1.25% 05/31/28	1.25	8,000	7,326	930,619 2028/5/31	
T 1.25% 06/30/28	1.25	9,500	8,685	1,103,272 2028/6/30	
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,504	572,218 2023/7/31	
T 1.25% 08/15/31	1.25	16,120	14,179	1,801,055 2031/8/15	
T 1.25% 09/30/28	1.25	14,500	13,212	1,678,259 2028/9/30	
T 1.25% 11/30/26	1.25	7,000	6,563	833,638 2026/11/30	
T 1.25% 12/31/26	1.25	7,130	6,675	847,681 2026/12/31	
T 1.375% 01/31/25	1.375	4,000	3,872	491,884 2025/1/31	
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,962	630,324 2023/6/30	
T 1.375% 08/15/50	1.375	9,900	6,767	859,617 2050/8/15	
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,475	314,442 2023/8/31	
T 1.375% 09/30/23	1.375	4,000	3,957	502,691 2023/9/30	
T 1.375% 11/15/31	1.375	18,030	15,983	2,030,200 2031/11/15	
T 1.375% 11/15/40	1.375	6,000	4,496	571,113 2040/11/15	
T 1.375% 12/31/28	1.375	4,900	4,491	570,563 2028/12/31	
T 1.5% 01/31/27	1.5	6,000	5,676	720,977 2027/1/31	
T 1.5% 02/15/30	1.5	6,470	5,922	752,221 2030/2/15	
T 1.5% 08/15/26	1.5	7,500	7,131	905,836 2026/8/15	
T 1.5% 09/30/24	1.5	8,500	8,299	1,054,238 2024/9/30	
T 1.5% 11/30/28	1.5	7,500	6,928	880,010 2028/11/30	
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,787	989,194 2026/2/15	
T 1.625% 05/15/26	1.625	2,270	2,177	276,587 2026/5/15	
T 1.625% 05/15/31	1.625	11,150	10,170	1,291,906 2031/5/15	
T 1.625% 05/31/23	1.625	1,000	995	126,481 2023/5/31	
T 1.625% 08/15/29	1.625	6,750	6,263	795,626 2029/8/15	
T 1.625% 10/31/23	1.625	2,500	2,479	314,883 2023/10/31	
T 1.625% 10/31/26	1.625	2,800	2,671	339,276 2026/10/31	
T 1.625% 11/15/50	1.625	6,900	5,042	640,484 2050/11/15	
T 1.625% 11/30/26	1.625	4,780	4,558	578,979 2026/11/30	
T 1.75% 05/15/23	1.75	3,690	3,680	467,504 2023/5/15	
T 1.75% 06/30/24	1.75	2,400	2,364	300,394 2024/6/30	
T 1.75% 08/15/41	1.75	14,500	11,494	1,460,050 2041/8/15	
T 1.75% 11/15/29	1.75	3,000	2,805	356,291 2029/11/15	
T 1.875% 02/15/41	1.875	7,900	6,453	819,699 2041/2/15	
T 1.875% 02/15/51	1.875	6,600	5,138	652,654 2051/2/15	
T 1.875% 02/28/27	1.875	4,000	3,849	488,927 2027/2/28	
T 1.875% 07/31/26	1.875	5,190	5,019	637,576 2026/7/31	
T 1.875% 08/31/24	1.875	6,000	5,913	751,194 2024/8/31	
T 1.875% 11/15/51	1.875	9,300	7,243	920,111 2051/11/15	
T 2% 02/15/25	2.0	8,460	8,324	1,057,420 2025/2/15	
T 2% 02/15/50	2.0	5,000	4,021	510,858 2050/2/15	
T 2% 04/30/24	2.0	6,230	6,179	784,982 2024/4/30	
T 2% 05/31/24	2.0	3,310	3,281	416,765 2024/5/31	
T 2% 06/30/24	2.0	5,500	5,446	691,842 2024/6/30	
T 2% 08/15/25	2.0	6,890	6,747	857,014 2025/8/15	
T 2% 08/15/51	2.0	15,150	12,151	1,543,541 2051/8/15	
T 2% 11/15/26	2.0	10,220	9,897	1,257,171 2026/11/15	
T 2% 11/15/41	2.0	5,700	4,717	599,234 2041/11/15	
T 2.125% 02/29/24	2.125	5,100	5,078	645,031 2024/2/29	

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,363	935,321	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	2,400	2,364	300,370	2025/5/15
T 2.125% 05/31/26	2.125	3,600	3,519	447,108	2026/5/31
T 2.125% 07/31/24	2.125	4,800	4,763	605,004	2024/7/31
T 2.125% 09/30/24	2.125	5,000	4,952	629,071	2024/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,680	2,674	339,715	2023/11/30
T 2.25% 01/31/24	2.25	4,000	3,993	507,216	2024/1/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	8,950	8,753	1,111,916	2027/2/15
T 2.25% 02/15/52	2.25	2,300	1,965	249,670	2052/2/15
T 2.25% 03/31/26	2.25	7,500	7,375	936,834	2026/3/31
T 2.25% 04/30/24	2.25	7,000	6,976	886,153	2024/4/30
T 2.25% 05/15/41	2.25	6,460	5,598	711,121	2041/5/15
T 2.25% 08/15/27	2.25	8,550	8,338	1,059,125	2027/8/15
T 2.25% 08/15/46	2.25	4,190	3,510	445,895	2046/8/15
T 2.25% 08/15/49	2.25	5,500	4,687	595,401	2049/8/15
T 2.25% 10/31/24	2.25	6,300	6,252	794,255	2024/10/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,067	1,278,828	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	4,400	4,335	550,744	2025/11/15
T 2.25% 11/15/27	2.25	7,650	7,451	946,499	2027/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	4,500	4,496	571,121	2023/12/31
T 2.25% 12/31/24	2.25	5,400	5,352	679,933	2024/12/31
T 2.375% 02/29/24	2.375	5,760	5,761	731,778	2024/2/29
T 2.375% 04/30/26	2.375	2,600	2,568	326,291	2026/4/30
T 2.375% 05/15/27	2.375	2,690	2,643	335,757	2027/5/15
T 2.375% 05/15/29	2.375	8,010	7,812	992,312	2029/5/15
T 2.375% 05/15/51	2.375	5,050	4,429	562,672	2051/5/15
T 2.375% 08/15/24	2.375	5,000	4,984	633,115	2024/8/15
T 2.375% 11/15/49	2.375	6,100	5,345	678,998	2049/11/15
T 2.5% 01/31/24	2.5	3,470	3,477	441,766	2024/1/31
T 2.5% 01/31/25	2.5	5,000	4,984	633,164	2025/1/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	1,710	1,506	191,360	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	4,000	3,524	447,705	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	7,900	7,909	1,004,692	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	5,050	4,447	564,927	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,570	580,514	2023/8/15
T 2.625% 01/31/26	2.625	4,690	4,677	594,118	2026/1/31
T 2.625% 02/15/29	2.625	13,340	13,213	1,678,428	2029/2/15
T 2.625% 03/31/25	2.625	7,250	7,251	921,038	2025/3/31
T 2.625% 06/30/23	2.625	4,900	4,928	626,032	2023/6/30
T 2.625% 12/31/23	2.625	3,500	3,518	446,905	2023/12/31
T 2.625% 12/31/25	2.625	5,820	5,807	737,610	2025/12/31
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,019	383,493	2024/2/15
T 2.75% 02/15/28	2.75	6,550	6,544	831,298	2028/2/15
T 2.75% 05/31/23	2.75	3,880	3,906	496,206	2023/5/31
T 2.75% 06/30/25	2.75	5,500	5,516	700,683	2025/6/30
T 2.75% 07/31/23	2.75	1,000	1,007	127,977	2023/7/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	1,300	1,211	153,876	2042/8/15
T 2.75% 08/15/47	2.75	4,050	3,754	476,893	2047/8/15
T 2.75% 08/31/23	2.75	1,500	1,511	191,947	2023/8/31
T 2.75% 08/31/25	2.75	6,900	6,915	878,457	2025/8/31
T 2.75% 11/15/23	2.75	2,320	2,336	296,838	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	3,920	3,646	463,141	2042/11/15
T 2.75% 11/15/47	2.75	3,050	2,834	359,989	2047/11/15
T 2.875% 04/30/25	2.875	4,000	4,025	511,295	2025/4/30
T 2.875% 05/15/28	2.875	7,260	7,297	926,920	2028/5/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	4,150	3,934	499,746	2043/5/15
T 2.875% 05/15/49	2.875	5,570	5,388	684,452	2049/5/15
T 2.875% 05/31/25	2.875	3,820	3,845	488,438	2025/5/31
T 2.875% 07/31/25	2.875	5,460	5,496	698,107	2025/7/31

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価 額	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
T 2.875% 08/15/28	2.875	3,920	3,938	500,213	2028/8/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	2,300	2,167	275,370	2045/8/15
T 2.875% 09/30/23	2.875	4,750	4,792	608,801	2023/9/30
T 2.875% 10/31/23	2.875	7,900	7,972	1,012,630	2023/10/31
T 2.875% 11/15/46	2.875	2,500	2,363	300,233	2046/11/15
T 2.875% 11/30/23	2.875	4,020	4,056	515,277	2023/11/30
T 2.875% 11/30/25	2.875	7,500	7,544	958,306	2025/11/30
T 3% 02/15/47	3.0	800	774	98,376	2047/2/15
T 3% 02/15/48	3.0	4,450	4,346	552,305	2048/2/15
T 3% 02/15/49	3.0	5,000	4,942	627,855	2049/2/15
T 3% 05/15/42	3.0	1,620	1,576	200,226	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	2,500	2,406	305,666	2045/5/15
T 3% 05/15/47	3.0	3,210	3,108	394,865	2047/5/15
T 3% 08/15/48	3.0	5,450	5,346	679,116	2048/8/15
T 3% 09/30/25	3.0	4,200	4,243	538,985	2025/9/30
T 3% 10/31/25	3.0	5,000	5,050	641,475	2025/10/31
T 3% 11/15/44	3.0	2,800	2,694	342,263	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,050	1,043	132,495	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	2,000	1,974	250,824	2043/2/15
T 3.125% 05/15/48	3.125	5,930	5,948	755,641	2048/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	4,140	4,071	517,153	2044/8/15
T 3.125% 11/15/28	3.125	8,400	8,564	1,087,890	2028/11/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	1,750	1,741	221,190	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	3,010	3,083	391,649	2044/5/15
T 3.375% 11/15/48	3.375	5,300	5,587	709,758	2048/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	770	826	104,949	2039/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	2,400	2,555	324,544	2044/2/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,130	270,631	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	2,000	2,172	275,990	2041/8/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	3,000	3,256	413,688	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,450	1,611	204,683	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,055	134,118	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	2,350	2,731	346,979	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,191	151,391	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,294	286,306	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,950	2,258	291,905	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,960	3,516	446,622	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,090	1,312	166,715	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	550	664	84,378	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	1,700	2,053	260,807	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	1,380	1,689	214,576	2040/2/15
T 4.75% 02/15/41	4.75	750	928	117,949	2041/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,390	176,671	2037/5/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,489	189,230	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,950	2,345	297,923	2031/2/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	1,897	240,977	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,694	215,259	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,050	1,313	166,828	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	1,732	220,021	2023/8/15
小 計				147,572,910	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 03/01/26	0.25	2,280	2,090	208,797	2026/3/1
CAN 0.25% 04/01/24	0.25	2,400	2,303	230,069	2024/4/1
CAN 0.25% 05/01/23	0.25	2,600	2,549	254,663	2023/5/1
CAN 0.25% 08/01/23	0.25	1,360	1,326	132,435	2023/8/1
CAN 0.5% 09/01/25	0.5	2,480	2,320	231,717	2025/9/1
CAN 0.5% 12/01/30	0.5	2,590	2,145	214,263	2030/12/1
CAN 0.75% 02/01/24	0.75	1,300	1,262	126,121	2024/2/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
CAN 0.75% 10/01/24	0.75	700	671	67,069	2024/10/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	810	749	74,820	2027/6/1
CAN 1% 09/01/26	1.0	1,530	1,431	142,965	2026/9/1
CAN 1.25% 03/01/25	1.25	1,440	1,390	138,832	2025/3/1
CAN 1.25% 03/01/27	1.25	2,980	2,797	279,362	2027/3/1
CAN 1.25% 06/01/30	1.25	3,620	3,230	322,599	2030/6/1
CAN 1.5% 05/01/24	1.5	490	480	47,982	2024/5/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,070	1,060	105,892	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,360	1,304	130,316	2026/6/1
CAN 1.5% 06/01/31	1.5	3,970	3,565	356,125	2031/6/1
CAN 1.5% 09/01/24	1.5	1,200	1,172	117,143	2024/9/1
CAN 1.5% 12/01/31	1.5	4,170	3,724	371,926	2031/12/1
CAN 1.75% 12/01/53	1.75	1,830	1,431	142,965	2053/12/1
CAN 2% 06/01/28	2.0	1,310	1,263	126,165	2028/6/1
CAN 2% 06/01/32	2.0	1,290	1,199	119,834	2032/6/1
CAN 2% 09/01/23	2.0	3,460	3,441	343,694	2023/9/1
CAN 2% 12/01/51	2.0	4,710	3,959	395,436	2051/12/1
CAN 2.25% 03/01/24	2.25	2,300	2,290	228,798	2024/3/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,800	1,784	178,225	2025/6/1
CAN 2.25% 06/01/29	2.25	1,260	1,224	122,302	2029/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,330	1,329	132,777	2024/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,650	1,626	162,468	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	760	743	74,253	2064/12/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,300	1,438	143,629	2045/12/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,050	1,216	121,477	2041/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	420	526	52,539	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,170	1,396	139,447	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	960	1,222	122,042	2033/6/1
小 計				6,159,165	
(メキシコ)					
国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	8,550	9,578	62,216	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,560	31,259	203,043	2024/12/5
MBONO 5% 03/06/25	5.0	3,700	3,345	21,731	2025/3/6
MBONO 5.5% 03/04/27	5.5	12,500	10,952	71,137	2027/3/4
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	47,710	43,077	279,804	2026/3/5
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	38,910	37,190	241,570	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	35,980	34,318	222,909	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	24,040	21,796	141,574	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	10,600	9,984	64,850	2034/11/23
MBONO 8% 09/05/24	8.0	34,470	33,794	219,508	2024/9/5
MBONO 8% 11/07/47	8.0	28,400	26,256	170,547	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	29,070	28,706	186,461	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	38,660	38,526	250,245	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	26,670	26,331	171,033	2038/11/18
小 計				2,306,634	
(ドイツ)					
国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BKO 0% 06/16/23	—	1,090	1,090	148,683	2023/6/16
BKO 0% 09/15/23	—	3,150	3,149	429,266	2023/9/15
BKO 0% 12/15/23	—	1,880	1,879	256,163	2023/12/15
DBR 0% 02/15/30	—	2,470	2,319	316,192	2030/2/15
DBR 0% 02/15/31	—	3,120	2,891	394,094	2031/2/15
DBR 0% 02/15/32	—	2,790	2,542	346,559	2032/2/15
DBR 0% 05/15/35	—	2,260	1,954	266,411	2035/5/15
DBR 0% 05/15/36	—	3,380	2,880	392,523	2036/5/15
DBR 0% 08/15/26	—	4,350	4,248	579,018	2026/8/15
DBR 0% 08/15/29	—	3,500	3,306	450,612	2029/8/15
DBR 0% 08/15/30	—	4,190	3,911	533,085	2030/8/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評 価	額	償還年月日
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
DBR 0% 08/15/30	—	670	626	85,386	2030/8/15
DBR 0% 08/15/31	—	3,450	3,172	432,368	2031/8/15
DBR 0% 08/15/50	—	4,420	3,142	428,307	2050/8/15
DBR 0% 08/15/52	—	1,260	868	118,378	2052/8/15
DBR 0% 11/15/27	—	2,960	2,851	388,612	2027/11/15
DBR 0% 11/15/28	—	2,500	2,383	324,806	2028/11/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	3,890	3,825	521,362	2027/2/15
DBR 0.25% 02/15/29	0.25	3,080	2,977	405,849	2029/2/15
DBR 0.25% 08/15/28	0.25	2,630	2,553	347,986	2028/8/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	3,080	3,089	421,053	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	3,000	2,998	408,604	2026/2/15
DBR 0.5% 02/15/28	0.5	3,680	3,636	495,603	2028/2/15
DBR 0.5% 08/15/27	0.5	1,940	1,922	262,046	2027/8/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	2,000	2,029	276,606	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,640	3,702	504,613	2025/8/15
DBR 1.25% 08/15/48	1.25	3,580	3,631	494,871	2048/8/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	3,020	3,065	417,794	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	2,290	2,345	319,728	2024/5/15
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,650	1,695	231,015	2024/2/15
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,860	2,931	399,530	2023/8/15
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	3,360	4,226	575,994	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	3,810	4,894	667,058	2046/8/15
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	2,230	3,048	415,504	2042/7/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,930	4,060	553,415	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	2,150	3,170	432,153	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	2,550	3,167	431,633	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,990	4,258	684,371	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,480	3,913	533,305	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,840	3,933	536,102	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	2,360	3,001	409,109	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	3,230	3,551	484,000	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,250	1,751	238,735	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	980	1,266	172,548	2027/7/4
OBL 0% 04/05/24	—	3,330	3,316	452,309	2024/4/5
OBL 0% 04/10/26	—	3,070	3,007	409,924	2026/4/10
OBL 0% 04/11/25	—	3,750	3,705	505,072	2025/4/11
OBL 0% 04/16/27	—	1,100	1,065	145,211	2027/4/16
OBL 0% 10/09/26	—	2,900	2,824	384,933	2026/10/9
OBL 0% 10/10/25	—	3,500	3,444	469,497	2025/10/10
OBL 0% 10/13/23	—	1,510	1,510	205,886	2023/10/13
OBL 0% 10/18/24	—	2,410	2,389	325,709	2024/10/18
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0% 01/15/24	—	1,000	986	134,475	2024/1/15
BTPS 0% 01/30/24	—	940	927	126,384	2024/1/30
BTPS 0% 04/01/26	—	1,460	1,362	185,735	2026/4/1
BTPS 0% 04/15/24	—	3,000	2,944	381,508	2024/4/15
BTPS 0% 08/01/26	—	2,580	2,389	325,607	2026/8/1
BTPS 0% 08/15/24	—	1,500	1,461	199,225	2024/8/15
BTPS 0% 12/15/24	—	2,900	2,799	381,502	2024/12/15
BTPS 0.25% 03/15/28	0.25	1,680	1,503	204,934	2028/3/15
BTPS 0.3% 08/15/23	0.3	2,900	2,896	394,822	2023/8/15
BTPS 0.35% 02/01/25	0.35	580	564	76,983	2025/2/1
BTPS 0.45% 02/15/29	0.45	2,070	1,820	248,059	2029/2/15
BTPS 0.5% 02/01/26	0.5	1,910	1,829	249,357	2026/2/1
BTPS 0.5% 07/15/28	0.5	2,280	2,052	279,685	2028/7/15
BTPS 0.6% 06/15/23	0.6	1,110	1,114	151,838	2023/6/15
BTPS 0.6% 08/01/31	0.6	3,160	2,599	354,231	2031/8/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	670	671	91,483	2023/10/15

銘	柄	利 率 (%)	期 末			
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
BTPS 0.85% 01/15/27	0.85	2,250	2,144	292,291	2027/1/15	
BTPS 0.9% 04/01/31	0.9	2,230	1,903	259,443	2031/4/1	
BTPS 0.95% 03/01/37	0.95	1,020	767	104,620	2037/3/1	
BTPS 0.95% 06/01/32	0.95	2,550	2,125	289,726	2032/6/1	
BTPS 0.95% 08/01/30	0.95	2,230	1,952	266,072	2030/8/1	
BTPS 0.95% 09/15/27	0.95	2,380	2,248	306,468	2027/9/15	
BTPS 0.95% 12/01/31	0.95	2,140	1,805	246,074	2031/12/1	
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,950	1,898	258,799	2026/12/1	
BTPS 1.35% 04/01/30	1.35	1,940	1,773	241,708	2030/4/1	
BTPS 1.45% 03/01/36	1.45	1,700	1,400	190,940	2036/3/1	
BTPS 1.45% 05/15/25	1.45	2,300	2,296	312,937	2025/5/15	
BTPS 1.45% 11/15/24	1.45	2,400	2,407	328,083	2024/11/15	
BTPS 1.5% 04/30/45	1.5	1,250	913	124,460	2045/4/30	
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	2,410	2,412	328,751	2025/6/1	
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	2,830	2,812	383,301	2026/6/1	
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	3,010	2,713	369,837	2032/3/1	
BTPS 1.65% 12/01/30	1.65	2,540	2,337	318,565	2030/12/1	
BTPS 1.7% 09/01/51	1.7	1,680	1,190	162,262	2051/9/1	
BTPS 1.75% 07/01/24	1.75	1,000	1,012	137,978	2024/7/1	
BTPS 1.8% 03/01/41	1.8	2,260	1,816	247,545	2041/3/1	
BTPS 1.85% 05/15/24	1.85	2,450	2,489	339,326	2024/5/15	
BTPS 1.85% 07/01/25	1.85	2,700	2,723	371,224	2025/7/1	
BTPS 2% 02/01/28	2.0	2,260	2,246	306,111	2028/2/1	
BTPS 2% 12/01/25	2.0	2,090	2,116	288,415	2025/12/1	
BTPS 2.05% 08/01/27	2.05	2,740	2,741	373,572	2027/8/1	
BTPS 2.1% 07/15/26	2.1	3,200	3,236	441,104	2026/7/15	
BTPS 2.15% 03/01/72	2.15	730	524	71,506	2072/3/1	
BTPS 2.15% 09/01/52	2.15	920	713	97,258	2052/9/1	
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	2,280	2,303	314,003	2027/6/1	
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,840	1,672	227,938	2036/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/33	2.45	2,640	2,522	343,851	2033/9/1	
BTPS 2.45% 09/01/50	2.45	1,810	1,532	208,806	2050/9/1	
BTPS 2.45% 10/01/23	2.45	2,910	2,984	406,721	2023/10/1	
BTPS 2.5% 11/15/25	2.5	2,950	3,035	413,703	2025/11/15	
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,950	3,037	413,988	2024/12/1	
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,210	2,023	275,803	2047/3/1	
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	1,130	984	134,236	2067/3/1	
BTPS 2.8% 12/01/28	2.8	3,190	3,289	448,325	2028/12/1	
BTPS 2.95% 09/01/38	2.95	2,050	2,012	274,222	2038/9/1	
BTPS 3% 08/01/29	3.0	3,360	3,483	474,823	2029/8/1	
BTPS 3.1% 03/01/40	3.1	1,420	1,407	191,790	2040/3/1	
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,950	1,967	268,213	2046/9/1	
BTPS 3.35% 03/01/35	3.35	1,820	1,885	256,989	2035/3/1	
BTPS 3.45% 03/01/48	3.45	2,120	2,195	299,171	2048/3/1	
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	3,960	4,246	578,745	2030/3/1	
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	2,150	2,274	309,942	2024/9/1	
BTPS 3.85% 09/01/49	3.85	1,860	2,046	278,917	2049/9/1	
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,550	3,947	537,945	2037/2/1	
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,750	2,926	398,863	2024/3/1	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,080	2,297	313,172	2026/3/1	
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	3,580	3,720	507,068	2023/5/1	
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	3,838	523,087	2023/8/1	
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,630	3,011	410,499	2028/9/1	
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	2,100	2,607	355,411	2044/9/1	
BTPS 5% 03/01/25	5.0	3,660	4,022	548,219	2025/3/1	
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,970	3,600	490,764	2034/8/1	
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,240	2,811	383,187	2040/9/1	
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	3,000	3,739	509,627	2039/8/1	
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,560	4,262	580,896	2029/11/1	

銘	柄	利 率 (%)	期 末			
			額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,280	2,881	392,692	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	2,940	3,714	506,243	2031/5/1	
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,600	4,432	604,159	2027/11/1	
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	1,726	235,326	2026/11/1	
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	895	122,005	2023/11/1	
(フランス)						
国債証券						
FRTR 0% 02/25/24	—	4,850	4,832	658,613	2024/2/25	
FRTR 0% 02/25/25	—	2,050	2,016	274,790	2025/2/25	
FRTR 0% 02/25/26	—	5,210	5,067	690,629	2026/2/25	
FRTR 0% 02/25/27	—	3,560	3,413	465,192	2027/2/25	
FRTR 0% 03/25/24	—	3,750	3,730	508,414	2024/3/25	
FRTR 0% 03/25/25	—	6,390	6,286	856,845	2025/3/25	
FRTR 0% 05/25/32	—	1,970	1,701	231,957	2032/5/25	
FRTR 0% 11/25/29	—	5,260	4,815	656,351	2029/11/25	
FRTR 0% 11/25/30	—	6,040	5,412	737,604	2030/11/25	
FRTR 0% 11/25/31	—	4,990	4,570	595,606	2031/11/25	
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	4,680	4,356	621,011	2026/11/25	
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	5,590	5,571	759,369	2025/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	6,690	6,617	901,859	2026/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/29	0.5	5,350	5,131	699,336	2029/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/40	0.5	3,160	2,497	340,363	2040/5/25	
FRTR 0.5% 05/25/72	0.5	990	505	68,870	2072/5/25	
FRTR 0.5% 06/25/44	0.5	1,980	1,474	200,979	2044/6/25	
FRTR 0.75% 05/25/28	0.75	6,290	6,194	844,233	2028/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/52	0.75	3,350	2,387	325,275	2052/5/25	
FRTR 0.75% 05/25/53	0.75	2,060	1,438	196,047	2053/5/25	
FRTR 0.75% 11/25/28	0.75	5,850	5,738	782,068	2028/11/25	
FRTR 1% 05/25/27	1.0	4,650	4,671	636,676	2027/5/25	
FRTR 1% 11/25/25	1.0	5,320	5,335	727,231	2025/11/25	
FRTR 1.25% 05/25/34	1.25	4,090	3,919	534,147	2034/5/25	
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	5,130	4,819	656,812	2036/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	6,770	6,880	937,769	2031/5/25	
FRTR 1.5% 05/25/50	1.5	3,590	3,202	436,497	2050/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,380	5,470	745,536	2023/5/25	
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	1,780	1,614	220,066	2066/5/25	
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	3,320	3,314	451,727	2039/6/25	
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,160	4,289	584,633	2024/11/25	
FRTR 2% 05/25/48	2.0	3,560	3,571	486,706	2048/5/25	
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,100	4,253	579,648	2024/5/25	
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	7,180	7,899	1,076,653	2030/5/25	
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	5,110	5,600	763,251	2027/10/25	
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,400	4,221	575,340	2045/5/25	
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	5,050	5,589	761,736	2026/4/25	
FRTR 4% 04/25/55	4.0	2,420	3,507	478,066	2055/4/25	
FRTR 4% 04/25/60	4.0	2,030	3,029	412,822	2060/4/25	
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,370	4,437	604,738	2038/10/25	
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,650	5,980	815,070	2023/10/25	
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	4,520	6,363	867,346	2041/4/25	
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,630	4,942	673,618	2035/4/25	
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	5,170	6,685	911,164	2029/4/25	
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	4,340	6,135	836,189	2032/10/25	
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	1,900	2,241	305,512	2025/10/25	
(オランダ)						
国債証券						
NETHER 0% 01/15/24	—	2,230	2,224	303,109	2024/1/15	
NETHER 0% 01/15/26	—	790	770	104,999	2026/1/15	
NETHER 0% 01/15/27	—	1,840	1,774	241,871	2027/1/15	
NETHER 0% 01/15/29	—	1,390	1,300	177,218	2029/1/15	

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
NETHER 0% 01/15/38	—	960	759	103,546	2038/1/15	
NETHER 0% 01/15/52	—	1,490	970	132,283	2052/1/15	
NETHER 0% 07/15/30	—	1,500	1,374	187,376	2030/7/15	
NETHER 0% 07/15/31	—	1,820	1,643	224,026	2031/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	2,310	2,287	311,794	2025/7/15	
NETHER 0.25% 07/15/29	0.25	1,570	1,488	202,810	2029/7/15	
NETHER 0.5% 01/15/40	0.5	1,040	877	119,628	2040/1/15	
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	2,320	2,302	313,783	2026/7/15	
NETHER 0.5% 07/15/32	0.5	700	650	88,655	2032/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	1,560	1,554	211,919	2027/7/15	
NETHER 0.75% 07/15/28	0.75	1,700	1,683	229,482	2028/7/15	
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,540	1,571	214,222	2023/7/15	
NETHER 2% 07/15/24	2.0	1,990	2,059	280,685	2024/7/15	
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	2,020	2,263	308,452	2033/1/15	
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	2,330	2,963	403,870	2047/1/15	
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	2,250	3,096	422,045	2042/1/15	
NETHER 4% 01/15/37	4.0	2,180	2,900	395,254	2037/1/15	
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,730	2,170	295,792	2028/1/15	
(スペイン)						
国債証券						
SPGB 0% 01/31/25	—	2,280	2,230	304,047	2025/1/31	
SPGB 0% 01/31/26	—	2,720	2,613	356,154	2026/1/31	
SPGB 0% 01/31/27	—	1,560	1,469	200,210	2027/1/31	
SPGB 0% 01/31/28	—	1,930	1,782	242,975	2028/1/31	
SPGB 0% 04/30/23	—	1,630	1,629	222,134	2023/4/30	
SPGB 0% 05/31/24	—	2,110	2,086	284,420	2024/5/31	
SPGB 0.1% 04/30/31	0.1	3,180	2,721	370,974	2031/4/30	
SPGB 0.25% 07/30/24	0.25	2,290	2,271	309,541	2024/7/30	
SPGB 0.35% 07/30/23	0.35	3,590	3,599	490,607	2023/7/30	
SPGB 0.5% 04/30/30	0.5	3,400	3,105	423,196	2030/4/30	
SPGB 0.5% 10/31/31	0.5	1,960	1,717	234,012	2031/10/31	
SPGB 0.6% 10/31/29	0.6	2,950	2,743	373,891	2029/10/31	
SPGB 0.7% 04/30/32	0.7	2,200	1,939	264,304	2032/4/30	
SPGB 0.8% 07/30/27	0.8	2,440	2,374	323,635	2027/7/30	
SPGB 0.85% 07/30/37	0.85	1,460	1,172	159,733	2037/7/30	
SPGB 1% 07/30/42	1.0	650	498	67,899	2042/7/30	
SPGB 1% 10/31/50	1.0	2,470	1,665	227,027	2050/10/31	
SPGB 1.2% 10/31/40	1.2	2,260	1,831	249,547	2040/10/31	
SPGB 1.25% 10/31/30	1.25	3,050	2,927	398,928	2030/10/31	
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,750	2,768	377,327	2026/10/31	
SPGB 1.4% 04/30/28	1.4	3,070	3,067	418,033	2028/4/30	
SPGB 1.4% 07/30/28	1.4	3,570	3,559	485,163	2028/7/30	
SPGB 1.45% 04/30/29	1.45	2,690	2,672	364,295	2029/4/30	
SPGB 1.45% 10/31/27	1.45	3,040	3,055	416,405	2027/10/31	
SPGB 1.45% 10/31/71	1.45	660	411	56,085	2071/10/31	
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	2,650	2,677	364,946	2027/4/30	
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	3,050	3,113	424,401	2025/4/30	
SPGB 1.85% 07/30/35	1.85	2,750	2,625	357,890	2035/7/30	
SPGB 1.9% 10/31/52	1.9	900	740	100,897	2052/10/31	
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,810	2,899	395,210	2026/4/30	
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	1,990	2,024	275,852	2030/7/30	
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	2,810	2,922	398,309	2025/10/31	
SPGB 2.35% 07/30/33	2.35	2,440	2,501	340,954	2033/7/30	
SPGB 2.7% 10/31/48	2.7	1,850	1,886	257,131	2048/10/31	
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	3,050	3,202	436,468	2024/10/31	
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	2,200	2,338	318,655	2046/10/31	
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	1,780	1,991	271,421	2066/7/30	
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,520	2,677	364,950	2024/4/30	
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,530	3,135	427,272	2037/1/31	

当		期				末
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額			償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日	
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	2,690	2,845	387,803	2023/10/31	
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,840	3,169	431,986	2025/7/30	
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	2,240	3,023	412,400	2041/7/30	
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	2,400	2,574	350,934	2024/1/31	
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	2,250	3,089	421,055	2040/7/30	
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,490	4,272	582,321	2028/10/31	
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,740	2,536	345,721	2044/10/31	
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,860	3,862	526,379	2032/7/30	
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	2,060	2,462	335,566	2026/7/30	
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,353	184,487	2029/1/31	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB 0% 10/22/27	—	430	409	55,791	2027/10/22	
BGB 0% 10/22/31	—	1,680	1,466	199,874	2031/10/22	
BGB 0.1% 06/22/30	0.1	1,370	1,248	170,202	2030/6/22	
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	1,030	1,032	140,714	2023/10/22	
BGB 0.35% 06/22/32	0.35	480	426	58,155	2032/6/22	
BGB 0.4% 06/22/40	0.4	1,240	940	128,203	2040/6/22	
BGB 0.5% 10/22/24	0.5	1,620	1,621	220,984	2024/10/22	
BGB 0.65% 06/22/71	0.65	640	342	46,726	2071/6/22	
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	2,680	2,694	367,273	2025/6/22	
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	1,690	1,682	229,337	2027/6/22	
BGB 0.8% 06/22/28	0.8	1,260	1,245	169,796	2028/6/22	
BGB 0.9% 06/22/29	0.9	1,560	1,535	209,208	2029/6/22	
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,280	2,301	313,277	2026/6/22	
BGB 1% 06/22/31	1.0	2,770	2,680	365,374	2031/6/22	
BGB 1.25% 04/22/33	1.25	1,500	1,465	199,771	2033/4/22	
BGB 1.4% 06/22/53	1.4	610	502	68,507	2053/6/22	
BGB 1.45% 06/22/37	1.45	800	755	102,910	2037/6/22	
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	1,240	1,114	151,856	2047/6/22	
BGB 1.7% 06/22/50	1.7	1,300	1,176	160,368	2050/6/22	
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	1,050	1,048	142,941	2038/6/22	
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	780	767	104,661	2066/6/22	
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,180	1,208	164,661	2023/6/22	
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	770	784	106,922	2057/6/22	
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,239	305,170	2024/6/22	
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,030	1,180	160,866	2034/6/22	
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,200	1,566	213,503	2045/6/22	
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,080	1,331	181,434	2032/3/28	
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	1,870	2,509	342,065	2041/3/28	
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,140	1,305	177,978	2026/3/28	
BGB 5% 03/28/35	5.0	2,290	3,149	429,296	2035/3/28	
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,780	3,507	478,014	2028/3/28	
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB 0% 02/20/30	—	1,450	1,311	178,783	2030/2/20	
RAGB 0% 02/20/31	—	1,640	1,453	198,110	2031/2/20	
RAGB 0% 04/20/25	—	930	914	124,622	2025/4/20	
RAGB 0% 07/15/23	—	1,120	1,120	152,760	2023/7/15	
RAGB 0% 07/15/24	—	1,440	1,430	194,985	2024/7/15	
RAGB 0% 10/20/40	—	670	477	65,042	2040/10/20	
RAGB 0.25% 10/20/36	0.25	600	486	66,246	2036/10/20	
RAGB 0.5% 02/20/29	0.5	1,770	1,693	230,836	2029/2/20	
RAGB 0.5% 04/20/27	0.5	1,090	1,071	146,024	2027/4/20	
RAGB 0.7% 04/20/71	0.7	440	266	36,307	2071/4/20	
RAGB 0.75% 02/20/28	0.75	1,210	1,193	162,608	2028/2/20	
RAGB 0.75% 03/20/51	0.75	780	592	80,727	2051/3/20	
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,080	2,076	282,958	2026/10/20	
RAGB 0.85% 06/30/20	0.85	330	167	22,880	2120/6/30	

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
RAGB 0.9% 02/20/32	0.9	510	482	65,737	2032/2/20
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,070	1,090	148,558	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	1,030	972	132,483	2047/2/20
RAGB 1.5% 11/02/86	1.5	270	216	29,530	2086/11/2
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	990	1,020	139,049	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,330	1,361	185,616	2023/10/20
RAGB 2.1% 09/20/17	2.1	810	780	106,397	2117/9/20
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	1,080	1,174	160,026	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	830	1,044	142,336	2044/6/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	638	87,026	2062/1/26
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,820	2,400	327,199	2037/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	1,370	1,591	216,840	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	1,180	1,502	204,819	2027/7/15
(フィンランド)					
国債証券					
RFGB 0% 09/15/23	—	570	569	77,582	2023/9/15
RFGB 0% 09/15/24	—	420	415	56,619	2024/9/15
RFGB 0% 09/15/26	—	200	192	26,257	2026/9/15
RFGB 0% 09/15/30	—	800	717	97,809	2030/9/15
RFGB 0.125% 04/15/36	0.125	330	265	36,172	2036/4/15
RFGB 0.125% 04/15/52	0.125	460	285	38,851	2052/4/15
RFGB 0.125% 09/15/31	0.125	540	480	65,442	2031/9/15
RFGB 0.25% 09/15/40	0.25	500	380	51,816	2040/9/15
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	620	612	83,482	2026/4/15
RFGB 0.5% 04/15/43	0.5	380	290	39,601	2043/4/15
RFGB 0.5% 09/15/27	0.5	870	850	115,897	2027/9/15
RFGB 0.5% 09/15/28	0.5	650	626	85,378	2028/9/15
RFGB 0.5% 09/15/29	0.5	760	723	98,611	2029/9/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	800	760	103,649	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	690	693	94,546	2025/9/15
RFGB 1.125% 04/15/34	1.125	560	529	72,134	2034/4/15
RFGB 1.375% 04/15/47	1.375	490	455	62,015	2047/4/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	730	752	102,588	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	640	723	98,657	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	550	606	82,648	2028/7/4
RFGB 4% 07/04/25	4.0	830	916	124,899	2025/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0% 10/18/31	—	850	741	101,012	2031/10/18
IRISH 0.2% 05/15/27	0.2	930	899	122,598	2027/5/15
IRISH 0.2% 10/18/30	0.2	1,090	991	135,187	2030/10/18
IRISH 0.35% 10/18/32	0.35	470	416	56,710	2032/10/18
IRISH 0.4% 05/15/35	0.4	610	516	70,411	2035/5/15
IRISH 0.55% 04/22/41	0.55	500	392	53,537	2041/4/22
IRISH 0.9% 05/15/28	0.9	690	684	93,284	2028/5/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,640	1,658	225,992	2026/5/15
IRISH 1.1% 05/15/29	1.1	1,200	1,196	163,018	2029/5/15
IRISH 1.3% 05/15/33	1.3	670	651	88,836	2033/5/15
IRISH 1.35% 03/18/31	1.35	810	811	110,627	2031/3/18
IRISH 1.5% 05/15/50	1.5	800	708	96,504	2050/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	820	815	111,099	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	1,150	1,158	157,891	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,210	1,319	179,838	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	970	1,024	139,621	2024/3/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,160	1,316	179,406	2025/3/13
ユ ー ロ 計					107,984,367
(イギリス)					
国債証券					
UKT 0.125% 01/30/26	0.125	1,520	1,446	232,005	2026/1/30
UKT 0.125% 01/31/24	0.125	3,300	3,227	517,637	2024/1/31

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
UKT 0.125% 01/31/28	0.125	2,260	2,077	333,232	2028/1/31
UKT 0.25% 01/31/25	0.25	1,110	1,072	172,015	2025/1/31
UKT 0.25% 07/31/31	0.25	3,270	2,821	452,574	2031/7/31
UKT 0.375% 10/22/26	0.375	1,910	1,811	290,494	2026/10/22
UKT 0.375% 10/22/30	0.375	2,420	2,157	345,999	2030/10/22
UKT 0.5% 01/31/29	0.5	1,020	940	150,856	2029/1/31
UKT 0.5% 10/22/61	0.5	1,340	782	125,467	2061/10/22
UKT 0.625% 06/07/25	0.625	1,700	1,659	266,102	2025/6/7
UKT 0.625% 07/31/35	0.625	2,810	2,319	372,094	2035/7/31
UKT 0.625% 10/22/50	0.625	880	594	95,393	2050/10/22
UKT 0.75% 07/22/23	0.75	2,360	2,343	375,912	2023/7/22
UKT 0.875% 01/31/46	0.875	1,170	881	141,444	2046/1/31
UKT 0.875% 07/31/33	0.875	510	452	72,628	2033/7/31
UKT 0.875% 10/22/29	0.875	1,700	1,601	256,897	2029/10/22
UKT 1% 01/31/32	1.0	400	366	58,847	2032/1/31
UKT 1% 04/22/24	1.0	800	793	127,299	2024/4/22
UKT 1.125% 01/31/39	1.125	500	424	68,100	2039/1/31
UKT 1.125% 10/22/73	1.125	520	381	61,202	2073/10/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	950	935	150,052	2027/7/22
UKT 1.25% 07/31/51	1.25	830	663	106,431	2051/7/31
UKT 1.25% 10/22/41	1.25	2,800	2,373	380,645	2041/10/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	1,600	1,599	256,534	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	2,370	2,044	327,887	2047/7/22
UKT 1.5% 07/31/53	1.5	420	358	57,481	2053/7/31
UKT 1.625% 10/22/28	1.625	1,620	1,621	260,081	2028/10/22
UKT 1.625% 10/22/54	1.625	1,860	1,633	261,968	2054/10/22
UKT 1.625% 10/22/71	1.625	1,480	1,313	210,615	2071/10/22
UKT 1.75% 01/22/49	1.75	1,300	1,183	189,749	2049/1/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	2,210	2,028	322,159	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	2,630	2,478	397,600	2037/9/7
UKT 2% 09/07/25	2.0	1,780	1,809	290,170	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,500	2,504	404,952	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,510	1,710	274,281	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	1,690	1,736	278,580	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,180	2,556	410,003	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	2,290	2,799	448,953	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	1,930	2,770	444,331	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	1,600	2,155	345,782	2052/7/22
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,540	2,306	370,019	2060/1/22
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	1,640	2,051	329,096	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,100	2,544	408,190	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,620	2,097	336,401	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,370	1,559	250,103	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	1,750	2,288	367,079	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	1,920	2,651	425,243	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,510	2,143	343,724	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,910	2,871	460,485	2055/12/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	1,860	2,348	376,707	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,210	3,037	487,197	2042/12/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,460	1,804	289,353	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,650	2,238	359,052	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	2,300	2,515	403,517	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,584	254,059	2028/12/7
小 計					15,794,705
(スウェーデン)		キスウェーデン クロナ	キスウェーデン クロナ		
国債証券					
SGB 0.125% 05/12/31	0.125	6,470	5,738	74,256	2031/5/12
SGB 0.75% 05/12/28	0.75	7,800	7,481	96,809	2028/5/12
SGB 0.75% 11/12/29	0.75	7,560	7,168	92,763	2029/11/12

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SGB 1% 11/12/26	1.0	8,440	8,283	107,188	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	12,500	12,561	162,539	2023/11/13
SGB 2.25% 06/31/32	2.25	4,980	5,328	68,955	2032/6/1
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	9,300	9,582	124,002	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,310	6,753	87,389	2039/3/30
小計				813,906	
(ノルウェー)		千ノルウェー	千ノルウェー		
		クローネ	クローネ		
国債証券					
NGB 1.25% 09/17/31	1.25	3,590	3,176	42,568	2031/9/17
NGB 1.375% 08/19/30	1.375	6,480	5,878	78,770	2030/8/19
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,670	4,501	60,319	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	4,680	4,512	60,461	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	5,720	5,612	75,204	2025/3/13
NGB 1.75% 09/06/29	1.75	6,340	5,972	80,036	2029/9/6
NGB 2% 04/26/28	2.0	5,020	4,855	65,064	2028/4/26
NGB 2% 05/24/23	2.0	10,660	10,679	143,105	2023/5/24
NGB 2.125% 05/18/32	2.125	3,220	3,070	41,150	2032/5/18
NGB 3% 03/14/24	3.0	7,760	7,863	105,368	2024/3/14
小計				752,049	
(デンマーク)		千デンマーク	千デンマーク		
		クローネ	クローネ		
国債証券					
DGB 0% 11/15/24	—	2,550	2,514	46,062	2024/11/15
DGB 0% 11/15/31	—	5,830	5,165	94,629	2031/11/15
DGB 0.25% 11/15/52	0.25	6,050	4,231	77,524	2052/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	8,850	8,612	157,790	2027/11/15
DGB 0.5% 11/15/29	0.5	12,410	11,853	217,149	2029/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	7,550	7,699	141,057	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	5,510	5,697	104,381	2025/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	13,290	19,447	356,278	2039/11/15
小計				1,194,873	
(ポーランド)		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券					
POLGB 0% 07/25/24	—	2,160	1,885	56,302	2024/7/25
POLGB 0.25% 10/25/26	0.25	2,850	2,165	64,655	2026/10/25
POLGB 0.75% 04/25/25	0.75	3,560	3,039	90,752	2025/4/25
POLGB 1.25% 10/25/30	1.25	4,150	2,759	82,368	2030/10/25
POLGB 1.75% 04/25/32	1.75	650	423	12,645	2032/4/25
POLGB 2.25% 10/25/24	2.25	3,930	3,586	107,059	2024/10/25
POLGB 2.5% 04/25/24	2.5	3,550	3,309	98,809	2024/4/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	6,860	5,830	174,057	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	3,780	3,088	92,207	2027/7/25
POLGB 2.75% 04/25/28	2.75	5,750	4,663	139,231	2028/4/25
POLGB 2.75% 10/25/29	2.75	6,220	4,815	143,768	2029/10/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	4,910	4,449	132,840	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	2,410	2,334	69,697	2023/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	600	572	17,091	2029/4/25
小計				1,281,487	
(オーストラリア)		千オーストラリア	千オーストラリア		
		ドル	ドル		
国債証券					
ACGB 0.25% 11/21/24	0.25	3,430	3,234	294,440	2024/11/21
ACGB 0.25% 11/21/25	0.25	2,340	2,138	194,682	2025/11/21
ACGB 0.5% 09/21/26	0.5	2,040	1,838	167,315	2026/9/21
ACGB 1% 11/21/31	1.0	3,250	2,659	242,112	2031/11/21
ACGB 1% 12/21/30	1.0	2,360	1,969	179,243	2030/12/21
ACGB 1.25% 05/21/32	1.25	2,740	2,272	206,870	2032/5/21
ACGB 1.5% 06/21/31	1.5	3,190	2,756	250,935	2031/6/21
ACGB 1.75% 06/21/51	1.75	1,760	1,176	107,084	2051/6/21

当		期		末	
銘柄	利率 (%)	額面金額	評価額	額	償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ACGB 1.75% 11/21/32	1.75	2,910	2,516	229,039	2032/11/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	1,140	1,088	99,065	2028/5/21
ACGB 2.5% 05/21/30	2.5	3,520	3,348	304,761	2030/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	1,380	1,388	126,365	2024/4/21
ACGB 2.75% 05/21/41	2.75	1,630	1,439	131,056	2041/5/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	1,050	978	89,060	2035/6/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	1,930	1,901	173,056	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,660	1,624	147,849	2028/11/21
ACGB 2.75% 11/21/29	2.75	1,410	1,370	124,753	2029/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,680	1,508	137,324	2047/3/21
ACGB 3% 11/21/33	3.0	1,000	970	88,342	2033/11/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	2,560	2,593	236,058	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	2,200	2,215	201,615	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	1,120	1,077	98,062	2039/6/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,620	1,672	152,268	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	1,890	1,982	180,422	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	2,310	2,565	233,478	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	2,320	2,504	227,979	2027/4/21
小計				4,623,245	
(シンガポール)		千シンガポール	千シンガポール		
		ドル	ドル		
国債証券					
SIGB 0.5% 11/01/25	0.5	750	704	65,351	2025/11/1
SIGB 1.25% 11/01/26	1.25	530	503	46,761	2026/11/1
SIGB 1.625% 07/01/31	1.625	650	598	55,534	2031/7/1
SIGB 1.875% 03/01/50	1.875	810	691	64,180	2050/3/1
SIGB 1.875% 10/01/51	1.875	320	275	25,547	2051/10/1
SIGB 2% 02/01/24	2.0	410	409	37,964	2024/2/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	1,080	1,068	99,135	2026/6/1
SIGB 2.25% 08/01/36	2.25	890	839	77,942	2036/8/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	730	730	67,828	2025/6/1
SIGB 2.375% 07/01/39	2.375	430	408	37,926	2039/7/1
SIGB 2.625% 05/01/28	2.625	530	533	49,496	2028/5/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	760	760	70,558	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	630	626	58,188	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	620	624	57,980	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	650	662	61,514	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	1,200	1,224	113,641	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	1,590	1,614	149,890	2024/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	830	886	82,296	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	880	920	85,487	2027/3/1
小計				1,307,226	
(マレーシア)		千マレーシア	千マレーシア		
		リンギット	リンギット		
国債証券					
MGS 2.632% 04/15/31	2.632	1,510	1,349	39,156	2031/4/15
MGS 3.478% 06/14/24	3.478	1,920	1,925	55,877	2024/6/14
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	1,510	1,490	43,267	2027/5/31
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	2,870	2,852	82,799	2028/6/15
MGS 3.757% 05/22/40	3.757	1,520	1,369	39,760	2040/5/22
MGS 3.8% 08/17/23	3.8	930	942	27,350	2023/8/17
MGS 3.828% 07/05/34	3.828	1,180	1,119	32,496	2034/7/5
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,670	1,601	46,485	2033/4/15
MGS 3.882% 03/14/25	3.882	1,030	1,041	30,230	2025/3/14
MGS 3.885% 08/15/29	3.885	1,500	1,489	43,239	2029/8/15
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,135	32,964	2027/3/15
MGS 3.899% 11/16/27	3.899	1,970	1,987	57,691	2027/11/16
MGS 3.9% 11/30/26	3.9	2,120	2,135	61,997	2026/11/30
MGS 3.906% 07/15/26	3.906	600	605	17,564	2026/7/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	3,120	3,156	91,610	2025/9/15

当		期				末	
銘	柄	利率 (%)	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		償還年月日
MGS	4.059%	09/30/24	4.059	1,780	1,806	52,428	2024/9/30
MGS	4.065%	06/15/50	4.065	2,340	2,095	60,809	2050/6/15
MGS	4.181%	07/15/24	4.181	1,280	1,300	37,741	2024/7/15
MGS	4.232%	06/30/31	4.232	3,000	3,014	87,493	2031/6/30
MGS	4.254%	05/31/35	4.254	2,030	1,984	57,609	2035/5/31
MGS	4.392%	04/15/26	4.392	2,500	2,565	74,470	2026/4/15
MGS	4.498%	04/15/30	4.498	2,860	2,945	85,484	2030/4/15
MGS	4.642%	11/07/33	4.642	1,770	1,824	52,967	2033/11/7
MGS	4.736%	03/15/46	4.736	1,480	1,468	42,618	2046/3/15
MGS	4.762%	04/07/37	4.762	2,280	2,355	68,354	2037/4/7
MGS	4.893%	06/08/38	4.893	2,310	2,392	69,440	2038/6/8
MGS	4.921%	07/06/48	4.921	1,680	1,699	49,323	2048/7/6
MGS	4.935%	09/30/43	4.935	1,030	1,056	30,659	2043/9/30
小 計						1,471,893	
(中国オフショア)				千オフショア人民元	千オフショア人民元		
国債証券							
CGB	1.99%	04/09/25	1.99	29,520	29,240	553,007	2025/4/9
CGB	2.28%	03/17/24	2.28	9,700	9,720	183,830	2024/3/17
CGB	2.47%	09/02/24	2.47	18,980	19,083	360,906	2024/9/2
CGB	2.48%	04/15/27	2.48	9,000	9,001	170,240	2027/4/15
CGB	2.56%	10/21/23	2.56	30,440	30,628	579,262	2023/10/21
CGB	2.68%	05/21/30	2.68	22,480	22,308	421,898	2030/5/21
CGB	2.69%	08/12/26	2.69	17,240	17,391	328,905	2026/8/12
CGB	2.8%	03/24/29	2.8	7,900	7,946	150,287	2029/3/24
CGB	2.84%	04/08/24	2.84	11,650	11,793	223,043	2024/4/8
CGB	2.85%	06/04/27	2.85	12,330	12,512	236,648	2027/6/4
CGB	2.89%	11/18/31	2.89	5,510	5,562	105,208	2031/11/18
CGB	2.91%	10/14/28	2.91	10,280	10,419	197,053	2028/10/14
CGB	3.01%	05/13/28	3.01	7,230	7,378	139,539	2028/5/13
CGB	3.02%	05/27/31	3.02	6,850	6,971	131,841	2031/5/27
CGB	3.03%	03/11/26	3.03	26,760	27,345	517,164	2026/3/11
CGB	3.27%	11/19/30	3.27	6,850	7,120	134,656	2030/11/19
CGB	3.28%	12/03/27	3.28	5,410	5,614	106,182	2027/12/3
CGB	3.39%	03/16/50	3.39	5,520	5,614	106,179	2050/3/16
CGB	3.53%	10/18/51	3.53	2,950	3,092	58,487	2051/10/18
CGB	3.72%	04/12/51	3.72	2,390	2,577	48,753	2051/4/12
CGB	3.81%	09/14/50	3.81	7,460	8,164	154,413	2050/9/14
CGB	3.86%	07/22/49	3.86	5,580	6,141	116,143	2049/7/22
CGB	4.08%	10/22/48	4.08	4,110	4,671	88,351	2048/10/22
小 計						5,112,008	
(イスラエル)				千イスラエル シェケル	千イスラエル シェケル		
国債証券							
ILGOV	0.15%	07/31/23	0.15	840	829	31,474	2023/7/31
ILGOV	0.4%	10/31/24	0.4	1,210	1,166	44,236	2024/10/31
ILGOV	0.5%	02/27/26	0.5	860	809	30,692	2026/2/27
ILGOV	0.5%	04/30/25	0.5	2,420	2,316	87,848	2025/4/30
ILGOV	1%	03/31/30	1.0	2,830	2,549	96,708	2030/3/31
ILGOV	1.3%	04/30/32	1.3	280	250	9,482	2032/4/30
ILGOV	1.5%	05/31/37	1.5	2,190	1,807	68,565	2037/5/31
ILGOV	1.5%	11/30/23	1.5	2,230	2,241	85,009	2023/11/30
ILGOV	1.75%	08/31/25	1.75	1,240	1,236	46,902	2025/8/31
ILGOV	2%	03/31/27	2.0	2,750	2,725	103,382	2027/3/31
ILGOV	2.25%	09/28/28	2.25	2,010	2,004	76,018	2028/9/28
ILGOV	3.75%	03/31/24	3.75	4,080	4,231	160,473	2024/3/31
ILGOV	3.75%	03/31/47	3.75	3,130	3,391	128,622	2047/3/31
ILGOV	5.5%	01/31/42	5.5	2,030	2,755	104,494	2042/1/31
ILGOV	6.25%	10/30/26	6.25	3,060	3,581	135,829	2026/10/30
小 計						1,209,741	
合 計						297,584,217	

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別		当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	EURO-SCHATZ	496	—
	US 5YR NOTE	1,065	—
	EURO-BOBL FU	781	—
	EURO-BUND	1,613	—
	US 10YR NOTE	869	—
	US LONG BOND	912	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	297,584,217	97.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,619,511	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	306,203,728	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(300,593,413千円)の投資信託財産総額(306,203,728千円)に対する比率は98.2%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=127.02円

1ユーロ=136.29円

1ノルウェークローネ=13.40円

1オーストラリアドル=91.02円

1オフショア人民元=18.9124円

1カナダドル=99.87円

1イギリスポンド=160.39円

1デンマーククローネ=18.32円

1シンガポールドル=92.82円

1イスラエルシェケル=37.927円

1メキシコペソ=6.4954円

1スウェーデンクローナ=12.94円

1ポーランドズロチ=29.8545円

1マレーシアリングギット=29.0252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 2022年5月30日現在
(A)資 産	312,166,419,317円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,231,147,162
公 社 債(評価額)	297,584,217,256
未 収 入 金	5,975,913,184
未 収 利 息	1,602,999,713
前 払 費 用	68,788,346
差 入 委 託 証 拠 金	703,353,656
(B)負 債	6,035,903,620
未 払 金	6,013,434,102
未 払 解 約 金	22,464,619
未 払 利 息	4,899
(C)純 資 産 総 額(A-B)	306,130,515,697
元 本	99,597,188,643
次 期 繰 越 損 益 金	206,533,327,054
(D)受 益 権 総 口 数	99,597,188,643口
1万口当たり基準価額(C/D)	30,737円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	5,588,602,464円
受 取 利 息	5,591,422,848
そ の 他 収 益 金	85,970
支 払 利 息	△2,906,354
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△4,919,550,310
売 買 益	28,346,868,449
売 買 損	△33,266,418,759
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△355,314,134
取 引 益	228,024,368
取 引 損	△583,338,502
(D)そ の 他 費 用	△78,636,127
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	235,101,893
(F)前 期 繰 越 損 益 金	205,204,029,702
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	37,399,000,336
(H)解 約 差 損 益 金	△36,304,804,877
(I)計 (E+F+G+H)	206,533,327,054
次 期 繰 越 損 益 金(I)	206,533,327,054

(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99,051,563,319円、期中追加設定元本額は17,957,103,019円、期中一部解約元本額は17,411,477,695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)	15,588,874,755円
世界経済インデックスファンド	13,705,517,215円
DC世界経済インデックスファンド	12,670,772,916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)	11,035,294,676円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	8,187,835,347円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	4,001,557,866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)	2,526,946,203円
DC外国債券インデックス・オープン	2,299,774,574円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,173,342,834円
DCマイセクション25	1,953,384,106円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,763,244,024円
DCマイセクション50	1,676,561,671円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,411,756,777円
外国債券オープン(毎月決算型)	1,322,110,043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)	1,316,783,744円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,312,521,937円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	1,174,457,124円
DCマイセクション75	1,141,290,393円
DCマイセクションS25	934,868,709円
グローバル経済コア	843,868,056円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	744,139,958円
FOFs用 外国債券オープン(適格機関投資家専用)	737,949,757円
DCマイセクションS50	736,631,684円
外国債券ファンド・シリーズ1	701,286,117円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	600,790,052円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	569,673,405円
分散投資コア戦略ファンドS	556,972,964円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	545,698,435円
コア投資戦略ファンド(安定型)	539,035,373円
コア投資戦略ファンド(切替型)	537,685,860円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	501,882,298円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	449,635,006円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	445,614,258円
DCマイセクションS75	414,158,205円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	387,700,518円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	344,318,886円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	331,732,727円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	311,958,664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)	305,209,636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)	283,459,403円
分散投資コア戦略ファンドA	259,544,875円
SMT 世界経済インデックス・オープン	250,909,160円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	250,415,573円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	211,302,672円
SMT インデックスバランス・オープン	196,612,068円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	185,614,783円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	169,275,387円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	111,549,248円
ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	102,644,337円
DCターゲット・イヤードファンド2035	92,308,746円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	82,452,091円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	75,911,463円

バランス25VA2(適格機関投資家専用)	73,784,318円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	71,940,031円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	70,266,398円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	53,860,232円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	47,930,499円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	47,411,067円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	30,403,026円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	28,394,173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)	23,157,130円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	16,454,941円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	13,381,571円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	12,541,025円
SBI資産設計オープン(分配型)	8,653,367円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	8,114,094円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	5,968,437円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	5,146,398円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	1,811,153円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	1,650,011円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	1,324,475円
My SMT グローバル債券インデックス(ノーロード)	159,718円

お知らせ

該当事項はありません。