

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合
信託期間	信託期間は2015年6月16日から2026年2月17日までです。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	以下の投資信託証券を主要投資対象とします。 FOFs用国内株式エンハスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用) 中小型株式 マザーファンド 国内株式インデックス マザーファンド 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド 国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用) 日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用) FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用) 外国株式インデックス マザーファンド 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド 新興国株式インデックス マザーファンド グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用) ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用) ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用) 世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け) Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL J-REITインデックス マザーファンド グローバルREITインデックス マザーファンド ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり) BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - クラスS-JPY ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用) 米国株式LSマザーファンド コモディティLSアルファ・マザーファンド GBCAマザーファンド(ミドルリスク型) ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用) ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用) MA Hedge Fund Strategies Limited MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR 米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド
組入制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 デリバティブの直接利用は行いません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

サテライト投資戦略ファンド(株式型) (愛称:サテラップ(株式型))

運用報告書(全体版)

第9期(決算日 2024年2月19日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	標準価額		株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
		税込分配金	期中騰落率						
第5期(2020年2月17日)	円 10,917	円 0	% 10.7	% 41.1	% 1.2	% 9.7	% -	% 46.3	百万円 13,138
第6期(2021年2月17日)	11,845	0	8.5	45.8	0.6	11.7	-	40.5	11,518
第7期(2022年2月17日)	12,563	0	6.1	35.1	0.7	12.2	-	50.7	9,679
第8期(2023年2月17日)	12,791	0	1.8	29.1	0.7	12.0	-	56.0	8,916
第9期(2024年2月19日)	15,024	0	17.5	18.0	0.4	11.6	△0.6	67.7	9,401

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

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

当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額	騰落率	株式組入率	株式先物比率	債券組入率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
2月末	12,727	△0.5	28.9	0.7	12.2	-	55.9
3月末	12,736	△0.4	28.8	1.0	11.7	-	55.3
4月末	12,924	1.0	29.2	0.8	12.0	-	55.9
5月末	13,284	3.9	26.1	0.8	11.2	△0.4	59.5
6月末	13,777	7.7	26.3	0.6	10.9	△0.4	59.6
7月末	13,864	8.4	17.4	0.4	10.6	△0.4	67.4
8月末	14,015	9.6	17.3	0.4	10.9	△0.4	68.7
9月末	13,886	8.6	17.1	0.5	11.0	△1.0	68.9
10月末	13,536	5.8	16.9	0.6	11.5	△0.7	68.8
11月末	14,125	10.4	17.2	0.6	11.6	△0.8	67.6
12月末	14,199	11.0	17.5	0.4	11.6	△0.8	68.7
2024年 1月末	14,700	14.9	17.7	0.4	11.7	△0.9	68.0
(当期末) 2024年 2月19日	15,024	17.5	18.0	0.4	11.6	△0.6	67.7

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

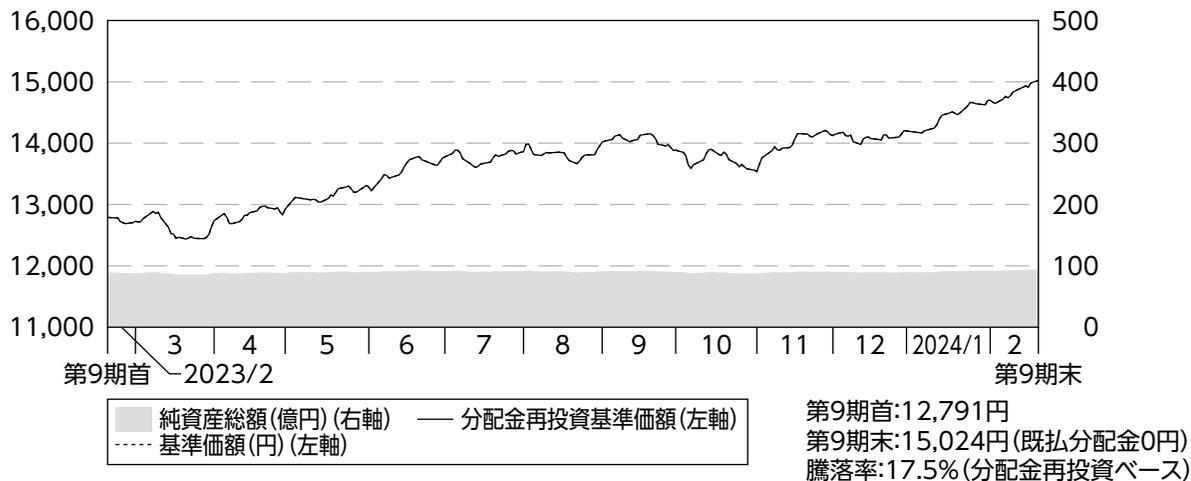
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。「株式先物比率」は「REIT先物比率」を含みます。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、2023年2月17日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は上昇しました。当期後半に日本の主要企業の好決算や円安・ドル高が進行したことで国内株式が堅調に推移したほか、欧米の物価指標鈍化を受けて早期の利下げ期待が高まったことや米国経済が軟着陸に向かうとの見方が支えとなり先進国株式のパフォーマンスも堅調となったことなどから、基準価額は上昇しました。当ファンドの投資対象ファンドの騰落率は以下の通りです。

組入ファンド	投資資産※1※2	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
FOFs用国内株式エンハスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	2.9%	33.0%
中小型株式 マザーファンド	国内株式	1.4%	11.7%
国内株式インデックス マザーファンド	国内株式	7.4%	35.9%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	国内株式	1.5%	36.9%
国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	5.9%	41.0%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	4.3%	35.3%
FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	国内株式	5.8%	47.8%
外国株式インデックス マザーファンド	外国株式	4.9%	33.9%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	外国株式	1.7%	36.8%
新興国株式インデックス マザーファンド	外国株式	1.6%	14.0%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	外国株式	4.7%	29.4%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	外国株式	4.7%	17.5%
ニッセイ/ソフダス・グローバルバリュー株式 ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)	外国株式	4.7%	23.2%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	外国株式	4.8%	23.6%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	外国株式	4.7%	40.4%
J-REITインデックス マザーファンド	国内リート	4.5%	△2.3%
グローバルREITインデックス マザーファンド	海外リート	4.9%	11.6%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	ヘッジファンド等	4.2%	2.2%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	ヘッジファンド等	2.5%	2.0%
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド等	1.8%	△4.8%
米国株式LSマザーファンド	ヘッジファンド等	3.5%	14.9%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	ヘッジファンド等	3.0%	△1.1%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	ヘッジファンド等	1.7%	△1.7%
ムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド等	3.0%	△8.2%
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	ヘッジファンド等	2.3%	△9.9%
MA Hedge Fund Strategies Limited	ヘッジファンド等	3.1%	0.3%
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	ヘッジファンド等	1.5%	4.2%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	ヘッジファンド等	1.7%	0.7%

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

※2 外国株式には、先進国および新興国の株式に投資するファンドが含まれます。

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注2) 期中に組み入れたファンドの騰落率は当ファンドへの組入日からのものです。

○国内株式市場

国内株式は上昇しました。

当期前半は、東証のPBR1倍割れ是正要請などから外国人による買いが鮮明となり上昇しました。その後は、日本の主要企業の好決算や円安・ドル高の進行、さらに米長期金利の低下を受けた米国株の上昇が支えとなり、上昇基調で推移しました。

○先進国株式市場

先進国株式は上昇しました。

当期前半は欧米のインフレ鈍化の兆しが見られたことなどをを受けて堅調に推移しましたが、2023年8月以降には米国の金融引き締め長期化が意識されたことを受けて、株価は下落しました。その後は、欧米の物価指標鈍化を受けて早期の利下げ期待が高まったことや米国経済が軟着陸に向かうとの見方が支えとなり、上昇しました。

○新興国株式市場

新興国株式は上昇しました。

当初初は米中対立の激化が懸念されたことを受けて、株価は下落しました。2023年8月にかけては、中国当局による不動産市場へのさらなる緩和姿勢や地方債務問題に取り組む方針などが好感され上昇しましたが、米国の金融引き締めの長期化が意識され新興国株が売られました。年末にかけて、世界的な利上げサイクルが終盤に近づいたことを受けて株価は上昇しました。年明け以降は、中国の景況感の悪化などを背景に一時下落したものの、当期末にかけては世界的な株価の上昇などが支援材料となり、上昇に転じました。

○国内リート市場

国内リートは下落しました。

当初初は次期日銀総裁候補の金融政策を巡る不透明感が意識されて始まった後、植田新総裁就任後初回となる日銀金融政策決定会合で現行の金融緩和の継続が確認されたことなどから、7月後半にかけて上昇しました。その後も、ジャクソンホール会議でのパウエルFRB(米連邦準備理事会)議長の講演などを受け、8月末にかけて上昇しました。11月末にかけては、一進一退の展開となりました。12月中旬にかけては日銀金融政策決定会合を控える中、徐々に様子見姿勢が強まり軟調に推移したものの、その後は日銀金融政策決定会合で金融政策の現状維持が決定されたことを受け、上昇しました。当期末にかけては、日銀の金融政策正常化に伴う利上げへの根強い警戒感などから、国内リート市場は大幅に下落しました。

○海外リート市場

海外リートは概ね横ばいとなりました。

当期の前半は経済指標や各国中央銀行の利上げトレンドの転換を巡る動向を受けて一進一退で推移しました。9月以降は、米国を中心とした金利上昇を受けて相対的に投資妙味が薄れたことから、大幅に下落しました。11月以降は、欧米の中央銀行による利上げ観測の後退を背景に上昇しました。2024年1月から期末にかけては、米国での利下げ観測の後退や欧州での景況感指標の低迷を受けて軟調に推移しました。

○ゴールド市場

当期のゴールドは上昇しました。

当期初から4月にかけては、弱含む経済指標を背景とした米国金利の低下を背景に上昇しました。その後は、FRBによる利上げ観測が強まり米長期金利が上昇したことや米ドル高が進行したことなどを背景に軟調に推移しました。10月以降は、中東における地政学リスクの高まりを背景とした質への逃避から再び上昇基調となり、ゴールドは前期末比で上昇しました。

○当ファンド

日本を含む先進国および新興国の株式、不動産投資信託証券(REIT)など株式代替資産およびその他の様々な資産ならびにヘッジファンド等を実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資し、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、投資対象ファンドのリターン・リスク特性を踏まえた目標配分比率に基づきポートフォリオの組成を行い、中長期的な安定収益の獲得を目指したファンド運営を行いました。

・ 外国株式インデックス マザーファンド

外国株式資産の投資割合の見直しに伴う目標配分比率の変更により、当期末時点における組入比率は4.9%となりました。

・ 世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)

外国株式資産の投資割合の見直しに伴い新規に組み入れ、当期末時点における組入比率は4.8%となりました。

・ ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式ファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用)

外国株式資産の投資割合の見直しに伴い新規に組み入れ、当期末時点における組入比率は4.7%となりました。

・ ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

ヘッジファンド資産の投資割合の見直しに伴う目標配分比率の変更により、当期末時点における組入比率は4.2%となりました。

・ Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J

外国株式資産の投資割合の見直しに伴い全部売却を行ったことから、当期末時点における組入はありません。

当ファンドのポートフォリオ

組入ファンド	当期首(前期末)	当期末	差
外国株式インデックス マザーファンド	15.7%	4.9%	△10.9%
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	—	4.8%	+4.8%
ニッセイ/サンダース・グローバルバリューストックファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	—	4.7%	+4.7%
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	7.1%	4.2%	△2.9%
Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	2.8%	—	△2.8%
国内株式インデックス マザーファンド	10.1%	7.4%	△2.7%
グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	2.9%	4.7%	+1.8%
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	2.9%	4.7%	+1.8%
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	2.9%	4.7%	+1.7%
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	—	1.7%	+1.7%
新興国株式インデックス マザーファンド	—	1.6%	+1.6%
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	2.8%	4.3%	+1.6%
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	—	1.5%	+1.5%
FOFs用国内株式EVIバリューストックファンド(適格機関投資家専用)	4.5%	5.8%	+1.2%
J-REITインデックス マザーファンド	5.7%	4.5%	△1.2%
コモディティLSアルファ・マザーファンド	4.0%	3.0%	△1.0%
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	3.4%	2.5%	△0.9%
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3.7%	3.0%	△0.7%
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイドリンクファンド(適格機関投資家専用)	1.4%	1.8%	+0.4%
グローバルREITインデックス マザーファンド	5.2%	4.9%	△0.3%
米国株式LSマザーファンド	3.2%	3.5%	+0.3%
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	1.4%	1.7%	+0.3%
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	2.0%	2.3%	+0.2%
MA Hedge Fund Strategies Limited	2.9%	3.1%	+0.2%
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	1.4%	1.5%	+0.1%
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	1.6%	1.7%	+0.1%
国内株式アクティブバリューストックファンド(適格機関投資家専用)	5.8%	5.9%	+0.1%
FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	3.0%	2.9%	△0.1%
中小型株式 マザーファンド	1.4%	1.4%	+0.0%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

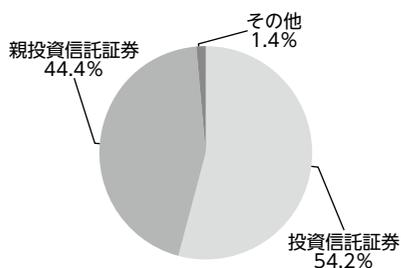
当ファンドの組入資産の内容

○組入上位ファンド

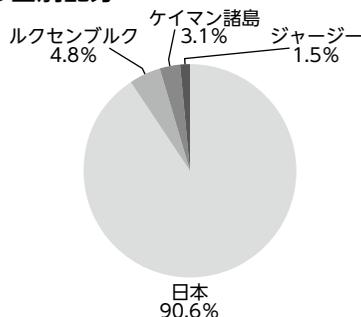
順位	ファンド名	当期末
		2024年2月19日
1	国内株式インデックス マザーファンド	7.4%
2	国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)	5.9%
3	FOFs用国内株式EVIバリューファンド(適格機関投資家専用)	5.8%
4	グローバルREITインデックス マザーファンド	4.9%
5	外国株式インデックス マザーファンド	4.9%
6	世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	4.8%
7	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	4.7%
8	グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)	4.7%
9	ニッセイ/サンダース・グローバルバリュー株式 ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	4.7%
10	ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	4.7%
組入ファンド数		28

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

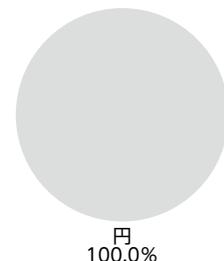
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

分配金

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第9期	
	2023年2月18日~2024年2月19日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	5,344	

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

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

(注3)－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

主として、日本を含む先進国及び新興国の株式、株式代替資産及びその他の様々な資産並びにヘッジファンドを実質的な投資対象とする投資対象ファンドに分散投資します。

各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は、各資産の期待リターンやリスク、各資産間の相関係数、各投資対象ファンドのリターン・リスク特性等をもとに決定します。各資産及び各投資対象ファンドへの配分比率は定期的な見直しを行うほか、市場環境等に応じて変更を行います。また適宜リバランスを行います。なお、全ての資産及び投資対象ファンドに投資するとは限りません。

投資対象ファンドについては、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。この際、投資対象ファンドとして定められていた投資信託証券が投資対象ファンドから除外されること、もしくは新たな投資信託証券が投資対象ファンドとして定められることがあります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2023年2月18日~2024年2月19日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	223円	1.637%	(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13,647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)	(140)	(1.029)	
(販売会社)	(75)	(0.553)	
(受託会社)	(8)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.001)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	2	0.017	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(2)	(0.012)	
(監査費用)	(1)	(0.006)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	225	1.658	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

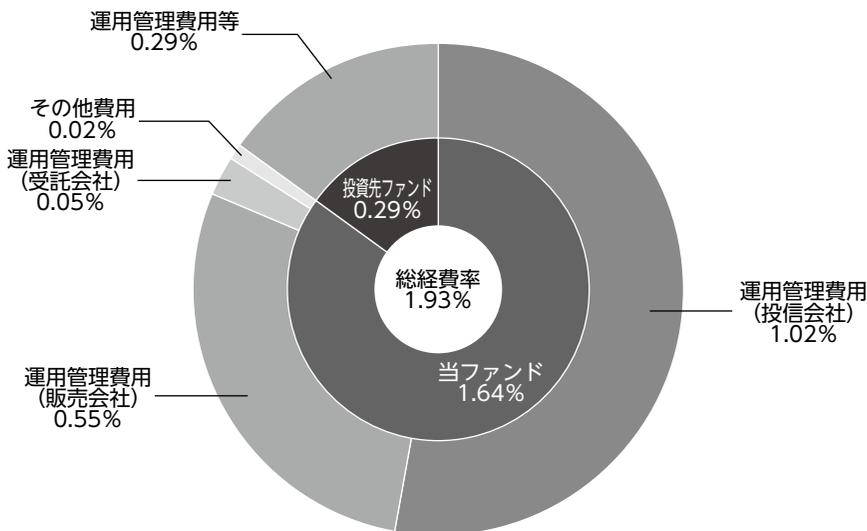
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

<参考情報>

総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した総経費率(年率)は1.93%です。



総経費率(①+②)	1.93%
①当ファンドの費用の比率	1.64%
②投資先ファンドの運用管理費用等の比率	0.29%

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

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

(注3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)です。

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの費用は投資先運用会社等から提供された入手可能なデータや情報を基に三井住友トラスト・アセットマネジメントが作成しています。

(注8)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注9)投資先ファンドの運用管理費用等の比率には、個々の投資先ファンドに応じて把握可能な場合には、運用管理費用以外の費用も含まれます。

(注10)上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
		千口	千円	千口	千円
国	MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	13	145,073	1	12,900
	ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド (適格機関投資家専用)	33,272	29,000	58,354	53,399
	国内株式アクティブバリュースタートアップファンド (適格機関投資家専用)	—	—	99,067	146,074
	FOFs用国内株式エンハンスド運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	—	—	34,195	67,351
	世界エクイティ・ファンド (適格機関投資家向け)	353,610	395,760	21,212	27,433
	Wellington Emerging Markets Research Equity Fund Class J	—	—	20	242,708
	Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	63	115,250	27	51,810
	ニッセイ/サンダース・グローバルバリュースタートアップファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	290,134	385,890	12,746	19,754
	グローバル株式コンセントレイト・ファンド (適格機関投資家専用)	70,099	134,753	19,180	37,385
	日本長期成長株集中投資ファンド (適格機関投資家専用)	35,027	90,000	8,431	22,783
	ブランディワイン・グローバル株式ファンド (適格機関投資家専用)	117,190	151,190	24,832	32,298
	ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS (適格機関投資家専用)	60,182	51,000	—	—
	FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)	38,952	44,000	—	—
内	FOFs用国内株式EVIバリュースタートアップファンド (適格機関投資家専用)	51,124	70,000	83,898	119,157
	MA Hedge Fund Strategies Limited	2	29,000	—	—

(注)金額は受渡代金です。

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	8,378	18,000	44,823	94,370
グローバルREITインデックス マザーファンド	—	—	19,960	54,110
中小型株式 マザーファンド	—	—	1,256	6,700
新興国株式インデックス マザーファンド	68,809	250,000	33,097	125,490
国内株式インデックス マザーファンド	2,263	5,240	197,761	457,950
外国株式インデックス マザーファンド	1,260	6,760	238,809	1,156,380
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	12,714	13,000	85,815	87,000
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	7,116	9,000	208,413	260,000
コモディティLSアルファ・マザーファンド	8,047	10,000	61,222	77,000
日本株式ESGセレクト・リーダーズ インデックスマザーファンド	—	—	17,624	21,890
外国株式ESGリーダーズ インデックスマザーファンド	810	1,150	9,171	11,830
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	142,281	163,000	—	—
米国株式イントラデイトレンド戦略マザーファンド	19,961	18,000	—	—

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

<中小型株式 マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	31,537,194千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	22,568,167千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	1.39

(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。

<新興国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	38,310,335千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	153,919,770千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.24

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<国内株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	98,511,075千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	562,691,998千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.17

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式インデックス マザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	83,356,808千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	567,486,213千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.14

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	6,723,184千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	11,542,930千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.58

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

<外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド>

項 目	当 期
(a) 当 期 中 の 株 式 売 買 金 額	5,552,018千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	11,501,764千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.48

(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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 1,640	百万円 1,351	% 82.4	百万円 833	百万円 525	% 63.0
金 銭 信 託	2	2	100.0	2	2	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	53,178	5,689	10.7	53,281	5,724	10.7

(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。

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 27	百万円 27	% 100.0	百万円 27	百万円 27	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	731,646	60,735	8.3	731,338	61,113	8.4

<平均保有割合 0.4%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<グローバルREITインデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 24,326	百万円 -	% -	百万円 14,928	百万円 5	% 0.0
金 銭 信 託	0.526175	0.526175	100.0	0.526175	0.526175	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	30,440	1,806	5.9	30,531	1,830	6.0

<平均保有割合 0.5%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 利害関係人とは、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。

<中小型株式 マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 14	百万円 14	% 100.0	百万円 14	百万円 14	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	247,584	21,842	8.8	247,160	21,960	8.9

<平均保有割合 0.5%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<新興国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.839683	百万円 0.839683	% 100.0	百万円 0.839683	百万円 0.839683	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	52,451	5,987	11.4	52,256	5,999	11.5

<平均保有割合 0.1%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 58	百万円 58	% 100.0	百万円 58	百万円 58	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	825,580	63,269	7.7	822,355	63,476	7.7

<平均保有割合 0.1%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 41,253	百万円 -	% -	百万円 76,495	百万円 139	% 0.2
金 銭 信 託	2	2	100.0	2	2	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	188,441	21,817	11.6	188,595	21,911	11.6

<平均保有割合 0.1%>

(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。

<ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 15	百万円 15	% 100.0	百万円 15	百万円 15	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	295,108	35,645	12.1	295,176	35,724	12.1

<平均保有割合 0.8%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 1	百万円 1	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	31,360	2,076	6.6	31,331	2,081	6.6

<平均保有割合 1.9%>

(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。

<コモディティLSアルファ・マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 2	百万円 2	% 100.0	百万円 2	百万円 2	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	55,078	4,758	8.6	55,126	4,782	8.7

<平均保有割合 1.5%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.805325	百万円 0.805325	% 100.0	百万円 0.805325	百万円 0.805325	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	24,311	2,223	9.1	24,281	2,235	9.2

<平均保有割合 1.1%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.109068	百万円 0.109068	% 100.0	百万円 0.109068	百万円 0.109068	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	4,646	327	7.0	4,626	328	7.1

<平均保有割合 1.1%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<米国株式LSマザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 先 物 取 引	百万円 248,427	百万円 248,427	% 100.0	百万円 246,467	百万円 246,467	% 100.0
為 替 直 物 取 引	—	—	—	5,363	5,363	100.0
金 銭 信 託	9	9	100.0	9	9	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	224,840	17,328	7.7	225,273	17,470	7.8

<平均保有割合 1.4%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 先 物 取 引	百万円 275,119	百万円 275,119	% 100.0	百万円 276,668	百万円 276,668	% 100.0
為 替 直 物 取 引	1,968	1,968	100.0	—	—	—
金 銭 信 託	74	74	100.0	74	74	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,443,768	124,494	8.6	1,440,424	124,798	8.7

<平均保有割合 0.7%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 1	百万円 1	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	22,360	1,884	8.4	22,382	1,895	8.5

<平均保有割合 1.7%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■ 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
投 資 信 託 受 益 証 券	395百万円	240百万円	1,283百万円

(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) 当該投資信託受益証券の発行者は、日興アセットマネジメント株式会社です。

< 国内株式インデックス マザーファンド >

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	76百万円	141百万円	1,846百万円

(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。

< 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド >

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株 式	11百万円	10百万円	72百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

組入資産の明細

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

フ ァ ン ド 名	当 期 末		
	口 数	評 価 額	比 率
株式ファンド	千口	千円	%
国内株式アクティブバリューストックファンド(適格機関投資家専用)	315,281	556,692	5.9
FOFs用国内株式エンハンスド運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)	120,390	274,213	2.9
世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)	332,398	452,460	4.8
ニッセイ/サンダース・グローバルバリューストックファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)	277,388	442,877	4.7
グローバル株式コンセンストリート・ファンド(適格機関投資家専用)	200,369	443,257	4.7
日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)	141,466	408,696	4.3
ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	311,304	437,725	4.7
FOFs用国内株式EVIバリューストックファンド(適格機関投資家専用)	322,181	543,519	5.8
Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL	199	445,028	4.7
その他			
ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)	334,608	282,476	3.0
ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	252,903	212,464	2.3
FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド(適格機関投資家専用)	141,605	167,194	1.8
MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR	12	137,990	1.5
MA Hedge Fund Strategies Limited	28	287,147	3.1
合 計	2,750,139	5,091,745	54.2

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	当 期 末		
	当 期 首(前期末)	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
J-REITインデックス マザーファンド	247,976	211,531	420,186
グローバルREITインデックス マザーファンド	182,175	162,214	457,088
中小型株式 マザーファンド	25,721	24,464	132,760
新興国株式インデックス マザーファンド	—	35,711	148,463
国内株式インデックス マザーファンド	452,804	257,305	697,864
外国株式インデックス マザーファンド	313,818	76,270	456,400
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	303,829	230,727	237,326
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	517,627	316,330	394,179
コモディティLSアルファ・マザーファンド	283,606	230,431	285,896
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	116,243	98,618	144,792
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	105,866	97,504	155,168
米 国 株 式 L S マ ザ ー フ ァ ン ド	267,116	267,116	327,858
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	—	142,281	160,023
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	154,896	174,857	158,141

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、以下の通りです。

J-REITインデックス マザーファンド	56,969,505千口	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	22,149,364千口
グローバルREITインデックス マザーファンド	39,464,790千口	コモディティLSアルファ・マザーファンド	13,526,605千口
中小型株式 マザーファンド	4,678,911千口	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	9,556,826千口
新興国株式インデックス マザーファンド	43,538,931千口	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	9,921,890千口
国内株式インデックス マザーファンド	243,047,559千口	米国株式LSマザーファンド	17,155,779千口
外国株式インデックス マザーファンド	115,185,099千口	GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	18,005,041千口
ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	24,898,753千口	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	8,288,047千口

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 信 託 受 益 証 券	4,221,579	44.5
投 資 証 券	870,166	9.2
J-REITインデックス マザーファンド	420,186	4.4
グローバルREITインデックス マザーファンド	457,088	4.8
中 小 型 株 式 マ ザ ー フ ァ ン ド	132,760	1.4
新興国株式インデックス マザーファンド	148,463	1.6
国内株式インデックス マザーファンド	697,864	7.4
外国株式インデックス マザーファンド	456,400	4.8
ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド	237,326	2.5
ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)	394,179	4.2
コモディティLSアルファ・マザーファンド	285,896	3.0
日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	144,792	1.5
外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド	155,168	1.6
米 国 株 式 L S マ ザ ー フ ァ ン ド	327,858	3.5
GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)	160,023	1.7
米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド	158,141	1.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	215,335	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	9,483,224	100.0

(注1) グローバルREITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(111,509,469千円)の投資信託財産総額(111,604,234千円)に対する比率は99.9%です。

(注2) 新興国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(180,853,102千円)の投資信託財産総額(181,147,661千円)に対する比率は99.8%です。

(注3) 外国株式インデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(689,636,005千円)の投資信託財産総額(690,214,571千円)に対する比率は99.9%です。

(注4) ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)において、当期末における外貨建純資産(28,124,914千円)の投資信託財産総額(28,196,519千円)に対する比率は99.7%です。

(注5) 外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(15,763,187千円)の投資信託財産総額(15,790,069千円)に対する比率は99.8%です。

(注6) 米国株式LSマザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(20,772,901千円)の投資信託財産総額(21,439,572千円)に対する比率は96.9%です。

(注7) GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)において、当期末における外貨建純資産(2,694,021千円)の投資信託財産総額(20,296,151千円)に対する比率は13.3%です。

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

1米ドル=150.03円

1ブラジルレアル=30.1963円

1ユーロ=161.81円

1スウェーデンクローナ=14.39円

1トルコリラ=4.8791円

1ポーランドズロチ=37.2755円

1ニュージーランドドル=92.10円

1マレーシアリングギット=31.3897円

1インドネシアルピア=0.0096円

1オフショア人民元=20.8108円

1カタールリアル=41.22円

1サウジアラビアリアル=40.07円

1カナダドル=111.39円

1チリペソ=0.154374円

1イギリスポンド=189.35円

1ノルウェークローネ=14.28円

1チェココルナ=6.3591円

1ロシアルーブル=1.63円

1香港ドル=19.18円

1タイバーツ=4.18円

1韓国ウォン=0.1128円

1インドルピー=1.82円

1南アフリカランド=7.96円

1クウェート・ディナール=488.06円

1メキシコペソ=8.811円

1コロンビアペソ=0.038373円

1スイスフラン=170.49円

1デンマーククローネ=21.70円

1ハンガリーフォリント=0.416507円

1オーストラリアドル=98.24円

1シンガポールドル=111.54円

1フィリピンペソ=2.6809円

1新台幣ドル=4.7823円

1イスラエルシェケル=41.5552円

1アラブ首長国連邦ディルハム=40.91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 2024年2月19日現在
(A) 資産		9,483,224,297円
	コール・ローン等	169,614,748
	投資信託受益証券(評価額)	4,221,579,198
	投資証券(評価額)	870,166,375
	J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	420,186,338
	グローバルREITインデックス マザーファンド(評価額)	457,088,964
	中小型株式 マザーファンド(評価額)	132,760,656
	新興国株式インデックス マザーファンド(評価額)	148,463,190
	国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	697,864,175
	外国株式インデックス マザーファンド(評価額)	456,400,649
	ビクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド(評価額)	237,326,797
	ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)(評価額)	394,179,933
	コモディティLSアルファ・マザーファンド(評価額)	285,896,079
	日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド(評価額)	144,792,276
	外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド(評価額)	155,168,338
	米国株式LSマザーファンド(評価額)	327,858,403
	GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)(評価額)	160,023,667
	米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド(評価額)	158,141,444
	未収入金	45,713,067
(B) 負債		81,509,318
	未払解約金	6,299,726
	未払信託報酬	74,956,389
	未払利息	36
	その他未払費用	253,167
(C) 純資産総額(A-B)		9,401,714,979
	元本	6,257,846,873
	次期繰越損益金	3,143,868,106
(D) 受益権総口数		6,257,846,873口
	1万口当たり基準価額(C/D)	15,024円

■ 損益の状況

項 目	当 期
	自 2023年2月18日 至 2024年2月19日
(A) 配当等収益	5,522,855円
受取配当金	5,131,619
受取利息	763
その他収益金	488,975
支払利息	△98,502
(B) 有価証券売買損益	1,535,561,658
売買益	1,663,788,497
売買損	△128,226,839
(C) 信託報酬等	△147,907,066
(D) 当期損益金 (A+B+C)	1,393,177,447
(E) 前期繰越損益金	1,778,404,163
(F) 追加信託差損益金	△27,713,504
(配当等相当額)	(173,185,807)
(売買損益相当額)	(△200,899,311)
(G) 計 (D+E+F)	3,143,868,106
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金 (G+H)	3,143,868,106
追加信託差損益金	△27,713,504
(配当等相当額)	(173,228,338)
(売買損益相当額)	(△200,941,842)
分配準備積立金	3,171,581,610

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

*当ファンドの期首元本額は6,970,541,061円、期中追加設定元本額は62,444,897円、期中一部解約元本額は775,139,085円です。

*分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	77,766,289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)	1,315,411,158円
(C) 収益調整金額	173,228,338円
(D) 分配準備積立金額	1,778,404,163円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	3,344,809,948円
(F) 期末残存口数	6,257,846,873口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	5,344円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

投資対象とする投資信託証券を追加するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年5月18日)

投資対象とする投資信託証券を削除するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年11月18日)

実質信託報酬率がレンジの上限近くまで上昇していることから、ポートフォリオ改善に係る自由度・機動性の確保を目的として、運用管理費用(信託報酬)の実質的な負担の上限を以下の通り変更しました。

実質的な負担(新)	実質的な負担(旧)
年率1.628%～ <u>2.18965%</u> 程度(税抜1.48%～ <u>2.0013%</u> 程度)	年率1.628%～ <u>1.95965%</u> 程度(税抜1.48%～ <u>1.8013%</u> 程度)

(変更日:2023年11月18日)

組入投資信託証券の内容

■FOFs用国内株式エンハンスト運用戦略ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	日興アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の株式
運用の基本方針	この投資信託は、わが国の金融商品取引所上場株式(これに準ずるものを含みます。)に投資し、TOPIX(東証株価指数)の動きを上回る投資成果を目指して運用を行ないます。

●損益の状況

項 目	第 8 期 自 2022年2月16日 至 2023年2月15日
(A)配 当 等 収 益	△24,233円
受 取 利 息	101
支 払 利 息	△24,334
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,349,025,522
売 買 益	1,387,532,446
売 買 損	△38,506,924
(C)信 託 報 酬 等	△56,588,586
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,292,412,703
(E)前 期 繰 越 損 益 金	3,090,267,805
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,437,941,151
(配 当 等 相 当 額)	(1,952,788,110)
(売 買 損 益 相 当 額)	(485,153,041)
(G) 計 (D+E+F)	6,820,621,659
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	6,820,621,659
追 加 信 託 差 損 益 金	2,437,941,151
(配 当 等 相 当 額)	(1,955,542,358)
(売 買 損 益 相 当 額)	(482,398,793)
分 配 準 備 積 立 金	4,382,680,508

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 7 期 末	第 8 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド	9,058,175	9,282,749	16,468,525

下記は、国内株式エンハンスト運用戦略マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第7期末	第8期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
水産・農林業(0.0%)			
ホクリョウ	—	1.7	1,397
鉱業(1.2%)			
三井松島ホールディングス	0.8	4	14,900
I N P E X	62.9	110.7	161,954
石油資源開発	5.7	2.6	12,428
建設業(1.0%)			
コムシスホールディングス	6.5	32.4	81,129
東建コーポレーション	0.1	—	—
大林組	—	3	2,910
長谷工コーポレーション	60.7	—	—
熊谷組	1.6	—	—
植木組	—	2.1	2,830
日本ハウスホールディングス	24.6	—	—
東亜道路工業	0.5	—	—
若築建設	6.1	—	—
住友林業	36.8	—	—
巴コーポレーション	5.3	8.1	3,329
大和ハウス工業	—	14.3	44,444
積水ハウス	130.4	—	—
ユアテック	17.1	2	1,498
四電工	2.3	—	—
関電工	17.3	0.4	349
日本電設工業	2.7	—	—
太平電業	—	3.1	11,563
三晃金属工業	—	2.1	7,969
食料品(1.0%)			
ニッポン	—	17.1	27,513
日本甜菜製糖	0.7	—	—
森永製菓	4.5	—	—
森永乳業	3.7	0.9	4,284
ヤクルト本社	6.1	—	—
雪印メグミルク	—	0.6	1,049
S F o o d s	5	—	—
柿安本店	0.2	—	—
伊藤ハム米久ホールディングス	11.4	—	—
宝ホールディングス	16.1	—	—
養命酒製造	—	1.6	2,953
サントリー食品インターナショナル	—	13.7	64,253
キッコーマン	—	4.7	30,268
アリアケジャパン	8.7	2.1	9,775
東洋水産	0.3	5.4	30,132
永谷園ホールディングス	4.2	—	—

銘柄	第7期末	第8期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
繊維製品(0.5%)			
富士紡ホールディングス	3.1	—	—
倉敷紡績	4.8	1.1	2,651
アツギ	1	—	—
ワールド	3.7	12.2	16,238
ゴールドウイン	—	6.4	69,120
パルプ・紙(0.0%)			
ザ・バック	—	1.1	3,113
化学(2.4%)			
住友化学	—	30.8	14,383
住友精化	4.6	3.3	13,744
日産化学	1.1	—	—
クレハ	—	1.4	11,396
日本曹達	—	2.9	12,513
東ソー	61.3	—	—
大阪ソーダ	0.9	—	—
関東電化工業	9	—	—
信越化学工業	—	0.9	17,500
堺化学工業	1.4	—	—
日本パーカラライジング	—	3.7	3,466
KHネオケム	7.1	—	—
積水化学工業	45.5	35.4	64,286
日本ゼオン	15.5	—	—
旭有機材	2.4	7.3	19,907
大倉工業	—	1.3	2,471
積水化成成品工業	—	11.9	4,593
ミライアル	3.1	—	—
竹本容器	4.1	—	—
森六ホールディングス	—	6.1	10,912
恵和	—	4.6	6,923
カーリットホールディングス	4.2	—	—
大日本塗料	—	7.1	5,836
関西ペイント	—	47.3	86,653
富士フィルムホールディングス	28.6	—	—
コーセー	0.9	—	—
コタ	8.2	—	—
小林製菓	—	7.8	66,690
タカラバイオ	9.1	5.8	10,521
デクセリアルズ	—	8.7	24,064
大成ラミック	0.5	—	—
クミアイ化学工業	—	7.2	6,141
日東電工	13.4	—	—
バルカー	—	2.1	6,678
ユニ・チャーム	33	—	—

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
医薬品(5.4%)				
協和キリン	31.4	9.5	28,547	
アステラス製薬	91.6	—	—	
塩野義製薬	30.9	54.4	342,393	
日本新薬	—	11.6	74,588	
中外製薬	82.9	—	—	
ロート製薬	20.9	35.1	90,171	
小野薬品工業	7.7	87.1	248,626	
参天製薬	7.9	—	—	
生化学工業	—	1.1	903	
東和薬品	5	—	—	
大塚ホールディングス	33.5	18	75,564	
大正製薬ホールディングス	—	3.7	20,017	
パプチドリーム	26.5	—	—	
あすか製薬ホールディングス	1.7	—	—	
石油・石炭製品(0.0%)				
ユシロ化学工業	—	3.5	2,898	
出光興産	13.8	—	—	
コスモエネルギーホールディングス	18.9	—	—	
ゴム製品(0.1%)				
横浜ゴム	20.3	—	—	
藤倉コンポジット	15.1	12.4	11,866	
ニッタ	0.5	—	—	
ガラス・土石製品(0.4%)				
日本山村硝子	3.3	5.1	2,866	
日本電気硝子	6.4	—	—	
ノリタケカンパニーリミテド	0.3	—	—	
日本特殊陶業	54	24.4	65,196	
フジインコーポレーテッド	0.7	—	—	
鉄鋼(1.4%)				
日本製鉄	—	8.8	26,012	
神戸製鋼所	37.4	—	—	
中山製鋼所	39.5	—	—	
合同製鐵	—	0.9	2,916	
東京製鐵	12.8	6.1	9,058	
共英製鋼	—	14.3	21,593	
大和工業	16.7	21.1	110,142	
東京鐵鋼	—	12.4	20,931	
モリ工業	2.7	—	—	
日本冶金工業	—	1.9	8,027	
愛知製鋼	—	5.7	12,773	
栗本鐵工所	—	5	10,020	
日亜鋼業	—	6.8	1,795	
日本精練	0.7	—	—	
エンビプロ・ホールディングス	3.7	—	—	
新家工業	3.2	—	—	

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
非鉄金属(0.1%)				
三井金属鉱業	7	—	—	
住友金属鉱山	14.2	—	—	
古河機械金属	1.6	—	—	
フジクラ	1.3	—	—	
カナレ電気	—	2.5	3,260	
平河ヒューテック	—	0.9	1,171	
リョービ	—	3.8	5,031	
アーレスティ	—	17.6	9,116	
金属製品(1.9%)				
稲葉製作所	—	8.5	11,832	
SUMCO	27.6	56.6	108,785	
川田テクノロジーズ	0.4	—	—	
RS Technologies	—	0.1	357	
信和	3.1	—	—	
東洋製罐グループホールディングス	7	—	—	
コロナ	—	5.5	4,994	
駒井ハルテック	0.2	—	—	
三和ホールディングス	—	93	130,479	
文化シャッター	0.2	—	—	
三協立山	—	6.2	3,949	
LIXIL	7.1	—	—	
ノーリツ	—	14.4	21,916	
ダイニチ工業	—	3	2,016	
三洋工業	—	1.6	3,025	
高周波熱練	4.3	—	—	
日本発條	—	30.3	26,845	
機械(7.7%)				
タクマ	—	16.8	23,150	
オークマ	—	12.5	65,750	
アマダ	51.1	—	—	
TAKISAWA	0.5	—	—	
FUJI	—	53.5	109,354	
牧野フライス製作所	1.4	4.6	21,689	
旭ダイヤモンド工業	3.2	—	—	
ディスコ	1.2	—	—	
日東工器	3.6	3.6	6,044	
フリュー	1.5	—	—	
日阪製作所	—	9.5	8,607	
やまびこ	1.3	—	—	
野村マイクロ・サイエンス	—	1.4	6,398	
SMC	2	0.3	20,208	
小松製作所	27.6	122.1	394,016	
住友重機械工業	—	46.4	132,332	
ローツェ	—	0.4	4,160	

銘柄	第 7 期 末			第 8 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)
クボタ	—	14.9	30,179			
帝国電機製作所	—	2.3	5,828			
小森コーポレーション	4.7	—	—			
住友精密工業	4	—	—			
日本ギア工業	—	4.1	1,972			
西島製作所	1.4	—	—			
オルガノ	0.6	—	—			
椿本チエイン	5	13	39,975			
ダイフク	1.6	—	—			
SANKYO	14.3	22.9	127,095			
ダイコク電機	—	1.5	3,810			
竹内製作所	2.3	—	—			
マックス	—	1.7	3,627			
グローリー	5	—	—			
大和冷機工業	10.4	2.8	3,427			
日本ピストンリング	1.6	—	—			
リケン	0.9	5.4	13,710			
T P R	—	13	17,485			
ホシザキ	—	20.8	96,720			
日本精工	—	80.3	58,859			
ジェイテクト	—	34.9	34,725			
日本トムソン	—	2.5	1,560			
日本ピラー工業	1.3	—	—			
キッツ	0.3	—	—			
三菱重工業	90.4	—	—			
スター精密	—	7.3	11,964			
電気機器 (18.7%)						
ブラザー工業	16.5	26.4	52,060			
日立製作所	—	11.5	79,706			
三菱電機	—	261.2	397,154			
富士電機	—	13.8	72,036			
東洋電機製造	—	4.1	3,534			
オリジン	2.2	—	—			
デンヨー	—	3	4,662			
PHCホールディングス	—	18.5	26,177			
マブチモーター	—	6.4	23,296			
東光高岳	7.3	—	—			
ダブル・スコープ	—	0.7	884			
ヤーマン	—	2	2,772			
JVCケンウッド	—	12	4,740			
I P E X	8.5	—	—			
日本電気	—	3.2	15,536			
サンケン電気	0.3	—	—			
ルネサスエレクトロニクス	—	23.9	41,048			
アクセル	6.3	2.4	4,046			

銘柄	第 7 期 末			第 8 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)
京三製作所	7.5	—	—			
ソニーグループ	54.3	44	515,020			
TDK	—	12.3	56,149			
鈴木	—	7.2	7,149			
ホシデン	0.7	0.2	319			
ヒロセ電機	3	2.9	49,126			
マクセル	16.4	—	—			
アイコム	—	3.4	8,802			
リオン	1	—	—			
横河電機	—	18.1	38,426			
日本光電工業	24.4	—	—			
堀場製作所	1.2	21.3	142,710			
アドバンテスト	5.1	—	—			
キーエンス	0.3	7.6	452,276			
シスメックス	0.7	—	—			
日本マイクロニクス	3.1	—	—			
OBARA GROUP	—	1	3,815			
コーセル	—	3.2	3,456			
ウシオ電機	1.2	—	—			
遠藤照明	1.6	—	—			
山一電機	5.1	—	—			
日本電子	1.2	1.5	6,067			
ファナック	4.8	7.6	174,116			
エンブラス	—	2.9	11,397			
ローム	2	—	—			
京セラ	46.4	55.7	366,617			
太陽誘電	0.9	—	—			
村田製作所	21.7	—	—			
日本ケミコン	—	0.8	1,635			
ミツバ	—	6.3	3,112			
キャノン電子	—	4.8	8,472			
キャノン	99.4	—	—			
MUTOHホールディングス	—	1.8	2,971			
東京エレクトロン	2.2	9.6	447,072			
輸送用機器 (8.1%)						
ユニプレス	—	14.1	10,307			
豊田自動織機	3	20	154,600			
川崎重工業	—	3.4	10,285			
日産自動車	487	349.8	171,297			
トヨタ自動車	149.6	146.8	275,103			
NOK	66.7	—	—			
マツダ	29.6	22.4	24,864			
本田技研工業	116.5	127.7	428,433			
SUBARU	—	98.9	212,635			
ヤマハ発動機	32.8	4.1	13,776			

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
T B K	—	3.1	744	—
エクセディ	2.5	—	—	—
日本プラスト	—	9.6	3,782	—
ヨロズ	8	15.6	11,497	—
シマノ	10.3	—	—	—
精密機器 (2.3%)				
テルモ	20.3	94.3	358,151	—
島津製作所	10.1	—	—	—
J M S	—	5.4	2,743	—
長野計器	1.2	3	3,492	—
東京精密	1.7	—	—	—
ニコン	63	—	—	—
理研計器	—	1.4	6,860	—
H O Y A	18.9	—	—	—
シチズン時計	9.2	—	—	—
その他製品 (1.8%)				
中本バックス	0.1	—	—	—
バテマウントベッドホールディングス	0.4	—	—	—
トランザクション	—	3.6	5,540	—
S H O E I	1.2	—	—	—
パイロットコーポレーション	5.7	—	—	—
フジシールインターナショナル	2.5	—	—	—
タカラトミー	1.2	—	—	—
大建工業	2.3	—	—	—
凸版印刷	—	41	94,546	—
N I S S H A	4	—	—	—
クリナップ	8	6.3	3,975	—
任天堂	—	36	192,096	—
三菱鉛筆	10.5	—	—	—
タカラスタンダード	8.6	—	—	—
グローブライド	0.1	—	—	—
電気・ガス業 (1.0%)				
中部電力	—	20.6	28,675	—
沖縄電力	0.7	—	—	—
電源開発	63.5	36.6	78,543	—
エフオン	—	2.1	1,159	—
東京瓦斯	—	2.3	6,242	—
東邦瓦斯	—	18.4	46,018	—
陸運業 (2.1%)				
S B S ホールディングス	—	8.4	26,292	—
東武鉄道	6.2	19.1	57,873	—
東海旅客鉄道	7.9	15.7	240,288	—
阪急阪神ホールディングス	24.5	1.5	5,760	—
南海電気鉄道	2.2	—	—	—
名古屋鉄道	20.7	—	—	—

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
丸全昭和運輸	2.6	—	—	—
トナミホールディングス	—	0.8	2,964	—
S G ホールディングス	3.7	—	—	—
海運業 (0.8%)				
日本郵船	8	—	—	—
商船三井	8.3	38.1	129,159	—
川崎汽船	5.2	0.5	1,645	—
乾汽船	0.9	—	—	—
空運業 (0.0%)				
A N A ホールディングス	27.9	—	—	—
パスコ	—	0.9	1,253	—
倉庫・運輸関連業 (0.2%)				
日新	2.8	1.6	3,300	—
三井倉庫ホールディングス	1.1	1.2	4,812	—
住友倉庫	1.3	—	—	—
日本トランスシティ	—	10.4	5,824	—
ファイズホールディングス	0.3	—	—	—
近鉄エクスプレス	2.6	—	—	—
エーアイティ	2.3	—	—	—
内外トランスライン	10.1	5.7	12,306	—
日本コンセプト	8.4	—	—	—
情報・通信業 (7.5%)				
クロスキャット	0.8	1.8	2,341	—
コア	0.6	—	—	—
ソリトンシステムズ	—	2.2	2,263	—
ソフトクリエイトホールディングス	0.6	—	—	—
T I S	5.8	24.8	85,684	—
三菱総合研究所	0.7	—	—	—
クロス・マーケティンググループ	—	5.4	3,423	—
じげん	34	16.8	6,854	—
S H I F T	0.6	—	—	—
システムリサーチ	2.2	2.1	4,613	—
インターネットイニシアティブ	—	11.8	30,597	—
フリービット	—	0.3	343	—
アステリア	10.7	—	—	—
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7.6	0.8	1,308	—
ネオジャパン	4.8	—	—	—
P R T I M E S	4.1	—	—	—
ノムラシステムコーポレーション	8.1	—	—	—
チェンジ	0.1	0.8	2,036	—
シンクロ・フード	5.5	27.5	13,915	—
ビーグリー	—	1.2	1,501	—
オロ	0.8	0.4	730	—
ソルクシーズ	—	12.4	4,364	—
ハイマックス	3	—	—	—

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
野村総合研究所	13.9	18.9	57,078	
システムサポート	1.9	—	—	
クレスコ	4.1	—	—	
オービック	0.9	2.1	43,029	
TDCソフト	1.5	—	—	
Zホールディングス	—	730.9	281,835	
日本オラクル	4.3	—	—	
S Bテクノロジー	1.4	—	—	
伊藤忠テクノソリューションズ	6.3	—	—	
アイティフォー	2.4	—	—	
東計電算	—	0.2	1,180	
デジタルガレージ	0.6	—	—	
ビジネスエンジニアリング	—	3.7	9,819	
日本テレビホールディングス	58.1	—	—	
朝日放送グループホールディングス	4.9	—	—	
スカパーJ SATホールディングス	0.1	—	—	
テレビ東京ホールディングス	1.5	—	—	
日本電信電話	—	29.3	113,801	
KDD I	109.6	120.5	484,771	
光通信	0.4	—	—	
D T S	—	2.3	7,256	
カプコン	21.3	—	—	
アイ・エス・ピー	—	4.7	5,569	
ジャステック	—	7.4	9,161	
S C S K	2.9	—	—	
アイネス	—	4.4	5,953	
ミログ情報サービス	—	2.8	4,846	
ソフトバンクグループ	56.2	4.2	24,322	
卸売業(9.1%)				
伊藤忠食品	—	1.2	5,970	
エレマテック	—	3.5	6,034	
あらた	0.4	—	—	
双日	—	13.2	34,042	
神戸物産	9	—	—	
あいホールディングス	3	—	—	
マクニカホールディングス	3.9	3.9	13,513	
バイタルケ-エスケ-ホールディングス	12.6	—	—	
ジュ-テックホールディングス	1.6	—	—	
エコートレーディング	—	5.7	4,463	
三菱食品	10.6	6.7	22,143	
メディバルホールディングス	—	22.4	38,550	
ドウシシャ	—	1.5	2,676	
丸文	1.7	6.4	8,556	
エスケイジャパン	1.4	—	—	
伊藤忠商事	106.4	—	—	

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
丸紅	273.2	169.7	297,823	
長瀬産業	—	6.4	13,107	
蝶理	—	4.2	10,533	
豊田通商	—	21	117,390	
三井物産	—	9.9	38,936	
住友商事	84.5	135.8	321,642	
内田洋行	—	0.6	2,823	
三菱商事	33.7	98.8	456,159	
キャノンマーケティングジャパン	19	—	—	
ユアサ商事	9.3	—	—	
阪和興業	6.1	1.3	5,063	
ニチモウ	0.3	—	—	
三愛オブリ	4.8	—	—	
ワキタ	—	0.9	1,041	
サンゲツ	—	7	16,604	
サンワテクノス	5.2	1.9	3,686	
リョ-サン	—	2.3	7,084	
加賀電子	0.5	2	8,940	
立花エレテック	1.5	3.3	6,154	
西本Wismettacホールディングス	1.1	—	—	
K P Pグループホールディングス	—	13.1	9,733	
泉州電業	—	2.5	9,162	
加藤産業	—	1.7	6,196	
イエローハット	3.8	—	—	
J Kホールディングス	9.7	0.1	103	
杉本商事	—	1.7	3,299	
ミスミグループ本社	21.5	—	—	
小売業(2.3%)				
ハードオフコーポレーション	—	3.3	4,181	
パルグループホールディングス	1.3	1.3	3,597	
ハローズ	—	3.2	10,192	
ハニーズホールディングス	—	10.4	15,121	
DCMホールディングス	6.2	—	—	
M o n o t a R O	—	13.7	25,893	
J. フロント リテイリング	3.3	—	—	
Z O Z O	13.3	42.7	133,010	
トレジャー・ファクトリー	—	5.8	14,117	
H a m e e	3.1	—	—	
ミサワ	7.1	—	—	
シュッピン	17	2.5	2,265	
ジョイフル本田	3.5	—	—	
ヨシックスホールディングス	0.1	—	—	
B E E N O S	—	0.1	250	
コスモス薬品	—	1	12,550	
セブン&アイ・ホールディングス	31.1	—	—	

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
トリドールホールディングス	0.5	—	—	—
串カツ田中ホールディングス	0.1	—	—	—
パロックジャパンリミテッド	2.1	—	—	—
クスリのアオキホールディングス	0.1	1.8	12,654	—
力の源ホールディングス	—	0.6	814	—
メディカルシステムネットワーク	—	11.4	4,571	—
コナカ	—	9.2	3,210	—
コーナン商事	0.6	—	—	—
エコス	4.3	—	—	—
バン・バシフィック・インターナショナルホ	61.8	19.9	48,197	—
フジ・コーポレーション	—	0.4	500	—
ユナイテッドアローズ	—	4.2	7,278	—
ピーシーデポコーポレーション	—	4.6	1,324	—
スギホールディングス	—	0.7	3,948	—
薬王堂ホールディングス	—	0.5	1,210	—
ライフコーポレーション	2	—	—	—
コメリ	3.7	1.8	4,777	—
青山商事	2.1	3	2,724	—
しまむら	—	1.9	23,997	—
高島屋	27.8	—	—	—
エイチ・ツー・オー リテイリング	7.9	—	—	—
日産東京販売ホールディングス	12.9	—	—	—
ギフトホールディングス	6.6	0.6	2,460	—
ヤマダホールディングス	—	19.9	9,472	—
パローホールディングス	1.9	9.4	18,113	—
サンドラッグ	1.4	—	—	—
やまや	2.3	1.1	2,875	—
銀行業(7.7%)				
いよぎんホールディングス	—	47.5	38,047	—
じもとホールディングス	5.6	11.1	4,850	—
東京きらぼしフィナンシャルグループ	9.7	2.9	8,729	—
ゆうちょ銀行	3.4	23	27,646	—
富山第一銀行	22.6	—	—	—
西日本フィナンシャルホールディングス	—	8.6	9,511	—
三十三フィナンシャルグループ	—	10.9	18,649	—
第四北越フィナンシャルグループ	2.9	—	—	—
あおぞら銀行	24	—	—	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	334.2	342.8	336,321	—
三井住友フィナンシャルグループ	83.4	43.4	256,537	—
群馬銀行	111.2	—	—	—
武蔵野銀行	—	1	2,470	—
七十七銀行	—	2.1	5,016	—
岩手銀行	—	7.3	17,359	—
八十二銀行	237.4	—	—	—
滋賀銀行	2	—	—	—

銘柄	第7期末		第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
南都銀行	0.6	—	—	—
大分銀行	—	3.1	6,968	—
宮崎銀行	—	4.3	11,932	—
みずほフィナンシャルグループ	—	215.8	463,322	—
高知銀行	—	4.1	3,025	—
山口フィナンシャルグループ	1.3	25	22,900	—
トマト銀行	—	1.3	1,424	—
北日本銀行	2.1	—	—	—
トモニホールディングス	—	49.9	19,610	—
池田泉州ホールディングス	83.8	—	—	—
証券・商品先物取引業(2.6%)				
F P G	—	4.2	4,842	—
S B Iホールディングス	29	—	—	—
大和証券グループ本社	—	190.3	118,176	—
野村ホールディングス	478	530.3	287,581	—
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19.4	—	—	—
マネックスグループ	—	9.7	4,820	—
岩井コスモホールディングス	5.6	—	—	—
保険業(1.0%)				
SOMPOホールディングス	15.2	—	—	—
MS&ADインシュアランスグループホール	—	13.1	56,985	—
第一生命ホールディングス	—	37	112,850	—
その他金融業(3.7%)				
ジェイリース	0.1	—	—	—
クレディセゾン	9.6	22.2	39,782	—
芙蓉総合リース	—	0.8	7,160	—
みずほリース	3.2	11.3	40,058	—
日本証券金融	—	8	8,096	—
アコム	—	322.2	104,392	—
ジャックス	3	—	—	—
オリックス	—	167.8	395,924	—
九州リースサービス	—	3.3	2,824	—
不動産業(1.0%)				
いちご	—	8.2	2,369	—
ヒューリック	—	56.6	60,788	—
プレサンスコーポレーション	—	1	1,591	—
東急不動産ホールディングス	—	5	3,170	—
飯田グループホールディングス	11	—	—	—
ファーストブラザーズ	—	1.2	1,029	—
シーアールイー	2.3	—	—	—
グッドコムアセット	—	17.1	14,090	—
ロードスターキャピタル	—	6.5	10,146	—
フェイスネットワーク	—	1.5	2,473	—
パーク24	—	13.3	27,171	—
東京建物	0.6	—	—	—

銘柄	第7期末	第8期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
スターツコーポレーション	2.1	7.6	19,471
ゴールドクレスト	7.2	—	—
エスリード	—	6.6	13,860
ファースト住建	3.3	—	—
グランディアハウス	0.4	—	—
サービス業(7.0%)			
L I F U L L	—	61.9	12,070
ジェイエイシーリクルートメント	3.9	0.3	681
日本M&Aセンターホールディングス	20.2	—	—
U T グループ	0.1	1.5	3,624
アイティメディア	7.3	6.4	9,388
オープンアップグループ	—	0.6	1,122
サニーサイドアップグループ	—	8.8	4,796
パソルホールディングス	10.6	—	—
アイ・ケイ・ケイホールディングス	—	7.2	4,521
学情	—	1.3	1,792
カカコム	—	12.2	24,680
キャリアデザインセンター	—	5.6	10,785
ベネフィット・ワン	1.5	—	—
ツカダ・グローバルホールディング	—	6.8	2,563
WDBホールディングス	1.9	—	—
J Pホールディングス	49.4	—	—
アミューズ	—	2.4	4,154
クイック	—	6.7	12,194
H. U. グループホールディングス	12.1	—	—
オリエンタルランド	2.4	—	—
ダスキン	12.5	—	—
ラウンドワン	—	11.8	5,546
ビー・エム・エル	5	—	—
りらいあコミュニケーションズ	0.8	—	—
サイバーエージェント	34.6	—	—
フルキャストホールディングス	—	2.6	6,913
エン・ジャパン	1.3	—	—
ベクトル	—	1.6	1,996
キャリアリンク	4.7	6.7	16,616
ライドオンエクスプレスホールディングス	2.1	—	—
E R Iホールディングス	11.4	—	—
ウィルグループ	2	—	—
リクルートホールディングス	17.4	100.9	402,591
日本郵政	34.6	318.9	379,012
セラク	—	2.9	4,277
ペイカレント・コンサルティング	1.7	17.9	98,271
ウェルビー	4.9	—	—
日総工産	—	20.2	12,726
スプリックス	0.5	—	—

銘柄	第7期末	第8期末		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	
Fast Fitness Japan	0.1	10.4	14,424	
建設技術研究所	3.3	—	—	
トランス・コスモス	2.8	—	—	
メイテック	—	40.3	98,614	
学究社	5.4	3.1	6,085	
ステップ	—	2.1	3,723	
合計	株数・金額	6,241	8,005	16,208,794
	銘柄数<比率>	345	328	<95.8%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別		第8期末	
		買建額 (百万円)	売建額 (百万円)
国内	TOPIX先物	654	—

組入投資信託証券の内容

■国内株式アクティブバリューファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の金融商品取引所上場株式
運用の基本方針等	この投資信託は、長期的な観点からわが国の株式市場全体(TOPIX(東証株価指数)配当込み)の動きを上回る投資成果の獲得を目指して運用を行いません。

●損益の状況

項目	第 5 期 自 2022年10月26日 至 2023年10月25日
(A)配当等収益	△86,712円
受取利息	532
支払利息	△87,244
(B)有価証券売買損益	7,523,114,646
売買益	8,365,284,128
売買損	△842,169,482
(C)信託報酬等	△193,281,464
(D)当期損益金(A+B+C)	7,329,746,470
(E)前期繰越損益金	6,405,554,909
(F)追加信託差損益金	△409,439,571
(配当等相当額)	(2,247,520,058)
(売買損益相当額)	(△2,656,959,629)
(G)計(D+E+F)	13,325,861,808
(H)収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	13,325,861,808
追加信託差損益金	△409,439,571
(配当等相当額)	(2,251,683,622)
(売買損益相当額)	(△2,661,123,193)
分配準備積立金	13,735,301,379

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 4 期 末	第 5 期 末	期 末
	口 数	口 数	評 価 額
アクティブバリュー マザーファンド	千口 6,739,222	千口 6,327,486	千円 38,895,695

下記は、アクティブバリュー マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
建設業(4.5%)				
熊谷組	183.7	150	548,250	
五洋建設	—	382.8	322,700	
大和ハウス工業	208.6	188.5	759,843	
きんでん	—	124.4	263,292	
日揮ホールディングス	156.6	204.7	377,159	
食料品(2.6%)				
アサヒグループホールディングス	76.6	84	449,988	
アリアケジャパン	14.5	70.2	327,342	
東洋水産	—	79.8	505,852	
パルプ・紙(0.9%)				
レンゴー	918.9	476.3	469,679	
化学(7.0%)				
クレハ	27.5	—	—	
エア・ウォーター	493.2	290.3	534,732	
カネカ	52.4	—	—	
三菱瓦斯化学	159.2	254.2	507,637	
KHネオケム	315.7	214.6	477,485	
ADEKA	—	197.4	503,764	
エスケー化研	—	8.2	57,646	
富士フイルムホールディングス	79	45.3	378,119	
ライオン	576.8	421.6	605,206	
上村工業	—	35.2	285,824	
JSP	84.8	92.9	172,979	
医薬品(2.5%)				
武田薬品工業	—	175.6	764,211	
小野薬品工業	263	—	—	
久光製薬	—	83.3	407,836	
参天製薬	206.1	—	—	
ツムラ	144.6	—	—	
鳥居薬品	68.6	16	59,200	
石油・石炭製品(2.5%)				
出光興産	—	222.3	748,039	
ENEOSホールディングス	1,359.7	893.1	492,723	
ゴム製品(1.3%)				
横浜ゴム	—	239.8	670,840	
ガラス・土石製品(3.1%)				
日東紡績	—	242.3	891,664	
AGC	115.8	97.1	492,685	
東洋炭素	77	34.2	173,394	
鉄鋼(0.9%)				
日本製鉄	—	135.8	435,510	

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
非鉄金属(1.2%)				
住友金属鉱山	89.3	89.5	368,471	
住友電気工業	194.9	146.9	234,305	
金属製品(1.2%)				
SUMCO	150.9	192	370,080	
東プレ	—	131.5	210,268	
機械(8.1%)				
芝浦機械	215.6	—	—	
NITTOKU	—	185.3	422,484	
ナブテスコ	145.7	98.3	265,164	
三井海洋開発	—	217.5	360,180	
小松製作所	100.1	—	—	
TOWA	—	121.3	619,843	
ローツェ	—	25.5	302,940	
ダイキン工業	20.9	—	—	
オルガノ	102.4	—	—	
タダノ	260.1	216	245,484	
アマノ	229.9	172.3	528,961	
THK	131.1	170.4	463,232	
マキタ	—	138.1	498,264	
IHI	137.8	121.4	348,600	
電気機器(14.1%)				
日立製作所	210.8	120.7	1,059,625	
富士電機	153.6	—	—	
マブチモーター	211.6	61.4	265,923	
IPEX	—	148.8	223,944	
ルネサスエレクトロニクス	—	117.7	256,762	
アルバック	—	121.3	655,990	
アンリツ	120.8	—	—	
ソニーグループ	111.9	138	1,738,800	
TDK	108.6	150.1	848,965	
日本光電工業	47	—	—	
山一電機	—	183	319,518	
京セラ	—	72.1	529,718	
太陽誘電	—	159.5	557,931	
村田製作所	59.1	—	—	
市光工業	680.5	567.2	296,078	
SCREENホールディングス	25.4	40.2	301,017	
輸送用機器(10.1%)				
デンソー	—	304.1	701,710	
トヨタ自動車	744.4	616.3	1,627,032	
NOK	233.6	—	—	

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
カヤバ	—	64.2	281,196	
太平洋工業	257.1	256.8	341,287	
マツダ	—	182.8	278,404	
本田技研工業	380.3	816.9	1,323,786	
豊田合成	—	163.3	483,694	
精密機器 (1.6%)				
テルモ	78.4	—	—	
オリンパス	249.4	275.6	530,943	
A&Dホロンホールディングス	—	172.9	263,499	
その他製品 (0.5%)				
タカラトミー	110.6	131	267,109	
電気・ガス業 (1.0%)				
中部電力	229.2	281	500,039	
陸運業 (2.0%)				
東日本旅客鉄道	66.4	38.2	294,140	
西日本鉄道	—	131	313,810	
ヤマトホールディングス	243.3	162.8	391,127	
セイノーホールディングス	167.2	—	—	
空運業 (0.5%)				
日本航空	177	93.2	253,550	
倉庫・運輸関連業 (1.0%)				
上組	212.1	164.5	497,283	
情報・通信業 (6.6%)				
NECネットエスアイ	512.3	89.7	175,453	
ネクソン	74.5	—	—	
ウイングアーク1st	—	260.2	695,254	
BIPROGY	229	109.9	392,672	
日本電信電話	237.4	4,435.7	775,360	
ソフトバンクグループ	124.4	201.2	1,268,968	
卸売業 (6.0%)				
伊藤忠商事	237	158.2	851,432	
住友商事	—	182.2	537,763	
三菱商事	216.8	153.3	1,075,552	
岩谷産業	42.6	18.9	133,963	
ミスミグループ本社	—	172.5	403,477	
小売業 (4.1%)				
くら寿司	124.4	—	—	
ジンズホールディングス	—	89.4	387,102	
J.フロントリテイリング	371.4	220.5	309,802	
ウエルシアホールディングス	70	—	—	
セブン&アイ・ホールディングス	—	44.6	240,706	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	144.5	112.9	318,829	
日本瓦斯	83.2	—	—	
ライフコーポレーション	84.6	92.9	326,543	
しまむら	—	32	473,120	

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
銀行業 (7.9%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,565.7	1,369.6	1,696,249	
三井住友フィナンシャルグループ	190.4	233.3	1,680,926	
千葉銀行	—	537.3	582,701	
証券・商品先物取引業 (—%)				
SBIホールディングス	82.3	—	—	
ジャフコグループ	185.1	—	—	
保険業 (2.2%)				
SOMPOホールディングス	59.1	53.9	343,612	
第一生命ホールディングス	199.8	241.4	741,098	
その他金融業 (1.4%)				
アルヒ	68.9	—	—	
東京センチュリー	112.2	46.3	264,002	
イオンフィナンシャルサービス	359.9	341.1	420,235	
不動産業 (1.5%)				
東急不動産ホールディングス	1,264	495.3	437,845	
三井不動産	199.3	93.8	309,633	
サービス業 (3.7%)				
ジェイエイシーリクルートメント	230.6	131.2	310,812	
総合警備保障	—	785.8	677,595	
セブテック・ホールディングス	1,239.6	1,371.6	562,356	
りらいあコミュニケーションズ	220.6	—	—	
リクルートホールディングス	50.2	6.8	29,233	
ダイセキ	152.6	72.4	293,220	
合計	株数・金額	20,971	25,374	50,040,302
	銘柄数<比率>	86	100	<97.8%>

(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。

組入投資信託証券の内容

■日本長期成長株集中投資ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	日本の上場株式(これに準ずるものを含みます。)
運用の基本方針等	この投資信託は、主として日本の上場株式(これに準ずるものを含みます。)に投資し、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

●損益の状況

項目	第 18 期 自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日
(A)有価証券売買損益	815,590,493円
売 買 益	989,974,490
売 買 損	△174,383,997
(B)信託報酬等	△452,771,952
(C)当期損益金(A+B)	362,818,541
(D)前期繰越損益金	22,029,351,373
(E)追加信託差損益金	60,198,913,094
(配当等相当額)	(43,607,713,432)
(売買損益相当額)	(16,591,199,662)
(F)計(C+D+E)	82,591,083,008
(G)収益分配金	△1,039,747,598
次期繰越損益金(F+G)	81,551,335,410
追加信託差損益金	60,198,913,094
(配当等相当額)	(43,653,088,184)
(売買損益相当額)	(16,545,824,910)
分配準備積立金	21,352,422,316

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 17 期 末	第 18 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本長期成長株集中投資マザーファンド	19,026,238	21,360,294	135,031,234

下記は、日本長期成長株集中投資マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第17期末	第18期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
食料品(3.7%)			
味の素	1,368.2	1,733.7	8,812,397
化学(11.6%)			
信越化学工業	2,048.9	2,282.1	12,457,983
三井化学	1,290.8	1,747.7	7,364,807
ユニ・チャーム	1,384.5	1,641	8,013,003
医薬品(3.3%)			
協和キリン	1,429.7	1,858.1	4,481,737
第一三共	683.8	869.6	3,482,748
機械(4.8%)			
ディスコ	—	94.4	3,108,592
SMC	36.2	22.5	1,643,400
ダイキン工業	168.2	—	—
ダイフク	—	2,424.2	6,887,152
電気機器(24.7%)			
イビデン	739.7	1,058.6	8,044,301
日立製作所	—	894.1	8,814,931
富士電機	1,376.3	1,233.1	7,359,140
ニデック	760.6	—	—
ソニーグループ	949.8	1,150	15,369,750
アドバンテスト	592.7	2,030.7	9,838,741
キーエンス	95.7	106.5	6,656,250
浜松ホトニクス	606.4	569.8	3,263,814
精密機器(8.2%)			
テルモ	879.3	1,117.8	5,194,416
オリンパス	3,502.3	3,257.5	6,873,325
HOYA	497.8	183.2	3,112,568
朝日インテック	717.5	1,677.4	4,663,172
その他製品(3.3%)			
アシックス	1,754.6	1,766.8	8,000,070
情報・通信業(13.7%)			
SHI FT	251.3	291.2	9,985,248
野村総合研究所	1,168.8	878.7	3,587,732
オービック	225.8	353	8,237,255
大塚商会	913.9	476.6	2,916,315
NTTデータグループ	3,133.7	—	—
カブコン	1,475.8	1,783.5	8,236,203
小売業(12.7%)			
パン・パシフィック・インターナショナルホ	1,855.1	1,821.8	6,126,713
しまむら	334.2	155.9	2,512,328
ニトリホールディングス	548.1	682.2	12,736,674
ファーストリテイリング	—	257.9	9,176,082

銘柄	第17期末	第18期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
保険業(4.3%)			
東京海上ホールディングス	2,998.1	2,939.8	10,265,781
その他金融業(3.8%)			
オリックス	3,114.9	3,469.5	9,206,318
サービス業(5.9%)			
リクルートホールディングス	1,903.5	2,389.2	14,132,118
合計	株数・金額	38,806	240,561,072
	銘柄数<比率>	32	33 <97.1%>

(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。

組入投資信託証券の内容

■FOFs用国内株式EVIバリュートファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	三井住友DSアセットマネジメント株式会社
運 用 方 針	日本株EVIハイアルファマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に以下のような運用を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果を目指します。 ・日本の株式を主要投資対象とします。 ・運用に当たっては、独自算出に基づく企業価値や各種バリュート指標(PBR、PER、配当利回り)等による割安と判断される銘柄の中から、ファンダメンタル分析により投資魅力のある銘柄に厳選投資します。
主 要 運 用 対 象	「日本株EVIハイアルファマザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

●損益の状況

項 目	第 2 期 自 2022年6月7日 至 2023年6月6日
(A)配 当 等 収 益	△29円
受 取 利 息	1
支 払 利 息	△30
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	4,917,295,872
売 買 益	4,987,873,833
売 買 損	△70,577,961
(C)信 託 報 酬 等	△115,032,675
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	4,802,263,168
(E)前 期 繰 越 損 益 金	765,180,502
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,315,646,921
(配 当 等 相 当 額)	(573,791,417)
(売 買 損 益 相 当 額)	(741,855,504)
(G)合 計 (D+E+F)	6,883,090,591
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	6,883,090,591
追 加 信 託 差 損 益 金	1,315,646,921
(配 当 等 相 当 額)	(584,279,195)
(売 買 損 益 相 当 額)	(731,367,726)
分 配 準 備 積 立 金	5,567,443,670

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	第 2 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本株EVIハイアルファマザーファンド	4,625,941	6,768,428	31,021,062

下記は、日本株EVIハイアルファマザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第1期末	第2期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
鉱業(1.8%)			
INPEX	396	957	1,530,721
建設業(4.0%)			
長谷工コーポレーション	611	989	1,656,575
鹿島建設	893	844	1,769,868
西松建設	117	—	—
食料品(1.7%)			
日本ハム	477	—	—
東洋水産	195	228	1,467,864
繊維製品(—)			
東レ	1,460.3	—	—
化学(1.7%)			
東ソー	—	892	1,470,908
信越化学工業	85	—	—
三菱瓦斯化学	573	—	—
医薬品(2.5%)			
武田薬品工業	—	391	1,785,697
鳥居薬品	108	98	347,410
ガラス・土石製品(—)			
日本特殊陶業	486	—	—
ニチアス	211	—	—
鉄鋼(4.8%)			
日本製鉄	697	975	2,822,625
東京製鐵	654	—	—
大同特殊鋼	—	227	1,240,782
非鉄金属(1.8%)			
フジクラ	1,527	1,320	1,551,660
金属製品(—)			
日本発条	614	—	—
機械(10.1%)			
アマダ	601	1,296	1,811,808
住友重機械工業	—	401	1,314,077
荏原製作所	161	294	1,920,408
セガサミーホールディングス	413	765	2,196,697
ジェイテクト	—	1,102	1,327,359
IHI	246	—	—
電気機器(24.5%)			
コニカミノルタ	—	2,570	1,207,900
日立製作所	282	430	3,704,880
東芝	200	—	—
三菱電機	—	1,611	3,210,723
JVCケンウッド	—	2,680	1,323,920

銘柄	第1期末	第2期末	評価額 (千円)
	株数 (千株)	株数 (千株)	
日本電気	238.9	351	2,444,364
ルネサスエレクトロニクス	895	—	—
パナソニックホールディングス	—	1,894	3,092,902
TDK	276	309	1,708,461
アルプスアルパイン	871	—	—
ローム	—	128	1,617,920
京セラ	110	—	—
SCREENホールディングス	—	165	2,564,100
キヤノン	375	—	—
輸送用機器(14.8%)			
トヨタ紡織	456	—	—
いすゞ自動車	1,560	792	1,366,200
トヨタ自動車	—	2,461	5,045,050
三菱自動車工業	2,314	—	—
本田技研工業	—	634	2,692,598
スズキ	—	534	2,613,930
SUBARU	571	—	—
豊田合成	—	376	875,892
精密機器(—)			
ニコン	613	—	—
シチズン時計	1,611	—	—
その他製品(1.9%)			
凸版印刷	391	523	1,610,317
電気・ガス業(0.5%)			
東北電力	—	560	467,432
陸運業(1.0%)			
セイノーホールディングス	—	521	839,331
海運業(—)			
川崎汽船	123	—	—
情報・通信業(—)			
アカツキ	81	—	—
日本電信電話	1,211	—	—
卸売業(6.7%)			
マクニカホールディングス	90	—	—
三菱食品	—	118	418,310
丸紅	615	817	1,756,550
豊田通商	—	298	2,016,268
三菱商事	726	181	1,118,580
トラスコ中山	—	163	362,023
小売業(5.4%)			
J.フロントリテイリング	—	500	707,000
マツキヨココカラ&カンパニー	—	158	1,243,460

銘柄	第1期末	第2期末	評価額 (千円)	
	株数 (千株)	株数 (千株)		
ツルハホールディングス	—	113	1,126,723	
しまむら	104	118	1,500,370	
アークランズ	192	—	—	
銀行業(12.2%)				
めぶきフィナンシャルグループ	3,144	4,645	1,570,010	
ひろぎんホールディングス	—	1,100	846,450	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	3,147	5,097	4,940,522	
三井住友トラスト・ホールディングス	—	439	2,215,633	
山口フィナンシャルグループ	—	928	842,160	
保険業(2.9%)				
MS&ADインシュアランス グループホールディングス	—	494	2,500,628	
第一生命ホールディングス	334	—	—	
その他金融業(1.5%)				
オリックス	641	514	1,280,374	
不動産業(-)				
ヒューリック	1,096	—	—	
サービス業(-)				
日本郵政	1,775	—	—	
合計	株数・金額	34,568.2	43,001	85,045,441
	銘柄数<比率>	49	48	<98.5%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■グローバル株式コンセントレイト・ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社
運 用 方 針	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界各国の株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目指します。 有力な無形資産(特許、著作権、ブランド等)を有し、中長期的に株主価値の高い成長をもたらすことが期待される企業を厳選して投資を行います。
主 要 運 用 対 象	グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢの受益証券を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式の実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産の実質投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

●損益の状況

項 目	第 3 期 自 2022年4月16日 至 2023年4月17日
(A)配 当 等 収 益	△31円
支 払 利 息	△31
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	943,383,364
売 買 益	993,044,336
売 買 損	△49,660,972
(C)信 託 報 酬 等	△129,555,923
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	813,827,410
(E)前 期 繰 越 損 益 金	4,280,312,024
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	2,222,461,553
(配 当 等 相 当 額)	(1,050,177,296)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,172,284,257)
(G)計 (D+E+F)	7,316,600,987
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	7,316,600,987
追 加 信 託 差 損 益 金	2,222,461,553
(配 当 等 相 当 額)	(1,054,400,398)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,168,061,155)
分 配 準 備 積 立 金	5,094,139,434

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 2 期 末	第 3 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ	8,677,023	9,373,802	16,942,211

下記は、グローバル・フランチャイズ・マザーファンドⅢ全体の内容です。

<外国株式>

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	第 3 期 末		業 種	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)			千米ドル			
ABBOTT LABORATORIES	431	421	4,383	586,861	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTERNATIONAL	626	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON AND CO	159	164	4,213	564,173	ヘルスケア機器・サービス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTION	94	112	1,638	219,340	商業・専門サービス	
COCA-COLA CO	354	351	2,216	296,812	食品・飲料・タバコ	
DANAHER CORP	204	249	6,285	841,627	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EQUIFAX INC	35	117	2,300	308,048	商業・専門サービス	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	260	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	59	1,191	159,580	保険	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	355	454	4,882	653,741	金融サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	59	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
MOODY'S CORP	40	52	1,597	213,924	金融サービス	
NIKE INC-CL B	135	101	1,280	171,400	耐久消費財・アパレル	
OTIS WORLDWIDE CORP	222	260	2,119	283,791	資本財	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,035	888	8,837	1,183,213	食品・飲料・タバコ	
PROCTER & GAMBLE CO	265	231	3,502	468,982	家庭用品・パーソナル用品	
ROPER TECHNOLOGIES INC	56	67	2,982	399,338	ソフトウェア・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	96	99	5,871	786,111	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VISA INC-CLASS A SHARES	308	311	7,292	976,397	金融サービス	
ZOETIS INC	72	79	1,389	186,012	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCENTURE PLC-CL A	165	212	5,942	795,633	ソフトウェア・サービス	
STERIS PLC	11	80	1,505	201,569	ヘルスケア機器・サービス	
AON PLC-CLASS A	—	92	3,013	403,513	保険	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	184	138	2,983	399,440	商業・専門サービス	
CDW CORP	—	97	1,813	242,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MICROSOFT CORP	359	417	11,949	1,599,879	ソフトウェア・サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,533 23	5,065 23	89,194 —	11,942,228 <70.5%>	
(ドイツ)			千ユーロ			
SAP SE	471	582	6,760	993,720	ソフトウェア・サービス	
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	471 1	582 1	6,760 —	993,720 <5.9%>	
(フランス)						
L'OREAL	57	63	2,677	393,521	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON	35	31	2,830	416,035	耐久消費財・アパレル	
PERNOD-RICARD	108	173	3,630	533,689	食品・飲料・タバコ	
国 小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	201 3	269 3	9,137 —	1,343,246 <7.9%>	
(オランダ)						
HEINEKEN NV	230	305	3,093	454,741	食品・飲料・タバコ	

銘柄		第2期末 株数 (百株)	第3期末 株数 (百株)	評価額		業種
				外貨建金額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV		436	674	777	114,321	食品・飲料・タバコ
国小計	株数・金額	666	980	3,871	569,063	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<3.4%>	
(その他) RELX PLC		192	254	758	111,484	商業・専門サービス
国小計	株数・金額	192	254	758	111,484	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.7%>	
ユーロ計	株数・金額	1,533	2,086	20,527	3,017,514	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<17.8%>	
(イギリス)				千英ポンド		
EXPERIAN PLC		307	512	1,388	230,533	商業・専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		969	984	6,191	1,027,998	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC		734	975	2,572	427,067	商業・専門サービス
小計	株数・金額	2,012	2,473	10,151	1,685,599	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<9.9%>	
合計	株数・金額	9,078	9,626	—	16,645,341	
	銘柄数<比率>	33	33	—	<98.2%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■ブランディワイン・グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	日本を含む世界各国の金融商品取引所に上場している株式及び不動産投資信託を含む投資信託証券
運用の基本方針等	この投資信託は、MSCIオール・カントリー・ワールド・インデックス(税引き後配当込み、円換算ベース)をベンチマークとし、これを中長期的に上回る投資成果を目指します。

●損益の状況

項目	第 2 期 自 2022年9月16日 至 2023年9月15日
(A)有価証券売買損益	3,598,323,657円
売 買 益	3,650,133,113
売 買 損	△51,809,456
(B)信託報酬等	△124,106,900
(C)当期損益金(A+B)	3,474,216,757
(D)前期繰越損益金	993,002,178
(E)追加信託差損益金	2,132,041,565
(配当等相当額)	(555,629,583)
(売買損益相当額)	(1,576,411,982)
(F)計(C+D+E)	6,599,260,500
(G)収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	6,599,260,500
追加信託差損益金	2,132,041,565
(配当等相当額)	(561,253,254)
(売買損益相当額)	(1,570,788,311)
分配準備積立金	4,467,218,935

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	第 2 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ブランディワイン・グローバル・オポ チュニスティック株式・マザーファンド	14,312,328	20,176,569	27,056,780

下記は、ブランディワイン・グローバル・オポチュニスティック株式・マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第1期末	第2期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
食料品(一%)			
森永製菓	30.1	—	—
医薬品(8.6%)			
小野薬品工業	63.5	70.7	207,681
金属製品(一%)			
三和ホールディングス	124.6	—	—
機械(10.2%)			
ナブテスコ	—	89.5	246,975
電気機器(16.1%)			
村田製作所	30.6	21.3	175,597
小糸製作所	37.4	90.2	215,081
輸送用機器(一%)			
ヤマハ発動機	93.8	—	—
倉庫・運輸関連業(4.2%)			
上組	57.5	31.8	102,523

銘柄	第1期末	第2期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
情報・通信業(17.1%)			
日本電信電話	—	2,317.4	415,046
卸売業(11.0%)			
メディカルホールディングス	—	99.4	265,497
小売業(32.8%)			
ネクステージ	—	119.5	256,686
しまむら	—	24.4	371,734
イズミ	32.5	41.3	165,530
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	470 8	2,905 10 2,422,352 <8.9%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国株式>

銘柄	第1期末	第2期末		業種	
	株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
			外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)			千ドル		
ALASKA AIR GROUP INC	255	—	—	—	運輸
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	343	575	5,062	747,333	一般消費財・サービス流通・小売り
ALLSTATE CORP	—	214	2,365	349,234	保険
ALPHABET INC-CL A	—	168	2,332	344,324	メディア・娯楽
BAIDU INC - SPON ADR	187	386	5,303	782,854	メディア・娯楽
BANCO DE CHILE-ADR	677	602	1,257	185,611	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	—	709	2,775	409,754	ヘルスケア機器・サービス
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	49	57	2,110	311,509	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	6	—	—	—	消費者サービス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	231	275	1,640	242,205	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CVS HEALTH CORP	261	678	4,748	701,002	ヘルスケア機器・サービス
CITIGROUP INC	274	642	2,772	409,228	銀行
CONOCOPHILLIPS	78	201	2,509	370,422	エネルギー
CROWN HOLDINGS INC	125	239	2,201	325,018	素材
DR HORTON INC	171	—	—	—	耐久消費財・アパレル
DELTA AIR LINES INC	—	907	3,567	526,594	運輸
WALT DISNEY CO/THE	156	300	2,536	374,427	メディア・娯楽
EXELIXIS INC	—	458	1,019	150,567	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
META PLATFORMS INC-A	117	—	—	—	メディア・娯楽
FEDEX CORP	94	101	2,608	385,043	運輸

銘柄	株数 (百株)	第 2 期 末			業 種	
		株数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
GENERAL MOTORS CO	304	591	1,991	294,009	自動車・自動車部品	
GLOBAL PAYMENTS INC	224	371	4,668	689,128	金融サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	79	—	—	—	銀行	
KROGER CO	—	755	3,457	510,343	生活必需品流通・小売り	
MICRON TECHNOLOGY INC	—	476	3,417	504,447	半導体・半導体製造装置	
NETEASE INC-ADR	193	—	—	—	メディア・娯楽	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	—	2,725	3,238	478,048	銀行	
NEWMONT CORP	275	—	—	—	素材	
PFIZER INC	118	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PULTEGROUP INC	197	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	121	—	—	—	保険	
SCHWAB (CHARLES) CORP	282	349	2,088	308,347	金融サービス	
T-MOBILE US INC	156	242	3,467	511,937	電気通信サービス	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	195	361	3,307	488,180	半導体・半導体製造装置	
TARGET CORP	—	136	1,696	250,492	生活必需品流通・小売り	
TERADYNE INC	165	255	2,506	369,966	半導体・半導体製造装置	
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	—	663	2,362	348,816	消費者サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	—	410	2,212	326,588	食品・飲料・タバコ	
VIATRIS INC	885	1,212	1,191	175,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WAYFAIR INC- CLASS A	217	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
WELLS FARGO & CO	567	796	3,428	506,172	銀行	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	82	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	186	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	79	79	1,062	156,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MEDTRONIC PLC	200	348	2,856	421,720	ヘルスケア機器・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	80	107	2,210	326,258	保険	
AERCAP HOLDINGS NV	308	554	3,412	503,701	資本財	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	7,949 36	16,955 34	93,388 —	13,786,055 <50.6%>	
(カナダ)			千カナダドル			
BARRICK GOLD CORP	563	—	—	—	素材	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	138	572	5,008	547,203	エネルギー	
MTY FOOD GROUP INC	355	276	1,692	184,928	消費者サービス	
ALAMOS GOLD INC-CLASS A	1,310	—	—	—	素材	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,367 4	848 2	6,701 —	732,131 <2.7%>	
(メキシコ)			千メキシカンペソ			
QUALITAS CONTROLADORA SAB CV	2,435	—	—	—	保険	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,435 1	— —	— —	— <-%>	
(ブラジル)			千ブラジルレアル			
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	1,982	4,880	13,490	408,330	銀行	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	—	4,528	11,854	358,807	不動産管理・開発	

銘柄		第1期末	第2期末			業種
		株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA		3,943	—	—	—	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額	5,925	9,408	25,344	767,137	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<2.8%>	
(チリ) BANCO DE CHILE		—	65,556	千チリアンペソ 609,015	100,859	銀行
小計	株数・金額	—	65,556	609,015	100,859	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<0.4%>	
(ドイツ) DHL GROUP		—	512	千ユーロ 2,141	336,187	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG		1,442	1,749	3,626	569,374	電気通信サービス
国小計	株数・金額	1,442	2,261	5,767	905,561	
	銘柄数<比率>	1	2	—	<3.3%>	
(フランス) SEB SA		95	162	1,512	237,449	耐久消費財・アパレル
KERING		36	50	2,334	366,612	耐久消費財・アパレル
SODEXO SA		221	—	—	—	消費者サービス
CREDIT AGRICOLE SA		1,059	—	—	—	銀行
BNP PARIBAS		706	835	5,124	804,616	銀行
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN		590	830	4,699	737,930	資本財
国小計	株数・金額	2,710	1,880	13,671	2,146,608	
	銘柄数<比率>	6	4	—	<7.9%>	
(オランダ) KONINKLIJKE PHILIPS NV		—	1,076	2,147	337,196	ヘルスケア機器・サービス
AALBERTS NV		—	321	1,165	183,025	資本財
国小計	株数・金額	—	1,397	3,313	520,222	
	銘柄数<比率>	—	2	—	<1.9%>	
(スペイン) BANCO SANTANDER SA		10,076	11,250	3,966	622,769	銀行
国小計	株数・金額	10,076	11,250	3,966	622,769	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<2.3%>	
ユーロ計	株数・金額	14,229	16,790	26,719	4,195,162	
	銘柄数<比率>	8	9	—	<15.4%>	
(イギリス) BARRATT DEVELOPMENTS PLC		1,797	2,386	千ポンド 1,076	197,128	耐久消費財・アパレル
BELLWAY PLC		545	—	—	—	耐久消費財・アパレル
BP PLC		—	6,602	3,460	633,822	エネルギー
TESCO PLC		4,117	9,830	2,623	480,619	生活必需品流通・小売り
HALEON PLC		3,646	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
GSK PLC		1,065	1,977	2,940	538,598	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額	11,172	20,795	10,100	1,850,168	
	銘柄数<比率>	5	4	—	<6.8%>	
(スイス) NESTLE SA-REG		189	258	千スイスフラン 2,717	447,698	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	189	258	2,717	447,698	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<1.6%>	

銘柄		第1期末		第2期末		業種
		株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
AUTOLIV INC-SWED DEP RECEIPT		272	233	24,712	326,455	自動車・自動車部品
HUSQVARNA AB-B SHS		3,038	3,106	26,696	352,659	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,310	3,339	51,409	679,115	
		2	2	—	<2.5%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
SUBSEA 7 SA		1,485	782	11,229	154,411	エネルギー
DNB BANK ASA		—	973	21,216	291,725	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,485	1,755	32,446	446,137	
		1	2	—	<1.6%>	
(ポーランド)				千ポーランドズロチ		
DINO POLSKA SA		149	—	—	—	生活必需品流通・小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	149	—	—	—	
		1	—	—	<—%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
HYUNDAI MOTOR CO		—	136	2,593,520	288,399	自動車・自動車部品
LG CORP		484	669	5,691,940	632,943	資本財
NICE HOLDINGS CO LTD		302	—	—	—	金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	787	805	8,285,460	921,343	
		2	2	—	<3.4%>	
(南アフリカ)				千ランド		
AVI LTD		1,971	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,971	—	—	—	
		1	—	—	<—%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	51,973	136,515	—	23,925,809	
		64	59	—	<87.8%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	ニッセイアセットマネジメント株式会社
運用方針	主として、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式マザーファンドへの投資を通じて、実質的に日本を除く世界各国の株式等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。
主要運用対象	ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。
組入制限	株式への実質投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券(上場投資信託証券等を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

●損益の状況

項目	第1期 自 2022年3月7日 至 2023年3月6日
(A)配当等収益	△15,804円
受取利息	809
支払利息	△16,613
(B)有価証券売買損益	5,104,389,333
売買益	5,207,832,036
売買損	△103,442,703
(C)信託報酬等	△175,540,824
(D)当期損益金(A+B+C)	4,928,832,705
(E)追加信託差損益金	1,638,841,749
(配当等相当額)	(△8,579)
(売買損益相当額)	(1,638,850,328)
(F)合計(D+E)	6,567,674,454
次期繰越損益金(F)	6,567,674,454
追加信託差損益金	1,638,841,749
(配当等相当額)	(△8,579)
(売買損益相当額)	(1,638,850,328)
分配準備積立金	4,928,848,509
繰越欠損金	△15,804

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第1期末	
	口数	評価額
ニッセイ／サンダース・グローバルバリュース株式マザーファンド	千口 32,040,481	千円 38,845,880

下記は、ニッセイ／サンダース・グローバルバリュー株式マザーファンド全体の内容です。

<外国株式>

銘柄	株数 (百株)	期末 評価額		業種
		外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)		千米ドル		
ALPHABET INC-CL C	1,360	12,786	1,737,970	メディア・娯楽
APPLE INC	689	10,405	1,414,379	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	12	145	19,774	半導体・半導体製造装置
BAIDU INC - SPON ADR	20	308	41,966	メディア・娯楽
BOOKING HOLDINGS INC	10	2,809	381,808	消費者サービス
CITIGROUP INC	503	2,636	358,353	銀行
DR HORTON INC	164	1,521	206,814	耐久消費財・アパレル
ELEVANCE HEALTH, INC	171	8,078	1,098,060	ヘルスケア機器・サービス
HALLIBURTON CO	989	3,846	522,778	エネルギー
HCA HEALTHCARE INC	385	9,637	1,309,876	ヘルスケア機器・サービス
JOHNSON & JOHNSON	129	1,999	271,728	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	394	5,660	769,334	銀行
LAM RESEARCH CORP	30	1,482	201,544	半導体・半導体製造装置
LENNAR CORP-CL A	107	1,044	141,958	耐久消費財・アパレル
MEDTRONIC PLC	488	4,072	553,567	ヘルスケア機器・サービス
META PLATFORMS INC-A	540	10,003	1,359,675	メディア・娯楽
MICRON TECHNOLOGY INC	1,629	9,249	1,257,186	半導体・半導体製造装置
MICROSOFT CORP	496	12,680	1,723,500	ソフトウェア・サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	151	7,096	964,583	資本財
PEPSICO INC	195	3,385	460,194	食品・飲料・タバコ
PROCTER & GAMBLE CO	317	4,469	607,497	家庭用品・パーソナル用品
SAMSUNG ELECTRONICS-GDR 144A	108	12,773	1,736,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEAGATE TECHNOLOGY	537	3,467	471,290	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	1,570	14,097	1,916,068	半導体・半導体製造装置
THE CIGNA GROUP	317	9,102	1,237,237	ヘルスケア機器・サービス
UNITEDHEALTH GROUP INC	210	10,078	1,369,866	ヘルスケア機器・サービス
WELLS FARGO & CO	1,036	4,853	659,709	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	12,565 27	167,693 -	22,792,965 <58.7%>
(カナダ)		千カナダ・ドル		
SUNCOR ENERGY INC	1,623	7,785	777,774	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,623 1	7,785 -	777,774 <2.0%>
(香港)		千香港ドル		
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	18,920	9,460	163,752	銀行
IND & COMM BK OF CHINA - H	16,300	6,683	115,682	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	35,220 2	16,143 -	279,435 <0.7%>
(シンガポール)		千シンガポール・ドル		
DBS GROUP HOLDINGS LTD	785	2,629	265,867	銀行
UNITED OVERSEAS BANK LTD	1,295	3,825	386,750	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,080 2	6,455 -	652,618 <1.7%>
(イギリス)		千イギリス・ポンド		
COMPASS GROUP PLC	1,321	2,532	414,009	消費者サービス
LLOYDS BANKING GROUP PLC	21,938	1,134	185,440	銀行
NATWEST GROUP PLC	4,046	1,190	194,636	銀行

銘柄	株数 (百株)	第 1 期 末		業 種
		評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
UNILEVER PLC	1,025	4,249	694,733	家庭用品・パーソナル用品
小 計	28,330	9,105	1,488,820	
(スイス)	4	—	<3.8%>	
NESTLE SA	411	4,420	641,622	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG	632	5,014	727,865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING AG	227	6,221	903,042	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	1,270	15,657	2,272,530	
(タイ)	3	—	<5.9%>	
KASIKORN BANK PCL-FOREIGN	4,015	56,009	220,676	銀行
SCB X PCL-FOREIGN	4,760	49,742	195,983	銀行
小 計	8,775	105,751	416,659	
(オランダ)	2	—	<1.1%>	
AIRBUS SE	220	2,739	395,742	資本財
HEINEKEN NV	417	4,109	593,641	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA	6,402	8,587	1,240,445	銀行
国 小 計	7,039	15,437	2,229,829	
(フランス)	3	—	<5.7%>	
BNP PARIBAS	1,463	9,401	1,357,914	銀行
国 小 計	1,463	9,401	1,357,914	
(ドイツ)	1	—	<3.5%>	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	978	9,924	1,433,530	自動車・自動車部品
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	1,421	4,514	652,076	資本財
MERCEDES-BENZ GROUP AG	1,629	12,313	1,778,577	自動車・自動車部品
SIEMENS AG	195	2,878	415,707	資本財
国 小 計	4,223	29,630	4,279,892	
ユ ー ロ 計	12,726	54,469	7,867,636	
合 計	102,590	—	36,548,440	
	49	—	<94.1%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託証券>

銘柄	口数 (千口)	第 1 期 末	
		評 価 額	
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)		千米ドル	
SPDR S&P 500 ETF TRUST	18	7,517	1,021,837
合 計	18	—	1,021,837
	1	—	<2.6%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■世界エクイティ・ファンド(適格機関投資家向け)

●ファンドの概要

運用会社	日興アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	日本を含む世界の金融商品取引所上場株式(預託証券を含みます。)
運用の基本方針等	主として、日本を含む世界の金融商品取引所に上場されている株式(預託証券を含みます。)に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

●損益の状況

項目	第 1 期 自 2022年12月16日 至 2023年 5月22日
(A) 配 当 等 収 益	△7,853円
受 取 利 息	62
支 払 利 息	△7,915
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,247,347,958
売 買 益	1,250,982,428
売 買 損	△3,634,470
(C) 信 託 報 酬 等	△36,063,226
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,211,276,879
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	346,634,541
(配 当 等 相 当 額)	(△993)
(売 買 損 益 相 当 額)	(346,635,534)
(F) 計 (D+E)	1,557,911,420
(G) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	1,557,911,420
追 加 信 託 差 損 益 金	346,634,541
(配 当 等 相 当 額)	(7,184,236)
(売 買 損 益 相 当 額)	(339,450,305)
分 配 準 備 積 立 金	1,211,276,879

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	
	口 数	評 価 額
世界エクイティ・マザーファンド	千口 15,252,037	千円 16,855,026

下記は、世界エクイティ・マザーファンド全体の内容です。

<外国株式>

銘柄	第 1 期 末			業 種
	株 数 (百株)	評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)		千ドル		
ABBOTT LABORATORIES	265	2,895	398,778	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	108	3,142	432,802	ソフトウェア・サービス
CHAMPIONX CORP	565	1,536	211,662	エネルギー
BOX INC - CLASS A	929	2,557	352,256	ソフトウェア・サービス
CARLISLE COS INC	67	1,440	198,447	資本財
CHART INDUSTRIES INC	120	1,387	191,145	資本財
COCA-COLA CO/THE	517	3,250	447,694	食品・飲料・タバコ
DANAHER CORP	120	2,742	377,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DEERE & CO	47	1,713	236,021	資本財
ENCOMPASS HEALTH CORP	463	2,862	394,216	ヘルスケア機器・サービス
HDFC BANK LTD-ADR	578	3,849	530,117	銀行
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	300	3,251	447,765	金融サービス
KBR INC	597	3,516	484,354	商業・専門サービス
LINDE PLC	102	3,803	523,792	素材
PROGRESSIVE CORP	199	2,696	371,395	保険
SCHLUMBERGER LTD	693	3,140	432,449	エネルギー
SONY GROUP CORP - SP ADR	310	3,041	418,867	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	356	3,301	454,732	半導体・半導体製造装置
TENET HEALTHCARE CORP	330	2,412	332,195	ヘルスケア機器・サービス
TRANSUNION	252	1,782	245,456	商業・専門サービス
ELEVANCE HEALTH INC	55	2,547	350,823	ヘルスケア機器・サービス
ADAPTHEALTH CORP	1,317	1,455	200,383	ヘルスケア機器・サービス
MASIMO CORP	139	2,283	314,466	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	265	8,452	1,164,043	ソフトウェア・サービス
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	29	2,847	392,175	一般消費財・サービス流通・小売り
PALOMAR HOLDINGS INC	356	1,864	256,768	保険
BOOKING HOLDINGS INC	13	3,669	505,363	消費者サービス
BIO-TECHNE CORP	263	2,208	304,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	124	2,793	384,714	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	株 数 銘 柄	9,494 29	82,448 -	11,354,814 <67.4%>
(フランス)		千ユーロ		
SCHNEIDER ELECTRIC SE	155	2,556	380,880	資本財
国 小 計	株 数 銘 柄	155 1	2,556 -	380,880 <2.3%>
(オランダ)				
KONINKLIJKE PHILIPS NV	769	1,453	216,643	ヘルスケア機器・サービス
国 小 計	株 数 銘 柄	769 1	1,453 -	216,643 <1.3%>
(スペイン)				
AMADEUS IT GROUP SA	476	3,223	480,308	消費者サービス
国 小 計	株 数 銘 柄	476 1	3,223 -	480,308 <2.8%>
ユ ー ロ 計	株 数 銘 柄	1,400 3	7,233 -	1,077,833 <6.4%>

銘柄	株数 (百株)	第 1 期 末		業 種
		評 価 額		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(イギリス) COMPASS GROUP PLC DIAGEO PLC HALEON PLC RENTOKIL INITIAL PLC	1,693 760 8,880 3,645	千ポンド 3,786 2,699 3,019 2,325	650,063 463,503 518,483 399,339	消費者サービス 食品・飲料・タバコ 家庭用品・パーソナル用品 商業・専門サービス
小 計	14,980	11,831	2,031,390	
	株 数 柄 数<比 率>	4	—	<12.1%>
(スウェーデン) HEXAGON AB-B SHS	2,278	千スウェーデンクローナ 27,463	360,042	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
小 計	2,278	27,463	360,042	
	株 数 柄 数<比 率>	1	—	<2.1%>
(オーストラリア) WORLEY LTD	3,119	千オーストラリアドル 5,132	470,917	資本財
小 計	3,119	5,132	470,917	
	株 数 柄 数<比 率>	1	—	<2.8%>
(香港) AIA GROUP LTD SAMSONITE INTERNATIONAL SA	2,832 10,473	千ホンコンドル 22,344 23,250	393,486 409,433	保険 耐久消費財・アパレル
小 計	13,305	45,594	802,919	
	株 数 柄 数<比 率>	2	—	<4.8%>
(シンガポール) DBS GROUP HOLDINGS LTD	924	千シンガポールドル 2,848	291,962	銀行
小 計	924	2,848	291,962	
	株 数 柄 数<比 率>	1	—	<1.7%>
(インドネシア) BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	70,694	千インドネシアルピア 35,877,205	333,658	銀行
小 計	70,694	35,877,205	333,658	
	株 数 柄 数<比 率>	1	—	<2.0%>
合 計	116,196	—	16,723,538	
	株 数 柄 数<比 率>	42	—	<99.2%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■Capital Group New Economy Fund (LUX) Class ZL

●ファンドの概要

投資顧問会社	キャピタル・リサーチ・アンド・マネジメント・カンパニー
運用方針	主として世界各国の金融商品取引所(これに準ずるものを含みます。)に上場され、またはその他の規制ある市場で取引されている株式に投資を行い、投資信託財産の長期的な成長を目標とします。 投資にあたっては、サステナビリティ・リスクを勘案し、温室効果ガス排出量及び環境・社会・ガバナンス(ESG)や社会的規範を考慮した運用を行います。
主要運用対象	世界各国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	原則として同一銘柄の株式への投資は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

以下の「損益の状況」および「投資明細表」は「Capital International Fund Audited Annual Report 2022 For the year ended 31 December 2022」の情報を基に掲載しています。

Capital Group New Economy Fund (LUX)

● 損益の状況 (2022年12月31日までの会計期間)

	Capital Group New Economy Fund (LUX)
Income	
Interest on bonds and convertible bonds (net of withholding taxes)	-
Dividend income (net of withholding taxes)	US\$2, 821, 698
Other income	-
Securities lending income	14, 988
Interest on bank accounts	644, 608
Interest on swap contracts	-
	<u>3, 481, 294</u>
Expenses	
Management fees	4, 282, 440
Administrative Manager services	398, 486
Taxe d'abonnement	179, 558
Professional services	221, 188
Depository and custody	118, 779
Interest on swap contracts	-
Tax charge	-
Other	40, 766
Printing and publishing	33, 037
Overdraft interest	-
	<u>5, 274, 254</u>
Reimbursement of expenses	275, 925
Net investment income/(loss) for the year (a)	(1, 517, 035)
Net realised gain/(loss) on:	
Sale of investments	(70, 426, 802)
Financial futures contracts	-
Foreign currency transaction	434, 543
Swap contracts	-
Net realised gain/(loss) for the year (b)	(69, 992, 259)
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) on:	
Investments	(123, 559, 215)
Financial futures contracts	-
Swap contracts	-
Foreign currency transactions	(812, 159)
Net change in unrealised appreciation/(depreciation) for the year (c)	(124, 371, 374)
Result of operations for the year (a+b+c)	(195, 880, 668)
Dividend distributions	(6, 512)
Net subscriptions/(redemptions) of shares for the year	(56, 632, 630)
Total net assets at the beginning of the year	673, 052, 833
Translation difference	-
Total net assets at the end of the year	US \$ 420, 533, 023

* Mainly due to negative interest rate policy implemented by central banks.

● 投資明細表 (2022年12月31日現在)

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing				
Equities				
<i>Brazil</i>				
Itau Unibanco Holding SA, ADR Preference	USD	38,707	182,310	0.04
NU Holdings Ltd. 'A'	USD	117,601	478,636	0.12
Rede D'Or Sao Luiz SA, Reg. S	BRL	255,608	1,432,054	0.34
XP, Inc. 'A'	USD	30,154	462,562	0.11
			<u>2,555,562</u>	<u>0.61</u>
<i>Canada</i>				
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD	21,412	866,126	0.21
Canadian Pacific Railway Ltd.	USD	10,884	811,838	0.19
Shopify, Inc. 'A'	USD	33,772	1,172,226	0.28
TC Energy Corp.	USD	16,392	653,385	0.15
			<u>3,503,575</u>	<u>0.83</u>
<i>China</i>				
Bank of Ningbo Co. Ltd. 'A'	CNY	38,600	180,234	0.04
China Merchants Bank Co. Ltd. 'A'	CNY	34,300	183,916	0.04
China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd., Reg. S	HKD	38,800	197,124	0.05
ENN Energy Holdings Ltd.	HKD	5,000	69,754	0.02
Hefei Meiya Optoelectronic Technology, Inc. 'A'	CNY	104,220	358,393	0.08
Meituan, Reg. S 'B'	HKD	3,296	72,879	0.02
Midea Group Co. Ltd. 'A'	CNY	25,700	190,900	0.05
Tencent Holdings Ltd.	HKD	2,000	85,004	0.02
WuXi AppTec Co. Ltd., Reg. S 'H'	HKD	186,312	1,968,696	0.47
Wuxi Biologics Cayman, Inc., Reg. S	HKD	252,500	1,938,459	0.46
Yunnan Energy New Material Co. Ltd.	CNY	3,900	73,684	0.02
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	HKD	28,500	145,271	0.03
			<u>5,464,314</u>	<u>1.30</u>
<i>Denmark</i>				
Novo Nordisk A/S 'B'	DKK	13,876	1,878,810	0.45
			<u>1,878,810</u>	<u>0.45</u>
<i>Finland</i>				
Neste OYJ	EUR	26,117	1,206,293	0.29
			<u>1,206,293</u>	<u>0.29</u>
<i>France</i>				
Air Liquide SA	EUR	3,136	446,063	0.11
EssilorLuxottica SA	EUR	6,601	1,202,017	0.29
Gaztransport Et Technigaz SA	EUR	15,304	1,635,025	0.39
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	3,851	2,797,541	0.66
Teleperformance	EUR	533	127,187	0.03
			<u>6,207,833</u>	<u>1.48</u>

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
<i>Germany</i>				
Carl Zeiss Meditec AG	EUR	3,076	388,235	0.09
SAP SE	EUR	11,412	1,177,712	0.28
Siemens AG	EUR	7,264	1,008,190	0.24
			<u>2,574,137</u>	<u>0.61</u>
<i>Hong Kong</i>				
AIA Group Ltd.	HKD	470,600	5,184,602	1.23
			<u>5,184,602</u>	<u>1.23</u>
<i>India</i>				
Axis Bank Ltd.	INR	25,572	287,425	0.07
Bajaj Finserv Ltd.	INR	18,905	352,272	0.09
Embassy Office Parks REIT, REIT	INR	373,781	1,516,726	0.36
ICICI Bank Ltd.	INR	114,413	1,226,336	0.29
Kotak Mahindra Bank Ltd.	INR	386,495	8,503,717	2.02
Star Health & Allied Insurance Co. Ltd.	INR	98,925	677,257	0.16
			<u>12,563,733</u>	<u>2.99</u>
<i>Ireland</i>				
Flutter Entertainment plc	EUR	18,030	2,470,553	0.59
Ryanair Holdings plc, ADR	USD	2,453	183,387	0.04
			<u>2,653,940</u>	<u>0.63</u>
<i>Israel</i>				
Monday.com Ltd.	USD	4,506	549,732	0.13
Nice Ltd., ADR	USD	948	182,300	0.04
			<u>732,032</u>	<u>0.17</u>
<i>Japan</i>				
Bandai Namco Holdings, Inc.	JPY	2,500	156,779	0.04
Chugai Pharmaceutical Co. Ltd.	JPY	3,400	86,394	0.02
Daiichi Sankyo Co. Ltd.	JPY	107,302	3,438,765	0.82
GMO Payment Gateway, Inc.	JPY	6,800	565,413	0.13
Hoya Corp.	JPY	900	87,080	0.02
Keyence Corp.	JPY	1,600	626,407	0.15
Obic Co. Ltd.	JPY	1,600	236,546	0.06
Olympus Corp.	JPY	30,700	542,644	0.13
Recruit Holdings Co. Ltd.	JPY	18,600	591,552	0.14
Seven & i Holdings Co. Ltd.	JPY	12,800	547,563	0.13
Sony Group Corp.	JPY	1,900	144,886	0.03
			<u>7,024,029</u>	<u>1.67</u>
<i>Korea, Republic of</i>				
Samsung Electronics Co. Ltd.	KRW	35,756	1,576,771	0.37
SK Hynix, Inc.	KRW	34,846	2,097,446	0.50
			<u>3,674,217</u>	<u>0.87</u>
<i>Netherlands</i>				
Allfunds Group plc	EUR	17,217	120,307	0.03
ASML Holding NV	EUR	8,765	4,744,523	1.13
IMCD NV	EUR	2,536	362,231	0.08
			<u>5,227,061</u>	<u>1.24</u>

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
<i>Singapore</i>				
Grab Holdings Ltd. 'A'	USD	35,610	114,664	0.03
Sea Ltd., ADR	USD	6,811	354,376	0.08
			<u>469,040</u>	<u>0.11</u>
<i>Spain</i>				
Amadeus IT Group SA 'A'	EUR	25,477	1,313,851	0.31
			<u>1,313,851</u>	<u>0.31</u>
<i>Sweden</i>				
Evolution AB, Reg. S	SEK	10,108	987,186	0.24
Nibe Industrier AB 'B'	SEK	69,518	650,064	0.15
			<u>1,637,250</u>	<u>0.39</u>
<i>Switzerland</i>				
Bachem Holding AG 'B'	CHF	10,950	955,030	0.23
Idorsia Ltd.	CHF	51,922	756,763	0.18
			<u>1,711,793</u>	<u>0.41</u>
<i>Taiwan, Province of China</i>				
eMemory Technology, Inc.	TWD	41,000	1,777,960	0.42
MediaTek, Inc.	TWD	38,000	771,859	0.18
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd., ADR	USD	27,926	2,080,208	0.50
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	TWD	78,000	1,136,822	0.27
			<u>5,766,849</u>	<u>1.37</u>
<i>United Kingdom</i>				
AstraZeneca plc	GBP	8,050	1,092,508	0.26
Entain plc	GBP	64,276	1,030,581	0.25
Ocado Group plc	GBP	28,824	216,906	0.05
Rentokil Initial plc	GBP	91,264	560,935	0.13
			<u>2,900,930</u>	<u>0.69</u>
<i>United States of America</i>				
Abbott Laboratories	USD	45,505	4,995,994	1.19
AbbVie, Inc.	USD	10,921	1,764,943	0.42
Accenture plc 'A'	USD	3,418	912,059	0.22
Activision Blizzard, Inc.	USD	5,116	391,630	0.09
Advanced Micro Devices, Inc.	USD	3,954	256,101	0.06
Affirm Holdings, Inc.	USD	12,427	120,169	0.03
agilon health, Inc.	USD	225,578	3,640,829	0.87
Air Products and Chemicals, Inc.	USD	3,796	1,170,155	0.28
Airbnb, Inc. 'A'	USD	16,363	1,399,037	0.33
Align Technology, Inc.	USD	10,161	2,142,955	0.51
Alnylam Pharmaceuticals, Inc.	USD	23,672	5,625,651	1.34
Alphabet, Inc. 'A'	USD	29,191	2,575,522	0.61
Alphabet, Inc. 'C'	USD	45,930	4,075,369	0.97
Amazon.com, Inc.	USD	71,886	6,038,424	1.44
Aon plc 'A'	USD	3,242	973,054	0.23
Apple, Inc.	USD	22,597	2,936,028	0.70
Applied Materials, Inc.	USD	62,246	6,061,515	1.44

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Aptiv plc	USD	4,647	432,775	0.10
Arch Capital Group Ltd.	USD	32,227	2,023,211	0.48
Arista Networks, Inc.	USD	17,971	2,180,781	0.52
Atlassian Corp. 'A'	USD	3,015	387,970	0.09
Autodesk, Inc.	USD	1,874	350,194	0.08
AvidXchange Holdings, Inc.	USD	67,785	673,783	0.16
Baker Hughes Co.	USD	68,518	2,023,337	0.48
Berkshire Hathaway, Inc. 'B'	USD	10,905	3,368,554	0.80
BioMarin Pharmaceutical, Inc.	USD	8,123	840,649	0.20
Blackstone, Inc. 'A'	USD	8,093	600,420	0.14
Block, Inc. 'A'	USD	16,268	1,022,281	0.24
Booking Holdings, Inc.	USD	368	741,623	0.18
Broadcom, Inc.	USD	31,102	17,390,061	4.14
Carrier Global Corp.	USD	39,385	1,624,631	0.39
Catalent, Inc.	USD	25,038	1,126,960	0.27
Centene Corp.	USD	64,198	5,264,878	1.25
Ceridian HCM Holding, Inc.	USD	107,649	6,905,683	1.64
Chart Industries, Inc.	USD	2,002	230,690	0.05
Charter Communications, Inc. 'A'	USD	2,242	760,262	0.18
Chipotle Mexican Grill, Inc.	USD	1,159	1,608,101	0.38
Chubb Ltd.	USD	5,857	1,292,054	0.31
Churchill Downs, Inc.	USD	963	203,607	0.05
Ciena Corp.	USD	10,287	524,431	0.12
Cigna Corp.	USD	5,684	1,883,337	0.45
Cloudflare, Inc. 'A'	USD	10,302	465,753	0.11
CME Group, Inc.	USD	4,228	710,980	0.17
Comcast Corp. 'A'	USD	116,943	4,089,497	0.97
Confluent, Inc. 'A'	USD	6,932	154,168	0.04
Copart, Inc.	USD	33,368	2,031,778	0.48
Corebridge Financial, Inc.	USD	31,974	641,398	0.15
Corteva, Inc.	USD	20,417	1,200,111	0.29
Costco Wholesale Corp.	USD	5,779	2,638,114	0.63
CrowdStrike Holdings, Inc. 'A'	USD	3,134	329,979	0.08
CSX Corp.	USD	53,500	1,657,430	0.39
Datadog, Inc. 'A'	USD	7,887	579,695	0.14
Dexcom, Inc.	USD	4,767	539,815	0.13
Discover Financial Services	USD	13,944	1,364,142	0.32
Dollar General Corp.	USD	2,571	633,109	0.15
Dollar Tree, Inc.	USD	8,143	1,151,746	0.27
DoorDash, Inc. 'A'	USD	3,725	181,855	0.04
DoubleVerify Holdings, Inc.	USD	24,096	529,148	0.13
DraftKings, Inc. 'A'	USD	55,429	631,336	0.15
Eli Lilly & Co.	USD	13,102	4,793,236	1.14
EPAM Systems, Inc.	USD	4,498	1,474,175	0.35
Equinix, Inc., REIT	USD	1,197	784,071	0.19

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Etsy, Inc.	USD	2,493	298,612	0.07
Exact Sciences Corp.	USD	27,958	1,384,201	0.33
Fate Therapeutics, Inc.	USD	33,461	337,621	0.08
Fifth Third Bancorp	USD	22,235	729,530	0.17
First Republic Bank	USD	1,370	166,989	0.04
First Solar, Inc.	USD	7,140	1,069,501	0.25
Fiserv, Inc.	USD	12,687	1,282,275	0.31
Five Below, Inc.	USD	13,783	2,437,799	0.58
Floor & Decor Holdings, Inc. 'A'	USD	30,162	2,100,180	0.50
General Motors Co.	USD	65,966	2,219,096	0.53
Gilead Sciences, Inc.	USD	17,283	1,483,746	0.35
Gitlab, Inc. 'A'	USD	4,818	218,930	0.05
Halliburton Co.	USD	27,845	1,095,701	0.26
Hilton Worldwide Holdings, Inc.	USD	13,590	1,717,232	0.41
Home Depot, Inc. (The)	USD	7,115	2,247,344	0.53
HubSpot, Inc.	USD	1,009	291,732	0.07
Humana, Inc.	USD	3,392	1,737,348	0.41
Informatica, Inc. 'A'	USD	77,047	1,255,096	0.30
Insight Enterprises, Inc.	USD	10,881	1,091,038	0.26
Insulet Corp.	USD	9,569	2,817,018	0.67
Intercontinental Exchange, Inc.	USD	10,646	1,092,173	0.26
Intuit, Inc.	USD	817	317,993	0.08
IQVIA Holdings, Inc.	USD	2,687	550,539	0.13
iRhythm Technologies, Inc.	USD	1,648	154,368	0.04
Janus Henderson Group plc	USD	13,421	315,662	0.08
JPMorgan Chase & Co.	USD	18,520	2,483,532	0.59
KKR & Co., Inc.	USD	27,025	1,254,501	0.30
Linde plc	USD	3,775	1,231,330	0.29
Live Nation Entertainment, Inc.	USD	7,505	523,399	0.12
LPL Financial Holdings, Inc.	USD	3,208	693,473	0.16
Marqeta, Inc. 'A'	USD	160,929	983,276	0.23
Marsh & McLennan Cos., Inc.	USD	7,998	1,323,509	0.31
Mastercard, Inc. 'A'	USD	15,659	5,445,104	1.29
MercadoLibre, Inc.	USD	5,339	4,518,075	1.07
Meta Platforms, Inc. 'A'	USD	19,748	2,376,474	0.57
Micron Technology, Inc.	USD	166,906	8,341,962	1.98
Microsoft Corp.	USD	69,721	16,720,490	3.98
Molina Healthcare, Inc.	USD	9,431	3,114,305	0.74
MongoDB, Inc.	USD	5,285	1,040,299	0.25
Monster Beverage Corp.	USD	6,525	662,483	0.16
Morgan Stanley	USD	8,943	760,334	0.18
Motorola Solutions, Inc.	USD	12,218	3,148,701	0.75
MSCI, Inc.	USD	1,288	599,139	0.14
Nasdaq, Inc.	USD	35,486	2,177,066	0.52
Netflix, Inc.	USD	18,530	5,464,126	1.30

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
New York Times Co. (The) 'A'	USD	18,452	598,952	0.14
NextEra Energy, Inc.	USD	7,000	585,200	0.14
NIKE, Inc. 'B'	USD	6,761	791,105	0.19
Norfolk Southern Corp.	USD	2,138	526,846	0.13
Novocure Ltd.	USD	14,870	1,090,715	0.26
NVIDIA Corp.	USD	13,641	1,993,496	0.47
Oak Street Health, Inc.	USD	14,499	311,873	0.07
Old Dominion Freight Line, Inc.	USD	1,949	553,087	0.13
Penumbra, Inc.	USD	1,146	254,939	0.06
PerkinElmer, Inc.	USD	11,597	1,626,131	0.39
Pfizer, Inc.	USD	35,051	1,796,013	0.43
PG&E Corp.	USD	294,534	4,789,123	1.14
Qorvo, Inc.	USD	4,129	374,253	0.09
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	USD	1,256	906,191	0.22
RenaissanceRe Holdings Ltd.	USD	12,418	2,287,768	0.54
Revance Therapeutics, Inc.	USD	48,225	890,234	0.21
RingCentral, Inc. 'A'	USD	28,276	1,000,970	0.24
Rivian Automotive, Inc. 'A'	USD	44,266	815,822	0.19
Salesforce, Inc.	USD	7,633	1,012,059	0.24
Schlumberger Ltd.	USD	19,335	1,033,649	0.25
Seagen, Inc.	USD	13,900	1,786,289	0.42
ServiceNow, Inc.	USD	3,940	1,529,784	0.36
Sherwin-Williams Co. (The)	USD	10,364	2,459,688	0.58
Smartsheet, Inc. 'A'	USD	34,394	1,353,748	0.32
Snowflake, Inc. 'A'	USD	13,652	1,959,608	0.47
Starbucks Corp.	USD	10,019	993,885	0.24
Stericycle, Inc.	USD	10,552	526,439	0.13
Stryker Corp.	USD	5,782	1,413,641	0.34
Synopsys, Inc.	USD	2,276	726,704	0.17
Take-Two Interactive Software, Inc.	USD	4,185	435,784	0.10
Target Corp.	USD	2,588	385,716	0.09
TE Connectivity Ltd.	USD	6,588	756,302	0.18
TechnipFMC plc	USD	89,135	1,086,556	0.26
Tesla, Inc.	USD	4,361	537,188	0.13
Thermo Fisher Scientific, Inc.	USD	17,594	9,688,840	2.30
T-Mobile US, Inc.	USD	9,192	1,286,880	0.31
Tradeweb Markets, Inc. 'A'	USD	16,753	1,087,772	0.26
Trane Technologies plc	USD	3,865	649,668	0.15
TransDigm Group, Inc.	USD	6,597	4,153,801	0.99
Twilio, Inc. 'A'	USD	8,382	410,383	0.10
Union Pacific Corp.	USD	9,055	1,875,019	0.45
UnitedHealth Group, Inc.	USD	22,711	12,040,918	2.86
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	USD	4,683	1,352,357	0.32
Visa, Inc. 'A'	USD	5,640	1,171,766	0.28
Warner Music Group Corp. 'A'	USD	18,744	656,415	0.16

銘柄	通貨	数量/額面	時価 USD	純資産比率 (%)
Weatherford International plc	USD	15,342	781,215	0.19
Wolfspeed, Inc.	USD	49,552	3,421,070	0.81
Yum! Brands, Inc.	USD	7,788	997,487	0.24
Zoetis, Inc.	USD	7,977	1,169,029	0.28
ZoomInfo Technologies, Inc. 'A'	USD	111,498	3,357,205	0.80
Zscaler, Inc.	USD	2,885	322,832	0.08
			300,006,961	71.34
Total Equities			374,256,812	88.99
Total Transferable securities and money market instruments admitted to an official exchange listing			374,256,812	88.99
Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings				
Collective Investment Schemes - UCITS				
<i>Luxembourg</i>				
JPMorgan USD Treasury CNAV Fund - JPM USD Treasury CNAV Institutional (dist.)	USD	29,892,926	29,892,926	7.11
			29,892,926	7.11
Total Collective Investment Schemes - UCITS			29,892,926	7.11
Total Units of authorised UCITS or other collective investment undertakings			29,892,926	7.11
Total Investments			404,149,738	96.10
Cash			16,229,785	3.86
Other assets/(liabilities)			153,500	0.04
Total net assets			420,533,023	100.00

組入投資信託証券の内容

■ FOFs用MAN AHL ダイバーシファイド リンクファンド (適格機関投資家専用)

● ファンドの概要

運 用 会 社	三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社の発行する円建債券
運用の基本方針等	この投資信託は、主として円建債券への投資を通じて、AHL Partners LLPが運用する外国投資信託証券「Man AHL Diversified (Cayman) Ltd」(主として世界各国の株式、債券、金利、商品、為替等の先物取引等に投資を行い、定量分析モデルを用いて市場動向を予測し、上昇局面だけでなく下落局面でも収益の獲得を目指して運用を行うケイマン諸島籍投資信託証券。なお、組入外貨建資産について対円で為替ヘッジを行うことがあります。)の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。

● 損益の状況

項 目	第 8 期 自 2022年10月12日 至 2023年10月10日
(A) 配 当 等 収 益	△19,926円
受 取 利 息	75
支 払 利 息	△20,001
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△649,175,226
売 買 益	90,110,486
売 買 損	△739,285,712
(C) 信 託 報 酬 等	△8,468,560
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△657,663,712
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,347,067,735
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	687,540,972
(配 当 等 相 当 額)	(920,303,275)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△232,762,303)
(G) 計 (D+E+F)	2,376,944,995
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	2,376,944,995
追 加 信 託 差 損 益 金	687,540,972
(配 当 等 相 当 額)	(920,299,844)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△232,758,872)
分 配 準 備 積 立 金	2,347,171,496
繰 越 損 益 金	△657,767,473

● 組入資産の明細

< 親投資信託残高 >

	第 7 期 末	第 8 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド	13,230,991	10,728,707	13,231,714

下記は、MAN AHL ダイバーシファイド リンク マザーファンド全体の内容です。

<国内(邦貨建)公社債>

第		8		期		末	
銘	柄	名	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日	
普通社債券(含む投資法人債券)							
STAR	HELIOS	0% 02/12/26	0	17,014,000	20,354,290	2026/2/12	
合		計		17,014,000	20,354,290		

組入投資信託証券の内容

■ノムラFOFs用 日本株ベータヘッジ戦略ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運 用 会 社	野村アセットマネジメント株式会社
主な投資対象・投資地域	わが国の株式及び株価指数先物取引の売建て
運用の基本方針等	この投資信託は、わが国の株式に投資を行うとともに、TOPIX(東証株価指数)を対象とする株価指数先物取引の売建てにより、投資する株式に対する株式市場全体の変動の影響を抑えることを目指し、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行います。

●損益の状況

項 目	第 5 期 自 2022年12月21日 至 2023年12月20日
(A)配 当 等 收 益	△740,426円
受 取 利 息	190
支 払 利 息	△740,616
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,065,202,300
売 買 益	3,633,470,764
売 買 損	△568,268,464
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△4,190,848,809
取 引 益	198,427,758
取 引 損	△4,389,276,567
(D)信 託 報 酬 等	△120,365,275
(E)当 期 損 益 金 (A+B+C+D)	△1,246,752,210
(F)前 期 繰 越 損 益 金	△1,717,546,844
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	412,861,901
(配 当 等 相 当 額)	(431,173,297)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△18,311,396)
(H) 計 (E+F+G)	△2,551,437,153
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	△2,551,437,153
追 加 信 託 差 損 益 金	412,861,901
(配 当 等 相 当 額)	(431,625,721)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△18,763,820)
分 配 準 備 積 立 金	921,549,722
繰 越 損 益 金	△3,885,848,776

●組入資産の明細

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	第 5 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 TOPIX	—	16,488

<親投資信託残高>

	第 4 期 末		第 5 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	評 価 額
	千口	千口	千円	千円
野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド	7,890,199	4,453,682	7,951,159	
日本成長株投資マザーファンド	8,440,244	5,254,653	8,042,772	

下記は、日本成長株投資マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
鉱業(1.1%)				
INPEX	84.1	42.2	82,100	
建設業(2.6%)				
ショーボンドホールディングス	16.8	16.7	101,369	
大和ハウス工業	52.1	22.7	94,205	
食料品(1.0%)				
キッコーマン	—	8.5	74,851	
東洋水産	19.6	—	—	
パルプ・紙(0.4%)				
レンゴー	109.5	31.5	29,232	
化学(13.8%)				
日産化学	20.1	15	82,680	
信越化学工業	30.1	65.8	371,112	
日油	27.8	14	96,586	
富士フイルムホールディングス	16.4	—	—	
資生堂	—	18.6	75,757	
ミルボン	17.3	20.9	75,804	
ニフコ	35.6	18.5	65,194	
ユニ・チャーム	79.7	59.6	294,304	
医薬品(5.7%)				
日本新薬	12.4	—	—	
中外製薬	125.6	36.6	199,470	
参天製薬	102.7	58	80,040	
JCRファーマ	42.2	35.5	40,505	
第一三共	17.9	29.6	115,765	
ゴム製品(0.8%)				
横浜ゴム	—	19	61,161	
機械(8.1%)				
三浦工業	43.4	30.2	84,801	
ディスコ	0.8	1.5	50,430	
SMC	4.8	2.4	184,704	
ダイキン工業	18.9	9.8	224,714	
ダイフク	19.4	26	75,205	
電気機器(17.0%)				
日立製作所	17.2	16.3	161,907	
ニデック	25.8	—	—	
ルネサスエレクトロニクス	—	48	123,816	
ソニーグループ	—	9.5	124,972	
キーエンス	8.9	5.4	337,932	
シスメックス	26.6	23.2	183,999	
太陽誘電	10.2	—	—	
村田製作所	29.7	50.2	142,216	
東京エレクトロン	2.4	9.1	229,820	
輸送用機器(1.0%)				
本田技研工業	27.3	—	—	
シマノ	10.1	3.4	75,038	
精密機器(2.5%)				
テルモ	35.9	12.4	58,738	
HOYA	17	5.2	89,726	
朝日インテック	37.9	16.5	47,025	
メニコン	11.4	—	—	

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
その他製品(2.0%)				
バンダイナムコホールディングス	12.3	28.8	81,518	
ビジョン	82.5	45.5	74,506	
陸運業(0.8%)				
SGホールディングス	60.1	30.1	60,756	
倉庫・運輸関連業(0.4%)				
トランコム	5	4.4	32,296	
情報・通信業(17.0%)				
システナ	159.3	—	—	
GMOペイメントゲートウェイ	30.5	37.9	350,764	
インターネットイニシアティブ	—	22.1	61,161	
ラクス	38.5	50.2	128,110	
オービック	13.9	8.1	190,107	
トレンドマイクロ	6.5	1	8,102	
大塚商会	12.8	7.6	45,273	
ネットワンシステムズ	29.1	—	—	
日本電信電話	80.8	1,682.2	284,796	
KDDI	41.7	39.5	175,143	
カブコン	—	14.6	67,087	
卸売業(3.5%)				
神戸物産	—	18.7	75,903	
伊藤忠商事	57.3	33.5	195,439	
小売業(7.2%)				
Monotaro	126.8	82.1	126,639	
コスモス薬品	4	1.9	29,763	
バン・パシフィック・インターナショナルホ	25.9	19.6	65,777	
ニトリホールディングス	14.5	5.8	106,401	
ファーストリテイリング	5.1	6.1	227,774	
銀行業(0.6%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	101.9	41.3	49,043	
保険業(1.8%)				
東京海上ホールディングス	94.2	40.2	141,544	
その他金融業(1.7%)				
芙蓉総合リース	—	4.8	56,688	
イー・ギャランティ	42.9	40.9	77,219	
不動産業(0.4%)				
カチタス	29	14.3	30,730	
サービス業(10.6%)				
日本M&Aセンターホールディングス	126.9	82.1	61,673	
エス・エム・エス	33.3	33.1	92,084	
エムスリー	119.7	122.2	279,960	
リクルートホールディングス	55.8	35.1	207,756	
インソース	—	81.7	70,262	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	28.5	15.6	36,270	
リログループ	32.1	—	—	
M&A総研ホールディングス	—	15.4	67,760	
合計	株数・金額	株数・金額	株数・金額	株数・金額
	64	65	7,693,498	7,693,498
	銘柄数<比率>	銘柄数<比率>	銘柄数<比率>	銘柄数<比率>
	64	65	<95.7%>	<95.7%>

(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。

下記は、野村日本株最小分散ポートフォリオ マザーファンド全体の内容です。

<国内株式(上場株式)>

銘柄	第4期末	第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
水産・農林業(0.8%)			
マルハニチロ	11.1	17.9	48,688
ホクト	19.5	14.4	24,868
建設業(6.4%)			
ショーボンドホールディングス	15.9	—	—
西松建設	31.8	19.1	72,942
大和ハウス工業	48.6	28.2	117,030
積水ハウス	57.2	35.8	107,292
関電工	67.7	31.7	42,731
きんでん	57.1	26.7	62,104
エクシオグループ	24.8	19.7	60,301
九電工	18	4.3	21,276
インフロンア・ホールディングス	58.7	61.1	85,387
食料品(13.4%)			
森永製菓	23.9	17.2	86,963
江崎グリコ	33.6	20	81,720
山崎製パン	49.4	29.1	91,839
カルビー	34.5	29.4	81,555
森永乳業	—	22.7	59,666
ヤクルト本社	—	24.3	76,326
明治ホールディングス	13.4	30	99,240
伊藤ハム米久ホールディングス	52.5	6.5	24,537
サッポロホールディングス	—	2.1	12,631
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホルデ	20.7	19.5	40,033
サントリー食品インターナショナル	29.3	5.5	25,888
伊藤園	15.7	—	—
味の素	30.4	22.4	122,438
キュービー	50.2	37.4	91,480
ハウス食品グループ本社	22.8	17	51,765
カゴメ	17.5	12.5	38,525
ニチレイ	14.5	28.7	99,474
東洋水産	23.4	—	—
日清食品ホールディングス	13	6.9	98,946
日本たばこ産業	60	—	—
パルプ・紙(2.0%)			
日本製紙	—	37.1	47,376
大王製紙	64	34.6	38,838
レンゴー	139.2	97.2	90,201
化学(7.1%)			
エア・ウォーター	29.5	25	46,375
積水化学工業	—	48.2	97,580
日油	6.1	8.2	56,571
花王	10.2	22.6	132,255

銘柄	第4期末	第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
富士フイルムホールディングス	4.5	—	—
ライオン	—	36.4	47,957
ポーラ・オルビスホールディングス	11.6	40.5	64,536
小林製薬	5.9	2.9	18,937
エフピコ	28	15	43,290
ユニ・チャーム	31.4	24.4	120,487
医薬品(1.1%)			
科研製薬	18.4	—	—
参天製薬	—	72.4	99,912
ツムラ	4.7	—	—
機械(0.7%)			
平和	41.4	30.9	63,283
SANKYO	23.1	—	—
セガサミーホールディングス	14.9	—	—
電気機器(7.4%)			
日立製作所	—	10.5	104,296
東芝	35	—	—
日本電気	17.1	14.8	121,108
ソニーグループ	—	2.9	38,149
ヒロセ電機	3.8	3.1	50,406
アズビル	28.2	7.9	37,185
日本光電工業	37	23.5	88,289
京セラ	23.8	10.3	84,418
村田製作所	—	15.6	44,194
キヤノン	62.3	23.1	85,031
その他製品(0.8%)			
大日本印刷	6	—	—
リンテック	25.1	—	—
コクヨ	52.1	30.7	69,919
電気・ガス業(4.0%)			
電源開発	60.9	41.2	92,185
東京瓦斯	56.1	31.6	105,733
大阪瓦斯	65.3	36.8	107,492
東邦瓦斯	33	17.8	48,051
陸運業(5.3%)			
相鉄ホールディングス	—	11.1	29,931
東急	—	18.2	30,576
東日本旅客鉄道	—	3.9	31,211
西日本鉄道	6.9	—	—
近鉄グループホールディングス	30.7	13.3	57,682
阪急阪神ホールディングス	18.9	22.4	99,769
南海電気鉄道	25.8	17.3	48,578
名古屋鉄道	38.7	27	59,251

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
ヤマトホールディングス	—	6.6	17,483	
九州旅客鉄道	33.9	30.5	93,970	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
上組	8.1	4.6	15,078	
情報・通信業(16.2%)				
NEC ネットエスアイ	48.6	42.2	95,372	
T I S	36	32.1	97,455	
グリー	80.6	—	—	
インターネットイニシアティブ	48.4	34.5	95,478	
フジ・メディア・ホールディングス	113.8	48	79,440	
オービック	5.8	—	—	
トレンドマイクロ	13.4	—	—	
日本オラクル	10	7.2	83,016	
伊藤忠テクノソリューションズ	39.1	—	—	
大塚商会	29.5	16.5	98,290	
B I P R O G Y	—	22.6	95,688	
日本テレビホールディングス	117.1	49.9	75,598	
スカパーJ S A Tホールディングス	147.5	76.9	50,215	
日本電信電話	85.1	1,329.1	225,016	
K D D I	62.1	40.1	177,803	
ソフトバンク	146.5	93.8	160,913	
東宝	11.6	—	—	
S C S K	59.8	34.8	95,230	
卸売業(4.0%)				
アルフレッサ ホールディングス	78.5	28.1	67,454	
シップヘルスケアホールディングス	45.1	7.2	15,998	
メディパルホールディングス	72.1	27.1	61,191	
伊藤忠商事	55.2	—	—	
キヤノンマーケティングジャパン	26.6	16.5	66,759	
岩谷産業	22	8.9	56,630	
P A L T A C	9.9	6.5	29,152	
スズケン	34.6	11	53,130	
小売業(14.3%)				
ローソン	25.2	13.3	94,709	
エービーシー・マート	17.9	6.5	16,474	
エディオン	17.4	34.8	52,339	
ビックカメラ	—	21.9	28,886	
すかいらーくホールディングス	80.8	44.9	92,381	
コスモス薬品	2.7	—	—	
セブン&アイ・ホールディングス	32.2	18.4	101,016	
ツルハホールディングス	—	3.9	48,633	
バン・パシフィック・インターナショナルホ	60.9	32.6	109,405	
ゼンショーホールディングス	31.6	4.2	30,496	
スギホールディングス	13.5	7.9	48,411	
しまむら	6.7	—	—	

銘柄	第4期末		第5期末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)	評価額 (千円)
ヤオコー	14.2	8.6	69,462	
ケーズホールディングス	67.5	51.5	67,825	
アインホールディングス	10.1	—	—	
ヤマダホールディングス	211.8	195.4	83,650	
ニトリホールディングス	7.9	6	110,070	
吉野家ホールディングス	50.6	26.8	83,991	
ファーストリテイリング	—	3.7	138,158	
サンドラッグ	31.4	20.4	88,556	
銀行業(11.5%)				
しずおかフィナンシャルグループ	—	31.8	36,140	
九州フィナンシャルグループ	—	72.1	55,163	
ひろぎんホールディングス	101.1	100.2	88,817	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	45.2	53,675	
三井住友トラスト・ホールディングス	19.9	19.5	102,492	
三井住友フィナンシャルグループ	—	31.8	213,155	
群馬銀行	—	81.7	55,752	
八十二銀行	—	87	66,955	
セブン銀行	340.6	303.5	88,895	
みずほフィナンシャルグループ	129.2	74.2	174,370	
山口フィナンシャルグループ	33.1	62.5	77,656	
保険業(2.6%)				
S O M P Oホールディングス	28.1	—	—	
MS&ADインシュアランスグループホール	39.8	21.6	117,504	
東京海上ホールディングス	83.8	32.4	114,080	
不動産業(0.7%)				
大東建託	9.9	2.3	36,788	
ヒューリック	—	15.5	22,963	
サービス業(1.5%)				
総合警備保障	—	113	90,433	
日本郵政	170.8	—	—	
セコム	—	3.8	38,722	
合 計	株数・金額	5,054	5,042	8,831,120
	銘柄数<比率>	116	119	<99.4%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

組入投資信託証券の内容

■ウエスタン・カレンシー・アルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	フランクリン・templton・ジャパン株式会社
主な投資対象・投資地域	日本の公社債及び為替予約取引等
運用の基本方針等	この投資信託は、主に日本の公社債に投資を行うとともに、為替予約取引等を積極的に活用する通貨ロング・ショート戦略により、市場動向に左右されにくい安定した収益の獲得を目指します。

●損益の状況

項目	第 2 期 自 2022年11月17日 至 2023年11月16日
(A)有価証券売買損益	△1,906,164,579円
売 買 益	184,505,136
売 買 損	△2,090,669,715
(B)信託報酬等	△105,450,243
(C)当期損益金(A+B)	△2,011,614,822
(D)前期繰越損益金	△1,348,617,518
(E)追加信託差損益金	△885,117,074
(配当等相当額)	(△1,622,951)
(売買損益相当額)	(△883,494,123)
(F)計(C+D+E)	△4,245,349,414
次期繰越損益金(F)	△4,245,349,414
追加信託差損益金	△885,117,074
(配当等相当額)	(△2,412,488)
(売買損益相当額)	(△882,704,586)
繰越損益金	△3,360,232,340

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 1 期 末	第 2 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド	千口 21,481,305	千口 26,185,019	千円 22,964,262

下記は、ウエスタン・カレンシー・アルファ・マザーファンド全体の内容です。

<国内(邦貨建)公社債>

第	2	期	末		
銘	柄	名	利	率	
			(%)	額	
				面	
				金	
				額	
				(千円)	
				評	
				価	
				額	
				(千円)	
				償	
				還	
				年月日	
国債証券					
第1161	回国庫短期証券	—	6,050,000	6,050,679	2023/12/11
第1177	回国庫短期証券	—	2,100,000	2,100,031	2023/11/20
第1179	回国庫短期証券	—	3,700,000	3,700,427	2023/12/4
第1182	回国庫短期証券	—	3,500,000	3,500,475	2023/12/18
第1184	回国庫短期証券	—	6,480,000	6,481,272	2023/12/25
第1185	回国庫短期証券	—	7,000,000	7,002,454	2024/1/9
合	計		28,830,000	28,835,341	

組入投資信託証券の内容

■MA Hedge Fund Strategies Limited

●ファンドの概要

運 用 会 社	UBS O' Connor LLC
運 用 方 針	公表された合併・買収案件等において、買収先企業の株式を買い付け、又は買収先企業の株式を買い付けると同時に買収元企業の株式を売り建てることを基本戦略とします。なお、関連する上場デリバティブ商品等を活用することがあります。
主 要 運 用 対 象	主として世界各国(日本を含みます。)の企業の株式に投資を行います。なお、関連する上場デリバティブ商品等に投資を行うことがあります。
組 入 制 限	投資法人財産を超える有価証券(現物に限ります)の空売りは行いません。 投資法人財産の10%を超える借り入れは行いません。 一発行会社(投資法人を含みます。)の発行済株式総数の50%超を超える株式(投資法人が発行する投資証券を含みます。)を取得しないものとします。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

以下の「損益の状況」は「MA Hedge Fund Strategies Limited FINANCIAL STATEMENTS Year Ended December 30, 2022 With Report of Independent Auditors」の情報を基に、「投資明細表」は当該ファンドの運用会社からの情報を基に掲載しています。

MA Hedge Fund Strategies Limited

● 損益の状況 (2022年12月30日までの会計期間)

Realized and unrealized gains (losses) on investments in securities, derivative contracts and foreign currency

Net realized loss on investments in securities and foreign currency	\$ (1,641,578)	
Net realized loss on derivative contracts and foreign currency	(5,214,663)	
Net change in unrealized appreciation/depreciation on investments in securities and foreign currency	(1,546,318)	
Net change in unrealized appreciation/depreciation on derivative contracts and foreign currency	<u>3,398,108</u>	
Net loss on investments in securities, derivative contracts and foreign currency		\$ (5,004,451)

Investment income

Interest	793,088	
Dividends (net of withholding tax of \$82,265)	<u>751,501</u>	
Total investment income	1,544,589	

Expenses

Interest	354,486	
Dividends	103,196	
Management fees	473,932	
Performance fees	11,303	
Administration fees	46,304	
Other	<u>163,785</u>	
Total expenses	<u>1,153,006</u>	

Net investment income		<u>391,583</u>
Net change in net assets resulting from operations		<u>\$ (4,612,868)</u>

●投資明細表(2022年12月30日現在)

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
Bond													
CONVERTIBLE CORP													
	307,000.000	US98936JAD37	ZENDESK INC 0.625% 06/15/25 CVT	USD	298,688.75	298,688.75	99.8200	1.0000	306,447.40	306,447.40	7,758.65	0.00	7,758.65
			Subtotal - CONVERTIBLE CORP			298,688.75			306,447.40	306,447.40	7,758.65	0.00	7,758.65
CORP													
	-285,000.000	US099724AJ55	BORGWARNER INC 3.375% 03/15/25	USD	-309,543.52	-309,543.52	95.8882	1.0000	-273,281.49	-273,281.49	36,262.03	0.00	36,262.03
	362,000.000	US099724AM84	BORGWARNER INC 5.000% 10/01/25 SR:144A	USD	417,535.48	417,535.48	98.1713	1.0000	355,379.94	355,379.94	-62,155.54	0.00	-62,155.54
	27,000.000	US20752TAA25	CONNECT FINCO SABL/CONN 6.750% 10/01/26 SR:144A	USD	28,350.00	28,350.00	92.8820	1.0000	25,078.13	25,078.13	-3,271.87	0.00	-3,271.87
	349,000.000	US22282EAJ10	COVANTA HOLDING CORP 5.000% 09/01/30	USD	343,423.53	343,423.53	80.9713	1.0000	282,589.83	282,589.83	-60,833.70	0.00	-60,833.70
	215,000.000	US44055PAA49	HORIZON THERAPEUTICS USA 5.500% 08/01/27 SR:144A	USD	214,305.00	214,305.00	102.0324	1.0000	219,369.72	219,369.72	5,064.72	0.00	5,064.72
	533,000.000	US449253AB91	IAA INC 5.500% 06/15/27 SR:144A	USD	527,457.02	527,457.02	97.7074	1.0000	520,780.38	520,780.38	-6,676.64	0.00	-6,676.64
	-204,000.000	US45866FAJ30	INTERCONTINENTALEXCHANGE 3.750% 09/21/28	USD	-187,486.61	-187,486.61	94.5501	1.0000	-192,882.21	-192,882.21	-5,395.60	0.00	-5,395.60
	80,000.000	US45866FAU84	INTERCONTINENTALEXCHANGE 4.000% 09/15/27	USD	75,943.62	75,943.62	96.6706	1.0000	77,336.46	77,336.46	1,392.84	0.00	1,392.84
	114,000.000	US45866FAV67	INTERCONTINENTALEXCHANGE 4.350% 06/15/29	USD	110,226.78	110,226.78	96.6861	1.0000	110,222.11	110,222.11	-4.67	0.00	-4.67
	1,172,000.000	US92047WAD39	VALVOLINE INC 4.250% 02/15/30 SR:144A	USD	1,140,837.31	1,140,837.31	97.1913	1.0000	1,139,081.51	1,139,081.51	-1,755.80	0.00	-1,755.80
	2,000.000	US92943GAA94	WR GRACE HOLDING LLC 5.625% 08/15/29 SR:144A	USD	2,046.24	2,046.24	80.9770	1.0000	1,619.54	1,619.54	-426.70	0.00	-426.70
			Subtotal - CORP			2,363,094.85			2,265,293.92	2,265,293.92	-97,800.93	0.00	-97,800.93
GOVT													
	-96,600.000	US91282CBH34	US TREASURY N/B 0.375% 01/31/26	USD	-89,949.21	-89,949.21	89.0742	1.0000	-86,045.68	-86,045.68	3,903.53	0.00	3,903.53
	-52,800.000	US91282CFL00	US TREASURY N/B 3.875% 09/30/29	USD	-52,808.26	-52,808.26	99.5391	1.0000	-52,556.64	-52,556.64	251.62	0.00	251.62
	-59,000.000	US91282CFM82	US TREASURY N/B 4.125% 09/30/27	USD	-58,990.78	-58,990.78	100.5430	1.0000	-59,320.37	-59,320.37	-329.59	0.00	-329.59
			Subtotal - GOVT			-201,748.25			-197,922.69	-197,922.69	3,825.56	0.00	3,825.56
			Subtotal - Bond			2,460,035.35			2,373,818.63	2,373,818.63	-86,216.72	0.00	-86,216.72
Equity													
ADR													
	3,734.000	RYAAY US	RYANAIR HOLDINGS PLC-SP ADR	USD	286,228.50	286,228.50	74.7600	1.0000	279,153.84	279,153.84	-7,074.66	0.00	-7,074.66
	16,647.000	SIMO US	SILICON MOTION TECHNOL-ADR	USD	1,227,552.01	1,227,552.01	64.9900	1.0000	1,081,888.53	1,081,888.53	-145,663.48	0.00	-145,663.48
			Subtotal - ADR			1,513,780.51			1,361,042.37	1,361,042.37	-152,738.14	0.00	-152,738.14
COMMON STOCK													
	43,615.000	1995244D AV	IIA_LR=AT	EUR	0.00	0.00	0.0000	1.0705	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	54,500.000	5486 JP	HITACHI METALS LTD	JPY	118,729,220.23	895,174.27	2,177.0000	131.1200	118,646,500.00	904,889.59	-630.89	10,326.21	9,695.32
	8,000.000	6502 JP	TOSHIBA CORP	JPY	39,238,102.11	300,183.10	4,603.0000	131.1200	36,824,000.00	280,841.97	-18,411.41	-929.72	-19,341.13
	10,400.000	9086 JP	HITACHI TRANSPORT SYSTEM LTD	JPY	92,570,230.05	698,280.96	8,890.0000	131.1200	92,456,000.00	705,125.08	-871.18	7,715.30	6,844.12
	387,971.000	AABA_ESCROW	AABA_ESCROW	USD	3,302,907.47	3,302,907.47	3.8000	1.0000	1,474,289.80	1,474,289.80	-1,828,617.67	0.00	-1,828,617.67
	1,145.000	AAC US	ARES ACQUISITION CORP-A	USD	11,209.55	11,209.55	10.0700	1.0000	11,530.15	11,530.15	320.60	0.00	320.60
	1,050.000	AACI US	ARMADA ACQUISITION CORP I	USD	10,426.50	10,426.50	10.1200	1.0000	10,626.00	10,626.00	199.50	0.00	199.50

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	17,534.00	AAWW US	ATLAS AIR WORLDWIDE HOLDINGS	USD	1,742,203.50	1,742,203.50	100.8000	1.0000	1,767,427.20	1,767,427.20	25,223.70	0.00	25,223.70
	10,910.00	ABMD US_Dummy CVR_35 USD Cash	ABMD US_Dummy CVR_35 USD Cash	USD	0.00	0.00	2.0000	1.0000	21,820.00	21,820.00	21,820.00	0.00	21,820.00
	294.00	ACAH US	ATLANTIC COASTAL ACQUISITI-A	USD	2,890.02	2,890.02	10.0150	1.0000	2,944.41	2,944.41	54.39	0.00	54.39
	750.00	ACDI US	ASCENDANT DIGITAL ACQU-CL A	USD	7,485.00	7,485.00	10.3200	1.0000	7,740.00	7,740.00	255.00	0.00	255.00
	1,206.00	ACEL US	ACCEL ENTERTAINMENT INC USD	USD	12,795.66	12,795.66	7.7000	1.0000	9,286.20	9,286.20	-3,509.46	0.00	-3,509.46
	15,790.00	ACHN_CVR	ACHILLION PHARMACEUTICALS INC	USD	0.00	0.00	0.6000	1.0000	9,474.00	9,474.00	9,474.00	0.00	9,474.00
	1,495.00	ACQR US	INDEPENDENCE HDS CORP-CL A	USD	14,725.75	14,725.75	10.0800	1.0000	15,069.60	15,069.60	343.85	0.00	343.85
	1,794.00	ACRO US	ACROPOLIS INFRASTRUCTURE - A	USD	17,491.50	17,491.50	9.9500	1.0000	17,850.30	17,850.30	358.80	0.00	358.80
	1,619.00	ADAL US	ANTHEMIS DIGITAL ACQUISITION	USD	16,076.67	16,076.67	10.2600	1.0000	16,610.94	16,610.94	534.27	0.00	534.27
	746.00	AEAC US	AUTHENTIC EQUITY ACQUISITI-A	USD	7,348.10	7,348.10	10.1100	1.0000	7,542.06	7,542.06	193.96	0.00	193.96
	1,500.00	AEAE US	ALTENERGY ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.1700	1.0000	15,255.00	15,255.00	255.00	0.00	255.00
	4,529.00	AFTR US	AFTERNEXT HEALTHTECH ACQUI-A	USD	44,112.46	44,112.46	10.0200	1.0000	45,380.58	45,380.58	1,268.12	0.00	1,268.12
	1,495.00	AGGR US	AGILE GROWTH CORP-A USD	USD	14,725.75	14,725.75	10.0900	1.0000	15,084.55	15,084.55	358.80	0.00	358.80
	1,176.00	AHRN US	AHREN ACQUISITION CO-CLASS A	USD	11,748.24	11,748.24	10.2350	1.0000	12,036.36	12,036.36	288.12	0.00	288.12
	15,550.00	AIMC US	ALTRA INDUSTRIAL MOTION CORP	USD	902,641.43	902,641.43	59.7500	1.0000	929,112.50	929,112.50	26,471.07	0.00	26,471.07
	1,500.00	ALCC US	ALTC ACQUISITION CORP-CL A	USD	14,640.00	14,640.00	9.9200	1.0000	14,880.00	14,880.00	240.00	0.00	240.00
	1,275.00	ALOR US	ALSP ORCHID ACQUISITION-CL A	USD	12,711.75	12,711.75	10.2300	1.0000	13,043.25	13,043.25	331.50	0.00	331.50
	2,250.00	AMCI US	AMCI ACQUISITION CORP II-A	USD	22,117.50	22,117.50	9.9800	1.0000	22,455.00	22,455.00	337.50	0.00	337.50
	1,747.00	ANAC US	ARCTOS NORTHSTAR ACQUISIT-A	USD	17,350.42	17,350.42	10.0900	1.0000	17,627.23	17,627.23	276.81	0.00	276.81
	1,344.00	ANZU US	ANZU SPECIAL ACQUISITION -A	USD	13,224.96	13,224.96	10.0200	1.0000	13,466.88	13,466.88	241.92	0.00	241.92
	735.00	AOGO US	AROGO CAPITAL ACQUISITION -A	USD	7,327.95	7,327.95	10.1300	1.0000	7,445.55	7,445.55	117.60	0.00	117.60
	750.00	APAC US	STONEBRIDGE ACQUISITION CORP	USD	7,537.50	7,537.50	10.2700	1.0000	7,702.50	7,702.50	165.00	0.00	165.00
	882.00	APCA US	AP ACQUISITION CORP-A USD	USD	8,899.38	8,899.38	10.3200	1.0000	9,102.24	9,102.24	202.86	0.00	202.86
	1,497.00	APGB US	APOLLO STRATEGIC GROWTH-CL A	USD	14,970.00	14,970.00	10.0200	1.0000	14,999.94	14,999.94	29.94	0.00	29.94
	750.00	APMI US	AXONPRIME INFRASTRUCTURE-A	USD	7,297.50	7,297.50	9.9000	1.0000	7,425.00	7,425.00	127.50	0.00	127.50
	900.00	APN US	APEIRON CAPITAL INVESTMENT-A	USD	9,000.00	9,000.00	10.2600	1.0000	9,234.00	9,234.00	234.00	0.00	234.00
	1,200.00	APTM US	ALPHA PARTNERS TECHNOLOGY-A	USD	11,688.00	11,688.00	10.0300	1.0000	12,036.00	12,036.00	348.00	0.00	348.00
	882.00	APXI US	APX ACQUISITION CORP I USD	USD	8,881.74	8,881.74	10.2750	1.0000	9,062.55	9,062.55	180.81	0.00	180.81
	1,200.00	ARTE US	ARTEMIS STRATEGIC INVES-CL A	USD	11,952.00	11,952.00	10.2100	1.0000	12,252.00	12,252.00	300.00	0.00	300.00
	588.00	ARYE US	ARYA SCIENCES ACQUISITION -A	USD	5,744.76	5,744.76	10.0900	1.0000	5,932.92	5,932.92	188.16	0.00	188.16
	1,196.00	ATAQ US	ALTIMAR ACQUISITION CORP-A	USD	11,804.52	11,804.52	10.0700	1.0000	12,043.72	12,043.72	239.20	0.00	239.20
	-75,770.00	ATCOA SS	ATLAS COPCO AB-A SHS SEK	USD	-7,773,018.97	-760,144.58	123.1000	10.4283	-9,327,287.00	-894,420.70	-149,043.26	14,767.14	-134,276.12
	86,569.00	ATCOB SS	ATLAS COPCO AB-B SHS SEK	USD	7,889,740.56	769,869.39	111.1000	10.4283	9,617,815.90	922,280.32	165,710.17	-13,299.24	152,410.93
	80,114.00	ATVI US	ACTIVISION BLIZZARD INC USD	USD	6,061,127.89	6,061,127.89	76.5500	1.0000	6,132,726.70	6,132,726.70	71,598.81	0.00	71,598.81
	750.00	AVAC US	AVALON ACQUISITION INC-A	USD	7,530.00	7,530.00	10.2500	1.0000	7,687.50	7,687.50	157.50	0.00	157.50
	-1,787.00	AVGO US	BROADCOM INC	USD	-684,029.99	-684,029.99	559.1300	1.0000	-999,165.31	-999,165.31	-115,135.32	0.00	-115,135.32
	750.00	AVHI US	ACHARI VENTURES HOLDINGS COR	USD	7,522.50	7,522.50	10.2200	1.0000	7,665.00	7,665.00	142.50	0.00	142.50
	1,500.00	BCSA US	BLOCKCHAIN COINVESTORS -CL A	USD	14,895.00	14,895.00	10.2400	1.0000	15,360.00	15,360.00	465.00	0.00	465.00
	735.00	BFAC US	BATTERY FUTURE ACQUISITION-A	USD	7,335.30	7,335.30	10.2700	1.0000	7,548.45	7,548.45	213.15	0.00	213.15
	1,451.00	BGSX US	BUILD ACQUISITION CORP-A	USD	14,176.27	14,176.27	10.0200	1.0000	14,539.02	14,539.02	362.75	0.00	362.75
	255.00	BHAC US	CRIVUS BH3 ACQUISITION CO-A	USD	2,534.70	2,534.70	10.0500	1.0000	2,562.75	2,562.75	28.05	0.00	28.05
	4,316.00	BHVN US	BIOHAVEN LTD	USD	29,172.67	29,172.67	13.8800	1.0000	59,906.08	59,906.08	30,733.41	0.00	30,733.41
	1,470.00	BIOS US	BIOPLUS ACQUISITION CORP-A	USD	14,685.30	14,685.30	10.2200	1.0000	15,023.40	15,023.40	338.10	0.00	338.10
	1,800.00	BLEU US	BLUEACACIA LTD - CLASS A	USD	17,568.00	17,568.00	10.0600	1.0000	18,108.00	18,108.00	540.00	0.00	540.00
	453.00	BLNG US	BELONG ACQUISITION CORP-A	USD	4,466.58	4,466.58	9.8900	1.0000	4,480.17	4,480.17	13.59	0.00	13.59
	1,500.00	BLUA US	BLUERIVER ACQUISITION CORP-A	USD	14,827.50	14,827.50	10.0900	1.0000	15,135.00	15,135.00	307.50	0.00	307.50
	1,350.00	BMAC US	BLACK MOUNTAIN ACQUISITION-A	USD	13,554.00	13,554.00	10.2000	1.0000	13,770.00	13,770.00	216.00	0.00	216.00
	31,990.00	BMY-R_CVR	BRISTOL-MYERS SQUIBB-CVR	USD	76,232.78	76,232.78	1.3000	1.0000	41,587.00	41,587.00	-34,645.78	0.00	-34,645.78
	1,764.00	BOCN US	BLUE OCEAN ACQUISITION COR-A	USD	17,995.90	17,995.90	10.2800	1.0000	18,133.92	18,133.92	538.02	0.00	538.02
	1,176.00	BPAC US	BULLPEN PARLAY ACQUISITION-A	USD	11,748.24	11,748.24	10.2400	1.0000	12,042.24	12,042.24	294.00	0.00	294.00
	1,544.00	BRD US	BEARD ENERGY TRANSITION AC-A	USD	15,393.68	15,393.68	10.1900	1.0000	15,733.36	15,733.36	339.68	0.00	339.68
	519.00	BRIV US	B RILEY PRINCIPAL 250 MERG-A	USD	5,047.28	5,047.28	9.9600	1.0000	5,169.24	5,169.24	121.96	0.00	121.96
	882.00	BRKH US	BURTECH ACQUISITION CORP-A	USD	8,802.36	8,802.36	10.1600	1.0000	8,961.12	8,961.12	158.76	0.00	158.76

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	735,000	BYN US	BANYAN ACQUISITION CORP-A	USD	7,342.65	7,342.65	10.2100	1.0000	7,504.35	7,504.35	161.70	0.00	161.70
	1,195,000	BYTS US	BYTE ACQUISITION CORP - A	USD	11,519.80	11,519.80	10.0800	1.0000	12,045.60	12,045.60	525.80	0.00	525.80
	2,100,000	CBRG US	CHAIN BRIDGE I-A	USD	20,884.50	20,884.50	10.2800	1.0000	21,588.00	21,588.00	703.50	0.00	703.50
	750,000	CCTS US	CACTUS ACQUISITION CORP 1 LT	USD	7,515.00	7,515.00	10.2600	1.0000	7,695.00	7,695.00	180.00	0.00	180.00
	1,598,000	CCV US	CHURCHILL CAPITAL CORP V-A	USD	15,804.22	15,804.22	9.9400	1.0000	15,884.12	15,884.12	79.90	0.00	79.90
	2,503,000	CCVI US	CHURCHILL CAPITAL CORP VI-A	USD	24,757.03	24,757.03	9.9950	1.0000	25,017.49	25,017.49	260.46	0.00	260.46
	1,176,000	CFFS US	CF ACQUISITION CORP VII-CL A	USD	11,712.96	11,712.96	10.2000	1.0000	11,995.20	11,995.20	282.24	0.00	282.24
	1,781,000	CFIV US	CF ACQUISITION CORP IV-CL A	USD	17,614.09	17,614.09	10.2200	1.0000	18,201.82	18,201.82	587.73	0.00	587.73
	750,000	CHAA US	CATCHA INVESTMENT CORP-A	USD	7,245.00	7,245.00	10.0900	1.0000	7,567.50	7,567.50	322.50	0.00	322.50
	1,800,000	CIIG US	CIIG CAPITAL PARTNERS II-A	USD	17,946.00	17,946.00	10.1900	1.0000	18,342.00	18,342.00	396.00	0.00	396.00
	662,000	CITE US	CARTICA ACQUISITION CORP-A	USD	6,672.96	6,672.96	10.3700	1.0000	6,864.94	6,864.94	191.98	0.00	191.98
	1,495,000	CLAA US	COLONNADE ACQUISITION CORP-A	USD	14,740.70	14,740.70	10.0700	1.0000	15,054.65	15,054.65	313.95	0.00	313.95
	1,500,000	CLBR US	COLOMBIER ACQUISITION CORP-A	USD	14,520.00	14,520.00	9.9400	1.0000	14,910.00	14,910.00	390.00	0.00	390.00
	722,000	CLIN US	CLEAN EARTH ACQUISITIONS -A	USD	7,147.80	7,147.80	10.1000	1.0000	7,292.20	7,292.20	144.40	0.00	144.40
	1,470,000	CMCA US	CAPITALWORKS EMERGING M-CL A	USD	14,744.10	14,744.10	10.3300	1.0000	15,185.10	15,185.10	441.00	0.00	441.00
	572,000	CNDA US	CONCORD ACQUISITION CORP -A	USD	5,570.00	5,570.00	9.9450	1.0000	5,688.55	5,688.55	118.55	0.00	118.55
	1,050,000	CNDB US	CONCORD ACQUISITION CORP -A	USD	10,405.50	10,405.50	10.1900	1.0000	10,699.50	10,699.50	294.00	0.00	294.00
	504,000	CORS US	CORSAIR PARTNERING CORP -A	USD	4,914.00	4,914.00	10.0000	1.0000	5,040.00	5,040.00	126.00	0.00	126.00
	23,287,000	COUP US	COUPA SOFTWARE INC	USD	1,830,588.52	1,830,588.52	79.1700	1.0000	1,843,631.79	1,843,631.79	13,043.27	0.00	13,043.27
	11,384,000	COWN US	COWEN INC - A	USD	439,503.21	439,503.21	38.6200	1.0000	439,650.08	439,650.08	146.87	0.00	146.87
	9,510,000	CPAA US	CONVERS PARK III ACQUISITI-A	USD	92,532.30	92,532.30	9.8961	1.0000	94,111.91	94,111.91	1,579.61	0.00	1,579.61
	1,156,000	CPAQ US	COUNTER PRESS ACQUISITION CO	USD	11,606.24	11,606.24	10.2600	1.0000	11,860.56	11,860.56	254.32	0.00	254.32
	2,955,000	CPAR US	CATALYST PARTNERS ACQ-A	USD	28,899.90	28,899.90	10.0750	1.0000	29,771.62	29,771.62	871.72	0.00	871.72
	596,000	CPKT US	CROWN PROTECH ACQUISITION-A	USD	5,960.00	5,960.00	10.1100	1.0000	6,025.56	6,025.56	65.56	0.00	65.56
	305,000	CRC US	CALIFORNIA RESOURCES CORP	USD	10,557.80	10,557.80	43.5100	1.0000	13,270.55	13,270.55	2,712.75	0.00	2,712.75
	750,000	CRZN US	CORAZON CAPITAL V838 MONOC-A	USD	7,353.75	7,353.75	10.0800	1.0000	7,560.00	7,560.00	206.25	0.00	206.25
	735,000	CSLM US	CONSILIUM ACQUISITION CORP I	USD	7,247.10	7,247.10	10.1200	1.0000	7,438.20	7,438.20	191.10	0.00	191.10
	760,000	CSTA US	CONSTELLATION ACQUISITION-A	USD	7,508.80	7,508.80	10.1100	1.0000	7,683.60	7,683.60	174.80	0.00	174.80
	1,232,000	CTAQ US	CARNEY TECHNOLOGY ACQU- CL A	USD	12,221.44	12,221.44	10.2400	1.0000	12,615.68	12,615.68	394.24	0.00	394.24
	2,991,000	CVII US	CHURCHILL CAPITAL CORP VII-A	USD	29,550.00	29,550.00	9.9700	1.0000	29,820.27	29,820.27	270.27	0.00	270.27
	900,000	DCACS NA	DISRUPTIVE CAPITAL ACQUISITI	GBP	9,090.00	10,995.26	10.1000	1.2083	9,090.00	10,983.45	0.00	-11.81	-11.81
	1,500,000	DCRD US	DECARBONIZATION PLUS ACQUI-A	USD	14,970.00	14,970.00	10.2150	1.0000	15,322.50	15,322.50	352.50	0.00	352.50
	2,206,000	DGNU US	DRAGONER GROWTH OPP III-A	USD	21,574.68	21,574.68	9.8600	1.0000	21,751.16	21,751.16	176.48	0.00	176.48
	1,495,000	DHCA US	DHC ACQUISITION CORP-A	USD	14,725.75	14,725.75	10.0701	1.0000	15,054.80	15,054.80	329.05	0.00	329.05
	2,213,000	DHHC US	DIAMONDHEAD HOLDINGS CORP-A	USD	21,831.25	21,831.25	10.0500	1.0000	22,240.65	22,240.65	409.40	0.00	409.40
	1,252,000	DISA US	DISRUPTIVE ACQUISITION COR-A	USD	12,094.32	12,094.32	10.0800	1.0000	12,620.16	12,620.16	525.84	0.00	525.84
	750,000	DLCA US	DEEP LAKE CAPITAL ACQUIS-CLA	USD	7,421.25	7,421.25	10.0900	1.0000	7,567.50	7,567.50	146.25	0.00	146.25
	2,198,000	DMYS US	DMY TECHNOLOGY GROUP INC VI	USD	21,496.44	21,496.44	10.0500	1.0000	22,089.90	22,089.90	593.46	0.00	593.46
	750,000	DNAB US	SOCIAL CAPITAL SURETTA HO-A	USD	7,400.79	7,400.79	10.0600	1.0000	7,545.00	7,545.00	144.21	0.00	144.21
	686,000	DNAD US	SOCIAL CAPITAL SURETTA HO-A	USD	6,771.76	6,771.76	10.0500	1.0000	6,894.30	6,894.30	122.54	0.00	122.54
	748,000	DNZ US	D AND Z MEDIA ACQUISITION-A	USD	7,382.76	7,382.76	10.0000	1.0000	7,480.00	7,480.00	97.24	0.00	97.24
	2,100,000	DPCS US	DP CAP ACQUISITION CORP-CL A	USD	21,000.00	21,000.00	10.2600	1.0000	21,546.00	21,546.00	546.00	0.00	546.00
	752,000	DRAY US	MACONDRAY CAPITAL AC-CLASS A	USD	7,433.52	7,433.52	10.1900	1.0000	7,662.88	7,662.88	229.36	0.00	229.36
	756,000	DSAQ US	DIRECT SELLING ACQUISITION-A	USD	7,578.90	7,578.90	10.2900	1.0000	7,779.24	7,779.24	200.34	0.00	200.34
	1,046,000	DTOC US	DIGITAL TRANSFORMATION OPP-A	USD	10,297.87	10,297.87	10.0450	1.0000	10,507.07	10,507.07	209.20	0.00	209.20
	765,000	DTRT US	DTRT HEALTH ACQ CORP-A	USD	7,734.15	7,734.15	10.3600	1.0000	7,925.40	7,925.40	191.25	0.00	191.25
	598,000	EGGF US	EG ACQUISITION CORP-A	USD	5,854.42	5,854.42	9.9700	1.0000	5,962.06	5,962.06	107.64	0.00	107.64
	735,000	EMLD US	FTAC EMERALD ACQUISITION -A	USD	7,232.40	7,232.40	10.0200	1.0000	7,364.70	7,364.70	132.30	0.00	132.30
	750,000	ENER US	ACCRETION ACQUISITION CORP	USD	7,417.50	7,417.50	10.0800	1.0000	7,560.00	7,560.00	142.50	0.00	142.50
	1,800,000	ENTF US	ENTERPRISE 4.0 TECHNOLOGY AC	USD	18,018.00	18,018.00	10.2800	1.0000	18,504.00	18,504.00	486.00	0.00	486.00
	2,250,000	EOCW US	ELLIOTT OPPORTUNITY II COR-A	USD	21,825.00	21,825.00	10.0800	1.0000	22,680.00	22,680.00	855.00	0.00	855.00
	747,000	EPHY US	EPIPHANY TECHNOLOGY ACQ-CL A	USD	7,376.63	7,376.63	10.0050	1.0000	7,473.74	7,473.74	97.11	0.00	97.11
	1,029,000	EPIC NA	EPIC ACQUISITION CORP	EUR	10,135.65	10,308.97	10.0000	1.0705	10,290.00	11,015.45	165.23	541.25	706.48

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	748.000	EQHA US	EQ HEALTH ACQUISITION CORP-A	USD	7,386.50	7,386.50	10.0600	1.0000	7,524.88	7,524.88	138.38	0.00	138.38
	1,500.000	ESAC US	ESGEN ACQUISITION CORP-A	USD	15,135.00	15,135.00	10.3400	1.0000	15,510.00	15,510.00	375.00	0.00	375.00
	1,943.000	ESG NA	ESG CORE INVESTMENTS BV	EUR	12,812.22	13,031.31	9.7800	1.0705	13,134.54	14,060.53	345.04	684.18	1,029.22
	1,495.000	ESM US	ESM ACQUISITION CORP-A	USD	14,755.65	14,755.65	10.0900	1.0000	15,084.55	15,084.55	328.90	0.00	328.90
	735.000	EVE US	EVE MOBILITY ACQUISITION C-A	USD	7,357.35	7,357.35	10.3000	1.0000	7,570.50	7,570.50	213.15	0.00	213.15
	4,501.000	EVLV US	EVOLV TECHNOLOGIES HOLDINGS	USD	14,763.28	14,763.28	2.5900	1.0000	11,657.59	11,657.59	-3,105.69	0.00	-3,105.69
	21,189.000	EVOP US	EVO PAYMENTS INC-CLASS A	USD	706,796.37	706,796.37	33.8400	1.0000	717,035.76	717,035.76	10,239.39	0.00	10,239.39
	451.000	FACT US	FREEDOM ACQUISITION I CORP-A	USD	4,455.88	4,455.88	10.1000	1.0000	4,555.10	4,555.10	99.22	0.00	99.22
	750.000	FATP US	FAT PROJECTS ACQUISITION COR	USD	7,492.50	7,492.50	10.1400	1.0000	7,605.00	7,605.00	112.50	0.00	112.50
	1,500.000	FCAX US	FORTRESS CAPITAL ACQUISITI-A	USD	14,902.50	14,902.50	10.1000	1.0000	15,150.00	15,150.00	247.50	0.00	247.50
	750.000	FE XD US	FINTECH ECOSYSTEM DEVELOPM-A	USD	7,545.00	7,545.00	10.2500	1.0000	7,687.50	7,687.50	142.50	0.00	142.50
	1,156.000	FGAA/U CN	FG ACQUISITION CORP-CL A	USD	11,271.00	11,271.00	9.9000	1.0000	11,444.40	11,444.40	173.40	0.00	173.40
	722.000	FGMC US	FG MERGER CORP	USD	7,220.00	7,220.00	10.1900	1.0000	7,357.18	7,357.18	137.18	0.00	137.18
	128,946.000	FHN US	FIRST HORIZON CORP	USD	3,076,440.68	3,076,440.68	24.5000	1.0000	3,159,177.00	3,159,177.00	82,736.32	0.00	82,736.32
	1,200.000	FIAC US	FOCUS IMPACT ACQUISITION-A	USD	11,934.00	11,934.00	10.1800	1.0000	12,216.00	12,216.00	282.00	0.00	282.00
	750.000	FICV US	FRONTIER INVESTMENT CORP -A	USD	7,267.50	7,267.50	10.0200	1.0000	7,515.00	7,515.00	247.50	0.00	247.50
	1,650.000	FINM US	MARLIN TECHNOLOGY CORP-A	USD	16,335.00	16,335.00	10.1300	1.0000	16,714.50	16,714.50	379.50	0.00	379.50
	1,419.000	FMIV US	FORUM MERGER IV CORP-A	USD	13,977.15	13,977.15	10.0300	1.0000	14,232.57	14,232.57	255.42	0.00	255.42
	675.000	FNV T US	FINNOVATE ACQUISITION CORP-A	USD	6,723.00	6,723.00	10.2600	1.0000	6,925.50	6,925.50	202.50	0.00	202.50
	2,280.000	FPAC US	FAR PEAK ACQUISITION CORP-A	USD	22,480.80	22,480.80	10.0400	1.0000	22,891.20	22,891.20	410.40	0.00	410.40
	588.000	FRBN US	FORBION EUROPEAN ACQUISITI-A	USD	5,894.70	5,894.70	10.3300	1.0000	6,074.04	6,074.04	179.34	0.00	179.34
	748.000	FRON US	FRONTIER ACQUISITION CORP-A	USD	7,382.76	7,382.76	10.0800	1.0000	7,539.84	7,539.84	157.08	0.00	157.08
	1,147.000	FRSG US	FIRST RESERVE SUSTAINABLE-A	USD	11,286.48	11,286.48	10.0500	1.0000	11,527.35	11,527.35	240.87	0.00	240.87
	1,196.000	FRXB US	FOREST ROAD ACQUISITION CO-A	USD	11,768.64	11,768.64	10.0350	1.0000	12,001.86	12,001.86	233.22	0.00	233.22
	2,251.000	FSNB US	FUSION ACQUISITION CORP II-A	USD	22,089.84	22,089.84	10.0400	1.0000	22,600.04	22,600.04	510.20	0.00	510.20
	3,679.000	FSRX US	FINSERV ACQUISITION CORP-A	USD	36,256.55	36,256.55	10.0550	1.0000	36,992.35	36,992.35	735.80	0.00	735.80
	1,376.000	FTAA US	FTAC ATHENA ACQUISITION CO-A	USD	13,601.76	13,601.76	10.1000	1.0000	13,897.60	13,897.60	295.84	0.00	295.84
	1,244.000	FTEV US	FINTECH EVOLUTION ACQUISIT-A	USD	12,265.84	12,265.84	10.1000	1.0000	12,564.40	12,564.40	298.56	0.00	298.56
	820.000	FTPA US	FTAC PARNASSUS ACQUISITION-A	USD	8,072.90	8,072.90	10.0300	1.0000	8,224.60	8,224.60	151.70	0.00	151.70
	2,952.000	FWAC US	FIFTH WALL ACQUISITION COR-A	USD	28,929.60	28,929.60	10.0400	1.0000	29,638.08	29,638.08	708.48	0.00	708.48
	1,230.000	FZT US	FAST ACQUISITION CORP II-A	USD	12,115.50	12,115.50	10.0100	1.0000	12,312.30	12,312.30	196.80	0.00	196.80
	725.000	GAMC US	GOLDEN ARROW MERGER CORP-A	USD	7,119.50	7,119.50	10.0150	1.0000	7,260.88	7,260.88	141.38	0.00	141.38
	5,821.000	GAQ US	GENERATION ASIA I ACQUISIT-A	USD	58,995.84	58,995.84	10.1200	1.0000	58,908.52	58,908.52	-87.32	0.00	-87.32
	1,470.000	GEE X US	GAMES & ESPORTS EXPERIENCE-A	USD	14,861.70	14,861.70	10.3000	1.0000	15,141.00	15,141.00	279.30	0.00	279.30
	1,470.000	GFGD US	GROWTH FOR GOOD ACQUISITION	USD	14,413.35	14,413.35	10.0300	1.0000	14,744.10	14,744.10	330.75	0.00	330.75
	1,650.000	GFJ1 GR	GFJ ESG ACQUISITION I SE - A	EUR	16,500.00	16,458.75	10.2000	1.0705	16,830.00	18,016.51	353.27	1,204.49	1,557.76
	1,049.000	GFOR US	GRAF ACQUISITION CORP IV	USD	10,238.24	10,238.24	9.9500	1.0000	10,437.55	10,437.55	199.31	0.00	199.31
	1,176.000	GGAA US	GENESIS GROWTH TECH ACQUIS-A	USD	11,859.96	11,859.96	10.3600	1.0000	12,183.36	12,183.36	323.40	0.00	323.40
	7,350.000	GHI X US	GORES HOLDING IX INC-CL A	USD	71,148.00	71,148.00	9.8700	1.0000	72,544.50	72,544.50	1,396.50	0.00	1,396.50
	2,970.000	GIAC US	GESHER I ACQUISITION CORP-A	USD	29,432.70	29,432.70	10.1900	1.0000	30,264.30	30,264.30	831.60	0.00	831.60
	750.000	GLTA US	GALATA ACQUISITION CORP - A	USD	7,421.25	7,421.25	10.2000	1.0000	7,650.00	7,650.00	228.75	0.00	228.75
	638.000	GMFI US	AETHERIUM ACQUISITION CORP-A	USD	6,341.72	6,341.72	10.1800	1.0000	6,494.84	6,494.84	153.12	0.00	153.12
	750.000	GOGN US	GOGREEN INVESTMENTS CORP	USD	7,492.50	7,492.50	10.3800	1.0000	7,785.00	7,785.00	292.50	0.00	292.50
	900.000	GPAC US	GLOBAL PARTNER ACQUISITION-A	USD	8,919.00	8,919.00	10.1100	1.0000	9,099.00	9,099.00	180.00	0.00	180.00
	450.000	GSQB US	G SQUARED ASCEND II INC -A	USD	4,439.25	4,439.25	10.1500	1.0000	4,567.50	4,567.50	128.25	0.00	128.25
	1,199.000	GSQD US	G SQUARED ASCEND I INC-CL A	USD	11,858.11	11,858.11	10.1050	1.0000	12,115.90	12,115.90	257.79	0.00	257.79
	578.000	GSRM US	GSR II METEORA ACQUISIT-CL A	USD	5,713.53	5,713.53	10.1126	1.0000	5,845.08	5,845.08	131.55	0.00	131.55
	750.000	GTAC US	GLOBAL TECHNOLOGY ACQUISIT-A	USD	7,515.00	7,515.00	10.2800	1.0000	7,710.00	7,710.00	195.00	0.00	195.00
	1,200.000	GVC I US	GREEN VISOR FINANCIAL TECH-A	USD	11,976.00	11,976.00	10.3700	1.0000	12,444.00	12,444.00	468.00	0.00	468.00
	746.000	GXII US	GX ACQUISITION CORP II-A	USD	7,333.18	7,333.18	10.0100	1.0000	7,467.46	7,467.46	134.28	0.00	134.28
	588.000	HUMA US	HCM ACQUISITION CORP-A	USD	5,909.40	5,909.40	10.2600	1.0000	6,032.88	6,032.88	123.48	0.00	123.48
	1,500.000	HCNE US	JAWS HURRICANE ACQUISITION-A	USD	14,535.00	14,535.00	9.9700	1.0000	14,955.00	14,955.00	420.00	0.00	420.00
	1,502.000	HEGA NA	HEDOSOPHIA EUROPEAN GROWTH	EUR	14,869.80	14,832.63	9.9000	1.0705	14,869.80	15,918.12	0.00	1,085.49	1,085.49

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	4,697,000	HEIA NA	HEINEKEN NV	EUR	417,482.99	439,597.68	87.8800	1.0705	412,772.36	441,872.79	-5,042.72	7,317.83	2,275.11
	-4,785,000	HEIO NA	HEINEKEN HOLDING NV	EUR	-382,347.81	-382,951.73	72.0500	1.0705	-344,759.25	-369,064.78	18,828.51	-4,941.56	13,886.95
	1,495,000	HERA US	FTAC HERA ACQUISITION CORP-A	USD	14,755.65	14,755.65	10.1100	1.0000	15,114.45	15,114.45	358.80	0.00	358.80
	827,000	HHLA US	HHL ACQUISITION CO -CLASS A	USD	5,175.14	5,175.14	10.1100	1.0000	5,327.97	5,327.97	152.83	0.00	152.83
	882,000	HMA US	HEARTLAND MEDIA ACQUISITIO-A	USD	8,820.00	8,820.00	10.1700	1.0000	8,969.94	8,969.94	149.94	0.00	149.94
	780,000	HMA1 LN	HIRO METAVERSE AC-CLASS A-DI	GBP	7,780.50	9,205.89	10.0250	1.2083	7,819.50	9,448.30	47.12	195.29	242.41
	722,000	HNRA US	HNR ACQUISITION CORP USD	USD	7,238.05	7,238.05	10.2300	1.0000	7,386.06	7,386.06	148.01	0.00	148.01
	514,000	HORI US	EMERGING MARKETS HORIZON -A	USD	5,134.86	5,134.86	10.2200	1.0000	5,253.08	5,253.08	118.22	0.00	118.22
	588,000	HPA1 LN	HAMBRO PERKS ACQ-CLASS A	GBP	5,880.00	6,957.22	10.1000	1.2083	5,938.80	7,175.85	71.05	147.58	218.63
	5,940,000	HPLT US	HOME PLATE ACQUISITION -CL A	USD	58,033.80	58,033.80	10.0300	1.0000	59,578.20	59,578.20	1,544.40	0.00	1,544.40
	300,000	HWEL US	HEALTHWELL ACQUISITION COR-A	USD	2,916.00	2,916.00	9.9100	1.0000	2,973.00	2,973.00	57.00	0.00	57.00
	32,873,000	HZNP US	HORIZON THERAPEUTICS PLC	USD	3,704,246.26	3,704,246.26	113.8000	1.0000	3,740,947.40	3,740,947.40	36,701.14	0.00	36,701.14
	-6,269,000	IAA US	IAA INC	USD	-249,729.70	-249,729.70	40.0000	1.0000	-250,760.00	-250,760.00	-1,030.30	0.00	-1,030.30
	1,500,000	ICNC US	ICONIC SPORTS ACQ CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.3400	1.0000	15,510.00	15,510.00	510.00	0.00	510.00
	750,000	IFIN US	INFINT ACQUISITION CORP-A	USD	7,492.50	7,492.50	10.3600	1.0000	7,770.00	7,770.00	277.50	0.00	277.50
	735,000	IGTA US	INCEPTION GROWTH ACQUISITION	USD	7,350.00	7,350.00	10.1300	1.0000	7,445.55	7,445.55	95.55	0.00	95.55
	36,958,000	INDUA SS	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	SEK	9,743,208.20	979,143.67	253.5000	10.4283	9,368,853.00	898,406.59	-35,898.01	-44,839.07	-80,737.08
	-36,957,000	INDUC SS	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	SEK	-9,599,876.97	-964,390.71	253.0000	10.4283	-9,350,121.00	-896,610.31	23,949.87	43,830.53	67,780.40
	750,000	INTE US	INTEGRAL ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.1101	1.0000	7,582.58	7,582.58	82.58	0.00	82.58
	1,200,000	IOAC US	INNOVATIVE INTERNATIONAL A-A	USD	12,000.00	12,000.00	10.3000	1.0000	12,360.00	12,360.00	360.00	0.00	360.00
	2,096,000	IPVF US	INTERPRIVATE III FINANCIAL-A	USD	20,816.00	20,816.00	10.1200	1.0000	21,211.52	21,211.52	395.52	0.00	395.52
	1,643,000	IPVI US	INTERPRIVATE IV INFRA TECH-A	USD	16,430.00	16,430.00	10.1900	1.0000	16,742.17	16,742.17	312.17	0.00	312.17
	1,200,000	IQMD US	INTELLIGENT MEDICINE ACQUI-A	USD	11,982.00	11,982.00	10.2800	1.0000	12,336.00	12,336.00	354.00	0.00	354.00
	735,000	ITAQ US	INDUSTRIAL TECH ACQUISITIO-A	USD	7,350.00	7,350.00	10.1800	1.0000	7,482.30	7,482.30	132.30	0.00	132.30
	600,000	ITQ US	ITTIQUIRA ACQUISITION CORP-A	USD	6,000.00	6,000.00	10.0900	1.0000	6,054.00	6,054.00	54.00	0.00	54.00
	1,445,000	IVCA US	INVESTCORP INDIA ACQUISITI-A	USD	14,450.00	14,450.00	10.3400	1.0000	14,941.30	14,941.30	491.30	0.00	491.30
	735,000	IVCB US	INVESTCORP EUROPE ACQUIST-A	USD	7,350.00	7,350.00	10.3000	1.0000	7,570.50	7,570.50	220.50	0.00	220.50
	294,000	IVCP US	SWIFEMERGE ACQUISITION COR-A	USD	2,940.00	2,940.00	10.1300	1.0000	2,978.22	2,978.22	38.22	0.00	38.22
	1,500,000	JAQC US	JUPITER ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	9.9100	1.0000	14,865.00	14,865.00	-135.00	0.00	-135.00
	750,000	JAIT US	JAIT ACQUISITION CORP - A	USD	7,500.00	7,500.00	10.2100	1.0000	7,657.50	7,657.50	157.50	0.00	157.50
	748,000	JCIC US	JACK CREEK INVESTMENT C-CL A	USD	7,300.48	7,300.48	10.1300	1.0000	7,577.24	7,577.24	276.76	0.00	276.76
	750,000	JMAC US	MAXPRO CAPITAL ACQUISITION-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.3600	1.0000	7,770.00	7,770.00	270.00	0.00	270.00
	1,732,000	JUGG US	JAWS JUGGERNAUT ACQUISITIO-A	USD	16,800.40	16,800.40	10.0580	1.0000	17,420.46	17,420.46	620.06	0.00	620.06
	1,800,000	JUN US	JUNIPER II CORP -CLASS A	USD	17,865.00	17,865.00	10.1700	1.0000	18,306.00	18,306.00	441.00	0.00	441.00
	2,206,000	KCGI US	KENSINGTON CAPITAL ACQ-A	USD	22,960.00	22,960.00	10.1950	1.0000	22,490.17	22,490.17	470.17	0.00	470.17
	735,000	KNSW US	KNIGHTSWAN ACQUISITION COR-A	USD	7,350.00	7,350.00	10.1800	1.0000	7,482.30	7,482.30	132.30	0.00	132.30
	753,000	KVSC US	KHOSLA VENTURES ACQUISITIO-A	USD	7,482.45	7,482.45	9.9550	1.0000	7,496.13	7,496.13	33.68	0.00	33.68
	164,000	LCA US	LANDCADIA HOLDINGS IV INC-A	USD	1,640.00	1,640.00	10.0200	1.0000	1,643.28	1,643.28	3.28	0.00	3.28
	1,481,000	LCAA US	L CATTERTON ASIA ACQ-CLASS A	USD	14,611.55	14,611.55	10.1000	1.0000	14,958.10	14,958.10	346.55	0.00	346.55
	1,500,000	LCW US	LEARN CW INVESTMENT CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.1000	1.0000	15,150.00	15,150.00	150.00	0.00	150.00
	1,498,000	LDHA US	LDH GROWTH CORP I-CLASS A	USD	14,934.38	14,934.38	10.0700	1.0000	15,084.86	15,084.86	150.48	0.00	150.48
	896,000	LEGA US	LEAD EDGE GROWTH OPPORTUNI-A	USD	8,960.00	8,960.00	10.0700	1.0000	9,022.72	9,022.72	62.72	0.00	62.72
	1,500,000	LFAC US	LF CAPITAL ACQUISITION -CLA	USD	14,970.00	14,970.00	10.2600	1.0000	15,390.00	15,390.00	420.00	0.00	420.00
	2,335,000	LGAC US	LAZARD GROWTH ACQUISITION CO	USD	23,148.88	23,148.88	10.1000	1.0000	23,583.50	23,583.50	434.62	0.00	434.62
	1,500,000	LGST US	SEMPER PARATUS ACQUISITION-A	USD	14,970.00	14,970.00	10.3300	1.0000	15,495.00	15,495.00	525.00	0.00	525.00
	900,000	LGTO US	LEGATO GLOBAL MERGER CORP II	USD	8,919.00	8,919.00	10.2200	1.0000	9,198.00	9,198.00	279.00	0.00	279.00
	1,200,000	LGVC US	LAMP GLOBAL VENTURES CORP I	USD	11,928.00	11,928.00	10.2500	1.0000	12,300.00	12,300.00	372.00	0.00	372.00
	1,498,000	LHC US	LEO HOLDINGS CORP II-CLASS A	USD	14,605.50	14,605.50	10.0900	1.0000	15,114.82	15,114.82	509.32	0.00	509.32
	18,742,000	LHCG US	LHC GROUP INC	USD	3,096,076.28	3,096,076.28	161.6900	1.0000	3,030,393.98	3,030,393.98	-65,682.30	0.00	-65,682.30
	600,000	LION US	LIONHEART III CORP -CLASS A	USD	6,012.00	6,012.00	10.1900	1.0000	6,114.00	6,114.00	102.00	0.00	102.00
	585,000	LITT US	LOGISTICS INNOVATION TECH-A	USD	5,668.65	5,668.65	9.9513	1.0000	5,821.51	5,821.51	152.86	0.00	152.86
	1,620,000	LOCC US	LIVE OAK CRESTVIEW CLIMATE-A	USD	15,584.40	15,584.40	9.9500	1.0000	16,119.00	16,119.00	534.60	0.00	534.60
	1,510,000	LOKM US	LIVE OAK MOBILITY ACQUISIT-A	USD	15,030.79	15,030.79	10.0550	1.0000	15,183.06	15,183.06	152.27	0.00	152.27

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	900,000	LVAC US	LAVA MEDTECH ACQUISITION C-A	USD	8,995.50	8,995.50	10.1900	1.0000	9,171.00	9,171.00	175.50	0.00	175.50
	1,495,000	LVRA US	LEVERE HOLDINGS CORP-A	USD	14,950.00	14,950.00	10.0800	1.0000	15,069.60	15,069.60	119.60	0.00	119.60
	2,600,000	MBAC US	M3-BRIGADE ACQUISITION II-A	USD	25,644.23	25,644.23	10.0200	1.0000	26,052.00	26,052.00	407.77	0.00	407.77
	1,200,000	MBCS US	M3-BRIGADE ACQUISITION I-A	USD	11,970.00	11,970.00	10.1400	1.0000	12,168.00	12,168.00	198.00	0.00	198.00
	1,350,000	MCAA US	MOUNTAIN & CO I ACQUISITION	USD	13,668.75	13,668.75	10.3800	1.0000	14,013.00	14,013.00	344.25	0.00	344.25
	2,194,000	MDH US	MDH ACQUISITION CORP -CL A	USD	21,457.32	21,457.32	10.0400	1.0000	22,027.76	22,027.76	570.44	0.00	570.44
	1,497,000	MIT US	MASON INDUSTRIAL TECH-CL A	USD	14,898.00	14,898.00	9.9950	1.0000	14,962.52	14,962.52	64.52	0.00	64.52
	750,000	MITA US	COLISEUM ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.0400	1.0000	7,530.00	7,530.00	30.00	0.00	30.00
	1,500,000	MLAI US	MCLAREN TECHNOLOGY ACQ-A	USD	14,947.50	14,947.50	10.2100	1.0000	15,315.00	15,315.00	367.50	0.00	367.50
	1,029,000	MNTN US	EVEREST CONSOLIDATOR ACQUIS	USD	10,290.00	10,290.00	10.2300	1.0000	10,526.67	10,526.67	236.67	0.00	236.67
	1,200,000	MPRA US	MERCATO PARTNERS ACQUISITI-A	USD	11,976.00	11,976.00	10.2300	1.0000	12,276.00	12,276.00	300.00	0.00	300.00
	1,469,000	MSDA US	MSD ACQUISITION CORP-A	USD	14,633.00	14,633.00	10.0900	1.0000	14,822.21	14,822.21	189.21	0.00	189.21
	722,000	MTAL US	METALS ACQUISITION CORP-CL A	USD	7,038.06	7,038.06	10.0050	1.0000	7,223.62	7,223.62	185.56	0.00	185.56
	1,029,000	MTVC US	MOTIVE CAPITAL CORP II-CL A	USD	10,290.00	10,290.00	10.2300	1.0000	10,526.67	10,526.67	236.67	0.00	236.67
	-6,445,000	MXL US	MAXLINEAR INC	USD	-227,879.93	-227,879.93	33.9500	1.0000	-218,807.75	-218,807.75	9,072.18	0.00	9,072.18
	5,177,000	NAAC US	NORTH ATLANTIC ACQUISITION-A	USD	51,459.38	51,459.38	10.1100	1.0000	52,339.47	52,339.47	880.09	0.00	880.09
	1,500,000	NCAC US	NEWCOURT ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.2800	1.0000	15,420.00	15,420.00	420.00	0.00	420.00
	1,084,000	NEOA LN	NEW ENERGY ONE ACQUISITION	GBP	10,829.16	14,117.98	10.1000	1.2083	10,948.40	13,228.95	144.07	-1,033.10	-889.03
	1,500,000	NETC US	NABORS ENERGY TRANSITION - A	USD	14,970.00	14,970.00	10.2700	1.0000	15,405.00	15,405.00	435.00	0.00	435.00
	1,494,000	NFNT US	INFINITE ACQUISITION CO-CL A	USD	14,693.49	14,693.49	10.2500	1.0000	15,313.50	15,313.50	620.01	0.00	620.01
	578,000	NFYS US	ENPHYS ACQUISITION CORP	USD	5,780.00	5,780.00	10.0300	1.0000	5,797.34	5,797.34	17.34	0.00	17.34
	610,000	NGC US	NORTHERN GENESIS ACQUISITI-A	USD	6,100.00	6,100.00	10.0400	1.0000	6,124.40	6,124.40	24.40	0.00	24.40
	5,197,000	NHIC US	NEWHOLD INVESTMENT CORP II-A	USD	51,970.00	51,970.00	9.9500	1.0000	51,710.15	51,710.15	-259.85	0.00	-259.85
	6,682,000	NPAB US	NEW PROVIDENCE ACQUISITION-A	USD	66,218.62	66,218.62	10.1700	1.0000	67,955.94	67,955.94	1,737.32	0.00	1,737.32
	1,156,000	NUBI US	NUBIA BRAND INTERNATION-CL A	USD	11,560.00	11,560.00	10.1500	1.0000	11,733.40	11,733.40	173.40	0.00	173.40
	452,000	NVSA US	NEW VISTA ACQUISITION CORP-A	USD	4,519.68	4,519.68	10.0950	1.0000	4,562.95	4,562.95	43.27	0.00	43.27
	121,653,000	ONEM US	1LIFE HEALTHCARE INC	USD	2,076,050.60	2,076,050.60	16.7100	1.0000	2,032,821.63	2,032,821.63	-43,228.97	0.00	-43,228.97
	1,500,000	ONXX US	ONXX ACQUISITION CO I-CL A	USD	15,007.50	15,007.50	10.3200	1.0000	15,490.00	15,490.00	472.50	0.00	472.50
	747,000	ORIA US	ORION BIOTECH OPPORTUNITI-A	USD	7,470.00	7,470.00	10.0500	1.0000	7,507.35	7,507.35	37.35	0.00	37.35
	747,000	OSI US	OSIRIS ACQUISITION CORP-A	USD	7,470.00	7,470.00	9.9500	1.0000	7,432.65	7,432.65	-37.35	0.00	-37.35
	991,000	OTA GR	OBOTECH ACQUISITION SE - A	EUR	9,563.15	11,480.56	9.8000	1.0705	9,711.80	10,396.48	159.13	-1,243.21	-1,084.08
	750,000	OXUS US	OXUS ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.3300	1.0000	7,747.50	7,747.50	247.50	0.00	247.50
	597,000	PACE NA	PEGASUS ACQUISITION CO EUR-A	EUR	5,970.00	7,086.39	9.8000	1.0705	5,850.60	6,263.07	-127.82	-695.50	-823.32
	1,470,000	PACI US	PROOF ACQUISITION CORP I-A	USD	14,700.00	14,700.00	10.1700	1.0000	14,949.90	14,949.90	249.90	0.00	249.90
	434,000	PACX US	PIONEER MERGER CORP -CLASS A	USD	4,244.52	4,244.52	10.1400	1.0000	4,400.76	4,400.76	156.24	0.00	156.24
	1,500,000	PCCCT US	PERCEPTION CAPITAL CORP II-A	USD	15,045.00	15,045.00	10.6300	1.0000	15,945.00	15,945.00	900.00	0.00	900.00
	2,941,000	PDOT US	PERIDOT ACQUISITION CORP-A	USD	29,410.00	29,410.00	10.1100	1.0000	29,733.51	29,733.51	323.51	0.00	323.51
	750,000	PEGR US	PROJECT ENERGY REIMAGINED AC	USD	7,500.00	7,500.00	10.0700	1.0000	7,552.50	7,552.50	52.50	0.00	52.50
	750,000	PEPL US	PEPPERLINE HEALTH ACQ - A	USD	7,500.00	7,500.00	10.2100	1.0000	7,657.50	7,657.50	157.50	0.00	157.50
	756,000	PFDR US	PATHFINDER ACQUISITION -CL A	USD	7,452.00	7,452.00	10.0700	1.0000	7,612.92	7,612.92	160.92	0.00	160.92
	750,000	PFTA US	PORTAGE FINTECH ACQUISITIO-A	USD	7,275.00	7,275.00	10.0300	1.0000	7,522.50	7,522.50	247.50	0.00	247.50
	750,000	PHYT US	PHYTOPHYTE ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.3300	1.0000	7,747.50	7,747.50	247.50	0.00	247.50
	1,505,000	PIAI US	PRIME IMPACT ACQ I -CL A	USD	14,809.20	14,809.20	10.2600	1.0000	15,441.30	15,441.30	632.10	0.00	632.10
	736,000	PICC US	PIVOTAL INVESTMENT CORP111-A	USD	7,230.64	7,230.64	10.1210	1.0000	7,449.05	7,449.05	218.41	0.00	218.41
	1,156,000	PLAO US	PATRIA LATIN AMERICAN OPPORT	USD	11,560.00	11,560.00	10.3400	1.0000	11,953.04	11,953.04	393.04	0.00	393.04
	750,000	PLMI US	PLIM ACQUISITION CORP I-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.0800	1.0000	7,560.00	7,560.00	60.00	0.00	60.00
	1,500,000	PMGM US	PRIVETERRA ACQUISITION COR-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.0500	1.0000	15,075.00	15,075.00	75.00	0.00	75.00
	1,496,000	PNTM US	PONTEM CORP-CLASS A	USD	14,593.48	14,593.48	10.1100	1.0000	15,124.56	15,124.56	531.08	0.00	531.08
	1,176,000	PORT US	SOUTHPORT ACQUISITION CORP	USD	11,760.00	11,760.00	10.1800	1.0000	11,971.68	11,971.68	211.68	0.00	211.68
	1,500,000	POW US	POWERED BRANDS - CLASS A	USD	15,000.00	15,000.00	10.1000	1.0000	15,150.00	15,150.00	150.00	0.00	150.00
	735,000	PRLH US	PEARL HOLDINGS ACQUISITION-A	USD	7,350.00	7,350.00	10.2300	1.0000	7,519.05	7,519.05	169.05	0.00	169.05
	1,304,000	PRPC US	CC NEIBERGER PRINCIPAL 111-A	USD	13,016.08	13,016.08	10.1000	1.0000	13,170.40	13,170.40	154.32	0.00	154.32
	1,497,000	PRSR US	PROSPECTOR CAPITAL CORP-CL A	USD	14,595.75	14,595.75	9.9500	1.0000	14,895.15	14,895.15	299.40	0.00	299.40

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	735,000	PSPC US	POST HOLDINGS PARTNERING -A	USD	7,350.00	7,350.00	9.9300	1.0000	7,298.55	7,298.55	-51.45	0.00	-51.45
	748,000	PTOC US	PINE TECHNOLOGY ACQUISIT-CL	A USD	7,480.00	7,480.00	10.0300	1.0000	7,502.44	7,502.44	22.44	0.00	22.44
	722,000	PWUP US	POWERUP ACQUISITION CORP-CL	A USD	7,220.00	7,220.00	10.3000	1.0000	7,436.60	7,436.60	216.60	0.00	216.60
	378,000	QFTA US	QUANTUM FINTECH ACQUISITION	USD	3,738.42	3,738.42	10.0500	1.0000	3,798.90	3,798.90	60.48	0.00	60.48
	4,367,000	RBA US	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	USD	237,595.91	237,595.91	57.8300	1.0000	252,543.61	252,543.61	14,947.70	0.00	14,947.70
	750,000	RCFA US	RCF ACQUISITION CORP-A	USD	7,432.50	7,432.50	10.2600	1.0000	7,695.00	7,695.00	262.50	0.00	262.50
	463,000	RCVR GR	SMG EUROPEAN RECOVERY SPAC S	EUR	4,625.37	4,965.33	10.2000	1.0705	4,722.60	5,055.54	104.09	-13.88	90.21
	1,734,000	RENE US	CARTESIAN GROWTH CORP II -A	USD	17,340.00	17,340.00	10.2500	1.0000	17,773.50	17,773.50	433.50	0.00	433.50
	450,000	REVE US	ALPINE ACQUISITION CORP	USD	4,500.00	4,500.00	10.4100	1.0000	4,684.50	4,684.50	184.50	0.00	184.50
	2,019,000	RFP US	RESOLUTE FOREST PRODUCTS	USD	41,367.36	41,367.36	21.5900	1.0000	43,590.21	43,590.21	2,222.85	0.00	2,222.85
	2,205,000	RJAC US	JACKSON ACQUISITION CO-CL	A USD	22,050.00	22,050.00	10.1100	1.0000	22,292.55	22,292.55	242.55	0.00	242.55
	1,186,000	RKTA US	ROCKET INTERNET GROWTH OPP-A	USD	11,764.30	11,764.30	10.1000	1.0000	11,978.60	11,978.60	214.30	0.00	214.30
	2,247,000	RMGC US	RMG ACQUISITION CORP III -A	USD	22,470.00	22,470.00	10.0850	1.0000	22,661.00	22,661.00	191.00	0.00	191.00
	735,000	ROC US	ROC ENERGY ACQUISITION CORP	USD	7,350.00	7,350.00	10.2400	1.0000	7,526.40	7,526.40	176.40	0.00	176.40
	294,000	ROCL US	ROTH CH ACQUISITION V CO	USD	2,940.00	2,940.00	10.1100	1.0000	2,972.34	2,972.34	32.34	0.00	32.34
	4,817,000	ROC US	ROGERS CORP	USD	1,100,234.87	1,100,234.87	119.3400	1.0000	574,860.78	574,860.78	-525,374.09	0.00	-525,374.09
	1,500,000	RONI US	RICE ACQUISITION CORP II -A	USD	14,715.00	14,715.00	10.1700	1.0000	15,255.00	15,255.00	540.00	0.00	540.00
	750,000	ROSE US	ROSE HILL ACQUISITION CORP-A	USD	7,500.00	7,500.00	10.3200	1.0000	7,740.00	7,740.00	240.00	0.00	240.00
	1,496,000	ROSS US	ROSS ACQUISITION CORP II -A	USD	14,960.00	14,960.00	10.1200	1.0000	15,139.52	15,139.52	179.52	0.00	179.52
	1,500,000	RRAC US	RIGEL RESOURCE ACQUISIT-CL	A USD	14,865.00	14,865.00	10.2900	1.0000	15,435.00	15,435.00	570.00	0.00	570.00
	1,494,000	SCAQ US	STRATIM CLOUD ACQUISITION CO	USD	14,940.00	14,940.00	10.0100	1.0000	14,954.94	14,954.94	14.94	0.00	14.94
	750,000	SCMA US	SEAPORT CALIBRE MATERIALS AC	USD	7,451.25	7,451.25	10.2300	1.0000	7,672.50	7,672.50	221.25	0.00	221.25
	858,000	SCOB US	SCION TECH GROWTH II-CLASS A	USD	8,555.16	8,555.16	10.1200	1.0000	8,682.96	8,682.96	127.80	0.00	127.80
	8,085,000	SCRM US	SCREAMING EAGLE ACQ -CLASS A	USD	80,850.00	80,850.00	9.9400	1.0000	80,364.90	80,364.90	-485.10	0.00	-485.10
	1,176,000	SCUA US	SCULPTOR ACQUISITION CORP -A	USD	11,760.00	11,760.00	10.2600	1.0000	12,065.76	12,065.76	305.76	0.00	305.76
	1,549,000	SDAC US	SUSTAINABLE DEVELOPMENT AC-A	USD	15,431.42	15,431.42	10.0600	1.0000	15,582.94	15,582.94	151.52	0.00	151.52
	750,000	SDGA US	SDCL EDGE ACQUISITION CORP-A	USD	7,323.75	7,323.75	10.0600	1.0000	7,545.00	7,545.00	221.25	0.00	221.25
	80,917,000	SEFY US	SIGNIFY HEALTH INC -CLASS A	USD	2,363,424.27	2,363,424.27	28.6600	1.0000	2,319,081.22	2,319,081.22	-44,343.05	0.00	-44,343.05
	825,000	SGII US	SEAPORT GLOBAL ACQUISITION-A	USD	8,200.50	8,200.50	10.1900	1.0000	8,406.75	8,406.75	206.25	0.00	206.25
	87,700,000	SJRB/CN	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	CAD	3,223,256.27	2,443,249.37	39.0100	1.3554	3,421,177.00	2,524,108.76	146,023.79	-65,164.40	80,859.39
	509,000	SKYA US	SKYDECK ACQUISITION CORP-A	USD	4,978.02	4,978.02	10.0600	1.0000	5,120.54	5,120.54	142.52	0.00	142.52
	862,000	SLAM US	SLAM CORP-A	USD	8,462.50	8,462.50	10.1100	1.0000	8,714.82	8,714.82	252.32	0.00	252.32
	750,000	SMAP US	SPORTSMAP TECH ACQUISITION C	USD	7,500.00	7,500.00	10.2050	1.0000	7,653.75	7,653.75	153.75	0.00	153.75
	867,000	SPCM US	SOUND POINT ACQUISITION CO-A	USD	8,670.00	8,670.00	10.3100	1.0000	8,938.77	8,938.77	268.77	0.00	268.77
	2,903,000	SPKB US	SILVER SPIKE ACQUISITION-A	USD	28,792.71	28,792.71	10.0900	1.0000	29,291.27	29,291.27	498.56	0.00	498.56
	1,050,000	SPRI NA	SPEAR INVESTMENTS I BV	EUR	10,489.50	12,011.53	10.1000	1.0705	10,605.00	11,352.65	123.64	-782.52	-658.88
	882,000	STET US	ST ENERGY TRANSITION I LTD	USD	8,820.00	8,820.00	10.2200	1.0000	9,014.04	9,014.04	194.04	0.00	194.04
	185,887,000	STOR US	STORE CAPITAL CORP	USD	5,982,558.77	5,982,558.77	32.0600	1.0000	5,959,537.22	5,959,537.22	76,978.45	0.00	76,978.45
	-8,000	STR US	SITIO ROYALTIES CORP-A	USD	-254.85	-254.85	28.8500	1.0000	-230.80	-230.80	24.05	0.00	24.05
	1,479,000	STRE US	SUPERNOVA PARTNERS ACQUISIT	A USD	14,790.00	14,790.00	10.0800	1.0000	14,908.32	14,908.32	118.32	0.00	118.32
	1,875,000	SUAC US	SHOULDERUP TECHNOLOGY ACQU	A USD	18,571.88	18,571.88	10.2000	1.0000	19,125.00	19,125.00	553.12	0.00	553.12
	942,000	SVFA US	SVF INVESTMENT CORP-CL	A USD	9,367.50	9,367.50	10.1100	1.0000	9,523.62	9,523.62	156.12	0.00	156.12
	2,194,000	SVFB US	SVF INVESTMENT CORP-CLS A	USD	21,434.32	21,434.32	10.0900	1.0000	22,137.46	22,137.46	703.14	0.00	703.14
	1,200,000	SVNA US	7 ACQUISITION CORP-A	USD	11,880.00	11,880.00	10.2400	1.0000	12,288.00	12,288.00	408.00	0.00	408.00
	18,322,000	SWIR US	SIERRA WIRELESS INC	USD	554,972.53	554,972.53	28.9900	1.0000	531,154.78	531,154.78	-23,817.75	0.00	-23,817.75
	600,000	SWSS US	SPRINGWATER SPECIAL SITUATIO	USD	6,000.00	6,000.00	10.1300	1.0000	6,078.00	6,078.00	78.00	0.00	78.00
	750,000	SZZL US	SIZZLE ACQUISITION CORP	USD	7,500.00	7,500.00	10.2200	1.0000	7,665.00	7,665.00	165.00	0.00	165.00
	1,497,000	TBCP US	THUNDER BRIDGE CAPITAL PAR-A	USD	14,970.00	14,970.00	9.7500	1.0000	14,596.75	14,596.75	-374.25	0.00	-374.25
	1,455,000	TBSA US	TB SA ACQUISITION CORP -A	USD	14,550.00	14,550.00	10.0800	1.0000	14,666.40	14,666.40	116.40	0.00	116.40
	752,000	TCVA US	TCV ACQUISITION CORP-A	USD	7,309.44	7,309.44	10.0050	1.0000	7,523.76	7,523.76	214.32	0.00	214.32
	1,495,000	TETC US	TECH AND ENERGY TRANSITION	A USD	14,950.00	14,950.00	10.0300	1.0000	14,994.85	14,994.85	44.85	0.00	44.85
	31,651,000	TGNA US	TEGNA INC	USD	658,681.47	658,681.47	21.1900	1.0000	670,684.69	670,684.69	12,003.22	0.00	12,003.22
	867,000	TGR US	KIMBELL TIGER ACQUISITION-A	USD	8,670.00	8,670.00	10.3000	1.0000	8,930.10	8,930.10	260.10	0.00	260.10

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	735,000	TGVC US	TG VENTURE ACQUISITION CORP	USD	7,298.55	7,298.55	10.1500	1.0000	7,460.25	7,460.25	161.70	0.00	161.70
	750,000	THAC US	THRIVE ACQUISITION CORP - A	USD	7,500.00	7,500.00	10.3000	1.0000	7,725.00	7,725.00	225.00	0.00	225.00
	1,502,000	THCP US	THRUNDER BRIDGE CAPITAL PAR-A	USD	14,704.58	14,704.58	9.9350	1.0000	14,922.37	14,922.37	217.79	0.00	217.79
	2,250,000	TIOA US	TIO TECH A-CLASS A	USD	22,500.00	22,500.00	10.0800	1.0000	22,680.00	22,680.00	180.00	0.00	180.00
	747,000	TLGA US	TLG ACQUISITION ONE COR-CL A	USD	7,268.31	7,268.31	10.1800	1.0000	7,604.46	7,604.46	336.15	0.00	336.15
	735,000	TLGY US	TLGY ACQUISITION CORP - A	USD	7,350.00	7,350.00	10.2600	1.0000	7,541.10	7,541.10	191.10	0.00	191.10
	735,000	TMKR US	TASTEMAKER ACQUISITION COR-A	USD	7,178.46	7,178.46	10.1800	1.0000	7,482.30	7,482.30	303.84	0.00	303.84
	1,500,000	TOAC US	TALON 1 ACQUISITION CORP-A	USD	15,105.00	15,105.00	10.3700	1.0000	15,555.00	15,555.00	450.00	0.00	450.00
	1,485,000	TPBA US	TPB ACQUISITION CORP I-CL A	USD	14,563.35	14,563.35	10.0300	1.0000	14,894.55	14,894.55	331.20	0.00	331.20
	5,250,000	TRAQ US	TRINE II ACQUISITION CORP -A	USD	52,132.50	52,132.50	10.3050	1.0000	54,101.25	54,101.25	1,968.75	0.00	1,968.75
	746,000	TRCA US	TWIN RIDGE CAPITAL ACQUI-A	USD	7,460.00	7,460.00	10.0900	1.0000	7,527.14	7,527.14	67.14	0.00	67.14
	379,000	TRIS US	TRISTAR ACQUISITION I CORP-A	USD	3,790.00	3,790.00	10.1100	1.0000	3,831.69	3,831.69	41.69	0.00	41.69
	1,050,000	TRON US	CORNER GROWTH ACQUISITION -A	USD	10,468.50	10,468.50	10.2600	1.0000	10,773.00	10,773.00	304.50	0.00	304.50
	1,500,000	TRTL US	TORTOISECOFIN ACQUISITION-A	USD	14,505.00	14,505.00	9.9500	1.0000	14,925.00	14,925.00	420.00	0.00	420.00
	24,651,000	TSEM US	TOWER SEMICONDUCTOR LTD	USD	1,120,347.29	1,120,347.29	43.2000	1.0000	1,064,923.20	1,064,923.20	-55,424.09	0.00	-55,424.09
	3,647,000	TWCB US	BILANDER ACQUISITION CORP-A	USD	35,965.62	35,965.62	9.9000	1.0000	36,105.30	36,105.30	139.68	0.00	139.68
	1,500,000	TWNI US	TAILWIND INTERNATIONAL ACQ-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.0900	1.0000	15,135.00	15,135.00	135.00	0.00	135.00
	750,000	TWOA US	TWO - CLASS A	USD	7,312.50	7,312.50	10.0700	1.0000	7,552.50	7,552.50	240.00	0.00	240.00
	1,500,000	TZPS US	TZP STRATEGIES ACQUI-SI-CL A	USD	14,640.00	14,640.00	10.1060	1.0000	15,159.00	15,159.00	519.00	0.00	519.00
	1,200,000	USCT US	TKB CRITICAL TECHNOLOGIES -A	USD	12,000.00	12,000.00	10.3000	1.0000	12,360.00	12,360.00	360.00	0.00	360.00
	1,617,000	UTAA US	UTA ACQUISITION CORPORATIO-A	USD	16,170.00	16,170.00	10.2100	1.0000	16,509.57	16,509.57	339.57	0.00	339.57
	2,358,000	VAQC US	VECTOR ACQUISITION CORP II-A	USD	22,937.70	22,937.70	10.1000	1.0000	23,815.80	23,815.80	878.10	0.00	878.10
	734,000	VBOC US	VISCOGLIOSI BROTHERS ACQUI-SI	USD	7,340.00	7,340.00	10.1100	1.0000	7,420.74	7,420.74	80.74	0.00	80.74
	735,000	VHNA US	VAHANNA TECH EDGE ACQUI-SI-A	USD	7,350.00	7,350.00	10.2400	1.0000	7,526.40	7,526.40	176.40	0.00	176.40
	747,000	VII US	7GC & CO HOLDINGS INC -CL A	USD	7,298.19	7,298.19	10.1200	1.0000	7,559.64	7,559.64	261.45	0.00	261.45
	1,456,000	VLAT US	VALOR LATITUDE ACQUISITION-A	USD	14,488.00	14,488.00	10.0600	1.0000	14,647.36	14,647.36	159.36	0.00	159.36
	1,275,000	VMGA US	VMG CONSUMER ACQUISITION C-A	USD	12,667.13	12,667.13	10.1500	1.0000	12,941.25	12,941.25	274.12	0.00	274.12
	14,226,000	VMW US	VMWARE INC-CLASS A	USD	1,646,671.11	1,646,671.11	122.7600	1.0000	1,746,383.76	1,746,383.76	99,712.65	0.00	99,712.65
	1,498,000	VPCB US	VPC IMPACT ACQUISITION HOL-A	USD	14,980.00	14,980.00	10.1000	1.0000	15,129.80	15,129.80	149.80	0.00	149.80
	825,000	VSAC US	VISION SENSING ACQUISITION-A	USD	8,250.00	8,250.00	10.2900	1.0000	8,489.25	8,489.25	239.25	0.00	239.25
	588,000	WEL US	INTEGRATED WELLNESS ACQ - A	USD	5,880.00	5,880.00	10.2800	1.0000	6,044.64	6,044.64	164.64	0.00	164.64
	722,000	WPCA US	WARBURG PINCUS CAPITAL COR-A	USD	7,220.00	7,220.00	10.1000	1.0000	7,292.20	7,292.20	72.20	0.00	72.20
	1,495,000	WPCB US	WARBURG PINCUS CAPITAL I-B	USD	14,950.00	14,950.00	10.0900	1.0000	15,084.55	15,084.55	134.55	0.00	134.55
	1,500,000	WQGA US	WORLD QUANTUM GROWTH ACQUI-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.1900	1.0000	15,285.00	15,285.00	285.00	0.00	285.00
	1,500,000	XFIN US	EXCELFIN ACQUISITION CORP-A	USD	15,000.00	15,000.00	10.2600	1.0000	15,390.00	15,390.00	390.00	0.00	390.00
	2,991,000	YTPG US	TPG PACE BENEFICIAL II COR-A	USD	29,766.00	29,766.00	9.8250	1.0000	29,386.57	29,386.57	-379.43	0.00	-379.43
	1,633,000	ZING US	FTAC ZEUS ACQUISITION C-CL A	USD	16,117.71	16,117.71	10.0700	1.0000	16,444.31	16,444.31	326.60	0.00	326.60
			Subtotal - COMMON STOCK			48,028,531.69				46,017,046.27	-1,966,346.70	-45,138.72	-2,011,485.42

EQUITY

59,797,000	IGYB_CVR	IGYB_CVR	EUR	0.00	0.00	0.7800	1.0705	46,641.66	49,929.90	49,929.90	0.00	49,929.90
		Subtotal - EQUITY			0.00				49,929.90	49,929.90	0.00	49,929.90

ETF

-219,000	IGV US	ISHARES EXPANDED TECH-SOFTWA	USD	-55,701.93	-55,701.93	255.8500	1.0000	-56,031.15	-56,031.15	-329.22	0.00	-329.22
-788,000	IYR US	ISHARES US REAL ESTATE ETF	USD	-62,546.27	-62,546.27	84.1900	1.0000	-66,341.72	-66,341.72	-3,795.45	0.00	-3,795.45
-599,000	KRE US	SPDR S&P REGIONAL BANKING	USD	-36,419.33	-36,419.33	58.7400	1.0000	-35,185.26	-35,185.26	1,234.07	0.00	1,234.07
-751,000	SMH US	VANECK SEMICONDUCTOR ETF	USD	-149,279.02	-149,279.02	202.9400	1.0000	-152,407.94	-152,407.94	-3,128.92	0.00	-3,128.92
-189,000	XBI US	SPDR S&P BIOTECH ETF	USD	-15,461.86	-15,461.86	83.0000	1.0000	-15,687.00	-15,687.00	-225.14	0.00	-225.14
-400,000	XLI US	INDUSTRIAL SELECT SECT SPDR	USD	-39,808.52	-39,808.52	98.2100	1.0000	-39,284.00	-39,284.00	524.52	0.00	524.52
		Subtotal - ETF			-359,219.93				-364,937.07	-5,720.14	0.00	-5,720.14

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
UNIT													
	2,940,000	BACEU NA	BRIGADE-M3 EUROPEAN ACQUISIT	USD	28,812.00	28,812.00	9.8500	1.0000	28,939.00	28,939.00	147.00	0.00	147.00
	1,445,000	CHEAU US	CHENGHE ACQUISITION CO	USD	14,580.05	14,580.05	10.2800	1.0000	14,854.60	14,854.60	274.55	0.00	274.55
	2,000	HEGAU NA	HEDOSOPHIA EUROPEAN-UNITS	EUR	19.40	19.35	9.6000	1.0705	19.20	20.55	-0.21	1.41	1.20
	1,000	PACEU NA	PEGASUS ACQUISITION CO-UNIT	EUR	0.00	0.00	9.9800	1.0705	9.98	10.68	10.68	0.00	10.68
	2,890,000	SKGRU US	SK GROWTH OPPORTUNITIES CORP	USD	28,900.00	28,900.00	10.1700	1.0000	29,391.30	29,391.30	491.30	0.00	491.30
	1,500,000	ZTAQU US	ZIMMER ENERGY TRANSITION ACQ	USD	15,003.76	15,003.76	9.8950	1.0000	14,842.51	14,842.51	-161.25	0.00	-161.25
			Subtotal - UNIT			87,315.16				88,078.64	762.07	1.41	763.48
			Subtotal - Equity			49,270,410.43				47,151,160.11	-2,074,113.01	-45,137.31	-2,119,250.32
Forward													
FX FORWARD													
	17,412,167,855.000	JPY.FWD	JPY per USD @ 133.7592 : 01/31/2023	JPY	17,412,167,855.00	130,175,521.32	1.0000	130.5538	17,412,167,855.00	133,371,607.37	0.00	3,196,086.05	3,196,086.05
	-130,175,521.320	USD.FWD	JPY per USD @ 133.7592 : 01/31/2023	USD	-130,175,521.32	-130,175,521.32	1.0000	1.0000	-130,175,521.32	-130,175,521.32	0.00	0.00	0.00
			Subtotal - FX FORWARD			0.00				3,196,086.05	0.00	3,196,086.05	3,196,086.05
			Subtotal - Forward			0.00				3,196,086.05	0.00	3,196,086.05	3,196,086.05
Medium													
CASH AND EQUIVALENTS													
	-78,949.830	AUD	Australian Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	AUD	-78,949.83	-58,176.60	1.0000	0.6813	-78,949.83	-53,788.52	0.00	4,388.08	4,388.08
	-0.030	AUD	Australian Dollar - 74991 CITI CFD - OnHand	AUD	-0.03	-0.02	1.0000	0.6813	-0.03	-0.02	0.00	0.00	0.00
	62,300.950	AUD	Australian Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	AUD	62,300.95	45,816.28	1.0000	0.6813	62,300.95	42,445.64	0.00	-3,370.64	-3,370.64
	0.390	AUD	Australian Dollar - 74991 FBCO CFD - OnHand	AUD	0.39	0.30	1.0000	0.6813	0.39	0.27	0.00	-0.03	-0.03
	-631.210	AUD	Australian Dollar - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	AUD	-631.21	-459.34	1.0000	0.6813	-631.21	-430.04	0.00	29.30	29.30
	17,277.000	AUD	Australian Dollar - 74991-GSCO-INTL - OnHand	AUD	17,277.00	12,330.60	1.0000	0.6813	17,277.00	11,770.82	0.00	-539.78	-539.78
	-29,386.330	CAD	Canadian Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	CAD	-29,386.33	-21,515.84	1.0000	1.3554	-29,386.33	-21,680.93	0.00	-165.09	-165.09
	-2,604,128.760	CAD	Canadian Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	CAD	-2,604,128.76	-1,980,384.05	1.0000	1.3554	-2,604,128.76	-1,921,299.07	0.00	59,084.98	59,084.98
	-633.720	CAD	Canadian Dollar - 74991 MSCO-DOMESTIC - OnHand	CAD	-633.72	-510.68	1.0000	1.3554	-633.72	-467.55	0.00	43.13	43.13
	-23,310.080	CHF	Swiss Franc - 74991 BARC INTL - OnHand	CHF	-23,310.08	-24,044.75	1.0000	1.0817	-23,310.08	-25,213.72	0.00	-1,168.97	-1,168.97
	23,310.450	CHF	Swiss Franc - 74991 CITI INTL - OnHand	CHF	23,310.45	24,397.95	1.0000	1.0817	23,310.45	25,214.11	0.00	816.16	816.16
	162,200.870	EUR	Euro - 74991 BARC INTL - OnHand	EUR	162,200.87	164,308.63	1.0000	1.0705	162,200.87	173,636.03	0.00	9,327.40	9,327.40
	3,679.880	EUR	Euro - 74991 CITI CFD - OnHand	EUR	3,679.88	3,908.70	1.0000	1.0705	3,679.88	3,939.31	0.00	30.61	30.61
	-253,180.090	EUR	Euro - 74991 CITI INTL - OnHand	EUR	-253,180.09	-260,224.63	1.0000	1.0705	-253,180.09	-271,029.28	0.00	-10,804.65	-10,804.65
	-7.530	EUR	Euro - 74991 FBCO CFD - OnHand	EUR	-7.53	-9.17	1.0000	1.0705	-7.53	-8.06	0.00	1.11	1.11
	-0.380	EUR	Euro - 74991 FBCO INTL - OnHand	EUR	-0.38	72.58	1.0000	1.0705	-0.38	-0.41	0.00	-72.99	-72.99
	81.850	EUR	Euro - 74991 GSCO CFD - OnHand	EUR	81.85	85.66	1.0000	1.0705	81.85	87.62	0.00	1.96	1.96
	-148,047.980	EUR	Euro - 74991 JPWQ CFD - OnHand	EUR	-148,047.98	-157,108.50	1.0000	1.0705	-148,047.98	-158,485.36	0.00	-1,376.86	-1,376.86
	-54,749.600	EUR	Euro - 74991 JPWQ INTL - OnHand	EUR	-54,749.60	-54,941.23	1.0000	1.0705	-54,749.60	-58,609.45	0.00	-3,668.22	-3,668.22
	-331.890	EUR	Euro - 74991 MSCO CFD - OnHand	EUR	-331.89	-353.83	1.0000	1.0705	-331.89	-355.29	0.00	-1.46	-1.46

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	1.120	EUR	Euro - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	EUR	1.12	1.32	1.0000	1.0705	1.12	1.20	0.00	-0.12	-0.12
	-10,254.210	EUR	Euro - 74991-GSCO-INTL - OnHand	EUR	-10,254.21	-11,455.44	1.0000	1.0705	-10,254.21	-10,977.13	0.00	478.31	478.31
	-63,255.960	GBP	Pound Sterling - 74991 BARC INTL - OnHand	GBP	-63,255.96	-74,954.22	1.0000	1.2083	-63,255.96	-76,432.18	0.00	-1,477.96	-1,477.96
	3,093.450	GBP	Pound Sterling - 74991 CITI CFD - OnHand	GBP	3,093.45	3,660.72	1.0000	1.2083	3,093.45	3,737.82	0.00	77.10	77.10
	54,455.030	GBP	Pound Sterling - 74991 CITI INTL - OnHand	GBP	54,455.03	64,269.85	1.0000	1.2083	54,455.03	65,798.01	0.00	1,528.16	1,528.16
	0.050	GBP	Pound Sterling - 74991 FBCO CFD - OnHand	GBP	0.05	0.07	1.0000	1.2083	0.05	0.06	0.00	-0.01	-0.01
	0.000	GBP	Pound Sterling - 74991 JPHQ CFD - OnHand	GBP	0.00	-124.09	1.0000	1.2083	0.00	0.00	0.00	124.09	124.09
	-22,997.130	GBP	Pound Sterling - 74991 JPHQ INTL - OnHand	GBP	-22,997.13	-27,129.95	1.0000	1.2083	-22,997.13	-27,787.43	0.00	-657.48	-657.48
	-13.420	GBP	Pound Sterling - 74991 MSCO CFD - OnHand	GBP	-13.42	-16.22	1.0000	1.2083	-13.42	-16.22	0.00	0.00	0.00
	-267.560	GBP	Pound Sterling - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	GBP	-267.56	-332.98	1.0000	1.2083	-267.56	-323.30	0.00	9.68	9.68
	-9,843.850	GBP	Pound Sterling - 74991-GSCO-INTL - OnHand	GBP	-9,843.85	-12,830.00	1.0000	1.2083	-9,843.85	-11,894.32	0.00	935.68	935.68
	-1.430	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	HKD	-1.43	-0.18	1.0000	7.8016	-1.43	-0.18	0.00	0.00	0.00
	-2.530	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	HKD	-2.53	-0.32	1.0000	7.8016	-2.53	-0.32	0.00	0.00	0.00
	-0.680	HKD	Hong Kong Dollar - 74991 FBCO CFD - OnHand	HKD	-0.68	-0.09	1.0000	7.8016	-0.68	-0.09	0.00	0.00	0.00
	-212,434.720	JPY	Japanese yen - 74991 BARC INTL - OnHand	JPY	-212,434.72	-1,555.16	1.0000	131.1200	-212,434.72	-1,620.15	0.00	-64.99	-64.99
	-183,224.040	JPY	Japanese yen - 74991 CITI INTL - OnHand	JPY	-183,224.04	-1,714.38	1.0000	131.1200	-183,224.04	-1,397.38	0.00	317.00	317.00
	2.480	JPY	Japanese yen - 74991 FBCO INTL - OnHand	JPY	2.48	-21.80	1.0000	131.1200	2.48	0.01	0.00	21.81	21.81
	-0.010	JPY	Japanese yen - 74991 JPHQ CFD - OnHand	JPY	-0.01	2.79	1.0000	131.1200	-0.01	0.00	0.00	-2.79	-2.79
	-235,580,496.110	JPY	Japanese yen - 74991 JPHQ INTL - OnHand	JPY	-235,580,496.11	-1,776,652.62	1.0000	131.1200	-235,580,496.11	-1,796,678.59	0.00	-20,025.97	-20,025.97
	30,338,077.440	JPY	Japanese yen - 74991-CAYM-FX - OnHand	JPY	30,338,077.44	231,376.43	1.0000	131.1200	30,338,077.44	231,376.43	0.00	0.00	0.00
	-392,497.050	JPY	Japanese yen - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	JPY	-392,497.05	-3,220.53	1.0000	131.1200	-392,497.05	-2,993.42	0.00	227.11	227.11
	1,247,727.810	JPY	Japanese yen - 74991-GSCO-INTL - OnHand	JPY	1,247,727.81	9,387.76	1.0000	131.1200	1,247,727.81	9,515.92	0.00	128.16	128.16
	85,202.310	NZD	New Zealand Dollar - 74991 BARC INTL - OnHand	NZD	85,202.31	51,498.76	1.0000	0.6350	85,202.31	54,103.47	0.00	2,604.71	2,604.71
	-85,204.820	NZD	New Zealand Dollar - 74991 CITI INTL - OnHand	NZD	-85,204.82	-51,844.82	1.0000	0.6350	-85,204.82	-54,105.06	0.00	-2,260.24	-2,260.24
	-12,179.400	PLN	Polish zlot - 74991 BARC INTL - OnHand	PLN	-12,179.40	-3,234.55	1.0000	4.3751	-12,179.40	-2,783.80	0.00	450.75	450.75
	12,181.110	PLN	Polish zlot - 74991 CITI INTL - OnHand	PLN	12,181.11	3,206.67	1.0000	4.3751	12,181.11	2,784.19	0.00	-422.48	-422.48
	0.210	PLN	Polish zlot - 74991 FBCO CFD - OnHand	PLN	0.21	0.06	1.0000	4.3751	0.21	0.05	0.00	-0.01	-0.01
	-3,553,880.670	SEK	Swedish Krona - 74991 BARC INTL - OnHand	SEK	-3,553,880.67	-334,601.98	1.0000	10.4283	-3,553,880.67	-340,791.95	0.00	-6,189.97	-6,189.97
	3,135,824.170	SEK	Swedish Krona - 74991 CITI INTL - OnHand	SEK	3,135,824.17	299,360.17	1.0000	10.4283	3,135,824.17	300,703.29	0.00	1,343.12	1,343.12
	1,076,346.920	USD	U. S. Dollars - 74991 BARC INTL - OnHand	USD	1,076,346.92	1,076,346.92	1.0000	1.0000	1,076,346.92	1,076,346.92	0.00	0.00	0.00
	21,217.080	USD	U. S. Dollars - 74991 CITI CFD - OnHand	USD	21,217.08	21,217.08	1.0000	1.0000	21,217.08	21,217.08	0.00	0.00	0.00
	64,892,335.330	USD	U. S. Dollars - 74991 CITI DOMESTIC - OnHand	USD	64,892,335.33	64,892,335.35	1.0000	1.0000	64,892,335.33	64,892,335.35	0.00	0.00	0.00

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	3,665,557.810	USD	U. S. Dollars - 74991 CITI INTL - OnHand	USD	3,665,557.81	3,665,557.81	1.0000	1.0000	3,665,557.81	3,665,557.81	0.00	0.00	0.00
	0.220	USD	U. S. Dollars - 74991 FBCO CFD - OnHand	USD	0.22	0.22	1.0000	1.0000	0.22	0.22	0.00	0.00	0.00
	0.000	USD	U. S. Dollars - 74991 FBCO DOMESTIC - OnHand	USD	0.00	0.00	1.0000	1.0000	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	1.700	USD	U. S. Dollars - 74991 FBCO INTL - OnHand	USD	1.70	1.70	1.0000	1.0000	1.70	1.70	0.00	0.00	0.00
	258,260.970	USD	U. S. Dollars - 74991 GS OTC Collateral - OnHand	USD	258,260.97	258,260.97	1.0000	1.0000	258,260.97	258,260.97	0.00	0.00	0.00
	-156.010	USD	U. S. Dollars - 74991 JPHQ CFD - OnHand	USD	-156.01	-156.01	1.0000	1.0000	-156.01	-156.01	0.00	0.00	0.00
	1,021,348.740	USD	U. S. Dollars - 74991 JPHQ DOMESTIC - OnHand	USD	1,021,348.74	1,021,348.74	1.0000	1.0000	1,021,348.74	1,021,348.74	0.00	0.00	0.00
	563,998.320	USD	U. S. Dollars - 74991 JPHQ INTL - OnHand	USD	563,998.32	563,998.32	1.0000	1.0000	563,998.32	563,998.32	0.00	0.00	0.00
	380,237.840	USD	U. S. Dollars - 74991 JPHQ OTC Collateral - OnHand	USD	380,237.84	380,237.84	1.0000	1.0000	380,237.84	380,237.84	0.00	0.00	0.00
	520,000.000	USD	U. S. Dollars - 74991 MSCO Collateral - OnHand	USD	520,000.00	520,000.00	1.0000	1.0000	520,000.00	520,000.00	0.00	0.00	0.00
	45,428,819.220	USD	U. S. Dollars - 74991-CAYM-FX - OnHand	USD	45,428,819.22	45,428,819.22	1.0000	1.0000	45,428,819.22	45,428,819.22	0.00	0.00	0.00
	6,356,625.030	USD	U. S. Dollars - 74991-GSCO- DOMESTIC - OnHand	USD	6,356,625.03	6,356,625.03	1.0000	1.0000	6,356,625.03	6,356,625.03	0.00	0.00	0.00
	916,156.300	USD	U. S. Dollars - 74991-GSCO-INTL - OnHand	USD	916,156.30	916,156.30	1.0000	1.0000	916,156.30	916,156.30	0.00	0.00	0.00
	2,581,878.160	USD	U. S. Dollars - 74991-MSCO- DOMESTIC - OnHand	USD	2,581,878.16	2,581,878.16	1.0000	1.0000	2,581,878.16	2,581,878.16	0.00	0.00	0.00
	-42,500,000.000	USD	U. S. Dollars - MUFJ Cayman - OnHand	USD	-42,500,000.00	-42,500,000.00	1.0000	1.0000	-42,500,000.00	-42,500,000.00	0.00	0.00	0.00
	-96,727.500	ZAR	South African rand - 74991 BARC INTL - OnHand	ZAR	-96,727.50	-6,452.36	1.0000	17.0374	-96,727.50	-5,677.37	0.00	774.99	774.99
	134,969.860	ZAR	South African rand - 74991 CITI INTL - OnHand	ZAR	134,969.86	7,702.52	1.0000	17.0374	134,969.86	7,921.98	0.00	219.46	219.46
	-0.030	ZAR	South African rand - 74991 JPHQ CFD - OnHand	ZAR	-0.03	-314.82	1.0000	17.0374	-0.03	0.00	0.00	314.82	314.82
	-5,244.410	ZAR	South African rand - 74991-GSCO-DOMESTIC - OnHand	ZAR	-5,244.41	-327.33	1.0000	17.0374	-5,244.41	-307.82	0.00	19.51	19.51
	-33,221.810	ZAR	South African rand - 74991-GSCO-INTL - OnHand	ZAR	-33,221.81	-2,286.01	1.0000	17.0374	-33,221.81	-1,949.93	0.00	336.08	336.08
			Subtotal - CASH AND EQUIVALENTS			81,237,216.98				81,268,559.54	0.00	31,342.56	31,342.56
			Subtotal - Medium			81,237,216.98				81,268,559.54	0.00	31,342.56	31,342.56

Option
EQUITY OPTION

	-93.000	BHVN1 230120C00150000	BHVN US 01/23 C150.00	USD	-23,249.46	-23,249.46	5.4000	1.0000	-50,220.00	-50,220.00	-26,970.54	0.00	-26,970.54
			Subtotal - EQUITY OPTION			-23,249.46				-50,220.00	-26,970.54	0.00	-26,970.54

EQUITY WRT

	560.000	ACAAQ/WS US	ATHENA CONSUMER ACQ -CW23	USD	98.56	98.56	0.1163	1.0000	65.13	65.13	-33.43	0.00	-33.43
	353.000	ADALW US	ANTHEMIS DIGITAL ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.1100	1.0000	38.83	38.83	38.83	0.00	38.83
	380.000	ADRA/WS US	ADARA ACQUISITION CL A -CW26	USD	36.00	36.00	0.0712	1.0000	27.06	27.06	-8.94	0.00	-8.94
	170.000	AEACW US	AUTHENTIC EQUITY ACQ -CW27	USD	8.33	8.33	0.0035	1.0000	0.60	0.60	-7.73	0.00	-7.73
	2,000.000	AFTR/WS US	AFTERNEXT HEALTHTECH -CW23	USD	480.00	480.00	0.0750	1.0000	150.00	150.00	-330.00	0.00	-330.00
	354.000	AGGRW US	AGILE GROWTH CORP -CW27	USD	38.94	38.94	0.0101	1.0000	3.58	3.58	-35.36	0.00	-35.36
	204.000	ALORW US	ALSP ORCHID ACQ CL A -CW23	USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	6.12	6.12	6.12	0.00	6.12
	750.000	ALTUW US	ALTITUDE ACQ CL A -CW27	USD	50.70	50.70	0.0585	1.0000	43.88	43.88	-6.82	0.00	-6.82

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	735,000	AMAOW US	AMERICAN ACQ -CL A -CW26	USD	137.89	137.89	0.0206	1.0000	15.14	15.14	-122.75	0.00	-122.75
	450,000	APACW US	STONEBRIDGE ACQUISITION-CW23	USD	20.25	20.25	0.0239	1.0000	11.66	11.66	-8.59	0.00	-8.59
	297,000	APXIW US	APX ACQUISITION CORP 1-23	USD	29.70	29.70	0.0200	1.0000	5.94	5.94	-23.76	0.00	-23.76
	499,000	ARBGW US	AEGUI ACQ CL A -CW27	USD	40.42	40.42	0.0280	1.0000	13.97	13.97	-26.45	0.00	-26.45
	299,000	ATAQ/WS US	ALTIMAR ACQUISITION A -CW28	USD	88.21	88.21	0.0000	1.0000	0.00	0.00	-88.21	0.00	-88.21
	418,000	AVACW US	AVALON ACQUISITION INC-CW23	USD	31.94	31.94	0.0630	1.0000	27.17	27.17	-4.77	0.00	-4.77
	177,000	BGSXW US	BUILD ACQUIS CORP -A -CW26	USD	0.00	0.00	0.0100	1.0000	1.77	1.77	1.77	0.00	1.77
	231,000	BHACW US	CRUX BBS ACQUISITION -CW26	USD	33.50	33.50	0.1186	1.0000	27.40	27.40	-6.10	0.00	-6.10
	591,000	BIOSW US	BIOPLUS ACQUISITION -CW23	USD	56.15	56.15	0.0999	1.0000	59.04	59.04	2.89	0.00	2.89
	226,000	BLNGW US	BELONG ACQUISITION A -CW27	USD	15.96	15.96	0.1400	1.0000	31.64	31.64	15.68	0.00	15.68
	161,000	BLUA/WS US	BLUERIVER ACQUISIT A -CW26	USD	12.77	12.77	0.0150	1.0000	2.42	2.42	-10.35	0.00	-10.35
	738,000	BOAC/WS US	BLUESCAPE OPPORTUNIT A -CW26	USD	74.32	74.32	0.1600	1.0000	118.08	118.08	43.76	0.00	43.76
	750,000	BURU/WS US	TAILWIND ACQUISITION -CW27	USD	180.68	180.68	0.0700	1.0000	52.50	52.50	-128.18	0.00	-128.18
	231,000	CCTSW US	CACTUS ACQUISITION CORP-CW23	USD	30.03	30.03	0.0100	1.0000	2.31	2.31	-27.72	0.00	-27.72
	750,000	CCV/WS US	CHURCHILL CAP V CL A -CW27	USD	162.08	162.08	0.0807	1.0000	60.53	60.53	-101.55	0.00	-101.55
	298,000	CCVI/WS US	CHURCHILL CAP VI CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0600	1.0000	17.88	17.88	17.88	0.00	17.88
	392,000	CFPSW US	CF ACQUISITION VII A -CW27	USD	46.06	46.06	0.0320	1.0000	12.54	12.54	-33.52	0.00	-33.52
	298,000	CLAA/WS US	COLONADE ACQ CL A -CW27	USD	64.07	64.07	0.0500	1.0000	14.90	14.90	-49.17	0.00	-49.17
	173,000	CLBR/WS US	COLOMBIER ACQ CL A -CW28	USD	0.00	0.00	0.0860	1.0000	14.88	14.88	14.88	0.00	14.88
	1,500,000	CONXW US	CONX CORP-CLASS A -CW27	USD	145.80	145.80	0.1500	1.0000	225.00	225.00	79.20	0.00	79.20
	356,000	COOLW US	CORNER GROWTH ACQ CL A -CW27	USD	20.54	20.54	0.0301	1.0000	10.72	10.72	-9.82	0.00	-9.82
	3,250,000	CPAAW US	CONY P III -CW23	USD	893.75	893.75	0.1490	1.0000	484.25	484.25	-409.50	0.00	-409.50
	591,000	CPARW US	CATALYST PARTNERS AC A -CW27	USD	111.88	111.88	0.0017	1.0000	1.00	1.00	-110.88	0.00	-110.88
	511,000	CRCQW US	CALIFORNIA RESOURCES -CW27	USD	6,710.48	6,710.48	12.6000	1.0000	6,438.60	6,438.60	-271.88	0.00	-271.88
	250,000	CRZRW US	CORAZON CAPITAL V838 A -CW28	USD	230.03	230.03	0.0200	1.0000	5.00	5.00	-225.03	0.00	-225.03
	223,000	CSLMW US	CONSILIUM ACQUISITION -27	USD	26.20	26.20	0.0300	1.0000	6.69	6.69	-19.51	0.00	-19.51
	455,000	CSTA/WS US	CONSTELLATION ACQ A -CW27	USD	40.95	40.95	0.0300	1.0000	13.65	13.65	-27.30	0.00	-27.30
	500,000	CTAQW US	CARNEY TECHNOLOGY ACQ -CW27	USD	60.05	60.05	0.0672	1.0000	33.60	33.60	-26.45	0.00	-26.45
	628,000	CVII/WS US	CHURCHILL CAPITAL VII -CW28	USD	35.51	35.51	0.0494	1.0000	31.02	31.02	-4.49	0.00	-4.49
	498,000	DHCAW US	DHC ACQUISITION CORP A -CW27	USD	109.56	109.56	0.0100	1.0000	4.98	4.98	-104.58	0.00	-104.58
	273,000	DISAW US	DISRUPTIVE ACQ CL A -CW26	USD	223.83	223.83	0.0120	1.0000	3.28	3.28	-220.55	0.00	-220.55
	156,000	DLCAW US	DEEP LAKE CAPITAL CL B -CW27	USD	10.90	10.90	0.0035	1.0000	0.55	0.55	-10.35	0.00	-10.35
	635,000	DMYS/WS US	DMY TECHNOLOGY GROUP -CW23	USD	0.00	0.00	0.1050	1.0000	66.68	66.68	66.68	0.00	66.68
	255,000	DNZ/WS US	D AND Z MEDIA ACQ CL A -CW27	USD	19.13	19.13	0.0514	1.0000	13.11	13.11	-6.02	0.00	-6.02
	195,000	DPCSW US	DP CAP ACQUISITION A -CW23	USD	36.08	36.08	0.0200	1.0000	3.90	3.90	-32.18	0.00	-32.18
	131,000	DRAYW US	MACONDRAY CAPITAL AC A -CW23	USD	0.00	0.00	0.0003	1.0000	0.04	0.04	0.04	0.00	0.04
	114,000	DTOCW US	DIGITAL TRANSFORMATION OPP-A	USD	12.36	12.36	0.0600	1.0000	6.84	6.84	-5.52	0.00	-5.52
	606,000	DTRTW US	DTRT HEALTH ACQUISITION -CW22	USD	27.27	27.27	0.2999	1.0000	181.74	181.74	154.47	0.00	154.47
	562,000	EOCW/WS US	ELLIOTT OPPORTUNITY II-CW23	USD	0.00	0.00	0.0900	1.0000	50.58	50.58	50.58	0.00	50.58
	282,000	EPHYW US	EPIPHANY TECHNOLOGY AC -CW27	USD	21.18	21.18	0.0023	1.0000	0.65	0.65	-20.53	0.00	-20.53
	168,000	ESGWA NA	ESG CORE INVESTMENTS -CW27	EUR	15.12	15.38	0.0010	1.0705	0.17	0.18	-16.01	0.81	-15.20
	198,000	ESM/WS US	ESM ACQUISITION CL A -CW26	USD	28.71	28.71	0.1163	1.0000	23.03	23.03	-5.68	0.00	-5.68
	2,250,000	EVLVW US	NEHWOLD INVESTMENT A -CW25	USD	1,378.13	1,378.13	0.4275	1.0000	961.76	961.76	-416.37	0.00	-416.37
	9,000	FATH/WS US	ALTIMAR ACQ A -CW27	USD	2.57	2.57	0.0830	1.0000	0.75	0.75	-1.82	0.00	-1.82
	578,000	FGAA-WU CN	FG ACQUISITION CORP-CW30	USD	820.76	820.76	1.2500	1.0000	722.50	722.50	-98.26	0.00	-98.26
	106,000	FICVW US	FRONTIER INVESTMENT A -CW23	USD	0.00	0.00	0.0594	1.0000	6.30	6.30	6.30	0.00	6.30
	299,000	FMIVW US	FORUM MERGER IV CL A -CW27	USD	68.47	68.47	0.0300	1.0000	8.97	8.97	-59.50	0.00	-59.50
	423,000	FNVTW US	FINNOVATE ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.0265	1.0000	11.21	11.21	11.21	0.00	11.21
	187,000	FRONW US	FRONTIER ACQUISITION - CW28	USD	30.39	30.39	0.0116	1.0000	2.17	2.17	-28.22	0.00	-28.22
	239,000	FRXB/WS US	FOREST ROAD ACQ CL A -CW26	USD	33.46	33.46	0.3340	1.0000	79.83	79.83	46.37	0.00	46.37
	750,000	FSNB/WS US	FUSION ACQ II CL A -CW27	USD	51.25	51.25	0.0008	1.0000	0.60	0.60	-50.65	0.00	-50.65
	919,000	FSRXW US	FINSERV ACQUISITION CO-CW26	USD	119.47	119.47	0.0051	1.0000	4.69	4.69	-114.78	0.00	-114.78
	150,000	FTAAW US	FTAC ATHENA ACQUISITION CO-A	USD	15.17	15.17	0.0490	1.0000	7.35	7.35	-7.82	0.00	-7.82

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	105,000	FTEV US	FINTECH EVOLUTION ACQ	-CW28 USD	15.90	15.90	0.0080	1.0000	0.84	0.84	-15.06	0.00	-15.06
	241,000	FZT/WS US	FAST ACQUISITION II A	-CW26 USD	83.81	83.81	0.6700	1.0000	161.47	161.47	77.66	0.00	77.66
	538,000	GAMCW US	GOLDEN ARROW MERGER A	-CW26 USD	62.35	62.35	0.0066	1.0000	3.56	3.56	-58.79	0.00	-58.79
	0.000	GAPAW US	G&P ACQUISITION CL A	-CW27 USD	37.31	37.31	0.0000	1.0000	0.00	0.00	-37.31	0.00	-37.31
	2,764,000	GAQ/WS US	GENERATION ASIA I ACQ	-CW23 USD	414.60	414.60	0.0440	1.0000	121.62	121.62	-292.98	0.00	-292.98
	735,000	GEEWX US	GAMES & ESPORTS EXPERIEN	-23 USD	79.97	79.97	0.0301	1.0000	22.12	22.12	-57.85	0.00	-57.85
	424,000	GETR/WS US	GETAROUND INC	USD	0.00	0.00	0.0457	1.0000	19.37	19.37	19.37	0.00	19.37
	825,000	GFJW GR	GFJ ESG ACQUISITION I SE	-CW EUR	412.50	411.47	0.1000	1.0705	82.50	88.32	-353.27	30.12	-323.15
	2,450,000	GHIW US	GORES HOLDING IX	-CW24 USD	943.25	943.25	0.1901	1.0000	465.75	465.75	-477.50	0.00	-477.50
	600,000	GIA/WS US	GIGCAPITAL5 INC	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0350	1.0000	21.00	21.00	21.00	0.00	21.00
	674,000	GIACW US	GESHER I ACQUISITION	-CW28 USD	388.36	388.36	0.4999	1.0000	336.93	336.93	-51.43	0.00	-51.43
	375,000	GLTA/WS US	GALATA ACQ CORP CL A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0712	1.0000	26.70	26.70	26.70	0.00	26.70
	125,000	GPACW US	GLOBAL PARTNER ACQ A	-CW27 USD	17.50	17.50	0.0300	1.0000	3.75	3.75	-13.75	0.00	-13.75
	313,000	GVCIW US	GREEN VISOR FIN TECH	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0100	1.0000	3.13	3.13	3.13	0.00	3.13
	227,000	GWIIW US	GOOD WORKS II ACQUISITION	USD	13.62	13.62	0.0725	1.0000	16.46	16.46	2.84	0.00	2.84
	375,000	HCNEW US	JAWS HURRICANE ACQUISITI	-CW USD	0.00	0.00	0.1605	1.0000	60.19	60.19	60.19	0.00	60.19
	572,000	HEGAW NA	HEDOSOPHIA EUROPEAN	-CW27 EUR	85.80	85.59	0.0300	1.0705	17.16	18.37	-73.48	6.26	-67.22
	390,000	HMIW LN	HIRO METAVERSE ACQUISIT	-CW GBP	60.45	71.52	0.1550	1.2083	60.45	73.04	0.00	1.52	1.52
	294,000	HPA1CW LN	HAMBRO PERKS ACQUISIT	-CW GBP	30.87	36.53	0.0800	1.2083	23.52	28.42	-8.88	0.77	-8.11
	2,970,000	HPLTW US	HOME PLATE ACQ	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0053	1.0000	15.74	15.74	15.74	0.00	15.74
	750,000	HPX/WS US	HPX CORP-A	-CW25 USD	240.00	240.00	0.4200	1.0000	315.00	315.00	75.00	0.00	75.00
	375,000	IFIN/WS US	INFINT ACQUISITION CORP	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0800	1.0000	30.00	30.00	30.00	0.00	30.00
	750,000	INKAW US	KLUDEIN I ACQUISITION	-CW27 USD	292.50	292.50	0.0792	1.0000	59.40	59.40	-233.10	0.00	-233.10
	191,000	INTEW US	INTEGRAL ACQUISITION	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0745	1.0000	14.23	14.23	14.23	0.00	14.23
	328,000	IPVIW US	INTERPRIVATE IV INFRAT	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0401	1.0000	13.13	13.13	13.13	0.00	13.13
	456,000	IQMDW US	INTELLIGENT MEDICINE	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0107	1.0000	4.88	4.88	4.88	0.00	4.88
	722,000	IYCAW US	INVESTORP INDIA ACQUISIT	-27 USD	0.00	0.00	0.0522	1.0000	37.69	37.69	37.69	0.00	37.69
	606,000	JAQCW US	JUPLITER ACQUISITION A	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0600	1.0000	36.36	36.36	36.36	0.00	36.36
	750,000	JMACW US	JADE MOUNTAIN ACQUISIT	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0550	1.0000	41.25	41.25	41.25	0.00	41.25
	525,000	JUGGW US	JAWS JUGGERNAUT ACQUI	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0628	1.0000	32.97	32.97	32.97	0.00	32.97
	900,000	JUN/WS US	JUNIPER II CORP CL A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.1634	1.0000	147.06	147.06	147.06	0.00	147.06
	562,000	JWSM/WS US	JAWS MUSTANG ACQ C	-CW26 USD	0.00	0.00	0.0650	1.0000	36.53	36.53	36.53	0.00	36.53
	1,439,000	KCGI/WS US	KENSINGTON CAPITAL ACQ	-CW23 USD	0.00	0.00	0.1700	1.0000	244.63	244.63	244.63	0.00	244.63
	562,000	KWACW US	KINGSWOOD ACQ CL A	-CW27 USD	115.21	115.21	0.0392	1.0000	22.03	22.03	-93.18	0.00	-93.18
	205,000	LCAAW US	L CATTERTON ASIA ACQ	-CW USD	0.00	0.00	0.0443	1.0000	9.08	9.08	9.08	0.00	9.08
	373,000	LCAHW US	LANDCADIA HOLDINGS IV	-CW28 USD	0.00	0.00	0.1000	1.0000	37.30	37.30	37.30	0.00	37.30
	750,000	LCW/WS US	LEARN CW INVESTMENT A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0600	1.0000	45.00	45.00	45.00	0.00	45.00
	450,000	LGACW US	LAZARD GROWTH ACQ A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0060	1.0000	2.70	2.70	2.70	0.00	2.70
	606,000	LGSTW US	SEMPER PARATUS ACQU	-CW26 USD	0.00	0.00	0.0075	1.0000	4.55	4.55	4.55	0.00	4.55
	450,000	LGTOW US	LEGATO MERGER CORP II	-CW23 USD	0.00	0.00	0.4390	1.0000	197.55	197.55	197.55	0.00	197.55
	270,000	LHCIW US	LEO HOLDINGS II CL A	-CW28 USD	128.79	128.79	0.0200	1.0000	5.40	5.40	-123.39	0.00	-123.39
	300,000	LIONW US	LIONHEART III CL A	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0479	1.0000	14.37	14.37	14.37	0.00	14.37
	525,000	LJAQW US	LIGHTJUMP ACQUISITION	-CW27 USD	131.30	131.30	0.1480	1.0000	77.70	77.70	-53.60	0.00	-53.60
	540,000	LOCC/WS US	LIVE OAK CRESTVIEW	-CW26 USD	0.00	0.00	0.1799	1.0000	97.15	97.15	97.15	0.00	97.15
	306,000	LVACW US	LAVA MEDTECH ACQUISIT	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0051	1.0000	1.56	1.56	1.56	0.00	1.56
	246,000	LWVR/WS US	LIVEWIRE GROUP INC	-27 USD	214.02	214.02	0.2750	1.0000	67.65	67.65	-146.37	0.00	-146.37
	78,000	MAQCW US	MAQUIA CAPITAL ACQ A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0360	1.0000	2.81	2.81	2.81	0.00	2.81
	442,000	MCAAW US	MOUNTAIN & CO I ACQ	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	13.26	13.26	13.26	0.00	13.26
	381,000	MEACW US	MERCURY ECOMMERCE ACQ	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0500	1.0000	19.05	19.05	19.05	0.00	19.05
	106,000	MITAW US	COLISEUM ACQUISITION A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0440	1.0000	4.66	4.66	4.66	0.00	4.66
	370,000	MNTN/WS US	EVEREST CONSOLIDATOR	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0151	1.0000	5.59	5.59	5.59	0.00	5.59
	268,000	MPRAW US	MERCATO PARTNERS ACQ	-CW26 USD	0.00	0.00	0.0151	1.0000	4.03	4.03	4.03	0.00	4.03
	435,000	MSDAW US	MSD ACQUISITION CORP A	-CW28 USD	150.75	150.75	0.0775	1.0000	33.72	33.72	-117.03	0.00	-117.03

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	600.000	MTRYW US	MONTEREY BIO ACQ	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0325	1.0000	19.50	19.50	19.50	0.00	19.50
	1,485.000	NAACW US	NORTH ATLANTIC ACQ	-CW25 USD	515.15	515.15	0.0205	1.0000	30.44	30.44	-484.71	0.00	-484.71
	542.000	NEOW LN	NEW ENERGY ONE	-CW27 GBP	135.50	163.90	0.2500	1.2083	135.50	163.72	0.00	-0.18	-0.18
	2,598.000	NHICW US	NEWHOLD INVEST II-A	-CW23 USD	0.00	0.00	0.1800	1.0000	467.64	467.64	467.64	0.00	467.64
	2,227.000	NPABW US	NEW PROVIDENCE ACQ A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.1000	1.0000	222.70	222.70	222.70	0.00	222.70
	1,347.000	NPF-WU CN	NEXTPONT ACQUISITION	-CW25 USD	1,232.50	1,232.50	0.0600	1.0000	80.82	80.82	-1,151.68	0.00	-1,151.68
	578.000	NUBIW US	NUBIA BRAND INTERN	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0800	1.0000	46.24	46.24	46.24	0.00	46.24
	156.000	OLITW US	OMNILIT ACQUISITION CL A	-23 USD	0.00	0.00	0.0325	1.0000	5.07	5.07	5.07	0.00	5.07
	149.000	ORIAW US	ORION BIOTECH OPPORTU	-CW27 USD	0.00	0.00	0.1517	1.0000	22.60	22.60	22.60	0.00	22.60
	330.000	OTAW GR	OBOTECH ACQUISITION SE	-CW EUR	247.50	297.12	0.1000	1.0705	33.00	36.33	-229.62	-32.17	-261.79
	750.000	OTECW US	OCEANTECH ACQUISITIONS-	CW A USD	0.00	0.00	0.0390	1.0000	29.25	29.25	29.25	0.00	29.25
	641.000	OXACW US	OXBRIDGE ACQUISITION	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0320	1.0000	20.51	20.51	20.51	0.00	20.51
	340.000	OXUSW US	OXUS ACQUISITION CORP	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0400	1.0000	13.60	13.60	13.60	0.00	13.60
	198.000	PACEW NA	PEGASUS ACQUISITION CO	-CW27 EUR	0.00	0.00	0.2000	1.0705	39.60	42.39	42.39	0.00	42.39
	156.000	PBAXW US	PHOENIX BIOTECH ACQ	-CW26 USD	0.00	0.00	0.0431	1.0000	6.72	6.72	6.72	0.00	6.72
	750.000	PCCTW US	PERCEPTION CAPITAL II	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0198	1.0000	14.85	14.85	14.85	0.00	14.85
	721.000	PDOT/WS US	PERIDOT ACQUISITION A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0467	1.0000	33.67	33.67	33.67	0.00	33.67
	231.000	PEPLW US	PEPPERLINE HEALTH ACQ	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0153	1.0000	3.53	3.53	3.53	0.00	3.53
	578.000	PLAOW US	PATRIA LATIN AMERICAN	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0900	1.0000	52.02	52.02	52.02	0.00	52.02
	354.000	PMGMW US	PRIVETERRA ACQ CL A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0456	1.0000	16.14	16.14	16.14	0.00	16.14
	355.000	POWRW US	POWERED BRANDS CL A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0003	1.0000	0.11	0.11	0.11	0.00	0.11
	240.000	PRPC/WS US	CC NEUBERGER PRINCIPAL	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0504	1.0000	12.10	12.10	12.10	0.00	12.10
	919.000	PUCKW US	GOAL ACQUISITIONS CORP	-CW USD	0.00	0.00	0.0466	1.0000	42.78	42.78	42.78	0.00	42.78
	307.000	PWUPW US	POWERUP ACQUISITION	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0799	1.0000	24.53	24.53	24.53	0.00	24.53
	231.000	RCVRW GR	SMG EUROPEAN RECOVERY	-CW27 EUR	4.62	4.96	0.0010	1.0705	0.23	0.25	-4.70	-0.01	-4.71
	578.000	RENEW US	CARTESIAN GROWTH CORP II	-28 USD	0.00	0.00	0.2249	1.0000	129.99	129.99	129.99	0.00	129.99
	958.000	RJACW US	JACKSON ACQUISITION A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0057	1.0000	5.46	5.46	5.46	0.00	5.46
	600.000	RMGCW US	RMG ACQUISITION CL A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	18.00	18.00	18.00	0.00	18.00
	375.000	RONI/WS US	RICE ACQUISITION CORP II	-CW USD	0.00	0.00	1.2500	1.0000	468.75	468.75	468.75	0.00	468.75
	231.000	ROSEW US	ROSE HILL ACQUISITION	-CW24 USD	0.00	0.00	0.1000	1.0000	23.10	23.10	23.10	0.00	23.10
	231.000	SCMAW US	SEAPORT CALIBRE MATERI	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0350	1.0000	8.09	8.09	8.09	0.00	8.09
	2,695.000	SCRMW US	SCREAMING EAGLE ACQ CL A	-27 USD	0.00	0.00	0.2357	1.0000	635.21	635.21	635.21	0.00	635.21
	379.000	SDACW US	SUSTAINABLE DEVELOP A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0400	1.0000	15.16	15.16	15.16	0.00	15.16
	231.000	SEDA/WS US	SDCL EDGE ACQ CL A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.1600	1.0000	36.96	36.96	36.96	0.00	36.96
	760.000	SFRWW US	APPRECIATE HOLDINGS INC	USD	374.25	374.25	0.0301	1.0000	22.58	22.58	-351.67	0.00	-351.67
	268.000	SGLIW US	SEAPORT GLOBAL ACQ II	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0100	1.0000	2.68	2.68	2.68	0.00	2.68
	416.000	SLACW US	SOCIAL LEVERAGE ACQ A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0598	1.0000	24.88	24.88	24.88	0.00	24.88
	473.000	SMAPW US	SPORTSMAP TECH ACQ	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0549	1.0000	25.97	25.97	25.97	0.00	25.97
	434.000	SPCMW US	SOUND POINT ACQUISITION	-CW27 USD	0.00	0.00	0.1000	1.0000	43.40	43.40	43.40	0.00	43.40
	340.000	SPKBW US	SILVER SPIKE ACQ -A	CW26 USD	0.00	0.00	0.0300	1.0000	10.20	10.20	10.20	0.00	10.20
	525.000	SPRIW NA	SPRIW	EUR	10.50	12.02	0.2200	1.0705	115.50	123.64	112.40	-0.78	111.62
	937.000	SUAC/WS US	SHOULDERIP TECHNOLOGY	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0200	1.0000	18.74	18.74	18.74	0.00	18.74
	450.000	SVFAW US	SVF INVESTMENT CL A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0239	1.0000	11.66	11.66	11.66	0.00	11.66
	456.000	SVNAW US	7 ACQUISITION CORP-A	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0888	1.0000	40.49	40.49	40.49	0.00	40.49
	156.000	SWSSW US	SPRINGWATER SPECIAL SIT	-CW26 USD	0.00	0.00	0.0200	1.0000	3.12	3.12	3.12	0.00	3.12
	450.000	TBCPW US	THUNDER BRIDGE CAP A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0767	1.0000	34.52	34.52	34.52	0.00	34.52
	348.000	TBSAW US	TB SA ACQUISITION A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0305	1.0000	10.61	10.61	10.61	0.00	10.61
	649.000	TGVCW US	TG VENTURE ACQUISITION	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0600	1.0000	38.94	38.94	38.94	0.00	38.94
	231.000	THACW US	THRIVE ACQUISITION	-CW23 USD	0.00	0.00	0.0101	1.0000	2.33	2.33	2.33	0.00	2.33
	723.000	TIOAW US	TIO TECH A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0240	1.0000	17.35	17.35	17.35	0.00	17.35
	253.000	TMKRW US	TASTEMAKER ACQ CL A	-CW25 USD	73.40	73.40	0.1501	1.0000	37.98	37.98	-35.42	0.00	-35.42
	1,445.000	TRAQ/WS US	TRINE II ACQ CL A	-CW27 USD	0.00	0.00	0.0799	1.0000	115.46	115.46	115.46	0.00	115.46
	45.000	TRIS/WS US	TRISTAR ACQ I CL A	-CW28 USD	0.00	0.00	0.0253	1.0000	1.14	1.14	1.14	0.00	1.14

証券種別	数量	銘柄コード	銘柄	通貨	簿価金額 (現地通貨)	簿価金額 (\$)	評価単価 (\$)	為替 レート	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (\$)	評価損益 (\$)	為替評価損益 (\$)	評価損益計 (\$)
	350,000	TRONW US	CORNER GROWTH ACQUISITI-CW23	USD	0.00	0.00	0.0100	1.0000	3.50	3.50	3.50	0.00	3.50
	562,000	TWCBW US	BILANDER ACQ CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.1800	1.0000	101.16	101.16	101.16	0.00	101.16
	354,000	TZPSW US	TZP STRATEGIES -CL A -CW27	USD	156.93	156.93	0.0245	1.0000	8.67	8.67	-148.26	0.00	-148.26
	600,000	USCTW US	TKE CRITICAL TECHNOLOG -CW23	USD	0.00	0.00	0.0217	1.0000	13.02	13.02	13.02	0.00	13.02
	223,000	VHNAW US	VAHANNA TECH EDGE -CW24	USD	0.00	0.00	0.0105	1.0000	2.34	2.34	2.34	0.00	2.34
	637,000	VMGAW US	VMG CONSUMER ACQUISITION COR	USD	0.00	0.00	0.0400	1.0000	25.48	25.48	25.48	0.00	25.48
	618,000	VSACW US	VISION SENSING ACQ -CW23	USD	0.00	0.00	0.0293	1.0000	18.11	18.11	18.11	0.00	18.11
	0.000	VWEWW US	VINTAGE WINE ESTATES -CW27	USD	-138.98	-138.98	0.3000	1.0000	0.00	0.00	138.98	0.00	138.98
	60,000	WINVW US	WINVEST ACQUISITION -CW23	USD	0.00	0.00	0.0170	1.0000	1.02	1.02	1.02	0.00	1.02
	606,000	WQGA/WS US	WORLD QUANTUM GROWTH -CW28	USD	0.00	0.00	0.0100	1.0000	6.06	6.06	6.06	0.00	6.06
	496,000	WRAC/WS US	WILLIAMS ROWLAND ACQ -CW22	USD	0.00	0.00	0.0451	1.0000	21.92	21.92	21.92	0.00	21.92
	942,000	ZINGW US	FTAC ZEUS ACQ C CL A -CW27	USD	0.00	0.00	0.0200	1.0000	18.84	18.84	18.84	0.00	18.84
			Subtotal - EQUITY WRT			19,661.42				16,954.30	-2,713.46	6.34	-2,707.12

RIGHT

	318,000	ENERR US	ACCRETION ACQUISITION COR-RT	USD	31.80	31.80	0.0699	1.0000	22.23	22.23	-9.57	0.00	-9.57
			Subtotal - RIGHT			31.80				22.23	-9.57	0.00	-9.57
			Subtotal - Option			-3,556.24				-33,243.47	-29,683.57	6.34	-29,687.23

Swap

EQUITY SWAP

	637,000	ESW_AAC FP	ESW_ACCOR ACQUISITION CO SA	EUR	0.00	0.00	9.9000	1.0705	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	637,000	ESW_AACW FP	ESW_ACCOR ACQUISITION CO SA	EUR	0.00	0.00	0.0105	1.0705	6.69	7.16	7.16	0.00	7.16
	-1,009,000	ESW_AMLP US	ESW_ALERIAN MLP ETF	USD	0.00	0.00	38.0700	1.0000	-1,033.50	-1,033.50	-1,033.50	0.00	-1,033.50
	15,649,000	ESW_AVV LN	ESW_AVEVA GROUP PLC	GBP	0.00	0.00	32.1300	1.2083	2,811.53	3,397.15	3,397.15	0.00	3,397.15
	103,035,000	ESW_BIFF LN	ESW_BIFFA PLC	GBP	0.00	0.00	4.0740	1.2083	206.07	248.99	248.99	0.00	248.99
	6,918,000	ESW_BIO3 GR	ESW_BIOTEST AG	EUR	0.00	0.00	34.0000	1.0705	-691.80	-740.57	-740.57	0.00	-740.57
	3,255,000	ESW_BMG1624R1079	ESW_BROOKFIELD PROP PFD LP 6.250% 07/26/81	USD	0.00	0.00	14.1700	1.0000	-9,472.05	-9,472.05	-9,472.05	0.00	-9,472.05
	25,660,000	ESW_DCP US	ESW_DCP MIDSTREAM LP	USD	0.00	0.00	38.7900	1.0000	-10,107.76	-10,107.76	-10,107.76	0.00	-10,107.76
	173,126,000	ESW_EDF FP	ESW_ELECTRICITE DE FRANCE SA	EUR	0.00	0.00	12.0000	1.0705	-25.88	-27.71	-27.71	0.00	-27.71
	982,000	ESW_FINS LN	ESW_FINANCIALS ACQUISITION CORP	GBP	0.00	0.00	10.0250	1.2083	24.55	29.66	29.66	0.00	29.66
	491,000	ESW_FNWR LN	ESW_FINANCIALS ACQUISITION CORP	GBP	0.00	0.00	0.0400	1.2083	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
	-19,708,000	ESW_GRF SM_USD	ESW_GRIFOLS SA	USD	0.00	0.00	11.5293	1.0000	-2,700.28	-4,650.79	-2,700.28	-1,950.51	-4,650.79
	27,690,000	ESW_GRF5 US	ESW_GRIFOLS SA	USD	0.00	0.00	8.5000	1.0000	12,737.40	12,737.40	12,737.40	0.00	12,737.40
	64,716,000	ESW_HSV LN	ESW_HOMESERVE PLC	GBP	0.00	0.00	11.9700	1.2083	3,948.34	4,770.77	4,770.77	0.00	4,770.77
	43,489,000	ESW_MICRO LN	ESW_MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	GBP	0.00	0.00	5.2940	1.2083	3,131.21	3,783.44	3,783.44	0.00	3,783.44
	171,254,000	ESW_MDC LN	ESW_MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	GBP	0.00	0.00	4.9800	1.2083	1,370.03	1,655.41	1,655.41	0.00	1,655.41
	-19,876,000	ESW_RYA ID_USD	ESW_RYANAIR HOLDINGS PLC	USD	0.00	0.00	13.0708	1.0000	339.78	339.78	2,619.52	-2,279.74	339.78
	-2,835,000	ESW_SPY US	ESW_SPDR S&P 500 ETF TRUST	USD	0.00	0.00	382.4300	1.0000	70,602.11	70,602.11	70,602.11	0.00	70,602.11
	45,328,000	ESW_UNO1 GR	ESW_UNIPER SE	EUR	0.00	0.00	2.5880	1.0705	9,518.88	10,189.97	10,189.97	0.00	10,189.97
	11,589,000	ESW_VTWR GR	ESW_VANTAGE TOWERS AG	EUR	0.00	0.00	32.1000	1.0705	-463.56	-496.24	-496.24	0.00	-496.24
			Subtotal - EQUITY SWAP			0.00				81,233.22	85,463.47	-4,230.25	81,233.22
			Subtotal - Swap			0.00				81,233.22	85,463.47	-4,230.25	81,233.22
			Report Totals:			132,964,106.52				134,037,614.08	-2,104,509.83	3,178,067.39	1,073,507.56

組入投資信託証券の内容

■MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited Class BR

●ファンドの概要

投資顧問会社	Graham Capital Management, L.P.
主な投資対象・投資地域	世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物
運用の基本方針等	この投資信託は、世界各国の株式、債券、通貨、商品等の先物の市場の非効率性やトレンド等を収益機会として捕捉し、各先物の収益機会の度合、ボラティリティ、流動性及び他先物との相関に係る評価等を鑑みて、各先物のロング・ショート戦略等によりポートフォリオを構築することにより、投資信託財産の中長期的な成長を目指します。

以下の「損益の状況」は「MANAGED FUND / GRAHAM QUANT MACRO FUND LIMITED ANNUAL REPORT AND AUDITED FINANCIAL STATEMENTS For the period from 1 June 2022 to 31 May 2023」の情報を基に、「組入銘柄」は当該ファンドの運用会社からの情報を基に掲載しています。

MANAGED FUND / Graham Quant Macro Fund Limited

● 損益の状況 (2023年5月31日までの会計期間)

	31 May 2023	31 May 2022
		(単位:円)
Gross dividend income	-	-
Interest income	1,521,233.00	6,517.00
Net change in fair value on financial assets and financial liabilities at fair value through profit or loss	3,685,957.00	1,071,524,990.00
Total investment income/(loss)	5,207,190.00	1,071,531,507.00
Administrative and custodian fees	(42,104,813.00)	(28,884,441.00)
Management and performance fees	(49,922,185.00)	(135,133,988.00)
Dividend expenses	-	-
Interest expenses	-	-
Other expenses	(32,962,920.00)	(27,900,491.00)
Total expenses	(124,989,918.00)	(191,918,920.00)
Finance costs	(16,192,567.00)	(8,469,770.00)
(Loss)/profit before taxation	(135,975,295.00)	871,142,818.00
Taxation	-	-
(Decrease)/increase in net assets from operations attributable to holders of redeemable participating preference shares	(135,975,295.00)	871,142,818.00

Continuing operations: All items dealt with in arriving at the (decrease)/increase in net assets from operations attributable to holders of redeemable participating preference shares for the periods ended 31 May 2023 and 31 May 2022 relate to continuing operations.

●組入銘柄(2023年5月31日現在)

組入ロング上位10銘柄

	銘柄名	種別	通貨	組入比率
1	CANADIAN DO 0623	FX	USD	14.8%
2	AUSTRALIAN 0623	FX	USD	12.1%
3	FTSE 100 IN 0623	INDEX	GBP	11.6%
4	CHF CURRENCY FU 0623	FX	USD	11.6%
5	DAX INDEX 0623	INDEX	EUR	11.3%
6	EURO STOXX 0623	INDEX	EUR	10.5%
7	NIKKEI 225 0623	INDEX	JPY	9.3%
8	JAPANESE YE 0623	FX	USD	7.7%
9	EURO FX 0623	FX	USD	7.6%
10	BRITISH POU 0623	FX	GBP	7.4%

組入ショート上位10銘柄

	銘柄名	種別	通貨	組入比率
1	CANADIAN DO 0623	FX	CAD	△14.8%
2	AUSTRALIAN 0623	FX	AUD	△11.7%
3	CHF CURRENCY FU 0623	FX	CHF	△11.4%
4	US 2 YR NOTE FU 0923	GOVERNMENT	USD	△8.3%
5	JAPANESE YE 0623	FX	JPY	△7.6%
6	BRITISH POU 0623	FX	USD	△7.4%
7	EURO FX 0623	FX	EUR	△7.4%
8	DOW JONES M 0623	INDEX	USD	△6.8%
9	EURO SCHATZ 0623	GOVERNMENT	EUR	△6.7%
10	3MO EURO EURIBO 0624	FUTURES	EUR	△6.2%

※組入比率は対純資産総額比です。(キャッシュを除いた上位10ポジションを記載しています。)

中小型株式 マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2023年6月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2008年9月22日から無期限です。
運用方針	わが国の中小型株式を主要な投資対象とし、投資信託財産の中長期的な成長を目指して積極的な運用を行います。
主要運用対象	わが国の中小型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		参 考 指 数 1		参 考 指 数 2		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	円	騰 落 率	円	騰 落 率	円	騰 落 率			
第11期(2019年7月 1日)	37,007	△13.4	17,090	△6.2	20,210	△9.7	94.8	—	百万円 40,226
第12期(2020年6月29日)	42,753	15.5	17,140	0.3	20,056	△0.8	95.6	—	38,070
第13期(2021年6月29日)	54,048	26.4	22,026	28.5	25,102	25.2	96.9	—	32,634
第14期(2022年6月29日)	47,268	△12.5	21,913	△0.5	24,702	△1.6	94.8	—	29,267
第15期(2023年6月29日)	53,687	13.6	27,302	24.6	29,968	21.3	95.9	—	24,037

(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。

参考指数1は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

TOPIX（東証株価指数）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。

「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

TOPIX（東証株価指数）（配当込み）（以下、「配当込みTOPIX」という。）の指数値及び配当込みTOPIX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、利用など配当込みTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及び配当込みTOPIX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、配当込みTOPIX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。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

参考指数2は、Russell/Nomura Mid-Small Capインデックス（配当込み）です。

Russell/Nomura Mid-Small Capインデックスの知的財産権及びその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社及びFrank Russell Companyに帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社及びFrank Russell Companyは、Russell/Nomura Mid-Small Capインデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性及び適合性を保証するものではなく、Russell/Nomura Mid-Small Capインデックスを用いて運用される当ファンドの運用成果等に関して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。

当期中の基準価額と市況の推移

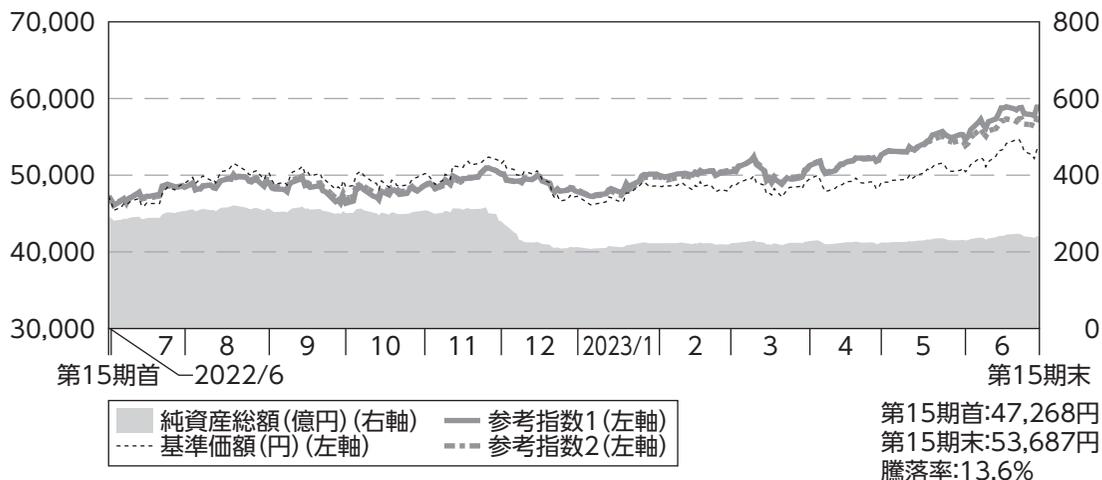
年月日	基準価額		参考指数1		参考指数2		株式組入比率	株式先物比率
	円	騰落率		騰落率		騰落率		
(当期首) 2022年 6月29日	47,268	—	21,913	—	24,702	—	94.8	—
6月末	46,542	△1.5	21,650	△1.2	24,449	△1.0	94.9	—
7月末	48,981	3.6	22,456	2.5	25,283	2.4	94.9	—
8月末	50,249	6.3	22,727	3.7	25,810	4.5	94.4	—
9月末	48,463	2.5	21,479	△2.0	24,563	△0.6	93.4	—
10月末	50,197	6.2	22,573	3.0	25,451	3.0	94.7	—
11月末	51,531	9.0	23,239	6.1	26,233	6.2	91.4	—
12月末	47,246	△0.0	22,178	1.2	25,122	1.7	95.0	—
2023年 1月末	48,568	2.8	23,160	5.7	26,022	5.3	95.8	—
2月末	48,537	2.7	23,379	6.7	26,451	7.1	95.7	—
3月末	49,539	4.8	23,777	8.5	26,810	8.5	95.4	—
4月末	49,066	3.8	24,418	11.4	27,555	11.5	95.6	—
5月末	50,454	6.7	25,301	15.5	28,146	13.9	94.3	—
(当期末) 2023年 6月29日	53,687	13.6	27,302	24.6	29,968	21.3	95.9	—

(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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)参考指数は、2022年6月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

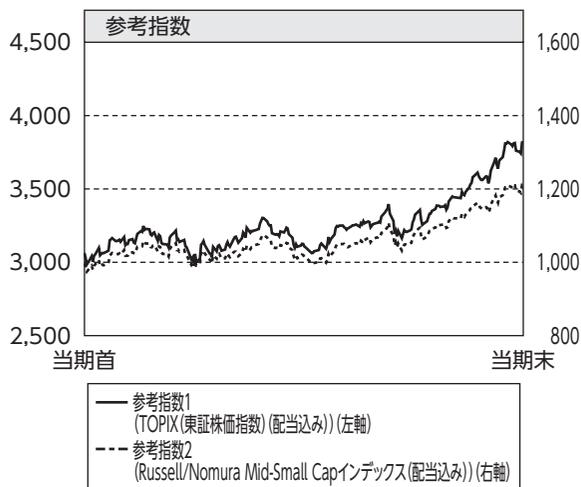
基準価額の主な変動要因

当期末の基準価額は、前期末比で上昇しました。

前半は好業績銘柄の株価上昇がパフォーマンスに寄与したものの、欧米での金融政策の引き締め傾向や日銀のイールドカーブ・コントロール政策の一部見直しなどがマイナスに影響し、概ね横ばいで推移しました。後半は米インフレ率の上昇が鈍化したことから米金利が落ち着き、米半導体大手エヌビディアがAI(人工知能)向け半導体の好調で好決算を発表したこともあり、グロース(成長)銘柄が見直されました。

保有銘柄では、焼肉業態やラーメン業態の売上が好調な物語コーポレーションや、ゲームソフトの販売がグローバルで伸びているカプコン、ハイブリッド車や電気自動車向けにセラミック部品の販売が伸びているMARUWAなどがプラスに寄与しました。一方で、障害者の雇用を支援する農園サービスに関して否定的な報道があったエスプールの、業績が市場の期待を下回ったヤプリ、買収した石炭火力発電所が石炭市況高騰で苦戦を強いられたイーレックスなどがマイナスに影響しました。

投資環境



当期はTOPIX（東証株価指数）（配当込み）もRussell/Nomura Mid-Small Capインデックス（配当込み）も上昇し、概ね類似した動きとなりました。期初から2022年後半にかけては、欧米のインフレ動向やそれを受けた金融政策に左右される展開が続きました。年末には日銀の実質的な利上げが嫌気されたものの、2023年年明け後は次期日銀総裁候補が金融緩和継続の方針を示したことが好感され、底堅く推移しました。3月には米地銀が倒産し、急落する局面もありましたが、各国当局の迅速な対応により事態の深刻化は避けられました。4月から期末にかけては日銀の金融緩和継続や海外に比べて堅調な国内景気を手掛かりに、海外投資家が大きく日本株を買い越したことから堅調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

中長期的に高い利益成長が期待できる銘柄に投資しました。

金融引き締めの影響により欧米の景気減速が懸念されることから、外部環境に左右されず自助努力で利益成長が期待できる銘柄を購入しました。具体的には、VTuber（バーチャルユーチューバー）と呼ばれるタレントが所属する事務所を運営するANYCOLORや、健康保険組合の医療データを匿名加工して製薬会社などに提供するJMDC、企業向けに名刺管理サービスなどを提供するSansanなどを購入しました。一方で、行動規制の緩和によってテレワーク需要の減少が懸念されたインターネットイニシアティブや、世界的なパソコン余剰を受けて電子材料が苦戦したデクセリアルズなどを売却しました。

当ファンドの組入資産の内容

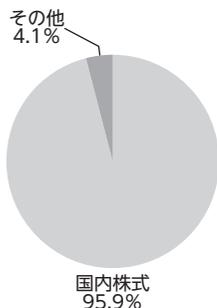
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	MARUWA	日本	3.3%
2	カブコン	日本	2.9%
3	ジャパンマテリアル	日本	2.7%
4	富士電機	日本	2.6%
5	東宝	日本	2.6%
6	ANYCOLOR	日本	2.4%

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ニフコ	日本	2.2%
8	ナカニシ	日本	2.2%
9	物語コーポレーション	日本	2.1%
10	アシックス	日本	2.0%
組入銘柄数			72

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

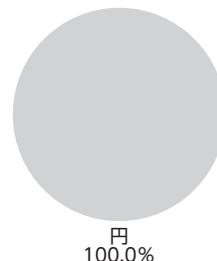
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

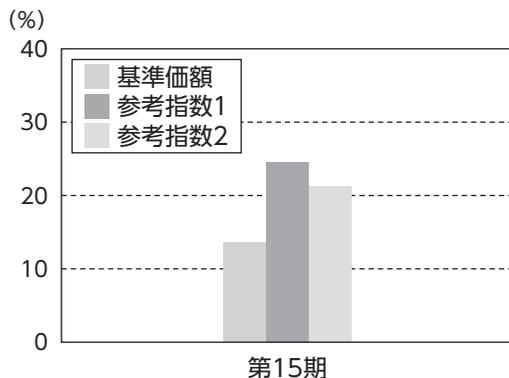


(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



今後の運用方針

主として、わが国の取引所上場株式(これに準ずるものを含みます)のうち、中小型株式に投資します。具体的には、以下の方針に基づいて銘柄選択を行います。

市場動向、業界動向、技術動向など成長ポテンシャルの観点から投資対象候補の絞込みを行い、マネジメントに対する評価なども踏まえた上で組入銘柄を決定します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年6月30日~2023年6月29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)	52円 (52) (-) (-) (-) (-) (-) (-)	0.105% (0.105) (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	52	0.105	

(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(49,114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 6,545 (898)	千円 20,720,796 (-)	千株 10,130	千円 28,737,535

(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。

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	49,458,331千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	24,706,864千円
(c) 売 買 高 比 率(a) / (b)	2.00

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.109007	百万円 0.109007	% 100.0	百万円 0.109007	百万円 0.109007	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	323,234	33,729	10.4	323,518	33,670	10.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
建設業(ー%)			
日揮ホールディングス	233	—	—
食料品(1.8%)			
寿スピリッツ	63	40	420,800
繊維製品(1.3%)			
セーレン	220	119	292,026
化学(6.4%)			
クラレ	—	245	341,530
KHネオケム	165	—	—
恵和	75	—	—
トリケミカル研究所	200	140	394,100
ミルボン	65	—	—
OATアグリオ	—	96.4	201,476
デクセリアルズ	218.8	—	—
ニフコ	180	126	537,642
医薬品(3.5%)			
ロート製薬	92	136	443,360
JCRファーマ	180	—	—
ペプチドリーム	—	170	368,220
ガラス・土石製品(3.5%)			
MARUWA	60	36	802,440
金属製品(3.2%)			
横河ブリッジホールディングス	150	140	351,400
三益半導体工業	145	120	373,200
機械(4.2%)			
日本製鋼所	70	—	—
芝浦機械	90	55	264,550
ヒラノテクシード	13	—	—
技研製作所	70	—	—
ローツェ	—	23	265,420
竹内製作所	—	100	444,500
電気機器(8.0%)			
イビデン	85	35	279,265
富士電機	166	100	631,500
オキサイド	—	57	225,435
ソシオネクスト	—	4	84,480
ローランド ディー. ジー.	95	—	—
マクセル	200	—	—
日本セラミック	178	115	316,480
エンブラス	—	27	156,870
大真空	230	235	152,750

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
精密機器(2.3%)			
ナカニシ	105	159	529,470
インターアクション	210	—	—
メニコン	95	—	—
その他製品(6.3%)			
ブシロード	95	400	306,000
壽屋	—	51	147,135
スノーピーク	115	—	—
前田工織	95	84.9	269,982
SHOEI	87	87	232,812
アシックス	—	110	486,860
電気・ガス業(1.0%)			
メタウォーター	—	130	236,990
陸運業(1.0%)			
AZ-COM丸和ホールディングス	—	120	235,800
倉庫・運輸関連業(ー%)			
トランコム	42	—	—
情報・通信業(28.2%)			
手間いらず	90	—	—
ネクソン	220	90	251,460
SHIFT	—	13	344,760
GMOペイメントゲートウェイ	18	27	304,830
インターネットイニシアティブ	190	110	299,970
カナミックネットワーク	170	205	95,735
チェンジホールディングス	—	122	276,940
ヤプリー	130	—	—
ビジョナル	60	30	234,600
サスメド	—	78	131,664
シンプレクス・ホールディングス	65	160	422,080
Sansan	—	240	404,760
ギフティ	—	105	196,350
JMDC	—	50	284,350
J TOWER	10	58	400,780
ビザスク	77	—	—
ウェザーニューズ	45	—	—
AnyMind Group	—	55	72,050
ANYCOLOR	—	76	578,360
ネットワンシステムズ	—	140	438,760
ビジョン	190	240	437,280
KADOKAWA	165	—	—
東宝	150	115	628,590

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
カブコン	150	125	706,875
卸売業(2.9%)			
神戸物産	185	100	377,800
アズワン	50	50	285,400
小売業(5.5%)			
サンエー	95	—	—
バルグループホールディングス	—	85	327,250
物語コーポレーション	125	145	500,250
シュッピン	360	—	—
ネクステージ	200	80	225,200
薬王堂ホールディングス	—	87	223,938
銀行業(1.3%)			
京都銀行	—	40	289,480
証券・商品先物取引業(—)			
ウェルスナビ	100	—	—
保険業(2.6%)			
F Pパートナー	—	84	379,680
アニコム ホールディングス	450	350	221,550
その他金融業(0.9%)			
イー・ギャランティ	230	110	211,310
不動産業(2.6%)			
スター・マイカ・ホールディングス	202	—	—
S R Eホールディングス	95	65	251,550
ティーケーピー	—	130	353,990
サービス業(13.5%)			
日本M&Aセンターホールディングス	165	—	—
エス・エム・エス	140	110	318,285
エスプール	590	300	157,800
イオンファンタジー	—	50	163,750
サイバーエージェント	350	130	137,930
弁護士ドットコム	62	105	387,450

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
Keep er 技研	170	45	216,450	
ジャパンマテリアル	345	270	642,870	
ER Iホールディングス	—	80	111,440	
エラン	235	—	—	
アトラエ	112	—	—	
インソース	220	—	—	
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	180	160	297,760	
マネジメントソリューションズ	—	70	294,000	
L I T A L I C O	105	60	137,400	
ダイセキ	170	60	246,600	
合 計	株 数・金 額	10,753	8,066	23,061,820
	銘柄数<比率>	71	72	<95.9%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 23,061,820	% 94.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,388,426	5.7
投 資 信 託 財 産 総 額	24,450,246	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 2023年6月29日現在
(A)資 産	24,450,246,255円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,146,960,013
株 式(評価額)	23,061,820,000
未 収 入 金	188,422,842
未 収 配 当 金	53,043,400
(B)負 債	412,355,498
未 払 金	155,735,449
未 払 解 約 金	256,617,164
未 払 利 息	2,885
(C)純 資 産 総 額(A-B)	24,037,890,757
元 本	4,477,404,543
次 期 繰 越 損 益 金	19,560,486,214
(D)受 益 権 総 口 数	4,477,404,543口
1万口当たり基準価額(C/D)	53,687円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年6月30日 至 2023年6月29日
(A)配 当 等 収 益	290,723,644円
受 取 配 当 金	291,384,550
受 取 利 息	5,027
そ の 他 収 益 金	5,575
支 払 利 息	△671,508
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	3,319,609,223
売 買 益	5,668,622,462
売 買 損	△2,349,013,239
(C)当 期 損 益 金(A+B)	3,610,332,867
(D)前 期 繰 越 損 益 金	23,075,548,663
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	1,221,699,267
(F)解 約 差 損 益 金	△8,347,094,583
(G)計 (C+D+E+F)	19,560,486,214
次 期 繰 越 損 益 金(G)	19,560,486,214

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は6,191,809,864円、期中追加設定元本額は321,399,444円、期中一部解約元本額は2,035,804,765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。

中小型株式オープン	2,713,521,650円
国内株式SMTBセクション(SMA専用)	1,685,183,545円
中小型株式オープン(SMA専用)	54,234,553円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	24,464,795円

お知らせ

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2023年5月29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 組入比率	株式先物率 比	純資産額
	円 騰落	% 中率	円 騰落	% 中率			
第19期(2019年5月29日)	14,134	△10.7	1,536.41	△12.8	97.8	2.2	272,283
第20期(2020年5月29日)	14,762	4.4	1,563.67	1.8	97.0	1.7	313,448
第21期(2021年5月31日)	18,550	25.7	1,922.98	23.0	98.5	1.5	462,835
第22期(2022年5月30日)	18,985	2.3	1,922.44	△0.0	98.3	1.9	497,213
第23期(2023年5月29日)	21,924	15.5	2,160.65	12.4	98.5	1.5	560,044

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式先物率 組入比率	株式先物率 比
	円 騰落	% 騰落率	円 騰落	% 騰落率		
(当期首) 2022年 5月30日	18,985	—	1,922.44	—	98.3	1.9
5月末	18,888	△0.5	1,912.67	△0.5	98.5	1.5
6月末	18,498	△2.6	1,870.82	△2.7	98.6	1.4
7月末	19,189	1.1	1,940.31	0.9	99.5	0.5
8月末	19,419	2.3	1,963.16	2.1	99.5	0.5
9月末	18,355	△3.3	1,835.94	△4.5	98.3	1.7
10月末	19,291	1.6	1,929.43	0.4	98.5	1.4
11月末	19,858	4.6	1,985.57	3.3	98.7	1.2
12月末	18,951	△0.2	1,891.71	△1.6	99.0	1.0
2023年 1月末	19,790	4.2	1,975.27	2.7	99.5	0.5
2月末	19,977	5.2	1,993.28	3.7	99.5	0.5
3月末	20,318	7.0	2,003.50	4.2	98.2	1.8
4月末	20,865	9.9	2,057.48	7.0	98.4	1.6
(当期末) 2023年 5月29日	21,924	15.5	2,160.65	12.4	98.5	1.5

(注1)騰落率は期首比です。

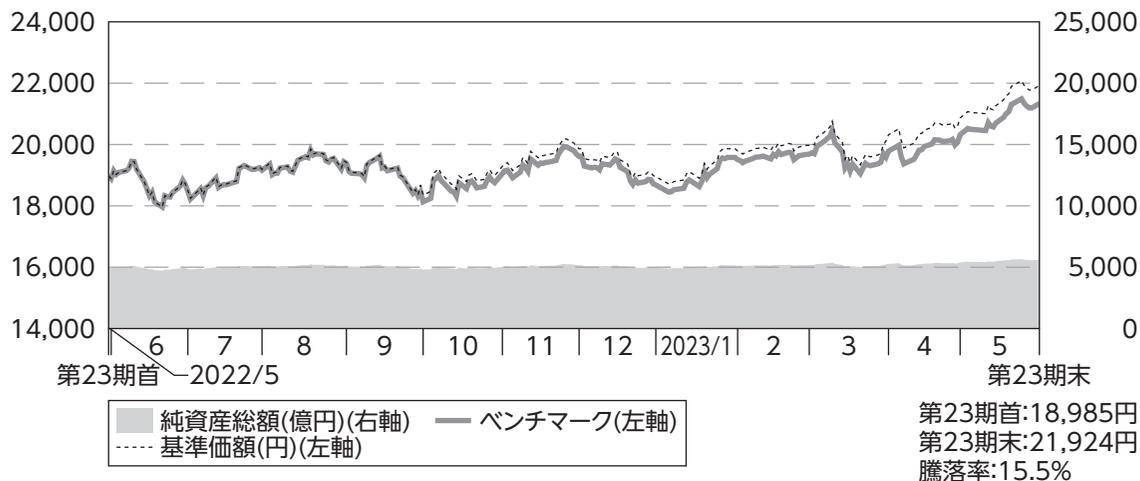
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

「TOPIX(東証株価指数)」とは、株式会社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、2022年5月30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、期末は期首比で上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

新型コロナウイルス感染拡大や米国の金融引き締めペースの加速が懸念される一方で、円安・米ドル高が進行したことなどが下支えとなり、国内株式市場は2022年11月にかけて一進一退の展開となりました。その後は、日銀により長期金利の許容変動幅が拡大されたことが事実上の利上げと解釈され下落しましたが、次期日銀総裁候補である植田和男氏が金融緩和継続の方針を示したことや引き続き円安・米ドル高が進行したことが好感され、2023年3月上旬にかけて堅調に推移しました。期末にかけては、日銀金融政策決定会合での金融政策の現状維持の決定が好感されたことや好決算の流れを受け、国内株式市場は一阶段高となりました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、資金の効率的な運用を行う目的で、株価指数先物取引を適宜活用しています。

(2) 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極力合わせたポートフォリオを組成しました。

当ファンドの組入資産の内容

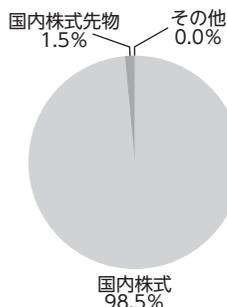
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.4%
2	ソニーグループ	日本	3.0%
3	キーエンス	日本	2.2%
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	1.8%
5	日本電信電話	日本	1.7%
6	東証株価指数先物 2306	日本	1.5%

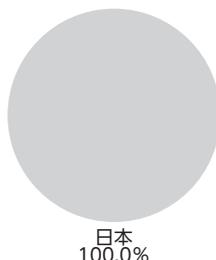
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	東京エレクトロン	日本	1.3%
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.3%
9	武田薬品工業	日本	1.3%
10	日立製作所	日本	1.3%
組入銘柄数			2,086

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

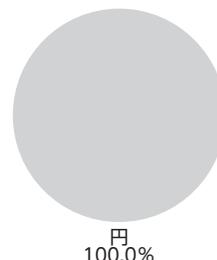
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

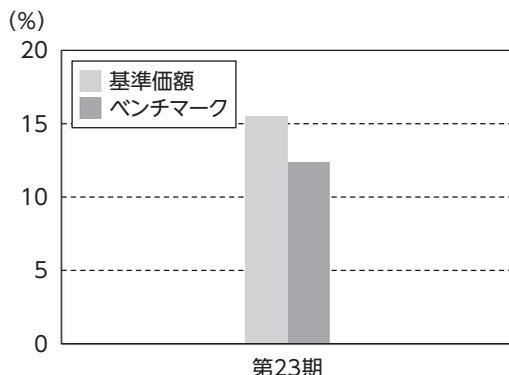


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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1.5%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

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

今後の運用方針

原則として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
	(2022年5月31日~2023年5月29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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
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(19,449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 22,259 (6,727)	千円 51,194,198 (-)	千株 21,626	千円 49,525,331

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 60,608	百万円 63,206	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	100,719,530千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	502,094,022千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.20

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	0.252396 百万円	0.252396 百万円	100.0	0.252396 百万円	0.252396 百万円	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	600,250	59,306	9.9	601,156	59,022	9.8

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人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	92百万円	143百万円	1,605百万円

(注1) 買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。

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

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

組入資産の明細

<国内株式(上場株式)>

銘柄	当期末(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	8.8	9.5	34,485
ニッスイ	250.3	250.3	159,190
マルハニチロ	36.9	37.1	92,935
雪国まいたけ	19.2	21.3	20,682
カネコ種苗	7.4	7.7	11,534
サカタのタネ	29.4	28.5	115,282
ホクト	20.7	22.3	41,277
ホクリヨウ	3.6	2.8	2,500
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	46	30.3	10,302
日鉄鉱業	5.4	10	37,600
三井松島ホールディングス	11	11.3	31,809
I N P E X	944.2	925.6	1,422,647
石油資源開発	30.9	29	125,570
K&Oエナジーグループ	10.8	11.3	26,295
建設業(2.0%)			
ショーボンドホールディングス	33	34.1	193,006
ミライト・ワン	84.6	82.8	146,224
タマホーム	15.9	15.7	64,684
サンヨーホームズ	3	2.4	1,692
日本アクア	10.4	8.1	7,330
ファーストコーポレーション	6.4	5	4,470
バステラ	5.3	4.2	3,906
R o b o t H o m e	43.8	42.6	7,795
キャンディル	4.1	3.5	1,984
ダイセキ環境ソリューション	5.1	3.9	3,775
第一カッター興業	6	6.4	7,968
安藤・間	123.3	145	149,495
東急建設	72.7	71.3	50,480
コムシスホールディングス	84.7	84.7	233,687
ビーアールホールディングス	33.9	39.7	15,006
高松コンストラクショングループ	16	16.3	39,087
東建コーポレーション	7.3	7.2	53,856
ソネック	2.7	2.1	2,043
ヤマウラ	11.8	12.7	15,125
オリエンタル白石	88.3	89.9	27,329
大成建設	164.9	163.8	756,756
大林組	578	626.1	735,041
清水建設	536.9	526.3	456,302
飛島建設	16.2	19.3	23,275

銘柄	当期末(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
長谷工コーポレーション	168.7	180.7	293,998
松井建設	21.4	16.3	11,312
銭高組	2.4	1.7	5,168
鹿島建設	423.5	388.2	800,080
不動テトラ	12.9	12.1	22,070
大末建設	6.4	5	6,400
鉄建建設	12.6	12.6	24,872
西松建設	36.7	29.7	100,534
三井住友建設	136.8	141.2	50,408
大豊建設	8.9	7.2	27,684
佐田建設	13.1	8.7	3,819
ナカノフドー建設	14.5	9.7	3,656
奥村組	31.7	28.4	110,334
東鉄工業	25.3	24.1	63,648
イチケン	4.4	3.1	5,849
富士ビー・エス	7.8	6.1	2,653
浅沼組	6.8	14	43,890
戸田建設	239.1	215.4	171,458
熊谷組	30	29.3	85,233
北野建設	3.7	2.6	7,748
植木組	5.1	3.9	5,042
矢作建設工業	25	23.8	26,299
ピーエス三菱	20	22.2	15,651
日本ハウスホールディングス	41	34.7	13,290
大東建託	62.1	—	—
新日本建設	25.8	24.6	27,675
東亜道路工業	3.1	7	28,770
日本道路	5.3	3.5	29,400
東亜建設工業	14	15	46,500
日本国土開発	51.2	52.5	32,130
若築建設	9.6	7.8	26,208
東洋建設	68	56.7	56,076
五洋建設	229.1	248.2	178,704
世紀東急工業	29.1	22.5	29,137
福田組	6.5	6.6	31,152
住友林業	140.4	134.3	427,074
日本基礎技術	15.4	8.2	4,173
巴コーポレーション	23.7	15.2	6,657
大和ハウス工業	507	489.2	1,757,695
ライト工業	34.5	32.4	62,726
積水ハウス	603.3	548.4	1,554,165

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
日特建設	12.5	16.7	16,516
北陸電気工事	11.4	12	10,356
ユアテック	34.7	38.6	32,732
日本リーテック	11.9	15.4	22,884
四電工	6.1	7.3	15,549
中電工	25.6	27.2	60,084
関電工	98.7	95.9	102,517
きんでん	127.4	123.2	229,028
東京エネシス	18.7	17.4	16,443
トーエネック	6.1	5.8	21,315
住友電設	15	16.7	47,110
日本電設工業	28.3	28.8	53,827
エクシオグループ	86.6	80.6	214,154
新日本空調	14.1	9.7	21,660
九電工	41.2	42.6	161,028
三機工業	39.4	38.8	57,656
日揮ホールディングス	176.6	173.2	298,423
中外炉工業	5.8	5.7	11,308
ヤマト	15.6	11.3	10,655
太平電業	11.8	10.9	44,744
高砂熱学工業	49.2	42.2	100,182
三晃金属工業	2.4	1.7	6,927
朝日工業社	7.6	7.3	17,790
明星工業	32.7	30.1	28,414
大気社	26.7	20.2	75,851
ダイダゲン	12.1	11.5	29,474
日比谷総合設備	17.5	15	34,230
フィル・カンパニー	3.2	3.1	2,765
テスホールディングス	16.9	18.9	19,296
インフロア・ホールディングス	235.4	183.5	231,760
東洋エンジニアリング	25.5	23.2	12,667
レイズネクスト	27.1	25.3	35,824
食料品(3.5%)			
ニッポン	50.5	47.4	85,272
日清製粉グループ本社	195.1	162.5	287,787
日東富士製粉	2.8	3.1	14,337
昭和産業	16.3	15.3	39,397
鳥越製粉	15.1	10.9	6,681
中部飼料	20.7	24.3	26,681
フィード・ワン	23.9	25.7	18,761
東洋精糖	3.3	2.5	3,477
日本甜菜製糖	10.1	10.2	18,594
DM三井製糖ホールディングス	16.3	17.4	45,779
塩水港精糖	23.1	16.4	3,247
ウェルネオシュガー	9.2	9.1	18,764

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
森永製菓	41.2	32.1	146,055
中村屋	4.2	4.4	13,552
江崎グリコ	48	50.3	189,128
名糖産業	7.5	6.9	11,122
井村屋グループ	10	9.6	21,676
不二家	10.8	12	29,724
山崎製パン	127.9	117.6	239,080
第一屋製パン	3.7	2.6	1,037
モロゾフ	5.9	5.7	21,090
亀田製菓	10.4	11.2	46,816
寿スピリッツ	17.5	18.7	192,984
カルビー	88.5	80.5	222,502
森永乳業	33.9	31.9	162,690
六甲バター	13.3	12.9	17,505
ヤクルト本社	130.2	125.6	1,144,216
明治ホールディングス	112.9	217.9	695,101
雪印メグミルク	43.9	42.5	81,727
プリマハム	24.3	23.6	52,392
日本ハム	70.1	68.7	263,121
林兼産業	5.9	4.2	2,024
丸大食品	18	17.7	26,178
S F o o d s	17.4	19.4	61,013
柿安本店	6.7	6.9	15,918
伊藤ハム米久ホールディングス	125	134.3	95,353
サッポロホールディングス	60	57.9	221,757
アサヒグループホールディングス	416.3	406.1	2,174,259
キリンホールディングス	713.8	793.1	1,653,216
宝ホールディングス	116	120	125,640
オエノンホールディングス	52.5	52.5	18,060
養命酒製造	5.5	5.8	10,573
コカ・コーラ ボトラーズ ジャパンホールディングス	128.1	137.7	216,739
サントリー食品インターナショナル ダイドグループホールディングス	129.9	123.8	663,568
伊藤園	59	59.6	250,618
キーコーヒー	18.2	19.7	40,188
ユニカフェ	5.8	4.5	4,090
ジャパンフーズ	2.8	2.1	2,328
日清オイリオグループ	23	24.8	84,072
不二製油グループ本社	42.1	40.9	81,063
かどや製油	1.8	1.6	5,552
Jーオイルミルズ	18.1	17.9	28,246
キッコーマン	124.3	116.5	972,775
味の素	397.9	424.4	2,310,433
ブルドックソース	7.3	9.3	18,395

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)
キユーピー	90.7	94.5	215,365			
ハウス食品グループ本社	64.6	53.8	173,774			
カゴメ	73.7	81.9	274,774			
焼津水産化学工業	8.4	5.4	4,330			
アリアケジャパン	17.7	15.3	78,489			
ピエトロ	2.5	2	3,612			
エバラ食品工業	4.2	4.7	13,733			
やまみ	1.7	1.3	1,859			
ニチレイ	77.8	80.5	241,902			
東洋水産	88.8	88.8	519,480			
イトアンドホールディングス	7.3	7.5	16,500			
大冷	2.2	1.7	3,248			
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10	11.1	8,880			
日清食品ホールディングス	66.8	61.8	736,038			
永谷園ホールディングス	8.6	8.6	18,472			
一正蒲鉾	7.8	5.9	4,495			
フジッコ	18.1	18.1	34,299			
ロック・フィールド	19.8	19.7	28,762			
日本たばこ産業	1,041.3	1,157	3,567,031			
ケンコーマヨネーズ	10.2	12.1	15,197			
わらべや日洋ホールディングス	12	12.9	29,476			
なとり	10.8	11	21,175			
イフジ産業	3.4	2.3	2,421			
ピクルスコーポレーション	9.3	—	—			
ファーマフーズ	24.5	25.2	45,637			
ユーグレナ	99.8	113.6	104,057			
紀文食品	15.1	13.7	13,631			
ピクルスホールディングス	—	10.3	12,524			
ミヨシ油脂	7	4.8	4,728			
理研ビタミン	17.7	15.2	30,932			
繊維製品(0.4%)						
片倉工業	18.6	16.8	28,526			
グンゼ	11.5	12.8	57,664			
東洋紡	75.4	77.8	78,967			
ユニチカ	54.1	56.5	12,486			
富士紡ホールディングス	8.1	7.2	22,140			
倉敷紡績	14.8	13.6	30,844			
シキボウ	9.9	7.7	7,484			
日本毛織	50.8	47.7	47,556			
トーア紡コーポレーション	7	5.4	2,073			
帝国繊維	20.6	20.5	33,620			
帝人	170.8	172.2	236,775			
東レ	1,242.3	1,198.7	881,763			
住江織物	3.4	3	7,275			
日本フエルト	11.9	9	3,690			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
イチカワ	2.7	2.2	2,956			
日東製網	2	1.5	2,077			
アツギ	14.3	8.6	3,560			
ダイニック	6.5	3.6	2,664			
セーレン	36.5	34.8	78,961			
ソトー	7.2	4.6	3,459			
東海染工	2.4	1.5	1,596			
小松マテレー	29.5	26.2	17,318			
ワコールホールディングス	42.1	34.5	100,153			
ホギメディカル	24.3	24.1	79,409			
T S I ホールディングス	60.1	60.5	40,777			
マツオカコーポレーション	5.9	3.9	4,278			
ワールド	24.9	23.1	35,574			
三陽商会	8.6	5.3	8,660			
ナイガイ	7.1	5.3	1,388			
オンワードホールディングス	108.4	116.5	44,270			
ルックホールディングス	6.2	4.1	9,343			
ゴールドウイン	32.3	31.7	377,230			
デサント	34	30.9	118,965			
キング	9.3	6.4	3,552			
ヤマトインターナショナル	15.7	11.7	3,135			
パルプ・紙(0.2%)						
特種東海製紙	10.4	8	24,880			
王子ホールディングス	751.6	744.8	408,895			
日本製紙	81.5	93.1	108,182			
三菱製紙	25.1	16.7	7,832			
北越コーポレーション	116.7	113	102,491			
中越パルプ工業	7.2	5.6	6,932			
巴川製紙所	5.6	4.4	2,895			
大王製紙	84.6	79	83,266			
阿波製紙	4.5	3.3	1,795			
レンゴー	157.4	162.8	136,752			
トーモク	10.1	10.3	19,518			
ザ・バック	12.8	13.3	40,631			
化学(6.1%)						
北の達人コーポレーション	67.8	75.3	21,535			
クラレ	262.9	284.2	381,680			
旭化成	1,200.3	1,116.6	1,078,077			
共和レザー	10.8	8	4,264			
レゾナック・ホールディングス	165.9	172.8	392,083			
住友化学	1,326.1	1,326.4	563,720			
住友精化	7.8	7.5	31,500			
日産化学	91.6	84.9	515,343			
ラサ工業	6.7	6.9	14,414			
クレハ	14.2	15.3	125,001			

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
多木化学	6.6	6.9	29,808
テイカ	11.8	12	15,480
石原産業	33.2	32.3	41,117
片倉コープアグリ	4.3	2.8	3,516
日本曹達	21.9	19.2	90,336
東ソー	247.4	238.7	392,661
トクヤマ	57.7	57.7	128,267
セントラル硝子	29.3	28.7	84,320
東亜合成	95.3	89.7	111,048
大阪ソーダ	15.5	10.7	43,923
関東電化工業	36.9	34.6	30,275
デンカ	65.6	65	170,170
信越化学工業	308.7	1,486.2	6,543,738
日本カーバイド工業	6.8	5.3	6,852
堺化学工業	12.6	13.6	24,847
第一稀元素化学工業	16.6	16.3	14,751
エア・ウォーター	161	168.7	313,950
日本酸素ホールディングス	164.8	173.5	504,885
日本化学工業	5.5	6	10,872
東邦アセチレン	3.9	2.9	3,761
日本バーカライジング	85	88.5	94,341
高压ガス工業	27.8	26	19,188
チタン工業	2.2	1.7	2,361
四国化成ホールディングス	22.7	21.2	30,676
戸田工業	4	4.1	9,495
ステラ ケミファ	9.5	10.6	32,171
保土谷化学工業	5.4	5.1	16,269
日本触媒	28.6	27.2	141,984
大日精化工業	14.2	12.4	24,118
カネカ	43.6	40.9	158,692
三菱瓦斯化学	158.2	133.5	264,463
三井化学	155.7	147.4	526,955
J S R	176.6	166.9	567,460
東京応化工業	29	31.3	265,424
大阪有機化学工業	14.4	13.5	32,184
三菱ケミカルグループ	1,206.6	1,206.6	996,410
KHネオケム	29.8	29.8	68,093
ダイセル	260.9	262.9	315,742
住友ベークライト	27.8	26.5	147,340
積水化学工業	377.7	365.7	718,234
日本ゼオン	151.9	107.2	158,548
アイカ工業	47.4	45.1	133,496
UBE	89.3	92.2	205,145
積水樹脂	26.9	26	53,196
タキロンシーアイ	41	39.1	20,605

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
旭有機材	10.7	11.9	44,327
ニチバン	10.4	11.1	20,512
リケンテクノス	41.1	38.5	23,446
大倉工業	8.7	8.3	17,305
積水化成成品工業	23.5	25.1	10,516
群栄化学工業	4	4.2	10,647
タイガースポリマー	9.4	6.3	3,402
ミライアル	6.1	4.3	7,314
ダイキアクシス	7.4	5.1	3,626
ダイキョーニシカワ	40	39.5	29,625
竹本容器	6.8	4.7	3,755
森六ホールディングス	9.5	9.1	18,254
恵和	5.2	11.6	12,852
日本化薬	136.6	136.6	165,559
カーリットホールディングス	16.9	16.1	11,559
日本精化	13.2	10.2	25,999
扶桑化学工業	15.6	16.6	66,566
トリケミカル研究所	19.5	23.9	61,327
ADEKA	79	62.3	154,690
日油	58.1	55.3	330,694
新日本理化学	28.4	19.2	4,108
ハリマ化成グループ	13.1	9.7	8,235
花王	409	435.4	2,211,832
第一工業製薬	6.6	6.4	11,628
石原ケミカル	9.1	8.2	13,480
日華化学	6.4	5.6	4,676
ニイタカ	3.7	2.5	5,380
三洋化成工業	11.3	11	45,320
有機合成薬品工業	13.2	10.3	3,038
大日本塗料	22	21.8	19,707
日本ペイントホールディングス	712	791.2	870,320
関西ペイント	174.7	163.8	346,273
神東塗料	14.9	11.6	1,531
中国塗料	42.2	29.4	31,605
日本特殊塗料	12.3	8.8	8,835
藤倉化成	23.6	24	10,152
太陽ホールディングス	27.9	27.2	71,536
D I C	72.4	69.9	179,573
サカタインクス	37.6	39.8	46,128
東洋インキSCホールディングス	37.6	35	76,720
T&K TOKA	15.3	15.9	18,873
富士フイルムホールディングス	340.1	343.5	2,929,711
資生堂	360.4	373.8	2,430,821
ライオン	205.1	214.8	294,276
高砂香料工業	11.7	12.1	31,823

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
マンダム	38.7	38.7	59,868
ミルボン	23.9	26.5	127,995
ファンケル	78.3	78.3	180,716
コーセー	36.4	36.4	510,692
コタ	13.5	16.5	26,053
シーボン	2.5	1.8	2,799
ポーラ・オルビスホールディングス	82.6	91.8	179,744
ノエビアホールディングス	15	16	84,480
アジュバンホールディングス	4.3	3.4	3,124
新日本製薬	7.9	10.2	14,096
アクシージア	—	9.1	10,983
エステー	12.4	13.8	21,141
アグロ カネショウ	6.4	7.2	11,606
コニシ	30.2	29.9	63,627
長谷川香料	33.4	34.2	106,191
星光PMC	10.9	7.1	3,954
小林製薬	54.2	52.1	412,632
荒川化学工業	14.5	15.2	15,200
メック	13.7	14.7	47,040
日本高純度化学	4.8	4.5	11,380
タカラバイオ	50.6	48.2	78,517
JCU	20.4	20	70,500
新田ゼラチン	11.4	8.6	6,329
OATアグリオ	8	5.7	10,254
デクセリアルズ	50.4	51.7	157,685
アース製薬	15.9	16.2	81,000
北興化学工業	16.8	18	16,830
大成ラミック	5.4	5.6	16,368
クミアイ化学工業	72	71.1	64,985
日本農薬	34.5	32.8	20,860
アキレス	12.4	11.3	16,125
有沢製作所	26.9	29.1	32,242
日東電工	117	130	1,309,100
レック	23.7	25.5	20,884
三光合成	22.1	22.5	12,330
きもと	29.6	20.5	3,731
藤森工業	15.8	14.1	48,856
前澤化成工業	11.7	11.6	18,223
未来工業	6.9	6.4	15,219
ウェーブブロックホールディングス	7.3	4.2	2,402
JSP	11.3	12.6	20,966
エフピコ	35.6	33.9	97,360
天馬	15.2	15.2	37,498
信越ポリマー	34.7	33.1	46,869
東リ	45.5	31.2	9,578

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ニフコ	64.6	64.6	243,542
バルカー	15.7	15	52,350
ユニ・チャーム	373	373	1,931,021
シヨエイコーポレーション	5.2	4	2,240
医薬品(5.5%)			
協和キリン	205.5	216.3	575,790
武田薬品工業	1,520.9	1,584.3	7,191,137
アステラス製薬	1,654.3	1,691.2	3,882,995
住友ファーマ	119.5	132.8	89,374
塩野義製薬	230.9	225.7	1,394,600
わかもと製薬	20.2	13	2,977
日本新薬	45	42.2	270,924
中外製薬	605.2	560.4	2,132,882
科研製薬	28.5	30.7	110,059
エーザイ	219.7	217.8	1,943,865
ロート製薬	94.6	173.4	522,801
小野薬品工業	393.8	345.4	898,040
久光製薬	44.3	39.8	146,663
持田製薬	22.5	20.6	71,173
参天製薬	345.1	326.2	421,124
扶桑薬品工業	6.4	5.7	11,428
日本ケミファ	2.1	1.4	2,576
ツムラ	56.9	56.4	160,909
日医工	57.2	—	—
キッセイ薬品工業	30.1	27.7	80,080
生化学工業	34.1	34.1	26,461
栄研化学	30.5	29.1	44,726
日水製薬	7.1	—	—
鳥居薬品	10.4	9.6	32,112
JCRファーマ	54.5	60.6	83,446
東和薬品	27.9	27.5	50,765
富士製薬工業	10.9	13.2	15,694
ゼリア新薬工業	30.9	24.8	60,784
そーせいグループ	—	61.5	186,960
第一三共	1,442.7	1,559.6	7,086,822
杏林製薬	36.2	38.8	69,296
大幸薬品	29.2	32.5	12,155
ダイト	12.2	12.5	30,112
大塚ホールディングス	379.8	409.6	2,141,388
大正製薬ホールディングス	39.2	39.8	214,124
ペプチドリーム	101.5	86.8	174,207
あすか製薬ホールディングス	19.6	18.4	23,294
サワイグループホールディングス	38.9	40.9	144,172
石油・石炭製品(0.4%)			
日本コークス工業	163.5	161.5	16,150

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)	
ニチレキ	22.2	21.2		36,676
ユシロ化学工業	9.5	9.3		9,095
ビービー・カストロール	6.9	5.4		4,800
富士石油	45.4	36.5		9,745
MORESCO	6.4	4.5		5,094
出光興産	202.8	198.8		555,248
ENEOSホールディングス	2,910.9	3,036.7	1,446,987	
コスモエネルギーホールディングス	69.6	70.8		290,634
ゴム製品(0.8%)				
横浜ゴム	98.5	101.9		310,795
TOYO TIRE	95.7	102.9		179,869
ブリヂストン	528.8	571.7	3,294,707	
住友ゴム工業	163.3	175.6		225,646
藤倉コンポジット	15.5	9.9		9,197
オカモト	9.9	9.9		39,748
フコク	8.5	9.4		11,035
ニッタ	18.8	18.2		55,055
住友理工	37.5	34.7		26,441
三ツ星ベルト	23.5	26.1		105,313
バンドー化学	31.2	28.4		37,118
ガラス・土石製品(0.7%)				
日東紡績	25.6	20.3		44,030
AGC	168.6	182.2		934,686
日本板硝子	89.3	91.3		55,693
石塚硝子	3.1	2.3		3,500
日本山村硝子	7.1	5.4		4,843
日本電気硝子	73.8	73.2		194,492
オハラ	7.8	8.7		10,692
住友大阪セメント	32.9	25.3		89,182
太平洋セメント	110	114.1		276,806
日本ヒューム	17.2	16		11,840
日本コンクリート工業	36.3	35.4		9,982
三谷セキサン	8.3	7.5		35,962
アジアパイルホールディングス	28.5	28.3		17,121
東海カーボン	153.3	150.3		183,666
日本カーボン	10	10.3		45,474
東洋炭素	11.8	11.3		57,404
ノリタケカンパニーリミテド	10.1	9		45,360
TOTO	124.1	118.2		506,487
日本碍子	197	208.3		362,858
日本特殊陶業	139.1	136.4		357,095
MARUWA	6.7	6.6		128,634
品川リフラクトリーズ	4.6	5.1		24,607
黒崎播磨	3.3	3.7		25,086
ヨータイ	12.4	12.1		17,109

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)	
東京窯業	21.4	13.4		4,381
ニッカトー	8.5	6.6		3,966
フジインコーポレーテッド	15.5	14.3		127,842
クニミネ工業	6.2	4.3		3,956
エーアンドエーマテリアル	3.3	2.7		2,859
ニチアス	42.2	45.3		123,351
ニチハ	25.5	22.5		66,060
鉄鋼(0.8%)				
日本製鉄	818.4	824.7	2,318,231	
神戸製鋼所	341.4	370.4	400,772	
中山製鋼所	28	38	29,260	
合同製鐵	9.7	9.2	28,796	
JFEホールディングス	467.6	492.2	871,686	
東京製鐵	59.1	51.8	70,033	
共英製鋼	19.8	21	38,430	
大和工業	32.6	30.4	169,328	
東京製鋼	8.1	8.8	22,624	
大阪製鐵	10.2	8.5	11,373	
淀川製鋼所	22.4	20.9	61,989	
中部鋼板	—	15.1	27,935	
丸一鋼管	57.2	56.1	174,751	
モリ工業	5	3.3	10,708	
大同特殊鋼	27.9	23.2	122,960	
日本高周波鋼業	7.3	5	1,605	
日本冶金工業	13.4	13.5	55,012	
山陽特殊製鋼	17.5	18.2	46,737	
愛知製鋼	10.8	10.6	27,369	
日立金属	206.2	—	—	
日本金属	4.8	3.1	2,752	
大太平洋金属	11.8	13.1	21,536	
新日本電工	112	117.9	32,304	
栗本鐵工所	8.2	8.8	17,617	
虹技	2.6	1.8	2,124	
三菱製鋼	12.3	11.6	13,885	
日亜鋼業	23.1	14.7	4,307	
日本精線	3	2.5	11,237	
エンビプロ・ホールディングス	12.7	9.9	5,801	
シンニッタン	23.4	15.6	3,790	
新家工業	4.3	3.1	6,727	
非鉄金属(0.7%)				
大紀アルミニウム工業所	25.4	26.3	34,584	
日本軽金属ホールディングス	48.5	49.7	67,890	
三井金属鉱業	51.7	53.6	170,448	
東邦亜鉛	10.1	10.9	18,769	
三菱マテリアル	115.9	122.9	293,116	

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)	
住友金属鉱山	221.3	213.6	923,820	
DOWAホールディングス	47.2	41.4	176,571	
古河機械金属	30.1	27.1	37,614	
大阪チタニウムテクノロジーズ	22.2	27.1	82,113	
東邦チタニウム	34.3	33.4	64,428	
UAC J	27.2	25.8	67,905	
CKサンエツ	3.8	4.5	18,765	
古河電気工業	56.7	61.4	148,588	
住友電気工業	683.7	636	1,085,016	
フジクラ	213.4	197.6	215,384	
SWCC	16.7	20.6	38,789	
東京特殊電線	2.6	—	—	
タツタ電線	34	37.6	26,921	
カナレ電気	2.9	2.3	3,045	
平河ヒューテック	10.7	10.7	15,161	
リョービ	21	19.7	30,909	
アーレスティ	20.7	16	10,064	
アサヒホールディングス	76.7	74.5	143,785	
金属製品(0.5%)				
稲葉製作所	10	9.6	13,948	
宮地エンジニアリンググループ	5.5	5.1	20,196	
トーカロ	49.4	50.6	69,777	
アルファC o	6.9	5.2	5,548	
SUMCO	308.5	350.6	735,909	
川田テクノロジーズ	3.7	4.3	21,027	
RS Technologies	6.2	12.3	39,975	
ジェイテックコーポレーション	2.5	1.9	5,196	
信和	11.9	7.9	5,782	
東洋製罐グループホールディングス	105.6	121.9	254,771	
ホッカンホールディングス	9.4	9.9	13,444	
コロナ	9.7	10.3	9,074	
横河ブリッジホールディングス	29.2	23.1	52,390	
駒井ハルテック	3.2	2.3	4,100	
高田機工	1.7	1.2	3,258	
三和ホールディングス	180.4	169.6	276,617	
文化シャッター	57.8	53	60,102	
三協立山	23.4	21.1	13,820	
アルインコ	13.1	14	13,832	
東洋シャッター	4.2	3.3	1,824	
L I X I L	301.2	268.3	504,135	
日本フィルコン	12.4	9.3	4,315	
ノーリツ	32.6	27.1	47,452	
長府製作所	19.5	18.6	43,635	
リンナイ	34.1	100.2	302,103	
ダイニチ工業	9.2	7.1	4,948	

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)	
日東精工	22.4	26.7	15,939	
三洋工業	2.3	1.6	3,065	
岡部	31.6	29.6	23,206	
ジーテクト	22	20.5	28,392	
東ブレ	31.4	32.5	47,677	
高周波熱錬	30.3	28.4	26,071	
東京製綱	11.7	10.9	11,684	
サンコール	16.4	12.7	6,337	
モリテック スチール	14.9	10.5	2,740	
パイオラックス	25.9	25.4	49,682	
エイチワン	17.6	19	12,350	
日本発條	166.2	162.9	158,827	
中央発條	9.2	13.6	9,696	
アドバネクス	2.5	1.7	1,708	
立川ブラインド工業	7.8	8.3	10,316	
三益半導体工業	14.9	14.2	44,233	
機械(5.5%)				
日本ドライケミカル	4.5	3.4	5,814	
日本製鋼所	52.2	49.7	139,706	
三浦工業	77.9	75.3	283,128	
タクマ	58.4	55.5	79,975	
ツガミ	40.3	40.2	53,224	
オークマ	19.7	18	120,780	
芝浦機械	21.7	18	81,630	
アマダ	302.3	287.8	391,120	
アイダエンジニアリング	44.8	37.2	34,075	
TAKI SAWA	5.6	3.8	4,670	
F U J I	80.4	78.4	181,809	
牧野フライス製作所	20	20	106,800	
オーエスジー	85.6	86.1	174,266	
ダイジェット工業	2.4	1.6	1,379	
旭ダイヤモンド工業	48.4	50.5	43,430	
DMG森精機	108.6	109.4	260,043	
ソディック	41.8	49.8	36,254	
ディスコ	28.2	86.8	1,774,192	
日東工器	9.7	8.8	18,066	
日進工具	15.1	15.1	17,229	
パンチ工業	16.4	12.8	6,272	
富士ダイス	9.8	6.7	4,596	
豊和工業	10.2	7.8	6,084	
ニデックオーケーケー	7.1	—	—	
東洋機械金属	12.6	9.8	6,262	
津田駒工業	3.4	—	—	
エンシュウ	4.6	3.2	2,198	
島精機製作所	28.1	28.8	50,400	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
オプトラン	24	26.7	63,439
NCホールディングス	4.9	2.9	6,403
イワキポンプ	12.3	12.1	15,730
フリュー	17.1	19	20,311
ヤマシンフィルタ	33.2	43.2	13,780
日阪製作所	21.1	17.6	15,452
やまびこ	33.7	29.5	42,834
野村マイクロ・サイエンス	6.3	6.1	38,918
平田機工	8.6	8.6	62,952
PEGASUS	19.6	20	11,120
マルマエ	7.9	7.9	14,291
タツモ	9	9.9	20,344
ナブテスコ	104.3	113.2	350,920
三井海洋開発	20.4	22.6	30,826
レオン自動機	20.5	19	28,633
SMC	56.7	58.5	4,361,175
ホソカワミクロン	12.8	12.7	35,648
ユニオンツール	7.2	7.9	25,280
オイレス工業	25.5	25.2	48,182
日精エー・エス・ビー機械	7.1	7.2	29,304
サトーホールディングス	25.2	25.7	50,115
技研製作所	17	17	34,272
日本エアータック	8.9	9.2	10,488
カワタ	5.9	4.1	3,837
日精樹脂工業	12.8	13.5	12,865
オカダアイオン	6.1	4.3	8,230
ワイエイシイホールディングス	7.6	6	21,150
小松製作所	877	844.8	2,901,888
住友重機械工業	105.9	106.7	340,906
日立建機	77.6	71.8	253,454
日工	25.3	26.9	17,027
巴工業	7.2	7.8	19,125
井関農機	16.3	17	20,502
TOWA	16.6	18.4	46,828
丸山製作所	3.5	2.4	4,372
北川鉄工所	8.1	7.2	8,676
ローツェ	9.5	9.4	108,476
タカキタ	6.3	4.1	1,804
クボタ	937.5	954.1	1,908,200
荏原実業	9	8.7	26,448
三菱化工機	6	5.9	14,496
月島ホールディングス	32.3	24.5	28,616
帝国電機製作所	12.8	12.7	29,400
新東工業	38.7	36.6	40,040
澁谷工業	15.9	17	43,724

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
アイチ コーポレーション	27.9	25.3	21,378
小森コーポレーション	47.1	41.9	41,020
鶴見製作所	14.2	13.8	33,961
住友精密工業	2.9	—	—
日本ギア工業	7.2	4.9	1,871
酒井重工業	3.3	2.3	10,269
荏原製作所	77.5	73.8	464,940
石井鐵工所	2.5	1.6	4,556
西島製作所	16.5	15.6	25,147
北越工業	17	18.2	23,023
ダイキン工業	223.1	215.2	5,756,600
オルガノ	5.6	24.8	96,596
トーヨーカネツ	7	6.9	23,839
栗田工業	100.1	100.9	596,319
椿本チエイン	25.4	25.6	87,680
大同工業	8.4	5.8	4,193
木村化工機	15.7	14	9,982
アネスト岩田	30.2	30.7	33,677
ダイフク	96.4	278.9	801,837
サムコ	5.2	4.8	27,744
加藤製作所	9.5	6.7	7,249
油研工業	3.2	2.2	4,461
タダノ	96.3	95.2	100,816
フジテック	62.7	63.2	232,576
CKD	51.7	49.9	107,584
キトー	15.6	—	—
平和	54	60	144,360
理想科学工業	15.7	16.1	36,466
SANKYO	41.8	35.4	197,178
日本金銭機械	19.8	19.9	22,626
マースグループホールディングス	12.3	10.6	31,906
フクシマガリレイ	12.4	13.3	68,495
オーイズミ	7	5.4	2,678
ダイコク電機	9	9.9	28,145
竹内製作所	29.5	32.7	126,712
アマノ	50.7	51.2	151,859
JUKI	26.9	28.1	16,157
ジャノメ	16.6	18.4	11,168
マックス	23.9	22.2	51,881
グローリー	47.2	43.3	116,693
新晃工業	18.1	18.2	37,091
大和冷機工業	28.1	27.7	38,447
セガサミーホールディングス	192	144.9	391,230
日本ピストンリング	7.1	4.8	6,777
リケン	7.5	7.1	19,887

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)	
T P R	23.2	20.7	30,760	
ツバキ・ナカシマ	42.6	44.5	39,560	
ホシザキ	56.6	116.1	603,720	
大豊工業	15.9	15.7	12,497	
日本精工	342.4	331.3	286,574	
NTN	373.2	355.4	103,066	
ジェイテクト	172	160.5	193,723	
不二越	14.5	13.3	52,734	
日本トムソン	47.3	44.3	26,358	
THK	109.3	104	321,880	
ユーシン精機	15.1	14.4	10,080	
前澤給装工業	13.3	12.7	14,325	
イーグル工業	22	20	29,980	
前澤工業	12.2	8.1	5,929	
日本ビラー工業	17.6	16.7	67,969	
キッツ	58.1	66.5	69,160	
マキタ	224.3	224.3	860,190	
三井E&S	70.2	83.9	40,859	
日立造船	157.2	147.9	124,236	
三菱重工	290.6	315.3	1,934,050	
I H I	120.9	113.6	383,968	
スター精密	27	34.1	63,732	
電気機器 (18.6%)				
日清紡ホールディングス	111.7	146.8	156,782	
イビデン	96.2	103.5	784,530	
コニカミノルタ	405.5	403.5	193,276	
ブラザー工業	226.3	241.1	502,211	
ミネベアミツミ	317	313.7	845,107	
日立製作所	930.7	876.7	7,126,694	
東芝	338.2	346.9	1,556,887	
三菱電機	1,849	1,863.3	3,413,565	
富士電機	110.6	109.6	669,656	
東洋電機製造	6.6	4.5	4,536	
安川電機	197.6	213.6	1,266,648	
シンフォニアテクノロジー	20.9	19.9	33,193	
明電舎	29.2	27.4	52,251	
オリジン	4.6	3.1	3,896	
山洋電気	7.8	7.8	58,422	
デンヨー	14.7	13.7	26,262	
PHCホールディングス	30.7	25.4	41,325	
ソシオネクスト	—	24.7	384,085	
東芝テック	20.8	26.9	111,904	
芝浦メカトロニクス	3.5	3.5	63,350	
マブチモーター	44.7	44.9	171,518	
ニデック	453.9	438.7	3,112,576	

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)	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	14	6,902	
トレックス・セミコンダクター	9.2	8.7	19,200	
東光高岳	11.4	11.1	22,521	
ダブル・スコープ	—	58.9	60,902	
ダイヘン	19	16.3	82,641	
ヤーマン	32.6	31.5	36,036	
J V Cケンウッド	164	165	82,500	
ミマキエンジニアリング	19.5	17.6	12,936	
I - P E X	9.9	10.3	13,884	
日新電機	45.3	—	—	
大崎電気工業	33.5	42.8	23,411	
オムロン	161.1	165.2	1,407,669	
日東工業	24.3	24.3	78,610	
I D E C	24	26.6	84,854	
正興電機製作所	6.7	5.7	5,648	
不二電機工業	4.6	3.2	3,574	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	60.3	59.3	146,471	
サクサホールディングス	4.5	2.9	5,475	
メルコホールディングス	5.4	4.6	14,559	
テクノメディカ	5.1	4.6	8,376	
日本電気	235	255	1,642,200	
富士通	174.1	179.6	3,234,596	
沖電気工業	75.1	81.5	66,504	
岩崎通信機	7.9	6.1	5,050	
電気興業	9.6	7.3	16,293	
サンケン電気	17.1	16.8	200,088	
ナカヨ	3.3	2.2	2,336	
アイホン	9.5	10.9	24,208	
ルネサスエレクトロニクス	1,052.4	1,176.5	2,635,948	
セイコーエプソン	224.1	231.3	498,682	
ワコム	151.3	137.6	99,347	
アルバック	38.5	42.8	253,376	
アクセル	9.1	5.5	7,507	
E I Z O	14.1	13.2	63,690	
日本信号	43.8	41.1	43,031	
京三製作所	39	37.8	16,669	
能美防災	23.9	24.6	44,895	
ホーチキ	13.7	13.7	22,289	
星和電機	10.8	6.4	3,078	
エレコム	45.1	43.4	61,411	
パナソニック ホールディングス	2,063.8	2,129.5	3,093,098	
シャープ	196.1	217.1	178,239	
アンリツ	124.6	127	152,654	
富士通ゼネラル	52.5	51.1	163,520	
ソニーグループ	1,212.1	1,262.7	16,762,342	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
TDK	280.5	285.5	1,530,280
帝国通信工業	9.4	8.4	12,919
タムラ製作所	71.3	77.4	55,108
アルプスアルパイン	163.3	161.3	201,625
池上通信機	5.7	4.4	2,675
日本電波工業	20.4	21.9	29,411
鈴木	11	10.1	9,211
メイコー	21.2	19.8	49,975
日本トリム	4.2	4.2	12,016
ローランド ディー、ジー、	11.8	10	33,350
フォスター電機	18.5	16.7	16,549
SMK	4.5	4.3	10,139
ヨコオ	13.9	14.6	25,842
ホシデン	45	42.3	73,432
ヒロセ電機	28.3	29.8	575,736
日本航空電子工業	40.7	37	95,941
TOA	20.7	20.5	17,425
マクセル	37.3	36.8	54,206
古野電気	24.2	23.8	23,347
ユニデンホールディングス	4.2	—	—
スミダコーポレーション	19.6	16.8	21,504
アイコム	6.5	6.9	19,975
リオン	7.4	7.6	13,908
本多通信工業	17.5	—	—
横河電機	182.9	197.2	521,199
新電元工業	7	6.9	23,632
アズビル	113.4	124.7	551,797
東亜ディーケーケー	10.8	7	5,691
日本光電工業	76.8	82.6	308,511
チノー	6.1	7.4	16,183
共和電業	18.5	13	4,576
日本電子材料	9.3	11.8	19,009
堀場製作所	34.1	39.7	306,881
アドバンテスト	143.8	140.6	2,484,402
小野測器	10.3	6	2,634
エスベック	15.4	14.5	29,623
キーエンス	175.3	178.6	12,260,890
日置電機	9.4	9.4	87,044
シスメックス	147.1	154	1,416,338
日本マイクロニクス	31.3	29.6	51,592
メガチップス	17.5	14.8	50,542
OBARA GROUP	8.4	9.8	40,523
澤藤電機	3.2	2	2,244
原田工業	10.5	6.6	5,273
コーセル	23	21.8	24,917

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
イリソ電子工業	16.6	16.5	70,867
オブテックグループ	32.4	32.9	64,648
千代田インテグレ	8.2	6.4	15,059
レーザーテック	81.3	81.8	1,833,547
スタンレー電気	128.7	127.2	363,283
岩崎電気	6.9	—	—
ウシオ電機	94.8	90.9	175,527
岡谷電機産業	18.2	12.1	3,315
ヘリオス テクノ ホールディング	20.6	13.3	7,647
エノモト	6.1	3.8	6,536
日本セラミック	18.6	18.3	47,342
遠藤照明	10.4	6.5	8,372
古河電池	14.8	13.5	14,634
双信電機	11.3	6.6	2,409
山一電機	13.7	15.8	32,879
図研	13	15.6	56,784
日本電子	38.4	44.8	200,256
カシオ計算機	124.7	133	156,408
ファナック	169.8	876	4,169,760
日本シイエムケイ	38.1	38.7	18,189
エンプラス	5.1	5.3	29,362
大真空	25.8	22.3	15,164
ローム	82.6	82.5	1,004,025
浜松ホトニクス	132.4	143.3	1,027,461
三井ハイテック	17.5	18.5	172,605
新光電気工業	57.1	63.2	325,480
京セラ	272.4	277.3	2,126,336
太陽誘電	88.9	87	385,410
村田製作所	541.5	541.4	4,470,339
双葉電子工業	34.9	34.8	17,400
北陸電気工業	8.2	5.5	6,567
ニチコン	55.6	36.7	49,728
日本ケミコン	19	17.9	23,771
KOA	28.3	27.2	46,076
市光工業	26.6	26.5	13,515
小糸製作所	100.1	214.8	570,938
ミツバ	32	33.5	23,383
SCREENホールディングス	31.5	30.5	436,150
キャノン電子	18.5	19.9	38,068
キャノン	961.5	979.3	3,435,384
リコー	486	447.5	530,735
象印マホービン	50.3	53.5	91,164
MUTOHホールディングス	3	2.1	3,687
東京エレクトロン	122.8	377.8	7,450,216
イノテック	—	12.1	19,456

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
輸送用機器 (7.3%)			
トヨタ紡織	71.4	75.2	172,433
芦森工業	3.6	2.6	4,453
ユニプレス	30.8	32.1	32,485
豊田自動織機	143.6	130.5	1,104,030
モリタホールディングス	31	31.4	47,131
三櫻工業	26.8	27.4	20,248
デンソー	394.5	368.2	3,232,059
東海理化電機製作所	50.9	50.4	95,155
川崎重工業	134.5	134.5	421,657
名村造船所	52.6	35.6	18,369
日本車輛製造	6.5	6.9	13,862
三菱ロジスネクスト	25.6	28.5	33,316
近畿車輛	2.9	1.9	2,705
日産自動車	2,282	2,535.6	1,330,936
いすゞ自動車	576.1	518.9	846,844
トヨタ自動車	9,148.4	9,801.4	18,901,999
日野自動車	241.6	230.1	127,245
三菱自動車工業	716.2	696.3	320,994
エフテック	12.7	9.7	7,798
レシップホールディングス	7.7	5.5	2,706
GMB	3.5	2.8	4,891
ファルテック	3.4	2.3	1,437
武蔵精密工業	43.1	43.7	76,343
日産車体	28.3	31.5	28,035
新明和工業	51.9	56.1	70,629
極東開発工業	32.5	29.5	49,265
トビー工業	14.9	14.5	28,826
ティラド	5	4.5	8,100
曙ブレーキ工業	106.2	108.9	14,701
タチエス	32.5	28.3	41,487
NOK	79.8	69.4	129,986
フタバ産業	44.8	48	22,608
KYB	18	17.2	79,550
大同メタル工業	37.1	35.1	16,988
プレス工業	88.9	79.9	46,102
ミクニ	23.2	16.1	6,423
太平洋工業	38.1	41	49,528
河西工業	23.7	—	—
アイシン	141.6	137.7	552,177
マツダ	582	590.4	717,926
今仙電機製作所	12.7	8.9	5,535
本田技研工業	1,451	1,451	5,840,275
スズキ	403.3	327.8	1,499,685
SUBARU	523.7	564.8	1,356,649

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評 価 額 (千円)
安永	8.3	6.1	5,502
ヤマハ発動機	252.5	280.5	991,567
TBK	20	14	4,620
エクセディ	29.2	29.2	63,013
豊田合成	57.3	52.1	121,184
愛三工業	30.3	29.6	30,162
盟和産業	2.7	2.1	2,024
日本ブラスト	14.4	11.1	4,983
ヨロズ	16.1	16.8	13,675
エフ・シー・シー	31.6	31.7	54,460
シマノ	73.7	73	1,587,750
テイ・エス テック	81.7	81.7	148,367
ジャムコ	11.3	7.6	10,845
精密機器 (2.6%)			
テルモ	547.5	549	2,318,427
クリエートメディック	5.8	4.5	4,077
日機装	52.1	41.6	37,065
日本エム・ディ・エム	11.2	10.6	10,260
島津製作所	237.2	217.4	954,386
JMS	15.4	16.5	8,745
長野計器	13.3	13	22,932
ブイ・テクノロジー	8.5	8.7	23,429
東京計器	12.3	13.7	17,193
愛知時計電機	7.4	7	10,948
インターアクション	9.7	8.5	12,554
オーバル	17.4	12.3	4,686
東京精密	31	39.2	239,904
マニー	72.8	71.4	118,952
ニコン	280.4	258.1	408,056
トプコン	91	94	181,044
オリンパス	962.7	1,098.8	2,370,111
理研計器	13.8	11.1	54,279
タムロン	14	13.4	47,369
HOYA	373.6	381.2	6,543,298
シード	9.1	7.1	4,061
ノーリツ鋼機	17.4	16.9	37,619
A&Dホロンホールディングス	21.8	26	38,974
朝日インテック	212.2	199.5	533,662
シチズン時計	201.5	196.3	162,340
リズム	6.1	4.3	7,301
大研医器	15.4	10.5	5,470
メニコン	61.2	61.3	152,943
シンシア	2.1	1.3	715
松風	7	8.1	17,763
セイコーグループ	27.4	27.6	71,677

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)
ニプロ	137.4	148.8	150,288	
その他製品(2.3%)				
KYORITSU	—	20.6	2,966	
中本パックス	5.4	4.2	6,808	
スノーピーク	25.2	30.6	56,854	
パラマウントベッドホールディングス	37.1	41.2	97,932	
トランザクション	11.8	11.8	19,623	
粧美堂	5.1	3.8	1,425	
ニホンフラッシュ	15.6	16.7	17,351	
前田工織	18.7	15.1	45,073	
永大産業	22.5	14.8	3,182	
アートネイチャー	16.5	18.4	13,910	
バンドイナムコホールディングス	164.5	489	1,617,123	
アイフィスジャパン	4.9	3.8	2,329	
共立印刷	28.5	—	—	
SHOEI	17.3	40.3	106,432	
フランスベッドホールディングス	24.9	22.1	24,265	
パイロットコーポレーション	29.3	27.9	129,735	
萩原工業	11.9	11.9	14,970	
フジシールインターナショナル	42.2	36.1	54,294	
タカラトミー	79.9	82.4	137,855	
広済堂ホールディングス	12	9.3	22,059	
エステールホールディングス	4.3	3.2	1,948	
タカノ	6.6	5.1	3,702	
プロネクス	15	14.8	14,459	
ホクシン	13.6	10.6	1,420	
ウッドワン	5.9	4.6	5,584	
大建工業	10.3	10.8	24,105	
凸版印刷	266.1	233.4	713,037	
大日本印刷	216	195.1	788,204	
共同印刷	5.2	5	14,045	
NISSHA	35.6	33.9	55,121	
光村印刷	1.6	1.2	1,404	
TAKARA & COMPANY	11.3	11.4	26,721	
アシックス	155.9	164.8	613,880	
ツツミ	4.8	3.1	6,578	
ローランド	13.5	13.1	52,727	
小松ウオール工業	5.9	6.6	15,958	
ヤマハ	112.5	112.5	637,875	
河合楽器製作所	5.1	4.8	15,168	
クリナップ	18	20	13,400	
ビジョン	116.9	113.7	232,175	
兼松サステック	1.2	—	—	
キングジム	15.1	15.7	14,381	
リンテック	38.4	35.8	81,445	

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)
イトーキ	35.7	36.6	31,256	
任天堂	109.2	1,127	6,659,443	
三菱鉛筆	28	25.3	43,591	
タカラスタンダード	34.1	32.9	56,818	
ココロ	87.7	85.9	168,535	
ナカバヤシ	16.1	19.2	9,273	
グローブライド	15.4	14.4	31,204	
オカムラ	58.4	53.7	94,887	
美津濃	17	17.7	64,782	
電気・ガス業(1.3%)				
東京電力ホールディングス	1,448.1	1,609	772,320	
中部電力	561.6	657.8	1,095,237	
関西電力	695.6	689.3	1,099,433	
中国電力	286.9	284.3	235,684	
北陸電力	168.5	168.5	125,364	
東北電力	433	436.4	358,720	
四国電力	165.3	152.4	144,932	
九州電力	379.8	411.5	356,359	
北海道電力	168.1	172.5	98,497	
沖縄電力	41	41.8	48,780	
電源開発	150.3	134.4	280,492	
エフオン	11.7	11.6	6,472	
イーレックス	26.1	31.7	37,501	
レノバ	37.9	47.5	77,520	
東京瓦斯	353.3	377.4	1,131,822	
大阪瓦斯	333.8	361.6	812,876	
東邦瓦斯	80.1	70.3	173,219	
北海道瓦斯	9.6	10.7	22,159	
広島ガス	34.8	37.7	13,835	
西部ガスホールディングス	19.5	16.8	33,868	
静岡ガス	47.3	40.7	49,084	
メタウォーター	20.1	22.3	39,270	
陸運業(3.0%)				
SBSホールディングス	14.3	15.9	49,608	
東武鉄道	180.7	196.1	716,745	
相鉄ホールディングス	59	59	154,580	
東急	463	500.5	941,941	
京浜急行電鉄	226.4	202.5	269,122	
小田急電鉄	258.3	270.6	569,883	
京王電鉄	90.1	94.4	478,608	
京成電鉄	120.9	115.1	620,389	
富士急行	20.9	22	115,720	
新京成電鉄	4.5	—	—	
東日本旅客鉄道	310.3	302.7	2,381,038	
西日本旅客鉄道	215	228	1,358,880	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
東海旅客鉄道	144.4	137.5	2,337,500
西武ホールディングス	239.7	215.9	321,691
鴻池運輸	28.5	30.4	47,606
西日本鉄道	48.9	47.7	115,290
ハマキョウレックス	12.9	14	49,980
サカイ引越センター	8.9	8.5	39,865
近鉄グループホールディングス	175.6	178.2	839,322
阪急阪神ホールディングス	219	237.6	1,064,448
南海電気鉄道	78.3	85.2	273,066
京阪ホールディングス	74.8	98.2	349,592
神戸電鉄	4.4	4.8	14,808
名古屋鉄道	185.1	196.9	461,533
山陽電気鉄道	13.4	13.4	30,083
アルプス物流	12.8	14.2	18,431
ヤマトホールディングス	256.8	228.2	578,943
山九	45.8	45.3	219,478
丸運	9.3	6.8	1,570
丸全昭和運輸	13.2	11	41,360
センコーグループホールディングス	88.1	94.4	88,452
トナミホールディングス	3.8	3.9	17,023
ニッコンホールディングス	58.8	57	153,672
日本石油輸送	2	1.4	3,827
福山通運	25.7	13.6	45,696
セイノーホールディングス	108.1	110.9	177,883
エスライン	5.2	3.9	3,073
神奈川中央交通	4.5	5	15,950
日立物流	35.4	—	—
AZ-COM丸和ホールディングス	33.5	43	88,623
C&Fロジホールディングス	16.5	17.1	21,426
九州旅客鉄道	129.2	126	381,150
SGホールディングス	320.6	342	716,832
NIPPON EXPRESSホールディングス	57.4	66.5	546,630
海運業(0.6%)			
日本郵船	153.6	477.1	1,437,979
商船三井	291	314.5	1,012,690
川崎汽船	56.4	134.2	443,531
NSユナイテッド海運	10	9.9	33,511
飯野海運	82.2	66.7	54,960
共栄タンカー	6.8	3.7	3,104
乾汽船	11.5	23.4	31,402
空運業(0.5%)			
日本航空	402.7	437.7	1,176,099
ANAホールディングス	446.1	484.9	1,496,401
パスコ	3.5	2.7	4,441
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	5.1	5.2	34,684

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
日新	13.8	13.5	34,411
三菱倉庫	51.1	38.3	133,092
三井倉庫ホールディングス	18.4	16.6	56,938
住友倉庫	57.1	48.1	108,369
澁澤倉庫	9.8	7.1	16,692
東陽倉庫	27.6	18.4	4,949
日本トランスシティ	35	35.9	22,186
ケイヒン	3.1	2.4	4,132
中央倉庫	10	8.6	8,952
川西倉庫	3.3	2.3	2,323
安田倉庫	13.2	12.2	11,748
ファイズホールディングス	3.9	2.5	2,912
東洋埠頭	5.3	4	5,292
上組	94.5	85.5	267,615
サンリツ	4.8	3.1	2,201
キムラユニティー	4.8	6.6	7,411
キューソー流通システム	9.1	8.3	8,092
近鉄エクスプレス	34.6	—	—
東海運	10.4	8.1	2,276
ユーアイティ	11.5	11.2	18,816
内外トランスライン	7.1	6.4	15,763
日本コンセプト	5.8	5.6	9,346
情報・通信業(8.3%)			
NECネットエスアイ	62.9	59.9	113,869
クロスキャット	10.1	10.4	11,242
システナ	271.4	301.8	93,256
デジタルアーツ	10.2	11.4	64,524
日鉄ソリューションズ	31.2	30.6	123,318
キューブシステム	9.8	10.9	12,469
WOW WORLD	2.8	—	—
コア	8.2	8.1	13,802
手間いらす	2.8	3.1	12,880
ラクーンホールディングス	16.3	15.2	11,004
ソリトンシステムズ	9.7	9.4	11,082
ソフトクリエイトホールディングス	8.3	14.9	24,048
T I S	171.1	195.9	773,805
J N Sホールディングス	8.8	7	2,709
グリー	86.6	48.4	32,815
GMOベバボ	2.1	2.7	4,541
コーエーテックモホールディングス	60.6	112.3	265,252
三菱総合研究所	8.9	8.8	45,936
電算	2.2	1.8	2,892
AGS	8.5	6.2	4,290
ファインデックス	16.3	14.6	8,468
ブレインパッド	16.3	13.7	10,042

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)	
KL a b	33.3	35.7	12,245	
ポルトゥウィンホールディングス	27.7	30.8	28,982	
ネクソン	431.4	463.7	1,362,350	
アイスタイル	50	52.5	26,670	
エムアップホールディングス	22.1	22.1	26,475	
エイチーム	12.6	10.9	7,880	
エニグモ	20.9	23.4	9,032	
テクノスジャパン	15.1	11.9	6,759	
コロブラ	62.8	69.8	47,045	
ブロードリーフ	94.7	105.1	42,040	
クロス・マーケティンググループ	7.5	8.8	6,168	
デジタルハーツホールディングス	8.7	11.4	14,945	
システム情報	14.4	14.6	10,570	
メディアドゥ	6.8	7.4	10,004	
じげん	54.3	52.6	34,558	
ブイキューブ	19.5	22	11,132	
エンカレッジ・テクノロジー	4.6	3.7	1,768	
サイバーリンクス	6.5	4.8	3,283	
フィックスターズ	19.1	20.4	28,356	
CARTA HOLDINGS	7.8	8.6	11,395	
オブティム	13.5	15	15,585	
セレス	7.3	7.4	7,969	
SHIFT	11.1	11.9	288,337	
ティーガイア	17	18.9	31,997	
セック	2.9	2	6,200	
テクマトリックス	32.2	32.8	59,728	
プロシッパ	6.4	8	11,216	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	49.4	52.5	144,847	
GMOベイメントゲートウェイ	36.8	35.8	379,480	
ザッパラス	7.4	4.5	1,543	
システムリサーチ	5.6	5.7	13,024	
インターネットイニシアティブ	50.6	100	273,000	
さくらインターネット	20.7	20.5	13,161	
ヴィンクス	5.5	4.3	6,093	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	4.3	5.5	18,370	
SRAホールディングス	9.2	9.2	28,290	
システムインテグレータ	6.4	4.7	1,983	
朝日ネット	17.7	19.6	11,877	
eBASE	23.1	25.5	19,584	
アバントグループ	20.5	22.8	31,965	
アドソル日進	6.9	7.7	12,966	
ODKソリューションズ	4.3	3.5	2,047	
フリービット	10.1	9.5	14,744	
コムチュア	21.4	23.8	50,337	
サイバーコム	3.1	2.4	3,722	

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)	
アステリア	13.9	14.4	9,504	
アイル	9.7	8.4	22,285	
マークライNZ	9.6	9.8	24,176	
メディカル・データ・ビジョ n g u m i	24.3	27.1	19,132	
g u m i	26.7	26.6	18,832	
ショーケース	4.6	4	1,184	
モバイルファクトリー	4.5	3.2	2,694	
テラスカイ	7.1	7.8	18,868	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ ー	8.5	10.5	15,802	
PC Iホールディングス	8	5.6	5,728	
パイブドHD	3.5	—	—	
アイビーシー	3.3	2.5	1,552	
ネオジャパン	5.5	6.2	5,666	
PR T I M E S	4.1	4.7	6,518	
ラクス	87.2	84.8	188,510	
ランドコンピュータ	4.5	3.6	4,262	
ダブルスタンダード	5.8	7.4	17,316	
オーブンドア	11.4	12.7	16,040	
マイネット	6.8	—	—	
アカツキ	8.5	8.6	18,748	
ベネフィットジャパン	1.5	1	1,183	
Ub i c o mホールディングス	5.1	5.7	10,636	
カナミックネットワーク	22.6	19.8	8,791	
ノムラシステムコーポレーション	10.7	15.1	1,751	
チェンジホールディングス	38.1	44	88,352	
シンクロ・フード	10.4	9.2	5,759	
オークネット	10.2	9	15,723	
キャピタル・アセット・プランニン グ	3.8	3	2,004	
セグエグループ	5.3	4.1	4,333	
エイトレッド	2.8	2.3	3,263	
マクロミル	38.3	35.4	31,364	
ビーグリー	4.6	2.5	2,817	
オロ	5.9	5.5	11,825	
ユーザローカル	5.9	6.6	14,190	
テモナ	4.2	4.1	1,045	
ニーズウェル	5.4	4	5,360	
マネーフォワード	38.7	43.2	241,920	
サインポスト	6.1	5.4	2,683	
Sun Asterisk	—	12.9	15,351	
電算システムホールディングス	7.9	8.7	28,231	
Appier Group	—	68	93,636	
ソルクシーズ	16.7	11.9	4,902	
フェイス	5.3	4.4	2,213	
プロトコーポレーション	20.4	22.6	25,108	
ハイマックス	5.2	5.8	8,056	

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
野村総合研究所	342.5	356.7	1,230,615
サイバネットシステム	13.8	15.3	13,035
CEホールディングス	9.9	7.6	4,142
日本システム技術	3.6	5.9	11,982
インタージホールディングス	22	20.4	33,007
東邦システムサイエンス	5.2	4.1	4,596
ソースネクスト	82.8	92.3	17,906
インフォコム	20.9	23.2	51,596
シンプレクス・ホールディングス	30.1	30.7	73,680
HEROZ	5.7	6.2	8,884
ラクスル	22.1	43.1	55,383
メルカリ	—	107.9	301,796
I P S	5.3	5.9	13,334
F I G	21.3	17	4,709
システムサポート	7	7.1	13,021
イーソル	12	11.7	10,787
アルテリア・ネットワークス	20.2	16.8	32,995
東海ソフト	3.2	2.3	2,341
ウイングアーク1st	14.6	18.6	42,222
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4.4	4.9	7,296
サーバーワークス	3.3	3.7	7,359
東名	1.7	1.2	2,306
ヴィッツ	1.9	1.6	2,097
トビラシステムズ	4.1	3.7	3,592
S a n s a n	62.8	58.7	95,622
L i n k - U	3.7	3.5	3,612
ギフト	16.4	19.6	40,689
メドレー	—	24.1	112,426
ベース	3.3	6.1	33,672
J M D C	23.8	29.4	159,348
フォーカスシステムズ	12.3	13.3	13,685
クレスコ	13.9	13.9	26,757
フジ・メディア・ホールディングス	173.7	172.1	233,195
オービック	59.8	59.8	1,332,942
ジャストシステム	27.1	25.8	111,198
T D C ソフト	15.8	15.3	22,506
Zホールディングス	2,738.5	2,548.4	891,430
トレンドマイクロ	95.9	103.4	677,270
I Dホールディングス	12.2	12.3	13,751
日本オラクル	30.8	34.3	366,667
アルファシステムズ	5.1	5.7	19,950
フューチャー	40.2	44.7	77,733
C A C H o l d i n g s	10.4	11.1	18,847
S B テクノロジー	8.3	7.7	18,657
トーセ	5.1	4.3	3,121

銘柄	当 期 末		
	当期首(前期末) 株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
オービックビジネスコンサルタント	18.2	35.3	183,207
伊藤忠テクノソリューションズ	86.6	96.2	344,877
アイティフォー	23.3	23.8	23,466
東計電算	2.3	2.5	15,150
エックスネット	3.2	2.2	2,200
大塚商会	102.8	101.5	525,770
サイボウズ	25.6	24.8	60,611
電通国際情報サービス	24.9	21.8	108,673
A C C E S S	21.8	21.5	18,748
デジタルガレージ	31.5	31.8	128,949
EMシステムズ	31.6	30.2	24,522
ウエザーニューズ	6	5.6	38,192
C I J	15	30.2	15,613
ビジネスエンジニアリング	4.4	3	10,020
日本エンタープライズ	20.6	16.2	2,203
WOWOW	8.4	13.7	15,083
スカラ	16.2	16.9	12,894
インテリジェント ウェイブ	9.8	7.7	5,805
I M A G I C A G R O U P	14.6	15.4	8,747
ネットワンシステムズ	70.1	66.8	212,758
システムソフト	53	65.7	4,927
アルゴグラフィックス	14.8	16.5	66,082
マーベラス	30.2	29.4	20,109
エイベックス	32.9	30.6	44,400
B I P R O G Y	59.4	66	219,780
兼松エレクトロニクス	10.4	—	—
都築電気	9	9.6	17,347
T B S ホールディングス	99.8	91.7	204,857
日本テレビホールディングス	158.7	158.7	202,025
朝日放送グループホールディングス	16.6	17.1	11,063
テレビ朝日ホールディングス	45.8	43.6	66,708
スカパーJSATホールディングス	161.2	159.3	84,747
テレビ東京ホールディングス	12.3	13	36,829
日本BS放送	6.6	5.3	4,780
ビジョン	31.4	23.7	39,768
スマートバリュー	4.7	4	1,568
USEN-NEXT HOLDINGS	15.7	20.1	64,923
ワイヤレスゲート	8.5	7.2	1,612
コネクシオ	13.6	—	—
クロップス	3.7	2.5	2,512
日本電信電話	2,080.9	2,294	9,334,286
K D D I	1,384.3	1,383.4	6,027,473
ソフトバンク	2,876	2,876.1	4,344,349
光通信	21.9	21.1	424,743
エムティーアイ	16.4	12.7	7,861

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
GMOインターネットグループ	66.6	66.2	172,848
ファイバーゲート	8.9	9.8	13,347
アйдママーケティングコミュニケーション	4.8	4	1,096
KADOKAWA	102.8	94.7	297,831
学研ホールディングス	27.1	30.1	26,668
ゼンリン	31.2	30.9	27,655
昭文社ホールディングス	8.2	6.8	2,006
インプレスホールディングス	15.7	13.4	2,720
アイネット	9.3	11	16,214
松竹	11.5	10.3	123,497
東宝	112.1	112.1	623,276
東映	5.6	4.9	86,191
エヌ・ティ・ティ・データ	505.6	561.8	1,124,161
ピー・シー・エー	11.3	10.5	13,146
ビジネスブレイン太田昭和	6.1	7.8	16,567
D T S	35.4	38.2	134,655
スクウェア・エニックス・ホールディングス	88.4	90	575,100
シーイーシー	20.5	25.3	37,115
カプコン	179.1	177.9	965,997
アイ・エス・ピー	9.1	9.3	14,070
ジャステック	11.2	11.2	14,324
S C S K	131.5	146.2	327,488
NSW	7.2	7.1	17,153
アイネス	16	12.7	18,808
TKC	30	28.6	103,532
富士ソフト	18.9	20.3	182,497
NSD	59.6	64	172,224
コナミグループ	69	76.7	571,415
福井コンピュータホールディングス	8.8	12.5	34,737
J B C Cホールディングス	12.9	13.2	30,069
ミログ情報サービス	16.9	16.4	24,649
ソフトバンクグループ	1,138.6	883.2	4,894,694
卸売業(6.5%)			
高千穂交易	6.9	5.2	13,624
オルパヘルスケアホールディングス	3.1	2.2	4,056
伊藤忠食品	4.1	4.3	22,274
エレマテック	15.3	17	29,903
あらた	14.5	14.4	67,032
トーマンデバイス	2.9	2.7	16,065
東京エレクトロン デバイス	5.7	7	72,100
円谷フィールズホールディングス	16.7	32.4	70,761
双日	200.5	200.5	587,665
アルフレッサ ホールディングス	202.4	189.6	407,450
横浜冷凍	48.7	51.5	56,083
ラサ商事	8.9	6.7	9,085

銘柄	当 期 末		評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
アルコニックス	24.1	24.9	33,390
神戸物産	137	146.1	571,981
ハイパー	4.8	2.8	1,248
あい ホールディングス	27.2	30.2	68,584
ディーブイエックス	6.5	4.1	3,956
ダイワボウホールディングス	84.9	77.2	208,903
マクニカホールディングス	45.5	44.7	230,205
ラクト・ジャパン	6.6	7.3	14,490
グリムス	8.5	7.9	20,437
バイタルケエスケー・ホールディングス	31.3	27.6	26,192
八洲電機	13.8	15.3	19,553
メディアスホールディングス	10.9	12.1	9,571
レスタールホールディングス	18.1	18.1	42,553
ジューテックホールディングス	4	3.4	3,852
大光	8.1	6.2	3,782
OCHIホールディングス	4.7	3.4	4,154
TOKAIホールディングス	92.4	93.3	81,264
黒谷	5.2	4.1	2,427
C o m i n i x	3.4	2.9	2,262
三洋貿易	18.1	21.3	28,307
ビューティガレージ	3.1	3	11,010
ウイン・パートナーズ	13.8	13.8	13,731
ミタチ産業	4.8	3.7	5,094
シップヘルスケアホールディングス	57	67.9	163,027
明治電機工業	5.9	7	9,212
デリカフーズホールディングス	7.5	5.8	3,451
スターティアホールディングス	4.4	2.9	3,407
コマダホールディングス	41.6	46.3	123,945
ピーバンドットコム	2.7	2.1	1,003
アセンテック	6.6	6.4	4,019
富士興産	4.8	3.3	4,573
協栄産業	2	1.4	2,851
フルサト・マルカホールディングス	17.4	18.8	47,733
ヤマエグループホールディングス	11.4	10.7	27,038
小野建	17.5	18.6	28,439
南陽	3.7	2.8	5,980
佐島電機	11.9	9.2	15,557
エコートレーディング	4.1	2.9	2,221
伯東	11.6	10.8	55,404
コンドートテック	14.3	14.5	15,573
中山福	10.1	7.9	2,654
ナガイレーベン	23.8	23.9	50,930
三菱食品	18.3	17.4	65,337
松田産業	13.9	14.4	30,528
第一興商	36.2	73.1	179,021

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)
メディアパルホールディングス	186.1	180.6	404,363	
SPK	7.6	8.4	14,632	
萩原電気ホールディングス	6.7	7.2	23,220	
アズワン	27.3	26.9	144,184	
スズデン	6.2	6.6	14,599	
尾家産業	4.7	3.5	3,948	
シモジマ	11.7	13	13,884	
ドウシシャ	18	20	44,400	
小津産業	4.2	3.3	5,926	
高速	10.5	9.8	19,198	
たけびし	6.7	7.2	11,858	
リックス	4	3	8,148	
丸文	15.8	16.9	20,212	
ハビネット	15	16.1	32,135	
橋本総業ホールディングス	3.5	7.5	8,317	
日本ライフライン	56.5	55.4	58,170	
タカショー	14.7	16.5	11,187	
IDOM	57.9	57.1	48,592	
進和	11.3	11.6	24,742	
エスケイジャパン	4.7	3.6	1,922	
ダイトロン	7.6	7.5	22,005	
シークス	25.3	26.9	39,596	
田中商事	5.9	4.2	2,654	
オーハシテクニカ	9.7	9.2	14,600	
白銅	6.2	6.8	15,721	
ダイコー通産	2.3	1.5	1,951	
伊藤忠商事	1,206.1	1,163.7	5,754,496	
丸紅	1,740.8	1,473.8	3,107,507	
高島	2.7	2.3	7,739	
長瀬産業	92	86.6	204,722	
蝶理	10.7	10.1	27,037	
豊田通商	177.3	165.4	1,050,290	
三共生興	24.5	27.2	15,177	
兼松	67.7	73.3	137,657	
ツカモトコーポレーション	3.2	2.1	2,738	
三井物産	1,414.2	1,340.3	6,212,290	
日本紙パルプ商事	9.3	10	49,450	
カメイ	21.1	20.1	28,903	
東都水産	1	0.8	5,304	
OUGホールディングス	2.8	2.2	5,350	
スターゼン	13.3	14.4	33,451	
山善	72.6	50.9	53,343	
椿本興業	3.4	3	11,865	
住友商事	1,152.8	1,169.6	3,224,002	
内田洋行	7.7	7.7	40,502	

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)
三菱商事	1,309.2	1,168.1	6,901,134	
第一実業	7.8	6.7	38,525	
キャノンマーケティングジャパン	47.3	43.8	152,205	
西華産業	8.7	7.4	14,807	
佐藤商事	14	13.1	18,523	
菱洋エレクトロ	11.3	16.1	43,582	
東京産業	16.1	17.3	14,687	
ユアサ商事	16.2	17	74,885	
神鋼商事	4.3	4.7	25,662	
トルク	10.3	8	1,704	
阪和興業	34.8	33.9	146,448	
正栄食品工業	12.3	12.6	50,211	
カナデン	15.5	12.6	15,346	
RYODEN	15.1	15.3	30,324	
岩谷産業	43.4	43	289,820	
ナイス	6.1	4	5,620	
ニチモウ	2.4	1.8	6,327	
極東貿易	5.5	11.3	17,774	
アステナホールディングス	25.4	32.7	14,845	
三愛オブリ	44.1	50	73,000	
稲畑産業	38.2	38.1	113,347	
G S I クレオス	9.1	11	19,910	
明和産業	17.6	25.2	16,833	
クワザワホールディングス	7.1	4.8	2,126	
ワキタ	36.5	34.8	47,989	
東邦ホールディングス	54.9	47	123,610	
サンゲツ	47.4	47.4	120,396	
ミツロコグループホールディングス	23.7	24.1	33,258	
シナネンホールディングス	6.5	6.1	22,997	
伊藤忠エネクス	42.2	46.8	56,160	
サンリオ	55.3	53.5	305,485	
サンワテクノス	10.3	9.7	21,825	
リョーサン	20	20	80,600	
新光商事	26.3	25.4	28,549	
トーホー	7.8	8.1	19,739	
三信電気	8.2	7.6	15,838	
東陽テクニカ	18.8	19.2	26,246	
モスフードサービス	25	27.8	87,292	
加賀電子	16.1	15.3	80,172	
ソーダニッカ	16.9	10.8	8,413	
立花エレテック	13.2	13.8	30,594	
フォーバル	7.3	7.4	7,969	
PALTA C	26.7	29.7	145,233	
三谷産業	29.8	33.1	10,327	
西本Wismettacホールディングス	4.3	4.8	20,616	

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)
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.7	1.2	2,544	
コア商事ホールディングス	12	10.6	7,377	
KPPグループホールディングス	36.8	44.1	25,798	
ヤマタネ	8.4	8.4	13,750	
丸紅建材リース	1.7	1.3	2,811	
日鉄物産	12.3	—	—	
泉州電業	4.9	9.5	30,590	
トラスコ中山	39.7	39.7	86,387	
オートバックスセブン	60.8	65.7	99,666	
モリト	13.9	13.6	14,511	
加藤産業	22.9	23.4	90,324	
北恵	4.9	3.3	2,442	
イノテック	11.6	—	—	
イエローハット	31	33.3	61,904	
J Kホールディングス	14.1	14.5	14,297	
日伝	13.9	11.2	25,009	
北沢産業	11.2	7.9	2,772	
杉本商事	8.9	8.4	16,800	
因幡電機産業	48.6	49	150,675	
東テク	5.9	6.3	26,239	
ミスミグループ本社	239.3	285	900,600	
アルテック	12.2	8.3	2,066	
タキヒヨー	5.4	3.6	3,506	
蔵王産業	3.7	2.4	5,491	
スズケン	70.4	55.3	195,485	
ジェコス	13.2	11.3	9,571	
グローセル	21.3	17.8	7,137	
小売業(4.5%)				
ローソン	42.2	46.9	292,656	
サンエー	13.5	14.5	67,207	
カワチ薬品	14.9	15	32,400	
エービーシー・マート	29.8	27.6	211,692	
ハードオフコーポレーション	8.8	6.3	8,416	
アスクル	43.4	39.3	71,408	
ゲオホールディングス	24.1	18.8	31,245	
アダストリア	20.7	23	63,618	
くら寿司	20	22.3	69,241	
キャンドウ	7.2	6.9	16,629	
I Kホールディングス	6.7	6	2,316	
バルグループホールディングス	16.9	18.7	63,393	
エディオン	87.8	75.1	105,215	
サーラコーポレーション	39.2	40.3	30,950	
ワッツ	9.7	7.9	5,553	
ハローズ	8.8	8.7	28,231	
フジオフードグループ本社	14.8	—	—	

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)
あみやき亭	4.6	4.7	16,144	
大黒天物産	6.2	5.9	30,680	
ハニーズホールディングス	16	15.2	23,316	
ファーマライズホールディングス	4.8	4	2,548	
アルペン	14.3	15.8	30,794	
ハブ	6.9	5.5	4,136	
クオールホールディングス	23.7	26.3	42,027	
ジンズホールディングス	11.1	11.4	34,884	
ビックカメラ	113.3	101	106,757	
DCMホールディングス	113.5	115.7	146,591	
MonotaRO	241.1	268	499,016	
東京一番フーズ	5.1	4.4	2,186	
きちりホールディングス	5.1	3.5	2,957	
アークランドサービスホールディングス	14.1	15.6	45,474	
J・フロント リテイリング	217.1	235.2	326,928	
ドール・日レスホールディングス	31.3	33.7	69,422	
マツキヨココカラ&カンパニー	113.6	114.6	845,748	
ブロンコビリー	10.4	10.3	29,190	
ZOZO	131.2	125	354,875	
トレジャー・ファクトリー	5.9	9.4	15,265	
物語コーポレーション	9.5	31.7	99,696	
三越伊勢丹ホールディングス	302.2	318.3	459,625	
Hamee	7.1	7.1	6,915	
マーケットエンタープライズ	2.3	1.9	2,316	
ウエルシアホールディングス	100.9	98.1	294,790	
クリエイトSDホールディングス	28.2	31.4	108,644	
丸善CHIホールディングス	22.2	18.8	6,561	
ミサワ	4.4	3.5	2,156	
ティーライフ	2.8	2.4	3,302	
チムニー	5.8	4.5	5,593	
シュッピン	16.1	14.6	14,235	
オイシックス・ラ・大地	27.6	25.6	58,316	
ネクステージ	38.9	43.3	105,219	
ジョイフル本田	57.5	56.4	97,741	
鳥貴族ホールディングス	6.7	7.2	16,106	
ホットランド	14.5	14.8	25,855	
すかいらくホールディングス	237.1	258.4	483,466	
SFPホールディングス	9.3	10.3	19,570	
綿半ホールディングス	13.8	15	20,220	
ヨシックスホールディングス	3.9	3.1	6,900	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	55.7	62	68,696	
ゴルフダイジェスト・オンライン	10.2	9.2	7,452	
BENOS	9.8	8.3	15,620	
あさひ	16	16.2	20,509	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
日本調剤	11.9	13.3	14,816
コスモス薬品	19.3	18.7	252,263
トーエル	9	7.2	5,400
セブン&アイ・ホールディングス	674.6	650.9	4,003,035
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	119.1	142.1	143,947
ツルハホールディングス	41.6	39.7	386,281
サンマルクホールディングス	15.3	15.5	29,357
フェリシモ	4.5	3.8	3,807
トリドールホールディングス	47.6	47.1	142,477
TOKYO BASE	18.5	20.5	9,471
ウイルプラスホールディングス	4	2.8	3,158
JMホールディングス	14.1	14.5	28,840
サツドラホールディングス	9.1	7.3	5,672
アレンザホールディングス	13.6	14.6	14,483
串カツ田中ホールディングス	5.3	5.4	8,974
パロックジャパンリミテッド	13.7	12.9	10,784
クスリのアオキホールディングス	17.7	16.9	119,652
力の源ホールディングス	9.7	8.4	13,288
FOOD & LIFE COMPANIES	102.4	100.9	328,429
メディカルシステムネットワーク	18	17.7	6,655
はるやまホールディングス	9.7	7.2	3,520
ノジマ	30.9	62	87,606
カッパ・クリエイト	26.7	29.7	44,579
ライトオン	14.2	11.1	6,282
良品計画	219.5	206.5	294,469
バリミキホールディングス	24.9	19.9	6,387
アドヴァングループ	17.7	18.5	17,667
アルビス	5.9	6.4	15,232
コナカ	21.2	16	5,760
ハウス オブ ローゼ	2.5	2.1	3,364
G-7ホールディングス	21.4	23.9	31,691
イオン北海道	28.1	28.1	23,098
コジマ	33.3	32.1	17,815
ヒマラヤ	6.5	5.2	4,877
コーナン商事	27.2	25.6	91,264
エコス	6.7	7.3	13,680
ワタミ	23.1	22.8	20,565
マルシェ	6.2	—	—
パン・パシフィック・インター ナショナルホールディングス	381.2	381.3	939,141
西松屋チェーン	39.3	42.1	70,980
ゼンショーホールディングス	93.1	103.5	578,565
幸楽苑ホールディングス	11.4	12.3	12,878
ハークスレイ	8.6	5.9	3,652
サイゼリヤ	28.4	28.1	97,788

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
V Tホールディングス	72.5	72.7	37,440
魚力	5.4	6.1	13,072
フジ・コーポレーション	10.4	11	14,729
ユナイテッドアローズ	20.1	20.4	49,429
ハイデイ日高	27.7	28.2	65,142
YU-WA Creation Holdings	12.8	11.4	2,234
コロワイド	78.3	87	176,697
ピーシーデポコーポレーション	23.2	22.2	10,633
壺番屋	13.5	15	79,350
P L A N T	5.1	4.1	2,898
スギホールディングス	38.1	38.1	225,171
薬王堂ホールディングス	9.7	10.7	27,616
スクロール	29.8	28.6	25,253
ヨンドシーホールディングス	16.8	16.5	29,584
木曾路	25.7	28.8	66,844
S R Sホールディングス	27.5	31.7	30,146
千趣会	35.3	36	15,012
リテールパートナーズ	27.4	28.4	44,701
ケーヨー	35.4	30.6	24,480
上新電機	19.8	17.1	32,763
日本瓦斯	92.8	101.4	196,918
ロイヤルホールディングス	31.4	36.6	100,906
いなげや	20.6	18.5	27,084
チヨダ	17.5	18.7	15,801
ライフコーポレーション	15.9	16.6	48,687
リンガーハット	22.4	24.4	58,608
M r M a x HD	24.4	27.3	16,707
AOKIホールディングス	37.4	35.7	29,702
オークワ	28.3	30.4	26,873
コメリ	29.5	29.2	87,483
青山商事	37.7	40.8	49,898
しまむら	22.2	22.2	280,164
はせがわ	11.4	8.4	2,889
高島屋	131.9	142.5	273,030
松屋	34.4	32.2	36,450
エイチ・ツー・オー リテイリング	85.5	92	137,172
近鉄百貨店	6.2	8.3	20,700
丸井グループ	142.2	139.4	332,329
アクシアル リテイリング	13.5	13	42,835
イオン	663.6	640.3	1,819,092
イズミ	31.6	28.8	95,184
平和堂	29.6	31.6	66,518
フジ	45.3	29.1	52,176
ヤオコー	21.7	21.4	150,656
ゼビオホールディングス	26.3	26	29,822

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)
ケーズホールディングス	167	133.9	165,500			
O l y m p i c グループ	9.4	6.4	3,372			
日産東京販売ホールディングス	29.5	20.2	6,726			
シルバーライフ	4.1	4	5,124			
Genky DrugStores	8.5	8.4	35,364			
ナルミヤ・インターナショナル	4.6	2.9	2,737			
ブックオフグループホールディングス	11.1	10	13,210			
ギフトホールディングス	3.2	4.1	20,541			
アインホールディングス	24.2	26.1	152,946			
元気寿司	5.5	5.5	17,627			
ヤマダホールディングス	694.4	775.6	324,976			
アークランズ	30.1	28	43,568			
ニトリホールディングス	75.7	76.4	1,335,472			
グルメ杵屋	15.5	15.8	16,542			
愛眼	13.9	10.8	1,879			
ケーユーホールディングス	10.3	11.4	14,318			
吉野家ホールディングス	66.7	74.1	191,474			
松屋フーズホールディングス	9.3	9	36,945			
サガミホールディングス	28.2	30.7	39,234			
関西フードマーケット	16.9	17.4	27,231			
王将フードサービス	12.6	12.5	78,625			
ブレナス	21.5	—	—			
ミニストップ	14.3	13.8	19,651			
アークス	34.8	34.8	85,120			
パローホールディングス	40.2	36.3	71,474			
ベルク	8.5	9.5	56,620			
大庄	10.5	8.4	9,265			
ファーストリテイリング	25.5	85	2,809,250			
サンドラッグ	71.8	71.8	292,585			
サクスパー ホールディングス	18.5	18.5	19,351			
ヤマザワ	4.3	3.1	3,896			
やまや	3.9	3.2	8,451			
ベルーナ	41.4	46.2	32,386			
銀行業(5.9%)						
いざぎんホールディングス	—	209.2	157,109			
いずおかフィナンシャルグループ	—	397.3	407,629			
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	—	148	128,908			
島根銀行	6.1	4.7	2,237			
じもとホールディングス	12.9	12.1	4,416			
めがきフィナンシャルグループ	828.8	872.3	285,242			
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22.7	22.5	68,062			
九州フィナンシャルグループ	352.6	309.3	162,382			
ゆうちょ銀行	450.5	492.6	517,230			
富山第一銀行	43.5	58.4	37,726			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	993.2	968.9	529,019			

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)
西日本フィナンシャルホールディングス	106.3	109.1	117,718			
三十三フィナンシャルグループ	16.1	15.7	23,879			
第四北越フィナンシャルグループ	28.3	27.6	85,698			
ひろぎんホールディングス	256.5	229.4	174,802			
おきなわフィナンシャルグループ	16.5	16.7	36,172			
十六フィナンシャルグループ	23.4	22.8	69,996			
北國フィナンシャルホールディングス	16.8	19.8	94,545			
プロクレアホールディングス	19.7	21.5	44,741			
あいちフィナンシャルグループ	—	24.6	51,635			
S B I 新生銀行	124.5	41.1	115,367			
あおぞら銀行	106.6	110.5	282,327			
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,437.2	11,009.9	10,217,187			
りそなホールディングス	2,067.5	2,222	1,410,747			
三井住友トラスト・ホールディングス	330.7	319.5	1,605,487			
三井住友フィナンシャルグループ	1,266	1,284.7	7,257,270			
千葉銀行	571.6	489.9	433,561			
群馬銀行	324.1	341.1	173,619			
武蔵野銀行	25.7	22.6	50,420			
千葉興業銀行	42.4	32	15,360			
筑波銀行	74.4	77.1	14,957			
七十七銀行	53.7	56.3	138,498			
秋田銀行	11.7	11.8	19,434			
山形銀行	18.5	19.5	21,508			
岩手銀行	11.9	12	24,648			
東邦銀行	144.1	139.1	31,575			
東北銀行	8.8	6.7	6,666			
ふくおかフィナンシャルグループ	145.5	140.3	367,866			
静岡銀行	417.2	—	—			
スルガ銀行	167.3	155	79,825			
八十二銀行	389	360.6	212,393			
山梨中央銀行	19.7	18.1	20,434			
大垣共立銀行	34.3	33.5	60,601			
福井銀行	15.6	15.7	22,278			
清水銀行	7.2	7	9,912			
富山銀行	3.1	2.1	3,446			
滋賀銀行	32.7	29.2	79,657			
南都銀行	27.1	26.5	63,096			
百五銀行	167.9	165.4	65,333			
京都銀行	62.3	55.7	368,177			
紀陽銀行	59.3	62.9	95,167			
ほくほくフィナンシャルグループ	110.9	111.7	121,194			
山陰合同銀行	108.5	110	85,360			
中国銀行	144.7	—	—			
鳥取銀行	6.1	4.4	5,073			
伊予銀行	227	—	—			

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)
百十四銀行	18.5	16	28,560			
四国銀行	26.4	27.9	23,659			
阿波銀行	26.6	24.7	50,091			
大分銀行	10.5	10.6	21,942			
宮崎銀行	10.9	11.5	26,197			
佐賀銀行	10.3	10.3	16,675			
琉球銀行	41.4	40.3	36,673			
セブン銀行	566.8	629.8	173,824			
みずほフィナンシャルグループ	2,339.1	2,542.5	5,275,687			
高知銀行	6.3	4.7	3,125			
山口フィナンシャルグループ	201.2	194.1	177,019			
長野銀行	6	4.2	6,480			
名古屋銀行	12.4	11.6	40,310			
北洋銀行	255.7	266.4	70,596			
愛知銀行	6.2	—	—			
中京銀行	6.2	—	—			
大光銀行	6	4.1	4,259			
愛媛銀行	25.5	23.7	19,054			
トマト銀行	6.1	4.5	4,531			
京葉銀行	79.6	80.5	42,906			
栃木銀行	87.8	80.5	19,239			
北日本銀行	5.7	6.2	12,108			
東和銀行	32	32.3	16,860			
福島銀行	20.7	14.4	3,024			
大東銀行	8.6	5.3	3,291			
トモニホールディングス	141	142.1	52,292			
フィデアホールディングス	17.4	18.2	23,896			
池田泉州ホールディングス	208.2	225.1	51,547			
証券、商品先物取引業(0.7%)						
F P G	64.5	59.6	66,454			
ジャパンインベストメントアドバイザー	15	14.5	15,529			
マチュアホールディングス	9.8	8.3	5,718			
S B I ホールディングス	235.7	254.6	685,128			
ジャフコ グループ	73.1	58.8	103,605			
大和証券グループ本社	1,361.6	1,257.4	798,449			
野村ホールディングス	2,914.3	3,238	1,615,438			
岡三証券グループ	142.5	154.7	68,686			
丸三証券	57.2	58.9	23,854			
東洋証券	60.7	59	15,812			
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	199	191.9	67,932			
光世証券	4.5	3.5	1,459			
水戸証券	49	47.8	13,862			
いちよし証券	34.4	32.7	19,162			
松井証券	93.7	104.1	82,134			
マネックスグループ	159.5	189.8	91,863			

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)
極東証券	23.3	22.2	13,364			
岩井コスモホールディングス	18.2	20.2	27,148			
アイザワ証券グループ	28	25.6	19,123			
マネーパートナーズグループ	21.4	14.9	3,799			
スパークス・グループ	89.1	19.7	28,249			
保険業(2.3%)						
かんぽ生命保険	192.1	213.4	458,383			
S O M P Oホールディングス	285.5	301.7	1,768,263			
アニコム ホールディングス	58.6	59.7	36,834			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	404.2	357.8	1,729,963			
第一生命ホールディングス	908.7	858.9	2,103,446			
東京海上ホールディングス	558.3	1,737.7	5,405,984			
T & Dホールディングス	448.2	471.8	905,856			
アドバンスクリエイト	9.1	10.2	11,556			
その他金融業(1.1%)						
全国保証	45.6	46	232,300			
あんしん保証	9.2	7.9	2,464			
イントラスト	8.9	5.6	5,129			
日本モーゲージサービス	11.1	8.2	4,370			
C a s a	7.3	5.7	4,953			
アルヒ	28.7	22	21,692			
プレミアグループ	9.8	29.8	46,368			
ネットプロテクションズホールディングス	58.7	59.1	21,926			
クレディセゾン	115.4	111.6	217,062			
芙蓉総合リース	17.7	16.2	164,106			
みずほリース	25.7	26.3	113,090			
東京センチュリー	32.1	32.9	164,500			
日本証券金融	75.5	70.8	78,163			
アイフル	321.6	292.2	98,179			
リコーリース	17	16.8	65,604			
イオンフィナンシャルサービス	104.2	101.2	123,767			
アコム	377.9	314.8	102,310			
ジャックス	19.8	18.8	86,856			
オリエン特コーポレーション	519.9	46.2	49,896			
オリックス	1,134	1,154.1	2,758,299			
三菱HCキャピタル	647	685.9	526,085			
九州リースサービス	9.4	6.8	5,378			
日本取引所グループ	455.4	494.1	1,121,112			
イー・ギャランティ	28.4	28.7	59,236			
アサックス	10.7	6.7	4,140			
NECキャピタルソリューション	8	8.7	24,647			
不動産業(1.8%)						
大東建託	—	64.5	870,105			
いちご	218.4	209.6	52,400			

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)	
日本駐車場開発	206.5	193.5	44,505	
スター・マイカ・ホールディングス	11.6	18.6	11,941	
SREホールディングス	5.9	9.1	33,852	
ADワークスグループ	35.9	34.4	6,364	
ヒューリック	430.5	411.5	491,331	
三栄建築設計	8.8	9.7	14,608	
野村不動産ホールディングス	99.3	110.4	376,464	
三重交通グループホールディングス	42.4	40.8	22,358	
サムティ	29.8	28.8	62,553	
ディア・ライフ	27.2	32.4	24,008	
地主	12.9	14.3	27,298	
プレサンスコーポレーション	23.4	28.7	53,382	
ハウスコム	4.8	3.9	3,658	
JPMC	10.9	10.4	11,876	
サンセイランディック	7.7	6	5,268	
フージャースホールディングス	24.4	27.1	25,663	
オープンハウスグループ	61	64.7	343,557	
東急不動産ホールディングス	536	530.9	397,113	
飯田グループホールディングス	160.1	154.7	365,710	
イムグラント	4.1	3.3	4,847	
ムゲンエステート	15.4	11.8	7,634	
And Doホールディングス	9.4	10.4	11,970	
シーアールイー	7.7	11.1	14,452	
ケイアイスター不動産	8.9	8.9	41,518	
グッドコムアセット	9.8	18.4	15,474	
ジェイ・エス・ビー	4.4	4.8	21,696	
ロードスターキャピタル	6.1	11.2	16,844	
テンポイノベーション	7.4	5.8	6,153	
フェイスネットワーク	3.8	5.1	6,293	
パーク24	113.9	137.8	288,691	
パラカ	6.4	7.1	13,511	
三井不動産	788.5	760.4	2,058,783	
三菱地所	1,143.5	1,061.9	1,714,437	
平和不動産	31.6	29	108,750	
東京建物	172.8	168.6	295,218	
京阪神ビルディング	27.9	31.1	36,666	
住友不動産	362.8	318.4	1,050,720	
テーオーシー	33.5	34.6	21,452	
東京楽天地	3.3	3.3	14,041	
スターツコーポレーション	26.7	25.9	69,852	
フジ住宅	24.9	27.2	18,822	
空港施設	22.5	24.4	13,395	
明和地所	12	8.6	7,679	
ゴールドクレスト	16.1	17.8	30,544	
エスリード	8.5	9	22,059	

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)	
日神グループホールディングス	35	32	14,816	
日本エスコン	35.5	39.5	31,442	
MIRARTHホールディングス	80	88.8	37,384	
AVANTIA	11.4	9.8	8,085	
イオンモール	96.8	92.1	166,240	
毎日コムネット	9.1	7.3	5,825	
ファースト住建	8.7	7.2	7,725	
カチタス	47.9	47.9	122,288	
トーセイ	27.9	30.3	50,964	
穴吹興産	5	3.5	7,805	
サンフロンティア不動産	28.1	30.6	40,453	
FJネクストホールディングス	20.4	20.3	20,503	
インテリックス	4.3	3.3	1,834	
ランドビジネス	7	5	1,215	
サンネクスタグループ	7.6	5.8	5,823	
グランディハウス	16.4	14.7	8,011	
日本空港ビルディング	65.6	62.4	414,336	
サービス業(5.0%)				
明豊ファシリティワークス	9	7.6	5,669	
日本工営	11.9	11.1	42,402	
LIFULL	58.5	64.1	15,063	
MIXI	42.5	41.9	117,320	
ジェイエイシーリクルートメント	15.1	16.7	37,207	
日本M&Aセンターホールディングス	303.5	315.2	313,939	
メンバーズ	5.2	5.6	8,002	
中広	3.9	2.8	1,125	
UTグループ	26.8	27.1	73,657	
アイティメディア	9	7.2	9,028	
E・Jホールディングス	10.9	10.9	17,276	
オープンアップグループ	60.5	55.2	107,529	
コシダカホールディングス	49.9	55.2	63,038	
アルトナー	4.9	3.7	5,520	
パソナグループ	20.2	22.4	40,454	
CDS	4.8	3.7	6,660	
リンクアンドモチベーション	40.8	52.8	22,281	
エス・エム・エス	63	69.9	203,898	
サニーサイドアップグループ	7	4.7	3,120	
パーソルホールディングス	185	205.5	555,261	
リニカル	10.8	8.5	7,029	
クックパッド	59.7	52	8,944	
アイ・ケイ・ケイホールディングス	9.6	7.5	4,807	
学情	7.9	8.5	14,220	
スタジオアリス	8.4	9.3	20,088	
シミックホールディングス	9.7	9	17,928	
エブコ	4.4	3.5	2,607	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
N J S	4.3	4.2	9,832
総合警備保障	69.6	68.2	267,003
カカクコム	135.8	134.8	279,036
アイロムグループ	6.7	6.8	12,940
セントケア・ホールディング	12.5	12.1	9,317
サイネックス	3.7	3	1,722
ルネサンス	13.2	13.2	12,025
ディップ	32.6	32.2	111,734
デジタルホールディングス	13.2	14.6	15,622
新日本科学	22.7	19.6	45,040
キャリアデザインセンター	4.4	3.2	4,908
ベネフィット・ワン	67.5	85.2	130,185
エムスリー	326.4	362.7	1,116,027
ツカダ・グローバルホールディング	11.8	9.2	3,854
アウトソーシング	106.3	109.5	135,780
ウェルネット	17.8	11.4	6,976
ワールドホールディングス	7.6	8.4	22,932
ディー・エヌ・エー	70.6	73.5	137,151
博報堂DYホールディングス	242.1	234.2	350,597
ぐるなび	28.9	34.6	12,490
タカミヤ	23.4	25.5	12,469
ジャパンベストレスキューシステム	11.1	9.1	6,297
ファンコミュニケーションズ	44	36.7	14,643
ライク	6.3	7	13,090
ビジネス・ブレイクスルー	7.7	6.1	2,610
エスプール	52.5	53.3	31,713
WDBホールディングス	8.6	9.5	19,855
ティア	11.6	9.1	3,958
CDG	2.3	1.8	2,448
アドウェイズ	28.2	25.7	16,782
バリューコマース	14.6	14	19,866
インフォマート	203.4	191.6	52,690
J Pホールディングス	49.2	53.7	17,291
エコナックホールディングス	36.3	27.9	2,566
CLホールディングス	4.3	5.4	4,822
プレステージ・インターナショナル	69.9	77.7	48,951
アミューズ	10.2	10.1	17,806
ドリームインキュベータ	5.6	5.7	15,572
クイック	12.1	14.2	28,172
TAC	11.6	8.5	1,708
電通グループ	179.1	180.4	815,408
イオンファンタジー	7.3	8	28,160
シーティーエス	21.3	20.7	14,945
ネクシィーズグループ	6.6	4.9	3,287
H. U. グループホールディングス	48.5	53.8	144,668

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
アルプス技研	15.4	16.1	46,078
ダイオーズ	4	—	—
日本空調サービス	19.8	20.1	14,974
オリエンタルランド	204	971.1	5,219,662
ダスキン	41	40.9	129,448
明光ネットワークジャパン	22.3	22.8	14,364
ファルコホールディングス	8.5	8.5	15,631
ラウンドワン	51.8	154	96,250
リゾートトラスト	80.6	72.6	154,057
ビー・エム・エル	23.6	22.9	69,272
りらいあコミュニケーションズ	27.6	30.5	44,408
リソー教育	85.5	84.5	26,195
早稲田アカデミー	10.6	10.4	14,414
ユニー・エス・エス	207.2	188.8	437,260
東京個別指導学院	16.9	22.3	11,729
サイバーエージェント	415.5	405.7	402,048
楽天グループ	889.2	958.6	551,195
クリーク・アンド・リバー社	9.9	10.9	21,680
SBIグローバルセットマネジメント	33	30.6	14,932
テー・オー・ダブリュ	36.4	36.9	12,029
山田コンサルティンググループ	9.9	9.5	16,302
セントラルスポーツ	7	7	17,304
フルキャストホールディングス	15.9	17.6	40,321
エン・ジャパン	32.1	33.3	79,487
リソルホールディングス	2.1	1.4	6,587
テクノプロ・ホールディングス	110.9	108.7	338,600
アトラグループ	4.1	3.2	576
インターワークス	6.3	4.6	1,596
アイ・アールジャパンホールディングス	8.7	9.7	16,431
Keeper 技研	12	11.4	62,814
ファーストロジック	3.6	2	1,800
三機サービス	3.5	2.4	2,582
Gunosy	10.6	15.1	9,090
デザインワン・ジャパン	7.2	5.3	911
イー・ガーディアン	6.8	7.1	14,192
リブセンス	12.4	7.7	1,955
ジャパンマテリアル	57.1	56.3	124,479
ベクトル	26.2	29	37,903
ウチヤマホールディングス	10.3	7.1	2,122
チャーム・ケア・コーポレーション	14.1	15.6	17,862
キャリアリンク	7	6.8	19,529
I B J	15.7	11.7	7,967
アサンテ	8.4	9.3	14,954
バリューHR	15.9	16.2	23,036
M&Aキャピタルパートナーズ	15.4	14.9	46,488

銘柄	当期首(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
ライドオンエクスプレスホールディングス	7.5	6.8	6,806	
ERIホールディングス	5.4	3.9	5,265	
アビスト	3	2.3	7,038	
シグマクス・ホールディングス	22.6	28.1	32,174	
ウィルグループ	14	15.6	16,021	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	23.2	17.2	2,442	
メドピア	13.6	16.4	18,876	
レアジョブ	4.2	3	3,114	
リクルートホールディングス	1,358.6	1,358.6	6,032,184	
エラン	25.8	24.6	21,918	
土木管理総合試験所	9.7	6.9	2,235	
ネットマーケティング	9.5	—	—	
日本郵政	2,213.8	2,405.2	2,402,554	
ベルシテム24ホールディングス	26.8	24.8	35,042	
鎌倉新書	21.7	21.2	17,384	
SMN	4.6	4.1	1,873	
グローバルキッズCOMPANY	3.6	3.1	2,114	
エアトリ	11.2	13.5	36,058	
アトラエ	13.1	11.2	8,724	
ストライク	7.9	7.8	28,002	
ソラスト	46	51.1	31,171	
セラク	6.2	5.8	9,216	
インソース	19.8	40.1	48,601	
バイカレント・コンサルティング	13.1	145.3	743,936	
Orchestra Holdings	3.7	4.2	5,014	
アイモバイル	8.1	8.4	10,920	
キャリアインデックス	7	5.9	1,781	
MS-Japan	8	5	5,005	
船場	4.2	2.9	2,090	
ジャパンエレベーター サービスホールディングス	58.9	65.6	126,411	
フルテック	2.9	2.3	2,488	
GameWith	6.3	5.1	2,004	
MS&Consulting	3.2	2.2	1,320	
ウェルビー	12.5	14	7,140	
エル・ティエ・エス	2.5	2.5	8,075	
ミダックホールディングス	8.5	11.3	20,023	
日総工産	15	14.1	11,421	
キュービーネットホールディングス	8.8	8.9	13,474	
RPAホールディングス	27.1	25.7	9,637	
スプリックス	6.3	4.5	3,712	
マネジメントソリューションズ	9.2	10.2	29,957	
プロレド・パートナーズ	4.7	5.1	2,611	
テノ・ホールディングス	2.8	2.2	1,493	
フロンティア・マネジメント	5.1	6.4	7,283	

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)	
ピアラ	3.4	2.9	1,479	
コプロ・ホールディングス	4	2.5	4,482	
ギークス	3.6	2.3	1,734	
アンビスホールディングス	—	19.7	56,184	
カープスホールディングス	51.3	50.6	35,420	
フォーラムエン지니어リング	12.2	11	12,925	
Fast Fitness Japan	3.6	6.5	8,203	
ダイレクトマーケティングミックス	19.9	22.2	25,530	
ポピンズ	4.5	2.9	4,640	
LITALICO	15.1	14.4	33,796	
アドバンテッジリスクマネジメント	10.1	7	3,857	
リログループ	101.3	102.3	198,359	
東祥	14.1	13	15,171	
ビーウィズ	5.2	4.8	8,400	
TREホールディングス	31.8	38.9	42,634	
人・夢・技術グループ	7.5	7.1	10,508	
大栄環境	—	46.8	95,284	
日本管財ホールディングス	—	19.4	51,119	
エイチ・アイ・エス	39.4	48.1	93,843	
ラックランド	5.7	7.7	24,909	
共立メンテナンス	33.1	31.5	160,650	
イチネンホールディングス	19.2	19.7	25,984	
建設技術研究所	10.1	9.5	32,585	
スペース	12.8	13.6	14,008	
燦ホールディングス	8.2	8	17,768	
スバル興業	1.1	0.9	8,514	
東京テアトル	6.9	5.2	5,850	
タナベコンサルティンググループ	7.6	5.9	5,150	
ナガワ	5.4	5	30,450	
東京都競馬	13.9	15.4	61,831	
カナモト	31.2	33.8	76,590	
ニシオホールディングス	16.1	17.2	56,502	
トランス・コスモス	23.6	22.9	75,684	
乃村工藝社	79.6	80.4	76,540	
藤田観光	8.1	8.1	29,484	
KNT-CTホールディングス	11.5	10.9	15,467	
日本管財	19.9	—	—	
トーカイ	15.4	16.4	31,012	
セコム	182.2	186.9	1,733,871	
セントラル警備保障	9.1	10	28,150	
丹青社	36.3	35.9	28,863	
メイテック	22	71.7	167,061	
応用地質	18.9	17.3	33,008	
船井総研ホールディングス	35.9	38.3	99,273	
進学会ホールディングス	7	5.7	1,681	

銘柄	当期首(前期末) 株数 (千株)	当 期 末	
		株数 (千株)	評 価 額 (千円)
オオバ	12.4	9.3	7,198
いであ	4.9	3.3	5,408
学究社	6.2	7.5	16,372
ベネッセホールディングス	61.8	68.7	129,224
イオンディライト	21.4	20.4	61,710
ナック	9.1	8.4	8,030
ダイセキ	33.8	37.5	141,000
ステップ	7	6.8	12,308
合 計	株数・金額	201,473	551,712,588
	銘柄数<比率>	2,102	<98.5%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<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	8,127	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	551,712,588	98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,092,147	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	560,804,735	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 2023年5月29日現在
(A)資 産	560,934,705,882円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,790,568,685
株 式(評価額)	551,712,588,640
未 収 入 金	524,319,050
未 収 配 当 金	5,907,229,507
(B)負 債	890,592,642
前 受 金	135,470,000
未 払 解 約 金	755,116,994
未 払 利 息	5,648
(C)純 資 産 総 額(A-B)	560,044,113,240
元 本	255,447,146,244
次 期 繰 越 損 益 金	304,596,966,996
(D)受 益 権 総 口 数	255,447,146,244口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,924円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年5月31日 至 2023年5月29日
(A)配 当 等 収 益	13,515,293,210円
受 取 配 当 金	13,511,917,254
受 取 利 息	18,696
そ の 他 収 益 金	4,530,667
支 払 利 息	△1,173,407
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	61,527,535,644
売 買 益	76,106,214,180
売 買 損	△14,578,678,536
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,108,214,500
取 引 益	1,740,989,100
取 引 損	△632,774,600
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	76,151,043,354
(E)前 期 繰 越 損 益 金	235,314,033,556
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	19,775,045,769
(G)解 約 差 損 益 金	△26,643,155,683
(H)計 (D+E+F+G)	304,596,966,996
次 期 繰 越 損 益 金(H)	304,596,966,996

(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261,899,870,077円、期中追加設定元本額は21,018,826,197円、期中一部解約元本額は27,471,550,030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)	44,770,677,888円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	42,578,750,664円
国内株式SMTBセレクション(SMA専用)	27,824,772,823円
DCマイセレクション75	19,162,340,750円
DCマイセレクション50	18,775,791,691円
SMT TOPIXインデックス・オープン	11,493,697,625円
DCマイセレクションS50	9,695,167,195円
DC日本株式インデックス・オープンS	8,780,570,245円
DCマイセレクションS75	7,776,031,159円
分散投資コア戦略ファンドS	6,232,800,431円
DC日本株式インデックス・オープン	6,056,317,510円
DCマイセレクション25	6,031,356,474円
世界経済インデックスファンド	4,576,726,130円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,959,900,275円
DC世界経済インデックスファンド	3,623,664,654円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,558,869,347円
DCマイセレクションS25	3,251,795,060円
日本株式インデックス・オープン	3,138,913,501円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,907,960,207円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,464,530,979円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,800,466,226円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,677,177,841円
分散投資コア戦略ファンドA	1,671,155,657円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,567,288,518円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	1,247,297,494円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,162,389,581円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	693,708,422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)	681,289,234円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	669,049,530円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	662,965,308円
My SMT TOPIXインデックス(ノーロード)	563,599,010円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	529,901,170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)	506,467,134円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	505,505,088円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	421,486,060円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	392,112,893円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	389,100,858円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	373,721,136円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	362,704,238円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	301,683,658円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	287,247,620円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	260,308,230円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	223,884,037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)	217,884,106円
グローバル経済コア	210,210,812円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	206,555,070円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	191,052,428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)	159,294,728円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	129,589,313円
10資産分散投資ファンド	94,695,277円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	84,833,818円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	52,219,315円

SMT インデックスバランス・オープン	51,052,963円
SMT 世界経済インデックス・オープン	47,493,894円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	34,980,647円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	32,894,758円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	32,488,330円
DCターゲット・イヤー ファンド2055	27,252,430円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	27,140,956円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	25,277,923円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	24,008,973円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	21,790,354円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	21,562,672円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	18,447,216円
私募世界経済パッシングファンド(適格機関投資家専用)	17,186,387円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	15,436,739円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	15,417,057円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	15,125,814円
SBI資産設計オープン(分配型)	13,243,995円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	11,664,003円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,008,359円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	10,113,328円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	9,580,250円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	4,378,127円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,122,651円

お知らせ

該当事項はありません。

日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

運用報告書

第2期（決算日 2023年4月5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2021年4月23日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所等に上場している株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組 比率	株式先 物率	投資信託 証券組 入比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率				
設定日(2021年4月23日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	百万円 399
第1期(2022年4月5日)	10,554	5.5	10,602	6.0	94.6	3.7	1.5	479
第2期(2023年4月5日)	10,755	1.9	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4	10,692

(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。

ベンチマークは、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)です。

MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、親指数(MSCIジャパンIMI)構成銘柄の中から、親指数における各GICS業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。

設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の基準価額と市況の推移

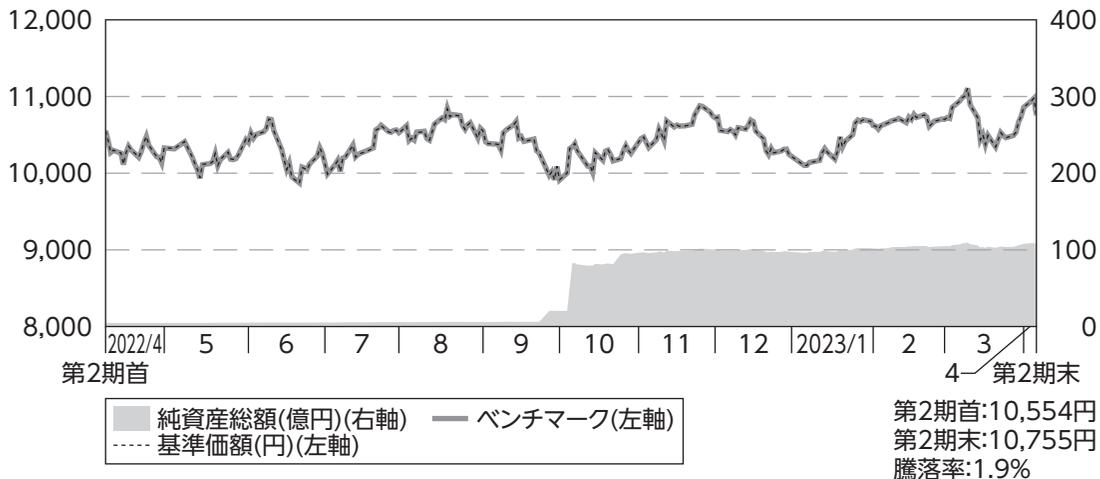
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託 証券組入比
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率					
(当 期 首) 2022年 4月5日	円 10,554	% —	10,602	% —	% 94.6	% 3.7	% 1.5		
4月末	10,333	△2.1	10,376	△2.1	95.5	2.8	1.6		
5月末	10,401	△1.4	10,449	△1.4	96.2	1.9	1.7		
6月末	10,122	△4.1	10,174	△4.0	96.0	2.1	1.6		
7月末	10,522	△0.3	10,576	△0.2	95.9	2.3	1.6		
8月末	10,552	△0.0	10,601	△0.0	96.9	1.3	1.6		
9月末	9,914	△6.1	9,956	△6.1	96.9	1.6	1.6		
10月末	10,406	△1.4	10,451	△1.4	97.6	0.8	1.6		
11月末	10,720	1.6	10,771	1.6	97.7	0.7	1.5		
12月末	10,218	△3.2	10,267	△3.2	97.6	0.9	1.5		
2023年 1月末	10,620	0.6	10,669	0.6	97.9	0.7	1.4		
2月末	10,701	1.4	10,751	1.4	97.8	0.8	1.4		
3月末	10,860	2.9	10,908	2.9	96.5	2.2	1.3		
(当 期 末) 2023年 4月5日	10,755	1.9	10,803	1.9	96.4	2.2	1.4		

(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。

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、2022年4月5日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で上昇しました。

投資環境



当期の国内株式市場は上昇しました。

前半は、新型コロナウイルス感染拡大や米国の金融引き締めペースの加速が懸念される一方で、円安・米ドル高の進行が好感されたことなどから一進一退の展開となりました。後半は、米国株式市場が堅調に推移したことが追い風となり上昇して始まりました。その後は、日銀による長期金利の変動許容幅の拡大が事実上の利上げと解釈され下落しましたが、金融緩和継続の方針が示されたことや引き続き円安・米ドル高が進行したことが好感され、2023年3月上旬にかけて堅調に推移しました。期末にかけては、米国での銀行の経営破綻をきっかけに市場心理が悪化したことなどから一時急落したものの、各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対する過度な懸念が後退したことなどから反発しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 株式組入比率

先物を含む株式組入比率は期を通じて高位を維持しました。

なお、資金の効率的な運用を行う目的で、株価指数先物取引(TOPIX先物)を適宜活用しています。

(2) ポートフォリオ構成

現物株式および投資信託証券については、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ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て運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

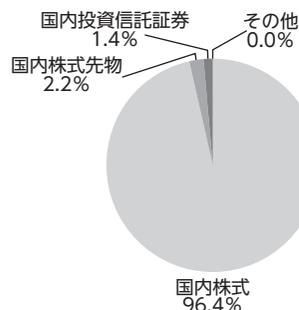
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	6.7%
2	ソニーグループ	日本	5.1%
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	3.4%
4	第一三共	日本	2.7%
5	東京エレクトロン	日本	2.4%
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	2.4%

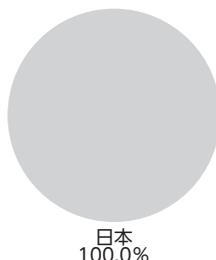
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	日立製作所	日本	2.4%
8	KDDI	日本	2.2%
9	任天堂	日本	2.0%
10	ダイキン工業	日本	1.9%
組入銘柄数		251	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

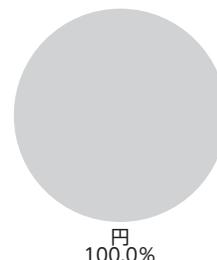
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

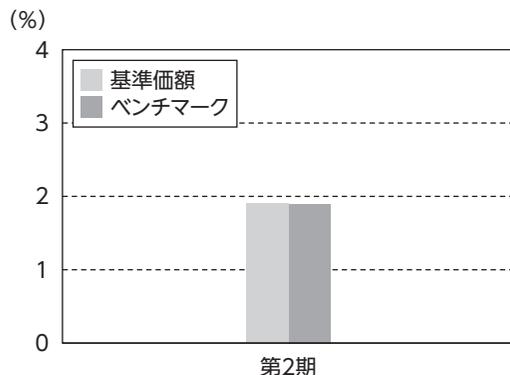


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(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2.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

今後の運用方針

主としてわが国の金融商品取引所等に上場している株式に投資し、MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年4月6日~2023年4月5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)	0.001% (0.000) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,447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 4,112 (95)	千円 10,458,112 (-)	千株 318	千円 965,793

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国内	森ヒルズリート投資法人	60	9,429	4	634
	産業ファンド投資法人	—	—	3	557
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	—	—	1	341
	日本プロロジスリート投資法人	80	25,486	5	1,647
	ヒューリックリート投資法人	49	8,200	4	688
	積水ハウス・リート投資法人	162	13,213	11	871
	野村不動産マスターファンド投資法人	1	169	8	1,354
	日本ビルファンド投資法人	58	37,264	4	2,509
	ジャパンリアルエステイト投資法人	48	29,184	3	1,796
	日本都市ファンド投資法人	2	209	13	1,427
	オリックス不動産投資法人	2	361	6	1,133
	日本プライムリアルティ投資法人	31	12,220	1	393
内	ユナイテッド・アーバン投資法人	115	17,327	8	1,222
	日本ロジスティクスファンド投資法人	31	9,889	—	—
	ジャパンエクセレント投資法人	45	5,994	3	407

(注1)金額は受渡代金です。

(注2)銘柄コードの変更等、管理の都合上により同一銘柄であっても別銘柄として記載されている場合があります。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 973	百万円 767	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	11,423,905千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	5,327,153千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	2.14

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

(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0	百万円 0.004209	百万円 0.004209	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	28,571	3,098	10.8	28,481	3,083	10.8

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人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	52百万円	3百万円	54百万円

(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	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
水産・農林業(ー%)			
マルハニチロ	0.1	—	—
鉱業(0.5%)			
I N P E X	1.6	37.7	55,230
建設業(1.8%)			
コムシスホールディングス	0.2	—	—
大成建設	0.3	—	—
大林組	1	23.6	23,647
清水建設	0.9	20	15,140
鹿島建設	0.7	—	—
戸田建設	0.4	—	—
住友林業	0.2	5.1	13,418
大和ハウス工業	0.9	21.8	67,536
積水ハウス	1	22.4	59,718
エクシオグループ	0.2	—	—
高砂熱学工業	0.1	1.7	3,598
大気社	—	0.9	3,258
千代田化工建設	—	5.7	2,274
食料品(3.7%)			
明治ホールディングス	—	8	25,240
サッポロホールディングス	0.1	2.3	8,004
アサヒグループホールディングス	0.7	16.6	81,871
キリンホールディングス	1.3	29.9	62,655
サントリー食品インターナショナル	0.2	5	24,550
伊藤園	—	1.9	8,179
不二製油グループ本社	0.1	1.6	3,051
キッコーマン	0.2	5.3	36,517
味の素	0.8	16.6	76,160
キューピー	0.2	3.3	7,355
ハウス食品グループ本社	0.1	2.2	6,164
カゴメ	—	2.7	8,356
ニチレイ	0.2	3.9	10,370
日清食品ホールディングス	0.1	2.2	26,334
繊維製品(0.5%)			
東洋紡	0.1	2.9	2,960
帝人	0.3	6.5	9,100
東レ	2.2	50.3	37,181
パルプ・紙(ー%)			
日本製紙	0.2	—	—
レンゴー	0.3	—	—
化学(6.2%)			
クラレ	0.5	11.6	13,896

銘柄	当期中(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
旭化成	2	45.5	41,750
住友化学	2.4	54.1	24,182
東ソー	—	9.4	16,732
デンカ	—	2.7	7,281
信越化学工業	0.6	—	—
カネカ	0.1	1.7	5,805
三井化学	0.3	6.7	22,143
J S R	—	6.4	19,264
東京応化工業	0.1	1.2	8,748
三菱ケミカルグループ	2.1	46.5	36,065
ダイセル	0.4	9.3	9,141
積水化学工業	0.6	13.3	24,897
UBE	0.2	3.5	7,290
日本化薬	0.2	—	—
花王	0.8	16.9	88,184
日本ペイントホールディングス	—	30.1	37,023
関西ペイント	0.3	6.4	11,494
D I C	0.1	2.8	6,655
東洋インキS Cホールディングス	0.1	—	—
富士フィルムホールディングス	0.6	13.1	87,023
資生堂	0.6	—	—
ライオン	—	8.5	12,308
小林製薬	—	1.8	14,490
デクセラアルズ	—	2	5,090
日東電工	0.2	5.2	43,888
信越ポリマー	—	1.5	2,154
ニフコ	0.1	2.9	10,701
ユニ・チャーム	0.6	14.6	77,832
医薬品(6.8%)			
協和キリン	0.4	9.8	28,645
アステラス製薬	3	66.6	126,140
住友ファーマ	0.3	—	—
塩野義製薬	0.4	9.6	57,254
中外製薬	1.1	24.4	79,007
エーザイ	0.4	9.1	66,966
小野薬品工業	0.6	13.1	35,782
参天製薬	0.6	12.7	14,147
第一三共	2.8	63.6	290,461
石油・石炭製品(0.5%)			
ENEOSホールディングス	4.9	111.4	52,402
ゴム製品(1.1%)			
ブリヂストン	—	20.7	108,323

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
住友理工	—	1.3	873
ガラス・土石製品(0.5%)			
太平洋セメント	—	4.2	10,096
TOTO	0.2	5.1	22,899
日本碍子	0.4	—	—
日本特殊陶業	0.2	5.6	15,013
ニチアス	0.1	—	—
鉄鋼(1.2%)			
日本製鉄	—	29.3	87,270
神戸製鋼所	—	12.2	12,163
JFEホールディングス	—	17.8	28,711
日立金属	0.3	—	—
非鉄金属(0.7%)			
日本軽金属ホールディングス	0.1	2	2,870
三井金属鉱業	—	2	6,350
三菱マテリアル	0.2	4.3	9,146
住友金属鉱山	0.4	9	45,585
DOWAホールディングス	0.1	1.9	8,113
UACJ	—	1.1	2,845
金属製品(0.2%)			
LIXIL	—	10.4	22,568
機械(5.6%)			
三浦工業	0.1	3.2	10,432
タクマ	0.1	—	—
ナブテスコ	0.2	4	12,620
小松製作所	1.4	33.6	107,788
日立建機	0.2	3.9	11,817
クボタ	1.7	36.7	71,711
荏原製作所	0.2	3.3	19,833
ダイキン工業	0.4	9	207,000
栗田工業	0.2	3.8	22,572
ダイフク	0.2	11.1	27,272
グローリー	0.1	1.7	4,833
セガサミーホールディングス	0.3	5.7	14,050
ホシザキ	0.1	—	—
NTN	0.6	—	—
日立造船	0.3	5.9	5,068
三菱重工業	0.5	11.6	58,649
電気機器(21.2%)			
日清紡ホールディングス	0.2	—	—
イビデン	0.2	4.1	20,869
コニカミノルタ	0.7	16.4	9,331
日立製作所	1.6	35.2	252,595
三菱電機	2.9	—	—
富士電機	—	4.6	23,690
安川電機	0.4	8.7	48,111

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
明電舎	—	1.2	2,236
オムロン	0.3	6.7	50,250
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.1	—	—
日本電気	0.4	—	—
富士通	0.3	7.1	127,445
セイコーエプソン	—	10.2	18,982
アルバック	0.1	—	—
パナソニック ホールディングス	3.6	80.2	99,448
アンリツ	0.2	4.9	5,924
ソニーグループ	2	45.8	540,898
TDK	0.6	14.1	65,001
アルプスアルパイン	—	7.2	8,935
ヒロセ電機	0.1	—	—
日本航空電子工業	0.1	1.7	3,823
横河電機	0.4	8.3	17,720
アズビル	0.2	4.2	14,868
日本光電工業	0.1	—	—
アドバンテスト	—	6.6	74,580
キーエンス	0.3	—	—
シスメックス	0.3	6.1	52,758
スタンレー電気	0.2	4.7	13,667
ウシオ電機	0.2	—	—
ファナック	—	35	160,335
ローム	—	3.2	34,240
京セラ	—	11.6	79,877
太陽誘電	—	4.3	18,447
村田製作所	0.9	20.8	162,281
リコー	—	19.9	19,502
東京エレクトロン	0.2	16.2	255,636
輸送用機器(7.7%)			
デンソー	0.7	—	—
川崎重工業	0.2	5.5	15,801
トヨタ自動車	17.1	384.9	713,027
日野自動車	0.5	—	—
マツダ	—	20.6	24,493
ヤマハ発動機	0.5	10.8	36,396
精密機器(1.3%)			
テルモ	1	23.4	84,403
島津製作所	0.4	8.6	35,561
ニコン	0.5	11	14,311
シチズン時計	0.4	—	—
その他製品(2.9%)			
前田工織	—	0.6	1,914
大建工業	—	0.4	901
大日本印刷	0.4	8.1	30,253
NISSHA	—	1.4	2,522

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)
アシックス	0.2	5.9	21,977	
ヤマハ	0.2	5.1	25,806	
リンテック	0.1	1.4	2,991	
任天堂	0.2	40.1	210,324	
コクヨ	0.1	3	5,469	
美津濃	—	0.6	1,842	
電気・ガス業(1.0%)				
中部電力	1	—	—	
中国電力	0.5	—	—	
東北電力	—	16.4	10,856	
九州電力	0.6	14.6	11,154	
電源開発	—	5.3	11,315	
レノバ	0.1	1.3	2,538	
東京瓦斯	0.6	14.2	35,272	
大阪瓦斯	0.6	13.6	29,525	
東邦瓦斯	0.1	2.7	6,639	
陸運業(2.4%)				
東武鉄道	0.3	—	—	
相鉄ホールディングス	0.1	2.8	6,328	
東急	0.8	19.3	34,431	
小田急電鉄	0.5	—	—	
京王電鉄	0.2	3.7	17,667	
東日本旅客鉄道	0.5	—	—	
西日本旅客鉄道	0.3	8	44,456	
西武ホールディングス	0.4	8.2	11,734	
西日本鉄道	0.1	2.2	5,321	
近鉄グループホールディングス	0.3	—	—	
阪急阪神ホールディングス	0.4	8.3	32,868	
南海電気鉄道	0.2	3.7	10,881	
京阪ホールディングス	—	3.5	12,425	
名古屋鉄道	0.3	—	—	
山九	0.1	1.9	9,006	
センコーグループホールディングス	0.2	3.7	3,459	
日立物流	0.1	—	—	
九州旅客鉄道	0.2	4.9	14,567	
S Gホールディングス	0.5	10.5	20,338	
NIPPON EXPRESSホールディングス	0.1	2.8	21,560	
海運業(0.6%)				
日本郵船	0.3	17.6	56,584	
倉庫・運輸関連業(0.0%)				
トランコム	—	0.3	2,139	
情報・通信業(6.2%)				
T I S	—	8.2	28,905	
S H I F T	—	0.5	11,440	
オープンドア	—	0.5	785	
マネーフォワード	—	1.6	7,808	

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)
ビジョナル	—	0.6	4,278	
野村総合研究所	0.5	14.4	44,208	
メルカリ	0.2	3.8	8,873	
Zホールディングス	4.3	97	37,354	
伊藤忠テクノソリューションズ	—	3.5	11,392	
サイボウズ	—	0.9	2,496	
ネットワンシステムズ	0.1	—	—	
B I P R O G Y	0.1	2.6	8,216	
ビジョン	—	1.4	2,234	
日本電信電話	2.1	—	—	
K D D I	2.6	58.5	237,100	
ソフトバンク	4.6	104.2	156,404	
エヌ・ティ・ティ・データ	—	22.9	40,853	
カブコン	—	6.3	29,830	
S C S K	0.3	5.7	11,069	
卸売業(4.9%)				
あらた	—	0.5	1,990	
アルフレッサ ホールディングス	0.3	—	—	
T O K A Iホールディングス	0.2	3.5	3,010	
シップヘルスケアホールディングス	0.1	—	—	
アズワン	—	1.1	6,105	
日本ライフライン	0.1	—	—	
伊藤忠商事	1.9	43.1	178,692	
丸紅	—	56.1	97,642	
三井物産	—	52	205,400	
キャンノンマーケティングジャパン	0.1	1.7	5,236	
サンゲツ	0.1	1.5	3,243	
モスフードサービス	—	0.9	2,740	
イエローハット	—	1.2	2,160	
スズケン	0.1	—	—	
小売業(3.6%)				
ローソン	0.1	1.6	8,832	
ゲオホールディングス	—	0.8	1,273	
ハローズ	—	0.3	915	
大黒天物産	—	0.2	972	
D C Mホールディングス	0.2	4	4,540	
マツキヨココカラ&カンパニー	—	4.2	29,106	
Z O Z O	—	4.5	13,545	
オイシックス・ラ・大地	—	1	2,360	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	—	1.9	2,055	
イオン北海道	—	1.5	1,186	
スギホールディングス	—	1.3	7,436	
日本瓦斯	—	3.8	7,250	
マックスバリュ東海	—	0.3	798	
丸井グループ	0.3	6.4	13,049	

銘柄	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
イオン	1.1	23.7	60,494
平和堂	—	1	1,955
ヤオコー	—	0.7	4,767
ケーズホールディングス	0.3	—	—
Genky DrugStores	—	0.3	1,144
ヤマダホールディングス	1.1	26.3	12,308
ファーストリテイリング	0.1	6.4	188,128
サンドラッグ	—	2.6	9,425
銀行業 (7.2%)			
しずおかフィナンシャルグループ	—	16.2	15,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	433.8	364,825
りそなホールディングス	3.3	78.4	51,148
三井住友トラスト・ホールディングス	0.5	12	54,912
三井住友フィナンシャルグループ	2.1	47.4	253,210
千葉銀行	0.9	—	—
静岡銀行	0.7	—	—
山口フィナンシャルグループ	0.3	—	—
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
大和証券グループ本社	—	48.4	29,814
野村ホールディングス	4.9	105.6	53,539
マネックスグループ	—	6.3	3,080
保険業 (3.7%)			
SOMPOホールディングス	0.5	11.4	59,451
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	0.7	15.6	63,304
第一生命ホールディングス	1.6	35.6	86,792
東京海上ホールディングス	1	66.6	168,131
T&Dホールディングス	0.9	—	—
その他金融業 (1.0%)			
東京センチュリー	0.1	1.3	5,804
オリックス	2	43.4	94,026
不動産業 (2.1%)			
ヒューリック	0.6	13.9	15,109
野村不動産ホールディングス	0.2	4.3	12,568
東急不動産ホールディングス	1	—	—
三井不動産	1.5	32.9	80,045
三菱地所	1.9	40.9	64,131
平和不動産	—	1.1	4,196
東京建物	—	6.8	10,839
住友不動産	—	11.2	33,168
サービス業 (4.1%)			
総合警備保障	0.1	2.8	9,884
ディップ	—	1.3	4,361
エスプール	—	2.4	1,418
H. U. グループホールディングス	0.1	1.9	5,031

銘柄	当 期 首 (前 期 末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	
オリエンタルランド	0.3	36.5	165,418	
ダスキン	0.1	1.5	4,807	
サイバーエージェント	—	15.6	17,440	
テクノプロ・ホールディングス	0.2	3.9	13,650	
リクルートホールディングス	2.2	52.3	191,888	
エラン	—	1.1	1,102	
インソース	—	1.7	2,114	
カープスホールディングス	—	1.9	1,360	
LITALICO	—	0.7	1,722	
乃村工藝社	0.1	2.8	2,455	
セコム	0.3	—	—	
ベネッセホールディングス	0.1	2.6	5,018	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄数<比率>	148 205	4,037 239	10,312,114 <96.4%>

(注1)銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注2)合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)	
森ヒルズリート投資法人	—	56	8,534	0.1	
産業ファンド投資法人	3	—	—	—	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1	—	—	—	
日本プロロジスリート投資法人	3	78	23,353	0.2	
ヒューリックリート投資法人	2	47	7,115	0.1	
積水ハウス・リート投資法人	—	151	11,189	0.1	
野村不動産マスターファンド投資法人	7	—	—	—	
日本ビルファンド投資法人	2	56	31,360	0.3	
ジャパンリアルエステイト投資法人	—	45	24,075	0.2	
日本都市ファンド投資法人	11	—	—	—	
オリックス不動産投資法人	4	—	—	—	
日本プライムリアルティ投資法人	1	31	10,943	0.1	
ユナイテッド・アーバン投資法人	—	107	15,547	0.1	
日本ロジスティクスファンド投資法人	—	31	9,408	0.1	
ジャパンエクセレント投資法人	2	44	5,236	0.0	
合 計	口 数	金 額			
	銘 柄 数 <比率>				
	10	646	146,762	<1.4%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

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

①資産運用会社

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

②一般事務受託会社

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

投資法人名	
森ヒルズリート投資法人 日本プロロジスリート投資法人 日本ビルファンド投資法人	ユナイテッド・アーバン投資法人 日本ロジスティクスファンド投資法人

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内	158	—
	73	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	10,312,114	96.4
投 資 証 券	146,762	1.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	236,677	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	10,695,553	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 2023年4月5日現在
(A)資 産	10,694,435,630円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	103,435,741
株 式(評価額)	10,312,114,580
投 資 証 券(評価額)	146,762,100
未 収 入 金	729,094
未 収 配 当 金	127,191,365
差 入 委 託 証 拠 金	4,202,750
(B)負 債	1,961,045
未 払 金	3,176
未 払 解 約 金	1,957,851
未 払 利 息	18
(C)純 資 産 総 額(A-B)	10,692,474,585
元 本	9,942,102,895
次 期 繰 越 損 益 金	750,371,690
(D)受 益 権 総 口 数	9,942,102,895口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,755円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年4月6日 至 2023年4月5日
(A)配 当 等 収 益	165,658,071円
受 取 配 当 金	165,706,053
受 取 利 息	198
そ の 他 収 益 金	132
支 払 利 息	△48,312
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	351,778,708
売 買 益	743,348,154
売 買 損	△391,569,446
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	8,501,494
取 引 益	17,174,808
取 引 損	△8,673,314
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	525,938,273
(E)前 期 繰 越 損 益 金	25,155,627
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	209,441,011
(G)解 約 差 損 益 金	△10,163,221
(H) 計 (D+E+F+G)	750,371,690
次 期 繰 越 損 益 金(H)	750,371,690

(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454,441,229円、期中追加設定元本額は9,729,862,124円、期中一部解約元本額は242,200,458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。

国内株式SMTBセクション(SMA専用)	7,678,903,135円
DC日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックスファンド	749,020,546円
コア投資戦略ファンド(成長型)	552,032,281円
コア投資戦略ファンド(安定型)	255,171,736円
コア投資戦略ファンド(切替型)	229,733,695円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	177,935,243円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	116,243,652円
POFs用 日本株式ESGセレクト・リーダーズインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	104,377,737円
私募日本株式ESGセレクト・リーダーズパッシブファンド(適格機関投資家専用)	41,184,314円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	37,500,556円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2023年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率						
第19期(2019年5月29日)	25,011	2.2	644.69	0.0	95.0	2.5	2.7	2.7	345,116	
第20期(2020年5月29日)	25,857	3.4	652.38	1.2	92.9	4.2	2.5	2.5	399,725	
第21期(2021年5月31日)	37,583	45.3	934.05	43.2	95.3	2.5	2.2	2.2	517,603	
第22期(2022年5月30日)	41,948	11.6	1,023.64	9.6	94.1	3.7	2.3	2.3	523,424	
第23期(2023年5月29日)	47,791	13.9	1,140.40	11.4	95.6	2.5	2.0	2.0	581,354	

(注) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率					
(当期首) 2022年 5月30日	41,948	—	1,023.64	—	94.1	3.7	2.3	2.3	
5月末	42,448	1.2	1,031.48	0.8	93.9	3.8	2.3	2.3	
6月末	41,456	△1.2	1,011.46	△1.2	94.6	3.1	2.4	2.4	
7月末	43,087	2.7	1,047.14	2.3	93.1	4.6	2.4	2.4	
8月末	43,380	3.4	1,055.48	3.1	94.7	3.0	2.4	2.4	
9月末	41,254	△1.7	997.29	△2.6	94.9	2.9	2.3	2.3	
10月末	45,206	7.8	1,089.45	6.4	95.0	2.7	2.2	2.2	
11月末	43,873	4.6	1,057.44	3.3	94.9	2.8	2.2	2.2	
12月末	41,207	△1.8	998.74	△2.4	95.2	2.6	2.2	2.2	
2023年 1月末	42,764	1.9	1,031.16	0.7	95.6	2.1	2.3	2.3	
2月末	44,263	5.5	1,064.10	4.0	95.2	2.8	2.2	2.2	
3月末	44,043	5.0	1,051.81	2.8	94.5	3.4	2.1	2.1	
4月末	45,249	7.9	1,084.70	6.0	95.4	2.5	2.1	2.1	
(当期末) 2023年 5月29日	47,791	13.9	1,140.40	11.4	95.6	2.5	2.0	2.0	

(注1) 騰落率は期首比です。

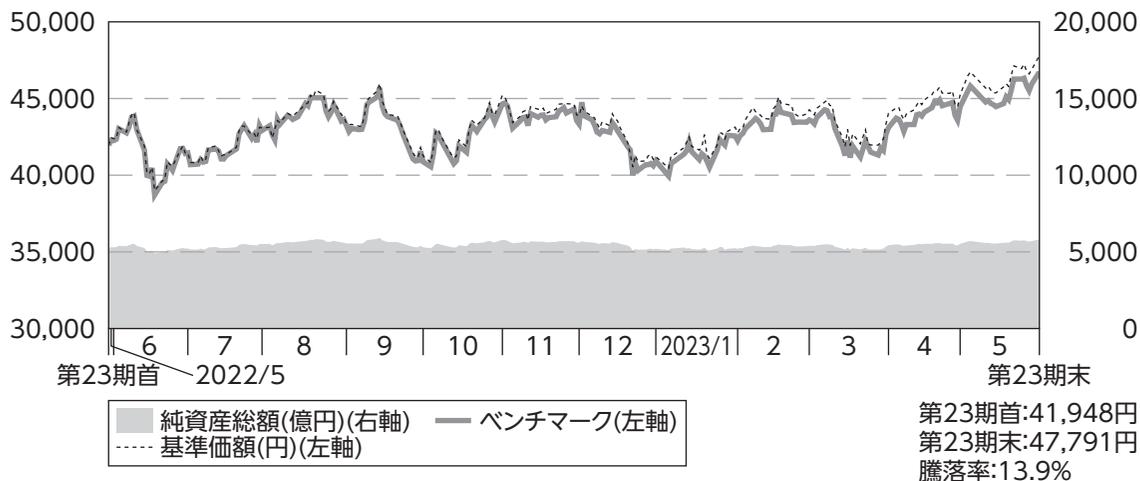
(注2) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(円ベース)です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2022年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイ・インデックス(円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、インフレ高進を受けて各国中央銀行が金融引き締めを加速させるとの警戒感が強まったことなどから2022年6月にかけて下落しました。その後は一時反発する場面もありましたが、過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから10月にかけて再び下落しました。しかし、その後は発表された欧米各国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテク株が堅調に推移したことなどから上昇し、高値圏で期末を迎えました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

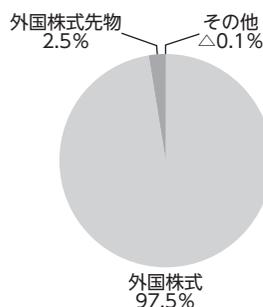
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	APPLE INC	アメリカ	5.4%
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	4.5%
3	AMAZON.COM	アメリカ	2.1%
4	NVIDIA CORP	アメリカ	1.8%
5	S&P 500 EMIN 2306	アメリカ	1.8%
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	1.4%

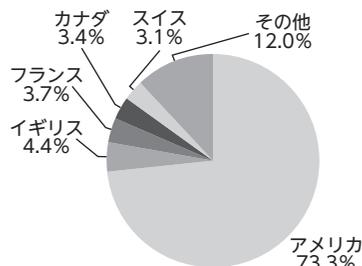
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	1.3%
8	META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	1.1%
9	TESLA INC	アメリカ	1.0%
10	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	0.9%
組入銘柄数			1,276

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

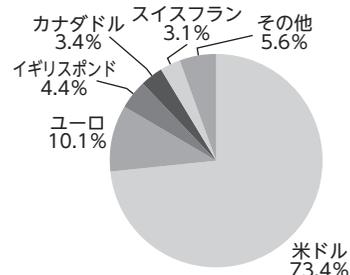
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

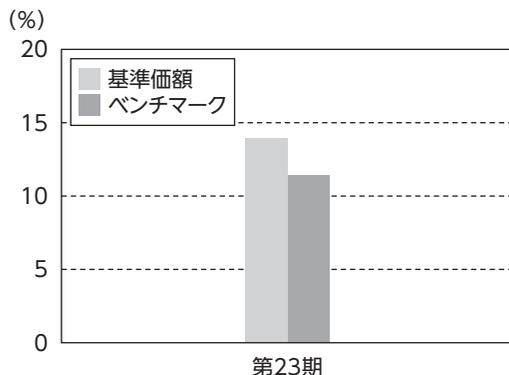


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.5%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、配当要因^{*1}および為替評価差要因^{*2}(いずれもプラス要因)です。

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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年5月31日~2023年5月29日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	1円 (1) (-) (-) (-) (0) (-) (1)	0.003% (0.002) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	1 (1) (-) (-) (-) (-) (0)	0.003 (0.003) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	12 (12) (-) (0)	0.028 (0.028) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	14	0.034	

(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(43,185円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 19,781 (19,571)	千米ドル 182,483 (1,871)	百株 20,291 (-)	千米ドル 161,150 (201)
	カ ナ ダ	2,919 (1,171)	千カナダドル 14,717 (-)	3,325	千カナダドル 15,032
	ド イ ツ	1,682 (-)	千ユーロ 7,357 (△247)	1,580	千ユーロ 6,137
	イ タ リ ア	2,385 (-)	1,927 (△1)	2,590	2,910
	フ ラ ン ス	1,248 (453)	8,028 (△35)	1,822	7,737
	オ ラ ン ダ	1,345 (△106)	4,316 (△1,971)	1,041	4,055
	ス ペ イ ン	1,992 (14,999)	2,419 (362)	2,800 (14,752)	2,272 (364)
	ベ ル ギ ー	130 (31)	933 (26)	276 (29)	837 (1)
	オ ー ス ト リ ア	80	200	190	347
	ル ク セ ン ブ ル ク	-	-	266	472
	フ ィ ン ラ ン ド	1,449	1,325	679	633
	ア イ ル ラ ン ド	1,838	1,382	68	450
	ポ ル ト ガ ル	117	143	-	-
	そ の 他	- (137)	- (1,945)	-	-
	国	イ ギ リ ス	9,113 (4,731)	千イギリスポンド 8,122 (105)	17,847 (2,642)
ス イ ス		1,991 (2,323)	千スイスフラン 8,517 (△236)	3,100	千スイスフラン 7,284
ス ウ ェ ー デ ン		3,610 (1,579)	千スウェーデンクローナ 52,713 (△1,350)	5,266 (-)	千スウェーデンクローナ 43,082 (6,410)
ノ ル ウ ェ ー		519 (163)	千ノルウェークローネ 12,640 (6,249)	481	千ノルウェークローネ 7,804
デ ン マ ー ク		111	千デンマーククローネ 9,230	375	千デンマーククローネ 16,133

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	6,835 (150)	千オーストラリアドル 10,342 (-)	4,476	千オーストラリアドル 7,611
	ニュージーランド	142	千ニュージーランドドル 634	717	千ニュージーランドドル 660
	香 港	3,360	千香港ドル 12,854	3,982	千香港ドル 15,440
	シンガポール	1,588 (21,544)	千シンガポールドル 1,288 (0.12902)	3,591 (16)	千シンガポールドル 1,125 (14)
	イスラエル	2,351	千イスラエルシェケル 4,812	248	千イスラエルシェケル 1,318

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	396	0.937	135
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	54 (△112)	364 (-)	-	-
PROLOGIS INC	6 (14)	795 (1,628)	4	563
DUKE REALTY CORP	2 (△30)	157 (△1,628)	-	-
CROWN CASTLE INC	2	389	2	290
ESSEX PROPERTY TRUST	0.435	123	-	-
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	5	381	3	196
WELLTOWER INC	4	418	2	198
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.792	143	-	-
REALTY INCOME CORP	5	389	-	-
UDR INC	4	205	5	208
SIMON PROPERTY GROUP	1	179	1	191
PUBLIC STORAGE	0.481	166	0.9	264
SUN COMMUNITIES INC	1	178	-	-
VORNADO REALTY TRUST	-	-	11	286
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	162	-	-
AGNC INVESTMENT CORP	-	-	46	565
AMERICAN TOWER CORPORATION	3	921	1	386
WP CAREY INC	1	152	-	-
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30	887	-	-
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	24	923	-	-
INVITATION HOMES INC	4	155	6	195
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21	1,052	3	192
AMC ENTERTAINMENT-PFD EQ UT	- (38)	- (201)	38	36
EQUINIX INC	0.579	398	0.3	215
VICI PROPERTIES INC	4	159	5	159
小 計	187 (△89)	9,102 (201)	134	4,086

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
ベルギー	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
WAREHOUSES DE PAUW SCA	12	443	—	—
小 計	12	443	—	—
ユ ー ロ 計	12	443	—	—
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
SEGRO PLC	10	79	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	10	61	—	—
小 計	20	141	—	—
オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
APA GROUP	26	320	26	281
VICINITY CENTERS	—	—	60	120
SCENTRE GROUP	99	294	100	290
小 計	126	615	186	692
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
HKT TRUST AND HKT LTD	110	1,203	—	—
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	—	220	1,120
LINK REIT -RIGHTS	— (34)	— (—)	34	146
小 計	110 (34)	1,203 (—)	254	1,266
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	120 (—)	248 (△0.4745)	121	256
CAPITALAND ASCENDAS REIT	— (—)	— (△10)	—	—
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	— (—)	— (△11)	—	—
CAPITALAND ASCOTT TRUST	— (12)	— (14)	12	13
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	— (—)	— (△1)	—	—
小 計	120 (12)	248 (△9)	134	269

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	117,046	125,061	—	—

(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	66,987,834千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	513,587,627千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.13

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 55,209	百万円 120	% 0.2	百万円 69,258	百万円 —	% —
金 銭 信 託	0.024758	0.024758	100.0	0.024758	0.024758	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	195,507	19,650	10.1	196,719	19,724	10.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式>

銘柄	当期首(前期末)	当		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(アメリカ)				千米ドル		
AMAZON.COM	357	7,270	87,328	12,293,215	一般消費財・サービス流通・小売り	
ABBOTT LABORATORIES	1,380	1,372	14,119	1,987,533	ヘルスケア機器・サービス	
AES CORP	543	543	1,080	152,092	公益事業	
ABIOMED INC	37	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	696	716	9,230	1,299,389	ソフトウェア・サービス	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,278	1,277	16,228	2,284,534	半導体・半導体製造装置	
ADOBE INC	371	366	15,237	2,144,959	ソフトウェア・サービス	
CHUBB LTD	336	332	6,312	888,665	保険	
AIR PRODUCTS&CHEMICALS	175	174	4,780	672,915	素材	
ALLEGHANY CORP	9	—	—	—	保険	
ALLSTATE CORP	230	207	2,268	319,302	保険	
HONEYWELL INTL INC	536	526	10,199	1,435,740	資本財	
AMGEN	440	424	9,208	1,296,244	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HESS CORP	227	215	2,803	394,698	エネルギー	
AMERICAN EXPRESS	514	503	7,923	1,115,344	金融サービス	
AMERICAN ELECTRIC POWER	381	399	3,282	462,056	公益事業	
AFLAC	505	468	3,019	425,007	保険	
AMERICAN INT'L GROUP	658	595	3,219	453,238	保険	
AMERCO	7	—	—	—	運輸	
ANALOG DEVICES	416	400	7,077	996,266	半導体・半導体製造装置	
VALERO ENERGY CORP	307	307	3,504	493,314	エネルギー	
COMCAST CORP-CL A	3,567	3,448	13,615	1,916,660	メディア・娯楽	
ANSYS INC	67	67	2,170	305,471	ソフトウェア・サービス	
APPLE INC	12,844	12,628	221,536	31,185,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS	713	680	9,257	1,303,181	半導体・半導体製造装置	
ALBEMARLE CORP	94	94	1,925	271,075	素材	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	429	438	3,188	448,791	食品・飲料・タバコ	
AMEREN CORPORATION	208	208	1,687	237,610	公益事業	
ARROW ELECTRONICS INC	61	43	557	78,494	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AUTODESK INC	174	174	3,474	489,061	ソフトウェア・サービス	
AUTOMATIC DATA PROCESS	327	328	6,983	983,048	商業・専門サービス	
AUTOZONE INC	16	14	3,678	517,876	一般消費財・サービス流通・小売り	
AVERY DENNISON CORP	66	66	1,081	152,284	素材	
BALL CORP	256	256	1,377	193,953	素材	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,019	1,033	33,135	4,664,455	金融サービス	
BANK NEW YORK CO	612	612	2,497	351,634	金融サービス	
BAXTER INTERNATIONAL	384	400	1,652	232,571	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	222	224	5,418	762,788	ヘルスケア機器・サービス	
AMETEK INC	180	177	2,631	370,415	資本財	
VERIZON COMMUNICATIONS	3,224	3,314	11,601	1,633,165	電気通信サービス	
WR BERKLEY CORP	175	175	986	138,893	保険	
BEST BUY COMPANY INC	181	152	1,136	159,933	一般消費財・サービス流通・小売り	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
BIO-RAD LABORATORIES-A	18	18	702	98,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUM BRANDS INC	226	217	2,818	396,775	消費者サービス
FIRSTENERGY CORP	411	455	1,671	235,247	公益事業
BOEING CO	432	446	9,099	1,280,923	資本財
ROBERT HALF INTL INC	95	71	484	68,271	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	197	197	933	131,348	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,128	1,150	5,875	827,068	ヘルスケア機器・サービス
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	112	83	816	114,884	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	89	128	1,788	251,732	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	18	18	2,437	343,130	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,727	1,696	10,825	1,523,883	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	332	355	2,036	286,613	エネルギー
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	63	63	719	101,272	保険
UNITED RENTALS INC	53	53	1,882	265,014	資本財
SEMPRA ENERGY	245	245	3,536	497,779	公益事業
FEDEX CORP	195	192	4,320	608,163	運輸
VERISIGN INC	77	77	1,760	247,820	ソフトウェア・サービス
AMPHENOL CORPORATION	459	472	3,620	509,605	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	240	240	1,478	208,098	食品・飲料・タバコ
QUANTA SERVICES INC	—	114	1,994	280,823	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	604	604	213	30,047	メディア・娯楽
CSX CORP	1,731	1,692	5,214	734,105	運輸
COTERRA ENERGY INC	640	640	1,551	218,384	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO (US)	158	158	817	115,067	食品・飲料・タバコ
CONSTELLATION BRANDS INC-A	129	129	3,013	424,205	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	219	219	1,814	255,376	ヘルスケア機器・サービス
CARLISLE COS INC	—	43	949	133,630	資本財
CATERPILLAR	424	413	8,749	1,231,720	資本財
CHECK POINT SOFTWARE TECH	81	81	1,006	141,648	ソフトウェア・サービス
CITRIX SYSTEMS INC	104	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	737	—	—	—	電気通信サービス
CERNER CORP	228	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
JPMORGAN CHASE & CO	2,312	2,328	31,885	4,488,543	銀行
CHURCH & DWIGHT CO INC	179	193	1,817	255,911	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	263	246	6,007	845,613	ヘルスケア機器・サービス
CINCINNATI FINANCIAL CORP	127	112	1,101	155,096	保険
CINTAS CORP	74	74	3,483	490,442	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	3,282	3,261	16,260	2,289,010	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLEVELAND-CLIFFS INC	—	430	617	86,922	素材
CLOROX COMPANY	95	95	1,522	214,321	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	3,197	3,269	19,700	2,773,307	食品・飲料・タバコ
COPART INC	166	351	3,090	435,009	商業・専門サービス
COGNEX CORP	143	143	786	110,754	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	637	622	4,747	668,241	家庭用品・パーソナル用品
MARRIOTT INTL A	211	213	3,665	515,948	消費者サービス
MOLINA HEALTHCARE INC	45	45	1,240	174,684	ヘルスケア機器・サービス
NRG ENERGY INC	190	190	647	91,101	公益事業
CONAGRA BRANDS INC	359	403	1,404	197,668	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CONSOLIDATED EDISON INC	275	271	2,515	354,121	公益事業
CMS ENERGY CORP	236	236	1,353	190,475	公益事業
THE COOPER COS INC	41	41	1,527	214,963	ヘルスケア機器・サービス
CORNING	649	649	2,049	288,452	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEALED AIR CORP	116	116	468	65,988	素材
HEICO CORP-CLASS A	64	63	806	113,554	資本財
CUMMINS INC	112	113	2,418	340,401	資本財
DARLING INGREDIENTS INC	—	132	841	118,499	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	277	254	2,717	382,539	耐久消費財・アパレル
DANAHER CORP	505	548	12,747	1,794,516	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	133	130	4,089	575,657	金融サービス
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	404	399	2,511	353,498	ソフトウェア・サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	371	362	5,035	708,810	生活必需品流通・小売り
DEERE&CO	232	226	8,099	1,140,199	資本財
MORGAN STANLEY	1,063	1,008	8,461	1,191,111	金融サービス
REPUBLIC SERVICES INC	169	183	2,585	363,971	商業・専門サービス
COSTAR GROUP INC	321	321	2,520	354,850	商業・専門サービス
THE WALT DISNEY CO	1,416	1,448	12,785	1,799,783	メディア・娯楽
DOLLAR TREE INC	179	179	2,554	359,564	生活必需品流通・小売り
DOVER CORP	106	106	1,460	205,570	資本財
OMNICOM GROUP	165	165	1,487	209,408	メディア・娯楽
DTE ENERGY COMPANY	146	158	1,688	237,660	公益事業
DUKE ENERGY CORP	598	607	5,388	758,555	公益事業
DARDEN RESTAURANTS INC	107	92	1,484	209,030	消費者サービス
EBAY	510	419	1,860	261,971	一般消費財・サービス流通・小売り
BANK OF AMERICA CORP	5,762	5,744	16,264	2,289,492	銀行
CITIGROUP	1,551	1,530	6,825	960,812	銀行
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	110	88	718	101,091	素材
EATON CORP	316	313	5,713	804,219	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	219	213	4,878	686,681	ソフトウェア・サービス
DISH NETWORK CORPORATION-A	201	201	134	18,874	メディア・娯楽
ECOLAB INC	198	199	3,328	468,508	素材
REVVITY INC	93	105	1,230	173,187	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ELECTRONIC ARTS INC	218	215	2,732	384,677	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	762	793	17,102	2,407,456	ソフトウェア・サービス
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	21	21	474	66,774	保険
EMERSON ELECTRIC CO	463	463	3,688	519,180	資本財
ATMOS ENERGY CORP	96	113	1,285	180,894	公益事業
ENTERGY CORP	151	161	1,566	220,490	公益事業
EOG RESOURCES INC	461	461	5,084	715,755	エネルギー
EQUIFAX INC	95	92	1,944	273,686	商業・専門サービス
EQT CORPORATION	—	270	975	137,302	エネルギー
ESTEE LAUDER CO-CL A	184	181	3,533	497,446	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	142	122	1,418	199,677	運輸
EXXON MOBIL	3,301	3,274	34,369	4,838,133	エネルギー
FMC CORP	105	105	1,088	153,216	素材
NEXTERA ENERGY INC	1,525	1,556	11,508	1,620,045	公益事業
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	31	31	1,222	172,134	金融サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FAIR ISAAC CORP	21	21	1,674	235,687	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	47	47	589	83,013	保険
FASTENAL CO	448	440	2,427	341,739	資本財
FIFTH THIRD BANCORP	528	544	1,374	193,509	銀行
M & T BANK CORP	140	136	1,690	237,916	銀行
FIRST HORIZON CORP	—	443	482	67,861	銀行
FISERV INC	464	477	5,432	764,703	金融サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	260	260	641	90,315	金融サービス
FREEPORT-MCMORAN INC	1,131	1,116	3,880	546,234	素材
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	9	9	1,209	170,260	銀行
ARTHUR J GALLAGHER & CO	163	164	3,349	471,554	保険
DENTSPLY SIRONA INC	177	177	656	92,475	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL DYNAMICS CORP	189	181	3,716	523,137	資本財
GENERAL MILLS INC	465	466	3,924	552,400	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	101	113	1,779	250,494	一般消費財・サービス流通・小売り
GILEAD SCIENCES INC	970	999	7,705	1,084,685	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	63	63	2,176	306,353	ソフトウェア・サービス
MCKESSON CORP	120	114	4,457	627,434	ヘルスケア機器・サービス
NVIDIA CORP	1,961	1,960	76,336	10,745,888	半導体・半導体製造装置
GRACO INC	—	133	1,031	145,252	資本財
GENERAL ELECTRIC CO	851	871	8,952	1,260,179	資本財
GRAINGER (WW) INC	32	36	2,435	342,877	資本財
HALLIBURTON CO	682	703	2,123	298,871	エネルギー
GOLDMAN SACHS GROUP INC	266	267	8,866	1,248,112	金融サービス
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	156	146	2,624	369,458	資本財
HASBRO INC	105	105	635	89,397	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	117	117	880	123,889	ヘルスケア機器・サービス
HEICO CORP	36	36	579	81,625	資本財
HERSHEY FOODS CORPORATION	113	120	3,097	436,040	食品・飲料・タバコ
HP INC	923	773	2,420	340,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
F5 INC	41	48	718	101,202	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CROWN HOLDINGS INC	99	99	782	110,219	素材
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	36	750	105,589	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JUNIPER NETWORKS INC	253	253	772	108,715	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	190	188	1,491	209,985	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	815	808	23,685	3,334,174	一般消費財・サービス流通・小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	147	147	1,308	184,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	233	233	897	126,385	食品・飲料・タバコ
CENTERPOINT ENERGY INC	481	474	1,345	189,361	公益事業
LENNOX INTERNATIONAL INC	25	25	708	99,755	資本財
HUMANA INC	99	99	4,939	695,288	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	70	70	1,200	169,028	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,141	1,141	1,200	168,988	銀行
BIOGEN INC	118	110	3,303	464,988	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	59	59	1,203	169,457	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	242	243	5,485	772,148	資本財
INTUIT INC	212	212	8,874	1,249,260	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	67	67	3,165	445,651	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末				業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
INTEL CORP	3,188	3,252	9,431	1,327,639	半導体・半導体製造装置	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	194	193	1,510	212,698	素材	
INT'L PAPER CO	308	251	771	108,582	素材	
INTERPUBLIC GROUP OF COS	338	285	1,075	151,348	メディア・娯楽	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	106	—	—	—	商業・専門サービス	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	62	52	774	109,018	金融サービス	
INCYTE CORP	152	152	951	134,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JOHNSON & JOHNSON	2,053	2,079	32,104	4,519,370	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARTFORD FINANCIAL SVCS	277	247	1,698	239,101	保険	
KLA CORP	121	114	5,298	745,820	半導体・半導体製造装置	
DEVON ENERGY CORPORATION	516	502	2,415	340,072	エネルギー	
KELLOGG CO	216	187	1,270	178,820	食品・飲料・タバコ	
KEY CORP	714	712	704	99,157	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	258	263	3,594	506,017	家庭用品・パーソナル用品	
BLACKROCK INC	118	119	8,025	1,129,713	金融サービス	
KROGER CO	561	517	2,449	344,879	生活必需品流通・小売り	
LAM RESEARCH CORP	109	107	6,754	950,893	半導体・半導体製造装置	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	38	38	1,549	218,068	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PACKAGING CORP OF AMERICA	76	76	977	137,642	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	136	114	1,040	146,415	ソフトウェア・サービス	
PLUG POWER INC	418	418	345	48,642	資本財	
LENNAR CORP-CL A	208	208	2,239	315,280	耐久消費財・アパレル	
LILLY (ELI) & CO	632	633	26,969	3,796,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BATH & BODY WORKS INC	198	198	730	102,852	一般消費財・サービス流通・小売り	
LINCOLN NATIONAL CORP	134	—	—	—	保険	
UNITED PARCEL SERVICE B	566	583	10,003	1,408,152	運輸	
AGILENT TECHNOLOGIES	237	237	2,864	403,191	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LOCKHEED MARTIN CORP	193	189	8,476	1,193,251	資本財	
LOEWS CORP	167	167	956	134,587	保険	
CARNIVAL CORPORATION	621	843	951	133,955	消費者サービス	
LOWES COMPANIES	521	478	9,887	1,391,813	一般消費財・サービス流通・小売り	
DOMINION ENERGY INC	623	661	3,299	464,496	公益事業	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	288	227	919	129,372	消費者サービス	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	189	207	1,807	254,410	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	581	580	16,606	2,337,754	消費者サービス	
S&P GLOBAL INC	277	267	9,637	1,356,723	金融サービス	
EVEREST RE GROUP LTD	32	32	1,150	162,025	保険	
MARKEL GROUP INC	11	10	1,337	188,343	保険	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	483	484	3,973	559,402	ヘルスケア機器・サービス	
MARSH & MCLENNAN COS	392	393	6,824	960,694	保険	
MASCO CORP	194	194	988	139,092	資本財	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	46	48	1,952	274,880	素材	
METLIFE INC	571	541	2,804	394,764	保険	
MEDTRONIC PLC	1,045	1,052	8,574	1,207,063	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	616	614	4,833	680,345	メディア・娯楽	
CVS HEALTH CORP	1,025	1,046	7,079	996,539	ヘルスケア機器・サービス	
MERCK & CO	1,970	2,012	22,354	3,146,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ON SEMICONDUCTOR CORP	317	344	2,985	420,285	半導体・半導体製造装置	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
LABORATORY CRP OF AMER	75	65	1,411	198,731	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	5,587	5,621	187,138	26,343,525	ソフトウェア・サービス
MICRON TECHNOLOGY	873	866	6,404	901,590	半導体・半導体製造装置
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	420	442	3,468	488,290	半導体・半導体製造装置
3 M COMPANY	448	430	4,171	587,170	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	50	41	395	55,731	耐久消費財・アパレル
ENTEGRIS INC	104	124	1,338	188,410	半導体・半導体製造装置
CHARLES RIVER LABORATORIES	42	42	816	114,879	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOTOROLA SOLUTIONS INC	129	130	3,703	521,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	112	126	2,485	349,849	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
XCEL ENERGY INC	437	437	2,813	396,045	公益事業
FORD MOTOR COMPANY	3,052	3,064	3,704	521,483	自動車・自動車部品
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	84	67	615	86,574	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	183	183	1,278	179,917	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	314	314	274	38,663	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	615	618	2,514	353,944	素材
NVR INC	2	2	1,387	195,323	耐久消費財・アパレル
NIKE B	994	993	10,683	1,503,944	耐久消費財・アパレル
NORDSON CORP	41	41	909	128,100	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	190	190	4,019	565,775	運輸
EVERSOURCE ENERGY	267	274	1,885	265,427	公益事業
NISOURCE INC	286	323	868	122,276	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	159	159	1,154	162,561	金融サービス
NORTHROP GRUMMAN CORP	117	115	5,080	715,129	資本財
WELLS FARGO & CO	3,118	3,049	12,575	1,770,192	銀行
NUCOR CORP	222	209	2,852	401,609	素材
CHENIERE ENERGY INC	190	182	2,533	356,704	エネルギー
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	332	295	3,035	427,309	金融サービス
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	699	578	3,406	479,582	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	80	73	2,306	324,642	運輸
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	54	51	4,776	672,391	一般消費財・サービス流通・小売り
ORACLE CORP	1,282	1,284	13,365	1,881,466	ソフトウェア・サービス
PACCAR INC	281	421	3,008	423,442	資本財
EXELON CORP	771	813	3,205	451,179	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	99	103	3,440	484,293	資本財
PAYCHEX INC	254	264	2,859	402,558	商業・専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	59	59	1,696	238,756	ヘルスケア機器・サービス
PPL CORPORATION	584	584	1,520	214,043	公益事業
PEPSICO INC	1,076	1,086	19,953	2,808,827	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	145	145	837	117,838	資本財
PFIZER	4,370	4,455	16,754	2,358,523	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ESSENTIAL UTILITIES INC	170	203	828	116,614	公益事業
CONOCOPHILLIPS	1,040	984	10,031	1,412,092	エネルギー
PG&E CORP	1,181	1,181	1,951	274,718	公益事業
PIONEER NATURAL RESOURCES	182	174	3,635	511,703	エネルギー
ALTRIA GROUP INC	1,429	1,421	6,339	892,415	食品・飲料・タバコ
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	329	320	3,806	535,880	銀行
BROWN & BROWN INC	198	198	1,249	175,880	保険

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
GARMIN LTD	128	128	1,334	187,875	耐久消費財・アパレル	
PPG INDUSTRIES INC	192	193	2,581	363,419	素材	
IPG PHOTONICS CORP	32	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COSTCO WHOLESALE CORP	344	352	17,895	2,519,167	生活必需品流通・小売り	
PRICE T ROWE GROUP INC	179	179	1,909	268,789	金融サービス	
QUEST DIAGNOSTICS	100	86	1,160	163,432	ヘルスケア機器・サービス	
PROCTER & GAMBLE CO	1,893	1,878	27,316	3,845,376	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	451	470	6,048	851,398	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	394	394	2,351	330,965	公益事業	
PULTE GROUP INC	216	167	1,103	155,286	耐久消費財・アパレル	
GLOBAL PAYMENTS INC	225	208	2,085	293,614	金融サービス	
QUALCOMM	878	893	9,858	1,387,789	半導体・半導体製造装置	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	154	154	1,442	203,085	金融サービス	
EXACT SCIENCES CORP	147	147	1,210	170,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RELIANCE STEEL & ALUMINUM	—	50	1,198	168,719	素材	
REGENERON PHARMACEUTICALS	81	86	6,246	879,292	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REPLIGEN CORP	—	43	744	104,796	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RESMED INC	114	111	2,406	338,727	ヘルスケア機器・サービス	
US BANCORP	1,090	1,110	3,404	479,263	銀行	
SEAGEN INC	100	109	2,124	299,095	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	297	297	2,110	297,101	保険	
ROSS STORES INC	280	280	2,902	408,544	一般消費財・サービス流通・小売り	
ROLLINS INC	174	174	687	96,711	商業・専門サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	83	81	3,687	519,141	ソフトウェア・サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	90	91	2,629	370,208	資本財	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	167	171	1,352	190,344	消費者サービス	
RPM INTERNATIONAL INC	104	104	837	117,869	素材	
ACCENTURE PLC-CL A	493	498	15,124	2,129,067	ソフトウェア・サービス	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,083	1,083	8,137	1,145,470	食品・飲料・タバコ	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	100	84	1,867	262,842	保険	
TRAVELERS COS INC/THE	197	185	3,190	449,194	保険	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	481	469	2,554	359,643	金融サービス	
BOOKING HOLDINGS INC	31	30	7,918	1,114,686	消費者サービス	
SCHLUMBERGER	1,071	1,117	4,971	699,861	エネルギー	
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,124	1,163	6,243	878,887	金融サービス	
POOL CORP	33	33	1,083	152,558	一般消費財・サービス流通・小売り	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	162	169	2,160	304,094	ヘルスケア機器・サービス	
BUNGE LIMITED	116	116	1,094	154,038	食品・飲料・タバコ	
SEI INVESTMENTS COMPANY	95	95	548	77,206	金融サービス	
ELEVANCE HEALTH INC	189	190	8,478	1,193,469	ヘルスケア機器・サービス	
AMERISOURCEBERGEN CORP	128	117	1,971	277,538	ヘルスケア機器・サービス	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	207	185	1,263	177,876	保険	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	197	193	4,431	623,799	素材	
CENTENE CORP	445	453	2,843	400,266	ヘルスケア機器・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	45	—	—	—	銀行	
SMITH (A. O.) CORP	90	90	601	84,616	資本財	
SNAP-ON INC	40	40	1,029	144,908	資本財	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	295	291	2,339	329,301	保険	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ADVANCE AUTO PARTS	53	46	517	72,874	一般消費財・サービス流通・小売り
EDISON INTL	280	303	1,991	280,293	公益事業
SOUTHERN CO	841	858	5,963	839,425	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	1,034	1,041	3,197	450,120	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	186	186	3,108	437,628	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	135	135	401	56,484	運輸
AT&T INC	5,555	5,695	8,828	1,242,753	電気通信サービス
CHEVRON CORP	1,507	1,461	22,524	3,170,707	エネルギー
STANLEY BLACK&DECKER	125	125	991	139,568	資本財
STATE STREET CORP	279	290	1,989	280,085	金融サービス
STARBUCKS CORP	915	909	8,958	1,261,135	消費者サービス
STEEL DYNAMICS INC	155	137	1,316	185,354	素材
STRYKER CORP	262	268	7,328	1,031,683	ヘルスケア機器・サービス
NETFLIX INC	344	350	13,269	1,868,002	メディア・娯楽
GEN DIGITAL INC	435	435	745	104,905	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	120	120	5,341	751,881	ソフトウェア・サービス
SYSCO CORP	402	393	2,783	391,808	生活必需品流通・小売り
INTUITIVE SURGICAL INC	276	282	8,666	1,219,946	ヘルスケア機器・サービス
TELEFLEX INC	39	39	914	128,672	ヘルスケア機器・サービス
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	804	921	686	96,631	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TERADYNE INC	123	123	1,277	179,833	半導体・半導体製造装置
TEXAS INSTRUMENTS	717	725	12,791	1,800,723	半導体・半導体製造装置
TEXTRON	169	169	1,063	149,726	資本財
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	306	311	16,252	2,287,800	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBE LIFE INC	81	81	853	120,087	保険
TORO CO	—	88	919	129,454	資本財
DAVITA INC	57	46	436	61,408	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	89	89	1,887	265,633	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE IMS HOLDINGS	211	177	836	117,699	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TYLER TECHNOLOGIES INC	33	33	1,314	185,004	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC	218	233	1,212	170,633	食品・飲料・タバコ
UGI CORP	180	180	509	71,783	公益事業
MARATHON OIL CORP	—	503	1,171	164,894	エネルギー
UNION PACIFIC CORP	507	488	9,430	1,327,548	運輸
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	1,172	1,174	10,954	1,542,118	資本財
UNITEDHEALTH GROUP INC	735	741	35,714	5,027,575	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	61	46	597	84,169	ヘルスケア機器・サービス
VF CORP	257	257	464	65,346	耐久消費財・アパレル
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	485	485	724	101,976	メディア・娯楽
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	200	206	6,825	960,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VULCAN MATERIALS CO	102	101	1,989	280,130	素材
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	597	597	1,793	252,486	生活必需品流通・小売り
WALMART INC	1,200	1,179	17,269	2,431,090	生活必需品流通・小売り
WASTE MANAGEMENT INC	327	325	5,242	737,996	商業・専門サービス
WATERS CORP	47	47	1,237	174,222	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	142	142	526	74,119	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	57	57	1,980	278,860	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	91	78	1,150	161,955	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
VAIL RESORTS INC	30	30	727	102,425	消費者サービス
WESTERN DIGITAL CORP	257	257	1,024	144,165	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WABTEC CORP	150	129	1,229	173,055	資本財
WEYERHAEUSER CO	582	597	1,686	237,451	エクイティ不動産投資信託(REIT)
WHIRLPOOL CORP	52	37	508	71,514	耐久消費財・アパレル
SKYWORKS SOLUTIONS INC	133	133	1,404	197,743	半導体・半導体製造装置
WYNN RESORTS LTD	93	93	940	132,423	消費者サービス
NASDAQ INC	96	289	1,570	221,122	金融サービス
CME GROUP INC	278	282	4,994	703,095	金融サービス
WILLIAMS COS	985	985	2,833	398,857	エネルギー
LKQ CORP	227	192	1,033	145,490	一般消費財・サービス流通・小売り
ALLIANT ENERGY CORPORATION	207	207	1,059	149,083	公益事業
WEC ENERGY GROUP INC	245	261	2,271	319,792	公益事業
CARMAX INC	120	135	985	138,669	一般消費財・サービス流通・小売り
TJX COMPANIES INC	931	917	7,065	994,678	一般消費財・サービス流通・小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	41	41	1,101	155,095	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	987	987	431	60,716	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	177	127	630	88,816	資本財
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	96	96	1,815	255,552	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIGNATURE BANK	46	—	—	—	銀行
CBRE GROUP INC-A	253	259	1,957	275,566	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC-A	155	155	253	35,689	電気通信サービス
REGIONS FINL CORP	708	708	1,259	177,229	銀行
DOMINO'S PIZZA INC	28	28	853	120,205	消費者サービス
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	35	35	1,839	258,927	半導体・半導体製造装置
WESTLAKE CORP	—	22	248	34,995	素材
LAS VEGAS SANDS CORP	243	255	1,440	202,751	消費者サービス
MOSAIC CO/THE	277	277	939	132,300	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	32	32	895	126,080	金融サービス
CELANESE CORP-SERIES A	85	85	921	129,772	素材
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	146	146	889	125,218	食品・飲料・タバコ
DEXCOM INC	76	306	3,525	496,313	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDIA GROUP INC	116	116	1,121	157,848	消費者サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	149	165	1,038	146,220	素材
AMERIPRISE FINANCIAL INC	87	87	2,690	378,678	金融サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	274	188	323	45,553	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	447	438	4,609	648,876	金融サービス
LIVE NATION ENTERTAINMENT	123	144	1,190	167,577	メディア・娯楽
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	21	21	4,471	629,429	消費者サービス
TRANSIGM GROUP INC	40	39	3,158	444,673	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	686	679	25,439	3,581,074	金融サービス
WESTERN UNION CO	292	—	—	—	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	86	64	709	99,849	資本財
LEIDOS HOLDINGS	112	112	900	126,828	商業・専門サービス
AERCAP HOLDINGS NV	110	110	632	88,984	資本財
FIRST SOLAR INC	—	79	1,598	224,981	半導体・半導体製造装置
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENT LTD-ADR	176	—	—	—	消費者サービス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	97	97	1,457	205,144	商業・専門サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
AECOM	—	104	805	113,423	資本財
DELTA AIR LINES INC	146	146	524	73,808	運輸
INSULET CORP	53	52	1,430	201,331	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	234	210	2,149	302,622	金融サービス
TE CONNECTIVITY LTD	260	244	3,006	423,278	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MASIMO CORP	41	41	652	91,856	ヘルスケア機器・サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	93	93	3,189	448,999	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	167	167	2,227	313,547	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	35	35	4,554	641,149	一般消費財・サービス流通・小売り
ULTA BEAUTY INC	39	39	1,647	231,912	一般消費財・サービス流通・小売り
INVESCO LTD	264	264	393	55,378	金融サービス
MSCI INC	65	65	3,101	436,592	金融サービス
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,212	1,240	11,272	1,586,806	食品・飲料・タバコ
VISA INC-CLASS A SHARES	1,306	1,288	28,986	4,080,456	金融サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	141	138	1,992	280,547	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	480	375	4,082	574,670	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	103	103	641	90,244	資本財
KINDER MORGAN INC	1,593	1,578	2,558	360,208	エネルギー
XYLEM INC	132	189	1,867	262,925	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	198	197	1,723	242,678	素材
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	35	35	708	99,797	資本財
SPLUNK INC	133	133	1,329	187,208	ソフトウェア・サービス
EPAM SYSTEMS INC	44	47	1,230	173,221	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	194	165	4,380	616,640	ヘルスケア機器・サービス
VERISK ANALYTICS INC	125	120	2,621	369,097	商業・専門サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	49	49	625	88,100	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	60	60	1,402	197,495	金融サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	137	—	—	—	銀行
NXP SEMICONDUCTORS NV	208	204	3,706	521,775	半導体・半導体製造装置
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	113	113	1,093	153,972	商業・専門サービス
TARGA RESOURCES CORP	—	172	1,196	168,480	エネルギー
LEAR CORP	52	52	674	94,973	自動車・自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	88	88	1,187	167,123	金融サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	193	193	1,067	150,269	商業・専門サービス
DOLLAR GENERAL CORP	186	176	3,627	510,657	生活必需品流通・小売り
FORTINET INC	106	518	3,512	494,447	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	667	2,130	41,158	5,793,887	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	52	52	601	84,673	資本財
ENPHASE ENERGY INC	101	110	1,820	256,272	半導体・半導体製造装置
GENERAL MOTORS CO	1,037	1,127	3,755	528,597	自動車・自動車部品
ALLY FINANCIAL INC	277	215	573	80,675	金融サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	—	63	1,262	177,723	金融サービス
APTIV PLC	207	213	1,968	277,046	自動車・自動車部品
PHILLIPS 66	355	376	3,570	502,594	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	63	—	—	—	ソフトウェア・サービス
META PLATFORMS INC-CLASS A	1,851	1,796	47,066	6,625,598	メディア・娯楽
IQVIA HOLDINGS INC	151	151	3,016	424,686	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIAMONDBACK ENERGY INC	132	132	1,737	244,636	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SERVICENOW INC	153	162	8,707	1,225,814	ソフトウェア・サービス
PALO ALTO NETWORKS INC	76	240	5,091	716,744	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	146	154	3,339	470,081	ソフトウェア・サービス
ABBVIE INC	1,376	1,403	19,311	2,718,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
T-MOBILE US INC	496	497	6,729	947,277	電気通信サービス
PTC INC	83	82	1,077	151,729	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	367	368	6,072	854,776	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEWS CORP-CLASS A	334	334	620	87,376	メディア・娯楽
CDW CORP/DE	108	108	1,895	266,880	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOWMET AEROSPACE INC	315	315	1,374	193,465	資本財
KEURIG DR PEPPER INC	525	621	1,952	274,823	食品・飲料・タバコ
TWILIO INC - A	128	128	771	108,646	ソフトウェア・サービス
COUPA SOFTWARE INC	60	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	833	833	857	120,653	メディア・娯楽
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	330	366	2,481	349,324	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	153	153	1,098	154,573	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM-A	63	63	181	25,567	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	135	135	386	54,345	メディア・娯楽
HUBBELL INC	—	44	1,289	181,496	資本財
OKTA INC	115	115	1,013	142,683	ソフトウェア・サービス
BLACK KNIGHT INC	115	115	647	91,141	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	627	773	2,156	303,611	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	118	1,299	182,976	食品・飲料・タバコ
AXON ENTERPRISE INC	—	53	1,046	147,287	資本財
BROADCOM INC	324	331	26,903	3,787,248	半導体・半導体製造装置
RINGCENTRAL INC-CLASS A	63	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	107	136	762	107,315	運輸
ARES MANAGEMENT CORP - A	—	127	1,088	153,278	金融サービス
MONGODB INC	46	53	1,508	212,406	ソフトウェア・サービス
BURLINGTON STORES INC	51	51	812	114,408	一般消費財・サービス流通・小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	360	360	300	42,234	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	112	112	1,862	262,180	ヘルスケア機器・サービス
TWITTER INC	630	—	—	—	メディア・娯楽
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	138	138	580	81,697	資本財
EVERGY INC	184	184	1,061	149,437	公益事業
ALLEGION PLC	76	76	814	114,596	資本財
CERIDIAN HCM HOLDING INC	106	106	666	93,858	商業・専門サービス
STERIS PLC	80	80	1,607	226,235	ヘルスケア機器・サービス
DOCUSIGN INC	149	149	823	115,895	ソフトウェア・サービス
WIX.COM LTD	50	50	389	54,763	ソフトウェア・サービス
DROPBOX INC-CLASS A	288	230	526	74,070	ソフトウェア・サービス
KKR & CO INC	399	442	2,288	322,151	金融サービス
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	43	43	165	23,327	金融サービス
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	170	165	1,094	154,065	ソフトウェア・サービス
MODERNA INC	273	261	3,295	463,942	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	218	208	2,873	404,524	消費者サービス
ARAMARK	209	166	659	92,875	消費者サービス
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	382	—	—	—	メディア・娯楽

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
DELL TECHNOLOGIES -C	224	224	1,090	153,517	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DOW INC	573	557	2,808	395,390	素材	
OVINTIV INC	—	209	723	101,800	エネルギー	
AMCOR PLC	1,114	1,102	1,079	151,997	素材	
PINTEREST INC- CLASS A	457	457	1,108	156,104	メディア・娯楽	
PELTON INTERACTIVE INC-A	217	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
NOVAVAX INC	57	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
FOX CORP - CLASS A	276	215	676	95,228	メディア・娯楽	
FOX CORP- CLASS B	103	103	302	42,595	メディア・娯楽	
CLARIVATE PLC	273	273	210	29,576	商業・専門サービス	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	144	166	2,571	361,923	ソフトウェア・サービス	
CHEWY INC - CLASS A	68	68	209	29,530	一般消費財・サービス流通・小売り	
AVANTOR INC	429	496	1,025	144,318	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LYFT INC-A	212	—	—	—	運輸	
DYNATRACE INC	147	147	735	103,474	ソフトウェア・サービス	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	202	202	1,240	174,569	ソフトウェア・サービス	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	90	90	625	88,048	金融サービス	
CARRIER GLOBAL CORP	631	681	2,786	392,323	資本財	
OTIS WORLDWIDE CORP	306	338	2,769	389,826	資本財	
INMODE LTD	55	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
UBER TECHNOLOGIES INC	1,136	1,195	4,595	646,941	運輸	
CORTEVA INC	585	554	3,056	430,298	素材	
FERGUSON PLC	—	160	2,364	332,806	資本財	
BILL HOLDINGS, INC.	57	74	731	102,962	ソフトウェア・サービス	
BLACKSTONE INC	545	569	4,878	686,694	金融サービス	
FIVERR INTERNATIONAL LTD	14	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	34	590	83,173	商業・専門サービス	
CARLYLE GROUP INC/THE	125	156	437	61,650	金融サービス	
10X GENOMICS INC-CLASS A	56	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DATADOG INC - CLASS A	170	201	1,875	264,079	ソフトウェア・サービス	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	150	165	1,032	145,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UPSTART HOLDINGS INC	31	—	—	—	金融サービス	
INGERSOLL-RAND INC	315	315	1,858	261,647	資本財	
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	—	299	2,346	330,345	ヘルスケア機器・サービス	
PAYCOM SOFTWARE INC	42	42	1,189	167,491	商業・専門サービス	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	133	269	407	57,405	自動車・自動車部品	
DRAFTKINGS INC	276	—	—	—	消費者サービス	
ASANA INC - CL A	49	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
UNITY SOFTWARE INC	43	219	605	85,287	ソフトウェア・サービス	
AON PLC	175	166	5,184	729,772	保険	
SOFI TECHNOLOGIES INC	389	—	—	—	金融サービス	
WARNER BROS DISCOVERY INC	1,753	1,774	2,029	285,707	メディア・娯楽	
TEXAS PACIFIC LAND CORP	—	5	700	98,665	エネルギー	
WOLFSPEED INC	—	102	525	73,919	半導体・半導体製造装置	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	139	139	669	94,215	ソフトウェア・サービス	
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	28	95	545	76,728	金融サービス	
AFFIRM HOLDINGS INC	128	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
IAC INC	67	—	—	—	メディア・娯楽	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AIRBNB INC-CLASS A	230	299	3,197	450,107	消費者サービス
ZENDESK INC	88	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONSTELLATION ENERGY	257	251	2,105	296,434	公益事業
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	261	300	974	137,122	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROBLOX CORP -CLASS A	—	280	1,125	158,468	メディア・娯楽
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	219	219	515	72,501	メディア・娯楽
VIATRIS INC	907	897	817	115,058	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAESARS ENTERTAINMENT INC	175	175	740	104,191	消費者サービス
CHESAPEAKE ENERGY CORP	—	84	658	92,691	エネルギー
HF SINCLAIR CORP	—	134	576	81,173	エネルギー
SNOWFLAKE INC-CLASS A	166	176	2,652	373,346	ソフトウェア・サービス
DOORDASH INC - A	83	192	1,295	182,389	消費者サービス
ARISTA NETWORKS INC	188	186	3,181	447,805	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	268	318	2,083	293,349	金融サービス
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	1,252	1,252	1,709	240,657	ソフトウェア・サービス
FNF GROUP	204	204	710	100,032	保険
JACOBS SOLUTIONS INC	—	106	1,215	171,100	商業・専門サービス
MARVELL TECHNOLOGY INC	633	655	4,294	604,556	半導体・半導体製造装置
APA CORP	—	233	781	110,015	エネルギー
LINDE PLC	—	392	13,981	1,968,139	素材
ROBINHOOD MARKETS INC - A	130	—	—	—	金融サービス
LUCID GROUP INC	312	312	245	34,602	自動車・自動車部品
U-HAUL HOLDING CO	—	66	372	52,475	運輸
ASPEN TECHNOLOGY INC	—	23	392	55,268	ソフトウェア・サービス
TOAST INC-CLASS A	—	203	435	61,334	金融サービス
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	830	1,130	343	48,362	運輸
CATALENT INC	137	137	509	71,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	453	361	1,116	157,101	金融サービス
ATLASSIAN CORP-CL A	—	118	1,969	277,275	ソフトウェア・サービス
HORIZON THERAPEUTICS PLC	179	179	1,785	251,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	322	395	1,067	150,270	銀行
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	31	31	480	67,591	ソフトウェア・サービス
WAYFAIR INC- CLASS A	60	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	149	138	2,236	314,851	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUBSPOT INC	36	36	1,809	254,678	ソフトウェア・サービス
QORVO INC	85	85	855	120,490	半導体・半導体製造装置
LIBERTY BROADBAND-A	25	—	—	—	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	112	91	686	96,660	メディア・娯楽
BIO-TECHNE CORP	32	129	1,083	152,570	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ZILLOW GROUP INC-A	54	—	—	—	エクイティ不動産投資信託(REIT)
SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	37	41	1,223	172,241	半導体・半導体製造装置
GODADDY INC - CLASS A	137	113	823	115,983	ソフトウェア・サービス
KORNIT DIGITAL LTD	27	—	—	—	資本財
ETSY INC	102	102	880	123,940	一般消費財・サービス流通・小売り
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	566	537	3,328	468,486	資本財
TRANSUNION	157	157	1,139	160,428	商業・専門サービス
ALCOA CORP	—	155	522	73,509	素材
BLOCK INC	396	430	2,540	357,606	金融サービス

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
DUPONT DE NEMOURS INC	409	383	2,593	365,149	素材	
CARVANA CO	57	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	153	153	967	136,261	食品・飲料・タバコ	
TELADOC HEALTH INC	113	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WESTROCK CO	213	213	608	85,588	素材	
KRAFT HEINZ CO/THE	521	567	2,174	306,162	食品・飲料・タバコ	
NOVOCURE LTD	79	79	583	82,146	ヘルスケア機器・サービス	
FORTIVE CORP	257	254	1,722	242,494	資本財	
MATCH GROUP INC	201	227	775	109,141	メディア・娯楽	
WASTE CONNECTIONS INC	212	197	2,737	385,406	商業・専門サービス	
ALPHABET INC-CL A	235	4,742	59,101	8,319,756	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	987	974	1,494	210,395	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PAYPAL HOLDINGS INC	882	867	5,223	735,369	金融サービス	
SEA LTD-ADR	251	283	1,703	239,827	メディア・娯楽	
EQUITABLE HOLDINGS INC	273	279	711	100,133	金融サービス	
SUNRUN INC	139	—	—	—	資本財	
ZILLOW GROUP INC-C	134	134	603	84,960	不動産管理・開発	
ALPHABET INC-CL C	223	4,339	54,436	7,662,972	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	62	72	940	132,462	ソフトウェア・サービス	
MONSTER BEVERAGE CORP	322	606	3,495	492,067	食品・飲料・タバコ	
CABLE ONE INC	4	—	—	—	メディア・娯楽	
LINDE PLC	401	—	—	—	素材	
ROKU INC	91	91	511	71,974	メディア・娯楽	
AVALARA INC	68	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	98	87	2,890	406,874	メディア・娯楽	
VISTRA CORP	377	317	777	109,439	公益事業	
小 計	250,077	269,138	2,886,926	406,392,657		
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	606	601	—	<69.9%>		
(カナダ)			千カナダドル			
AGNICO EAGLE MINES	363	363	2,524	261,189	素材	
BARRICK GOLD CORP	1,390	1,337	3,094	320,120	素材	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	197	—	—	—	資本財	
BANK MONTREAL	513	544	6,249	646,550	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	965	933	6,235	645,077	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	272	272	2,731	282,587	銀行	
BCE INC	62	62	383	39,702	電気通信サービス	
BROOKFIELD CORP	1,105	1,144	4,906	507,538	金融サービス	
BAUSCH HEALTH COS INC	208	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAPUTO INC	208	208	738	76,423	食品・飲料・タバコ	
BLACKBERRY LIMITED	394	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	—	69	732	75,818	ソフトウェア・サービス	
CGI INC - CL A	161	160	2,261	233,909	ソフトウェア・サービス	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	131	131	862	89,179	素材	
CAE INC	259	259	779	80,634	資本財	
CAMECO CORP	268	317	1,184	122,514	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	261	303	1,868	193,320	電気通信サービス	
CANADIAN IMPERIAL BANK	689	739	4,252	439,950	銀行	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	931	879	6,668	689,874	エネルギー	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	35	45	762	78,854	一般消費財・サービス流通・小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	103	103	374	38,790	公益事業
CANADIAN NATL RAILWAY CO	554	460	7,142	738,905	運輸
GILDAN ACTIVEWEAR INC	170	170	659	68,181	耐久消費財・アパレル
OPEN TEXT CORP	204	204	1,161	120,176	ソフトウェア・サービス
EMPIRE CO LTD 'A'	152	152	540	55,937	生活必需品流通・小売り
RB GLOBAL INC	102	102	748	77,411	商業・専門サービス
FORTIS INC	368	355	2,042	211,299	公益事業
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	430	433	1,325	137,169	素材
TELUS CORP	329	329	866	89,670	電気通信サービス
GREAT-WEST LIFE CO INC	237	237	933	96,539	保険
IMPERIAL OIL	165	164	1,055	109,146	エネルギー
ENBRIDGE	1,564	1,590	7,768	803,663	エネルギー
IGM FINANCIAL INC	76	76	299	30,957	金融サービス
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,478	1,433	3,659	378,561	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	129	129	1,560	161,437	生活必需品流通・小売り
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	674	654	4,411	456,402	生活必需品流通・小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	232	202	1,421	147,046	自動車・自動車部品
SUN LIFE FINANCIAL INC	457	484	3,242	335,445	保険
FAIRFAX FINANCIAL HDGS LTD	21	17	1,740	180,075	保険
METRO INC	188	188	1,384	143,270	生活必需品流通・小売り
EMERA INC	187	232	1,309	135,448	公益事業
ONEX CORP	66	66	410	42,487	金融サービス
TC ENERGY CORP	773	784	4,243	438,986	エネルギー
PAN AMERICAN SILVER CORP	184	184	372	38,511	素材
POWER CORP OF CANADA	435	435	1,544	159,764	保険
QUEBECOR INC -CL B	152	152	497	51,481	メディア・娯楽
ROYAL BANK OF CANADA	1,106	1,095	13,485	1,395,062	銀行
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	737	728	7,645	790,896	運輸
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	354	—	—	—	メディア・娯楽
SUNCOR ENERGY	1,162	1,092	4,244	439,095	エネルギー
LUNDIN MINING CORP	622	622	631	65,291	素材
TECK RESOURCES LTD-CL B	347	353	1,846	190,977	素材
THOMSON REUTERS CORP	132	132	2,248	232,594	商業・専門サービス
TOROMONT INDUSTRIES LTD	55	52	558	57,784	資本財
TORONTO-DOMINION BANK	1,414	1,425	11,153	1,153,825	銀行
WEST FRASER TIMBER CO LTD	78	35	340	35,225	素材
WESTON (GEORGE) LTD	52	52	861	89,171	生活必需品流通・小売り
KINROSS GOLD CORP	1,084	1,084	700	72,476	素材
INTACT FINANCIAL CORP	133	132	2,685	277,797	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	342	372	2,264	234,291	素材
CONSTELLATION SOFTWARE INC	15	16	4,313	446,184	ソフトウェア・サービス
FRANCO-NEVADA CORP	153	153	3,048	315,317	素材
TFI INTERNATIONAL INC	58	58	864	89,422	運輸
TOURMALINE OIL CORP	221	250	1,486	153,782	エネルギー
KEYERA CORP	186	186	570	58,998	エネルギー
PARKLAND CORP	140	140	471	48,777	エネルギー
ALTAGAS INCOME LTD	243	243	556	57,615	公益事業

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PEMBINA PIPELINE CORP	456	456	1,913	197,989	エネルギー	
DOLLARAMA INC	220	220	1,842	190,583	一般消費財・サービス流通・小売り	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	518	518	584	60,467	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	966	1,112	2,525	261,235	エネルギー	
ARC RESOURCES LTD	—	548	927	95,968	エネルギー	
NORTHLAND POWER INC	178	178	531	54,966	公益事業	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORPORATION	—	325	656	67,911	金融サービス	
TMX GROUP LTD	46	46	686	70,974	金融サービス	
BRP INC/CA- SUB VOTING	—	30	307	31,790	耐久消費財・アパレル	
IVANHOE MINES LTD-CL A	518	518	553	57,282	素材	
NUTRIEN LTD	447	415	3,159	326,824	素材	
LIGHTSPEED COMMERCE INC	82	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
WSP GLOBAL INC	86	99	1,725	178,462	資本財	
IA FINANCIAL CORP INC	100	69	611	63,227	保険	
FIRSTSERVICE CORP	26	26	530	54,863	不動産管理・開発	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	135	135	673	69,645	商業・専門サービス	
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	43	43	186	19,252	金融サービス	
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	112	112	515	53,293	公益事業	
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	—	290	1,227	126,966	金融サービス	
AIR CANADA	138	138	300	31,061	運輸	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	230	230	2,300	237,950	消費者サービス	
SHOPIFY INC - CLASS A	87	956	7,714	798,068	ソフトウェア・サービス	
CANOPY GROWTH CORP	209	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HYDRO ONE LTD	232	288	1,115	115,444	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	31,347	32,113	187,518	19,398,834	
(ドイツ)		86	85	—	<3.3%>	
ADIDAS AG	147	126	1,963	296,247	耐久消費財・アパレル	
COMMERZBANK AG	818	818	796	120,136	銀行	
FRESENIUS SE&CO KGAA	336	336	901	135,934	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	95	95	133	20,175	電気通信サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	57	—	—	—	素材	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	43	44	888	134,028	保険	
GEA GROUP AG	133	133	522	78,844	資本財	
CONTINENTAL AG	81	81	547	82,523	自動車・自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	787	812	3,422	516,272	運輸	
MERCK KGAA	105	105	1,743	262,937	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
RWE STAMM	496	503	1,963	296,237	公益事業	
SAP SE	812	825	10,123	1,526,982	ソフトウェア・サービス	
E.ON SE	1,703	1,866	2,078	313,561	公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	87	87	598	90,322	家庭用品・パーソナル用品	
PUMA SE	92	92	415	62,625	耐久消費財・アパレル	
BAYER	760	766	4,168	628,769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	144	144	1,101	166,136	家庭用品・パーソナル用品	
BASF SE	711	738	3,463	522,463	素材	
BEIERSDORF AG	74	74	922	139,083	家庭用品・パーソナル用品	
HEIDELBERG MATERIALS AG	130	100	682	103,003	素材	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	144	169	683	103,121	ヘルスケア機器・サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種			
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額					
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)				
ALLIANZ SE-REG	320	318	6,600	995,620	保険			
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	453	453	418	63,074	運輸			
MUENCHENER RUECKVERSICH.	107	111	3,734	563,305	保険			
RHEINMETALL AG	—	36	905	136,638	資本財			
VOLKSWAGEN STAMM	24	24	365	55,179	自動車・自動車部品			
VOLKSWAGEN AG-PFD	142	152	1,830	276,081	自動車・自動車部品			
MERCEDES-BENZ GROUP AG	667	625	4,467	673,866	自動車・自動車部品			
NEMETSCHK SE	54	54	394	59,540	ソフトウェア・サービス			
SIEMENS	594	607	9,524	1,436,639	資本財			
DEUTSCHE BANK NAMEN	1,606	1,571	1,530	230,869	金融サービス			
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	261	267	2,789	420,783	自動車・自動車部品			
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	49	49	489	73,891	自動車・自動車部品			
DEUTSCHE TELEKOM	2,581	2,566	5,400	814,675	電気通信サービス			
SARTORIUS AG-VORZUG	18	18	578	87,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス			
INFINEON TECHNOLOGIES	1,018	1,053	3,638	548,844	半導体・半導体製造装置			
RATIONAL AG	4	4	301	45,534	資本財			
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	34	34	371	56,058	ヘルスケア機器・サービス			
BECHTLE AG	76	76	283	42,826	ソフトウェア・サービス			
DEUTSCHE BOERSE	149	156	2,583	389,730	金融サービス			
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	117	117	639	96,482	自動車・自動車部品			
LANXESS	72	—	—	—	素材			
MTU AERO ENGINES AG	39	39	879	132,733	資本財			
SYMRISE AG	97	100	1,036	156,400	素材			
BRENTAG SE	125	125	933	140,853	資本財			
EVONIK INDUSTRIES AG	160	160	315	47,582	素材			
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	987	987	265	40,099	電気通信サービス			
LEG IMMOBILIEN SE	52	52	260	39,330	不動産管理・開発			
KION GROUP AG	58	—	—	—	資本財			
VONOVIA SE	590	525	918	138,557	不動産管理・開発			
KNORR-BREMSE AG	50	50	331	49,996	資本財			
SIEMENS HEALTHINEERS AG	215	215	1,157	174,564	ヘルスケア機器・サービス			
DR ING HC F PORSCHE AG	—	94	1,108	167,240	自動車・自動車部品			
SIEMENS ENERGY AG	268	368	890	134,259	資本財			
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	333	334	951	143,483	資本財			
ZALANDO SE	176	176	501	75,643	一般消費財・サービス流通・小売り			
SCOUT24 SE	74	74	445	67,195	メディア・娯楽			
COVESTRO AG	144	144	561	84,636	素材			
HELLOFRESH SE	138	138	309	46,665	生活必需品流通・小売り			
UNIPER SE	73	—	—	—	公益事業			
DELIVERY HERO SE	134	134	501	75,684	消費者サービス			
国 小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	19,845	19,947	95,341	14,381,278	—	<2.5%>
(イタリア)								
ASSICURAZIONI GENERALI	856	826	1,482	223,651	保険			
INTESA SANPAOLO	12,510	12,475	2,800	422,449	銀行			
UNICREDIT SPA	1,683	1,498	2,804	422,993	銀行			
MEDIOBANCA	539	539	563	85,062	銀行			
ENEL	6,179	6,308	3,755	566,533	公益事業			

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ENI	1,976	1,982	2,615	394,535	エネルギー	
SNAM SPA	1,475	1,475	725	109,374	公益事業	
TELECOM ITALIA ORD	8,525	8,525	220	33,242	電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	359	—	—	—	運輸	
TERNA SPA	1,028	1,238	955	144,183	公益事業	
RECORDATI SPA	98	101	439	66,231	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPLIFON SPA	116	116	384	57,990	ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	211	211	747	112,770	資本財	
DIASORIN ITALIA SPA	20	20	205	30,980	ヘルスケア機器・サービス	
MONCLER SPA	143	145	921	139,015	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	314	484	364	55,039	金融サービス	
FINECOBANK SPA	531	415	516	77,843	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	460	460	450	68,022	保険	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	303	303	356	53,767	電気通信サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	37,335 19	37,131 18	20,310 —	3,063,689 <0.5%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD	166	166	502	75,746	資本財	
AIR LIQUIDE	369	412	6,571	991,172	素材	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	510	492	1,328	200,375	公益事業	
LOREAL	198	191	7,867	1,186,774	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH	215	220	18,578	2,802,445	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT AVIATION SA	21	21	350	52,852	資本財	
THALES SA	74	85	1,142	172,356	資本財	
CAPGEMINI SA	127	134	2,115	319,089	ソフトウェア・サービス	
PUBLICIS GROUPE	170	172	1,208	182,258	メディア・娯楽	
FAURECIA	109	—	—	—	自動車・自動車部品	
BOLLORE SE	836	836	489	73,873	メディア・娯楽	
MICHELIN	138	553	1,524	229,956	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	159	166	3,510	529,561	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	173	173	576	87,025	自動車・自動車部品	
REMY COINTREAU	13	25	373	56,310	食品・飲料・タバコ	
SEB SA	22	22	218	32,941	耐久消費財・アパレル	
VINCI S. A.	410	413	4,483	676,307	資本財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	417	426	6,993	1,054,966	資本財	
VIVENDI SE	612	612	520	78,503	メディア・娯楽	
TOTALENERGIES SE	1,945	1,959	10,926	1,648,179	エネルギー	
VALEO SA	215	165	320	48,339	自動車・自動車部品	
ORANGE	1,538	1,490	1,698	256,132	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	25	25	4,929	743,542	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	527	527	2,148	324,065	ソフトウェア・サービス	
KERING	58	59	3,104	468,304	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	162	—	—	—	保険	
CARREFOUR	525	525	924	139,492	生活必需品流通・小売り	
SANOFI	880	900	8,955	1,350,854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR	144	144	451	68,134	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	633	633	1,509	227,732	銀行	
TELEPERFORMANCE	47	47	695	104,969	商業・専門サービス	

銘柄	当期首(前期末)		期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
EURAZEO SA	33	33	211	31,850	金融サービス	
SODEXO	60	61	628	94,743	消費者サービス	
AXA SA	1,485	1,456	3,946	595,301	保険	
ESSILORLUXOTTICA	220	226	4,009	604,772	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT AGRICOLE SA	895	994	1,184	178,667	銀行	
BNP PARIBAS	867	899	5,064	763,974	銀行	
ORPEA	43	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
SAINT-GOBAIN	400	400	2,149	324,273	資本財	
WENDEL	20	20	201	30,469	金融サービス	
DANONE (GROUPE)	515	515	2,946	444,404	食品・飲料・タバコ	
SAFRAN SA	261	264	3,680	555,187	資本財	
ENGIE	1,415	1,456	2,024	305,309	公益事業	
ALSTOM	243	243	647	97,595	資本財	
ELECTRICITE DE FRANCE	395	—	—	—	公益事業	
IPSEN	35	35	392	59,137	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ARKEMA	43	43	374	56,557	素材	
LEGRAND SA	217	217	1,922	290,063	資本財	
EIFFAGE	59	59	600	90,608	資本財	
ADP	23	23	338	51,020	運輸	
UBISOFT ENTERTAINMENT	70	—	—	—	メディア・娯楽	
BUREAU VERITAS SA	250	250	612	92,318	商業・専門サービス	
GETLINK	293	352	588	88,799	運輸	
EDENRED	186	201	1,212	182,922	金融サービス	
BIOMERIEUX	30	30	290	43,877	ヘルスケア機器・サービス	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	81	81	302	45,618	消費者サービス	
WORLDLINE SA	203	203	786	118,565	金融サービス	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	19	25	617	93,124	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMUNDI SA	46	46	262	39,529	金融サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	19,874	19,752	129,017	19,460,961	
	銘 柄 数 < 比 率 >	59	54	—	< 3.3% >	
(オランダ)						
AIRBUS SE	458	465	5,851	882,664	資本財	
ASM INTERNATIONAL NV	34	39	1,608	242,701	半導体・半導体製造装置	
RANDSTAD NV	75	105	495	74,771	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	791	861	2,620	395,258	生活必需品流通・小売り	
AKZO NOBEL	153	153	1,105	166,776	素材	
WOLTERS KLUWER	208	206	2,219	334,748	商業・専門サービス	
QIAGEN N.V.	170	170	728	109,816	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KONINKLIJKE DSM NV	137	—	—	—	素材	
AEGON	1,146	1,487	645	97,350	保険	
ASML HOLDING NV	322	318	21,730	3,277,804	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	2,829	2,829	917	138,400	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	550	550	2,240	337,955	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS	717	718	1,307	197,180	ヘルスケア機器・サービス	
ING GROEP NV-CVA	3,016	2,938	3,566	537,938	銀行	
HEINEKEN NV	201	201	2,006	302,710	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	92	68	568	85,695	食品・飲料・タバコ	
OCI NV	—	72	161	24,434	素材	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FERRARI NV	101	101	2,763	416,799	自動車・自動車部品
CNH INDUSTRIAL NV	810	810	1,006	151,796	資本財
PROSUS	724	648	4,198	633,235	一般消費財・サービス流通・小売り
JDE PEET'S BV	70	70	192	28,994	食品・飲料・タバコ
EXOR NV	—	78	609	91,923	金融サービス
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	490	512	627	94,684	食品・飲料・タバコ
EURONEXT NV	64	64	410	61,969	金融サービス
IMCD NV	46	46	661	99,826	資本財
NN GROUP NV	226	226	787	118,860	保険
ARGENX SE	34	41	1,562	235,704	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	612	536	1,006	151,852	メディア・娯楽
STELLANTIS NV	1,597	1,757	2,596	391,705	自動車・自動車部品
JUST EAT TAKEAWAY	155	155	239	36,111	消費者サービス
ABN AMRO BANK NV-CVA	399	276	400	60,385	銀行
EXOR NV	78	—	—	—	金融サービス
ADYEN NV	15	17	2,668	402,529	金融サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	16,334 31	16,532 31	67,505 —	10,182,589 <1.8%>
(スペイン)					
IBERDROLA SA	4,494	4,864	5,589	843,131	公益事業
ENDESA	259	259	518	78,273	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA	5,348	4,724	3,061	461,811	銀行
ACCIONA SA	—	21	349	52,670	公益事業
NATURGY ENERGY GROUP SA	100	100	261	39,378	公益事業
REPSOL SA	1,111	1,111	1,452	219,138	エネルギー
BANCO SANTANDER SA	13,394	13,066	4,177	630,136	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA	306	306	484	73,090	公益事業
TELEFONICA	4,179	4,314	1,695	255,681	電気通信サービス
INDITEX	873	873	2,718	410,052	一般消費財・サービス流通・小売り
ENAGAS	156	216	380	57,412	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	224	—	—	—	資本財
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	211	156	486	73,308	資本財
GRIFOLS SA	276	276	314	47,376	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FERROVIAL SA	339	370	1,072	161,797	資本財
CAIXABANK	3,304	3,367	1,200	181,055	銀行
EDP RENOVAVEIS SA	214	214	405	61,164	公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	355	353	2,377	358,562	消費者サービス
CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA	—	54	170	25,669	公益事業
FERROVIAL SA-RTS	339	—	—	—	資本財
EDP RENOVAVEIS SA-BONUS RIGH	—	214	5	854	公益事業
AENA SME SA	55	55	808	121,882	運輸
CELLNEX TELECOM SA	414	477	1,777	268,103	電気通信サービス
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	35,960 20	35,400 21	29,306 —	4,420,553 <0.8%>
(ベルギー)					
UMICORE	176	176	483	73,000	素材
D'IETEREN GROUP	—	22	366	55,345	一般消費財・サービス流通・小売り
KBC GROEP NV	186	214	1,321	199,326	銀行

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
SOFINA	12	12	246	37,198	金融サービス	
SOLVAY SA	53	53	543	82,001	素材	
UCB (GROUPE)	93	93	780	117,689	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	54	—	—	—	生活必需品流通・小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	85	85	622	93,966	金融サービス	
AGEAS	110	110	447	67,523	保険	
PROXIMUS	131	—	—	—	電気通信サービス	
ELIA GROUP SA/NV	29	31	365	55,198	公益事業	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	687	676	3,594	542,211	食品・飲料・タバコ	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,619	1,475	8,773	1,323,462	
		11	10	—	<0.2%>	
(オーストリア)						
OMV AG	125	125	542	81,848	エネルギー	
VERBUND AG	64	64	445	67,214	公益事業	
VOESTALPINE AG	71	71	213	32,148	素材	
ERSTE GROUP BANK AG	239	253	780	117,663	銀行	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	124	—	—	—	銀行	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	625	515	1,981	298,875	
		5	4	—	<0.1%>	
(ルクセンブルク)						
EUROFINS SCIENTIFIC	102	102	628	94,807	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TENARIS SA	406	406	486	73,453	エネルギー	
ARCELORMITTAL	552	410	998	150,607	素材	
AROUNDTOWN SA	640	640	59	8,997	不動産管理・開発	
INPOST SA	124	—	—	—	運輸	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,826	1,560	2,173	327,865	
		5	4	—	<0.1%>	
(フィンランド)						
KESKO OYJ-B SHS	200	200	352	53,240	生活必需品流通・小売り	
WARTSILA OYJ	419	419	445	67,147	資本財	
UPM KYMMENE OYJ	423	423	1,244	187,757	素材	
STORA ENSO OYJ R	421	421	507	76,520	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	386	386	1,662	250,720	保険	
FORTUM OYJ	325	325	408	61,544	公益事業	
ELISA A	102	102	545	82,315	電気通信サービス	
NOKIA OYJ	4,276	4,519	1,722	259,832	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OIL OYJ	321	327	1,185	178,866	エネルギー	
KONE OYJ-B	263	263	1,277	192,670	資本財	
ORION OYJ-CLASS B	98	98	402	60,673	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METSO CORPORATION	—	519	529	79,802	資本財	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	7,238	8,008	10,283	1,551,093	
		11	12	—	<0.3%>	
(アイルランド)						
KINGSPAN GROUP PLC	123	123	784	118,378	資本財	
CRH PLC	596	604	2,733	412,350	素材	
KERRY GROUP PLC-A	130	130	1,217	183,657	食品・飲料・タバコ	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	195	195	667	100,645	素材	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	—	883	779	117,578	銀行	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
AIB GROUP PLC	—	882	336	50,745	銀行	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	130	125	2,329	351,428	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1,176 5	2,946 7	8,849 —	1,334,784 <0.2%>	
(ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	2,257	2,257	1,025	154,734	公益事業	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	279	396	412	62,159	エネルギー	
JERONIMO MARTINS	249	249	560	84,586	生活必需品流通・小売り	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2,785 3	2,903 3	1,998 —	301,480 <0.1%>	
(その他)						
DSM-FIRMENICH AG	—	137	1,516	228,755	素材	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	137 1	1,516 —	228,755 <0.0%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	144,622 228	146,311 222	377,057 —	56,875,388 <9.8%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
ANTOFAGASTA PLC	358	298	414	72,088	素材	
ASHTAD GROUP PLC	341	333	1,639	284,901	資本財	
SEVERN TRENT PLC	224	174	476	82,745	公益事業	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	732	732	346	60,268	耐久消費財・アパレル	
BUNZL PLC	248	291	930	161,661	資本財	
AVIVA PLC	2,253	2,403	964	167,624	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	109	109	681	118,413	素材	
DIAGEO	1,805	1,794	6,278	1,090,970	食品・飲料・タバコ	
SCHRODERS PLC	117	828	378	65,773	金融サービス	
DCC PLC	66	66	311	54,198	資本財	
BAE SYSTEMS PLC	2,601	2,401	2,281	396,534	資本財	
BRITISH AMERICAN TOBACCO	1,682	1,697	4,533	787,809	食品・飲料・タバコ	
HALMA PLC	310	310	744	129,302	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
STANDARD CHARTERED PLC	2,124	1,901	1,234	214,587	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	760	684	1,188	206,514	食品・飲料・タバコ	
JOHNSON MATTHEY PLC	168	168	301	52,420	素材	
ANGLO AMERICAN PLC	1,021	1,013	2,349	408,304	素材	
COMPASS GROUP PLC	1,424	1,424	3,156	548,449	消費者サービス	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	15,838	15,754	9,622	1,672,170	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP	4,607	4,907	1,119	194,521	保険	
UNILEVER PLC	2,019	2,004	8,357	1,452,226	家庭用品・パーソナル用品	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	585	505	508	88,288	公益事業	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	257	257	479	83,239	食品・飲料・タバコ	
PEARSON	663	553	442	76,902	消費者サービス	
PERSIMMON PLC	256	256	314	54,721	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL	2,109	2,122	2,387	414,883	保険	
RIO TINTO PLC REG	871	886	4,364	758,339	素材	
VODAFONE GROUP PLC	22,047	20,547	1,632	283,750	電気通信サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	546	560	3,596	624,928	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	1,495	1,494	3,718	646,083	商業・専門サービス	

銘柄	当期首(前期末)	期 末				業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
RENTOKIL INITIAL PLC	1,404	2,124	1,344	233,646	商業・専門サービス	
NATWEST GROUP PLC	4,437	4,120	1,102	191,515	銀行	
ST JAMES'S PLACE PLC	409	409	455	79,133	金融サービス	
SSE PLC	816	816	1,497	260,276	公益事業	
BP PLC	15,556	14,405	6,870	1,193,814	エネルギー	
SAGE GROUP PLC	766	766	657	114,216	ソフトウェア・サービス	
SMITHS GROUP PLC	264	264	434	75,544	資本財	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	54,438	52,546	2,391	415,505	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	2,641	2,641	305	53,075	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	6,010	6,010	1,585	275,524	生活必需品流通・小売り	
3I GROUP PLC	747	747	1,448	251,756	金融サービス	
SMITH & NEPHEW PLC	685	685	840	146,076	ヘルスケア機器・サービス	
GSK PLC	3,888	3,186	4,436	771,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WPP PLC	958	858	749	130,191	メディア・娯楽	
ASTRAZENECA	1,202	1,231	14,516	2,522,568	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	7,167	4,791	690	119,943	電気通信サービス	
NATIONAL GRID PLC	2,860	2,869	3,126	543,283	公益事業	
BARCLAYS	13,395	12,521	1,969	342,294	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	138	138	590	102,653	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	297	297	659	114,607	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	114	110	706	122,823	一般消費財・サービス流通・小売り	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	6,359	6,359	947	164,703	資本財	
KINGFISHER PLC	1,537	1,537	355	61,756	一般消費財・サービス流通・小売り	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	247	302	2,570	446,657	金融サービス	
SAINSBURY (J) PLC	1,483	1,483	407	70,884	生活必需品流通・小売り	
ADMIRAL GROUP PLC	162	162	376	65,503	保険	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	76	69	276	48,019	耐久消費財・アパレル	
INTERCONTINENTAL HOTELS	125	148	792	137,744	消費者サービス	
WHITBREAD PLC	174	174	567	98,671	消費者サービス	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	164	164	304	52,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABRDN PLC	1,534	1,534	309	53,802	金融サービス	
EXPERIAN PLC	741	741	2,095	364,217	商業・専門サービス	
MONDI PLC	367	417	534	92,954	素材	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	330	330	264	46,008	金融サービス	
OCADO GROUP PLC	358	547	222	38,723	生活必需品流通・小売り	
GLENCORE PLC	7,673	8,335	3,522	612,091	素材	
ENTAIN PLC	496	496	695	120,911	消費者サービス	
COCA-COLA HBC AG-CDI	179	179	434	75,588	食品・飲料・タバコ	
AVEVA GROUP PLC	109	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	510	510	283	49,275	保険	
FERGUSON PLC	177	—	—	—	資本財	
M&G PLC	2,291	2,291	454	78,966	金融サービス	
INFORMA PLC	1,105	1,105	780	135,606	メディア・娯楽	
HALEON PLC	—	4,050	1,336	232,269	家庭用品・パーソナル用品	
SHELL PLC-NEW	5,982	5,620	13,221	2,297,511	エネルギー	
AUTO TRADER GROUP PLC	724	724	453	78,874	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	55	55	611	106,308	資本財	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MELROSE INDUSTRIES PLC	3,197	—	—	—	資本財
JD SPORTS FASHION PLC	2,068	2,068	312	54,269	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	224,085	217,441	143,271	24,896,339	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	78	76	—	<4.3%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SIKA AG-BR	109	117	2,946	457,789	素材
SGS SA	5	126	1,033	160,557	商業・専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG-REG	2	2	531	82,536	食品・飲料・タバコ
SWISSCOM	21	18	1,067	165,816	電気通信サービス
GEBERIT AG-REG	29	29	1,456	226,280	資本財
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.82	0.82	892	138,760	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.08	0.08	873	135,748	食品・飲料・タバコ
GIVAUDAN-REG	7	7	2,282	354,622	素材
ZURICH INSURANCE GROUP AG	116	118	5,045	783,952	保険
NOVARTIS	1,702	1,717	15,268	2,372,588	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	1,276	1,221	4,117	639,833	資本財
ROCHE HOLDING AG-BR	27	22	697	108,350	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROCHE HOLDING GENUSS	546	558	16,228	2,521,674	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG	104	156	440	68,505	商業・専門サービス
HOLCIM LTD	406	448	2,533	393,735	素材
CLARIANT AG-REG	173	173	233	36,280	素材
NESTLE SA - REGISTERED	2,193	2,183	24,462	3,801,276	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG	31	43	618	96,066	保険
TEMENOS AG - REG	51	51	385	59,955	ソフトウェア・サービス
BACHEM HOLDING AG-REG B	18	18	172	26,878	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SONOVA HOLDING AG-REG	40	38	927	144,175	ヘルスケア機器・サービス
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	45	1,197	186,126	運輸
STRAUMANN HOLDING AG-REG	85	85	1,168	181,604	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	2,133	2,974	235	36,602	金融サービス
SWATCH GROUP AG(BEARER)	24	24	700	108,920	耐久消費財・アパレル
SWATCH GROUP AG/THE-REG	39	39	203	31,636	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	58	57	3,279	509,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	24	24	1,287	200,047	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	5	5	405	63,060	素材
SWISS PRIME SITE-REG	56	56	431	67,066	不動産管理・開発
PARTNERS GROUP HOLDING AG	18	18	1,511	234,813	金融サービス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	30	30	596	92,729	資本財
SCHINDLER HOLDING AG-REG	13	20	379	58,937	資本財
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	146	146	877	136,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	413	409	6,128	952,364	耐久消費財・アパレル
JULIUS BAER GROUP LTD	188	187	1,066	165,735	金融サービス
SWISS RE LTD	228	244	2,232	346,955	保険
BKW AG	—	17	282	43,902	公益事業
SIG GROUP AG	—	262	673	104,642	素材
ALCON INC	393	383	2,752	427,701	ヘルスケア機器・サービス
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	24	223	34,722	銀行
VIFOR PHARMA AG/NEW	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
UBS GROUP AG	2,710	2,618	4,691	729,046	金融サービス	
VAT GROUP AG	19	19	727	113,066	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	13,540	14,754	113,270	17,601,059	
		41	43	—	<3.0%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ATLAS COPCO A	2,052	2,070	33,342	434,120	資本財	
LUNDBERGS AB-B SHS	72	72	3,364	43,809	金融サービス	
SKF AB-B	248	360	6,519	84,885	資本財	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	1,207	1,312	15,171	197,538	銀行	
SWEDBANK AB-A	725	725	12,351	160,812	銀行	
SCA SV CELLULOSA B	438	538	7,940	103,382	素材	
VOLVO AB-A SHS	135	135	2,829	36,844	資本財	
VOLVO B	1,117	1,142	23,310	303,499	資本財	
HOLMEN AB-B SHARES	—	53	2,256	29,380	素材	
SWEDISH MATCH AB	1,272	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TELE2 AB-B SHS	328	467	4,772	62,132	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	212	212	3,340	43,490	耐久消費財・アパレル	
SECURITAS B	295	283	2,339	30,464	商業・専門サービス	
INVESTOR AB-B SHS	1,427	1,404	30,655	399,135	金融サービス	
HENNES & MAURITZ B	552	552	7,652	99,635	一般消費財・サービス流通・小売り	
ASSA ABLOY AB-B	781	759	18,690	243,348	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	1,107	1,207	10,619	138,271	銀行	
ERICSSON (LM) B	2,255	2,146	12,192	158,742	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	876	876	17,384	226,342	資本財	
TELIA CO AB	2,306	2,306	6,086	79,248	電気通信サービス	
SKANSKA B	255	255	3,769	49,084	資本財	
ORRON ENERGY AB	172	—	—	—	公益事業	
BOLIDEN AB	184	222	7,625	99,287	素材	
ALFA LAVAL AB	272	192	7,605	99,019	資本財	
GETINGE AB-B SHS	177	177	4,511	58,736	ヘルスケア機器・サービス	
KINNEVIK AB - B	187	187	2,875	37,434	金融サービス	
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	567	567	2,196	28,599	不動産管理・開発	
INDUTRADE AB	—	226	5,833	75,946	資本財	
HUSQVARNA AB-B SHS	387	387	3,335	43,427	資本財	
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	—	143	3,302	43,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ATLAS COPCO B	1,276	1,276	17,654	229,862	資本財	
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	118	118	3,430	44,668	金融サービス	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	111	111	3,233	42,095	金融サービス	
HEXAGON AB-B SHS	1,538	1,470	18,228	237,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SAGAX AB-B	124	174	3,710	48,305	不動産管理・開発	
EPIROC AB-A	469	534	10,516	136,926	資本財	
EPIROC AB-B	288	288	4,833	62,929	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	494	494	14,703	191,441	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	232	314	6,564	85,474	金融サービス	
EVOLUTION AB	140	150	21,351	278,000	消費者サービス	
EMBRACER GROUP AB	375	531	1,261	16,424	メディア・娯楽	
LIFCO AB-B SHS	179	179	4,221	54,959	資本財	
INVESTOR AB-A SHS	389	389	8,559	111,446	金融サービス	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
VOLVO CAR AB-B	—	498	1,886	24,567	自動車・自動車部品	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	1,076	1,228	13,163	171,384	資本財	
NORDEA BANK ABP	2,538	2,585	28,411	369,919	銀行	
INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	140	140	3,014	39,250	資本財	
SINCH AB	441	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	29,554 44	29,476 45	426,621 —	5,554,617 <1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
NORSK HYDRO	968	1,005	7,000	88,760	素材	
TELENOR ASA	511	511	5,882	74,584	電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA-CL A	70	—	—	—	メディア・娯楽	
KONGSBERG GRUPPEN ASA	—	86	3,904	49,503	資本財	
ORKLA	698	698	5,679	72,012	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	763	734	21,656	274,601	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	124	124	5,312	67,367	素材	
MOWI ASA	319	319	6,056	76,794	食品・飲料・タバコ	
AKER BP ASA	61	277	6,977	88,476	エネルギー	
SALMAR ASA	—	54	2,658	33,714	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	185	185	3,397	43,076	保険	
ADEVINTA ASA	191	191	1,486	18,846	メディア・娯楽	
DNB BANK ASA	717	717	13,343	169,190	銀行	
SCHIBSTED ASA-B SHS	92	—	—	—	メディア・娯楽	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,705 12	4,907 12	83,354 —	1,056,929 <0.2%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	70	68	7,410	150,063	食品・飲料・タバコ	
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	4	4	5,064	102,561	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	2	2	2,518	50,999	運輸	
GN STORE NORD A/S	92	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
DANSKE BANK A/S	561	561	8,057	163,169	銀行	
GENMAB A/S	52	52	14,805	299,801	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	171	171	6,009	121,690	素材	
ROCKWOOL A/S-B SHS	7	7	1,289	26,113	資本財	
DSV A/S	163	142	18,975	384,247	運輸	
DEMANT A/S	85	85	2,321	47,004	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSYEMS A/S	816	816	16,338	330,864	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	1,323	1,314	149,535	3,028,088	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	92	92	8,084	163,713	ヘルスケア機器・サービス	
TRYG A/S	297	297	4,750	96,189	保険	
PANDORA A/S	81	79	4,525	91,650	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	84	84	4,479	90,700	素材	
AMBU A/S-B	135	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
ORSTED A/S	154	154	9,479	191,960	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	4,197 18	3,934 16	263,645 —	5,338,819 <0.9%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	162	121	695	63,895	ヘルスケア機器・サービス	
AUST AND NZ BANKING GROUP	2,255	—	—	—	銀行	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
WESTPAC BANKING	2,837	2,722	5,694	523,249	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,273	1,385	2,719	249,837	素材
TELSTRA CORP	3,084	—	—	—	電気通信サービス
BRAMBLES LTD	1,080	1,080	1,515	139,229	商業・専門サービス
ASX LTD	145	145	985	90,512	金融サービス
BHP GROUP LTD	3,972	3,999	17,097	1,570,959	素材
AMPOL LTD	206	206	650	59,780	エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED	443	443	991	91,086	商業・専門サービス
CSL LIMITED	376	379	11,535	1,059,902	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REA GROUP LTD	35	35	494	45,405	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	2,334	2,496	3,642	334,695	運輸
COCHLEAR LIMITED	47	47	1,171	107,668	ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	1,190	1,514	1,264	116,205	公益事業
COMMONWEALTH BANK OF AUST	1,340	1,344	13,196	1,212,506	銀行
RIO TINTO LTD	288	282	3,046	279,946	素材
ARISTOCRAT LEISURE LTD	462	462	1,774	162,995	消費者サービス
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	1,687	1,666	866	79,627	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	369	369	1,398	128,492	素材
IGO LTD	—	563	802	73,771	素材
ORICA LTD	382	382	586	53,894	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	347	347	662	60,826	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED	270	290	5,062	465,129	金融サービス
SUNCORP GROUP LIMITED	948	948	1,238	113,832	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,535	2,470	6,481	595,489	銀行
NEWCREST MINING LIMITED	611	739	1,915	175,952	素材
QANTAS AIRWAYS LIMITED	850	850	546	50,217	運輸
QBE INSURANCE GROUP	1,115	1,264	1,860	170,924	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	1,016	1,016	1,275	117,186	素材
REECE LTD	168	168	302	27,838	資本財
SANTOS	2,361	2,654	1,977	181,671	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	372	372	1,290	118,593	ヘルスケア機器・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	128	138	456	41,941	エネルギー
WESFARMERS LTD	871	929	4,549	417,986	一般消費財・サービス流通・小売り
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	1,461	1,470	5,130	471,377	エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	999	1,014	3,852	353,974	生活必需品流通・小売り
SEEK LTD	280	280	670	61,616	メディア・娯楽
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	35	—	—	—	消費者サービス
MINERAL RESOURCES LTD	144	144	1,006	92,434	素材
PILBARA MINERALS LTD	—	2,094	951	87,383	素材
CROWN RESORTS LTD	303	—	—	—	消費者サービス
EVOLUTION MINING LTD	1,221	—	—	—	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	1,195	1,195	419	38,567	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD	458	639	752	69,109	食品・飲料・タバコ
XERO LTD	113	113	1,254	115,309	ソフトウェア・サービス
IDP EDUCATION LTD	177	177	459	42,211	消費者サービス
TELSTRA GROUP LTD	—	3,084	1,344	123,570	電気通信サービス
LOTTERY CORP LTD/THE	1,820	1,820	900	82,780	消費者サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	1,099	1,099	687	63,211	生活必需品流通・小売り

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	2,362	5,545	509,547	銀行
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,321	2,321	828	76,158	保険
SOUTH32 LTD	3,411	3,467	1,362	125,215	素材
COLES GROUP LTD	1,084	1,084	1,964	180,514	生活必需品流通・小売り
WISETECH GLOBAL LTD	138	138	1,033	94,975	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	51,842 51	54,351 50	125,916 —	11,569,214 <2.0%>
(ニュージーランド)					
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	1,178	824	720	61,397	運輸
EBOS GROUP LTD	—	142	606	51,688	ヘルスケア機器・サービス
RYMAN HEALTHCARE LTD	363	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	399	399	958	81,673	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,731	1,731	904	77,057	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	646	646	407	34,677	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD	1,105	1,105	591	50,382	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	5,424 6	4,849 6	4,189 —	356,876 <0.1%>
(香港)					
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,730	1,730	2,093	37,616	不動産管理・開発
CLP HOLDINGS	1,375	1,375	7,940	142,693	公益事業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	675	375	1,606	28,875	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	958	944	27,753	498,732	金融サービス
MTR CORP	1,250	1,250	4,768	85,694	運輸
HANG SENG BANK	594	594	6,480	116,455	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMEN	1,252	1,252	3,312	59,521	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	1,120	1,120	4,732	85,034	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	9,046	9,046	6,631	119,161	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	1,740	1,740	8,586	154,306	消費者サービス
BOC HONG KONG HOLDINGS -R	2,815	2,815	6,671	119,887	銀行
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,363	1,363	2,588	46,513	不動産管理・開発
SINO LAND CO	3,154	3,154	3,311	59,511	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,080	1,245	12,674	227,753	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC A	405	405	2,156	38,754	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,070	1,070	8,222	147,766	資本財
XINYI GLASS HOLDING CO LTD	1,720	920	1,065	19,144	資本財
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	1,722	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
AIA GROUP LTD	9,338	9,312	71,236	1,280,125	保険
SANDS CHINA LTD	1,980	1,980	4,890	87,884	消費者サービス
SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	1,200	1,200	1,588	28,550	運輸
SWIRE PROPERTIES LTD	962	962	1,879	33,779	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	1,190	1,230	4,907	88,191	不動産管理・開発
ESR GROUP LTD	1,570	1,570	1,777	31,937	不動産管理・開発
BUDWEISER BREWING CO APAC LT	1,459	1,459	2,939	52,829	食品・飲料・タバコ
WH GROUP LTD	4,748	6,583	2,751	49,448	食品・飲料・タバコ
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,939	2,139	10,368	186,314	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD	1,644	1,644	7,089	127,403	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	59,102 28	58,480 27	220,027 —	3,953,885 <0.7%>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	1,474	1,474	554	57,672	資本財	
DBS GROUP	1,415	1,404	4,440	462,115	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	428	428	293	30,508	不動産管理・開発	
SEATRIM LTD	—	21,527	269	28,002	資本財	
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	—	80	275	28,645	資本財	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	451	660	613	63,803	金融サービス	
GENTING SINGAPORE LTD	6,150	3,150	321	33,434	消費者サービス	
KEPPEL CORP LTD	1,373	1,128	721	75,122	資本財	
OCBC BANK	2,571	2,571	3,149	327,734	銀行	
SINGAPORE AIRLINES	1,083	1,083	701	73,049	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	939	939	2,641	274,864	銀行	
UOL GROUP LIMITED	475	475	323	33,611	不動産管理・開発	
VENTURE CORP LTD	257	257	395	41,184	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,845	6,809	1,681	175,021	電気通信サービス	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,786	1,786	710	73,968	食品・飲料・タバコ	
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	2,235	2,235	771	80,238	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	26,482	46,007	17,864	1,858,977	
	銘柄 数 <比率>	14	16	—	<0.3%>	
(イスラエル)			千イスラエルシケル			
BANK HAPOALIM BM	983	983	3,096	116,904	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,088	1,125	3,168	119,606	銀行	
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	—	1,769	844	31,864	電気通信サービス	
FIRST INTL BANK ISRAEL	—	50	730	27,564	銀行	
ELBIT SYSTEMS LTD	21	21	1,594	60,192	資本財	
TOWER SEMICONDUCTOR LTD	—	100	1,498	56,550	半導体・半導体製造装置	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	995	995	1,925	72,682	銀行	
ICL LTD	420	594	1,321	49,893	素材	
NICE LTD	49	49	3,514	132,661	ソフトウェア・サービス	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	125	125	1,575	59,471	銀行	
AZRIELI GROUP	43	15	300	11,331	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	3,726	5,829	19,568	738,724	
	銘柄 数 <比率>	8	11	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	848,710	887,596	—	555,592,325	
	銘柄 数 <比率>	1,220	1,210	—	<95.6%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当期		期末	
	口	数 (千口)	口	数 (千口)	評価額	
					外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)
(アメリカ)					千米ドル	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		10		12	1,397	196,720
BOSTON PROPERTIES		11		11	537	75,664
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		95		37	689	97,088
PROLOGIS INC		57		73	9,174	1,291,505
AVALONBAY COMMUNITIES INC		11		11	1,946	273,944
CAMDEN PROPERTY TRUST		7		7	805	113,358
DUKE REALTY CORP		27		—	—	—
CROWN CASTLE INC		33		33	3,722	523,969
ESSEX PROPERTY TRUST		4		5	1,095	154,147
EQUITY RESIDENTIAL PPTY		27		29	1,757	247,365
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		45		45	881	124,061
WELLTOWER INC		32		35	2,579	363,104
KIMCO REALTY CORP		47		47	865	121,836
IRON MOUNTAIN INC		23		23	1,249	175,935
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		14		14	899	126,563
HOST HOTELS AND RESORTS INC		56		56	952	134,104
MID-AMERICA APARTMENT COMM		8		9	1,342	188,927
REALTY INCOME CORP		44		49	2,925	411,763
REGENCY CENTERS CORP		12		12	699	98,520
UDR INC		24		23	934	131,516
SIMON PROPERTY GROUP		25		25	2,607	367,031
PUBLIC STORAGE		12		12	3,446	485,176
SUN COMMUNITIES INC		9		10	1,311	184,635
VENTAS INC		31		31	1,353	190,533
VORNADO REALTY TRUST		11		—	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC		10		10	1,593	224,251
DIGITAL REALTY TRUST INC		22		23	2,317	326,176
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		50		50	396	55,785
AGNC INVESTMENT CORP		46		—	—	—
AMERICAN TOWER CORPORATION		35		37	6,821	960,320
WP CAREY INC		14		16	1,091	153,613
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		—		30	547	77,114
AMERICAN HOMES 4 RENT-A		—		24	841	118,510
INVITATION HOMES INC		46		45	1,502	211,551
GAMING AND LEISURE PROPERTIE		—		18	851	119,923
EQUINIX INC		7		7	5,394	759,451
VICI PROPERTIES INC		75		75	2,294	322,942

銘柄	当期首(前期末)		当期		期末	
	口数 (千口)	口数 (千口)	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
SBA COMMUNICATIONS CORP	8	8	1,920	270,401		
小計	1,002	966	68,747	9,677,517		
	銘柄数 <比率>	35	35	—	<1.7%>	
(カナダ)			千カナダドル			
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	4	4	236	24,489		
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15	15	311	32,209		
小計	20	20	548	56,698		
	銘柄数 <比率>	2	2	—	<0.0%>	
(フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	17	17	359	54,276		
GECINA SA	3	3	299	45,194		
COVIVIO(FP)	4	4	226	34,160		
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	10	10	448	67,717		
国小計	35	35	1,334	201,348		
	銘柄数 <比率>	4	4	—	<0.0%>	
(ベルギー)			千ユーロ			
WAREHOUSES DE PAUW SCA	—	12	337	50,880		
国小計	—	12	337	50,880		
	銘柄数 <比率>	—	1	—	<0.0%>	
ユーロ計	35	48	1,672	252,229		
	銘柄数 <比率>	4	5	—	<0.0%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	79	79	274	47,705		
SEGRO PLC	93	103	813	141,419		
LAND SECURITIES GROUP PLC	46	56	337	58,590		
小計	219	239	1,425	247,715		
	銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.0%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
MIRVAC GROUP	266	266	613	56,356		
APA GROUP	82	83	838	77,062		
GPT GROUP	167	167	715	65,711		
STOCKLAND	207	207	900	82,707		
DEXUS	94	94	754	69,332		
GOODMAN GROUP	133	133	2,650	243,547		
VICINITY CENTERS	365	305	578	53,130		
LENDLEASE GROUP	64	64	501	46,072		
SCENTRE GROUP	382	381	1,040	95,638		
小計	1,764	1,704	8,593	789,559		
	銘柄数 <比率>	9	9	—	<0.1%>	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	170	170	8,277	148,751	
HKT TRUST AND HKT LTD	205	315	3,156	56,718	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	220	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	596	485	11,434	205,470
	銘 柄 数 <比 率>	3	2	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	340	338	677	70,454	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	284	284	767	79,831	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	283	283	464	48,328	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	220	220	363	37,773	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,127	1,125	2,271	236,388
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	4,766	4,590	—	11,465,579
	銘 柄 数 <比 率>	60	60	—	<2.0%>

(注1) 邦貨換算金額は、当期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<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	S&P 500 EMIN	10,735	—
	S&P/TSE 60	471	—
	SWISS MKT IX	783	—
	DJ EURO STOXX	1,584	—
国	SPI 200 FUTU	494	—
	FTSE 100	530	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	555,592,325	95.5
投 資 信 託 受 益 証 券	179,853	0.0
投 資 証 券	11,285,726	1.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	14,875,494	2.6
投 資 信 託 財 産 総 額	581,933,398	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(581,561,501千円)の投資信託財産総額(581,933,398千円)に対する比率は99.9%です。

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

1米ドル=140.77円

1カナダドル=103.45円

1ユーロ=150.84円

1イギリスポンド=173.77円

1スイスフラン=155.39円

1スウェーデンクローナ=13.02円

1ノルウェークローネ=12.68円

1デンマーククローネ=20.25円

1オーストラリアドル=91.88円

1ニュージーランドドル=85.19円

1香港ドル=17.97円

1シンガポールドル=104.06円

1イスラエルシェケル=37.7506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 2023年5月29日現在
(A) 資 産	582,860,071,869円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,455,165,586
株 式(評価額)	555,592,325,162
投資信託受益証券(評価額)	179,853,892
投資証券(評価額)	11,285,726,028
未 収 入 金	1,602,617,634
未 収 配 当 金	826,943,261
差 入 委 託 証 拠	3,917,440,306
(B) 負 債	1,505,980,461
未 払 金	994,049,200
未 払 解 約 金	511,930,640
未 払 利 息	621
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	581,354,091,408
元 本	121,644,600,809
次 期 繰 越 損 益 金	459,709,490,599
(D) 受 益 権 総 口 数	121,644,600,809口
1万口当たり基準価額(C/D)	47,791円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年5月31日 至 2023年5月29日
(A) 配 当 等 収 益	10,964,215,767円
受 取 配 当 金	10,682,109,127
受 取 利 息	197,199,415
そ の 他 収 益 金	93,583,810
支 払 利 息	△8,676,585
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	59,537,775,948
売 益	105,598,268,189
売 買 損	△46,060,492,241
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,104,714,594
取 引 益	4,094,242,431
取 引 損	△2,989,527,837
(D) そ の 他 費 用	△155,418,133
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	71,451,288,176
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	398,646,905,402
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	55,005,184,778
(H) 解 約 差 損 益 金	△65,393,887,757
(I) 計 (E+F+G+H)	459,709,490,599
次 期 繰 越 損 益 金(I)	459,709,490,599

(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124,778,059,850円、期中追加設定元本額は16,749,612,981円、期中一部解約元本額は19,883,072,022円です。
 ※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

SMT グローバル株式インデックス・オープン	33,890,123,327円
DC外国株式インデックス・オープン	12,380,384,611円
世界経済インデックスファンド	11,659,741,137円
外国株式SMTBセクション(SMA専用)	10,821,370,570円
DC世界経済インデックスファンド	9,236,960,810円
分散投資コア戦略ファンドS	8,287,346,972円
DCマイセクション75	4,452,815,816円
DCマイセクション50	3,718,032,451円
DCマイセクションS50	1,942,823,086円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,818,294,850円
DCマイセクションS75	1,790,450,783円
分散投資コア戦略ファンドA	1,696,464,551円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,478,711,110円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,350,641,913円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	1,134,703,301円
外国株式ファンド・シリーズ1	1,126,011,675円
外国株式インデックス・オープン(SMA専用)	1,084,876,749円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	991,871,162円
FOFs用 外国株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	971,757,885円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	937,867,057円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	904,970,174円
外国株式インデックス・オープン	890,134,765円
DCマイセクション25	772,351,973円
My SMT グローバル株式インデックス(ノーロード)	752,479,135円
コア投資戦略ファンド(成長型)	736,906,633円
グローバル経済コア	534,720,086円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	526,543,562円
外株インデックス・ファンド2(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	474,207,670円
DCマイセクションS25	414,087,663円
コア投資戦略ファンド(切替型)	339,465,119円
コア投資戦略ファンド(安定型)	304,044,821円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	288,399,668円
SMT 世界経済インデックス・オープン	232,971,840円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	214,968,295円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	209,372,552円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	209,262,076円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	208,311,048円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	207,653,821円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	207,193,300円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	190,175,925円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	161,506,587円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	151,997,491円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	148,951,405円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	138,760,023円
FOFs用 外国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	136,715,824円

SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	134,994,647円
SMT インデックスバランス・オープン	129,439,609円
DCターゲット・イヤール ファンド2045	113,583,208円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	106,517,990円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	103,512,005円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	84,417,317円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	82,116,060円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	79,260,045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)	76,032,093円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2030	66,364,495円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2040	64,661,623円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	61,645,058円
10資産分散投資ファンド	54,763,415円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	45,581,213円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2060	41,254,603円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	37,948,390円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2050	31,446,653円
DCターゲット・イヤール ファンド2025	29,102,851円
外株インデックス・ファンド(為替ヘッジあり)(適格機関投資家専用)	25,019,730円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	24,469,386円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	24,215,124円
外国株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	23,463,022円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	20,988,576円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,463,638円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	9,533,949円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	8,554,198円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,172,434円
DCターゲット・イヤール ファンド2055	6,130,836円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	4,972,676円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	3,528,471円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	2,046,222円

お知らせ

該当事項はありません。

外国株式ESGリーダーズインデックスマザーファンド

運用報告書

第2期（決算日 2023年6月26日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2021年7月8日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入率	株式先比率	株式物率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率					
設定日(2021年7月8日)	10,000	—	10,000	—	—	—	—	—	百万円 1,499
第1期(2022年6月27日)	11,016	10.2	11,169	11.7	91.0	6.4	2.4		1,721
第2期(2023年6月26日)	13,134	19.2	13,329	19.3	95.2	2.6	2.0		11,945

(注)株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数(配当込み、円ベース)です。

MSCI コクサイ ESG リーダーズ指数は、MSCI Inc. が開発した株価指数で、日本を除く世界主要国の株式の中から、相対的にESG評価の高い銘柄を選定することで構築される指数です。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

当ファンドは、MSCI Inc. (以下「MSCI」)、その関連会社、情報提供会社又はMSCI指数の編集又は計算に関連するその他の第三者(総称して「MSCI当事者」)が支援、保証、販売又は販売促進するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。

MSCI及びMSCI指数の名称は、MSCI又はその関連会社のサービスマークであり、当社による特定の目的のための使用について許諾されているものです。

いかなるMSCI当事者も当ファンドの発行者、受益者、あるいはその他の個人もしくは法人に対して、ファンドの全般的又は当ファンドの特定の投資の妥当性、もしくはMSCI指数の株式市場のパフォーマンスに追従する能力に関して、明示・黙示を問わず一切の表明又は保証を行いません。MSCI又はその関連会社は特定の商標、サービスマーク、商号の所有者であり、当ファンドの発行者、受益者あるいはその他の個人もしくは法人とは無関係で、MSCIが決定、構成、計算するMSCI指数の所有者です。いかなるMSCI当事者も、MSCI指数について決定、構成又は計算するにあたり、当ファンドの発行者又は受益者、あるいはその他の個人もしくは法人の要求を考慮する義務を一切負いません。いかなるMSCI当事者も、当ファンドの設定時期、価格、数量に関する決定又は償還価格及び数式の決定及び算定に参加しておらず、且つその責任を負うものではありません。さらに、いかなるMSCI当事者も当ファンドの運営・管理、マーケティング又は募集に関連して、発行者、受益者、その他の個人もしくは法人に対して一切の義務又は責任を負いません。MSCIは、MSCIが信頼できると考える情報源からMSCI指数の算出に使用するための情報を入手するものとしますが、いずれのMSCI当事者も、いかなるMSCI指数又はそのデータの独創性、正確性、完全性について一切保証しません。MSCI当事者は、明示的、暗示的を問わず発行者、受益者、その他の個人もしくは法人がいかなるMSCI指数又はそのデータを使用して得られる結果に関して、いかなる保証もしません。MSCI当事者は、MSCI指数もしくはそのデータについての、もしくはそれらに関連する誤り、省略、中断について一切の責任を負いません。

さらに、MSCI当事者は、いかなる種類の明示的、黙示的な保証をするものではなく、MSCI指数もしくはそのデータに関して、商品性及び特定目的への適合性に関する保証をここに明確に否認します。上記のいずれをも制限することなく、いかなる場合もMSCI当事者は、直接的、間接的、特別的、懲罰的、派生的損害、及びその他の損害(逸失利益を含む)について、そのような損害の可能性について通知された場合においても、一切責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、受益者、又はその他の個人もしくは法人も、MSCIの許諾が必要かどうかを判断するために最初にMSCIに問い合わせることなく、当ファンドを支援・保証、販売又は販売促進するためにMSCIの商号、商標又はサービスマークを使用又は言及することはできません。いかなる状況においても、MSCIの事前の書面による許諾なしに、いかなる個人も法人もMSCIとの関係を主張することはできません。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。

当期中の基準価額と市況の推移

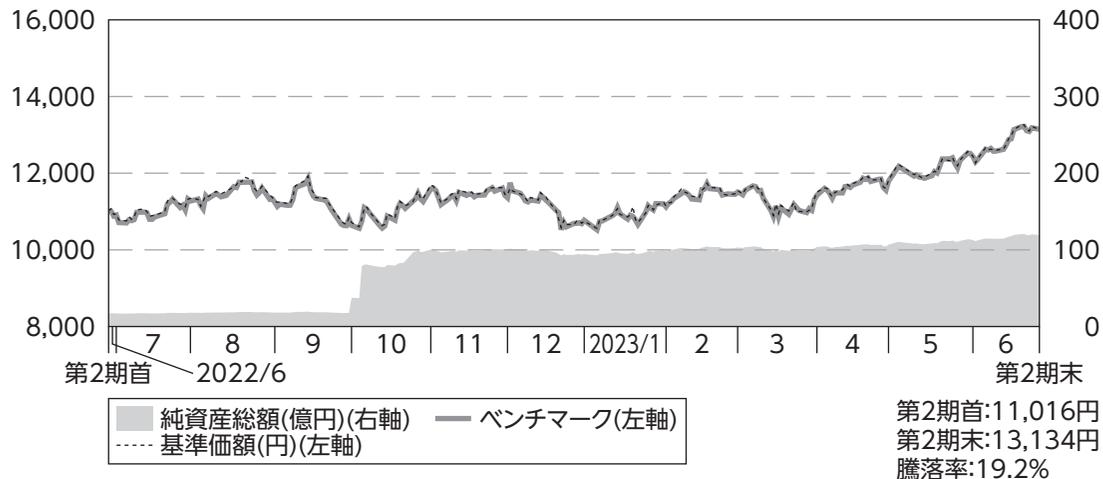
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組比	式入率	株先比	式物率	投資信託 証券組入比
	円	騰落率		騰落率					
(当 期 首) 2022年 6月27日	円 11,016	% ー		% ー	% 91.0	% 6.4	% 2.4		
6月末	10,937	△0.7	11,058	△1.0	90.9	6.4	2.4		
7月末	11,343	3.0	11,430	2.3	95.2	2.1	2.6		
8月末	11,272	2.3	11,398	2.0	93.1	4.1	2.4		
9月末	10,713	△2.8	10,788	△3.4	95.6	2.2	2.2		
10月末	11,691	6.1	11,752	5.2	94.4	3.2	2.2		
11月末	11,428	3.7	11,518	3.1	92.6	4.9	2.2		
12月末	10,746	△2.5	10,922	△2.2	94.4	3.1	2.3		
2023年 1月末	11,146	1.2	11,277	1.0	93.6	3.8	2.3		
2月末	11,549	4.8	11,666	4.5	92.6	5.0	2.2		
3月末	11,512	4.5	11,583	3.7	94.2	3.3	2.2		
4月末	11,816	7.3	11,956	7.0	93.9	3.8	2.2		
5月末	12,442	12.9	12,610	12.9	93.4	4.4	2.0		
(当 期 末) 2023年 6月26日	13,134	19.2	13,329	19.3	95.2	2.6	2.0		

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は「買建比率ー売建比率」で算出しております。

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、2022年6月27日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



先進国株式市場は、インフレ高進を受けた各国中央銀行の過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから、2022年10月にかけて下落しました。しかし、その後は欧米各国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、市場予想を上回る決算を発表した大型ハイテク株が上昇したことなどから堅調に推移しました。期末にかけては、米国で債務上限停止法案が可決されたことなどが好感されて一段高となりました。

外国為替市場では、日本の貿易収支の悪化や日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるMSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

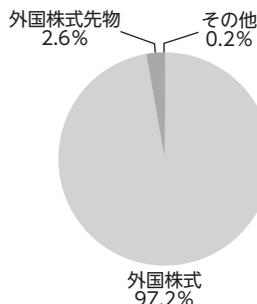
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	8.8%
2	NVIDIA CORP	アメリカ	3.9%
3	TESLA INC	アメリカ	2.7%
4	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	2.7%
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	2.5%
6	S&P 500 EMIN 2309	アメリカ	2.1%

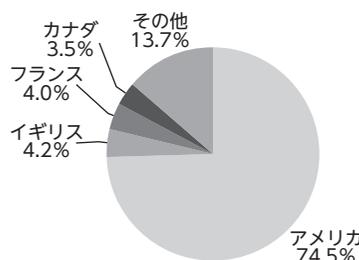
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	1.6%
8	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	1.4%
9	ELI LILLY & CO	アメリカ	1.4%
10	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	1.3%
組入銘柄数		604	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

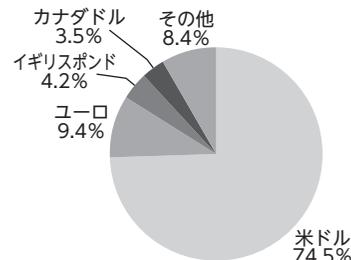
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

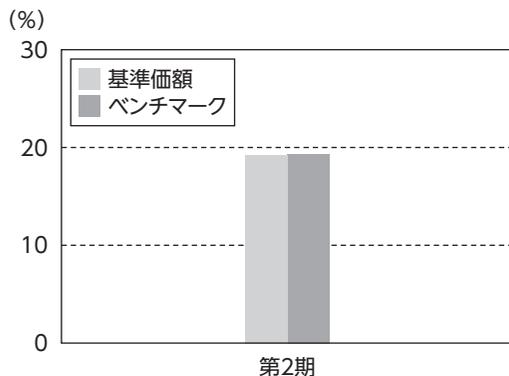


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.6%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、プラスの影響としては為替評価差要因^{*1}、マイナスの影響としては配当課税要因^{*2}および取引コスト要因です。

^{*1} ファンドとベンチマークとで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

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

今後の運用方針

主としてわが国を除く世界主要国の金融商品取引所等に上場している株式(預託証券(DR)を含みます。)に投資し、MSCIコクサイESGリーダーズ指数(配当込み、円ベース)に連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年6月28日~2023年6月26日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	3円 (2) (-) (-) (-) (0) (-) (0)	0.024% (0.021) (-) (-) (-) (0.000) (-) (0.002)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	6 (6) (-) (-) (-) (-) (0)	0.050 (0.050) (-) (-) (-) (-) (0.001)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	19 (19) (-) (0)	0.165 (0.164) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	28	0.239	

(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(11,382円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 4,483 (81)	千米ドル 45,268 (△2)	百株 595	千米ドル 4,045
	カ ナ ダ	559 (15)	千カナダドル 3,210 (-)	39	千カナダドル 145
	ド イ ツ	254 (-)	千ユーロ 1,336 (△1)	56	千ユーロ 709
	イ タ リ ア	772	387	481	115
	フ ラ ン ス	451 (-)	2,702 (△0.22149)	82	538
	オ ラ ン ダ	349 (△5)	1,149 (△61)	10	50
	ス ペ イ ン	421 (210)	472 (3)	243 (206)	232 (3)
	ベ ル ギ ー	14	72	2	31
	オ ー ス ト リ ア	8	34	3	11
	ル ク セ ン ブ ル ク	15	21	-	-
	フ ィ ン ラ ン ド	263	297	16	70
	ア イ ル ラ ン ド	33	140	-	-
	ポ ル ト ガ ル	19	26	-	-
	そ の 他	- (5)	- (61)	-	-
国	イ ギ リ ス	4,526 (22)	千イギリスポンド 2,485 (-)	336	千イギリスポンド 527
	ス イ ス	195 (6)	千スイスフラン 2,328 (△0.97763)	46	千スイスフラン 901
	ス ウ ェ ー デ ン	619 (10)	千スウェーデンクローナ 6,974 (-)	102	千スウェーデンクローナ 595
	ノ ル ウ ェ ー	141	千ノルウェークローネ 2,337	-	千ノルウェークローネ -
	デ ン マ ー ク	98	千デンマーククローネ 6,338	7	千デンマーククローネ 151
	オ ー ス ト ラ リ ア	1,027 (0.9)	千オーストラリアドル 1,993 (-)	209	千オーストラリアドル 602

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ニュージーランド	152	千ニュージーランドドル 122	53	千ニュージーランドドル 72
	香 港	1,073	千香港ドル 3,235	80	千香港ドル 163
国	シンガポール	211 (821)	千シンガポールドル 183 (0.00487)	874 (0.65)	千シンガポールドル 43 (0.43554)
	イスラエル	38	千イスラエルシェケル 119	—	千イスラエルシェケル —

(注1)金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国					
アメリカ		千口	千米ドル	千口	千米ドル
	BOSTON PROPERTIES	0.452	32	—	—
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	1 (△0.507)	24 (—)	—	—
	PROLOGIS INC	2	267	—	—
	CROWN CASTLE INC	1	161	—	—
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	1	30	—	—
	WELLTOWER INC	1	84	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	0.95	50	—	—
	VENTAS INC	0.918	36	1	50
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.95	97	—	—
	AMERICAN TOWER CORPORATION	1	252	—	—
	EQUINIX INC	0.242	140	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.276	76	—	—
	小 計	12 (△0.507)	1,253 (—)	1	50
カナダ		千口	千カナダドル	千口	千カナダドル
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.236	9	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	0.55	11	—	—
	小 計	0.786	20	—	—

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
フランス	千口	千ユーロ	千口	千ユーロ
KLEPIERRE	0.466	8	—	—
GECINA SA	0.099	7	—	—
COVIVIO (FP)	0.13	6	0.156	7
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.245	10	0.305	13
小 計	0.94	33	0.461	20
ユ ー ロ 計	0.94	33	0.461	20
イギリス	千口	千イギリスポンド	千口	千イギリスポンド
BRITISH LAND CO PLC	1	6	2	7
SEGRO PLC	3	22	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC	1	6	1	10
小 計	6	35	4	18
オーストラリア	千口	千オーストラリアドル	千口	千オーストラリアドル
MIRVAC GROUP	8	15	—	—
APA GROUP	2	22	—	—
GPT GROUP	3	15	—	—
STOCKLAND	4	16	—	—
DEXUS	2	16	—	—
GOODMAN GROUP	4	81	—	—
VICINITY CENTERS	7	13	—	—
LENDLEASE GROUP	1	12	—	—
SCENTRE GROUP	12	31	—	—
小 計	48	226	—	—
香港	千口	千香港ドル	千口	千香港ドル
HKT TRUST AND HKT LTD	9	82	—	—
小 計	9	82	—	—
シンガポール	千口	千シンガポールドル	千口	千シンガポールドル
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	12 (—)	23 (△0.01694)	—	—
CAPITALAND ASCOTT TRUST	— (0.444)	— (0.43067)	0.444	0.46985
小 計	12 (0.444)	23 (0.41373)	0.444	0.46985

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	2,412	2,271	—	—

(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	10,432,737千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	7,107,655千円
(c) 売 買 高 比 率(a)/(b)	1.46

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 直 物 取 引	百万円 8,565	百万円 105	% 1.2	百万円 412	百万円 —	% —
金 銭 信 託	0.000148	0.000148	100.0	0.000148	0.000148	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	2,258	245	10.9	2,255	244	10.8

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式>

銘柄	当期首(前期末)	当		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(アメリカ)				千米ドル		
ABIOMED INC	0.21	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP	4	28	367	52,744	52,744	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	2	14	682	97,860	97,860	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	2	—	—	—	—	保険
ALLSTATE CORP	1	7	85	12,220	12,220	保険
AMGEN	2	16	381	54,747	54,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERICAN EXPRESS	3	19	325	46,641	46,641	金融サービス
AFLAC	3	17	118	16,994	16,994	保険
AMERICAN INT'L GROUP	4	—	—	—	—	保険
AMERCO	0.04	—	—	—	—	運輸
VALERO ENERGY CORP	1	11	130	18,733	18,733	エネルギー
COMCAST CORP-CL A	—	130	521	74,811	74,811	メディア・娯楽
ANSYS INC	0.41	2	80	11,600	11,600	ソフトウェア・サービス
APPLIED MATERIALS	4	25	353	50,686	50,686	半導体・半導体製造装置
AUTODESK INC	1	6	126	18,144	18,144	ソフトウェア・サービス
AUTOMATIC DATA PROCESS	2	13	281	40,439	40,439	商業・専門サービス
AUTOZONE INC	—	0.57	138	19,823	19,823	一般消費財・サービス流通・小売り
AVERY DENNISON CORP	—	2	42	6,045	6,045	素材
BALL CORP	1	9	52	7,479	7,479	素材
BANK NEW YORK CO	3	25	109	15,767	15,767	金融サービス
BAXTER INTERNATIONAL	2	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	21	130	464	66,580	66,580	電気通信サービス
BEST BUY COMPANY INC	1	5	46	6,733	6,733	一般消費財・サービス流通・小売り
YUM BRANDS INC	—	8	117	16,849	16,849	消費者サービス
ROBERT HALF INTL INC	0.55	3	26	3,734	3,734	商業・専門サービス
BORGWARNER INC	1	7	35	5,081	5,081	自動車・自動車部品
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	0.65	3	33	4,854	4,854	運輸
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	0.55	4	66	9,586	9,586	メディア・娯楽
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.11	0.65	83	12,015	12,015	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	10	64	418	60,017	60,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ONEOK INC	2	12	74	10,711	10,711	エネルギー
UNITED RENTALS INC	0.34	2	84	12,069	12,069	資本財
SEMPRA ENERGY	1	9	138	19,884	19,884	公益事業
QUANTA SERVICES INC	0.75	4	78	11,192	11,192	資本財
SIRIUS XM HOLDINGS INC	5	19	7	1,056	1,056	メディア・娯楽
CSX CORP	10	62	204	29,333	29,333	運輸
CAMPBELL SOUP CO (US)	0.96	6	28	4,075	4,075	食品・飲料・タバコ
CARDINAL HEALTH	1	—	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR	2	16	381	54,799	54,799	資本財
CITRIX SYSTEMS INC	0.59	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
LUMEN TECHNOLOGIES INC	7	—	—	—	—	電気通信サービス

銘柄	当 期		期 末		業 種
	当期首(前期末)	当	評 価	額	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHURCH & DWIGHT CO INC	—	7	73	10,521	家庭用品・パーソナル用品
THE CIGNA GROUP	1	9	249	35,849	ヘルスケア機器・サービス
CINTAS CORP	—	2	136	19,596	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS	20	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CLOROX COMPANY	0.6	3	56	8,043	家庭用品・パーソナル用品
COCA-COLA CO	20	127	777	111,587	食品・飲料・タバコ
COPART INC	1	—	—	—	商業・専門サービス
COGNEX CORP	0.85	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COLGATE-PALMOLIVE CO	3	24	187	26,964	家庭用品・パーソナル用品
MOLINA HEALTHCARE INC	—	1	51	7,395	ヘルスケア機器・サービス
CONAGRA BRANDS INC	2	14	47	6,848	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	1	10	92	13,319	公益事業
CMS ENERGY CORP	—	9	52	7,583	公益事業
THE COOPER COS INC	—	1	55	8,023	ヘルスケア機器・サービス
CUMMINS INC	0.7	4	104	15,014	資本財
DARLING INGREDIENTS INC	—	5	29	4,221	食品・飲料・タバコ
DANAHER CORP	—	21	509	73,171	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOODY'S CORP	0.8	5	169	24,343	金融サービス
TARGET (DAYTON HUDSON)	2	13	183	26,388	生活必需品流通・小売り
DEERE&CO	1	—	—	—	資本財
MORGAN STANLEY	6	38	322	46,268	金融サービス
REPUBLIC SERVICES INC	1	—	—	—	商業・専門サービス
DECKERS OUTDOOR CORP	—	0.81	40	5,882	耐久消費財・アパレル
THE WALT DISNEY CO	9	56	497	71,399	メディア・娯楽
DOVER CORP	0.69	4	59	8,505	資本財
OMNICOM GROUP	—	6	58	8,329	メディア・娯楽
EBAY	3	16	70	10,112	一般消費財・サービス流通・小売り
EATON CORP	1	12	238	34,209	資本財
CADENCE DESIGN SYSTEMS	1	8	191	27,546	ソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	1	8	144	20,705	素材
ELECTRONIC ARTS INC	1	8	101	14,503	メディア・娯楽
SALESFORCE INC	4	30	649	93,210	ソフトウェア・サービス
EMERSON ELECTRIC CO	—	17	153	21,977	資本財
ATMOS ENERGY CORP	0.62	4	46	6,682	公益事業
ESTEE LAUDER CO-CL A	1	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
EXPEDITORS INTL WASH INC	0.81	4	56	8,046	運輸
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	0.18	1	44	6,445	金融サービス
FAIR ISAAC CORP	—	0.78	60	8,685	ソフトウェア・サービス
ASSURANT INC	0.28	1	16	2,327	保険
FASTENAL CO	2	16	94	13,591	資本財
FISERV INC	—	19	232	33,316	金融サービス
FRANKLIN RESOURCES INC	1	10	26	3,776	金融サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1	—	—	—	保険
DENTSPLY SIRONA INC	1	8	33	4,848	ヘルスケア機器・サービス
GENERAL MILLS INC	2	18	154	22,100	食品・飲料・タバコ
GENUINE PARTS CO	0.69	4	65	9,393	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
GILEAD SCIENCES INC	5	38	296	42,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GARTNER INC	—	2	82	11,840	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	12	76	3,223	462,479	半導体・半導体製造装置
GRACO INC	—	5	43	6,222	資本財
GRAINGER (WW) INC	0.21	1	98	14,082	資本財
HALLIBURTON CO	4	26	80	11,564	エネルギー
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	—	5	112	16,163	資本財
HASBRO INC	0.63	4	27	3,891	耐久消費財・アパレル
HP INC	5	27	81	11,675	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HOLOGIC INC	1	7	59	8,509	ヘルスケア機器・サービス
HOME DEPOT	5	31	941	135,144	一般消費財・サービス流通・小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	0.87	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HORMEL FOODS CORP	1	8	35	5,098	食品・飲料・タバコ
LENNOX INTERNATIONAL INC	0.16	1	33	4,830	資本財
HUMANA INC	0.61	3	168	24,187	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	0.45	2	42	6,158	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	7	41	42	6,128	銀行
BIOGEN INC	0.72	4	132	19,065	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IDEX CORP	0.36	2	45	6,467	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	1	9	231	33,161	資本財
INTUIT INC	1	8	392	56,317	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	0.41	2	132	18,967	ヘルスケア機器・サービス
INTEL CORP	20	129	426	61,211	半導体・半導体製造装置
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1	7	55	7,971	素材
INT'L PAPER CO	1	10	32	4,684	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS	1	11	44	6,404	メディア・娯楽
JOHNSON & JOHNSON	13	80	1,329	190,741	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HARTFORD FINANCIAL SVCS	1	9	67	9,646	保険
KELLOGG CO	1	9	61	8,807	食品・飲料・タバコ
KEY CORP	4	—	—	—	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	1	10	145	20,813	家庭用品・パーソナル用品
BLACKROCK INC	0.73	4	308	44,327	金融サービス
KROGER CO	3	19	92	13,228	生活必需品流通・小売り
LAM RESEARCH CORP	0.68	4	256	36,862	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	—	4	42	6,142	ソフトウェア・サービス
PLUG POWER INC	2	—	—	—	資本財
ELI LILLY & CO	4	24	1,145	164,399	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	0.88	—	—	—	保険
UNITED PARCEL SERVICE B	3	22	376	53,975	運輸
AGILENT TECHNOLOGIES	1	9	115	16,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOEWS CORP	1	—	—	—	保険
LOWES COMPANIES	3	18	393	56,483	一般消費財・サービス流通・小売り
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1	7	68	9,797	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	3	22	654	93,930	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	1	10	403	57,861	金融サービス
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2	19	174	25,031	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
MARSH & MCLENNAN COS	2	15	287	41,206	保険
MASCO CORP	1	6	38	5,510	資本財
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.34	1	80	11,489	素材
MERCK & CO	12	78	899	129,019	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LABORATORY CRP OF AMER	0.46	2	63	9,064	ヘルスケア機器・サービス
MICROSOFT CORP	35	218	7,324	1,050,998	ソフトウェア・サービス
3 M COMPANY	2	16	165	23,802	資本財
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.8	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ILLUMINA INC	0.94	4	97	13,976	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETAPP INC	—	6	48	6,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NEWELL BRANDS INC	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
NEWMONT CORPORATION	3	25	105	15,154	素材
NVR INC	—	0.1	61	8,839	耐久消費財・アパレル
NIKE B	6	38	418	60,078	耐久消費財・アパレル
NORFOLK SOUTHERN CORP	1	6	149	21,427	運輸
EVERSOURCE ENERGY	1	11	83	11,926	公益事業
NORTHERN TRUST CORP	0.95	5	41	5,901	金融サービス
NUCOR CORP	1	7	118	16,947	素材
CHENIERE ENERGY INC	1	7	112	16,200	エネルギー
OLD DOMINION FREIGHT LINE	0.5	3	106	15,279	運輸
EXELON CORP	—	31	123	17,734	公益事業
PAYCHEX INC	—	10	108	15,598	商業・専門サービス
ALIGN TECHNOLOGY INC	0.35	2	71	10,286	ヘルスケア機器・サービス
PEPSICO INC	6	42	792	113,685	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	0.8	5	34	4,943	資本財
ESSENTIAL UTILITIES INC	1	7	30	4,403	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2	11	146	20,954	銀行
PPG INDUSTRIES INC	1	7	108	15,604	素材
PRICE T ROWE GROUP INC	1	6	70	10,054	金融サービス
QUEST DIAGNOSTICS	0.64	3	48	6,963	ヘルスケア機器・サービス
PROCTER & GAMBLE CO	12	72	1,083	155,444	家庭用品・パーソナル用品
PROGRESSIVE CORP	2	18	244	35,111	保険
PULTE GROUP INC	—	6	52	7,584	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	0.88	6	67	9,692	金融サービス
REPLIGEN CORP	—	1	24	3,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RESMED INC	0.69	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
US BANCORP	6	47	151	21,760	銀行
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1	10	79	11,366	保険
ROLLINS INC	1	—	—	—	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	0.5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	0.55	3	105	15,103	資本財
ACCENTURE PLC-CL A	3	19	582	83,587	ソフトウェア・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	0.61	3	75	10,776	保険
TRAVELERS COS INC/THE	1	6	120	17,224	保険
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	—	18	96	13,866	金融サービス
BOOKING HOLDINGS INC	—	1	304	43,674	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SCHLUMBERGER	6	45	210	30,237	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	7	46	248	35,713	金融サービス
POOL CORP	0.19	1	41	5,915	一般消費財・サービス流通・小売り
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	—	6	93	13,409	ヘルスケア機器・サービス
BUNGE LIMITED	0.68	4	41	6,004	食品・飲料・タバコ
ELEVANCE HEALTH INC	1	7	327	47,049	ヘルスケア機器・サービス
AMERISOURCEBERGEN CORP	0.74	5	100	14,460	ヘルスケア機器・サービス
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1	7	53	7,625	保険
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1	7	185	26,585	素材
SVB FINANCIAL GROUP	0.34	—	—	—	銀行
SMITH (A. O.) CORP	0.75	—	—	—	資本財
SNAP-ON INC	0.26	—	—	—	資本財
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1	10	90	13,012	保険
ADVANCE AUTO PARTS	0.31	1	11	1,686	一般消費財・サービス流通・小売り
EDISON INTL	11	11	74	10,753	公益事業
TRUIST FINANCIAL CORP	6	40	121	17,468	銀行
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1	6	125	18,003	資本財
STATE STREET CORP	1	10	75	10,850	金融サービス
STEEL DYNAMICS INC	1	5	56	8,118	素材
GEN DIGITAL INC	3	17	31	4,467	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	—	4	197	28,355	ソフトウェア・サービス
TELEFLEX INC	0.22	1	37	5,448	ヘルスケア機器・サービス
TEXAS INSTRUMENTS	4	28	474	68,139	半導体・半導体製造装置
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TORO CO	—	3	31	4,500	資本財
DAVITA INC	0.34	1	13	1,935	ヘルスケア機器・サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	0.56	3	70	10,167	一般消費財・サービス流通・小売り
TRIMBLE IMS HOLDINGS	1	7	36	5,211	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UGI CORP	1	7	18	2,702	公益事業
UNION PACIFIC CORP	3	19	381	54,783	運輸
VF CORP	1	11	20	2,885	耐久消費財・アパレル
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE MANAGEMENT INC	—	12	208	29,890	商業・専門サービス
WATERS CORP	0.29	1	45	6,524	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEBSTER FINANCIAL CORP	1	4	15	2,273	銀行
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	0.35	2	78	11,322	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JM SMUCKER CO	—	3	49	7,117	食品・飲料・タバコ
VAIL RESORTS INC	0.19	1	35	5,034	消費者サービス
WESTERN DIGITAL CORP	—	9	37	5,361	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WEYERHAEUSER CO	3	21	65	9,425	エクイティ不動産投資信託(REIT)
WHIRLPOOL CORP	—	1	23	3,409	耐久消費財・アパレル
NASDAQ INC	0.55	10	49	7,158	金融サービス
CME GROUP INC	1	—	—	—	金融サービス
WILLIAMS COS	5	38	118	16,995	エネルギー
LQ CORP	1	7	42	6,145	一般消費財・サービス流通・小売り
CARMAX INC	0.78	5	46	6,729	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
TJX COMPANIES INC	5	35	288	41,329	一般消費財・サービス流通・小売り
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	0.25	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CBRE GROUP INC-A	1	9	71	10,233	不動産管理・開発
LIBERTY GLOBAL PLC-A	—	5	9	1,309	電気通信サービス
REGIONS FINL CORP	4	27	46	6,605	銀行
MOSAIC CO/THE	1	—	—	—	素材
MARKETAXESS HOLDINGS INC	0.18	1	30	4,377	金融サービス
CELANESE CORP-SERIES A	0.61	—	—	—	素材
DEXCOM INC	1	12	158	22,770	ヘルスケア機器・サービス
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	—	4	54	7,813	資本財
AMERIPRISE FINANCIAL INC	0.56	3	100	14,420	金融サービス
LIBERTY GLOBAL PLC-C	—	7	13	1,993	電気通信サービス
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	2	17	189	27,257	金融サービス
MASTERCARD INC-CLASS A	4	26	999	143,386	金融サービス
WESTERN UNION CO	2	—	—	—	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	0.51	3	43	6,212	資本財
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS LLC	—	3	57	8,252	商業・専門サービス
AECOM	—	4	34	4,975	資本財
DELTA AIR LINES INC	0.78	4	19	2,810	運輸
INSULET CORP	0.31	2	58	8,343	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1	7	89	12,901	金融サービス
LULULEMON ATHLETICA INC	0.59	3	136	19,654	耐久消費財・アパレル
VMWARE INC-CLASS A	1	7	100	14,417	ソフトウェア・サービス
MERCADOLIBRE INC	0.21	1	171	24,638	一般消費財・サービス流通・小売り
ULTA BEAUTY INC	0.3	1	68	9,759	一般消費財・サービス流通・小売り
INVESCO LTD	1	8	13	1,913	金融サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	8	50	1,153	165,481	金融サービス
AMERICAN WATER WORKS CO INC	0.87	6	91	13,113	公益事業
MARATHON PETROLEUM CORP	3	14	157	22,651	エネルギー
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	0.67	4	29	4,246	資本財
KINDER MORGAN INC	10	67	110	15,797	エネルギー
XYLEM INC	0.86	7	80	11,534	資本財
LYONDELLBASELL INDU-CL A	—	8	75	10,773	素材
SPLUNK INC	0.9	4	49	7,114	ソフトウェア・サービス
HCA HEALTHCARE INC	1	6	188	27,000	ヘルスケア機器・サービス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	0.29	2	25	3,601	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	0.83	—	—	—	銀行
NXP SEMICONDUCTORS NV	1	8	158	22,688	半導体・半導体製造装置
TARGA RESOURCES CORP	1	6	44	6,360	エネルギー
LEAR CORP	0.38	2	27	4,011	自動車・自動車部品
CBOE GLOBAL MARKETS INC	0.52	3	43	6,291	金融サービス
TESLA INC	4	88	2,262	324,711	自動車・自動車部品
GENERAC HOLDINGS INC	0.3	2	26	3,796	資本財
ALLY FINANCIAL INC	1	10	28	4,033	金融サービス
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	0.6	2	48	6,932	金融サービス
APTIV PLC	1	9	91	13,081	自動車・自動車部品

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
PHILLIPS 66	2	13	125	18,043	エネルギー
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	0.54	—	—	—	ソフトウェア・サービス
SERVICENOW INC	1	6	346	49,786	ソフトウェア・サービス
WORKDAY INC-CLASS A	—	6	140	20,123	ソフトウェア・サービス
PTC INC	—	3	48	7,013	ソフトウェア・サービス
ZOETIS INC	2	14	238	34,209	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KEURIG DR PEPPER INC	4	28	88	12,643	食品・飲料・タバコ
TWILIO INC - A	—	5	35	5,044	ソフトウェア・サービス
SNAP INC - A	—	30	33	4,777	メディア・娯楽
BLACK KNIGHT INC	—	4	27	3,966	ソフトウェア・サービス
BAKER HUGHES CO	5	32	95	13,767	エネルギー
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	4	51	7,405	食品・飲料・タバコ
AXON ENTERPRISE INC	—	2	40	5,794	資本財
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	0.9	5	28	4,091	運輸
BURLINGTON STORES INC	0.31	2	33	4,783	一般消費財・サービス流通・小売り
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLEGION PLC	0.44	2	32	4,690	資本財
CERIDIAN HCM HOLDING INC	—	4	28	4,124	商業・専門サービス
STERIS PLC	0.48	2	61	8,832	ヘルスケア機器・サービス
DOCUSIGN INC	—	6	31	4,484	ソフトウェア・サービス
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1	8	109	15,778	消費者サービス
ARAMARK	—	7	28	4,087	消費者サービス
AMCOR PLC	7	43	43	6,208	素材
FOX CORP - CLASS A	—	9	29	4,303	メディア・娯楽
FOX CORP- CLASS B	—	4	15	2,162	メディア・娯楽
CLARIVATE PLC	—	12	10	1,515	商業・専門サービス
AVANTOR INC	—	20	41	5,890	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CARRIER GLOBAL CORP	4	24	117	16,892	資本財
OTIS WORLDWIDE CORP	2	12	105	15,144	資本財
FERGUSON PLC	—	6	95	13,702	資本財
PAYLOCITY HOLDING CORP	—	1	22	3,271	商業・専門サービス
CARLYLE GROUP INC/THE	0.78	—	—	—	金融サービス
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	—	5	34	4,976	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INGERSOLL-RAND INC	2	11	74	10,738	資本財
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1	19	26	3,861	自動車・自動車部品
WARNER BROS DISCOVERY INC	10	—	—	—	メディア・娯楽
ZENDESK INC	0.68	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	2	7	18	2,657	メディア・娯楽
HF SINCLAIR CORP	—	5	21	3,079	エネルギー
MARVELL TECHNOLOGY INC	—	26	153	21,977	半導体・半導体製造装置
LINDE PLC	—	15	556	79,923	素材
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	7	—	—	—	運輸
CATALENT INC	0.82	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SYNCHRONY FINANCIAL	3	14	47	6,869	金融サービス
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1	14	36	5,273	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	0.89	5	83	11,923	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
HUBSPOT INC	0.25	1	68	9,775	ソフトウェア・サービス	
BIO-TECHNE CORP	0.18	4	35	5,057	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KORNIT DIGITAL LTD	0.24	—	—	—	資本財	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	3	22	144	20,795	資本財	
TRANSUNION	—	5	44	6,357	商業・専門サービス	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	1	7	45	6,588	食品・飲料・タバコ	
TELADOC HEALTH INC	0.65	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WESTROCK CO	1	9	26	3,782	素材	
NOVOCURE LTD	0.44	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
FORTIVE CORP	1	12	85	12,281	資本財	
ALPHABET INC-CL A	1	184	2,252	323,249	メディア・娯楽	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	6	37	62	8,993	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EQUITABLE HOLDINGS INC	1	11	28	4,112	金融サービス	
ALPHABET INC-CL C	1	166	2,047	293,749	メディア・娯楽	
ZSCALER INC	—	2	38	5,508	ソフトウェア・サービス	
CABLE ONE INC	0.03	—	—	—	メディア・娯楽	
LINDE PLC	2	—	—	—	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	703	4,673	58,929	8,455,774	
(カナダ)		271	286	—	<70.8%>	
AGNICO EAGLE MINES	2	15	102	11,216	素材	
BANK MONTREAL	3	22	260	28,349	銀行	
BANK NOVA SCOTIA	5	35	226	24,730	銀行	
NATIONAL BANK OF CANADA	1	9	92	10,061	銀行	
BROOKFIELD CORP	7	43	180	19,645	金融サービス	
CAE INC	1	11	32	3,560	資本財	
CAMECO CORP	1	12	50	5,501	エネルギー	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1	10	60	6,630	電気通信サービス	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	0.27	1	24	2,656	一般消費財・サービス流通・小売り	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2	17	271	29,546	運輸	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	0.97	5	21	2,378	耐久消費財・アパレル	
OPEN TEXT CORP	1	6	36	3,939	ソフトウェア・サービス	
RB GLOBAL INC	0.54	5	41	4,537	商業・専門サービス	
FORTIS INC	2	13	76	8,388	公益事業	
TELUS CORP	2	17	43	4,695	電気通信サービス	
ENBRIDGE	9	62	296	32,315	エネルギー	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	4	23	151	16,529	生活必需品流通・小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	1	8	56	6,131	自動車・自動車部品	
SUN LIFE FINANCIAL INC	—	18	120	13,122	保険	
METRO INC	1	7	50	5,523	生活必需品流通・小売り	
POWER CORP OF CANADA	4	—	—	—	保険	
LUNDIN MINING CORP	3	17	18	1,983	素材	
THOMSON REUTERS CORP	0.83	4	87	9,520	商業・専門サービス	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	0.4	3	32	3,534	資本財	
TORONTO-DOMINION BANK	9	57	449	48,957	銀行	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	—	2	25	2,821	素材	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
KINROSS GOLD CORP	6	33	20	2,239	素材
INTACT FINANCIAL CORP	1	5	99	10,854	保険
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2	13	74	8,096	素材
KEYERA CORP	1	5	16	1,833	エネルギー
PARKLAND CORP	0.74	4	13	1,455	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP	2	16	63	6,943	エネルギー
DOLLARAMA INC	—	10	88	9,662	一般消費財・サービス流通・小売り
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	—	21	22	2,442	公益事業
NORTHLAND POWER INC	1	—	—	—	公益事業
IVANHOE MINES LTD-CL A	4	15	19	2,144	素材
NUTRIEN LTD	2	15	119	12,987	素材
FIRSTSERVICE CORP	0.19	1	19	2,153	不動産管理・開発
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	—	4	17	1,857	公益事業
SHOPIFY INC - CLASS A	0.55	37	318	34,657	ソフトウェア・サービス
HYDRO ONE LTD	1	11	41	4,567	公益事業
小 計	株 数 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	94	630	3,746	408,172
		36	39	—	<3.4%>
(ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	0.9	5	88	13,894	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	4	27	26	4,111	銀行
GEA GROUP AG	1	3	15	2,362	資本財
DEUTSCHE POST AG-REG	—	31	134	21,032	運輸
MERCK KGAA	0.61	3	57	8,975	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAP SE	5	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HENKEL AG & CO KGAA	0.5	3	24	3,786	家庭用品・パーソナル用品
PUMA SE	0.51	2	14	2,241	耐久消費財・アパレル
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	0.85	5	37	5,914	家庭用品・パーソナル用品
BEIERSDORF AG	0.48	3	42	6,699	家庭用品・パーソナル用品
HEIDELBERG MATERIALS AG	0.71	3	27	4,311	素材
ALLIANZ SE-REG	1	—	—	—	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	—	20	18	2,882	運輸
MUENCHENER RUECKVERSICH.	—	4	143	22,400	保険
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	1	10	118	18,475	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	0.28	1	16	2,513	自動車・自動車部品
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	0.29	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
DEUTSCHE BOERSE	0.9	5	91	14,380	金融サービス
MTU AERO ENGINES AG	0.25	—	—	—	資本財
SYMRISE AG	0.61	3	36	5,701	素材
BRENNTAG SE	0.74	5	37	5,920	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	1	6	10	1,713	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	5	34	9	1,417	電気通信サービス
LEG IMMOBILIEN SE	0.4	3	15	2,491	不動産管理・開発
VONOVIA SE	—	23	39	6,233	不動産管理・開発
KNORR-BREMSE AG	—	2	14	2,292	資本財
ZALANDO SE	1	8	22	3,494	一般消費財・サービス流通・小売り
COVESTRO AG	—	6	29	4,600	素材

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
HELLOFRESH SE	1	5	10	1,666	生活必需品流通・小売り	
DELIVERY HERO SE	0.75	—	—	—	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	32	231	1,083	169,512	
	銘柄数 <比率>	24	25	—	<1.4%>	
(イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	—	31	57	8,951	保険	
INTESA SANPAOLO	77	—	—	—	銀行	
MEDIOBANCA	—	18	19	3,079	銀行	
ENEL	39	254	154	24,119	公益事業	
TERNA SPA	—	46	35	5,582	公益事業	
AMPLIFON SPA	0.59	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PRYSMIAN SPA	1	6	23	3,644	資本財	
MONCLER SPA	—	6	39	6,223	耐久消費財・アパレル	
NEXI SPA	3	14	10	1,569	金融サービス	
FINECOBANK SPA	—	18	22	3,536	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	—	16	15	2,406	保険	
国 小 計	株 数 ・ 金 額	122	413	377	59,114	
	銘柄数 <比率>	5	9	—	<0.5%>	
(フランス)						
BOUYGUES ORD	1	5	17	2,714	資本財	
AIR LIQUIDE	2	—	—	—	素材	
LOREAL	1	7	303	47,440	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH	—	8	708	110,929	耐久消費財・アパレル	
PUBLICIS GROUPE	1	—	—	—	メディア・娯楽	
MICHELIN	3	19	52	8,144	自動車・自動車部品	
SEB SA	0.13	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	2	16	264	41,438	資本財	
VIVENDI SE	3	—	—	—	メディア・娯楽	
TOTALENERGIES SE	12	73	381	59,693	エネルギー	
VALEO SA	1	6	12	1,960	自動車・自動車部品	
ORANGE	9	58	60	9,424	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	—	0.98	186	29,158	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	—	20	81	12,815	ソフトウェア・サービス	
KERING	0.36	2	117	18,310	耐久消費財・アパレル	
CARREFOUR	2	21	34	5,393	生活必需品流通・小売り	
ACCOR	0.83	—	—	—	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE	3	23	52	8,230	銀行	
TELEPERFORMANCE	0.28	1	26	4,097	商業・専門サービス	
AXA SA	9	57	151	23,779	保険	
ESSILORLUXOTTICA	1	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT AGRICOLE SA	—	37	39	6,130	銀行	
BNP PARIBAS	5	33	182	28,615	銀行	
DANONE (GROUPE)	3	20	115	18,054	食品・飲料・タバコ	
ALSTOM	1	—	—	—	資本財	
EIFFAGE	0.4	2	27	4,314	資本財	
ADP	—	0.92	12	1,901	運輸	

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
			株 数 (百株)	評 価 額		外 貨 換 算 金 額 (千円)
BUREAU VERITAS SA	1	—	—	—	商業・専門サービス	
GETLINK	—	13	21	3,303	運輸	
BIOMERIEUX	0.6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
WORLDFINE SA	1	8	27	4,255	金融サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	71	441	2,876	450,106	
		25	22	—	<3.8%>	
(オランダ)						
RANDSTAD NV	0.58	—	—	—	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE AHOLD NV	4	30	91	14,309	生活必需品流通・小売り	
AKZO NOBEL	0.91	5	37	5,895	素材	
WOLTERS KLUWER	1	7	89	13,949	商業・専門サービス	
KONINKLIJKE DSM NV	0.82	—	—	—	素材	
ASML HOLDING NV	2	12	798	124,939	半導体・半導体製造装置	
KPN (KON.)	16	98	31	4,938	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	—	21	90	14,096	半導体・半導体製造装置	
ING GROEP NV-CVA	18	115	135	21,206	銀行	
CNH INDUSTRIAL NV	4	30	38	6,056	資本財	
PROSUS	4	23	150	23,490	一般消費財・サービス流通・小売り	
JDE PEET'S BV	0.38	3	8	1,376	食品・飲料・タバコ	
IMCD NV	0.3	—	—	—	資本財	
NN GROUP NV	1	8	26	4,179	保険	
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	—	26	51	8,048	メディア・娯楽	
JUST EAT TAKEAWAY	—	7	9	1,525	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	56	390	1,559	244,011	
		13	13	—	<2.0%>	
(スペイン)						
IBERDROLA SA	28	179	209	32,712	公益事業	
BANCO BILBAO VIZCAYA	32	—	—	—	銀行	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1	4	12	1,914	公益事業	
REPSOL SA	7	42	54	8,565	エネルギー	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	2	10	16	2,609	公益事業	
INDITEX	5	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	—	7	22	3,498	資本財	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	—	13	95	14,896	消費者サービス	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	75	257	410	64,197	
		6	6	—	<0.5%>	
(ベルギー)						
UMICORE	0.93	5	14	2,262	素材	
D' IETEREN GROUP	0.19	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
KBC GROEP NV	1	8	50	7,964	銀行	
SOLVAY SA	0.35	—	—	—	素材	
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2	14	65	10,227	
		4	2	—	<0.1%>	
(オーストリア)						
OMV AG	0.69	4	16	2,633	エネルギー	
VERBUND AG	0.47	1	13	2,140	公益事業	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
VOESTALPINE AG	0.55	—	—	—	素材
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	1 3	6 2	30 —	4,774 <0.0%>
(ルクセンブルク)					
TENARIS SA	2	17	22	3,508	エネルギー
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	2 1	17 1	22 —	3,508 <0.0%>
(フィンランド)					
KESKO OYJ-B SHS	1	6	11	1,830	生活必需品流通・小売り
WARTSILA OYJ	2	13	13	2,125	資本財
UPM KYMMENE OYJ	2	15	42	6,604	素材
STORA ENSO OYJ R	2	20	21	3,423	素材
SAMPO OYJ-A SHS	2	—	—	—	保険
ELISA A	0.67	5	26	4,107	電気通信サービス
NOKIA OYJ	—	165	62	9,706	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OIL OYJ	1	12	42	6,684	エネルギー
ORTON OYJ-CLASS B	0.5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METSO CORPORATION	—	21	23	3,647	資本財
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	14 8	261 8	243 —	38,130 <0.3%>
(アイルランド)					
KINGSPAN GROUP PLC	0.73	5	29	4,606	資本財
CRH PLC	3	22	107	16,878	素材
KERRY GROUP PLC-A	0.75	4	40	6,351	食品・飲料・タバコ
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	1	8	24	3,871	素材
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	6 4	40 4	202 —	31,707 <0.3%>
(ポルトガル)					
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	2	14	15	2,368	エネルギー
JERONIMO MARTINS	1	8	21	3,411	生活必需品流通・小売り
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	3 2	22 2	36 —	5,779 <0.0%>
(その他)					
DSM-FIRMENICH AG	—	5	47	7,492	素材
国 小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	— —	5 1	47 —	7,492 <0.1%>
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	391 95	2,101 95	6,956 —	1,088,562 <9.1%>
(イギリス)					
ANTOFAGASTA PLC	1	10	14	2,656	素材
ASHTAD GROUP PLC	2	12	69	12,634	資本財
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	4	26	10	1,944	耐久消費財・アパレル
BUNZL PLC	1	—	—	—	資本財
CRODA INTERNATIONAL PLC	0.67	4	22	4,187	素材
SCHRODERS PLC	0.61	23	10	1,837	金融サービス
DCC PLC	0.48	2	10	1,979	資本財

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
JOHNSON MATTHEY PLC	0.94	4	7	1,445	素材	
ANGLO AMERICAN PLC	—	39	88	16,135	素材	
COMPASS GROUP PLC	8	—	—	—	消費者サービス	
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	102	622	374	68,501	銀行	
LEGAL & GENERAL GROUP	28	174	38	7,111	保険	
UNILEVER PLC	12	76	314	57,385	家庭用品・パーソナル用品	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	1	13	25	4,645	食品・飲料・タバコ	
PEARSON	3	—	—	—	消費者サービス	
PERSIMMON PLC	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
PRUDENTIAL	14	86	93	17,078	保険	
VODAFONE GROUP PLC	127	772	56	10,252	電気通信サービス	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3	21	131	24,077	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	9	59	154	28,243	商業・専門サービス	
RENTOKIL INITIAL PLC	8	—	—	—	商業・専門サービス	
ST JAMES'S PLACE PLC	2	19	20	3,708	金融サービス	
SAGE GROUP PLC	—	32	27	5,095	ソフトウェア・サービス	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	336	2,009	85	15,540	銀行	
TAYLOR WIMPEY PLC	17	91	9	1,689	耐久消費財・アパレル	
TESCO PLC	36	220	54	10,003	生活必需品流通・小売り	
3I GROUP PLC	—	30	55	10,208	金融サービス	
GSK PLC	23	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WPP PLC	5	32	27	4,974	メディア・娯楽	
ASTRAZENECA	7	48	548	100,202	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BT GROUP PLC	42	205	26	4,792	電気通信サービス	
NATIONAL GRID PLC	20	113	118	21,613	公益事業	
INTERTEK GROUP PLC	0.77	5	23	4,320	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	1	12	27	5,039	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	0.63	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
KINGFISHER PLC	10	51	11	2,100	一般消費財・サービス流通・小売り	
SAINSBURY (J) PLC	8	45	11	2,125	生活必需品流通・小売り	
ADMIRAL GROUP PLC	—	6	13	2,535	保険	
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	0.54	2	10	1,957	耐久消費財・アパレル	
INTERCONTINENTAL HOTELS	0.88	—	—	—	消費者サービス	
WHITBREAD PLC	0.98	—	—	—	消費者サービス	
ABRDN PLC	10	68	14	2,598	金融サービス	
MONDI PLC	2	16	19	3,489	素材	
OCADO GROUP PLC	4	18	9	1,810	生活必需品流通・小売り	
COCA-COLA HBC AG-CDI	0.98	9	22	4,127	食品・飲料・タバコ	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	—	23	12	2,247	保険	
FERGUSON PLC	1	—	—	—	資本財	
ENDEAVOUR MINING PLC	—	6	11	2,067	素材	
INFORMA PLC	7	43	30	5,507	メディア・娯楽	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	28	16	3,069	メディア・娯楽	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	0.35	2	25	4,589	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	881	5,093	2,657	485,531	
	銘柄 数 < 比 率 >	44	41	—	< 4.1% >	

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
(スイス)			千スイスフラン			
SIKA AG-BR	0.68	4	110	17,678	素材	
SGS SA	0.03	4	39	6,403	商業・専門サービス	
SWISSCOM	—	0.8	44	7,126	電気通信サービス	
GEBERIT AG-REG	0.18	1	47	7,573	資本財	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.01	0.06	65	10,473	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	0.05	0.28	82	13,264	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	—	4	200	32,042	保険	
NOVARTIS	—	63	574	92,038	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABB LTD	8	47	162	25,971	資本財	
ROCHE HOLDING GENUSS	3	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADECCO GROUP AG-REG	0.75	—	—	—	商業・専門サービス	
CLARIANT AG-REG	1	5	7	1,178	素材	
BALOISE HOLDING AG - REG	—	1	21	3,477	保険	
TEMENOS AG - REG	0.8	2	13	2,215	ソフトウェア・サービス	
SONOVA HOLDING AG-REG	0.26	1	36	5,863	ヘルスケア機器・サービス	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	0.26	1	41	6,626	運輸	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	0.5	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
LONZA GROUP AG-REG	0.36	2	123	19,854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.15	0.92	48	7,805	保険	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	—	5	25	4,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CIE FINANCIERE RICHEMON SA-(REGD)	2	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
JULIUS BAER GROUP LTD	—	7	38	6,123	金融サービス	
SWISS RE LTD	1	9	82	13,252	保険	
SIG GROUP AG	—	10	24	3,946	素材	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	—	1	13	2,145	銀行	
VIFOR PHARMA AG/NEW	0.24	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VAT GROUP AG	—	0.83	29	4,659	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額	21	176	1,834	293,779	
	銘 柄 数 <比 率>	18	22	—	<2.5%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
ATLAS COPCO A	15	86	1,326	17,777	資本財	
SKF AB-B	1	10	192	2,577	資本財	
SCA SV CELLULOSA B	2	15	216	2,903	素材	
HOLMEN AB-B SHARES	0.69	2	112	1,506	素材	
TELE2 AB-B SHS	2	15	134	1,796	電気通信サービス	
ELECTROLUX AB-SER B	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
HENNES & MAURITZ B	3	18	295	3,953	一般消費財・サービス流通・小売り	
ASSA ABLOY AB-B	4	29	717	9,609	資本財	
SVENSKA HANDELSBK A	—	46	407	5,462	銀行	
ERICSSON (LM) B	14	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SANDVIK AB	5	31	634	8,497	資本財	
TELIA CO AB	12	79	183	2,461	電気通信サービス	
BOLIDEN AB	1	9	297	3,983	素材	
ALFA LAVAL AB	1	10	407	5,455	資本財	
KINNEVIK AB - B	—	9	127	1,715	金融サービス	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
HUSQVARNA AB-B SHS	1	13	129	1,740	資本財	
ATLAS COPCO B	7	45	613	8,216	資本財	
EPIROC AB-A	3	19	381	5,109	資本財	
EPIROC AB-B	2	10	173	2,327	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	2	17	511	6,852	家庭用品・パーソナル用品	
EQT AB	1	12	257	3,449	金融サービス	
BELJER REF AB	—	10	138	1,855	資本財	
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	6	44	448	6,012	資本財	
NORDEA BANK ABP	15	98	1,105	14,820	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	109	637	8,812	118,083	
		21	22	—	<1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
NORSK HYDRO	6	40	250	3,327	素材	
TELENOR ASA	3	21	231	3,074	電気通信サービス	
ORKLA	3	21	163	2,164	食品・飲料・タバコ	
EQUINOR ASA	5	28	870	11,559	エネルギー	
MOWI ASA	2	11	198	2,634	食品・飲料・タバコ	
AKER BP ASA	1	10	267	3,555	エネルギー	
SALMAR ASA	0.45	2	85	1,135	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1	6	104	1,383	保険	
DNB BANK ASA	4	27	518	6,887	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	27	168	2,689	35,722	
		9	9	—	<0.3%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
A P MOLLER-MAERSK A/S-B	0.03	0.18	212	4,464	運輸	
A P MOLLER - MAERSK A/S - A	0.02	0.08	93	1,964	運輸	
GN STORE NORD A/S	0.62	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
GENMAB A/S	0.31	2	549	11,550	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NOVOZYMES A/S	1	6	192	4,046	素材	
ROCKWOOL A/S-B SHS	—	0.5	81	1,712	資本財	
DSV A/S	—	5	787	16,554	運輸	
DEMANT A/S	0.53	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
VESTAS WIND SYSEMS A/S	4	29	528	11,110	資本財	
NOVO NORDISK A/S-B	8	51	5,568	116,989	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLOPLAST-B	0.57	3	299	6,293	ヘルスケア機器・サービス	
PANDORA A/S	0.48	2	138	2,917	耐久消費財・アパレル	
CHR HANSEN HOLDING A/S	0.51	2	131	2,764	素材	
ORSTED A/S	0.9	5	345	7,268	公益事業	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	18	109	8,930	187,637	
		12	12	—	<1.6%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	0.87	7	38	3,708	ヘルスケア機器・サービス	
AUST AND NZ BANKING GROUP	13	—	—	—	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	8	49	105	10,112	素材	
TELSTRA CORP	19	—	—	—	電気通信サービス	
BRAMBLES LTD	6	42	59	5,709	商業・専門サービス	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ASX LTD	0.92	6	41	4,013	金融サービス
COMPUTERSHARE LIMITED	2	16	36	3,512	商業・専門サービス
REA GROUP LTD	0.25	2	31	2,986	メディア・娯楽
TRANSURBAN GROUP	18	103	147	14,110	運輸
COCHLEAR LIMITED	0.31	2	48	4,650	ヘルスケア機器・サービス
COMMONWEALTH BANK OF AUST	8	—	—	—	銀行
ARISTOCRAT LEISURE LTD	2	17	67	6,439	消費者サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	1	13	51	4,907	素材
IGO LTD	—	25	39	3,744	素材
ORICA LTD	2	11	17	1,642	素材
BLUESCOPE STEEL LTD	2	12	24	2,341	素材
MACQUARIE GROUP LIMITED	1	11	196	18,814	金融サービス
SUNCORP GROUP LIMITED	7	44	60	5,757	保険
NEWCREST MINING LIMITED	3	26	68	6,553	素材
QBE INSURANCE GROUP	7	43	67	6,452	保険
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	5	40	49	4,757	素材
SANTOS	17	—	—	—	エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	2	14	49	4,764	ヘルスケア機器・サービス
WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	4	59	200	19,219	エネルギー
SEEK LTD	1	8	18	1,771	メディア・娯楽
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	0.54	—	—	—	消費者サービス
MINERAL RESOURCES LTD	0.8	5	40	3,893	素材
PILBARA MINERALS LTD	—	90	44	4,223	素材
EVOLUTION MINING LTD	8	—	—	—	素材
AURIZON HOLDINGS LTD	8	46	18	1,727	運輸
XERO LTD	0.62	5	59	5,694	ソフトウェア・サービス
IDP EDUCATION LTD	1	6	14	1,359	消費者サービス
TELSTRA GROUP LTD	—	120	51	4,977	電気通信サービス
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	12	33	21	2,025	生活必需品流通・小売り
ANZ GROUP HOLDINGS LTD	—	92	210	20,195	銀行
COLES GROUP LTD	6	39	72	6,900	生活必需品流通・小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	181 32	999 30	1,952 —	186,967 <1.6%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	5	—	—	—	運輸
EBOS GROUP LTD	—	5	19	1,712	ヘルスケア機器・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	2	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	8	57	29	2,579	電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	3	23	14	1,324	公益事業
MERIDIAN ENERGY LTD	6	40	21	1,909	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	26 5	125 4	85 —	7,525 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	5	—	—	—	公益事業
MTR CORP	5	40	144	2,652	運輸
HANG SENG BANK	3	24	268	4,920	銀行

銘柄	銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
HONG KONG & CHINA GAS		50	300	202	3,709	公益事業
BOC HONG KONG HOLDINGS -R		15	115	276	5,056	銀行
SINO LAND CO		20	100	93	1,720	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC A		5	15	78	1,438	不動産管理・開発
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU		10	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
AIA GROUP LTD		62	362	2,829	51,827	保険
SWIRE PROPERTIES LTD		6	38	71	1,303	不動産管理・開発
WH GROUP LTD		60	240	100	1,846	食品・飲料・タバコ
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	241	1,234	4,065	74,475	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CITY DEVELOPMENTS LTD		2	13	8	927	不動産管理・開発
SINGAPORE EXCHANGE LTD		4	24	22	2,441	金融サービス
KEPPEL CORP LTD		7	43	28	3,031	資本財
SINGAPORE AIRLINES		6	—	—	—	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		6	38	106	11,294	銀行
UOL GROUP LIMITED		2	—	—	—	不動産管理・開発
CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI		12	78	25	2,708	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	39	196	192	20,404	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK LEUMI LE-ISRAEL		6	45	124	4,925	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	6	45	124	4,925	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	2,742	16,191	—	11,367,563	
		562	575	—	<95.2%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
BOSTON PROPERTIES	0.07	0.522	26	3,857	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	0.675	1	29	4,215	
PROLOGIS INC	0.352	2	338	48,543	
CROWN CASTLE INC	0.205	1	145	20,948	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	0.25	1	30	4,385	
WELLTOWER INC	0.19	1	112	16,122	
IRON MOUNTAIN INC	—	0.95	51	7,356	
VENTAS INC	0.25	—	—	—	
DIGITAL REALTY TRUST INC	—	0.95	98	14,197	
AMERICAN TOWER CORPORATION	0.236	1	266	38,225	
EQUINIX INC	0.042	0.284	211	30,404	
SBA COMMUNICATIONS CORP	0.065	0.341	76	10,915	
小 計	口 数 ・ 金 額	2	13	1,388	199,172
	銘 柄 数 <比 率>	10	11	—	<1.7%>
(カナダ)			千カナダドル		
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	0.042	0.278	13	1,447	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	—	0.55	10	1,101	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.042	0.828	23	2,549
	銘 柄 数 <比 率>	1	2	—	<0.0%>
(フランス)			千ユーロ		
KLEPIERRE	0.102	0.568	12	1,936	
GECINA SA	0.022	0.121	11	1,776	
COVIVIO(FP)	0.026	—	—	—	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.06	—	—	—	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額	0.21	0.689	23	3,713
	銘 柄 数 <比 率>	4	2	—	<0.0%>
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND CO PLC	0.434	—	—	—	
SEGRO PLC	0.571	3	25	4,594	
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.5	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	1	3	25	4,594
	銘 柄 数 <比 率>	3	1	—	<0.0%>
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
MIRVAC GROUP	1	9	21	2,105	
APA GROUP	0.561	2	29	2,822	
GPT GROUP	0.927	4	19	1,872	

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
STOCKLAND	1	6	24	2,321	
DEXUS	0.517	2	20	1,994	
GOODMAN GROUP	0.791	5	111	10,717	
VICINITY CENTERS	1	9	17	1,691	
LENLEASE GROUP	0.327	1	12	1,180	
SCENTRE GROUP	3	15	38	3,699	
小 計	口 数 ・ 金 額	11	59	296	28,404
	銘 柄 数 <比 率>	9	9	—	<0.2%>
(香港)			千香港ドル		
HKT TRUST AND HKT LTD	2	11	99	1,823	
小 計	口 数 ・ 金 額	2	11	99	1,823
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2	14	28	2,998	
小 計	口 数 ・ 金 額	2	14	28	2,998
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	19	103	—	243,256
	銘 柄 数 <比 率>	29	27	—	<2.0%>

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国 S&P 500 EMIN	251	—
DJ EURO STOXX	60	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	11,367,563	95.2
投 資 信 託 受 益 証 券	5,826	0.0
投 資 証 券	237,430	2.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	335,840	2.8
投 資 信 託 財 産 総 額	11,946,659	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(11,940,699千円)の投資信託財産総額(11,946,659千円)に対する比率は100.0%です。

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

1米ドル=143.49円	1カナダドル=108.95円	1ユーロ=156.48円
1イギリスポンド=182.69円	1スイスフラン=160.15円	1スウェーデンクローナ=13.40円
1ノルウェークローネ=13.28円	1デンマーククローネ=21.01円	1オーストラリアドル=95.77円
1ニュージーランドドル=88.32円	1香港ドル=18.32円	1シンガポールドル=106.19円
1イスラエルシェケル=39.5827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 2023年6月26日現在
(A) 資 産	11,951,922,769円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	211,176,017
株 式(評価額)	11,367,563,200
投資信託受益証券(評価額)	5,826,601
投資証券(評価額)	237,430,115
未 収 入 金	5,337,345
未 収 配 当 金	14,591,712
差 入 委 託 証 拠 金	109,997,779
(B) 負 債	6,499,776
未 払 金	6,467,334
未 払 解 約 金	32,431
未 払 利 息	11
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	11,945,422,993
元 本	9,095,211,203
次 期 繰 越 損 益 金	2,850,211,790
(D) 受 益 権 総 口 数	9,095,211,203口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,134円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年6月28日 至 2023年6月26日
(A) 配 当 等 収 益	169,402,869円
受 取 配 当 金	162,549,518
受 取 利 息	5,136,643
そ の 他 収 益 金	1,723,096
支 払 利 息	△6,388
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,857,300,519
売 買 益	2,142,093,292
売 買 損	△284,792,773
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	58,858,013
取 引 益	80,839,837
取 引 損	△21,981,824
(D) そ の 他 費 用	△13,003,352
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	2,072,558,049
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	158,687,546
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	635,392,441
(H) 解 約 差 損 益 金	△16,426,246
(I) 計 (E+F+G+H)	2,850,211,790
次 期 繰 越 損 益 金(I)	2,850,211,790

(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1,562,498,874円、期中追加設定元本額は7,654,087,485円、期中一部解約元本額は121,375,156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。

外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	5,975,380,828円
DC外国株式ESGリーダーズインデックスファンド	1,978,096,873円
コア投資戦略ファンド(成長型)	414,398,493円
コア投資戦略ファンド(切替型)	185,653,993円
コア投資戦略ファンド(安定型)	174,450,525円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	155,144,883円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	104,285,474円
POFs用 外国株式ESGリーダーズ・インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	73,607,935円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	34,192,199円

お知らせ

該当事項はありません。

新興国株式インデックス マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物率	投資信託証券組入比率	純資産額
	円	%	騰落率	騰落率				
第11期(2019年11月11日)	28,752	7.2	31,224	7.6	96.3	3.0	0.6	62,222 百万円
第12期(2020年11月10日)	31,648	10.1	34,564	10.7	95.8	3.8	0.3	82,503
第13期(2021年11月10日)	37,038	17.0	40,526	17.3	93.6	6.2	0.3	104,132
第14期(2022年11月10日)	34,922	△5.7	38,407	△5.2	95.8	3.8	0.4	114,243
第15期(2023年11月10日)	39,228	12.3	43,509	13.3	94.4	5.2	0.4	164,504

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物率	投資信託証券組入比率
	円	%	騰落率	騰落率			
(当期首) 2022年11月10日	34,922	—	38,407	—	95.8	3.8	0.4
11月末	35,156	0.7	38,619	0.6	95.8	3.9	0.3
12月末	33,780	△3.3	37,187	△3.2	96.7	3.0	0.3
2023年 1月末	36,180	3.6	39,887	3.9	104.8	2.0	0.4
2月末	35,137	0.6	38,639	0.6	97.1	2.8	0.4
3月末	35,195	0.8	38,702	0.8	95.1	4.5	0.3
4月末	34,836	△0.2	38,388	△0.0	96.2	4.0	0.3
5月末	36,328	4.0	40,062	4.3	94.2	6.0	0.3
6月末	38,519	10.3	42,518	10.7	95.1	4.5	0.4
7月末	39,733	13.8	43,922	14.4	96.0	3.7	0.4
8月末	39,172	12.2	43,262	12.6	96.6	3.1	0.4
9月末	38,356	9.8	42,382	10.3	95.9	3.8	0.4
10月末	37,422	7.2	41,396	7.8	94.8	4.9	0.4
(当期末) 2023年11月10日	39,228	12.3	43,509	13.3	94.4	5.2	0.4

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。

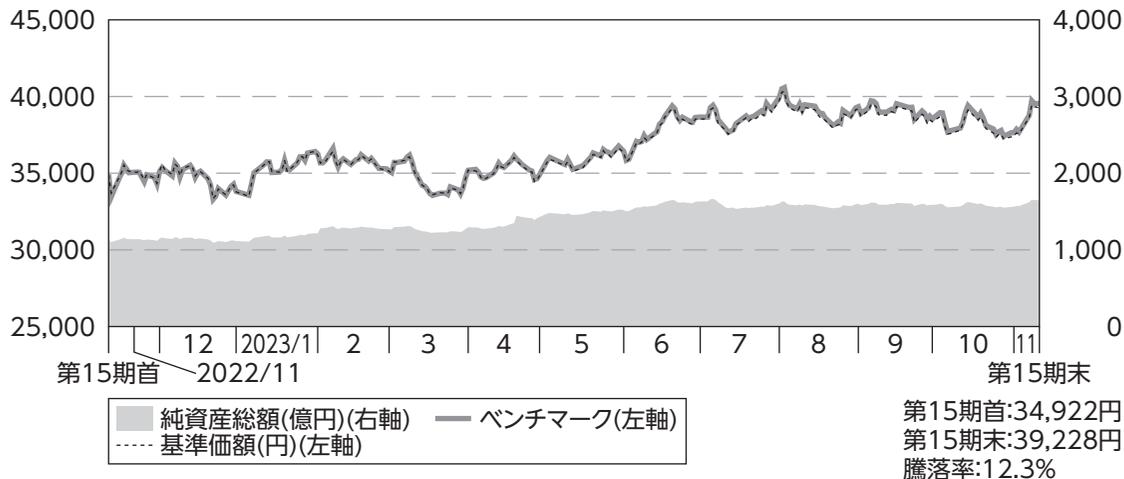
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスに関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. はMSCIエマージング・マーケット・インデックスの内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



新興国株式市場は上昇しました。

中国本土で新型コロナウイルス関連規制の緩和による経済再開期待が高まったことや、中国当局による大手不動産開発会社への支援などが好感され、2023年1月にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国の領空に中国の気球が侵入し米軍が気球を撃墜したことなどから、米中対立の激化が懸念され下落しました。8月初旬にかけては、中国共産党による不動産市場へのさらなる緩和姿勢や地方債務問題に取り組む方針などが好感され上昇しましたが、期末にかけては中国の大手不動産開発会社の社債利払い延期などを受け、投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどから上げ幅を縮小しました。

外国為替市場では、新興国通貨に対し円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

資金の流入などには、ヘッジ目的で海外の株価指数先物を利用し、DR(預託証券)および先物を含む株式の組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

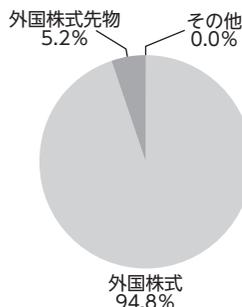
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	6.2%
2	MSCI EMERG M 2312	ー	5.2%
3	TENCENT HOLDINGS LTD	ケイマン諸島	3.8%
4	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	3.7%
5	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	ケイマン諸島	2.5%
6	RELIANCE INDUSTRIES LTD	インド	1.2%

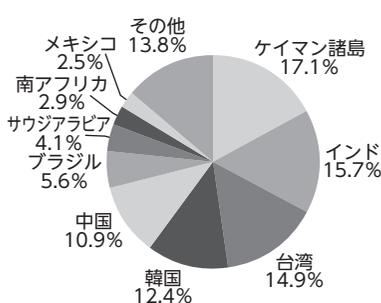
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	MEITUAN-CLASS B	ケイマン諸島	1.1%
8	PDD HOLDINGS INC-ADR	ケイマン諸島	0.9%
9	ICICI BANK LTD	インド	0.8%
10	INFOSYS LTD	インド	0.8%
組入銘柄数			1,248

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

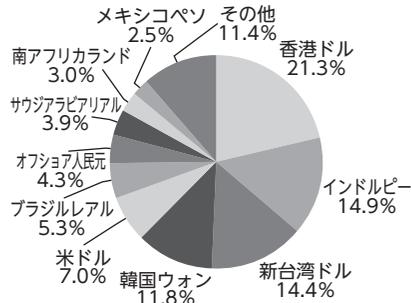
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

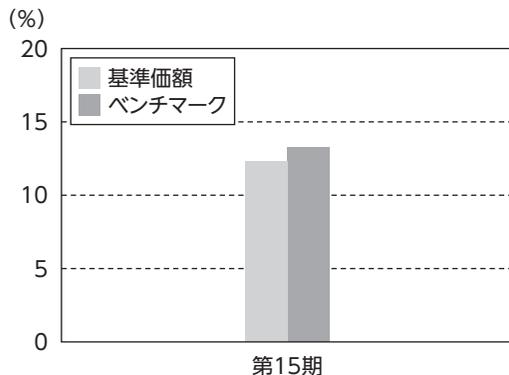


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未取・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで外国株式先物を想定元本ベースで純資産総額に対して5.2%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は概ねベンチマーク騰落率に連動しました。

差異の主な要因は、配当課税要因*1、先物要因、為替評価差要因*2(いずれもマイナス要因)です。

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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月1日~2023年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	10円 (8) (-) (-) (0) (-) (2)	0.026% (0.021) (-) (-) (0.000) (-) (0.005)	(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)	9 (9) (-) (-) (-) (0)	0.025 (0.025) (-) (-) (-) (0.000)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	66 (66) (-) (0)	0.179 (0.179) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	85	0.230	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(36,651円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<株 式>

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	ア メ リ カ	百株 4,801 (234)	千米ドル 9,591 (-)	百株 3,251 (2,273)	千米ドル 1,675 (5,299)
	メ キ シ コ	31,698 (3,135)	千メキシコペソ 127,124 (-)	25,085	千メキシコペソ 34,926
	ブ ラ ジ ル	30,371 (939)	千ブラジルリアル 65,537 (165)	5,865 (118)	千ブラジルリアル 14,135 (64)
	チ リ	29,379 (18)	千チリペソ 998,752 (1,443)	10 (-)	千チリペソ 502 (1,443)
	コ ロ ン ビ ア	640	千コロンビアペソ 2,295,955	8,361	千コロンビアペソ 3,188,943
	ギ リ シ ャ	1,978 (-)	千ユーロ 1,625 (△17)	320	千ユーロ 517
	ト ル コ	14,497 (2,884)	千トルコリラ 62,203 (-)	3,296	千トルコリラ 8,888
	チ ェ コ	72	千チェココルナ 6,641	93	千チェココルナ 6,441
	ハ ン ガ リ ー	240	千ハンガリーフォリント 212,263	91	千ハンガリーフォリント 98,786
	ポ ー ラ ン ド	3,456	千ポーランドズロチ 9,002	2,337	千ポーランドズロチ 1,638
国	香 港	377,389 (9,386)	千香港ドル 571,296 (41,156)	127,961 (-)	千香港ドル 90,188 (41)
	マ レ ー シ ア	24,370 (53)	千マレーシアリンギット 19,459 (24)	13,890	千マレーシアリンギット 3,749
	タ イ	72,438 (620)	千タイバーツ 214,520 (-)	15,997	千タイバーツ 48,046

		当 期			
		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外	フィリピン	百株 16,005 (630)	千フィリピンペソ 98,326 (-)	百株 46,592 (259)	千フィリピンペソ 67,116 (197)
	インドネシア	1,450,788 (39,161)	千インドネシアルピア 78,306,769 (355,963)	46,423 (517)	千インドネシアルピア 15,890,741 (30,557)
	韓 国	6,144 (454)	千韓国ウォン 47,048,785 (583,389)	1,523 (557)	千韓国ウォン 8,226,201 (271,399)
	台 湾	133,450 (6,506)	千新台幣ドル 1,203,284 (179)	15,240	千新台幣ドル 163,528
	中国 オフ ショ ア	104,619 (4,366)	千オフショア人民元 140,409 (316)	31,367	千オフショア人民元 42,241
	イ ン ド	72,347 (9,543)	千インドルピー 3,496,740 (-)	7,538	千インドルピー 535,604
	カ タ ー ル	13,424	千カタールリアル 9,181	-	千カタールリアル -
	南 ア フ リ カ	16,811 (67)	千南アフリカランド 148,422 (681)	2,249	千南アフリカランド 39,055
	アラブ 首 長 国 連 邦	25,395 (233)	千アラブ首長国連邦ディルハム 17,391 (-)	1,896	千アラブ首長国連邦ディルハム 441
	サ ウ ジ ア ラ ビ ア	9,035 (3,505)	千サウジアラビアリアル 47,232 (-)	1,332 (0.06)	千サウジアラビアリアル 4,442 (-)
ク ウ ェ ー ト	7,848 (2,030)	千クウェート・ディナール 671 (2)	1,031 (111)	千クウェート・ディナール 98 (0.14242)	

(注1) 金額は受渡代金です。

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

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	38,960	5,454	—	—
小 計	38,960	5,454	—	—
ブラジル	口	千ブラジルリアル	口	千ブラジルリアル
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	68,800	1,459	—	—
小 計	68,800	1,459	—	—
香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	— (19,877)	— (41)	19,877	31
小 計	— (19,877)	— (41)	19,877	31

(注1)金額は受渡代金です。

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別	当 期			
	買 建		売 建	
	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	百万円	百万円	百万円	百万円
株 式 先 物 取 引	46,644	43,074	—	—

(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	47,906,677千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	136,301,723千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.35

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

(注2) (c) 売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 0.839051	百万円 0.839051	% 100.0	百万円 0.839051	百万円 0.839051	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	48,256	6,468	13.4	48,209	6,474	13.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

<外国株式>

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
TRIP.COM GROUP LTD	670	—	—	—	消費者サービス
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	169	169	146	22,124	素材
CREDECORP LTD	87	108	1,298	196,688	銀行
SOUTHERN COPPER CORP	115	157	1,099	166,511	素材
COMMERCIAL INTL BANK-SP GDR	4,039	4,039	516	78,288	銀行
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	1,394	1,394	189	28,708	エネルギー
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	1,524	—	—	—	不動産管理・開発
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-B	247	1,407	301	45,678	ソフトウェア・サービス
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	0.04	0.04	—	—	素材
SEVERSTAL - GDR REG S	387	387	—	—	素材
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	0.01	—	—	—	生活必需品流通・小売り
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	527	546	773	117,156	一般消費財・サービス流通・小売り
TAL EDUCATION GROUP- ADR	410	792	734	111,152	消費者サービス
VK CO LTD	193	193	—	—	メディア・娯楽
YANDEX NV-A	327	327	—	—	メディア・娯楽
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1	1	—	—	素材
H WORLD GROUP LTD-ADR	242	301	1,043	158,063	消費者サービス
JOYY INC	61	61	254	38,568	メディア・娯楽
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	78	78	205	31,132	半導体・半導体製造装置
ZAI LAB LTD-ADR	128	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	140	140	—	—	銀行
QIFU TECHNOLOGY INC	80	207	311	47,233	金融サービス
NIO INC - ADR	1,712	2,312	1,727	261,609	自動車・自動車部品
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,135	1,135	845	128,098	メディア・娯楽
AUTOHOME INC-ADR	122	122	325	49,290	メディア・娯楽
MINISO GROUP HOLDING LTD-ADR	—	107	276	41,824	一般消費財・サービス流通・小売り
WEIBO CORP-SPON ADR	52	52	59	9,037	メディア・娯楽
KANZHUN LTD	221	388	572	86,755	メディア・娯楽
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	681	—	—	—	食品・飲料・タバコ
KE HOLDINGS INC	805	1,140	1,661	251,628	不動産管理・開発
LEGEND BIOTECH CORP-ADR	62	80	516	78,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LI AUTO INC - ADR	675	—	—	—	自動車・自動車部品
XPENG INC - ADR	532	—	—	—	自動車・自動車部品
OZON HOLDINGS PLC - ADR	75	75	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
LUFAX HOLDING LTD-ADR	1,141	1,141	117	17,801	金融サービス
PDD HOLDINGS INC-ADR	655	944	10,235	1,549,987	一般消費財・サービス流通・小売り
YUM CHINA HOLDINGS INC	540	664	2,866	434,110	消費者サービス
IQIYI INC-ADR	289	594	288	43,665	メディア・娯楽
HUTCHMED CHINA-ADR	72	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	537	638	1,512	228,985	運輸
BEIGENE LTD-ADR	60	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小 計	20,203	19,714	27,882	4,222,248	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	40	32	—	<2.6%>
(メキシコ)			千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A	3,135	3,135	3,526	30,050	資本財
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	2,424	3,131	66,570	567,213	食品・飲料・タバコ
GRUPO TELEVISIA SAB-SER CPO	2,884	5,906	5,032	42,880	メディア・娯楽
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	1,818	1,818	14,643	124,774	食品・飲料・タバコ
GRUMA S. A. B. -B	259	259	8,427	71,807	食品・飲料・タバコ
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	426	426	7,035	59,944	運輸
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	375	1,020	12,830	109,322	資本財
CEMEX SAB-SPONS	20,634	22,142	27,235	232,059	素材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	3,246	4,123	63,065	537,348	銀行
ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	1,785	1,785	5,617	47,861	素材
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	145	350	7,780	66,293	素材
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	1,818	1,818	6,255	53,302	家庭用品・パーソナル用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	233	335	12,811	109,160	運輸
GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	4,229	4,888	36,911	314,503	素材
AMERICA MOVIL-SAB DE C-SER L	35,136	—	—	—	電気通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	2,525	2,717	10,620	90,494	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV-NOM	504	818	14,122	120,331	食品・飲料・タバコ
WALMART DE MEXICO-SER V	6,666	8,272	53,367	454,720	生活必需品流通・小売り
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B	436	599	13,608	115,949	運輸
OPERADORA DE SITIS MEX- A-1	2,211	2,211	4,063	34,625	電気通信サービス
AMERICA MOVIL SAB DE CV	—	35,213	53,277	453,954	電気通信サービス
SITIOS LATINOAMERICA SAB DE	1,756	—	—	—	電気通信サービス
BANCO DEL BAJIO SA	—	1,427	7,720	65,778	銀行
小 計	92,653	102,401	434,525	3,702,378	
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	21	21	—	<2.3%>
(ブラジル)			千ブラジルリアル		
BRF SA	1,063	—	—	—	食品・飲料・タバコ
VALE SA	5,095	5,253	37,024	1,134,242	素材
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	370	370	1,518	46,530	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	1,224	2,117	7,892	241,779	公益事業
BANCO DO BRASIL S. A.	1,160	1,565	7,748	237,371	銀行
ITAUSA SA	5,283	7,746	7,227	221,418	銀行
GERDAU SA-PREF	1,418	1,555	3,535	108,295	素材
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	4,963	5,941	22,302	683,244	エネルギー
VIBRA ENERGIA SA	1,730	1,730	3,710	113,683	一般消費財・サービス流通・小売り
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	5,764	7,280	25,394	777,953	エネルギー
CCR SA	1,256	2,486	3,090	94,666	運輸
WEG SA	2,175	2,558	8,291	254,024	資本財
BANCO BRADESCO SA-PREF	5,849	8,281	12,638	387,170	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	3,260	3,260	4,394	134,635	銀行
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	994	994	1,244	38,125	素材

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SUZANO SA	900	1,217	6,506	199,333	素材	
CPFL ENERGIA SA	272	272	951	29,148	公益事業	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6,122	7,802	22,815	698,957	銀行	
BRASKEM SA-PREF A	193	—	—	—	素材	
ENGIE BRASIL SA	462	462	1,896	58,106	公益事業	
LOCALIZA RENT A CAR	924	1,373	7,588	232,461	運輸	
LOJAS RENNER S.A.	1,159	2,164	2,932	89,848	一般消費財・サービス流通・小売り	
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	756	756	1,772	54,287	エネルギー	
COSAN SA	1,621	1,621	2,814	86,209	エネルギー	
TOTVS SA	579	579	1,793	54,951	ソフトウェア・サービス	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,651	1,651	5,497	168,427	公益事業	
AMERICANAS SA	730	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り	
JBS SA	1,100	1,100	2,317	71,003	食品・飲料・タバコ	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	2,118	2,118	2,711	83,064	公益事業	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	505	505	3,086	94,557	公益事業	
ENEVA SA	—	1,022	1,176	36,036	公益事業	
HYPERA SA	545	545	1,764	54,062	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	7,998	8,874	10,968	336,019	金融サービス	
MAGAZINE LUIZA SA	3,055	3,055	522	16,004	一般消費財・サービス流通・小売り	
TELEFONICA BRASIL S.A.	523	894	4,426	135,597	電気通信サービス	
RAIA DROGASIL SA	1,225	1,892	4,889	149,779	生活必需品流通・小売り	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	690	1,089	3,408	104,422	保険	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	6,131	10,451	4,661	142,802	ヘルスケア機器・サービス	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	415	1,326	1,385	42,450	生活必需品流通・小売り	
AMBEV SA	6,286	7,562	10,140	310,661	食品・飲料・タバコ	
NATURA &CO HOLDING SA	1,003	1,003	1,349	41,331	家庭用品・パーソナル用品	
SENDAS DISTRIBUIDORA SA	—	1,518	1,897	58,130	生活必需品流通・小売り	
TIM SA	961	961	1,655	50,726	電気通信サービス	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	456	957	2,291	70,187	ヘルスケア機器・サービス	
LOCALIZA RENT A CAR SA-RIGHT	2	—	—	—	運輸	
ITAUSA SA-RECEIPT	—	107	101	3,102	銀行	
RUMO SA	1,597	2,443	5,582	171,014	運輸	
PRIO SA	847	1,300	5,814	178,141	エネルギー	
小 計	株 数 ・ 金 額	92,438	117,764	270,732	8,293,968	
	銘 柄 数 < 比 率 >	45	44	—	< 5.0% >	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO SANTANDER CHILE	115,501	115,501	472,170	78,322	銀行	
BANCO DE CREDITO E INVERSION	61	69	161,306	26,756	銀行	
BANCO DE CHILE	48,626	75,832	711,304	117,989	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	1,359	1,359	236,579	39,243	素材	
EMPRESAS COPEC SA	447	904	578,707	95,994	エネルギー	
CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	73	73	40,395	6,700	食品・飲料・タバコ	
CIA SUD AMERICANA DE VAPORES	24,611	24,611	124,043	20,576	運輸	
ENEL AMERICAS SA	34,913	34,913	338,622	56,169	公益事業	
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	180	212	928,647	154,041	資本財	
FALABELLA SA	708	708	132,890	22,043	一般消費財・サービス流通・小売り	

銘柄	銘柄	当期末(前期末)	期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)
CENCOSUD SA		1,379	3,064	464,704	77,083	生活必需品流通・小売り
ENEL CHILE SA		25,612	25,612	139,282	23,103	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	253,477 12	282,864 12	4,328,654 -	718,024 <0.4%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		505	505	776,859	29,256	公益事業
ECOPETROL SA		7,934	-	-	-	エネルギー
BANCOLOMBIA SA		293	506	1,561,498	58,806	銀行
BANCOLOMBIA SA-PREF		615	615	1,663,486	62,646	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	9,348 4	1,627 3	4,001,843 -	150,709 <0.1%>	
(ギリシャ)				千ユーロ		
ALPHA SERVICES AND HLD		2,636	2,636	377	61,000	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		736	736	405	65,577	銀行
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA		262	262	338	54,618	電気通信サービス
EUROBANK ERGASIAS SERVICES A		4,276	4,276	653	105,573	銀行
MYTILINEOS S. A.		98	202	705	114,038	資本財
MOTOR OIL (HELLAS) SA		-	52	116	18,805	エネルギー
OPAP SA		184	205	318	51,384	消費者サービス
JUMBO SA		193	193	517	83,617	一般消費財・サービス流通・小売り
PUBLIC POWER CORP		208	558	547	88,447	公益事業
PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS		-	1,130	315	50,961	銀行
ユーロ計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	8,597 8	10,255 10	4,295 -	694,027 <0.4%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S.		2,763	5,861	17,210	91,192	銀行
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		995	1,991	8,498	45,033	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		1,167	2,588	9,712	51,464	素材
FORD OTOMOTIV SANAYI AS		65	163	13,677	72,471	自動車・自動車部品
HEKTAS TICARET T. A. S		-	1,330	3,012	15,963	素材
KOC HOLDING AS		898	898	12,880	68,249	資本財
SASA POLYESTER SANAYI		-	1,180	5,230	27,716	素材
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI		2,987	2,987	14,596	77,344	資本財
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		-	316	8,374	44,375	自動車・自動車部品
TURK HAVA YOLLARI AO		866	866	19,938	105,649	運輸
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		1,430	1,430	7,948	42,117	電気通信サービス
TURKIYE IS BANKASI-C		3,844	3,844	7,712	40,865	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		116	1,425	21,474	113,784	エネルギー
YAPI VE KREDI BANKASI		-	3,711	6,298	33,371	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING		2,113	2,113	12,344	65,407	銀行
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		428	812	24,855	131,703	生活必需品流通・小売り
KOZA ALTIN ISLETMELERI AS		-	167	375	1,991	素材
PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS		-	71	5,310	28,137	運輸
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 <比 率>	17,677 12	31,763 18	199,452 -	1,056,839 <0.6%>	

銘柄	株数 (百株)	株数 (百株)	期末		業種
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(チェコ)			千		
KOMERCNI BANKA AS	226	133	8,952	58,911	銀行
CEZ AS	179	252	25,169	165,618	公益事業
MONETA MONEY BANK AS	607	607	5,500	36,193	銀行
小計	1,013	992	39,622	260,723	
銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)			千		
RIGHTER GEDEON NYRT	151	287	256,369	109,230	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NY	445	445	127,157	54,177	エネルギー
OTP BANK NYRT	386	400	550,288	234,459	銀行
小計	983	1,132	933,816	397,868	
銘柄数 <比率>	3	3	—	<0.2%>	
(ポーランド)			千		
M BANK SA	14	14	761	27,699	銀行
BUDIMEX	—	26	1,265	46,063	資本財
KGHM POLSKA MIEDZ SA	201	201	2,210	80,451	素材
BANK PEKAO SA	276	276	3,622	131,847	銀行
ORANGE POLSKA SA	556	—	—	—	電気通信サービス
ORLEN SA	833	1,029	6,513	237,070	エネルギー
LPP SA	1	1	1,753	63,817	耐久消費財・アパレル
SANTANDER BANK POLSKA SA	73	73	3,483	126,790	銀行
CD PROJEKT SA	67	67	737	26,840	メディア・娯楽
PKO BANK POLSKI SA	1,302	1,302	5,717	208,099	銀行
CYFROWY POLSAT SA	360	360	442	16,121	メディア・娯楽
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	634	998	720	26,219	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	485	865	4,098	149,188	保険
DINO POLSKA SA	59	94	4,072	148,229	生活必需品流通・小売り
ALLEGRO.EU SA	392	837	2,595	94,455	一般消費財・サービス流通・小売り
PEPCO GROUP NV	—	228	418	15,244	一般消費財・サービス流通・小売り
小計	5,260	6,379	38,413	1,398,138	
銘柄数 <比率>	14	15	—	<0.8%>	
(ロシア)			千		
SBERBANK OF RUSSIA PJSC	11,414	11,414	0.00011	—	銀行
PHOSAGRO PJSC	88	88	—	—	素材
POLYUS PJSC	39	39	—	—	素材
TATNEFT PJSC	1,794	1,794	0.00001	—	エネルギー
NOVOLIPETSK STEEL PJSC	1,959	1,959	0.00001	—	素材
MOBILE TELESYSTEMS PUBLIC JO	797	797	—	—	電気通信サービス
MAGNIT PJSC	79	79	—	—	生活必需品流通・小売り
NOVATEK PJSC	1,059	1,059	0.00001	—	エネルギー
GAZPROM PJSC	13,106	13,106	0.00013	—	エネルギー
LUKOIL PJSC	440	440	—	—	エネルギー
ROSNEFT OIL CO PJSC	1,340	1,340	0.00001	—	エネルギー
VTB BANK PJSC	7,560,740	7,560,740	0.0756	0.124	銀行
MMC NORILSK NICKEL PJSC	72	72	—	—	素材

銘柄	株数 (百株)	当期首(前期末)	当 期 末		業 種		
			株 数 (百株)	評 価 額		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
SURGUTNEFTEGAS PJSC	12,320	12,320	0.00012	—	エネルギー		
小 計	7,605,253	7,605,253	0.076	0.124			
	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	14	14	—	<0.0%>		
(香港)			千香港ドル				
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	670	2,340	2,503	48,548	素材		
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	3,220	3,220	2,208	42,830	運輸		
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	1,760	5,980	2,230	43,250	運輸		
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	152	152	1,928	37,395	食品・飲料・タバコ		
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	1,445	2,375	4,465	86,576	素材		
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED-R	595	595	1,535	29,765	公益事業		
HUANENG POWER INTL INC-H	7,040	7,040	2,555	49,551	公益事業		
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	7,840	7,840	3,755	72,816	生活必需品流通・小売り		
YANKUANG ENERGY GROUP COMPANY LIMITED-H	1,960	4,290	5,834	113,129	エネルギー		
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	798	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)		
HENGAN INTL GROUP CO LTD	875	875	2,305	44,706	家庭用品・パーソナル用品		
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP	11,441	13,881	9,508	184,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD-R	4,685	5,845	8,569	166,159	不動産管理・開発		
CHINA RESOURCES LAND LTD-R	4,051	5,411	15,611	302,698	不動産管理・開発		
CITIC LTD	7,680	10,380	7,027	136,258	資本財		
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	2,480	2,480	801	15,532	運輸		
LENOVO GROUP LTD	9,000	11,880	10,787	209,160	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
PETROCHINA CO LTD-H	26,480	32,180	15,961	309,489	エネルギー		
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY	1,840	1,840	1,321	25,619	保険		
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	33,434	38,694	15,554	301,611	エネルギー		
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	790	790	990	19,208	消費者サービス		
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	3,110	4,930	5,906	114,520	ソフトウェア・サービス		
ENN ENERGY HOLDINGS LIMITED	986	1,170	6,967	135,096	公益事業		
KUNLUN ENERGY COMPANY LIMITED	5,480	5,480	3,704	71,829	公益事業		
COSCO SHIPPING PORTS LTD	2,507	2,507	1,181	22,902	運輸		
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,156	3,206	2,301	44,633	不動産管理・開発		
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	1,655	1,655	1,662	32,227	運輸		
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	3,400	3,400	1,343	26,040	素材		
WHARF HOLDINGS	1,540	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)		
SHENZHEN INTL HOLDINGS-R	1,423	1,423	810	15,709	運輸		
CHINA GAS HOLDINGS LTD	4,664	4,664	3,358	65,113	公益事業		
KINGBOARD HOLDINGS LTD	670	670	1,247	24,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器		
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	7,580	9,480	9,053	175,545	自動車・自動車部品		
CHINA RESOURCES GAS GROUP LIMITED	1,060	1,068	2,520	48,872	公益事業		
BYD CO LTD-H	1,085	1,690	41,574	806,119	自動車・自動車部品		
CHINA OILFIELD SERVICES-H	2,420	2,420	2,098	40,682	エネルギー		
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	14,500	—	—	—	メディア・娯楽		
CHINA EVERBRIGHT ENVIRONMENT GROUP LTD	3,850	3,850	1,028	19,935	商業・専門サービス		
ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	175	175	1,679	32,558	運輸		
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	8,892	11,972	10,979	212,885	保険		
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	2,750	2,750	970	18,822	資本財		
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS-R	2,574	2,574	3,809	73,866	公益事業		

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	4,937	4,937	5,757	111,630	自動車・自動車部品
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	9,180	13,200	13,939	270,281	保険
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	7,290	9,050	10,624	206,012	素材
MMG LIMITED	3,040	—	—	—	素材
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	3,992	3,992	3,057	59,292	ヘルスケア機器・サービス
WEICHAI POWER CO LTD-H	2,118	4,088	5,134	99,558	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	—	220	179	3,485	エネルギー
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	2,280	4,160	4,243	82,275	食品・飲料・タバコ
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	880	1,160	6,658	129,106	食品・飲料・タバコ
GUANGDONG INVESTMENT LTD-R	4,460	4,460	2,461	47,736	公益事業
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	4,860	4,860	1,744	33,830	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	2,080	2,460	10,110	196,044	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	3,100	3,100	1,732	33,600	運輸
SINO BIOPHARMACEUTICAL	13,810	19,710	6,918	134,144	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA MENGNIU DAIRY CO	4,020	4,580	11,450	222,015	食品・飲料・タバコ
TENCENT HOLDINGS LTD	7,929	10,591	324,931	6,300,429	メディア・娯楽
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	8,190	10,580	40,204	779,555	保険
LI NING CO LTD	2,920	3,800	9,500	184,205	耐久消費財・アパレル
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	6,100	6,100	1,006	19,516	公益事業
CHINA POWER INTERNATIONAL	6,660	6,660	1,971	38,224	公益事業
AIR CHINA LIMITED-H	2,140	6,300	3,276	63,521	運輸
ZTE CORP-H	829	829	1,533	29,740	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA SHENHUA ENERGY CO -H	4,600	4,555	11,045	214,179	エネルギー
COSCO SHIPPING HOLDONGS CO-H	5,180	5,180	4,009	77,748	運輸
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	13,714	13,714	6,322	122,593	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT-R	1,700	4,420	3,757	72,848	資本財
BAIDU INC-CLASS A	2,819	3,514	36,796	713,490	メディア・娯楽
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	121,876	152,016	67,799	1,314,626	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	996	1,221	10,006	194,018	耐久消費財・アパレル
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	2,660	2,660	946	18,361	自動車・自動車部品
MINTH GROUP LTD	640	1,760	3,139	60,881	自動車・自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	3,640	3,640	1,619	31,407	素材
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	4,120	7,280	2,686	52,087	素材
BANK OF CHINA LTD-H	102,282	123,942	34,579	670,502	銀行
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	1,325	—	—	—	不動産管理・開発
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	725	725	579	11,232	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	4,949	6,219	18,502	358,757	銀行
IND&COMM BK OF CHINA-H	70,435	100,565	37,309	723,434	銀行
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	1,810	1,810	1,677	32,533	素材
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	690	690	517	10,034	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	1,960	1,960	631	12,237	資本財
CHINA COAL ENERGY CO - H	3,290	3,290	1,990	38,594	エネルギー
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	780	780	1,463	28,372	資本財
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	623	623	1,579	30,622	資本財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	10,166	—	—	—	不動産管理・開発
CMOC GROUP LTD-H	8,100	8,100	3,458	67,064	素材

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHINA CITIC BANK-H	9,512	15,652	5,446	105,615	銀行
SUNNY OPTICAL TECH	929	1,195	8,263	160,227	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	1,516	1,988	18,090	350,780	耐久消費財・アパレル
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	250	250	476	9,229	家庭用品・パーソナル用品
FOSUN INTERNATIONAL	2,880	2,880	1,393	27,028	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	5,780	6,259	588	11,408	不動産管理・開発
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	4,380	4,380	1,357	26,327	耐久消費財・アパレル
KINGSOFT CORP LTD	920	1,712	5,084	98,591	メディア・娯楽
GCL TECHNOLOGY HOLDINGS LTD	—	31,490	3,747	72,660	半導体・半導体製造装置
SINOTRUK HONG KONG LTD	545	1,665	2,387	46,295	資本財
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	7,060	7,060	2,527	49,007	資本財
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	800	800	436	8,469	食品・飲料・タバコ
DONGYUE GROUP	1,470	1,470	876	16,987	素材
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	605	1,605	5,689	110,323	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	5,600	5,560	2,579	50,023	食品・飲料・タバコ
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	3,866	3,866	6,579	127,584	保険
CRRC CORP LTD-H	4,090	9,360	3,023	58,621	資本財
XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	1,650	1,650	1,156	22,427	耐久消費財・アパレル
SINOPHARM GROUP CO-H	1,912	1,912	3,636	70,514	ヘルスケア機器・サービス
CHINA SUNTIEN GREEN ENERGY-H	2,360	—	—	—	エネルギー
CHINA RESOURCES CEMENT	2,880	2,880	558	10,833	素材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	3,583	3,583	1,322	25,639	自動車・自動車部品
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	2,190	5,555	3,916	75,936	素材
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	4,520	4,520	2,906	56,354	公益事業
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	1,284	1,284	1,474	28,581	ヘルスケア機器・サービス
CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	—	2,520	2,882	55,899	一般消費財・サービス流通・小売り
ZOOMLION HAEVY INDUSTRY SCIENCE AND TECH	1,162	—	—	—	資本財
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	1,600	1,600	1,433	27,797	資本財
LONGFOR PROPERTIES	2,290	3,435	4,204	81,524	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	964	1,054	1,764	34,211	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	6,744	6,744	1,726	33,476	銀行
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	1,412	—	—	—	資本財
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	3,750	3,750	832	16,142	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	39,100	39,350	11,096	215,165	銀行
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	920	920	1,810	35,106	一般消費財・サービス流通・小売り
FAR EAST HORIZON LTD	2,400	2,400	1,336	25,920	金融サービス
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	660	660	891	17,276	ヘルスケア機器・サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	2,857	2,857	4,635	89,877	金融サービス
SEAZEN GROUP LTD	7,680	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	2,470	2,470	3,280	63,602	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	3,572	3,572	1,621	31,444	金融サービス
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	715	715	1,208	23,429	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	9,390	18,780	4,732	91,764	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	730	730	1,321	25,620	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	4,830	4,830	2,038	39,521	金融サービス
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	2,760	2,760	1,656	32,109	ソフトウェア・サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	1,280	—	—	—	資本財
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	1,800	—	—	—	不動産管理・開発
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	10,590	10,750	3,891	75,456	銀行
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	480	480	706	13,700	食品・飲料・タバコ
GENSCRIPT BIOTECH CORP	1,320	1,320	3,161	61,299	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EAST BUY HOLDING LTD	—	440	1,304	25,296	消費者サービス
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	2,320	3,410	2,441	47,341	不動産管理・開発
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	537	537	991	19,221	生活必需品流通・小売り
SHANDONG GOLD MINING CO LTD-H	950	950	1,369	26,562	素材
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD-H	1,045	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHINA TOWER CORP LTD-H	45,660	70,820	5,523	107,109	電気通信サービス
XIAOMI CORP-CLASS B	19,062	24,042	39,717	770,120	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIGENE LTD	—	1,109	12,998	252,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WUXI APPTTEC CO LTD-H	422	636	6,101	118,304	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEITUAN-CLASS B	5,589	8,061	92,707	1,797,593	消費者サービス
TONGCHENG TRAVEL HOLDINGS LTD	1,668	1,668	2,465	47,802	消費者サービス
HUIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	1,160	2,340	3,898	75,590	消費者サービス
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	6,259	8,959	4,399	85,302	半導体・半導体製造装置
INNOVENT BIOLOGICS INC	1,390	2,030	9,601	186,180	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	8,320	8,320	640	12,422	金融サービス
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	1,040	1,040	532	10,324	一般消費財・サービス流通・小売り
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	2,430	2,430	1,620	31,427	資本財
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	1,240	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CANSINO BIOLOGICS INC-H	100	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	1,140	4,100	2,652	51,435	一般消費財・サービス流通・小売り
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	1,220	1,220	1,771	34,348	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA FEIHE LTD	5,640	5,640	2,763	53,586	食品・飲料・タバコ
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	19,309	26,039	213,917	4,147,862	一般消費財・サービス流通・小売り
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	334	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JD.COM INC - CL A	2,735	3,791	38,707	750,533	一般消費財・サービス流通・小売り
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	1,950	1,950	1,261	24,463	食品・飲料・タバコ
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-H	—	90	819	15,889	一般消費財・サービス流通・小売り
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	570	2,350	2,042	39,597	消費者サービス
KUAISHOU TECHNOLOGY	2,116	3,724	21,394	414,837	メディア・娯楽
HAIER SMART HOME CO LTD-H	3,030	3,106	6,957	134,904	耐久消費財・アパレル
BILIBILI INC-CLASS Z	266	266	3,053	59,210	メディア・娯楽
AKESO INC	—	610	2,909	56,419	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NETEASE INC	2,584	3,136	55,449	1,075,171	メディア・娯楽
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	880	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CHINA RUYI HOLDINGS LTD	2,680	12,680	2,345	45,485	メディア・娯楽
GDS HOLDINGS LTD-CL A	1,267	1,267	1,355	26,286	ソフトウェア・サービス
NONGFU SPRING CO LTD-H	2,276	2,826	12,476	241,924	食品・飲料・タバコ
LI AUTO INC-CLASS A	—	1,716	26,587	515,528	自動車・自動車部品
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	1,508	1,934	7,370	142,912	生活必需品流通・小売り
HYGEIA HEALTHCARE HOLDINGS C	352	754	3,717	72,076	ヘルスケア機器・サービス
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	676	1,190	3,451	66,914	不動産管理・開発

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	51	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA VANKE CO LTD-H	1,784	3,155	2,524	48,940	不動産管理・開発
NEW ORIENTAL EDUCATION & TEC	2,445	2,445	13,178	255,532	消費者サービス
POP MART INTERNATIONAL GROUP	646	646	1,498	29,060	一般消費財・サービス流通・小売り
JD LOGISTICS INC	—	3,262	3,105	60,214	運輸
TRIP.COM GROUP LTD	—	876	23,001	445,993	消費者サービス
XPENG INC - CLASS A SHARES	—	1,671	10,832	210,034	自動車・自動車部品
ZAI LAB LTD	—	1,282	2,994	58,066	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	900	900	1,813	35,163	半導体・半導体製造装置
CGN POWER CO LTD-H	14,280	14,280	2,627	50,947	公益事業
GF SECURITIES CO LTD-H	886	886	894	17,351	金融サービス
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	584	584	2,046	39,689	自動車・自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	2,660	2,660	2,878	55,806	金融サービス
3SBIO INC	1,190	4,455	3,145	60,986	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	—	3,390	1,613	31,288	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA LITERATURE LTD	516	516	1,545	29,965	メディア・娯楽
FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	640	640	1,007	19,532	半導体・半導体製造装置
DALI FOODS GROUP CO LTD	2,460	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	2,250	2,250	1,516	29,404	不動産管理・開発
BOC AVIATION LTD	238	238	1,284	24,896	資本財
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	1,161	1,161	2,496	48,400	保険
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	1,080	2,340	3,397	65,881	自動車・自動車部品
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	2,036	3,512	4,670	90,569	金融サービス
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	4,460	6,280	31,651	613,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GANFENG LITHIUM GROUP CO LTD-H	540	540	1,564	30,334	素材
C&D INTERNATIONAL INVESTMENT	—	914	1,547	30,004	不動産管理・開発
HUISHAN DAIRY UNTRADE	4,350	4,350	—	—	食品・飲料・タバコ
CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY-SPV	6,500	6,500	—	—	半導体・半導体製造装置
小 計	1,053,062	1,311,876	1,794,414	34,793,696	
株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	194	189	—	<21.2%>	
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
AMMB HOLDINGS BHD	3,007	3,007	1,151	36,891	銀行
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	9,433	9,200	5,317	170,336	銀行
CELCOMDIGI BHD	4,980	4,980	2,121	67,956	電気通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	1,065	1,072	784	25,120	運輸
RHB BANK BHD	2,170	2,193	1,234	39,557	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED	382	—	—	—	資本財
GAMUDA BHD	—	1,619	744	23,857	資本財
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	166	166	285	9,142	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	612	1,212	2,311	74,053	銀行
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	506	1,142	2,499	80,071	食品・飲料・タバコ
MALAYAN BANKING BHD	5,711	8,815	8,039	257,519	銀行
MISC BHD	2,175	2,175	1,566	50,172	運輸
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	72	182	2,220	71,124	食品・飲料・タバコ
PPB GROUP BERHAD	734	734	1,065	34,129	食品・飲料・タバコ
PETRONAS DAGANGAN BHD	251	884	2,022	64,788	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PETRONAS GAS BHD	755	1,484	2,513	80,526	公益事業	
TELECOM MALAYSIA BHD	2,715	2,715	1,414	45,319	電気通信サービス	
TENAGA NATIONAL BHD	3,052	4,417	4,373	140,096	公益事業	
QL RESOURCES BHD	1,248	1,248	698	22,386	食品・飲料・タバコ	
DIALOG GROUP BHD	4,136	4,136	872	27,959	エネルギー	
PUBLIC BANK BERHAD	18,704	21,229	8,937	286,287	銀行	
TOP GLOVE CORP BHD	5,049	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
GENTING BHD	2,716	2,716	1,146	36,714	消費者サービス	
GENTING MALAYSIA BERHAD	3,697	3,697	916	29,369	消費者サービス	
IOI CORPORATION BHD	2,703	2,703	1,070	34,292	食品・飲料・タバコ	
SIME DARBY BERHAD	3,363	3,363	800	25,642	資本財	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	1,813	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
AXIATA GROUP BERHAD	5,410	5,410	1,325	42,464	電気通信サービス	
MAXIS BHD	2,679	2,679	1,079	34,583	電気通信サービス	
INARI AMERTRON BHD	2,747	2,747	813	26,046	半導体・半導体製造装置	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	2,699	4,164	2,998	96,035	素材	
IHH HEALTHCARE BHD	2,293	4,714	2,800	89,694	ヘルスケア機器・サービス	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	4,802	7,576	3,704	118,669	素材	
SIME DARBY PLANTATION BHD	2,470	2,470	1,072	34,344	食品・飲料・タバコ	
MR DIY GROUP M BHD	3,034	3,034	482	15,455	一般消費財・サービス流通・小売り	
小 計	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	107,358 34	117,892 32	68,387 —	2,190,609 <1.3%>
(タイ)				千タイバーツ		
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	1,776	1,776	4,795	20,283	生活必需品流通・小売り	
KRUNG THAI BANK - NVDR	4,386	4,386	8,334	35,254	銀行	
CP AXTRA PCL-NVDR	—	2,379	6,364	26,920	生活必需品流通・小売り	
RATCHABURI ELECTRICITY-NVDR	814	3,560	11,482	48,571	公益事業	
TRUE CORP PCL-NVDR	9,614	—	—	—	電気通信サービス	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	832	832	10,940	46,279	銀行	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	—	17,132	13,105	55,438	エネルギー	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	169	712	9,184	38,851	公益事業	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	1,218	1,218	8,712	36,852	電気通信サービス	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	5,564	5,564	10,460	44,247	食品・飲料・タバコ	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	1,532	2,038	45,243	191,380	電気通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	8,401	8,401	9,913	41,934	一般消費財・サービス流通・小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	389	4,960	41,416	175,189	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PTT PCL-NVDR	13,936	16,846	56,012	236,934	エネルギー	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	1,849	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	1,015	1,015	4,669	19,749	金融サービス	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	8,720	8,720	6,627	28,033	不動産管理・開発	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	1,026	1,304	38,337	162,168	素材	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	5,270	6,549	45,188	191,145	運輸	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	2,263	3,784	23,650	100,039	不動産管理・開発	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	11,769	18,881	50,506	213,643	ヘルスケア機器・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	827	827	19,269	81,508	ヘルスケア機器・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	3,627	3,627	10,065	42,579	消費者サービス	

銘柄	当期末(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
THAI OIL PCL-NVDR	1,303	2,936	13,872	58,682	エネルギー	
CP ALL PCL-NVDR	7,838	9,564	52,602	222,506	生活必需品流通・小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	8,095	8,095	5,990	25,338	運輸	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	2,008	2,008	32,529	137,600	エネルギー	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	2,064	2,064	5,263	22,263	素材	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	4,861	4,861	17,622	74,542	素材	
JMT NETWORK SERVICES-NVDR	726	—	—	—	金融サービス	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	2,199	2,199	10,170	43,020	公益事業	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	8,170	8,170	6,536	27,647	運輸	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	534	3,210	7,736	32,723	公益事業	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	4,029	4,029	18,029	76,265	公益事業	
OSOTSPA PCL-NVDR	2,931	2,931	7,034	29,755	食品・飲料・タバコ	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	1,651	—	—	—	金融サービス	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	8,103	8,103	2,852	12,065	消費者サービス	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	1,822	1,822	6,786	28,708	一般消費財・サービス流通・小売り	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	2,027	2,027	7,449	31,510	素材	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	763	—	—	—	金融サービス	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	2,890	7,924	14,817	62,679	一般消費財・サービス流通・小売り	
SCB X PCL-NVDR	887	812	7,937	33,574	銀行	
TRUE CORP PCL/NEW-NVDR	—	20,156	11,690	49,451	電気通信サービス	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	463	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	898	898	3,771	15,953	金融サービス	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	682	682	2,966	12,549	公益事業	
小 計	株 数	金 額	149,943	207,004	669,939	2,833,844
	銘柄数	<比率>	43	40	—	<1.7%>
(フィリピン)					千フィリピンペソ	
AYALA LAND INC	7,941	12,809	37,786	102,412	不動産管理・開発	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	2,379	2,379	11,611	31,470	資本財	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	2,125	2,348	24,372	66,056	銀行	
GLOBE TELECOM INC	50	—	—	—	電気通信サービス	
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,531	1,531	31,697	85,910	運輸	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	3,035	5,861	22,858	61,954	資本財	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	610	610	13,324	36,113	消費者サービス	
METROPOLITAN BANK & TRUST	1,612	1,612	8,588	23,277	銀行	
BDO UNIBANK INC	2,199	3,947	53,294	144,443	銀行	
PLDT INC	104	104	12,949	35,096	電気通信サービス	
SM PRIME HOLDINGS INC	15,677	15,533	49,396	133,879	不動産管理・開発	
UNIVERSAL ROBINA CORP	955	955	10,721	29,059	食品・飲料・タバコ	
SM INVESTMENTS CORP	362	362	29,644	80,346	資本財	
AYALA CORPORATION	282	544	34,305	92,978	資本財	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	23,557	—	—	—	金融サービス	
MANILA ELECTRIC COMPANY	531	531	19,623	53,185	公益事業	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	68	—	—	—	資本財	
ACEN CORP	8,218	—	—	—	公益事業	
MONDE NISSIN CORP	4,905	—	—	—	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数 (百株)	当	期		業	種	
		期首(前期末)	末	評 価 額			
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	外 貨 建 金 額			邦 貨 換 算 金 額 (千円)
CONVERGE INFORMATION AND COM	3,200	—	—	—	電気通信サービス		
小 計	79,348	49,132	360,176	976,185			
	銘柄数 <比率>	20	14	—	<0.6%>		
(インドネシア)			千インドネシアルピア				
ANEKA TAMBANG TBK PT	9,858	9,858	1,631,499	15,825	素材		
BARITO PACIFIC TBK PT	28,825	28,922	3,094,663	30,018	素材		
UNITED TRACTORS TBK PT	2,009	2,009	4,595,587	44,577	エネルギー		
INDOFOOD SUKSES MAK TBK PT	4,291	4,291	2,714,057	26,326	食品・飲料・タバコ		
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	25,420	32,773	18,844,475	182,791	資本財		
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	7,923	9,533	5,386,145	52,245	食品・飲料・タバコ		
GUDANG GARAM TBK PT	596	—	—	—	食品・飲料・タバコ		
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	2,442	7,540	6,465,550	62,715	素材		
BANK MANDIRI	25,130	61,017	35,848,028	347,725	銀行		
UNILEVER INDONESIA TBK PT	11,574	11,574	4,166,640	40,416	家庭用品・パーソナル用品		
PT BANK RAKYAT INDONESIA	87,236	109,604	56,994,090	552,842	銀行		
BANK NEGARA INDONESIA PT	8,102	25,846	12,561,156	121,843	銀行		
KALBE FARMA TBK PT	41,885	41,885	6,785,370	65,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス		
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	3,456	3,949	2,517,513	24,419	素材		
BANK CENTRAL ASIA PT	70,152	86,893	78,203,700	758,575	銀行		
PT VALE INDONESIA TBK	3,042	3,042	1,429,740	13,868	素材		
TELEKOM INDONESIA PERSERO TBK	62,417	72,998	25,768,294	249,952	電気通信サービス		
ADARO ENERGY INDONESIA TBKPT	21,623	21,623	5,297,635	51,387	エネルギー		
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	1,610	5,994	6,263,730	60,758	食品・飲料・タバコ		
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	10,761	—	—	—	電気通信サービス		
SUMBER ALFARIA TRIJAYA TBK P	21,387	21,387	6,202,230	60,161	生活必需品流通・小売り		
SARANA MENARA NUSANTARA PT	28,406	28,406	2,712,773	26,313	電気通信サービス		
ADARO MINERALS INDONESIA TBK	9,640	—	—	—	素材		
GOTO GOJEK TOKOPEDIA TBK PT	—	1,346,399	10,097,992	97,950	一般消費財・サービス流通・小売り		
BANK JAGO TBK PT	4,749	—	—	—	銀行		
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	16,232	16,232	3,733,583	36,215	素材		
小 計	508,767	1,951,777	301,314,452	2,922,750			
	銘柄数 <比率>	25	22	—	<1.8%>		
(韓国)			千韓国ウォン				
SKC CO LTD	17	14	123,581	14,224	素材		
CHEIL COMMUNICATIONS INC	98	—	—	—	メディア・娯楽		
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	60	60	616,284	70,934	自動車・自動車部品		
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	41	41	1,028,541	118,385	保険		
DB INSURANCE CO LTD	42	100	834,127	96,008	保険		
COWAY CO LTD	90	90	461,739	53,146	耐久消費財・アパレル		
KT&G CORP	188	139	1,243,977	143,181	食品・飲料・タバコ		
S-1 CORPORATION	35	—	—	—	商業・専門サービス		
CJ CORP	12	—	—	—	資本財		
KAKAO CORP	378	520	2,372,112	273,030	メディア・娯楽		
CJ ENM CO LTD	8	—	—	—	メディア・娯楽		
HANWHA OCEAN CO LTD	—	145	350,582	40,352	資本財		
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	310	310	232,612	26,773	金融サービス		

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
NCSOFT CORPORATION	19	27	716,530	82,472	メディア・娯楽
LG UPLUS CORP	221	221	228,993	26,357	電気通信サービス
DOOSAN ENERBILITY CO LTD	550	820	1,157,062	133,177	資本財
POSCO INTERNATIONAL CORP	—	86	511,037	58,820	資本財
LG H&H CO LTD	13	13	449,800	51,772	家庭用品・パーソナル用品
LG CHEM LTD	61	80	3,780,672	435,155	素材
LG CHEM LTD-PREFERENCE	8	8	258,715	29,778	素材
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	3	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	594	677	2,358,674	271,483	銀行
HMM CO LTD	355	355	582,582	67,055	運輸
S-OIL CORPORATION	63	63	427,929	49,254	エネルギー
HANWHA SOLUTIONS CORPORATION	123	182	575,694	66,262	素材
MERITZ SECURITIES CO LTD	479	—	—	—	金融サービス
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	57	159	603,593	69,473	金融サービス
POSCO FUTURE M CO LTD	33	47	1,386,957	159,638	資本財
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	19	23	365,233	42,038	素材
HOTEL SHILLA CO LTD	43	43	291,884	33,595	一般消費財・サービス流通・小売り
HD KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	43	62	614,362	70,713	資本財
HYUNDAI MOBIS	81	101	2,273,152	261,639	自動車・自動車部品
SK HYNIX INC	689	873	11,183,360	1,287,204	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	97	97	345,298	39,743	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	34	34	350,763	40,372	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO	168	207	3,623,802	417,099	自動車・自動車部品
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	—	28	214,206	24,655	資本財
HYUNDAI STEEL CO	111	111	383,782	44,173	素材
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	283	283	326,078	37,531	銀行
KIA CORP	327	392	3,041,410	350,066	自動車・自動車部品
KOREA ZINC CO LTD	12	12	577,920	66,518	素材
KOREA ELECTRIC POWER CORP	264	442	760,485	87,531	公益事業
KOREAN AIR LINES CO LTD	237	268	580,696	66,838	運輸
CJ LOGISTICS	8	—	—	—	運輸
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	18	18	248,258	28,574	素材
HLB INC	100	239	732,626	84,325	ヘルスケア機器・サービス
LG ELECTRONICS INC	135	172	1,789,239	205,941	耐久消費財・アパレル
LG CORP	116	166	1,377,616	158,563	資本財
NH INVESTMENT & SECURITIES C	121	121	124,338	14,311	金融サービス
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	67	—	—	—	資本財
NAVER CORP	170	215	4,276,759	492,255	メディア・娯楽
L&F CO LTD	30	43	663,761	76,398	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	46	46	262,774	30,245	金融サービス
PACIFIC CORP	33	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
KANGWON LAND INC	77	285	443,610	51,059	消費者サービス
POSCO HOLDINGS INC	101	117	5,426,992	624,646	素材
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	185	303	745,380	85,793	資本財
COSMOAM&T CO LTD	—	39	618,181	71,152	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SDI CO LTD	68	88	3,877,708	446,324	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	68	92	1,232,605	141,872	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GREEN CROSS CORP	5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	6,036	7,504	52,760,079	6,072,685	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	951	951	681,410	78,430	資本財
HANWHA AEROSPACE CO LTD	—	58	724,171	83,352	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	1,077	1,330	7,569,236	871,219	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUHAN CORPORATION	125	131	816,770	94,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANON SYSTEMS	190	190	142,690	16,423	自動車・自動車部品
GS HOLDINGS CORP	65	65	277,894	31,985	資本財
LG DISPLAY CO LTD	383	383	510,935	58,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELLTRION INC	122	175	2,771,952	319,051	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANMI SEMICONDUCTOR CO LTD	—	72	445,137	51,235	半導体・半導体製造装置
HANA FINANCIAL GROUP	410	512	2,075,584	238,899	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	27	27	484,306	55,743	運輸
CELLTRION PHARM INC	19	20	147,719	17,002	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LOTTE SHOPPING CO	10	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
MERITZ FIRE & MARINE INSURAN	73	—	—	—	保険
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	121	121	840,678	96,762	保険
AMOREPACIFIC CORP	37	37	545,490	62,785	家庭用品・パーソナル用品
JYP ENTERTAINMENT CORP	—	41	439,845	50,626	メディア・娯楽
SK INNOVATION CO LTD	67	100	1,365,984	157,224	エネルギー
ECOPRO CO LTD	—	31	2,283,957	262,883	素材
CJ CHEILJEDANG CORP	7	18	558,136	64,241	食品・飲料・タバコ
STX PAN OCEAN CO LTD	297	297	136,785	15,744	運輸
LG INNOTEK CO LTD	14	26	645,692	74,319	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SK INC	45	63	1,020,482	117,457	資本財
KB FINANCIAL GROUP INC	486	645	3,449,586	397,047	銀行
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	58	134	624,514	71,881	資本財
LOTTE ENERGY MATERIALS CORP	21	21	89,889	10,346	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MERITZ FINANCIAL GROUP INC	79	169	903,070	103,943	金融サービス
HANMI PHARM CO LTD	11	11	347,805	40,032	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEEGENE INC	38	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EMART	35	—	—	—	生活必需品流通・小売り
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	70	70	308,077	35,459	自動車・自動車部品
HD HYUNDAI	51	51	306,656	35,296	エネルギー
BGF RETAIL CO LTD/NEW	16	16	239,904	27,612	生活必需品流通・小売り
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	31	31	387,094	44,554	食品・飲料・タバコ
SK CHEMICALS CO LTD/NEW	11	—	—	—	素材
NETMARBLE CORP	24	24	115,608	13,306	メディア・娯楽
WOORI FINANCIAL GROUP INC	770	1,138	1,397,635	160,867	銀行
ECOPRO BM CO LTD	65	82	2,045,652	235,454	資本財
SD BIOSENSOR INC	39	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	31	31	272,384	31,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KRAFTON INC	35	37	723,704	83,298	メディア・娯楽
HD HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO	21	21	234,553	26,997	資本財
SK IE TECHNOLOGY CO LTD	23	23	157,347	18,110	素材

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SK SQUARE CO LTD	116	116	557,931	64,217	資本財	
SK BIOSCIENCE CO LTD	21	21	144,480	16,629	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KAKAO GAMES CORP	30	30	81,264	9,353	メディア・娯楽	
HYBE CO LTD	24	24	524,488	60,368	メディア・娯楽	
LG ENERGY SOLUTION	31	73	3,161,301	363,865	資本財	
KAKAOBANK CORP	184	354	852,788	98,156	銀行	
F&F CO LTD / NEW	30	30	283,899	32,676	耐久消費財・アパレル	
KAKAOPAY CORP	—	30	130,415	15,010	金融サービス	
SAMSUNG SDS CO LTD	37	72	1,046,710	120,476	ソフトウェア・サービス	
ALTEOGEN INC	34	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SAMSUNG C&T CORP	119	119	1,383,942	159,291	資本財	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	22	26	1,934,025	222,606	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PEARL ABYSS CORP	46	46	218,967	25,203	メディア・娯楽	
DOOSAN BOBCAT INC	43	120	489,969	56,395	資本財	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	88	153	1,081,344	124,462	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	20,480	24,999	167,794,042	19,313,094	
	銘柄数 <比率>	111	103	—	<11.7%>	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACCTON TECHNOLOGY CORP	700	700	38,780	181,843	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ACER INC	2,558	6,178	21,623	101,392	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	920	1,270	45,371	212,753	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	619	859	35,451	166,237	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT CORP	2,341	4,541	18,348	86,038	素材	
TAIWAN BUSINESS BANK	—	7,987	10,463	49,063	銀行	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	890	1,880	12,690	59,504	半導体・半導体製造装置	
GIGABYTE TECHNOLOGY CO LTD	—	750	17,325	81,238	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	1,000	1,000	17,200	80,652	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	1,410	2,110	32,599	152,862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
QUANTA COMPUTER INC	2,862	4,082	89,411	419,257	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
EVA AIRWAYS CORP	3,860	3,860	11,444	53,666	運輸	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	1,187	1,187	21,781	102,135	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	5,935	6,083	10,585	49,637	銀行	
CHINA AIRLINES LTD	4,650	4,650	9,741	45,680	運輸	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	1,770	1,770	7,932	37,195	自動車・自動車部品	
CHINA STEEL	14,942	17,792	43,680	204,823	素材	
ADVANTECH CO LTD	433	762	26,043	122,118	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COMPAL ELECTRONICS	4,317	8,057	23,850	111,837	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	2,399	3,029	91,476	428,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	1,150	2,590	16,731	78,455	半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	5,053	5,843	68,657	321,939	電気通信サービス	
AUO CORP	7,560	12,680	20,289	95,137	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN MOBILE CO LTD	2,452	2,452	24,127	113,137	電気通信サービス	
EVERGREEN MARINE	1,232	1,832	19,970	93,643	運輸	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	3,480	3,620	10,951	51,351	資本財	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	704	789	14,754	69,185	耐久消費財・アパレル	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	199	399	23,682	111,050	耐久消費財・アパレル	

銘柄	当期末(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	740	960	46,389	217,526	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTICS CORP	5,048	5,978	46,809	219,494	素材
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	4,200	5,420	34,041	159,623	素材
GIANT MANUFACTURING	344	357	6,071	28,468	耐久消費財・アパレル
MEDIATEK INC	1,968	2,418	218,832	1,026,128	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	9,549	11,664	71,970	337,474	保険
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	10,953	15,183	31,505	147,734	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	420	540	34,868	163,502	一般消費財・サービス流通・小売り
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	2,160	2,160	16,999	79,710	電気通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	13,896	14,338	35,845	168,083	金融サービス
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	10,161	15,310	69,127	324,144	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	18,962	25,762	29,497	138,318	保険
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	14,916	20,025	48,962	229,587	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	15,852	19,382	189,754	889,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	13,946	16,849	65,040	304,982	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	150	150	32,035	150,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	13,480	20,006	35,511	166,517	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	19,318	19,318	17,309	81,166	保険
INVENTEC CO LTD	2,805	4,555	19,427	91,097	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	2,254	3,534	39,586	185,625	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	11,684	17,914	33,052	154,984	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING COMPANY LTD	22,582	26,412	66,955	313,960	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	12,732	16,533	44,309	207,773	銀行
NAN YA PLASTICS CORP	6,477	7,707	50,330	236,002	素材
WISTRON CORP	—	4,270	42,102	197,421	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
POU CHEN	2,737	2,737	8,103	37,999	耐久消費財・アパレル
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	6,453	7,763	54,658	256,297	食品・飲料・タバコ
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	885	885	23,552	110,440	生活必需品流通・小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	1,122	2,382	19,202	90,040	エネルギー
E INK HOLDINGS INC	940	1,440	24,840	116,477	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	3,100	2,790	9,586	44,951	不動産管理・開発
SYNEX TECHNOLOGY INTL CORP	2,021	2,021	13,864	65,009	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN CEMENT	6,484	9,134	30,051	140,914	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	31,323	38,863	2,164,718	10,150,582	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	15,260	17,010	82,668	387,641	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LIMITED	746	746	3,459	16,221	運輸
WALSIN LIHWA CORP	3,092	5,022	17,853	83,717	資本財
WINBOND ELECTRONICS CORP	3,490	3,630	9,112	42,727	半導体・半導体製造装置
YAGEO CORPORATION	435	425	23,210	108,836	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YANG MING MARINE TRANSPORT	2,170	2,170	9,081	42,583	運輸
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	4,720	4,720	14,089	66,065	運輸
GLOBAL UNICHIP CORP	—	130	21,645	101,495	半導体・半導体製造装置
INNOLUX CORP	13,900	13,205	16,177	75,855	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD	2,606	2,606	19,160	89,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	210	210	4,777	22,402	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
E MEMORY TECHNOLOGY INC	60	120	27,900	130,825	半導体・半導体製造装置

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
PEGATRON CORP	2,004	3,404	26,556	124,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	185	185	20,319	95,282	資本財	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	320	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	1,803	2,207	39,284	184,211	金融サービス	
PARADE TECHNOLOGIES LTD	80	80	8,520	39,951	半導体・半導体製造装置	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	30	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	1,379	1,379	14,274	66,936	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	11,107	15,149	38,933	182,563	銀行	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	4,518	6,899	30,876	144,784	銀行	
VOLTRONIC POWER TECHNOLOGY	90	90	12,825	60,137	資本財	
WIWYNN CORP	80	160	28,560	133,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LT	4,273	5,143	60,689	284,577	半導体・半導体製造装置	
SILERGY CORP	360	530	17,384	81,515	半導体・半導体製造装置	
POWERCHIP SEMICONDUCTOR MANU	3,010	5,760	16,387	76,841	半導体・半導体製造装置	
PHARMAESSENTIA CORP	—	250	9,362	43,901	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MOMO.COM INC	60	66	3,544	16,619	一般消費財・サービス流通・小売り	
GLOBALWAFERS CO LTD	240	420	21,588	101,228	半導体・半導体製造装置	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	310	310	9,656	45,280	耐久消費財・アパレル	
小 計	株 数 ・ 金 額	420,849	545,566	5,067,778	23,763,322	
	銘 柄 数 <比 率>	87	90	—	<14.4%>	
(中国オフショア)				千円/千人民元		
EVE ENERGY CO LTD-A	75	394	1,894	39,295	資本財	
CHINA ZHENHUA GROUP SCIENC-A	91	91	610	12,658	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
GUANGZHOU YUEXIU CAPITAL H-A	1,716	1,716	1,139	23,646	金融サービス	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	103	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	327	327	297	6,175	半導体・半導体製造装置	
GANFENG LITHIUM GROUP CO L-A	112	112	499	10,361	素材	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	481	481	687	14,268	資本財	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	183	183	393	8,160	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	80	80	558	11,580	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHEJIANG YONGTAI TECH-A	430	—	—	—	素材	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	407	407	676	14,040	資本財	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	—	41	124	2,582	ソフトウェア・サービス	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	22	22	345	7,160	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	—	73	203	4,214	資本財	
NORTH INDUSTRIES GROUP RED-A	404	404	575	11,942	資本財	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	163	163	473	9,822	メディア・娯楽	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	285	285	554	11,504	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,113	—	—	—	素材	
GEM CO LTD-A	—	2,898	1,733	35,949	素材	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	55	55	450	9,341	ソフトウェア・サービス	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	170	170	409	8,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	615	615	370	7,679	メディア・娯楽	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	100	100	902	18,710	資本財	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	413	537	422	8,768	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	277	277	655	13,601	耐久消費財・アパレル	

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	348	348	573	11,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	94	94	212	4,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	274	274	498	10,333	食品・飲料・タバコ
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	84	84	213	4,418	資本財
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	288	—	—	—	ソフトウェア・サービス
GUANGDONG HAIID GROUP CO-A	170	170	766	15,890	食品・飲料・タバコ
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	58	58	137	2,846	資本財
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	335	335	1,249	25,909	食品・飲料・タバコ
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	99	148	941	19,520	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	53	53	87	1,805	食品・飲料・タバコ
CETC CYBERSPACE SECURITY T-A	201	201	470	9,769	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	796	796	725	15,059	エネルギー
CHINA BAOAN GROUP-A	640	640	703	14,590	資本財
TIANQI LITHIUM CORP-A	114	114	628	13,027	素材
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	348	348	387	8,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TIANMA MICROELECTRONICS-A	470	470	503	10,451	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	922	—	—	—	素材
NAVINFO CO LTD-A	332	332	336	6,976	ソフトウェア・サービス
BY-HEALTH CO LTD-A	297	297	542	11,262	家庭用品・パーソナル用品
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	5,664	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	378	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	112	112	312	6,488	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	188	188	431	8,946	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	484	484	543	11,266	素材
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	102	102	440	9,132	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	68	68	530	10,995	半導体・半導体製造装置
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	197	197	689	14,311	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OPILM GROUP CO LTD-A	313	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	1,374	1,374	524	10,887	素材
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	705	917	1,654	34,315	ヘルスケア機器・サービス
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	280	280	871	18,086	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	—	502	1,372	28,480	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	70	70	229	4,754	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	148	148	256	5,311	ヘルスケア機器・サービス
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,994	1,994	1,130	23,452	資本財
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	221	221	1,050	21,784	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	97	97	406	8,440	ヘルスケア機器・サービス
YANTAI JEREH OILFIELD-A	280	280	820	17,018	エネルギー
TONGLING NONFERROUS METALS-A	3,316	3,316	984	20,429	素材
37 INTERACTIVE ENTERTAINME-A	245	245	603	12,517	メディア・娯楽
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	98	184	3,969	82,341	食品・飲料・タバコ
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	283	283	1,788	37,099	資本財
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	595	595	412	8,553	食品・飲料・タバコ
TCL ZHONGHUAN RENEWABLE EN-A	295	368	714	14,816	半導体・半導体製造装置
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	334	334	366	7,604	消費者サービス
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	264	343	381	7,920	ソフトウェア・サービス

銘柄	当 期 首 (前 期 末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	54	54	812	16,856	金融サービス
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	536	536	439	9,117	メディア・娯楽
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	464	464	1,482	30,756	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
QINGHAI SALT LAKE INDUSTRY-A	476	476	804	16,697	素材
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,394	1,394	960	19,923	メディア・娯楽
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	268	268	270	5,609	食品・飲料・タバコ
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	303	303	647	13,438	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DHC SOFTWARE CO LTD -A	557	557	367	7,625	ソフトウェア・サービス
IFLYTEK CO LTD - A	108	108	523	10,867	ソフトウェア・サービス
HESTEEL CO LTD-A	-	8,321	1,805	37,456	素材
GOERTEK INC -A	269	269	500	10,373	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	1,520	1,520	1,073	22,267	金融サービス
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	425	-	-	-	商業・専門サービス
BANK OF NINGBO CO LTD -A	583	583	1,466	30,427	銀行
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	168	168	228	4,746	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	1,020	1,122	462	9,589	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	199	199	114	2,373	金融サービス
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	793	793	298	6,185	不動産管理・開発
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	433	433	723	15,018	自動車・自動車部品
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	12	785	2,027	42,055	食品・飲料・タバコ
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	99	99	504	10,464	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EAST MONEY INFORMATION CO-A	978	1,174	1,824	37,853	金融サービス
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	91	91	1,103	22,897	食品・飲料・タバコ
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	302	415	6,579	136,490	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	641	641	453	9,400	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	1,146	1,146	452	9,390	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	547	547	606	12,572	不動産管理・開発
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	435	435	1,465	30,409	耐久消費財・アパレル
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	-	2,251	2,212	45,900	金融サービス
PING AN BANK CO LTD-A	1,194	1,194	1,252	25,981	銀行
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	381	381	703	14,588	食品・飲料・タバコ
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	2,072	2,072	934	19,384	金融サービス
CHINA VANKE CO LTD -A	537	537	642	13,322	不動産管理・開発
ZTE CORP-A	126	764	2,115	43,883	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	801	801	517	10,733	資本財
WEICHAI POWER CO LTD-A	432	432	610	12,671	資本財
GF SECURITIES CO LTD-A	606	606	902	18,730	金融サービス
GOLDWIND SCIENCE & TECHNOL-A	201	201	182	3,792	資本財
BYD CO LTD -A	97	170	4,068	84,387	自動車・自動車部品
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	500	500	332	6,886	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	248	248	697	14,465	素材
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	108	108	468	9,709	素材
LB GROUP CO LTD-A	153	153	271	5,630	素材
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	223	223	237	4,917	素材
YANGZHOU YANGJIE ELECTRONI-A	142	142	560	11,626	半導体・半導体製造装置
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	499	499	886	18,394	素材

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
CHACHA FOOD CO LTD-A	100	—	—	—	食品・飲料・タバコ
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	31	31	796	16,529	半導体・半導体製造装置
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	277	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	224	224	479	9,945	半導体・半導体製造装置
PERFECT WORLD CO LTD-A	228	228	312	6,484	メディア・娯楽
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	16	16	427	8,874	食品・飲料・タバコ
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,475	1,475	1,051	21,815	素材
ZHEJIANG JINGSHENG MECHAN-A	170	170	799	16,578	半導体・半導体製造装置
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	80	80	404	8,398	耐久消費財・アパレル
NINESTAR CORP-A	185	185	490	10,177	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNDA HOLDING CO LTD-A	218	218	202	4,199	運輸
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	825	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	161	161	961	19,938	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASYMCHAM LABORATORIES TIAN-A	2	187	2,791	57,913	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	56	56	430	8,940	食品・飲料・タバコ
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	248	248	148	3,071	ヘルスケア機器・サービス
S F HOLDING CO LTD-A	203	531	2,125	44,081	運輸
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	63	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	602	602	379	7,867	金融サービス
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	75	75	575	11,932	半導体・半導体製造装置
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	455	455	275	5,710	銀行
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	269	269	254	5,284	ソフトウェア・サービス
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	28	28	129	2,690	耐久消費財・アパレル
CSC FINANCIAL CO LTD-A	241	241	629	13,068	金融サービス
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	112	162	416	8,644	素材
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	276	276	342	7,103	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	371	371	530	11,005	素材
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	—	114	673	13,975	食品・飲料・タバコ
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	437	437	448	9,300	金融サービス
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	185	222	548	11,384	生活必需品流通・小売り
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	1,096	1,096	784	16,267	素材
CHENGXIN LITHIUM GROUP CO-A	206	206	482	10,003	素材
CHONGQING FULING ZHACAI-A	46	59	93	1,936	食品・飲料・タバコ
SATELLITE CHEMICAL CO LTD-A	554	554	869	18,043	素材
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	112	157	533	11,059	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	41	41	285	5,921	素材
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	70	70	314	6,519	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JUEWEI FOOD CO LTD-A	70	70	240	4,979	食品・飲料・タバコ
OPPEIN HOME GROUP INC-A	77	77	682	14,166	耐久消費財・アパレル
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	74	74	275	5,719	素材
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	87	87	878	18,225	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENNAI CIRCUITS CO LTD-A	47	47	354	7,356	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	84	84	1,007	20,908	自動車・自動車部品
ZHEJIANG WOLVO BIO-PHARMAC-A	97	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	123	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
BGI GENOMICS CO LTD-A	55	55	277	5,755	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	92	147	384	7,980	素材
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	108	108	335	6,955	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	573	573	467	9,704	金融サービス
HOSHINE SILICON INDUSTRY C-A	24	24	139	2,903	素材
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	—	1,574	1,926	39,964	銀行
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	493	493	524	10,881	素材
BETHEL AUTOMOTIVE SAFETY S-A	—	108	828	17,190	自動車・自動車部品
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	28	28	192	4,003	ヘルスケア機器・サービス
NANJING SECURITIES CO LTD-A	427	—	—	—	金融サービス
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	451	451	703	14,585	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	84	79	2,243	46,540	ヘルスケア機器・サービス
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	30	30	264	5,486	ソフトウェア・サービス
OVCTEK CHINA INC-A	72	72	183	3,798	ヘルスケア機器・サービス
SG MICRO CORP-A	31	40	369	7,660	半導体・半導体製造装置
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	177	397	7,615	157,982	資本財
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR I-A	62	62	659	13,674	半導体・半導体製造装置
WUXI APPTTEC CO LTD-A	164	164	1,464	30,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HAINAN AIRPORT INFRASTRUCT-A	—	5,228	1,976	40,993	不動産管理・開発
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	42	42	218	4,524	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	17	17	251	5,216	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	792	792	1,144	23,740	素材
SHENZHEN DYNANONIC CO LTD-A	6	9	77	1,603	素材
AMLOGIC SHANGHAI INC-A	101	101	652	13,543	半導体・半導体製造装置
WESTERN SUPERCONDUCTING TE-A	117	164	800	16,609	素材
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	70	70	1,193	24,760	半導体・半導体製造装置
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	210	210	1,197	24,842	半導体・半導体製造装置
NINGBO RONBAY NEW ENERGY T-A	116	116	515	10,692	資本財
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	72	72	804	16,696	半導体・半導体製造装置
HOYUAN GREEN ENERGY CO LTD-A	53	74	286	5,950	半導体・半導体製造装置
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	111	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	362	362	531	11,031	資本財
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	3,086	4,011	1,014	21,054	銀行
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	195	195	69	1,440	素材
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	379	379	828	17,186	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	467	467	395	8,205	金融サービス
SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	79	79	611	12,682	半導体・半導体製造装置
NINGBO ORIENT WIRES & CABL-A	125	125	560	11,619	資本財
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	3,388	3,971	1,957	40,610	運輸
STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	28	28	525	10,905	半導体・半導体製造装置
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	25	40	527	10,943	資本財
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	1,415	1,415	652	13,531	銀行
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	794	794	878	18,232	金融サービス
SHANGHAI JUNSHI BIOSCIENCE-A	190	190	820	17,017	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CANMAX TECHNOLOGIES CO LTD-A	161	209	571	11,852	素材
GINLONG TECHNOLOGIES CO LT-A	24	24	168	3,484	資本財
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	101	101	351	7,297	食品・飲料・タバコ

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	—	665	1,907	39,576	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	94	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
YONGXING SPECIAL MATERIALS-A	14	18	88	1,840	素材
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	244	342	835	17,325	半導体・半導体製造装置
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	—	3,148	2,323	48,192	金融サービス
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	74	104	519	10,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANJOY FOODS GROUP CO LTD-A	30	30	378	7,841	食品・飲料・タバコ
JINKO SOLAR CO LTD-A	—	229	232	4,820	半導体・半導体製造装置
CAMBRICON TECHNOLOGIES-A	—	114	1,513	31,398	半導体・半導体製造装置
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPE-A	20	20	687	14,270	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENZHEN TRANSSION HOLDING-A	64	64	810	16,813	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	48	48	1,606	33,315	ソフトウェア・サービス
NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	641	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BEIJING ROBOROCK TECHNOLOG-A	14	—	—	—	耐久消費財・アパレル
CHINA ENERGY ENGINEERING COR	6,031	6,031	1,314	27,273	資本財
PETROCHINA CO LTD-A	1,000	1,000	709	14,707	エネルギー
IND & COMM BK OF CHINA-A	5,786	5,786	2,765	57,371	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	3,536	10,321	3,746	77,717	銀行
CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	200	890	2,734	56,715	エネルギー
CHINA MERCHANTS BANK-A	1,377	1,860	5,702	118,296	銀行
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	668	1,048	4,535	94,088	保険
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	952	2,055	3,107	64,454	銀行
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	1,383	4,373	3,030	62,863	銀行
CHINA MINSHENG BANKING-A	2,736	2,736	1,050	21,793	銀行
SAIC MOTOR CORP LTD-A	426	426	633	13,140	自動車・自動車部品
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	92	115	20,632	427,991	食品・飲料・タバコ
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	989	5,119	2,974	61,694	銀行
CITIC SECURITIES CO-A	496	1,410	3,168	65,729	金融サービス
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	182	1,002	2,515	52,171	保険
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	444	444	219	4,559	運輸
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	1,798	1,798	4,059	84,217	公益事業
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	1,605	1,605	1,144	23,738	運輸
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	1,289	8,353	2,480	51,462	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	2,109	5,624	2,896	60,081	資本財
HUAXIA BANK CO LTD-A	1,194	1,194	667	13,845	銀行
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	343	343	947	19,660	食品・飲料・タバコ
BANK OF BEIJING CO LTD -A	580	580	260	5,402	銀行
CHINA UNITED NETWORK-A	—	4,228	1,898	39,379	電気通信サービス
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	387	3,695	2,242	46,525	素材
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	294	294	702	14,565	素材
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	286	286	408	8,483	金融サービス
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	818	818	916	19,004	不動産管理・開発
CRRG CORP LTD-A	1,858	1,858	992	20,581	資本財
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	381	391	1,891	39,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	208	208	442	9,177	素材
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	315	315	513	10,644	金融サービス

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
QINGDAO HAIER CO LTD-A	260	1,011	2,252	46,725	耐久消費財・アパレル
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	419	419	599	12,429	資本財
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	3,157	3,157	1,158	24,034	公益事業
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	1,249	1,249	796	16,529	銀行
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	—	895	670	13,905	エネルギー
GEMDALE CORP-A	455	455	247	5,143	不動産管理・開発
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	175	403	3,423	71,024	素材
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	—	4,867	2,160	44,826	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,056	2,691	3,196	66,316	素材
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	828	—	—	—	金融サービス
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	676	1,769	2,140	44,401	公益事業
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	699	839	1,903	39,492	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	122	207	1,988	41,253	一般消費財・サービス流通・小売り
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	4,610	4,610	737	15,300	素材
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	1,225	1,225	418	8,690	金融サービス
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	1,643	1,643	948	19,665	素材
AIR CHINA LTD-A	259	259	203	4,217	運輸
TBEA CO LTD-A	225	292	418	8,683	資本財
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	—	2,301	1,603	33,268	資本財
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	3,309	3,309	1,075	22,308	資本財
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	1,632	1,632	845	17,536	資本財
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	552	552	1,420	29,470	資本財
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	53	53	197	4,105	運輸
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	160	160	470	9,754	ヘルスケア機器・サービス
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	1,140	1,140	481	9,979	金融サービス
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	343	343	598	12,415	自動車・自動車部品
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	923	923	1,333	27,666	公益事業
AECC AVIATION POWER CO-A	114	114	410	8,513	資本財
BANK OF NANJING CO LTD -A	1,475	1,475	1,140	23,651	銀行
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	104	216	160	3,325	ヘルスケア機器・サービス
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	—	1,835	1,768	36,694	運輸
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	1,142	1,142	732	15,194	金融サービス
BEIJING TONGRENTANG CO-A	284	284	1,421	29,479	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	72	72	165	3,434	素材
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	316	316	742	15,404	資本財
YANKUANG ENERGY GROUP CO-A	207	310	611	12,682	エネルギー
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	400	400	168	3,493	運輸
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	432	432	662	13,746	資本財
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	878	99	194	4,027	エネルギー
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	165	165	540	11,210	ソフトウェア・サービス
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	131	131	227	4,723	ソフトウェア・サービス
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	185	185	683	14,176	自動車・自動車部品
AVICOPTER PLC-A	155	155	578	11,993	資本財
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	—	3,076	2,448	50,791	金融サービス
SHAN XI HUA YANG GROUP NEW-A	—	2,377	1,916	39,757	エネルギー
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	600	600	238	4,953	素材

銘柄	当期首(前期末)	期 末			業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	228	228	132	2,752	資本財
ZHANGZHOU PIENITZEHUANG PHA-A	39	39	978	20,295	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	93	93	2,330	48,342	食品・飲料・タバコ
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	208	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA MERCHANTS ENERGY -A	—	1,467	911	18,897	エネルギー
KINGFA SCI. & TECH CO LTD-A	304	—	—	—	素材
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	1,105	1,105	711	14,761	一般消費財・サービス流通・小売り
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	85	—	—	—	エクイティ不動産投資信託 (REIT)
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	—	322	1,167	24,222	ソフトウェア・サービス
ZHEJIANG JUHUA CO-A	—	1,294	1,921	39,861	素材
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	2,866	2,866	854	17,716	素材
BEIJING TIANANTAN BIOLOGICAL-A	280	831	2,438	50,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	411	411	600	12,456	資本財
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	—	640	891	18,493	エネルギー
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	115	115	396	8,230	食品・飲料・タバコ
SICHUAN ROAD&BRIDGE GROUP-A	179	250	199	4,137	資本財
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	90	90	142	2,965	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	243	243	426	8,856	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TONGWEI CO LTD-A	316	316	882	18,301	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	79	95	417	8,659	ソフトウェア・サービス
JCET GROUP CO LTD-A	298	298	940	19,515	半導体・半導体製造装置
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	75	75	191	3,979	半導体・半導体製造装置
CHONGQING BREWERY CO-A	79	79	595	12,351	食品・飲料・タバコ
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	262	262	857	17,782	消費者サービス
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	100	—	—	—	素材
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	179	179	546	11,342	素材
XIAMEN FARATRONIC CO LTD-A	47	47	482	10,015	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHINA JUSHI CO LTD -A	922	922	1,080	22,415	素材
NINGBO SHANSHAN CO LTD-A	471	471	669	13,883	素材
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	114	114	667	13,849	資本財
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	902	902	742	15,399	資本財
TONGKUN GROUP CO LTD-A	98	98	134	2,780	素材
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	78	101	681	14,134	素材
ANGEL YEAST CO LTD-A	107	107	373	7,750	食品・飲料・タバコ
CNGR ADVANCED MATERIAL CO -A	—	103	565	11,736	素材
NINGBO DEYE TECHNOLOGY CO -A	33	59	445	9,247	資本財
BLOOMAGE BIOTECHNOLOGY COR-A	90	90	707	14,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODWE TECHNOLOGIES CO LTD-A	—	37	464	9,644	資本財
CHINA RESOURCES MICROELECT-A	210	210	1,093	22,682	半導体・半導体製造装置
TRINA SOLAR CO LTD-A	254	254	803	16,672	半導体・半導体製造装置
CHINA THREE GORGES RENEWAB-A	2,413	2,413	1,148	23,826	公益事業
ZANGGE MINING CO LTD-A	374	374	849	17,626	素材
PYLON TECHNOLOGIES CO LTD-A	27	27	317	6,575	資本財
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	470	1,003	2,432	50,453	半導体・半導体製造装置
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	90	90	1,290	26,764	自動車・自動車部品
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	962	962	1,748	36,279	エネルギー

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種	
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	202	540	2,081	43,183	食品・飲料・タバコ	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	173	173	969	20,107	食品・飲料・タバコ	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	293	293	554	11,505	自動車・自動車部品	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	263	263	769	15,969	資本財	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	7	7	50	1,037	自動車・自動車部品	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	723	723	1,093	22,691	金融サービス	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	1,738	1,738	1,256	26,066	公益事業	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	22	22	107	2,231	食品・飲料・タバコ	
ANHUI YINGJIA DISTILLERY C-A	183	183	1,377	28,584	食品・飲料・タバコ	
SKSHU PAINT CO LTD-A	—	99	586	12,167	素材	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	2,297	2,297	1,571	32,597	銀行	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	1,127	1,127	1,201	24,921	銀行	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	392	392	758	15,731	自動車・自動車部品	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	557	557	765	15,875	運輸	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	79	79	291	6,051	耐久消費財・アパレル	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	20	20	181	3,755	ヘルスケア機器・サービス	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	556	556	917	19,041	公益事業	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	151	211	574	11,921	半導体・半導体製造装置	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	101	141	508	10,542	生活必需品流通・小売り	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	29	29	874	18,142	メディア・娯楽	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	82	82	411	8,531	資本財	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	405	405	364	7,558	金融サービス	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	124	—	—	—	素材	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	36	36	61	1,273	金融サービス	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	110	110	426	8,853	商業・専門サービス	
SEAZEN HOLDINGS CO LTD-A	128	128	158	3,295	不動産管理・開発	
小 計	株 数 銘柄数	金 額 <比率>	177,568 345	255,186 347	342,099 —	7,096,437 <4.3%>
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LTD	3,870	4,813	1,112,212	2,035,349	エネルギー	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	962	935	35,871	65,645	エネルギー	
ASIAN PAINTS LTD	469	569	175,325	320,845	素材	
BANK OF BARODA	—	2,483	47,924	87,701	銀行	
EICHER MOTORS LTD	178	178	63,291	115,824	自動車・自動車部品	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	1,107	1,501	233,146	426,658	自動車・自動車部品	
SHREE CEMENT LTD	13	13	35,992	65,865	素材	
ICICI BANK LTD	6,532	8,122	761,418	1,393,395	銀行	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	594	594	17,726	32,439	エネルギー	
STATE BANK OF INDIA	2,269	2,688	155,607	284,761	銀行	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	264	264	19,445	35,585	運輸	
TATA STEEL LTD	9,408	11,379	136,212	249,268	素材	
JSW STEEL LTD	993	993	74,548	136,424	素材	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	610	932	84,129	153,957	食品・飲料・タバコ	
BAJAJ HOLDINGS AND INVESTMENT	—	29	21,209	38,813	金融サービス	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	145	150	70,126	128,330	食品・飲料・タバコ	
NESTLE INDIA LIMITED	39	51	124,677	228,158	食品・飲料・タバコ	

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
GAIL INDIA LTD	2,621	5,045	62,690	114,722	公益事業
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	735	1,681	293,417	536,954	銀行
VEDANTA LTD	1,071	1,071	25,201	46,119	素材
SUPREME INDUSTRIES LTD	—	100	42,313	77,433	素材
TITAN CO LTD	465	565	185,673	339,782	耐久消費財・アパレル
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	3,815	5,397	103,984	190,291	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE (INDIA)	95	260	55,344	101,281	家庭用品・パーソナル用品
LUPIN LTD	265	265	31,988	58,538	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MPHASIS LTD	77	193	42,320	77,446	ソフトウェア・サービス
ACC LTD	53	—	—	—	素材
BAJAJ FINANCE LTD	344	441	326,163	596,879	金融サービス
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	2,193	—	—	—	金融サービス
INFOSYS LTD	4,286	5,324	732,264	1,340,044	ソフトウェア・サービス
WIPRO LTD	1,795	1,820	69,232	126,696	ソフトウェア・サービス
TATA ELXSI LTD	41	41	33,607	61,501	ソフトウェア・サービス
MRF LTD	4	4	46,695	85,453	自動車・自動車部品
INDIAN OIL CORP LTD	2,906	5,970	61,458	112,469	エネルギー
HINDUSTAN UNILEVER LTD	1,040	1,295	320,847	587,151	家庭用品・パーソナル用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	134	145	77,141	141,168	ヘルスケア機器・サービス
CUMMINS INDIA LTD	—	209	36,679	67,123	資本財
HCL TECHNOLOGIES LTD	1,398	1,390	176,287	322,606	ソフトウェア・サービス
DABUR INDIA LTD	797	797	42,717	78,172	家庭用品・パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	122	137	43,539	79,676	自動車・自動車部品
SRF LTD	191	191	44,766	81,922	素材
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	88	88	22,815	41,752	自動車・自動車部品
DR. REDDY'S LABORATORIES	126	183	99,900	182,818	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BHARTI AIRTEL LTD	2,948	3,589	334,672	612,450	電気通信サービス
UNITED SPIRITS LTD	324	585	64,232	117,546	食品・飲料・タバコ
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	1,222	1,451	170,805	312,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DIVI'S LABORATORIES LTD	147	219	76,712	140,384	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	157	213	221,845	405,976	自動車・自動車部品
AUROBINDO PHARMA LTD	354	354	33,667	61,611	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TVS MOTOR CO LTD	—	412	67,959	124,366	自動車・自動車部品
JINDAL STEEL & POWER LTD	697	697	43,591	79,772	素材
BIOCON LTD	582	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMVARDHANA MOTHERSON INTERN	1,866	5,212	46,879	85,790	自動車・自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	212	385	74,976	137,206	金融サービス
PETRONET LNG LTD	837	837	16,764	30,678	エネルギー
CIPLA LTD	599	885	109,659	200,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LARSEN & TOUBRO LTD	826	1,075	325,459	595,591	資本財
ULTRATECH CEMENT LTD	133	198	171,315	313,507	素材
ASHOK LEYLAND LIMITED	—	2,419	41,244	75,477	資本財
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	1,173	1,431	479,405	877,312	ソフトウェア・サービス
ADANI ENTERPRISES LTD	342	230	50,918	93,180	資本財
NTPC LTD	6,641	6,641	157,866	288,895	公益事業
YES BANK LTD	10,201	23,524	43,238	79,126	銀行

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
AMBUJA CEMENTS LTD	735	735	30,762	56,295	素材
BHARAT FORGE LTD	303	303	31,308	57,295	自動車・自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LTD	1,805	1,796	87,022	159,251	素材
ITC LTD	3,451	4,804	208,730	381,976	食品・飲料・タバコ
PIDILITE INDUSTRIES LTD	181	291	71,649	131,117	素材
UNITED PHOSPHORUS LTD	696	696	38,346	70,173	素材
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	122	122	25,024	45,794	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIEMENS INDIA LTD	110	110	37,413	68,467	資本財
INFO EDGE INDIA LTD	78	143	65,612	120,071	メディア・娯楽
CG POWER AND INDUSTRIAL SOLU	—	704	26,990	49,391	資本財
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	633	633	62,606	114,570	家庭用品・パーソナル用品
TECH MAHINDRA LTD	721	947	106,551	194,989	ソフトウェア・サービス
INDIAN HOTELS CO LIMITED	—	1,644	66,629	121,932	消費者サービス
MINDTREE LTD	62	—	—	—	ソフトウェア・サービス
MARICO LTD	817	817	42,526	77,823	食品・飲料・タバコ
POWER FINANCE CORPORATION	—	2,057	57,086	104,468	金融サービス
PAGE INDUSTRIES LTD	8	8	33,365	61,059	耐久消費財・アパレル
ABB LTD INDIA	—	52	22,650	41,450	資本財
DLF LTD	879	879	52,860	96,734	不動産管理・開発
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	3,803	8,009	168,205	307,816	公益事業
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	647	1,045	84,314	154,294	運輸
REC LTD	—	1,865	59,324	108,563	金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD	550	550	87,067	159,333	金融サービス
BAJAJ AUTO LTD	96	96	52,268	95,650	自動車・自動車部品
JUBILANT FOODWORKS LTD	439	439	22,217	40,658	消費者サービス
ADANI POWER LTD	856	856	34,343	62,848	公益事業
MUTHOOT FINANCE LTD	124	124	16,312	29,852	金融サービス
COAL INDIA LTD	1,803	2,954	95,587	174,925	エネルギー
HDFC BANK LTD	—	4,614	686,201	1,255,748	銀行
TATA MOTORS LTD	2,189	2,773	180,034	329,462	自動車・自動車部品
TATA POWER CO LTD	1,995	1,995	49,469	90,528	公益事業
INDUS TOWERS LTD	905	—	—	—	電気通信サービス
PI INDUSTRIES LTD	127	127	46,596	85,271	素材
VARUN BEVERAGES LTD	—	803	80,518	147,349	食品・飲料・タバコ
TUBE INVESTMENTS OF INDIA LT	—	211	66,641	121,953	自動車・自動車部品
LTIMINDTREE LTD	57	156	82,486	150,950	ソフトウェア・サービス
ADANI GREEN ENERGY LTD	425	425	39,923	73,059	公益事業
INDRAPRASTHA GAS LTD	267	267	10,554	19,314	公益事業
TRENT LTD	192	379	94,017	172,051	一般消費財・サービス流通・小売り
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	1,290	1,401	87,076	159,350	保険
BHARAT ELECTRONICS LTD	5,074	5,074	70,021	128,140	資本財
AU SMALL FINANCE BANK LTD	301	301	20,848	38,152	銀行
HINDUSTAN AERONAUTICS LTD	—	212	43,227	79,105	資本財
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	141	39,139	71,625	金融サービス
BANDHAN BANK LTD	748	748	16,248	29,735	銀行
ADANI TOTAL GAS LTD	330	—	—	—	公益事業

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
GODREJ PROPERTIES LTD	127	127	23,090	42,256	不動産管理・開発
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	548	548	63,165	115,592	金融サービス
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	310	606	45,521	83,303	金融サービス
INDIAN RAILWAY CATERING & TO	229	229	15,409	28,200	商業・専門サービス
ZOMATO LTD	4,278	8,422	102,627	187,807	消費者サービス
MAX HEALTHCARE INSTITUTE LTD	—	1,201	71,309	130,496	ヘルスケア機器・サービス
SONA BLW PRECISION FORGINGS	—	592	33,536	61,372	自動車・自動車部品
AXIS BANK LTD	2,880	3,597	367,710	672,910	銀行
HAVELLS INDIA LTD	356	356	44,725	81,847	資本財
JIO FINANCIAL SERVICES LTD	—	4,711	101,469	185,688	金融サービス
ASTRAL LTD	—	199	37,844	69,254	資本財
BERGER PAINTS INDIA LTD	294	353	20,434	37,394	素材
ADANI ENERGY SOLUTIONS LTD	328	—	—	—	公益事業
GRASIM INDUSTRIES LTD	315	468	90,688	165,959	素材
AVENUE SUPERMARTS LTD	212	285	107,078	195,953	生活必需品流通・小売り
IDFC FIRST BANK LTD	—	5,310	44,940	82,241	銀行
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	336	336	45,630	83,503	保険
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	317	453	23,926	43,786	保険
INTERGLOBE AVIATION LTD	148	264	68,324	125,033	運輸
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	537	727	98,219	179,740	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	125,461 108	199,813 122	13,382,571 —	24,490,105 <14.9%>
(カタル)			千カタルリアル		
QATAR NATIONAL BANK	5,900	7,413	11,771	489,592	銀行
COMMERCIAL BANK QSC	3,260	5,313	2,826	117,552	銀行
OOREDOO QSC	728	728	712	29,617	電気通信サービス
QATAR FUEL QSC	599	599	964	40,118	エネルギー
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	965	965	1,635	68,036	公益事業
QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	985	2,145	2,101	87,404	銀行
INDUSTRIES QATAR	1,967	2,829	3,643	151,553	資本財
QATAR ISLAMIC BANK	2,063	2,595	4,672	194,315	銀行
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	4,697	4,697	1,623	67,536	エネルギー
MASRAF AL RAYAN	7,323	11,431	2,661	110,676	銀行
BARWA REAL ESTATE CO	2,074	2,074	553	23,023	不動産管理・開発
MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	4,439	4,439	710	29,540	素材
DUKHAN BANK	—	3,197	1,221	50,800	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	35,004 12	48,429 13	35,099 —	1,459,767 <0.9%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	146	146	2,406	19,542	素材
BIDVEST GROUP LTD	277	503	13,493	109,569	資本財
CLICKS GROUP LTD	354	354	10,113	82,120	生活必需品流通・小売り
DISCOVERY LIMITED	595	987	12,919	104,904	保険
GOLD FIELDS LTD	1,200	1,442	35,506	288,311	素材
REMGRO LTD	746	746	10,450	84,858	金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LIMITED	375	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り

銘柄	当期首(前期末)		期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	563	998	8,726	70,862	素材
EXXARO RESOURCES LTD	342	342	6,487	52,678	エネルギー
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	113	146	27,608	224,181	銀行
MTN GROUP LTD	2,192	2,553	24,283	197,184	電気通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	513	—	—	—	素材
FIRSTSTRAND LTD	6,175	8,166	51,513	418,288	金融サービス
NASPERS LTD-N SHS	276	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
NEDBANK GROUP LTD	631	631	13,094	106,325	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LIMITED	59	99	6,635	53,876	素材
SASOL LTD	722	881	20,360	165,329	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	600	852	21,007	170,582	生活必需品流通・小売り
MR PRICE GROUP LTD	285	—	—	—	一般消費財・サービス流通・小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	1,737	2,036	39,009	316,755	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	232	—	—	—	生活必需品流通・小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	1,104	1,763	12,322	100,060	一般消費財・サービス流通・小売り
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	561	561	9,590	77,872	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABSA GROUP LTD	1,091	1,401	24,823	201,566	銀行
SANLAM LTD	2,140	3,074	21,207	172,205	保険
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	1,140	1,508	12,132	98,516	素材
KUMBA IRON ORE LTD	53	53	2,814	22,853	素材
VODACOM GROUP	844	793	8,677	70,461	電気通信サービス
NEPI ROCKCASTLE N.V.	605	673	7,002	56,863	不動産管理・開発
OLD MUTUAL LTD	4,896	9,746	11,734	95,287	保険
REINET INVESTMENTS SCA	171	171	7,083	57,520	金融サービス
PEPKOR HOLDINGS LTD	1,445	4,755	8,707	70,707	一般消費財・サービス流通・小売り
MULTICHOICE GROUP LTD	405	—	—	—	メディア・娯楽
SIBANYE STILLWATER LTD	3,949	3,949	9,174	74,493	素材
NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LT	480	480	5,586	45,363	素材
NASPERS LTD-N SHS	—	305	98,796	802,226	一般消費財・サービス流通・小売り
OUTSURANCE GROUP LTD	—	721	2,979	24,190	保険
ANGLOGOLD ASHANTI PLC	—	674	21,537	174,887	素材
BID CORP LTD	439	580	24,660	200,239	生活必需品流通・小売り
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数 銘 柄 数	金 額 <比 率>	金 額 <比 率>	
	37,474 36	52,104 33	592,449 —	4,810,691 <2.9%>	
(アラブ首長国連邦)			千アラブ首長国 連邦ディルハム		
ABU DHABI ISLAMIC BANK	1,857	1,857	1,969	81,331	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK	3,354	5,251	2,904	119,937	銀行
EMIRATES TELECOM GROUP CO	4,357	5,585	10,891	449,816	電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	3,270	4,714	3,922	161,990	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC	5,293	7,240	9,701	400,686	銀行
EMAAAR PROPERTIES PJSC	5,768	11,086	7,538	311,358	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC	4,870	7,258	4,093	169,069	不動産管理・開発
EMIRATES NBD PJSC	2,702	2,702	4,810	198,678	銀行
MULTIPLY GROUP	—	5,196	1,917	79,192	資本財
AMERICANA RESTAURANTS INTERN	—	4,314	1,453	60,049	消費者サービス

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		業 種
	株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	4,440	4,440	1,536	63,449	一般消費財・サービス流通・小売り
小 計	35,915	59,647	50,739	2,095,560	
	株 数 銘柄数 <比率>	9	11	—	<1.3%>
(サウジアラビア)			千サウジアラビアリアル		
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	265	510	1,925	77,874	素材
JARIR MARKETING CO	125	1,250	1,792	72,488	一般消費財・サービス流通・小売り
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	—	62	739	29,922	保険
ETIHAD ETISALAT CO	488	488	2,315	93,626	電気通信サービス
SAUDI AWWAL BANK	1,167	1,478	5,131	207,536	銀行
AL RAJHI BANK	2,485	3,075	21,773	880,510	銀行
ARAB NATIONAL BANK	860	860	2,083	84,263	銀行
BANK ALBILAD	611	897	3,296	133,312	銀行
BANK AL-JAZIRA	358	978	1,668	67,458	銀行
BANQUE SAUDI FRANSI	675	948	3,527	142,666	銀行
RIYAD BANK	1,660	2,344	6,436	260,289	銀行
SAUDI INVESTMENT BANK/THE	706	706	1,045	42,278	銀行
SAUDI TELECOM CO	1,835	3,013	11,510	465,480	電気通信サービス
SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	282	374	4,923	199,108	素材
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	1,191	1,439	11,198	452,849	素材
SAUDI ELECTRICITY CO	1,119	1,621	2,804	113,413	公益事業
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	384	853	1,940	78,463	素材
SAVOLA	253	362	1,348	54,518	食品・飲料・タバコ
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	319	319	379	15,364	素材
ALMARAI CO	301	301	1,624	65,674	食品・飲料・タバコ
SAUDI RESEARCH & MEDIA GROUP	42	42	622	25,179	メディア・娯楽
EMAA ECONOMIC CITY	461	—	—	—	不動産管理・開発
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	472	472	1,516	61,324	素材
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	117	117	442	17,880	素材
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	1,034	1,034	1,108	44,839	素材
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	1,009	1,009	1,486	60,117	不動産管理・開発
RABIGH REFINING AND PETROCHE	449	449	438	17,718	エネルギー
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	905	905	1,312	53,072	電気通信サービス
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	60	142	2,915	117,911	保険
ALINMA BANK	1,242	1,613	5,622	227,356	銀行
SAUDI ARABIAN MINING CO	1,065	2,108	7,864	318,039	素材
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	79	159	1,716	69,419	ヘルスケア機器・サービス
DALLAH HEALTHCARE CO	—	68	1,067	43,162	ヘルスケア機器・サービス
SAUDI ARABIAN OIL CO	3,066	4,162	13,945	563,943	エネルギー
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	117	117	2,990	120,922	ヘルスケア機器・サービス
ACWA POWER CO	91	169	3,584	144,940	公益事業
SAUDI ARAMCO BASE OIL CO	—	93	1,265	51,191	素材
ARABIAN INTERNET & COMMUNICA	—	44	1,373	55,551	ソフトウェア・サービス
NAHDI MEDICAL CO	—	64	845	34,173	生活必需品流通・小売り
SAUDI TADAWUL GROUP HOLDING	39	109	1,873	75,770	金融サービス
ELM CO	24	40	2,903	117,416	ソフトウェア・サービス
POWER & WATER UTILITY CO FOR	—	160	876	35,442	公益事業

銘柄	銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		業 種	
		株 数 (百株)	株 数 (百株)	評 価 額		
				外 貨 建 金 額		邦 貨 換 算 金 額 (千円)
	THE SAUDI NATIONAL BANK	2,762	4,370	15,317	619,426	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	28,132 37	39,341 42	158,553 —	6,411,902 <3.9%>	
	(クウェート)			千クウェート・ディナール		
	KUWAIT FINANCE HOUSE	9,321	12,929	897	440,606	銀行
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	2,968	2,968	142	70,105	電気通信サービス
	GULF BANK	1,371	1,551	37	18,439	銀行
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	8,931	12,049	1,072	526,591	銀行
	AGILITY	1,576	3,233	169	83,046	運輸
	MABANEE CO KPSC	1,337	1,418	118	58,078	不動産管理・開発
	BOUBYAN BANK K. S. C	1,528	1,620	97	47,661	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	27,036 7	35,772 7	2,534 —	1,244,529 <0.8%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 <比 率>	10,913,312 1,244	13,078,694 1,240	— —	155,297,427 <94.4%>	

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(メキシコ)			千メキシコペソ	
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	391,700	391,700	11,241	95,785
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	58,400	97,360	14,324	122,052
小 計	口 数 ・ 金 額	450,100	489,060	25,566
	銘 柄 数 <比 率>	2	2	—
(ブラジル)			千ブラジルレアル	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	45,900	45,900	1,353	41,467
ENERGISA SA-UNITS	37,400	37,400	1,792	54,904
KLABIN SA-UNIT	100,000	100,000	2,261	69,266
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	131,500	200,300	6,519	199,734
小 計	口 数 ・ 金 額	314,800	383,600	11,926
	銘 柄 数 <比 率>	4	4	—
(南アフリカ)			千南アフリカランド	
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	478,733	478,733	4,950	40,194
小 計	口 数 ・ 金 額	478,733	478,733	4,950
	銘 柄 数 <比 率>	1	1	—
合 計	口 数 ・ 金 額	1,243,633	1,351,393	—
	銘 柄 数 <比 率>	7	7	—

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

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外国	MSCI EMERG M	8,526	—

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	
株 式	155,297,427	94.2%
投 資 信 託 受 益 証 券	487,426	0.3
投 資 証 券	135,980	0.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	8,931,784	5.4
投 資 信 託 財 産 総 額	164,852,617	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(164,567,837千円)の投資信託財産総額(164,852,617千円)に対する比率は99.8%です。

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

1米ドル=151.43円	1メキシコペソ=8.5205円	1ブラジルリアル=30.6353円
1チリペソ=0.165877円	1コロンビアペソ=0.03766円	1ユーロ=161.56円
1イギリスポンド=185.08円	1トルコリラ=5.2987円	1チェココロナ=6.5802円
1ハンガリーフォリント=0.426067円	1ポーランドズロチ=36.3973円	1ロシアルーブル=1.65円
1香港ドル=19.39円	1マレーシアリンギット=32.0325円	1タイバーツ=4.23円
1フィリピンペソ=2.7103円	1インドネシアルピア=0.0097円	1韓国ウォン=0.1151円
1新台湾ドル=4.6891円	1オフショア人民元=20.7438円	1インドルピー=1.83円
1カタールリアル=41.59円	1南アフリカランド=8.12円	1アラブ首長国連邦ディルハム=41.30円
1サウジアラビアリアル=40.44円	1クウェート・ディナール=491.02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 2023年11月10日現在
(A) 資 産	164,920,447,425円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,503,319,583
株 式(評価額)	155,297,427,328
投資信託受益証券(評価額)	487,426,422
投資証券(評価額)	135,980,476
未 収 入 金	123,926,100
未 収 配 当 金	203,368,549
差 入 委 託 証 拠 金	1,168,998,967
(B) 負 債	415,987,498
未 払 金	259,644,459
未 払 解 約 金	156,342,980
未 払 利 息	57
そ の 他 未 払 費 用	2
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	164,504,459,927
元 本	41,935,603,524
次 期 繰 越 損 益 金	122,568,856,403
(D) 受 益 権 総 口 数	41,935,603,524口
1万口当たり基準価額(C/D)	39,228円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A) 配 当 等 収 益	4,188,069,288円
受 取 配 当 金	4,034,836,619
受 取 利 息	106,982,057
そ の 他 収 益 金	46,735,760
支 払 利 息	△485,148
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	13,100,953,465
売 買 益	26,493,493,644
売 買 損	△13,392,540,179
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	242,805,788
取 引 益	1,135,442,921
取 引 損	△892,637,133
(D) そ の 他 費 用	△272,108,055
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	17,259,720,486
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	81,529,469,186
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	34,497,961,479
(H) 解 約 差 損 益 金	△10,718,294,748
(I) 計 (E+F+G+H)	122,568,856,403
次 期 繰 越 損 益 金(I)	122,568,856,403

(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32,714,193,593円、期中追加設定元本額は13,135,238,010円、期中一部解約元本額は3,913,828,079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。

世界経済インデックスファンド	9,998,563,511円
SMT 新興国株式インデックス・オープン	7,681,173,036円
DC世界経済インデックスファンド	7,264,996,363円
DC新興国株式インデックス・オープン	6,043,436,095円
外国株式SMTBセレクション(SMA専用)	2,272,805,509円
世界株式ファンド(適格機関投資家専用)	1,452,511,178円
分散投資コア戦略ファンドS	1,419,462,050円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	1,149,700,192円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	1,015,754,264円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	782,747,081円
グローバル経済コア	417,761,723円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	385,409,398円
分散投資コア戦略ファンドA	310,316,270円
SMT 世界経済インデックス・オープン	242,050,933円
My SMT 新興国株式インデックス(ノーロード)	233,992,225円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	172,756,262円
コア投資戦略ファンド(成長型)	142,991,154円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	98,760,072円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030	95,525,041円
SMT インデックスバランス・オープン	95,202,337円
新興国株式インデックス・オープン(SMA専用)	93,733,030円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040	90,532,563円
私募世界経済バシブファンド(適格機関投資家専用)	83,089,105円
コア投資戦略ファンド(切替型)	62,028,588円
コア投資戦略ファンド(安定型)	60,817,634円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	57,500,179円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060	43,789,988円
DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050	39,223,600円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	35,711,445円
FOFs用 新興国株式インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	26,821,331円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	18,687,015円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	14,175,859円
10資産分散投資ファンド	13,147,546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)	12,259,652円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	6,679,596円
グローバル10資産バランスファンド	1,491,699円

お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)

J-REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		REIT 先比	投信証 託証入 組入比	資 券 率	純 資 産 額
	円 騰 落	% 中 率	円 騰 落	% 中 率				
第12期(2019年11月11日)	21,338	26.3	21,125	26.2	2.6	97.4	123,441	
第13期(2020年11月10日)	17,549	△17.8	17,391	△17.7	3.4	96.6	97,598	
第14期(2021年11月10日)	21,895	24.8	21,683	24.7	3.8	96.1	111,120	
第15期(2022年11月10日)	21,469	△1.9	21,266	△1.9	3.1	96.9	131,445	
第16期(2023年11月10日)	20,865	△2.8	20,641	△2.9	2.9	97.1	114,790	

(注)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基準価額		ベンチマーク		REIT 先比	投信証 託証入 組入比	資 券 率
	円 騰 落	% 騰 落 率	円 騰 落	% 騰 落 率			
(当期首) 2022年11月10日	21,469	—	21,266	—	3.1	96.9	%
11月末	21,792	1.5	21,586	1.5	3.1	96.9	%
12月末	21,020	△2.1	20,822	△2.1	3.0	97.0	%
2023年 1月末	20,352	△5.2	20,157	△5.2	3.0	97.0	%
2月末	20,671	△3.7	20,480	△3.7	3.0	97.0	%
3月末	20,069	△6.5	19,881	△6.5	2.9	97.1	%
4月末	21,098	△1.7	20,901	△1.7	2.9	97.1	%
5月末	21,235	△1.1	21,036	△1.1	2.9	97.1	%
6月末	21,103	△1.7	20,905	△1.7	2.8	97.1	%
7月末	21,352	△0.5	21,149	△0.5	2.8	97.2	%
8月末	21,668	0.9	21,463	0.9	3.4	96.6	%
9月末	21,330	△0.6	21,127	△0.7	3.2	96.8	%
10月末	20,890	△2.7	20,673	△2.8	3.3	96.6	%
(当期末) 2023年11月10日	20,865	△2.8	20,641	△2.9	2.9	97.1	%

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)REIT先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

【「東証REIT指数」】とは、株式会社J P X総研が算出、公表する指数で、東京証券取引所に上場しているREIT（不動産投資信託証券）全銘柄を対象とした時価総額加重型の指数です。

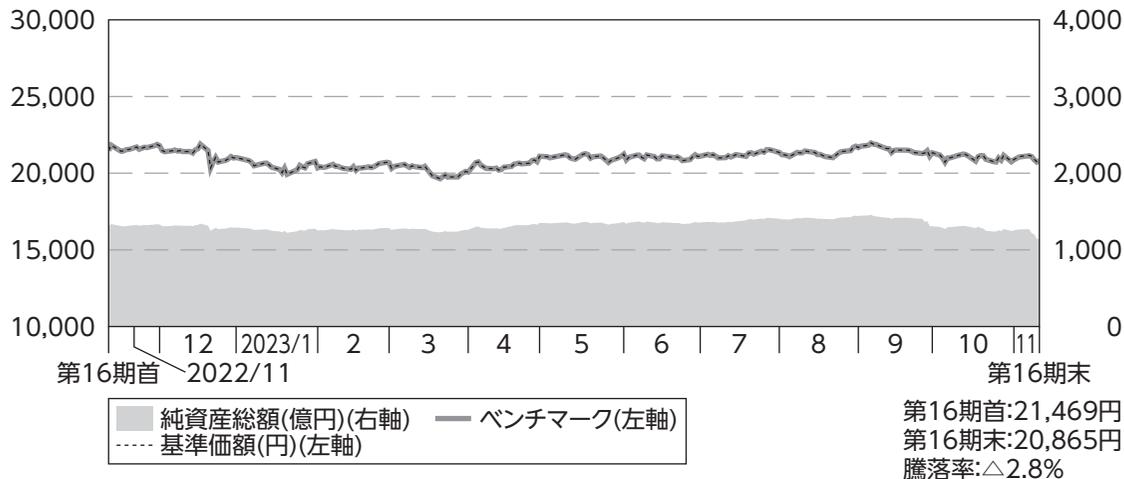
「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

【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

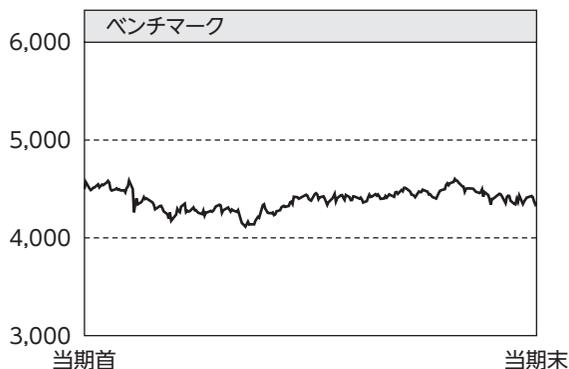


(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークである東証REIT指数(配当込み)の動きを反映して基準価額は変動し、期末は期首比で下落しました。

投資環境



当期のJ-REIT市場は下落しました。

日銀により長期金利の変動許容幅が拡大されたことが事実上の利上げと受け止められたことや、公募増資の発表が相次ぎ短期的な需給への影響が意識されたことなどから2023年1月にかけて下落しました。2023年3月中旬にかけては米銀行の経営破綻や欧州金融機関の信用不安が報じられ、世界的なリスクオフの流れがJ-REIT市場にも波及したことで一時的に下落する局面もありましたが、その後は各国当局の迅速な対応を受けて欧米の金融システム不安に対しての過度な懸念が後退したことなどから上昇しました。2023年4月以降は米雇用統計の発表などを受け景気の減速懸念が後退したことや、日銀金融政策決定会合での金融政策の現状維持の決定が好感されたことも追い風となり上昇しましたが、高値警戒感が強まる中、米金融引き締め長期化の観測に加えて米暫定予算の成立が危ぶまれたことから米政府機関閉鎖の可能性が懸念され、下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

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

当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	日本ビルファンド投資法人	日本	6.7%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	5.4%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	5.1%
4	日本プロジスリート投資法人	日本	4.5%
5	日本都市ファンド投資法人	日本	4.4%
6	KDX不動産投資法人	日本	4.4%

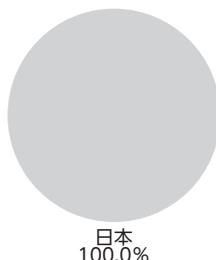
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	GLP投資法人	日本	4.3%
8	大和ハウスリート投資法人	日本	3.9%
9	オリックス不動産投資法人	日本	3.2%
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	3.1%
組入銘柄数			59

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

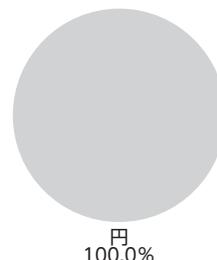
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

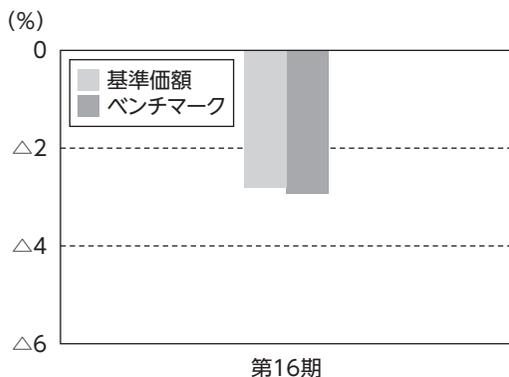


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスでJ-REIT先物を想定元本ベースで純資産総額に対して2.9%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2023年10月の指数構成銘柄の吸収合併により生じた価格差によるものです。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月11日~2023年11月10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)	(0)	(0.000)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	0	0.001	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(21,048円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜投資信託受益証券、投資証券＞

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国	エスコンジャパンリート投資法人	476	54,972	666	78,398
	サンケイリアルエステート投資法人	748	66,316	1,045	95,430
	SOS i LA物流リート投資法人	1,473 (70)	194,566 (9,401)	1,637	205,567
	SOS i LA物流リート投資法人	70 (△70)	9,401 (△9,401)	—	—
	東海道リート投資法人	606 (286)	73,293 (32,569)	708	87,182
	東海道リート投資法人	286 (△286)	32,569 (△32,569)	—	—
	日本アコモデーションファンド投資法人	819	512,713	1,139	713,076
	森ヒルズリート投資法人	2,807	419,249	3,897	564,315
	産業ファンド投資法人	3,982	587,960	5,029	712,956
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,647	887,250	3,776	1,276,233
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,911 (△8,607)	405,775 (△1,812,442)	1,708	376,581
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,236	495,975	1,761	719,406
	GLP投資法人	9,668	1,397,160	11,040	1,535,718
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,426 (34)	457,724 (9,504)	1,605	521,233
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	34 (△34)	9,504 (△9,504)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	5,083 (223)	1,522,649 (64,703)	5,710	1,615,229
	日本プロロジスリート投資法人	223 (△223)	64,703 (△64,703)	—	—
	星野リゾート・リート投資法人	543	360,943	601	383,036
	One リート投資法人	406	99,653	568	145,624
	イオンリート投資法人	4,115 (124)	616,312 (16,796)	3,974	584,868
イオンリート投資法人	124 (△124)	16,796 (△16,796)	—	—	
ヒューリックリート投資法人	2,227	353,675	3,094	489,845	
日本リート投資法人	770	259,443	1,071	374,281	
積水ハウス・リート投資法人	7,147	560,637	10,332	834,983	
トーセイ・リート投資法人	511	68,134	838	115,129	
内	ケネディクス商業リート投資法人	1,024 (△5,097)	267,361 (△1,359,835)	1,021	283,273
	ヘルスケア&メディカル投資法人	579	94,200	808	122,300

		当期			
		買付		売却	
		口数	金額	口数	金額
国		口	千円	口	千円
		サムティ・レジデンシャル投資法人	775	89,300	881
	野村不動産マスターファンド投資法人	7,683	1,234,188	10,681	1,779,703
	いちごホテルリート投資法人	391	41,898	544	59,254
	ラサールロジポート投資法人	3,631	560,957	4,183	628,136
	スターアジア不動産投資法人	6,842	375,445	4,842	279,664
	マリモ地方創生リート投資法人	695	90,143	495	62,992
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,213	585,572	1,354	646,823
	大江戸温泉リート投資法人	373	23,830	615	39,865
	投資法人みらい	3,715	170,298	4,152	192,931
	森トラスト・ホテルリート投資法人	138 (△2,807)	18,563 (△394,098)	80	10,763
	三菱地所物流リート投資法人	830	337,189	1,130	439,728
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,504	265,565	1,397	235,855
	ザイマックス・リート投資法人	380	43,427	532	61,717
	タカラレーベン不動産投資法人	1,365 (172)	128,592 (15,208)	1,553	151,814
	タカラレーベン不動産投資法人	172 (△172)	15,208 (△15,208)	—	—
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,061	143,207	1,441	186,362
	日本ビルファンド投資法人	2,770	1,618,190	3,852	2,318,356
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,739	1,530,949	3,373	1,944,490
	日本都市ファンド投資法人	11,732	1,157,846	19,133	1,873,428
	オリックス不動産投資法人	4,743	843,456	6,590	1,169,835
	日本プライムリアルティ投資法人	1,590	567,262	2,225	798,859
	NTT都市開発リート投資法人	2,571 (306)	344,037 (37,427)	3,202	432,308
	NTT都市開発リート投資法人	306 (△306)	37,427 (△37,427)	—	—
	東急リアル・エステート投資法人	1,600	303,532	2,221	411,334
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,371	259,799	2,431	277,499
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,260	783,705	7,502	1,148,122
	森トラストリート投資法人	4,605 (13,715)	362,016 (394,098)	5,896	450,398
	インヴィンシブル投資法人	16,297	907,604	15,627	903,664
	フロンティア不動産投資法人	879	424,809	1,223	571,797
	平和不動産リート投資法人	2,378 (92)	354,818 (13,637)	2,416	353,635
	平和不動産リート投資法人	92 (△92)	13,637 (△13,637)	—	—
内	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,572	479,111	2,561	758,751
	福岡リート投資法人	1,215	199,930	1,694	275,311

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
国 内	KDX不動産投資法人	1,435 (26,917)	453,325 (3,172,277)	4,118	906,714
	いちごオフィスリート投資法人	1,946	173,841	2,705	235,301
	大和証券オフィス投資法人	489	306,021	703	459,984
	阪急阪神リート投資法人	1,397	201,183	1,545	221,317
	スターツプロシード投資法人	405	91,583	566	123,360
	大和ハウスリート投資法人	3,582	1,006,532	4,980	1,358,545
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	9,253	693,295	10,919	800,714
	大和証券リビング投資法人	4,333	482,746	4,679	526,332
	ジャパンエクセレント投資法人	2,142	270,545	3,513	463,547

(注1)金額は受渡代金です。

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

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

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	R E I T 先 物 取 引	百万円 25,632	百万円 26,144	百万円 —	百万円 —

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
金 銭 信 託	百万円 27	百万円 27	% 100.0	百万円 27	百万円 27	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	748,719	71,510	9.6	744,223	71,859	9.7

(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

＜国内投資信託受益証券、投資証券＞

銘柄	当期首(前期末)		当 期		末	
	口	数 (口)	口	数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)
エスコンジャパンリート投資法人		2,382		2,192	259,094	0.2
サンケイリアルエステート投資法人		3,754		3,457	312,512	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人		5,478		5,384	643,388	0.6
東海道リート投資法人		1,421		1,605	200,625	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人		4,046		3,726	2,265,408	2.0
森ヒルズリート投資法人		13,779		12,689	1,763,771	1.5
産業ファンド投資法人		17,511		16,464	2,242,396	2.0
アドバンス・レジデンス投資法人		11,716		10,587	3,440,775	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人		8,404		—	—	—
アクティブピア・プロパティーズ投資法人		6,186		5,661	2,264,400	2.0
GLP投資法人		37,821		36,449	4,978,933	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		5,451		5,306	1,687,308	1.5
日本プロロジスリート投資法人		19,201		18,797	5,174,814	4.5
星野リゾート・リート投資法人		2,049		1,991	1,184,645	1.0
Oneリート投資法人		2,044		1,882	484,615	0.4
イオンリート投資法人		12,971		13,236	1,891,424	1.6
ヒューリックリート投資法人		10,963		10,096	1,523,486	1.3
日本リート投資法人		3,806		3,505	1,200,462	1.0
積水ハウス・リート投資法人		35,609		32,424	2,535,556	2.2
トーセイ・リート投資法人		2,599		2,272	308,764	0.3
ケネディクス商業リート投資法人		5,094		—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人		2,889		2,660	383,572	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人		3,046		2,940	318,990	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人		37,892		34,894	5,820,319	5.1
いちごホテルリート投資法人		1,941		1,788	183,091	0.2
ラサールロジポート投資法人		14,345		13,793	2,068,950	1.8
スターアジア不動産投資法人		14,630		16,630	949,573	0.8
マリモ地方創生リート投資法人		1,463		1,663	211,034	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人		4,629		4,488	2,098,140	1.8
大江戸温泉リート投資法人		1,891		1,649	108,009	0.1
投資法人みらい		14,236		13,799	623,024	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人		2,749		—	—	—
三菱地所物流リート投資法人		4,026		3,726	1,406,565	1.2
CREロジスティクスファンド投資法人		4,538		4,645	745,987	0.6
ザイマックス・リート投資法人		1,901		1,749	204,982	0.2
タカラレーベン不動産投資法人		5,132		5,116	498,810	0.4

銘 柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額 (千円)	比 率 (%)
アドバンス・ロジスティクス投資法人	5,108	4,728		589,581	0.5
日本ビルファンド投資法人	13,670	12,588		7,653,504	6.7
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,718	11,084		6,240,292	5.4
日本都市ファンド投資法人	59,122	51,721		5,068,658	4.4
オリックス不動産投資法人	23,347	21,500		3,674,350	3.2
日本プライムリアルティ投資法人	8,014	7,379		2,564,202	2.2
N T T都市開発リート投資法人	11,264	10,939		1,401,285	1.2
東急リアル・エステート投資法人	7,856	7,235		1,292,171	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	8,028	7,968		895,603	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	26,379	24,137		3,615,722	3.1
森トラストリート投資法人	8,375	20,799		1,522,486	1.3
インヴィンシブル投資法人	51,574	52,244		2,972,683	2.6
フロンティア不動産投資法人	4,348	4,004		1,811,810	1.6
平和不動産リート投資法人	8,008	8,062		1,139,966	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人	7,901	6,912		1,968,537	1.7
福岡リート投資法人	6,060	5,581		904,680	0.8
KDX不動産投資法人	6,818	31,052		5,008,687	4.4
いちごオフィスリート投資法人	9,601	8,842		743,612	0.6
大和証券オフィス投資法人	2,449	2,235		1,457,220	1.3
阪急阪神リート投資法人	5,293	5,145		727,503	0.6
スターツプロシード投資法人	2,031	1,870		381,480	0.3
大和ハウスリート投資法人	17,663	16,265		4,422,453	3.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人	37,787	36,121		2,405,658	2.1
大和証券リビング投資法人	16,237	15,891		1,733,708	1.5
ジャパンエクセレント投資法人	10,749	9,378		1,236,958	1.1
合 計	口 数 ・ 金 額	696,993	680,943	111,416,247	
	銘 柄 数 <比 率>	61	58	<97.1%>	

(注1) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

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

①資産運用会社

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

②一般事務受託会社

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

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

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘	柄	別	期			末	
			買	建	額	売	建
			(百万円)			(百万円)	
国内	東	証	R E I T 指 数			3,355	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	千円 111,416,247	% 92.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,055,244	7.5
投 資 信 託 財 産 総 額	120,471,491	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 2023年11月10日現在
(A)資 産	120,471,491,820円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,232,349,014
投 資 証 券(評価額)	111,416,247,550
未 収 入 金	122,018,001
未 収 配 当 金	1,432,956,164
差 入 委 託 証 拠 金	267,921,091
(B)負 債	5,681,027,880
未 払 金	211,410,108
未 払 解 約 金	5,469,613,245
未 払 利 息	4,444
そ の 他 未 払 費 用	83
(C)純 資 産 総 額(A-B)	114,790,463,940
元 本	55,015,213,467
次 期 繰 越 損 益 金	59,775,250,473
(D)受 益 権 総 口 数	55,015,213,467口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,865円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配 当 等 収 益	5,319,385,391円
受 取 配 当 金	5,320,964,111
受 取 利 息	12,383
そ の 他 収 益 金	61,938
支 払 利 息	△1,653,041
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△8,360,807,690
売 買 益	944,750,922
売 買 損	△9,305,558,612
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△144,825,090
取 引 益	376,947,140
取 引 損	△521,772,230
(D)そ の 他 費 用	△83
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△3,186,247,472
(F)前 期 繰 越 損 益 金	70,219,792,611
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	12,054,054,754
(H)解 約 差 損 益 金	△19,312,349,420
(I)計 (E+F+G+H)	59,775,250,473
次 期 繰 越 損 益 金(I)	59,775,250,473

(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61,225,723,115円、期中追加設定元本額は11,096,208,886円、期中一部解約元本額は17,306,718,534円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

Jリートインデックス・オープン(SMA専用)	26,696,166,094円
SMT J-REITインデックス・オープン	16,705,566,878円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,926,122,015円
分散投資コア戦略ファンドS	1,830,619,539円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,637,547,155円
分散投資コア戦略ファンドA	1,017,119,866円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,011,513,433円
コア投資戦略ファンド(切替型)	750,196,687円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	526,962,705円
My SMT J-REITインデックス(ノーロード)	524,199,116円
J-REIT バッジ・ファンド2018-05(適格機関投資家専用)	508,830,600円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	420,963,439円
FOFs用 J-REITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	350,225,825円
J-REIT バッジ・ファンド2019-03(適格機関投資家専用)	280,493,401円
グローバル経済コア	280,077,565円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	256,354,957円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	129,646,228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)	70,179,766円
SMT インデックスバランス・オープン	23,921,569円
10資産分散投資ファンド	23,142,611円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	15,349,392円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	11,440,387円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	8,937,152円
SBI資産設計オープン(分配型)	6,941,545円
グローバル10資産バランスファンド	2,695,542円

お知らせ

該当事項はありません。

グローバルREITインデックス マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2023年11月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率		ベンチマーク		投資信託証券組入比率	純資産総額
		円	%	騰落率	%		
第12期(2019年11月11日)	19,790		9.2	21,166	9.9	99.4	88,663
第13期(2020年11月10日)	16,838		△14.9	18,082	△14.6	99.6	80,213
第14期(2021年11月10日)	24,699		46.7	26,632	47.3	99.5	102,118
第15期(2022年11月10日)	24,409		△1.2	26,413	△0.8	99.5	84,560
第16期(2023年11月10日)	24,877		1.9	27,027	2.3	99.7	105,580

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額	騰落率		ベンチマーク		投資信託証券組入比率
		円	%	騰落率	%	
(当期首) 2022年11月10日	24,409		—	26,413	—	99.5
11月末	24,538		0.5	26,563	0.6	99.6
12月末	23,010		△5.7	24,929	△5.6	99.3
2023年1月末	24,559		0.6	26,625	0.8	99.5
2月末	24,824		1.7	26,920	1.9	99.6
3月末	23,125		△5.3	25,064	△5.1	99.1
4月末	23,661		△3.1	25,657	△2.9	99.4
5月末	24,019		△1.6	26,050	△1.4	99.5
6月末	25,766		5.6	27,974	5.9	99.1
7月末	25,906		6.1	28,139	6.5	99.6
8月末	26,306		7.8	28,577	8.2	99.3
9月末	24,838		1.8	26,979	2.1	99.2
10月末	23,407		△4.1	25,419	△3.8	99.6
(当期末) 2023年11月10日	24,877		1.9	27,027	2.3	99.7

(注)騰落率は期首比です。

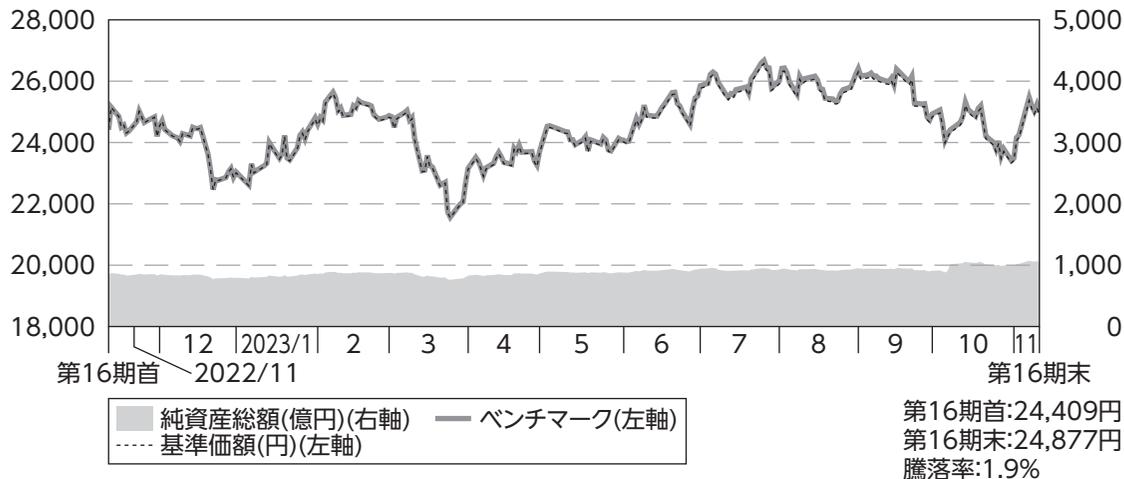
ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ベース）です。

S&P先進国REIT指数とは、S&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJ」）が公表する指数で、世界主要国に上場するREIT（不動産投資信託証券）及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出されます。「配当込み」指数は、配当収益を考慮して算出した指数です。

S&P先進国REIT指数（以下「当インデックス」）は、S&P Globalの一部門であるS&P Dow Jones Indices LLC（以下「SPDJ」）の商品であり、これを利用するライセンスが当社に付与されています。Standard & Poor's®及びS&P®は、S&P Globalの一部門であるStandard & Poor's Financial Services LLC（以下「S&P」）の登録商標で、Dow Jones®はDow Jones Trademark Holdings LLC（以下「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが当社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&P又はそれぞれの関連会社によって支援、保証、販売、又は販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、当インデックスの誤り、欠落、又は中断に対して一切の責任も負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2022年11月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

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

投資環境



海外REIT市場は、米国でCPI(消費者物価指数)の伸びが鈍化し利上げ幅の縮小や先行きの利上げ停止への期待が高まったことなどから2023年2月上旬にかけて上昇しました。その後は一時下落に転じる場面もありましたが、予想を上回る経済指標を受けた米国景気の軟着陸期待の高まりなどから7月にかけて堅調に推移しました。しかし8月以降は、米国で大手自動車メーカーのストライキなど新たなインフレ要因への警戒から長期金利が大きく上昇したことが嫌気されたほか、各国中央銀行が政策金利を長期間高水準に維持するとの見方が強まったことなどから下落しました。外国為替市場では、日本と米欧との金融政策姿勢の違いが意識され、主要通貨に対して円安が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

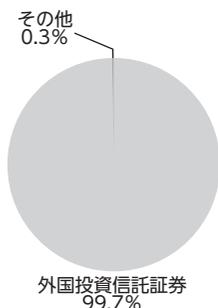
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	PROLOGIS INC	アメリカ	8.2%
2	EQUINIX INC	アメリカ	6.1%
3	WELLTOWER INC	アメリカ	4.0%
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	3.3%
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.3%
6	SIMON PROPERTY GROUP	アメリカ	3.2%

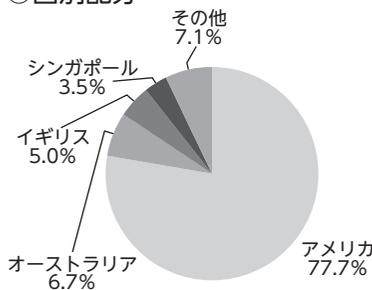
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	REALTY INCOME CORP	アメリカ	3.0%
8	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	2.4%
9	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	2.1%
10	GOODMAN GROUP	オーストラリア	2.1%
組入銘柄数		308	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

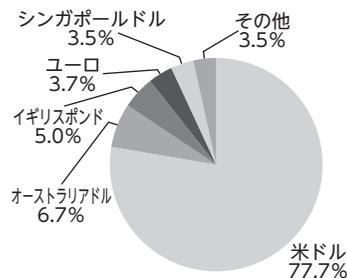
○資産別配分



○国別配分



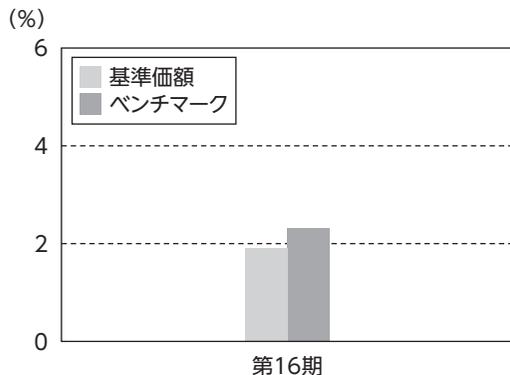
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



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

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

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年11月11日~2023年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	1円	0.006%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(1)	(0.006)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(-)	(-)	
(b) 有価証券取引税	3	0.011	(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)	(3)	(0.011)	
(c) その他費用	9	0.037	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
(保管費用)	(9)	(0.037)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	13	0.054	

(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(24,496円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国				
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,934	3,168	4,938	588
ALEXANDER'S INC	450	77	304	72
BOSTON PROPERTIES	24,272	1,415	5,579	347
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,581	1,245	4,180	129
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,550	179	12,620	110
AGREE REALTY CORP	20,291	1,260	—	—
SL GREEN REALTY CORP	11,270	352	3,635	96
EPR PROPERTIES	8,886	361	—	—
PROLOGIS INC	139,764	15,888	28,523	3,423
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,621	3,510	2,940	524
LXP INDUSTRIAL TRUST	40,300	363	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,552	1,759	4,289	481
VERIS RESIDENTIAL INC	11,160	179	—	—
NNN REIT INC	29,244	1,141	3,720	161
COUSINS PROPERTIES INC	22,590	484	4,760	111
URSTADT BIDDLE - CL A	— (△15,050)	— (△273)	—	—
SITE CENTERS CORP	26,800	333	8,467	113
SAFEHOLD INC	9,190 (△33,950)	197 (—)	—	—
ESSEX PROPERTY TRUST	9,578	2,071	2,337	532
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	54,542	3,253	9,526	614
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,637	989	1,220	118
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,159	811	—	—
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	85,695	1,688	14,661	333
EQUITY COMMONWEALTH	12,310	238	—	—
HIGHWOODS PROPERTIES INC	12,767	276	—	—
SERVICE PROPERTIES TRUST	22,510	192	—	—
WELLTOWER INC	117,844	9,452	9,276	714
EASTGROUP PROPERTIES, INC	7,141	1,182	630	111

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
KIMCO REALTY CORP	91,383	1,665	15,899	322
KILROY REALTY CORPORATION	13,040	418	—	—
LTC PROPERTIES INC	5,950	196	—	—
BRANDYWINE REALTY TRUST	23,290	91	—	—
IRON MOUNTAIN INC	43,014	2,436	6,883	389
MACERICH CO/THE	25,590	256	—	—
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,626	2,128	4,868	324
ACADIA REALTY TRUST	13,670	195	4,773	72
HOST HOTELS AND RESORTS INC	110,956	1,822	26,803	457
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,682	2,450	2,407	369
HERSHA HOSPITALITY TRUST	8,044	70	7,383	72
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,530	231	—	—
CENTERSPACE	1,650	95	—	—
GETTY REALTY CORP	6,730	201	—	—
RPT REALTY	20,120	190	15,897	169
REALTY INCOME CORP	143,367	7,968	14,630	909
REGENCY CENTERS CORP	23,982 (5,222)	1,431 (273)	4,073	255
UDR INC	50,084	1,892	14,611	597
COPT DEFENSE PROPERTIES	15,717	376	2,500	57
SAUL CENTERS INC	1,740	70	1,694	72
SIMON PROPERTY GROUP	49,338	5,389	10,149	1,183
LIFE STORAGE INC	4,747 (Δ 42,213)	563 (Δ 4,365)	2,480	309
PUBLIC STORAGE	23,721	6,443	4,570	1,323
SUN COMMUNITIES INC	18,460	2,323	3,023	405
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,050	375	4,289	92
UMH PROPERTIES INC	7,880	116	—	—
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,792	81	—	—
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	3,018	132	—	—
VENTAS INC	61,420	2,649	11,091	519
VORNADO REALTY TRUST	18,020	385	—	—
ELME COMMUNITIES	20,990	330	6,957	109
KITE REALTY GROUP TRUST	33,956	721	4,640	105
EXTRA SPACE STORAGE INC	27,458 (37,780)	3,501 (4,365)	3,440	525

	当期			
	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	34,040	319	10,190	105
CUBESMART	33,973	1,342	5,922	257
DIGITAL REALTY TRUST INC	49,638	5,681	6,150	687
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	24,640	198	—	—
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	81,310	535	12,030	114
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	25,390	302	9,850	129
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	16,000	194	—	—
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	16,880	88	—	—
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	14,580	88	—	—
TERRENO REALTY CORP	17,850	1,068	—	—
AMERICAN ASSETS TRUST INC	10,950	191	8,049	185
RLJ LODGING TRUST	27,190	275	10,590	111
AMERICOLD REALTY TRUST	39,962	1,195	15,190	498
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,950	205	6,538	86
CHATHAM LODGING TRUST	5,760	70	5,558	71
SABRA HEALTH CARE REIT INC	26,933	355	—	—
WHITESTONE REIT	8,880	83	—	—
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	15,730	95	—	—
STAG INDUSTRIAL INC	26,134	907	2,930	107
WP CAREY INC	33,712	2,121	4,944	361
ALEXANDER & BALDWIN INC	11,075	191	4,394	86
GLADSTONE LAND CORP	6,430	89	—	—
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	56,222	948	6,690	127
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,986	868	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	9,180	93	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	20,935	759	—	—
PHYSICIANS REALTY TRUST	33,570	434	—	—
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	46,139	2,370	3,901	208
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	55,111	1,811	9,442	311
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	33,250	502	5,970	110
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,350	248	—	—
JBG SMITH PROPERTIES	16,140	227	7,110	112
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	— (△63,086)	— (△393)	—	—
UNITI GROUP INC	142,940	730	—	—

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
INVITATION HOMES INC	88,868	2,811	20,947	708
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	— (—)	— (△7)	127,300	73
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	29,310	223	19,585	132
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	8,750	175	4,324	97
SAFEHOLD INC	— (3,093)	— (—)	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	25,060	571	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,715	1,941	5,754	280
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44,041	924	5,270	116
PRIME US REIT	— (—)	— (△4)	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC- A	6,280	83	—	—
INVENTRUST PROPERTIES CORP	12,620	290	4,400	103
FARMLAND PARTNERS INC	5,149	57	—	—
CITY OFFICE REIT INC	—	—	9,752	95
ORION OFFICE REIT INC	12,000	115	7,530	70
NETSTREIT CORP	17,229	287	—	—
CARETRUST REIT INC	12,970	249	—	—
PEAKSTONE REALTY TRUST	19,000	364	—	—
INDUS REALTY TRUST INC	—	—	2,340	156
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	17,320	569	3,480	118
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	—	1,856	25
APARTMENT INCOME REIT CO	19,480	642	4,750	170
BROADSTONE NET LEASE INC-A	33,588	529	5,000	83
CTO REALTY GROWTH INC	4,000	65	—	—
STAR HOLDINGS	— (6,183)	— (—)	—	—
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,140	88	—	—
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	190,000 (—)	106 (△3)	—	—
NET LEASE OFFICE PROPERTY	— (8,467)	— (—)	—	—
STORE CAPITAL CORP	4,060	128	129,849	4,186
PARAMOUNT GROUP INC	20,120	87	—	—
GLOBAL MEDICAL REIT INC	11,360	99	7,499	70
URBAN EDGE PROPERTIES	19,910	293	5,711	87

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	EQUINIX INC	14,739	10,495	2,350	1,728
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	14,190	179	—	—
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,880	206	7,000	86
	NEXPOINT RESIDENTIAL	3,050	94	—	—
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,600	284	—	—
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	3,930	111	—	—
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	31,390	480	6,760	103
	GLOBAL NET LEASE INC	23,960 (42,267)	231 (393)	—	—
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	15,490 (179)	190 (1)	—	—
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	34,820	425	13,859	170
	VICI PROPERTIES INC	166,899	5,007	23,742	752
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	15,060	368	—	—
	小 計	3,735,461 (△51,108)	152,665 (△13)	849,171	30,322
	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,491	304	—	—
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,580	639	2,825	143
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	15,000	133	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	31,681	611	11,619	234
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	8,000	137	—	—
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	—	—	8,481	127
	PRIMARIS REIT	8,325	110	6,259	94
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,546	277	—	—
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	9,052	112	—	—
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	10,773	104	—	—
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	—	—	5,934	97
	INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	—	—	8,700	27
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	14,183	192	—	—
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	5,334	119	45,062	1,056
	GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,801	287	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	24,950	320	—	—
	EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	—	—	23,900	59
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	23,728	322	7,075	103
	SLATE GROCERY REIT	15,480	203	16,202	225

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	SLATE OFFICE REI	—	—	17,000	27
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	—	—	12,000	125
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	13,747	228	—	—
	小 計	214,671	4,105	165,057	2,322
	ドイツ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT -AG	—	—	7,200	30
	小 計	—	—	7,200	30
	フランス				
	ICADE	4,417 (—)	148 (△28)	—	—
	ALTAREA	—	—	521 (—)	69 (0.31344)
	KLEPIERRE	25,191 (—)	571 (△81)	3,390	80
	GECINA SA	8,000	772	3,409	339
	COVIVIO (FP)	9,356	418	1,645	72
	MERCIALYS	21,221	178	—	—
	CARMILA	6,000 (—)	83 (△30)	—	—
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	17,327	834	5,183	246
	小 計	91,512 (—)	3,007 (△141)	14,148 (—)	807 (0.31344)
	オランダ				
	WERELDHAVE NV	8,823	128	5,117	71
	NSI NV	—	—	2,691	68
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	7,997	171	—	—
	小 計	16,820	300	7,808	139
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	26,172 (—)	142 (△8)	—	—
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	— (—)	— (△15)	—	—
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	42,822	342	—	—
	小 計	68,994 (—)	484 (△23)	—	—
	ベルギー				
	COFINIMMO	8,208	585	2,319	175

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	RETAIL ESTATES	2,210	120	—	—
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	5,697	78	—	—
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	31,705	798	3,000	79
	MONTEA NV	4,230	288	—	—
	AEDIFICA	9,180	532	(—)	(28)
	CARE PROPERTY INVEST	12,000	156	4,113	67
	CARE PROPERTY INVEST NV-RTS	(10,887)	(—)	10,887	6
	AEDIFICA SA-RIGHTS	(20,737)	(28)	20,737	8
	XIOR STUDENT HOUSING NV	7,670	221	—	—
	小 計	80,900 (31,624)	2,781 (28)	41,056 (—)	338 (28)
	その他				
	CROMWELL REIT EUR	(—) (—)	(—) (△13)	—	—
	小 計	(—) (—)	(—) (△13)	—	—
	ユ ー ロ 計	258,226 (31,624)	6,573 (△148)	70,212 (—)	1,316 (29)
	イギリス	口	千イギリスポンド	口	千イギリスポンド
	BRITISH LAND CO PLC	129,650	451	20,138	63
	DERWENT LONDON PLC	16,649	347	3,000	64
	BIG YELLOW GROUP PLC	21,900	223	—	—
	HAMMERSON PLC	909,460	226	241,321	60
	WORKSPACE GROUP PLC	19,080	88	—	—
	UNITE GROUP PLC	74,278	695	30,484	273
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	174,230	164	—	—
	SHAFTESBURY PLC	(—) (△139,823)	(—) (△525)	—	—
	SEGRO PLC	183,936	1,355	23,590	182
	LAND SECURITIES GROUP PLC	108,460	667	21,309	126
	ASSURA PLC	505,423	239	120,000	59
	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	110,000	51	136,908	71
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	48,583	228	14,378	62
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	—	—	135,000	61

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	HELICAL PLC	65,400	163	—	—
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	80,000	50	—	—
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	128,750	68	—	—
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	38,640	332	7,090	62
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	123,420	213	—	—
	SHAFTESBURY CAPITAL PLC	337,675 (469,245)	381 (525)	—	—
	WAREHOUSE REIT PLC	60,185	64	52,309	60
	NEWRIVER REIT PL	70,000	54	—	—
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	—	330,067	262
	CLS HOLDINGS PLC	75,636	111	—	—
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	168,840	135	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	288,560	405	48,784	62
	TARGET HEALTHCARE REIT PLC	391,491	304	—	—
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	72,010	61	—	—
	EDISTON PROPERTY INVESTMENT	—	—	110,000	75
	LIFE SCIENCE REIT PLC	176,938	130	—	—
	LXI REIT PLC	335,710	320	119,999	110
	URBAN LOGISTICS REIT PLC	73,230	78	—	—
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	80,000	73	67,062	69
	小 計	4,868,134 (329,422)	7,688 (—)	1,481,439	1,728
	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
	BWP TRUST	94,560	336	31,619	115
	MIRVAC GROUP	580,488	1,227	70,000	157
	CHARTER HALL RETAIL REIT	67,470	228	—	—
	GPT GROUP	256,974	1,039	41,111	170
	CENTURIA CAPITAL GROUP	217,027	325	—	—
	ABACUS GROUP	120,145	127	—	—
	STOCKLAND	347,474	1,334	40,803	169
	DEXUS	156,893	1,155	14,931	118
	GOODMAN GROUP	257,879	5,286	41,786	824
	VICINITY CENTERS	517,712	946	79,179	146
	CHARTER HALL GROUP	65,454	685	10,617	119

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	53,150	215	—	—
	REGION RE GROUP	157,570	348	—	—
	ARENA REIT	31,370	118	—	—
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	101,860	298	35,000	108
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	89,730	337	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	302,130	703	30,000	74
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	25,000	88	40,179	125
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	70	138,903	105
	RURAL FUNDS GROUP	90,748	165	—	—
	SCENTRE GROUP	716,370	1,849	87,218	232
	RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	—	—	190,640	135
	HMC CAPITAL LTD	57,170	263	—	—
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	52,350	131	—	—
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	431,268	511	96,718	114
	HEALTHCO REIT	243,191	346	80,000	114
	ABACUS STORAGE KING	153,450 (194,329)	162 (—)	—	—
	CENTURIA OFFICE REIT	99,190	153	136,206	207
	WAYPOINT REIT LTD	69,640	156	—	—
	小 計	5,486,263 (194,329)	18,613 (—)	1,164,910	3,039
	ニュージーランド	口	千ニュージーランドドル	口	千ニュージーランドドル
	AMP NZ OFFICE LTD	240,000	286	—	—
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	60,000	138	241,387	490
	GOODMAN PROPERTY TRUST	157,325	327	—	—
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	180,000	153	—	—
	ARGOSY PROPERTY LTD	90,000	103	—	—
	STRIDE PROPERTY GROUP	—	—	300,000	380
	小 計	727,325	1,008	541,387	871
	香港	口	千香港ドル	口	千香港ドル
	LINK REIT	586,500	26,105	54,100	2,544
	PROSPERITY REIT	260,000	368	260,000	578
	YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	566,000	1,253	575,000	1,078
	CHAMPION REIT	422,000	1,273	—	—

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	FORTUNE REIT	270,000	1,472	—	—
	LINK REIT -RIGHTS	— (206,000)	— (—)	206,000	886
	小 計	2,104,500 (206,000)	30,472 (—)	1,095,100	5,089
	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	717,100 (—)	1,346 (△8)	60,000	120
	CAPITALAND ASCENDAS REIT	677,100 (—)	1,841 (△36)	122,500	329
	SUNTEC REIT	265,600 (—)	320 (△9)	—	—
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	435,200 (—)	723 (△64)	—	—
	STARHILL GLOBAL REIT	200,000	95	186,400	97
	CAPITALAND ASCOTT TRUST	606,100 (—)	607 (△20)	95,200	101
	KEPPEL REIT	242,000	211	—	—
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	172,200	364	—	—
	ESR-LOGOS REIT	1,188,200 (—)	361 (△11)	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	— (—)	— (△2)	—	—
	CAPITALAND CHINA TRUST	89,300 (—)	101 (△30)	—	—
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	— (—)	— (△6)	538,100	122
	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	184,900 (—)	232 (△6)	—	—
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	70,700 (—)	263 (△7)	—	—
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	279,800 (—)	636 (△1)	—	—
	MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	343,900 (—)	516 (△10)	64,700	106
	PARAGON REIT	351,900	300	—	—
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	— (—)	— (△0.38454)	—	—
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	— (—)	— (△3)	1,273,644	270

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	330,300	198	156,100	102
	DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	— (—)	— (△17)	328,400	181
	KEPPEL DC REIT	171,900 (—)	352 (△15)	—	—
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	361,500 (—)	402 (△37)	—	—
	小 計	6,687,700 (—)	8,877 (△290)	2,825,044	1,432
	韓国	口	千韓国ウォン	口	千韓国ウォン
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	—	—	42,950	171,252
	E KOCREF CR-REIT CO LTD	—	—	13,200	65,553
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	10,000	60,467	—	—
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	— (4,501)	— (19,702)	15,754	66,831
	SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LTD	—	—	14,201	45,803
	JR REIT XXVII	19,000	76,455	—	—
	SK REITS CO LTD	22,000 (14,685)	90,561 (60,336)	— (—)	— (1,044)
	SHINHAN ALPHA REIT CO-RTS	— (6,670)	— (—)	6,670	1,085
	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	21,000 (—)	74,010 (△166)	— (—)	— (1)
	D&D PLATFORM REIT CO LTD	—	—	— (—)	— (382)
	NH ALL-ONE REIT CO LTD	— (—)	— (△779)	— (—)	— (389)
	SK REITS CO LTD-RIGHTS	— (14,685)	— (—)	— (14,685)	— (331)
	IGIS VALUE PLUS REIT-RIGHTS	— (4,501)	— (—)	— (4,501)	— (483)
	小 計	72,000 (45,042)	301,496 (79,092)	92,775 (19,186)	350,526 (2,632)

(注1)金額は受渡代金です。

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

利害関係人[※]との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	25,797	—	—	7,163	5	0.1
金 銭 信 託	0.525324	0.525324	100.0	0.525324	0.525324	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	21,604	2,183	10.1	21,587	2,198	10.2

(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。

組入資産の明細

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)		当 期		比 率 (%)
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
(アメリカ)			千米ドル		
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	70,288	93,284	8,822	1,336,036	1.3
ALEXANDER'S INC	1,190	1,336	252	38,271	0.0
BOSTON PROPERTIES	67,517	86,210	4,499	681,328	0.6
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	110,823	146,224	4,518	684,209	0.6
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	72,024	83,954	524	79,457	0.1
AGREE REALTY CORP	37,791	58,082	3,303	500,279	0.5
BRT APARTMENTS CORP	5,000	5,000	81	12,356	0.0
SL GREEN REALTY CORP	30,439	38,074	1,165	176,425	0.2
EPR PROPERTIES	35,511	44,397	1,982	300,183	0.3
PROLOGIS INC	439,354	550,595	56,865	8,611,135	8.2
AVALONBAY COMMUNITIES INC	66,793	84,474	14,053	2,128,188	2.0
LXP INDUSTRIAL TRUST	132,496	172,796	1,425	215,873	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	50,428	63,691	5,548	840,152	0.8
VERIS RESIDENTIAL INC	37,510	48,670	676	102,444	0.1
NNN REIT INC	83,841	109,365	4,179	632,966	0.6
COUSINS PROPERTIES INC	71,685	89,515	1,652	250,230	0.2
URSTADT BIDDLE - CL A	15,050	—	—	—	—
SITE CENTERS CORP	88,151	106,484	1,357	205,592	0.2
SAFEHOLD INC	40,416	27,084	449	68,123	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST	30,829	38,070	7,902	1,196,628	1.1
EQUITY RESIDENTIAL PPTY	160,241	205,257	11,024	1,669,417	1.6
FEDERAL REALTY INVS TRUST	34,470	43,887	4,016	608,290	0.6
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	62,519	79,678	3,420	517,977	0.5
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	255,424	326,458	5,135	777,620	0.7
EQUITY COMMONWEALTH	52,660	64,970	1,222	185,158	0.2

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

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	49,792	62,559	1,124	170,235	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	78,173	100,683	695	105,352	0.1
WELLTOWER INC	221,128	329,696	27,905	4,225,725	4.0
EASTGROUP PROPERTIES, INC	20,624	27,135	4,523	684,979	0.6
KIMCO REALTY CORP	292,774	368,258	6,518	987,045	0.9
KILROY REALTY CORPORATION	49,792	62,832	1,783	270,025	0.3
LTC PROPERTIES INC	19,175	25,125	792	119,961	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	116,800	116,800	235	35,727	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	81,217	104,507	397	60,136	0.1
IRON MOUNTAIN INC	137,603	173,734	10,227	1,548,783	1.5
MACERICH CO/THE	101,670	127,260	1,266	191,746	0.2
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	82,800	110,558	7,185	1,088,049	1.0
ACADIA REALTY TRUST	47,870	56,767	804	121,808	0.1
HOST HOTELS AND RESORTS INC	338,412	422,565	6,866	1,039,821	1.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	54,646	69,921	8,375	1,268,247	1.2
HERSHA HOSPITALITY TRUST	18,550	19,211	190	28,858	0.0
NATL HEALTH INVESTORS INC	21,139	25,669	1,290	195,480	0.2
CENTERSPACE	7,349	8,999	459	69,634	0.1
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	8,599	8,599	158	24,024	0.0
GETTY REALTY CORP	20,690	27,420	752	113,936	0.1
RPT REALTY	43,950	48,173	513	77,690	0.1
REALTY INCOME CORP	294,425	423,162	21,230	3,214,864	3.0
REGENCY CENTERS CORP	72,902	98,033	5,824	881,949	0.8
UDR INC	144,582	180,055	5,759	872,230	0.8
COPT DEFENSE PROPERTIES	53,219	66,436	1,563	236,821	0.2
SAUL CENTERS INC	6,800	6,846	238	36,087	0.0
SIMON PROPERTY GROUP	156,090	195,279	22,220	3,364,895	3.2
LIFE STORAGE INC	39,946	—	—	—	—
PUBLIC STORAGE	75,268	94,419	23,284	3,525,997	3.3
SUN COMMUNITIES INC	58,379	73,816	8,443	1,278,646	1.2
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	49,407	62,168	1,493	226,220	0.2
UMH PROPERTIES INC	25,129	33,009	478	72,429	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	20,150	26,942	318	48,182	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	4,793	7,811	305	46,307	0.0
VENTAS INC	189,214	239,543	10,079	1,526,409	1.4
VORNADO REALTY TRUST	76,257	94,277	1,927	291,808	0.3
ELME COMMUNITIES	41,374	55,407	725	109,912	0.1
KITE REALTY GROUP TRUST	103,723	133,039	2,748	416,218	0.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	63,891	125,689	14,843	2,247,807	2.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	45,973	45,973	98	14,967	0.0
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	100,505	124,355	1,177	178,330	0.2
CUBESMART	106,251	134,302	4,915	744,347	0.7
DIGITAL REALTY TRUST INC	137,142	180,630	23,050	3,490,490	3.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	99,846	124,486	1,004	152,126	0.1
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	283,552	352,832	1,637	247,912	0.2
DOUGLAS EMMETT INC-W/I	83,212	98,752	1,110	168,232	0.2

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末		
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	58,955	74,955	891	135,070	0.1
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST	58,412	75,292	420	63,620	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	52,970	67,550	399	60,453	0.1
TERRENO REALTY CORP	31,471	49,321	2,664	403,532	0.4
AMERICAN ASSETS TRUST INC	26,331	29,232	538	81,538	0.1
RLJ LODGING TRUST	77,042	93,642	919	139,249	0.1
AMERICOLD REALTY TRUST	127,511	152,283	3,823	579,041	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	62,226	71,638	833	126,163	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	22,938	22,938	108	16,499	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	25,360	25,562	241	36,502	0.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	109,335	136,268	1,858	281,462	0.3
WHITESTONE REIT	23,074	31,954	328	49,791	0.0
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	61,023	76,753	412	62,530	0.1
STAG INDUSTRIAL INC	84,837	108,041	3,709	561,661	0.5
WP CAREY INC	98,249	127,017	6,894	1,044,031	1.0
ALEXANDER & BALDWIN INC	36,712	43,393	686	103,953	0.1
GLADSTONE LAND CORP	15,061	21,491	292	44,324	0.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	180,143	229,675	3,275	495,958	0.5
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	26,109	36,095	3,326	503,679	0.5
ARMADA HOFFLER PROPERTIES	32,051	41,231	416	63,122	0.1
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	64,541	85,476	3,266	494,705	0.5
PHYSICIANS REALTY TRUST	107,135	140,705	1,549	234,589	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	80,979	123,217	5,488	831,060	0.8
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	143,210	188,879	6,512	986,195	0.9
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	105,006	132,286	1,703	258,013	0.2
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	13,242	16,592	1,246	188,766	0.2
JBG SMITH PROPERTIES	47,111	56,141	744	112,813	0.1
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	63,086	—	—	—	—
UNITI GROUP INC	—	142,940	683	103,465	0.1
INVITATION HOMES INC	274,483	342,404	10,686	1,618,245	1.5
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	470,000	342,700	83	12,714	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	68,118	77,843	652	98,781	0.1
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	17,286	21,712	451	68,321	0.1
SAFEHOLD INC	8,335	—	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	66,851	91,911	2,073	313,991	0.3
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	33,166	33,166	90	13,710	0.0
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	120,938	155,899	7,013	1,062,114	1.0
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	141,856	180,627	3,766	570,296	0.5
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	28,700	28,700	59	8,996	0.0
EAGLE HOSPITALITY TRUST	295,000	295,000	0.00002	0.003	0.0
PRIME US REIT	295,000	295,000	39	5,986	0.0
POSTAL REALTY TRUST INC- A	7,000	13,280	180	27,349	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	5,700	5,700	85	12,955	0.0
INVENTRUST PROPERTIES CORP	31,919	40,139	972	147,215	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	22,851	28,000	305	46,216	0.0
CITY OFFICE REIT INC	25,050	15,298	64	9,799	0.0

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
ORION OFFICE REIT INC	30,374	34,844	174	26,487	0.0	
NETSTREIT CORP	23,831	41,060	621	94,136	0.1	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	17,000	17,000	33	5,122	0.0	
CARETRUST REIT INC	45,932	58,902	1,265	191,680	0.2	
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	19,000	262	39,733	0.0	
INDUS REALTY TRUST INC	2,340	—	—	—	—	
PHILLIPS EDISON & COMPANY INC	55,243	69,083	2,276	344,802	0.3	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	1,856	—	—	—	—	
APARTMENT INCOME REIT CO	72,989	87,719	2,559	387,606	0.4	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	81,949	110,537	1,585	240,031	0.2	
CTO REALTY GROWTH INC	8,400	12,400	201	30,531	0.0	
STAR HOLDINGS	—	6,183	69	10,449	0.0	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	11,597	15,737	336	50,973	0.0	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	178,800	368,800	193	29,319	0.0	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	—	8,467	107	16,270	0.0	
STORE CAPITAL CORP	125,789	—	—	—	—	
PARAMOUNT GROUP INC	80,008	100,128	426	64,591	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	33,930	37,791	343	51,962	0.0	
URBAN EDGE PROPERTIES	55,595	69,794	1,118	169,419	0.2	
EQUINIX INC	43,383	55,772	42,219	6,393,368	6.1	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	42,991	57,181	614	93,083	0.1	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	54,132	64,012	752	113,993	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL	10,806	13,856	406	61,624	0.1	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	40,398	48,998	1,492	226,080	0.2	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST	11,050	14,980	385	58,343	0.1	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	100,761	125,391	1,956	296,212	0.3	
GLOBAL NET LEASE INC	49,084	115,311	921	139,517	0.1	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	—	15,669	124	18,815	0.0	
CLIPPER REALTY INC	7,300	7,300	35	5,361	0.0	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	835,164	835,164	65	9,864	0.0	
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	106,435	127,396	1,658	251,176	0.2	
VICI PROPERTIES INC	459,464	602,621	16,939	2,565,175	2.4	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	38,562	53,622	1,170	177,259	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	12,568,769	15,403,951	540,713	81,880,308	
	銘 柄 数 < 比 率 >	145	143	—	< 77.6 % >	
(カナダ)			千カナダドル			
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	30,663	43,154	991	108,737	0.1	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	39,175	49,930	2,216	243,082	0.2	
H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST-UNIT	61,841	76,841	680	74,650	0.1	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	70,377	90,439	1,564	171,557	0.2	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	29,679	37,679	617	67,674	0.1	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	13,820	5,339	43	4,818	0.0	
PRIMARIS REIT	28,309	30,375	407	44,663	0.0	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	9,047	13,593	902	98,937	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	30,330	30,330	187	20,552	0.0	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	26,577	26,577	354	38,875	0.0	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	33,790	42,842	507	55,619	0.1	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	48,099	58,872	267	29,307	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL	12,890	6,956	93	10,197	0.0	
INOVALIS REAL ESTATE INVESTM	8,700	—	—	—	—	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	59,149	73,332	886	97,213	0.1	
BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	20,000	20,000	58	6,425	0.0	
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	39,728	—	—	—	—	
GRANITE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,334	19,135	1,238	135,855	0.1	
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	25,800	25,800	37	4,102	0.0	
CHOICE PROPERTIES REIT	76,025	100,975	1,290	141,498	0.1	
MINTO APARTMENT REAL ESTATE	11,100	11,100	156	17,124	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	27,730	27,730	376	41,230	0.0	
EUROPEAN RESIDENTIAL REAL ES	23,900	—	—	—	—	
PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	16,000	16,000	71	7,807	0.0	
BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	9,500	9,500	139	15,333	0.0	
FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	49,695	66,348	906	99,377	0.1	
SLATE GROCERY REIT	17,300	16,578	174	19,104	0.0	
NEXUS INDUSTRIAL REIT	16,015	16,015	109	11,993	0.0	
SLATE OFFICE REI	17,000	—	—	—	—	
AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	12,000	—	—	—	—	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	21,900	35,647	598	65,666	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	901,473	951,087	14,878	1,631,407	
	銘柄 数<比 率>	31	26	—	<1.5%>	
(ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	37,000	37,000	249	40,230	0.0	
ALSTRIA OFFICE REIT -AG	7,200	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	44,200	37,000	249	40,230	
	銘柄 数<比 率>	2	1	—	<0.0%>	
(イタリア)				千ユーロ		
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	33,790	33,790	72	11,791	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	33,790	33,790	72	11,791	
	銘柄 数<比 率>	1	1	—	<0.0%>	
(フランス)				千ユーロ		
ICADE	15,570	19,987	639	103,331	0.1	
ALTAREA	2,480	1,959	138	22,407	0.0	
KLEPIERRE	92,974	114,775	2,598	419,814	0.4	
GECINA SA	25,736	30,327	2,962	478,693	0.5	
COVIVIO(FP)	21,972	29,683	1,281	206,977	0.2	
MERCIALYS	36,384	57,605	474	76,733	0.1	
CARMILA	26,392	32,392	461	74,521	0.1	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	49,378	61,522	3,131	505,920	0.5	
小 計	口 数 ・ 金 額	270,886	348,250	11,688	1,888,400	
	銘柄 数<比 率>	8	8	—	<1.8%>	
(オランダ)				千ユーロ		
VASTNED RETAIL	10,650	10,650	207	33,448	0.0	
WERELDHAVE NV	22,670	26,376	393	63,578	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
NSI NV	10,050	7,359	129	20,972	0.0	
EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	17,493	25,490	557	90,023	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	60,863	69,875	1,287	208,023	
		4	4	—	<0.2%>	
(スペイン)			千ユーロ			
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	141,272	167,444	944	152,574	0.1	
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	34,000	34,000	194	31,420	0.0	
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	157,888	200,710	1,707	275,789	0.3	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	333,160	402,154	2,845	459,784	
		3	3	—	<0.4%>	
(ベルギー)			千ユーロ			
COFINIMMO	14,199	20,088	1,266	204,623	0.2	
RETAIL ESTATES	5,335	7,545	475	76,795	0.1	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	12,100	17,797	359	58,080	0.1	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	66,064	94,769	2,348	379,403	0.4	
MONTEA NV	4,970	9,200	639	103,301	0.1	
AEDIFICA	18,867	28,047	1,618	261,454	0.2	
CARE PROPERTY INVEST	15,000	22,887	290	46,959	0.0	
XIOR STUDENT HOUSING NV	9,813	17,483	541	87,561	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	146,348	217,816	7,540	1,218,179	
		8	8	—	<1.2%>	
(アイルランド)			千ユーロ			
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	210,000	210,000	207	33,588	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	210,000	210,000	207	33,588	
		1	1	—	<0.0%>	
(その他)			千ユーロ			
CROMWELL REIT EUR	170,400	170,400	207	33,586	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	170,400	170,400	207	33,586	
		1	1	—	<0.0%>	
ユーロ計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,269,647	1,489,285	24,099	3,893,583	
		28	27	—	<3.7%>	
(イギリス)			千イギリスポンド			
BRITISH LAND CO PLC	446,042	555,554	1,742	322,449	0.3	
DERWENT LONDON PLC	53,156	66,805	1,368	253,220	0.2	
BIG YELLOW GROUP PLC	82,773	104,673	1,099	203,415	0.2	
HAMMERSON PLC	1,673,646	2,341,785	571	105,840	0.1	
WORKSPACE GROUP PLC	65,316	84,396	474	87,862	0.1	
INTU PROPERTIES PLC	521,960	521,960	9	1,715	0.0	
UNITE GROUP PLC	190,394	234,188	2,248	416,097	0.4	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	630,955	805,185	772	142,913	0.1	
SHAFTESBURY PLC	139,823	—	—	—	—	
SEGRO PLC	572,354	732,700	5,697	1,054,488	1.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	355,654	442,805	2,665	493,365	0.5	
ASSURA PLC	1,400,809	1,786,232	801	148,371	0.1	
ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	260,756	233,848	110	20,385	0.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	109,600	143,805	589	109,016	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	350,000	215,000	90	16,752	0.0	
HELICAL PLC	—	65,400	136	25,237	0.0	
PICTON PROPERTY INCOME LTD	268,000	348,000	226	41,865	0.0	
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	405,972	534,722	307	57,004	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	98,896	130,446	986	182,520	0.2	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	464,236	587,656	1,037	191,967	0.2	
BALANCED COMMERCIAL PROPERTY TRUST LTD	378,400	378,400	244	45,172	0.0	
SHAFTESBURY CAPITAL PLC	354,157	1,161,077	1,354	250,779	0.2	
WAREHOUSE REIT PLC	230,000	237,876	192	35,573	0.0	
NEWRIVER REIT PL	126,000	196,000	156	29,020	0.0	
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	330,067	—	—	—	—	
PRS REIT PLC/THE	260,002	260,002	210	38,978	0.0	
CLS HOLDINGS PLC	—	75,636	69	12,836	0.0	
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	203,286	203,286	118	21,897	0.0	
SUPERMARKET INCOME REIT PLC	589,189	758,029	601	111,395	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	888,708	1,128,484	1,659	307,232	0.3	
CUSTODIAN PROPERTY INCOME REIT	234,276	234,276	203	37,723	0.0	
TARGET HEALTHCARE REIT PLC	—	391,491	312	57,748	0.1	
HOME REIT PLC	374,236	374,236	142	26,354	0.0	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	306,000	378,010	347	64,365	0.1	
EDISTON PROPERTY INVESTMENT	110,000	—	—	—	—	
LIFE SCIENCE REIT PLC	—	176,938	119	22,202	0.0	
AEW UK REIT PLC	68,000	68,000	65	12,031	0.0	
LXI REIT PLC	811,588	1,027,299	968	179,294	0.2	
REGIONAL REIT LTD	222,000	222,000	63	11,730	0.0	
URBAN LOGISTICS REIT PLC	223,421	296,651	350	64,786	0.1	
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	229,355	242,293	202	37,444	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	14,029,027	17,745,144	28,317	5,241,057	
	銘 柄 数 < 比 率 >	37	38	—	<5.0%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
BWP TRUST	228,066	291,007	992	95,492	0.1	
MIRVAC GROUP	1,867,868	2,378,356	4,697	452,016	0.4	
CROMWELL PROPERTY GROUP	669,440	669,440	251	24,157	0.0	
CHARTER HALL RETAIL REIT	244,874	312,344	1,011	97,384	0.1	
GPT GROUP	906,785	1,122,648	4,389	422,406	0.4	
CENTURIA CAPITAL GROUP	274,928	491,955	617	59,412	0.1	
ABACUS GROUP	194,329	314,474	319	30,715	0.0	
STOCKLAND	1,130,026	1,436,697	5,516	530,892	0.5	
DEXUS	509,145	651,107	4,557	438,592	0.4	
GOODMAN GROUP	804,776	1,020,869	22,938	2,207,412	2.1	
VICINITY CENTERS	1,831,690	2,270,223	4,075	392,142	0.4	
CHARTER HALL GROUP	223,905	278,742	2,781	267,696	0.3	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	138,810	138,810	309	29,787	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	173,646	226,796	927	89,262	0.1	
REGION RE GROUP	528,421	685,991	1,447	139,287	0.1	
ARENA REIT	161,278	192,648	645	62,104	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)		
CENTURIA INDUSTRIAL REIT	255,476	322,336	957	92,124	0.1	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	286,964	376,694	1,243	119,622	0.1	
DEXUS INDUSTRIA REIT	113,000	113,000	291	28,054	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	473,590	745,720	1,573	151,414	0.1	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	117,885	102,706	283	27,278	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	324,500	315,597	173	16,703	0.0	
RURAL FUNDS GROUP	181,331	272,079	510	49,091	0.0	
SCENTRE GROUP	2,456,991	3,086,143	7,931	763,237	0.7	
RAM ESSENTIAL SERVICES PROPE	190,640	—	—	—	—	
HMC CAPITAL LTD	92,191	149,361	699	67,265	0.1	
CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	157,784	210,134	540	51,968	0.0	
HOMEKO DAILY NEEDS REIT	734,103	1,068,653	1,202	115,691	0.1	
HEALTHCO REIT	137,130	300,321	411	39,592	0.0	
ABACUS STORAGE KING	—	347,779	363	34,972	0.0	
CENTURIA OFFICE REIT	240,945	203,929	250	24,137	0.0	
WAYPOINT REIT LTD	336,956	406,596	943	90,774	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	15,987,473	20,503,155	72,853	7,010,694	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 6.6% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
AMP NZ OFFICE LTD	556,295	796,295	911	81,337	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	181,387	—	—	—	—	
GOODMAN PROPERTY TRUST	498,199	655,524	1,337	119,297	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	743,753	923,753	762	67,986	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	417,278	507,278	558	49,779	0.0	
STRIDE PROPERTY GROUP	300,000	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,696,912	2,882,850	3,569	318,401	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	4	—	< 0.3% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	997,800	1,530,200	60,442	1,171,987	1.1	
PROSPERITY REIT	752,000	752,000	1,007	19,538	0.0	
YUEXIU REIT ASSET MANAGEMENT	1,315,660	1,306,660	1,476	28,629	0.0	
CHAMPION REIT	745,000	1,167,000	2,894	56,117	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	561,000	561,000	1,155	22,408	0.0	
FORTUNE REIT	605,000	875,000	3,998	77,535	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,976,460	6,191,860	70,975	1,376,218	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 1.3% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	2,383,544	3,040,644	5,533	616,152	0.6	
CAPITALAND ASCENDAS REIT	1,581,818	2,136,418	5,832	649,381	0.6	
SUNTEC REIT	1,060,900	1,326,500	1,472	163,938	0.2	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	1,523,285	1,958,485	3,055	340,170	0.3	
STARHILL GLOBAL REIT	849,400	863,000	409	45,641	0.0	
CAPITALAND ASCOTT TRUST	847,977	1,358,877	1,216	135,411	0.1	
KEPPEL REIT	936,300	1,178,300	948	105,609	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	469,862	642,062	1,341	149,408	0.1	
ESR-LOGOS REIT	2,418,564	3,606,764	973	108,425	0.1	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末			
	口 数 (口)	口 数 (口)	評 価 額		比 率 (%)	
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
CDL HOSPITALITY TRUSTS	397,900	397,900	387	43,194	0.0	
CAPITALAND CHINA TRUST	553,921	643,221	498	55,502	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	538,100	—	—	—	—	
AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	275,000	459,900	574	64,006	0.1	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	163,200	233,900	806	89,846	0.1	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	941,863	1,221,663	2,675	297,883	0.3	
MAPLETREE PAN ASIA COMMERCIA	1,090,073	1,369,273	1,848	205,814	0.2	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	540,000	540,000	329	36,675	0.0	
PARAGON REIT	409,600	761,500	609	67,828	0.1	
EC WORLD REIT	180,000	180,000	46	5,200	0.0	
SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	295,800	295,800	199	22,230	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	1,273,644	—	—	—	—	
LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	883,950	1,058,150	581	64,797	0.1	
DAIWA HOUSE LOGISTICS TRUST	328,400	—	—	—	—	
KEPPEL DC REIT	626,303	798,203	1,436	159,969	0.2	
FRASERS LOGISTICS & COMMERC	1,364,796	1,726,296	1,812	201,816	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	21,934,200	25,796,856	32,592	3,628,904	
	銘 柄 数<比 率>	25	22	—	<3.4%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	42,950	—	—	—	—	
E KOCREF CR-REIT CO LTD	13,200	—	—	—	—	
SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	36,380	46,380	289,411	33,311	0.0	
IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	11,253	—	—	—	—	
LOTTE REIT CO LTD	72,480	72,480	221,064	25,444	0.0	
KORAMCO LIFE INFRA REIT	25,433	25,433	138,101	15,895	0.0	
SHINHAN SEOBU T&D REIT CO LT	14,201	—	—	—	—	
JR REIT XXVII	76,683	95,683	387,516	44,603	0.0	
SK REITS CO LTD	39,229	75,914	299,860	34,513	0.0	
ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	81,340	102,340	341,815	39,342	0.0	
D&D PLATFORM REIT CO LTD	28,240	28,240	84,720	9,751	0.0	
NH ALL-ONE REIT CO LTD	14,949	14,949	50,452	5,807	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	456,338	461,419	1,812,941	208,669	
	銘 柄 数<比 率>	12	8	—	<0.2%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
REIT 1 LTD	103,500	103,500	1,592	62,676	0.1	
SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	115,000	115,000	885	34,842	0.0	
MENIVIM- THE NEW REIT LTD	360,000	360,000	529	20,823	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	578,500	578,500	3,007	118,341	
	銘 柄 数<比 率>	3	3	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	75,398,799	92,004,107	—	105,307,588	
	銘 柄 数<比 率>	324	308	—	<99.7%>	

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

(注2) 比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 証 券	105,307,588	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	672,617	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	105,980,205	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(105,580,274千円)の投資信託財産総額(105,980,205千円)に対する比率は99.6%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=151.43円	1カナダドル=109.65円	1ユーロ=161.56円
1イギリスポンド=185.08円	1オーストラリアドル=96.23円	1ニュージーランドドル=89.21円
1香港ドル=19.39円	1シンガポールドル=111.34円	1韓国ウォン=0.1151円
1イスラエルシェケル=39.3481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 2023年11月10日現在
(A)資 産	105,980,205,739円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	537,071,979
投 資 証 券(評価額)	105,307,588,300
未 収 入 金	3,605,255
未 収 配 当 金	131,940,205
(B)負 債	400,172,240
未 払 金	269,166,320
未 払 解 約 金	131,005,839
未 払 利 息	80
そ の 他 未 払 費 用	1
(C)純 資 産 総 額(A-B)	105,580,033,499
元 本	42,440,513,111
次 期 繰 越 損 益 金	63,139,520,388
(D)受 益 権 総 口 数	42,440,513,111口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,877円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年11月11日 至 2023年11月10日
(A)配 当 等 収 益	3,780,759,271円
受 取 配 当 金	3,767,102,940
受 取 利 息	13,702,551
そ の 他 収 益 金	3,802
支 払 利 息	△50,022
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△1,333,019,067
売 買 益	9,018,650,058
売 買 損	△10,351,669,125
(C)そ の 他 費 用	△35,275,760
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	2,412,464,444
(E)前 期 繰 越 損 益 金	49,916,887,937
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	16,210,411,963
(G)解 約 差 損 益 金	△5,400,243,956
(H)計 (D+E+F+G)	63,139,520,388
次 期 繰 越 損 益 金(H)	63,139,520,388

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は34,643,734,497円、期中追加設定元本額は11,402,252,400円、期中一部解約元本額は3,605,473,786円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

グローバルリートインデックス・オープン(SMA専用)	19,405,996,820円
SMT グローバルREITインデックス・オープン	12,247,254,798円
グローバルリートインデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,622,820,631円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,580,923,198円
分散投資コア戦略ファンドS	1,578,869,574円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,382,411,427円
分散投資コア戦略ファンドA	1,038,546,021円
コア投資戦略ファンド(切替型)	589,093,366円
コア投資戦略ファンド(安定型)	515,173,421円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	444,030,757円
FOFs用 グローバルREITインデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	239,927,885円
グローバル経済コア	237,253,600円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	176,477,358円
My SMT グローバルREITインデックス(ノーロード)	170,480,212円
SMT インデックスバランス・オープン	111,160,303円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	109,346,956円
SMTAM海外バランスファンド2020-01(適格機関投資家専用)	95,120,470円
ワールド・ファイブインカム・ファンド(毎月決算型)	92,963,651円
SMTAM海外バランスファンド2020-08(適格機関投資家専用)	92,682,971円
SMTAM海外バランスファンド2021-04(適格機関投資家専用)	92,598,015円
SMTAM海外バランスファンド2020-11(適格機関投資家専用)	92,211,639円
SMTAM海外バランスファンド2021-07(適格機関投資家専用)	91,680,030円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	79,974,585円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド2021-11(適格機関投資家専用)	79,493,312円
ダイナミック・リスクコントロール・バランス戦略ファンド(適格機関投資家専用)	63,295,249円
SMTAM海外バランスファンド2023-02(適格機関投資家専用)	59,598,092円
グローバル3資産バランスオープン	55,090,495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)	50,693,016円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	14,438,228円
10資産分散投資ファンド	12,808,800円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	9,945,768円
SBI資産設計オープン(分配型)	5,828,344円
グローバル10資産バランスファンド	2,324,119円

お知らせ

ベンチマークを「配当込み指数」とすることを明示、併せて指数名称の記載整備を行うべく、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年6月28日)

ゴールドマザーファンド(為替ヘッジあり)

運用報告書

第6期(決算日 2023年7月10日)

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		投 信 証 資 純 託 託 券 資 総 組 入 比 率 産 額
	円	%	期 騰 落 中 率	期 騰 落 中 率	
第2期(2019年7月10日)	10,200	7.1	10,341	7.5	99.8 百万円 27,180
第3期(2020年7月10日)	12,833	25.8	13,346	29.1	99.0 28,966
第4期(2021年7月12日)	12,644	△1.5	13,227	△0.9	98.9 36,114
第5期(2022年7月11日)	12,005	△5.1	12,602	△4.7	100.1 30,762
第6期(2023年7月10日)	12,430	3.5	13,394	6.3	98.4 30,894

ベンチマークは、LBMA金価格(円ヘッジベース)です。

LBMA金価格とは、正式名称はLBMA Gold Price PMといい、ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)によってロンドン時間の午後に公表される1トロイオンスあたりの金現物価格(米ドル建て)を指します。なお、LBMAは、ロンドン貴金属市場協会(London Bullion Market Association)の略称です。

「円ヘッジベース」は、対円の為替ヘッジを考慮して当社が独自に算出した指数です。

ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッド(ICE Benchmark Administration Limited)は、LBMA金価格及びLBMA金価格が示す、あらゆる特定の日、特定の時点における数値により生じた結果について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。ICEベンチマーク・アドミニストレーション・リミテッドは、当ファンドに関する商品性や特定目的への適合性について、明示的又は暗示的に、何ら保証するものではありません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

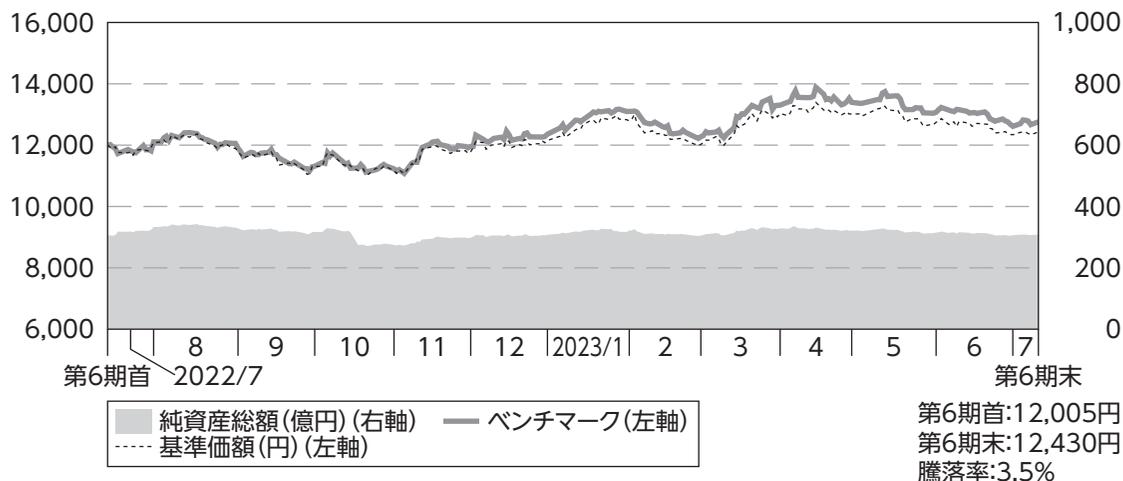
当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		投資信託証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	
(当 期 首) 2022年 7月11日	円 12,005	% ー	12,602	% ー	% 100.1
7月末	12,077	0.6	12,707	0.8	98.6
8月末	11,791	△1.8	12,493	△0.9	104.5
9月末	11,307	△5.8	11,876	△5.8	103.7
10月末	11,168	△7.0	11,785	△6.5	102.4
11月末	11,786	△1.8	12,553	△0.4	93.6
12月末	12,154	1.2	12,970	2.9	96.9
2023年 1月末	12,791	6.5	13,754	9.1	99.6
2月末	12,026	0.2	12,884	2.2	105.2
3月末	13,034	8.6	13,966	10.8	98.4
4月末	13,017	8.4	14,061	11.6	101.0
5月末	12,748	6.2	13,723	8.9	102.3
6月末	12,339	2.8	13,242	5.1	104.0
(当 期 末) 2023年 7月10日	12,430	3.5	13,394	6.3	98.4

(注) 騰落率は期首比です。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

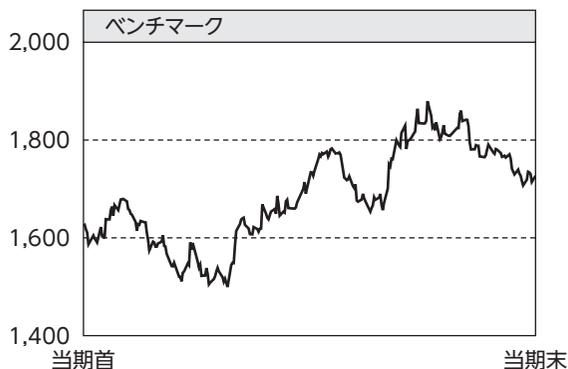


(注)ベンチマークは、2022年7月11日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)の動きを反映して、基準価額は上昇しました。

投資環境



金価格は上昇しました。

期初から2022年10月末頃にかけて米国で積極的な利上げが継続されるとの警戒感から下落しましたが、2023年1月末頃にかけては米CPI(消費者物価指数)の伸びの鈍化傾向が確認されたことなどから先行きのインフレ率の低下が見込まれ、ドル安が進み上昇しました。その後は好調な経済指標を背景にしたドル高などを受けて下落する局面もありましたが、3月末頃にかけては米国の商業銀行が経営破綻したことに端を発する信用不安から上昇しました。その後、期末にかけてはパウエルFRB(米連邦準備理事会)議長が早期の利下げ転換に否定的な見方を示したことなどから、金価格は下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

金現物に投資するETF(上場投資信託証券)の組入比率を期を通じて高位に維持し、組入外貨建資産については原則として対円での為替ヘッジを行うことでベンチマークであるLBMA金価格(円ヘッジベース)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

当ファンドの組入資産の内容

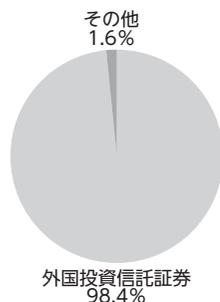
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	ISHARES GOLD TRUST	アメリカ	98.4%
2	――	――	――
3	――	――	――
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――

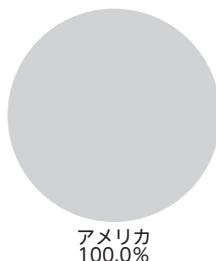
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数			1

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

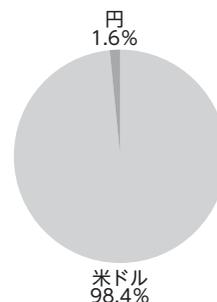
○資産別配分



○国別配分



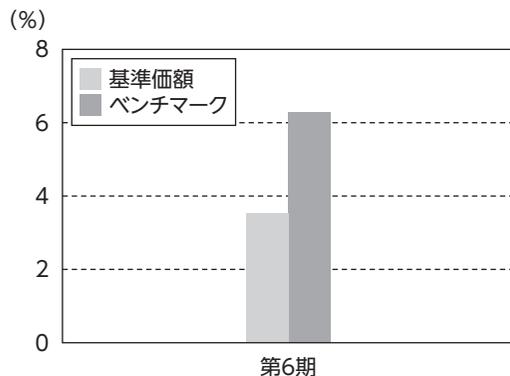
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率は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、キャッシュ要因、ETF要因^{*}、信託報酬要因(すべてマイナス要因)などです。

^{*}ベンチマークがロンドン時間の価格を元に算出されるのに対しETFは米国市場の終値で評価されることにより発生する評価差要因です。

今後の運用方針

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

別に定める「投資対象上場投資信託証券」とは、次のものをいいます。

iShares Gold Trust

SPDR Gold Shares

別に定める「ベンチマーク」とは、次のものをいいます。

LBMA金価格(円ヘッジベース)

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年7月12日~2023年7月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	2円 (-) (-) (-) (2) (-) (-)	0.015% (-) (-) (-) (0.015) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	0 (-) (-) (-) (-) (0)	0.001 (-) (-) (-) (-) (0.001)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	2 (2) (-) (0)	0.016 (0.016) (-) (0.000)	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	4	0.032	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(12,186円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<投資信託受益証券、投資証券>

	当 期			
	買 付		売 付	
	口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
外 国				
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
ISHARES GOLD TRUST	2,049	70,116	3,020	102,020
小 計	2,049	70,116	3,020	102,020

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.010390	百万円 0.010390	% 100.0	百万円 0.010390	百万円 0.010390	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	28,403	3,265	11.5	28,354	3,249	11.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<外国投資信託受益証券、投資証券>

銘 柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	口 数 (千口)	口 数 (千口)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千米ドル	
ISHARES GOLD TRUST	6,820	5,850	213,298	30,403,512
合 計	口 数 ・ 金 額 6,820	口 数 ・ 金 額 5,850	213,298	30,403,512
	銘 柄 数 < 比 率 > 1	銘 柄 数 < 比 率 > 1	—	< 98.4% >

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

(注2)< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	30,403,512	98.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	501,617	1.6
投 資 信 託 財 産 総 額	30,905,129	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(30,406,200千円)の投資信託財産総額(30,905,129千円)に対する比率は98.4%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=142.54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 2023年7月10日現在
(A)資 産	61,139,315,584円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	114,851,873
投資信託受益証券(評価額)	30,403,512,556
未 収 入 金	30,620,951,155
(B)負 債	30,244,456,375
未 払 金	30,234,692,221
未 払 解 約 金	9,764,061
未 払 利 息	93
(C)純 資 産 総 額(A-B)	30,894,859,209
元 本	24,854,962,097
次 期 繰 越 損 益 金	6,039,897,112
(D)受 益 権 総 口 数	24,854,962,097口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,430円

■ 損益の状況

項 目	当 期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日
(A)配 当 等 収 益	2,329,334円
受 取 利 息	2,385,344
支 払 利 息	△56,010
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	945,854,386
売 買 益	10,209,387,250
売 買 損	△9,263,532,864
(C)そ の 他 費 用	△4,942,702
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	943,241,018
(E)前 期 繰 越 損 益 金	5,137,323,398
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	1,202,971,984
(G)解 約 差 損 益 金	△1,243,639,288
(H)計 (D+E+F+G)	6,039,897,112
次 期 繰 越 損 益 金(H)	6,039,897,112

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は25,625,430,409円、期中追加設定元本額は5,719,589,312円、期中一部解約元本額は6,490,057,624円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

分散投資コア戦略ファンドS	7,439,587,857円
コア投資戦略ファンド(成長型)	3,619,980,624円
SMT ゴールドインデックス・オープン(為替ヘッジあり)	3,464,735,644円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,323,181,016円
分散投資コア戦略ファンドA	2,034,630,620円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,663,978,391円
グローバル経済コア	1,310,568,348円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	912,842,328円
SMTAM9資産アロケーションファンド(適格機関投資家専用)	679,703,398円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	591,073,671円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	517,627,891円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	207,870,061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)	89,182,248円

お知らせ

該当事項はありません。

ピクテ マルチストラテジー リンク マザーファンド

運用報告書

第8期（決算日 2023年8月25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2015年12月11日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	ゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

- ・基準価額は1万口当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未满是切捨て、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	期 騰 落 中 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額	
					債 組 入 比 率
第4期(2019年8月26日)	円 10,196	% △1.1	% 98.7	% —	百万円 29,321
第5期(2020年8月25日)	10,695	4.9	97.0	—	27,866
第6期(2021年8月25日)	10,662	△0.3	97.9	—	43,449
第7期(2022年8月25日)	10,043	△5.8	97.5	—	43,727
第8期(2023年8月25日)	10,202	1.6	98.9	—	30,171

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 券 先 物 率
(当 期 首) 2022年 8月25日	円 10,043	% —	% 97.5	% —
8月末	10,036	△0.1	97.5	—
9月末	10,046	0.0	97.6	—
10月末	9,986	△0.6	97.9	—
11月末	9,942	△1.0	98.1	—
12月末	10,032	△0.1	98.3	—
2023年 1月末	10,117	0.7	98.1	—
2月末	10,097	0.5	97.8	—
3月末	10,163	1.2	83.1	—
4月末	10,094	0.5	95.8	—
5月末	10,115	0.7	96.1	—
6月末	10,166	1.2	96.1	—
7月末	10,161	1.2	95.2	—
(当 期 末) 2023年 8月25日	10,202	1.6	98.9	—

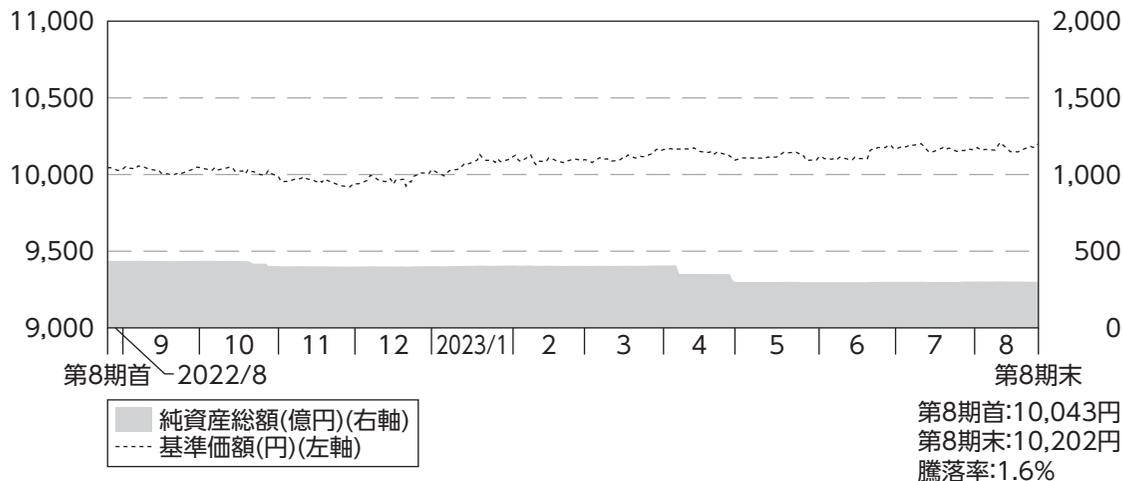
(注1) 騰落率は期首比です。

(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。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、世界的なインフレ基調の鈍化、欧州のガス価格の下落、中国のゼロコロナ政策解除と経済再開期待、そして人工知能(AI)の構造的成長期待によって生じる投資機会を捉え、米地銀の経営破綻を発端とした信用不安や米国の債務上限問題などの波乱要因があった中でも堅調に推移しました。

戦略別には、グローバル・クオリティ株式やエマージング・フロンティア債券などがプラスに寄与した一方、為替や欧州株式(中型)などがマイナスに影響しました。グローバル・クオリティ株式は、良好な株主還元利回りが市場から評価された日本の総合商社のロング・ポジションなどがプラスに寄与しました。一方で、為替は、電力不足による景気減速懸念に加えて、ロシアに対する武器供与疑惑が報じられる中で、南アフリカ・ランドのロング・ポジション(対米ドル)などがマイナスに影響しました。

投資環境

株式市場は、米地銀の経営破綻を発端とした信用不安や米国の債務上限問題を受けた調整を挟みつつも、世界的なインフレ基調の鈍化、欧州のガス価格の下落、中国のゼロコロナ政策解除と経済再開期待、そして人工知能(AI)の構造的成長期待などを背景に上昇しました。債券市場は、主要国の利上げペースの鈍化観測や米地銀の経営破綻を発端とした信用不安を受けて上昇(利回りは低下)する局面もありましたが、米国における中立金利の上振れ観測やFRB(米連邦準備理事会)のタカ派姿勢などを背景に下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」(以下「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」ということがあります。)の基準価額の値動きに概ね連動する円建債券の組み入れを高位に保つ運用を行いました。

<円建債券と「Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド」の連動性>

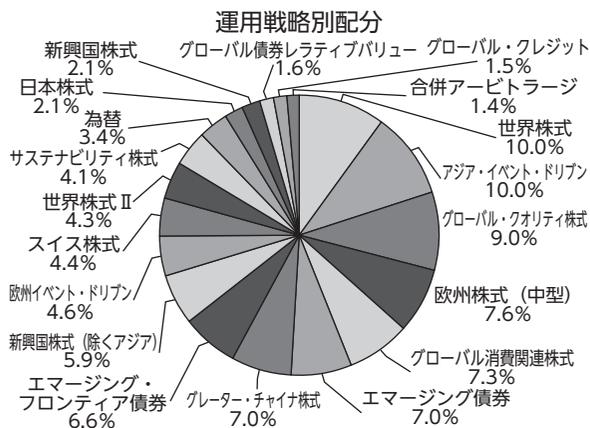
基準価額への反映期間(2022年8月22日~2023年8月22日)のパフォーマンス

Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンド	1.9%
円建債券	1.6%
差異	△0.3%

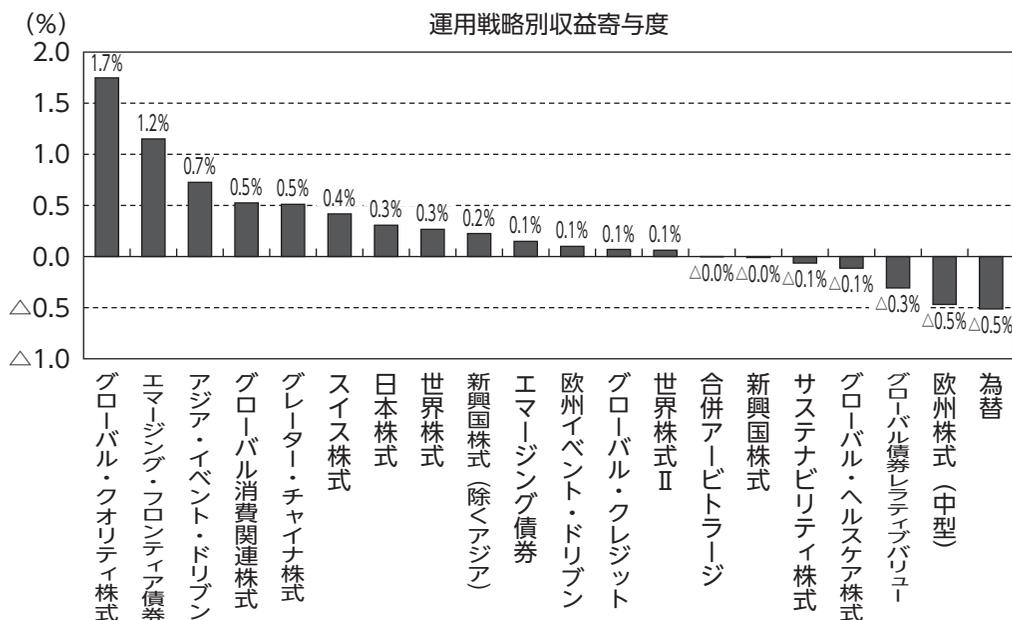
差異の要因は、管理報酬等によるものです。

管理報酬控除後の円建債券のパフォーマンスは概ねPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドのパフォーマンスに連動しています。

当ファンドのポートフォリオ



※配分率は純資産総額に対する割合です。
 ※2023年7月末時点のPictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドの運用戦略別配分です。
 なお、各戦略については、後掲「各戦略の概要」をご参照ください。



※日本株式は、2023年2月6日～2023年8月25日の寄与度です。
 ※合併アービトラージは、2022年9月1日～2023年8月25日の寄与度です。
 ※新興国株式は、2022年12月6日～2023年8月25日の寄与度です。
 ※グローバル・ヘルスケア株式は、2022年8月26日～2023年1月26日の寄与度です。
 ※その他の戦略は、2022年8月26日～2023年8月25日の寄与度です。

当ファンドのポートフォリオ

各戦略の概要

戦略名	概要
エマージング債券	エマージング債券市場における収益源泉(為替、金利等)からリターンを獲得を目指す、トータルリターンアプローチの債券投資戦略。
グレーター・チャイナ株式	グレーター・チャイナ株式(中国、香港、台湾等)市場におけるロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
グローバル・クオリティ株式	グローバル株式を対象に企業の「クオリティ」に注目し、クオンツを駆使してポートフォリオを構築するマーケット・ニュートラル戦略。大型株と流動性の高い銘柄を中心に投資。
グローバル・クレジット	主に流動性が高い投資適格債券を投資対象とするグローバル・クレジット投資戦略。デレション・リスクを極力抑制し、クレジット・スプレッドの相対価値取引によりリターンの創出を目指す。
グローバル債券レティバリュ	アンコンストレインド(投資制約の緩和された戦略)かつ柔軟なアプローチに基づく債券投資戦略。ボラティリティを抑制しながら目標リターンの達成を目指す。(主なリターンの源泉は、為替、クレジット・スプレッド、金利等)
スイス株式	スイス株式市場におけるロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
欧州イベント・ドリブン	欧州大型株を中心としたカタリストに着目したマーケット・ニュートラル戦略。カタリストとして、コーポレートイベント(M&Aなど)、構造的な勝者と敗者(規制の変更による影響など)等に分類。
欧州株式(中型)	欧州の中型株を中心としたロング、ショートのリターンの創出を目指す株式マーケット・ニュートラル戦略。
世界株式	ボトムアップのファンダメンタルズ分析とトップダウンのマクロ分析に基づき、グローバル株式のロング、ショートのリターンの創出を目指す戦略。
グローバル消費関連株式	グローバルな株式を対象に、主に消費、テクノロジー、メディア、通信等のセクターにおける消費関連株式に注目し、ロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
世界株式II	企業のファンダメンタルズ分析に基づき、グローバルな株式を投資対象としたロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
為替	流動性の高い通貨(G10および新興国)を対象に、為替スポット、フォワード、オプション等を主要ツールとして使用し、絶対リターン獲得を目指す為替戦略。
エマージング・フロンティア債券	主にフロンティア市場(南米、東欧、アフリカ、中央アジア、中東、アジア太平洋の国々)を投資対象とする債券戦略。デレション・リスクを抑制し、金利の方向性などからアルファ獲得を目指す。
アジア・イベント・ドリブン	アジア株式でカタリスト(コーポレート・イベント(規制変更や株主還元など)、M&A等)に着目したマーケット・ニュートラル戦略。
サステナビリティ株式	米国株式を対象に、サステナビリティの観点に注目し、ロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
グローバル・ヘルスケア株式	グローバル株式を対象に、ヘルスケアセクターにおける株式について、ロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
新興国株式	新興国株式のロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
新興国株式(除くアジア)	中東欧、南米、EMEA(ヨーロッパ、中東、アフリカ)の新興国株式市場における、ロング、ショートのリターンの創出を目指すマーケット・ニュートラル戦略。
合併アービトラージ	米国・欧州市場におけるM&A案件に対し、各ディールのプレミアム水準および案件完了に関するリスク等の詳細な分析を行い、裁定取引の機会を発掘することでアルファ獲得を目指す合併アービトラージ戦略。
日本株式	日本株式を投資対象としたファンダメンタルズ・アプローチによる株式マーケット・ニュートラル戦略。

<Pictet TR - ディバーシファイド・アルファ・ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

当ファンドの組入資産の内容

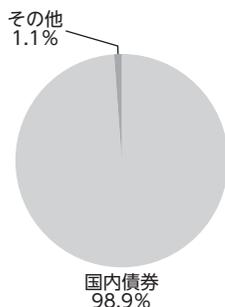
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	SIGNUM GENEVA1 0% 12/15/25	ケイマン諸島	98.9%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

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

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

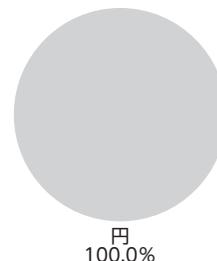
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

主としてゴールドマン・サックス・インターナショナルによって設立された海外籍特別目的会社の発行する円建債券への投資を通じて、ピクテグループの運用会社が運用する外国投資信託証券「Pictet TR - Diversified Alpha」の基準価額の値動きに概ね連動する投資成果を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年8月26日~2023年8月25日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.028 (0.028) (-) (-)	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.028	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,079円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	社債券（投資法人債券を含む）	千円 899,694	千円 14,303,145

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

利害関係人^{*}との取引状況等

■ 利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期 末		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.063423	百万円 0.063423	% 100.0	百万円 0.063423	百万円 0.063423	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	322,748	45,404	14.1	323,477	45,404	14.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期				期 末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	千円 28,786,000 (28,786,000)	千円 29,824,886 (29,824,886)	% 98.9 (98.9)	% — (—)	% — (—)	% 98.9 (98.9)	% — (—)
合 計	28,786,000 (28,786,000)	29,824,886 (29,824,886)	98.9 (98.9)	— (—)	— (—)	98.9 (98.9)	— (—)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2)()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期		期 末		償 還 年 月 日
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券) SIGNUM GENEVA 1 0% 12/15/25	0	28,786,000	29,824,886	2025/12/15	
合 計		28,786,000	29,824,886		

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 29,824,886	% 98.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	347,085	1.2
投 資 信 託 財 産 総 額	30,171,971	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 2023年8月25日現在
(A)資 産	30,171,971,725円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	347,084,985
公 社 債(評価額)	29,824,886,740
(B)負 債	190,777
未 払 解 約 金	190,000
未 払 利 息	777
(C)純 資 産 総 額(A-B)	30,171,780,948
元 本	29,573,574,056
次 期 繰 越 損 益 金	598,206,892
(D)受 益 権 総 口 数	29,573,574,056口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,202円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年8月26日 至 2023年8月25日
(A)配 当 等 収 益	△695,494円
受 取 利 息	5,328
支 払 利 息	△700,822
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	577,058,950
売 買 益	585,097,550
売 買 損	△8,038,600
(C)そ の 他 費 用	△10,365,688
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	565,997,768
(E)前 期 繰 越 損 益 金	185,916,153
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	6,916,656
(G)解 約 差 損 益 金	△160,623,685
(H)計 (D+E+F+G)	598,206,892
次 期 繰 越 損 益 金(H)	598,206,892

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は43,541,331,894円、期中追加設定元本額は599,006,623円、期中一部解約元本額は14,566,764,461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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	16,277,188,084円
FOFs用 ビクテ マルチストラテジー リンクファンド(適格機関投資家専用)	12,293,233,113円
FOFs用 ビクテ マルチストラテジー リンクファンドS(適格機関投資家専用)	562,481,865円
ビクテ マルチストラテジー リンクファンド(SMA専用)	222,657,224円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	218,013,770円

お知らせ

当ファンドが投資対象とする円建債券の値動きが、その基準価額に概ね連動する外国投資信託証券の表記の統一に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日:2023年7月12日)

米国株式LSマザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2023年7月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2017年10月10日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額	
					債 組 入 比 率
第2期(2019年7月10日)	円 10,662	% 12.1	% 97.6	% —	百万円 27,261
第3期(2020年7月10日)	10,113	△5.1	96.8	—	24,162
第4期(2021年7月12日)	9,712	△4.0	97.7	—	18,398
第5期(2022年7月11日)	10,481	7.9	98.4	—	21,178
第6期(2023年7月10日)	10,849	3.5	96.6	—	22,446

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 組 入 比 率	債 券 先 物 率
(当 期 首) 2022年 7月11日	円 10,481	% —	% 98.4	% —
7月末	10,460	△0.2	97.2	—
8月末	10,364	△1.1	99.9	—
9月末	10,696	2.1	102.2	—
10月末	10,972	4.7	100.2	—
11月末	10,606	1.2	91.8	—
12月末	10,545	0.6	91.9	—
2023年 1月末	10,318	△1.6	92.5	—
2月末	10,770	2.8	99.6	—
3月末	11,123	6.1	96.0	—
4月末	10,868	3.7	96.9	—
5月末	11,027	5.2	101.5	—
6月末	10,902	4.0	101.2	—
(当 期 末) 2023年 7月10日	10,849	3.5	96.6	—

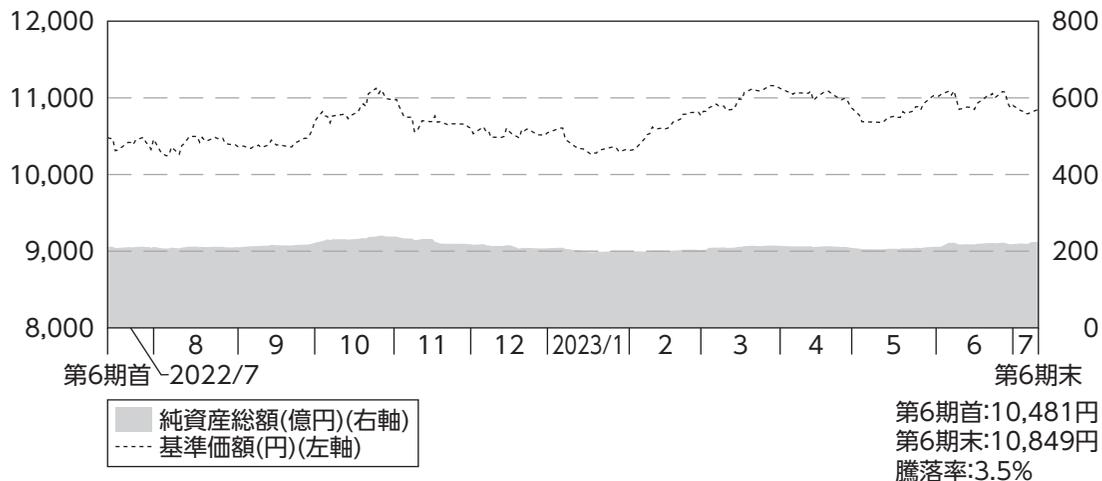
(注1)騰落率は期首比です。

(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。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

主要投資対象である米ドル建債券において、Two Sigmaグループの運用会社が活用する計量モデルに基づき銘柄選択を行いました。当期の基準価額は上昇しました。特に、2022年9月や10月、2023年2月や3月に大きくプラスのリターンを計上しました。

投資環境

当期の米国株式市場は上昇しました。金融引き締めによる景気後退リスクや欧米金融機関に対する信用不安を警戒する局面もありましたが、先進国の物価指標の鈍化を背景に世界的な利上げサイクルが終盤に近いとの見方が強まったことや、米国のハイテク企業の好決算を受けて上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

米ドル建債券の組入比率を高位に保つとともに、対円での為替ヘッジ(米ドル売り／円買い)を行い、米ドル／円の為替変動に伴うリスクの低減を図りました。米ドル建債券においては、Two Sigmaグループの運用会社が計量モデルを活用し、米国の金融商品取引所等に上場している株式等を対象にしたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行い、期初はロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに米ドル建債券の時価総額比で170%前後にて運用を開始しましたが、期中は概ねロング・エクスポージャー、ショート・エクスポージャーともに140%程度から150%程度で推移しました。

当ファンドの組入資産の内容

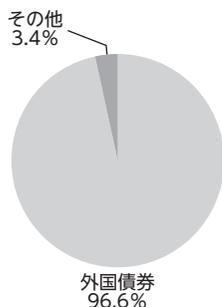
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 004 10/18/27	アイルランド	96.6%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

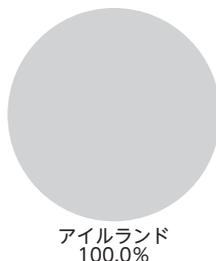
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

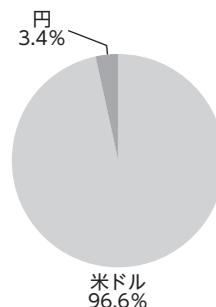
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

UBS AG ロンドン支店が組成を取りまとめた海外籍特別目的会社(SPC)の発行する米ドル建債券への投資を通じて、主として米国の金融商品取引所等に上場している株式等の買建(ロングポジション)と売建(ショートポジション)を組み合わせたマーケット・ニュートラル戦略による運用を行います。

組入外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年7月12日~2023年7月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.025 (0.025) (-) (-)	(c) 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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	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(10,720円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

			当 期	
			買 付 額	売 付 額
外国	ア メ リ カ	社債券(投資法人債券を含む)	千米ドル -	千米ドル 11,958

(注1) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	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 先 物 取 引	百万円 250,030	百万円 250,030	% 100.0	百万円 248,690	百万円 248,690	% 100.0
為 替 直 物 取 引	-	-	-	1,754	1,754	100.0
金 銭 信 託	0.039983	0.039983	100.0	0.039983	0.039983	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	198,518	23,422	11.8	198,848	23,348	11.7

(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 B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
		外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額			5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
ア メ リ カ	千 米 ド ル 123,000	千 米 ド ル 152,087	千 円 21,678,539	% 96.6	% —	% —	% 96.6	% —
合 計	123,000	152,087	21,678,539	96.6	—	—	96.6	—

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

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄	利 率 (%)	額 面 金 額	評 価 額		償 還 年 月 日
			当 期		
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千 円)	
(アメリカ) 普通社債券(含む投資法人債券) STAR HELIOS 004 10/18/27	—	千 米 ド ル 123,000	千 米 ド ル 152,087	千 円 21,678,539	2027/10/18
合 計				21,678,539	

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	比 率
公 社 債	千 円 21,678,539	% 93.0	% 93.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,642,308	7.0	7.0
投 資 信 託 財 産 総 額	23,320,847	100.0	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(21,678,539千円)の投資信託財産総額(23,320,847千円)に対する比率は93.0%です。

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

1米ドル=142.54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 2023年7月10日現在
(A)資 産	44,870,267,916円
コール・ローン等	1,320,676,638
公 社 債(評価額)	21,678,539,278
未 収 入 金	21,871,052,000
(B)負 債	22,423,471,984
未 払 金	22,422,353,600
未 払 解 約 金	1,117,283
未 払 利 息	1,101
(C)純 資 産 総 額(A-B)	22,446,795,932
元 本	20,689,301,202
次 期 繰 越 損 益 金	1,757,494,730
(D)受 益 権 総 口 数	20,689,301,202口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,849円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年7月12日 至 2023年7月10日
(A)配 当 等 収 益	1,165円
受 取 利 息	391,125
支 払 利 息	△389,960
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	676,912,029
売 買 益	5,967,247,330
売 買 損	△5,290,335,301
(C)そ の 他 費 用	△5,336,052
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	671,577,142
(E)前 期 繰 越 損 益 金	971,800,991
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	313,432,780
(G)解 約 差 損 益 金	△199,316,183
(H) 計 (D+E+F+G)	1,757,494,730
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,757,494,730

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は20,206,233,087円、期中追加設定元本額は3,934,553,381円、期中一部解約元本額は3,451,485,266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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	14,952,737,882円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,913,062,233円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,462,094,500円
コア投資戦略ファンド(切替型)	898,365,040円
FOFs用米国株式LSファンドS(適格機関投資家専用)	478,317,521円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	399,064,145円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	267,116,183円
米国株式LSファンド(SMA専用)	230,209,237円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	88,334,461円

お知らせ

該当事項はありません。

コモディティLSアルファ・マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2023年5月26日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2019年7月8日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	債 券 先 物 率	純 資 産 額
設定日(2019年7月 8日)	円 10,000	% —	% —	百万円 2,500
第1期(2020年5月26日)	11,113	11.1	98.0	10,908
第2期(2021年5月26日)	11,168	0.5	98.9	20,334
第3期(2022年5月26日)	11,343	1.6	98.6	23,203
第4期(2023年5月26日)	12,611	11.2	99.5	21,071

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 先 物 率
(当 期 首) 2022年 5月26日	円 11,343	% —	% 98.6
5月末	11,286	△0.5	98.6
6月末	11,320	△0.2	98.5
7月末	11,266	△0.7	99.2
8月末	11,266	△0.7	99.1
9月末	11,509	1.5	99.2
10月末	11,718	3.3	99.6
11月末	11,797	4.0	99.7
12月末	12,167	7.3	99.8
2023年 1月末	12,360	9.0	99.4
2月末	12,525	10.4	99.2
3月末	12,633	11.4	99.1
4月末	12,620	11.3	99.1
(当 期 末) 2023年 5月26日	12,611	11.2	99.5

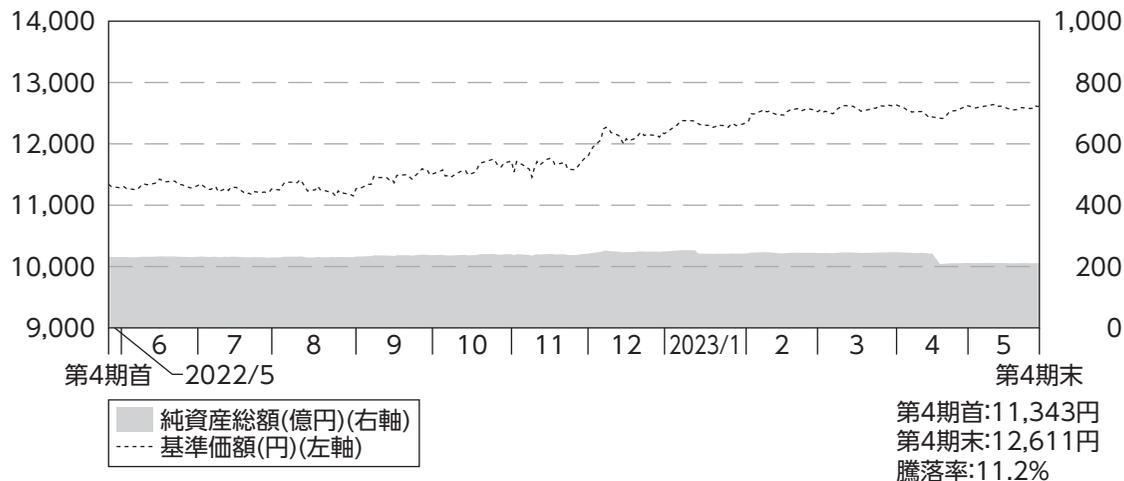
(注1) 騰落率は期首比です。

(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。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当ファンドの基準価額は、ブルームバーグ商品フォワード指数*の騰落率がブルームバーグ商品指数の騰落率を上回ったため、前期末比で上昇しました。

*ブルームバーグ商品指数と構成商品(エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物)および構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数です。

投資環境

商品市場は、主要中央銀行による金融引き締めを受けて先行きの景気後退リスクが意識され、需要鈍化懸念が強まったことなどから全般的に軟調に推移しました。特に天然ガス市場では、2022年から2023年にかけて冬場の気温が平年を上回るなど良好な気象条件の下で暖房需要が低調であったことや、米国内での生産量の増加などを受けて、期近物を中心に大きく下落しました。さらに、事故により稼働を停止した一部LNG(液化天然ガス)輸出プラントの再開が予想以上に遅れたことの影響で足もとの在庫増加が懸念されたこともあり、期近物の価格下落幅が期先物を上回り、当ファンドのリターンにプラスに寄与しました。

当ファンドのポートフォリオ

主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とブルームバーグ商品フォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指して運用を行いました。

※主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値と、ブルームバーグ商品フォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券です。なお、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値です。

当ファンドの組入資産の内容

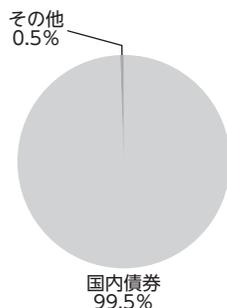
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 07/13/23	アイルランド	97.9%
2	ソシエテ・ジェネラル 0% 2023/06/30	イギリス	1.6%
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

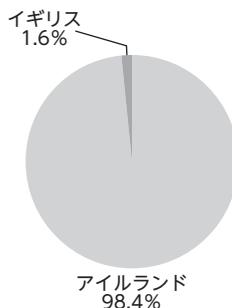
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		2	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

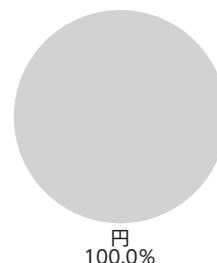
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

主としてブルームバーグ商品指数の騰落率とブルームバーグ商品フォワード指数(以下、「フォワード指数※1」といいます。)の騰落率の差に基づいて償還価格が決定される円建債券※2への投資を通じて、ブルームバーグ商品指数とフォワード指数の間でロング・ショート戦略に基づく運用を行い、絶対収益の獲得を目指します。

※1 この投資信託においてフォワード指数とは、ブルームバーグ商品指数と構成商品(エネルギー、穀物、非鉄、貴金属等に係る各種商品先物)及び構成比率を同一としながら、異なる限月の商品先物で構成された指数をいいます。

※2 運用効率の向上を目的として、主としてブルームバーグ商品指数の騰落率に一定数を乗じた数値とフォワード指数の騰落率に一定数を乗じた数値の差に基づいて償還価格が決定される円建の債券に投資することがあります。なお、この場合、夫々の指数騰落率に乘じる一定数は同値とします。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年5月27日~2023年5月26日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	3 (3) (-) (-)	0.026 (0.026) (-) (-)	(c) 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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	3	0.026	

(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(11,872円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	社債券 (投資法人債券を含む)	千円 300,340	千円 4,756,440

(注1)金額は受渡資金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金 銭 信 託	0.006849	0.006849	100.0	0.006849	0.006849	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	54,783	6,147	11.2	54,997	6,152	11.2

(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。

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	%	%	%	%	%	%	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	16,530,000 (16,530,000)	20,959,464 (20,959,464)	99.5 (99.5)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	99.5 (99.5)	
合 計	16,530,000 (16,530,000)	20,959,464 (20,959,464)	99.5 (99.5)	— (—)	— (—)	— (—)	— (—)	99.5 (99.5)	

(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	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	当 期		末	
			評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日		
普通社債券(含む投資法人債券)						
ソシエテ・ジェネラル	0%	2023/06/30	0	300,000	334,380	2023/6/30
STAR HELIOS	0%	07/13/23	0	16,230,000	20,625,084	2023/7/13
合 計				16,530,000	20,959,464	

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 20,959,464	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	118,534	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	21,077,998	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 2023年5月26日現在
(A)資 産	21,077,998,337円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	118,534,337
公 社 債(評価額)	20,959,464,000
(B)負 債	6,355,471
未 払 解 約 金	6,355,227
未 払 利 息	244
(C)純 資 産 総 額(A-B)	21,071,642,866
元 本	16,709,046,613
次 期 繰 越 損 益 金	4,362,596,253
(D)受 益 権 総 口 数	16,709,046,613口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,611円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年5月27日 至 2023年5月26日
(A)配 当 等 収 益	△81,964円
受 取 利 息	1,045
支 払 利 息	△83,009
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	2,539,301,000
売 買 益	2,539,301,000
(C)そ の 他 費 用	△6,134,773
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	2,533,084,263
(E)前 期 繰 越 損 益 金	2,747,301,273
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	123,770,699
(G)解 約 差 損 益 金	△1,041,559,982
(H)計 (D+E+F+G)	4,362,596,253
次 期 繰 越 損 益 金(H)	4,362,596,253

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は20,455,898,129円、期中追加設定元本額は764,591,424円、期中一部解約元本額は4,511,442,940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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	11,950,183,496円
コア投資戦略ファンド(成長型)	1,545,396,700円
コア投資戦略ファンド(安定型)	1,193,173,131円
コア投資戦略ファンド(切替型)	732,422,024円
FOFs用 コモディティLSアルファ・ファンドS(適格機関投資家専用)	476,205,637円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	316,133,217円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	222,383,629円
コモディティLSアルファ・ファンド(SMA専用)	205,582,368円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	67,566,411円

お知らせ

該当事項はありません。

GBCAマザーファンド(ミドルリスク型)

運用報告書

第3期（決算日 2023年2月20日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2020年3月25日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	日本の円建短期公社債等を主要投資対象とし、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を主要取引対象とします。
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。 デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定しません。 為替予約取引は、ヘッジ目的に限定しません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	期 騰 落 中 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
設定日(2020年3月25日)	円 10,000	% —	% —	% —	百万円 99
第1期(2021年2月22日)	10,193	1.9	53.2	△40.0	263
第2期(2022年2月21日)	10,123	△0.7	50.5	△79.8	277
第3期(2023年2月20日)	11,285	11.5	50.5	△29.7	6,187

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
(当 期 首) 2022年 2月21日	円 10,123	% —	% 50.5	% △79.8
2月末	10,193	0.7	50.2	△86.6
3月末	10,273	1.5	51.1	△60.4
4月末	10,544	4.2	49.8	△63.6
5月末	10,371	2.4	53.0	△29.2
6月末	10,321	2.0	53.8	△37.6
7月末	10,599	4.7	53.2	26.5
8月末	10,533	4.1	53.6	39.8
9月末	10,790	6.6	44.9	△11.8
10月末	11,440	13.0	51.7	5.0
11月末	11,261	11.2	51.6	△15.9
12月末	11,336	12.0	50.2	△29.1
2023年 1月末	11,204	10.7	50.8	△27.7
(当 期 末) 2023年 2月20日	11,285	11.5	50.5	△29.7

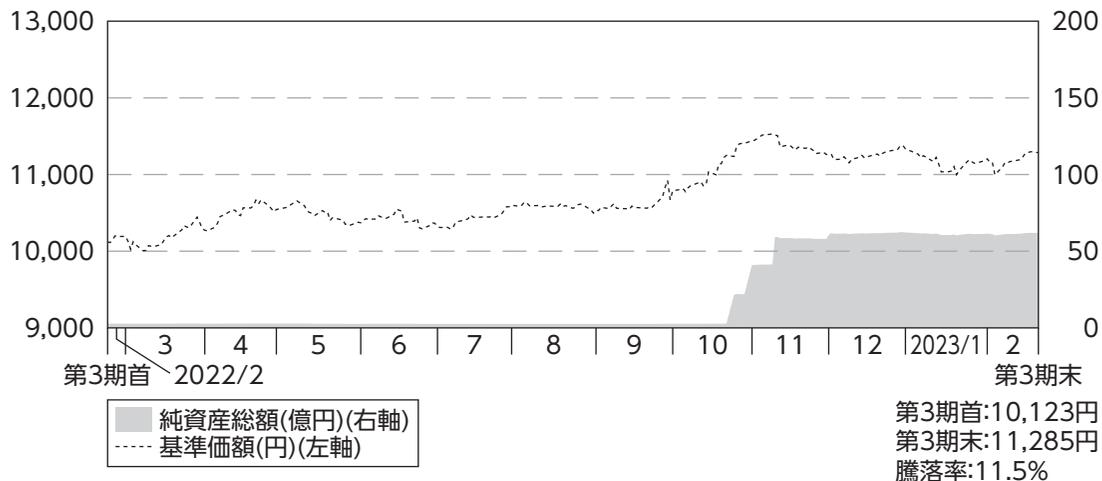
(注1) 騰落率は期首比です。

(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。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

基準価額は上昇しました。2022年2月から4月にかけて米国の長期金利が上昇（債券価格は下落）、米国債のショートがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。その後、9月から10月にかけて英国の長期金利が上昇した後に低下（債券価格は下落した後に上昇）、英国債のショートからロングへのポジション変更がプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。その後、11月から2023年1月にかけて米国の長期金利が低下、米国債のショートがマイナスに影響し、基準価額は下落しました。

投資環境

○国内債券市場

金融緩和政策の修正を受けて売られました。

○米国債券市場

政策金利の引き上げを受けて売られました。

○ドイツ債券市場

政策金利の引き上げを受けて売られました。

○英国債券市場

政策金利の引き上げを受けて売られました。

○豪ドル／円相場

豪ドルは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○カナダドル／円相場

カナダドルは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○スイスフラン／円相場

スイスフランは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○ユーロ／円相場

ユーロは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

投資環境

○イギリスポンド／円相場

イギリスポンドは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○ノルウェークローネ／円相場

ノルウェークローネは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○ニュージーランドドル／円相場

ニュージーランドドルは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○スウェーデンクローナ／円相場

スウェーデンクローナは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

○米ドル／円相場

米ドルは対円で、金利差拡大期待を受けて買われました。

当ファンドのポートフォリオ

主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引と為替予約取引について、定量的手法により運用を行いました。

・国内債券市場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

・米国債券市場

全期間でショートポジションを継続しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・ドイツ債券市場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

・英国債券市場

概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・豪ドル／円相場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。しかし、基準価額への影響はマイナスでした。

・カナダドル／円相場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

・スイスフラン／円相場

全期間でショートポジションを継続しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

・ユーロ／円相場

概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

当ファンドのポートフォリオ

- ・ イギリスポンド／円相場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

- ・ ノルウェークローネ／円相場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

- ・ ニュージーランドドル／円相場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

- ・ スウェーデンクローナ／円相場

概ねニュートラルからショートポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はマイナスでした。

- ・ 米ドル／円相場

概ねニュートラルからロングポジションの間で推移しました。結果、基準価額への影響はプラスでした。

当ファンドの組入資産の内容

○ロング上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	長期国債標準物先物 2303	日本	47.4%
2	第1115回国庫短期証券	日本	34.3%
3	第1108回国庫短期証券	日本	16.2%
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数		3	

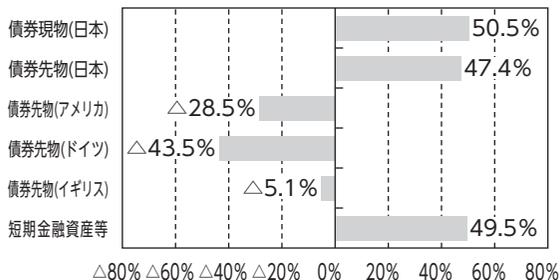
(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○ショート上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	EURO-BUND 2303	ドイツ	△43.5%
2	US 10YR NOTE 2303	アメリカ	△28.5%
3	LONG GILT FU 2303	イギリス	△5.1%
4	――	――	――
5	――	――	――
6	――	――	――
7	――	――	――
8	――	――	――
9	――	――	――
10	――	――	――
組入銘柄数		3	

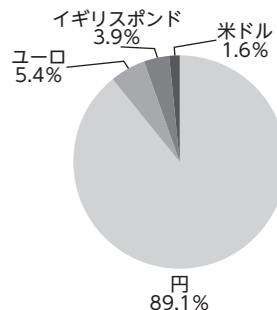
(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○資産・国別配分



(注)資産・国別配分、通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合です。また、オフバランス取引を行っているため、資産・国別配分の合計は100%となりません。

○通貨別配分



当ファンドのベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

主として日本の円建短期公社債等に投資するとともに、先進国の債券先物取引及び世界主要通貨の為替予約取引を行うことで、絶対収益の獲得を目指します。

債券先物取引及び為替予約取引等は、原則として定量的手法に基づいた複数の運用戦略を組み合わせることで行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年2月22日~2023年2月20日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	6円	0.058%	(a) 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)	(6)	(0.058)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 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)	(-)	(-)	
(c) その他費用	0	0.003	(c) 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)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.003)	
合計	6	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。

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(10,738円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 4,123,597	千円 — (1,140,000)

(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。

派生商品の取引状況等

<先物取引の銘柄別取引・残高状況>

銘 柄 別			当 期				当 期 末 評 価 額		
			買 建		売 建		買 建 額	売 建 額	評価損益
			新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額			
国 内	債 券	10年国債標準物 海外市場JGB(SGX)min	百万円 11,098 833	百万円 8,142 909	百万円 — 45	百万円 — 45	百万円 2,933 — —	百万円 — — —	百万円 8 — —
外 国	債 券	US 10YR NOTE LONG GILT FU EURO-BUND	— 2,219 1,170	— 2,273 1,262	12,069 3,202 7,544	10,241 3,116 4,872	— — —	1,761 315 2,691	36 2 29

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人[※]との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
為 替 先 物 取 引	百万円 40,262	百万円 40,262	% 100.0	百万円 39,920	百万円 39,920	% 100.0
為 替 直 物 取 引	586	586	100.0	—	—	—
金 銭 信 託	0.200276	0.200276	100.0	0.200276	0.200276	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	203,918	14,029	6.9	201,664	13,736	6.8

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

＜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BB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	3,120,000 (3,120,000)	3,122,237 (3,122,237)	50.5 (50.5)	— (—)	— (—)	— (—)	50.5 (50.5)
合 計	3,120,000 (3,120,000)	3,122,237 (3,122,237)	50.5 (50.5)	— (—)	— (—)	— (—)	50.5 (50.5)

(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	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	当 期		末
			評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日	
国債証券					
第1108回国庫短期証券	—	1,000,000	1,000,838		2023/9/20
第1115回国庫短期証券	—	2,120,000	2,121,399		2023/10/20
合 計		3,120,000	3,122,237		

＜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)	
内 10年国債標準物	2,933	—	
外 LONG GILT FU	—	—	315
EURO-BUND	—	—	2,691
国 US 10YR NOTE	—	—	1,761

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 3,122,237	% 50.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,101,991	49.8
投 資 信 託 財 産 総 額	6,224,228	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(671,916千円)の投資信託財産総額(6,224,228千円)に対する比率は10.8%です。

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

1米ドル=134.45円

1ユーロ=143.53円

1イギリスポンド=161.61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 2023年2月20日現在
(A)資 産	9,622,783,675円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,353,681,345
公 社 債(評価額)	3,122,237,200
未 収 入 金	3,512,464,317
差 入 委 託 証 拠 金	634,400,813
(B)負 債	3,435,033,207
未 払 金	3,434,531,726
未 払 解 約 金	500,679
未 払 利 息	802
(C)純 資 産 総 額(A-B)	6,187,750,468
元 本	5,483,012,464
次 期 繰 越 損 益 金	704,738,004
(D)受 益 権 総 口 数	5,483,012,464口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,285円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年2月22日 至 2023年2月20日
(A)配 当 等 収 益	2,063,525円
受 取 利 息	4,132
そ の 他 収 益 金	2,529,924
支 払 利 息	△470,531
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△57,855,950
売 買 益	274,871,464
売 買 損	△332,727,414
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	34,113,441
取 引 益	308,818,910
取 引 損	△274,705,469
(D)そ の 他 費 用	△52,999
(E)当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△21,731,983
(F)前 期 繰 越 損 益 金	3,370,549
(G)追 加 信 託 差 損 益 金	727,208,119
(H)解 約 差 損 益 金	△4,108,681
(I) 計 (E+F+G+H)	704,738,004
次 期 繰 越 損 益 金(I)	704,738,004

(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) (C) 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273,749,682円、期中追加設定元本額は5,256,891,881円、期中一部解約元本額は47,629,099円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

分散投資コア戦略ファンドS	4,274,969,424円
分散投資コア戦略ファンドA	981,922,457円
SMTAM・FOFs用先進国債券・通貨ターゲットリターン・ファンド(4%目標コース)(適格機関投資家専用)	226,120,583円

お知らせ

該当事項はありません。

米国株式イントラデイ・トレンド戦略マザーファンド

運用報告書

第3期（決算日 2023年3月10日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2020年10月6日から無期限です。
運用方針	投資信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	債 券 先 物 率	純 資 産 額	債 券 先 物 率	
				騰 落 率	債 券 先 物 率
設定日(2020年10月6日)	円 10,000	% —	百万円 0.4	% —	% —
第1期(2021年3月10日)	9,132	△8.7	17,580	98.7	—
第2期(2022年3月10日)	7,851	△14.0	18,312	98.8	—
第3期(2023年3月10日)	9,002	14.7	8,402	98.7	—

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	債 券 先 物 率	債 券 先 物 率	
			騰 落 率	債 券 先 物 率
(当 期 首) 2022年 3月10日	円 7,851	% —	% 98.8	% —
3月末	7,913	0.8	98.8	—
4月末	8,066	2.7	99.1	—
5月末	8,178	4.2	99.1	—
6月末	8,505	8.3	98.7	—
7月末	8,505	8.3	99.8	—
8月末	8,699	10.8	99.1	—
9月末	8,721	11.1	98.8	—
10月末	8,855	12.8	99.2	—
11月末	9,150	16.5	99.5	—
12月末	8,967	14.2	99.1	—
2023年 1月末	8,927	13.7	99.1	—
2月末	8,978	14.4	99.0	—
(当 期 末) 2023年 3月10日	9,002	14.7	98.7	—

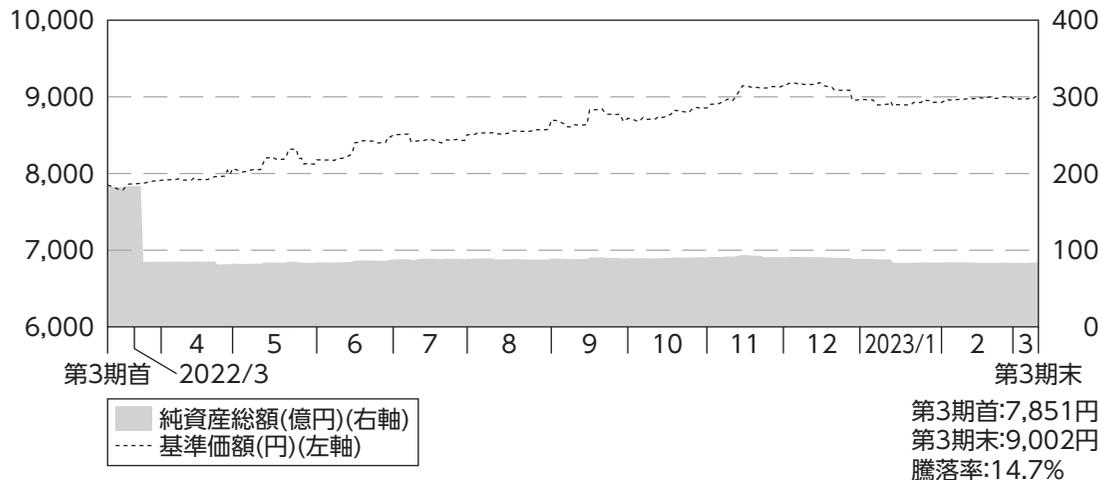
(注1)騰落率は期首比です。

(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。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



基準価額の主な変動要因

当期の米国株式イントラデイ・トレンド戦略*のリターンがプラスとなったことから、当ファンドの基準価額は上昇しました。

*米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする戦略をいいます。具体的には、一定のルールに従って株式市場が一定率以上上昇した場合には買い建てポジションを、一定率以上下落した場合には売り建てポジションを構築し、全てのポジションを当該取引日の終了時までには解消する戦略です。

投資環境

米国株式市場は、欧米の対ロシア経済制裁による世界経済の減速懸念や、世界的なインフレ高進を受けた金融引き締め加速への警戒感から2022年6月にかけて下落しました。その後は一時反発する場面もありましたが、FRB（米連邦準備理事会）の過度な金融引き締めによる景気後退リスクが意識されたことなどから、9月にかけて再び下落しました。しかし、10月以降は、CPI（消費者物価指数）の伸びが鈍化したことなどから、利上げ幅の縮小や先行きの利上げ停止が期待されたことで下げ幅を縮小しました。

当ファンドのポートフォリオ

主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指しました。

当ファンドの組入資産の内容

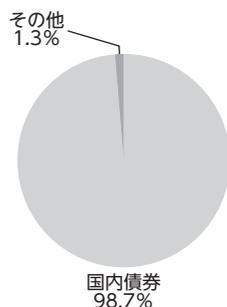
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	STAR HELIOS 0% 10/18/23	アイルランド	98.7%
2	————	—	—
3	————	—	—
4	————	—	—
5	————	—	—
6	————	—	—

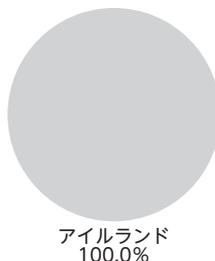
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	————	—	—
8	————	—	—
9	————	—	—
10	————	—	—
組入銘柄数		1	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

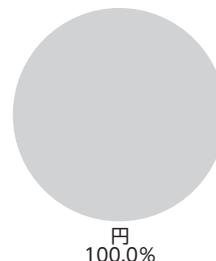
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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

今後の運用方針

主として米国株式イントラデイ・トレンド戦略に基づいて償還価格が決定される円建債券への投資を通じて、米国株式市場の1日の取引時間中の値動きを捉えることを目的とする運用を行い、収益の積み上げを目指します。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年3月11日~2023年3月10日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (投資信託証券) (商品) (先物・オプション)	-円 (-) (-) (-) (-) (-) (-)	-% (-) (-) (-) (-) (-) (-)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) (投資信託証券)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	4 (4) (-) (-)	0.045 (0.045) (-) (-)	(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、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	4	0.045	

(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(8,622円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国内	社債券（投資法人債券を含む）	千円 251,180	千円 11,269,400

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

利害関係人^{*}との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
金 銭 信 託	百万円 0.005405	百万円 0.005405	% 100.0	百万円 0.005405	百万円 0.005405	% 100.0
コー ル ・ ロ ー ン	33,377	3,088	9.3	33,491	3,093	9.2

(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。

組入資産の明細

<国内(邦貨建)公社債>

(A)債券種類別開示

区 分	当 期			期 末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	千円 9,220,000 (9,220,000)	千円 8,290,624 (8,290,624)	% 98.7 (98.7)	% — (—)	% — (—)	% — (—)	% 98.7 (98.7)
合 計	9,220,000 (9,220,000)	8,290,624 (8,290,624)	98.7 (98.7)	— (—)	— (—)	— (—)	98.7 (98.7)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

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

(B)個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期	期 末	
	利 率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)			
STAR HELIOS 0%	10/18/23	9,220,000	8,290,624
合 計		9,220,000	8,290,624

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	8,290,624	98.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	112,476	1.3
投 資 信 託 財 産 総 額	8,403,100	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 2023年3月10日現在
(A)資 産	8,403,100,633円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	112,476,633
公 社 債(評価額)	8,290,624,000
(B)負 債	326,917
未 払 解 約 金	326,783
未 払 利 息	134
(C)純 資 産 総 額(A-B)	8,402,773,716
元 本	9,334,795,160
次 期 繰 越 損 益 金	△932,021,444
(D)受 益 権 総 口 数	9,334,795,160口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,002円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年3月11日 至 2023年3月10日
(A)配 当 等 収 益	△44,268円
受 取 利 息	401
支 払 利 息	△44,669
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	1,221,544,000
売 買 益	1,221,544,000
(C)そ の 他 費 用	△3,899,160
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	1,217,600,572
(E)前 期 繰 越 損 益 金	△5,011,854,839
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	△78,443,304
(G)解 約 差 損 益 金	2,940,676,127
(H)計 (D+E+F+G)	△932,021,444
次 期 繰 越 損 益 金(H)	△932,021,444

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は23,324,628,395円、期中追加設定元本額は546,432,356円、期中一部解約元本額は14,536,265,591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。

ヘッジファンドSMTBセレクション(SMA専用)	6,405,265,191円
コア投資戦略ファンド(成長型)	753,477,327円
コア投資戦略ファンド(安定型)	591,407,510円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(適格機関投資家専用)	514,342,982円
コア投資戦略ファンド(切替型)	356,950,564円
FOFs用 米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンドS(適格機関投資家専用)	205,095,187円
米国株式イントラデイ・トレンド戦略ファンド(SMA専用)	171,184,265円
サテライト投資戦略ファンド(株式型)	154,896,295円
コア投資戦略ファンド(切替型ワイド)	150,514,590円
コア投資戦略ファンド(積極成長型)	31,661,249円

お知らせ

該当事項はありません。